

# **EINLEITUNG ZU FUNDSXML: DATENAUSTAUSCH ZWISCHEN VERWAHRSTELLE UND KVG**

AM 16. MÄRZ 2017  
IN FRANKFURT AM MAIN

# DER DEUTSCHE FONDSMARKT IN DEN BVI-STATISTIKEN: ZWEI SEITEN EINER MEDAILLE



## INVESTMENTSTATISTIK

**BVI Investmentstatistik**  
Übersicht nach Anbietern - Teil 1: Offene Publikumsfonds

Offene Publikums zurückkaufen oder Publikums-Vermögensgegenstände ohne Ausweis (KAGB) aufgelegt

abgesetzt

Sitzland Mio. Euro

**A. Wertpapier-/Beteiligungsfonds**  
(ohne Sachwertfonds)

|  | Summe | Mio. Euro      |
|--|-------|----------------|
| <b>Gruppe bzw. Gesellschaft</b>                            |       | <b>2.138,2</b> |
| Aberdeen Asset Management Gruppe                           |       | 2.138,2        |
| Aberdeen Global Services S.A.                              | LU    | 122.793,8      |
| Allianz Asset Management Gruppe                            |       | 122.793,8      |
| Allianz Global Investors                                   | DE    | 0,0            |
| PIMCO Deutschland GmbH                                     | DE    | 466,3          |
| ALTE LEIPZIGER Trust Investment-Gesellschaft mbH           | DE    | 5.229,6        |
| Ampega Investment GmbH                                     | DE    | 43,1           |
| AVANA Invest GmbH  |       | 7.968,4        |
| AXA-IM Gruppe  |       | 2.063,7        |
| AXA Investment Managers Deutschland GmbH                   | LU    | 2.060,4        |
| AXA Fund Management S.A. Luxemburg                         | IE    | 2.306,8        |
| AXA Rosenberg  | FR    | 603,4          |
| AXA IM Paris   | GB    | 2,0            |
| AXA Investment Managers UK Limited                         |       | 1.816,9        |
| BayernInvest Gruppe  |       | 551,0          |
| BayernInvest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH            | LU    | 465,9          |
| BayernInvest Luxembourg S.A.                               | DE    | 40.281,0       |
| BlackRock Asset Management Deutschland AG (iShares) 1) 2)  |       | 0,0            |
| BNP Paribas Real Estate Gruppe                             |       | 0,0            |
| BNP Paribas Real Estate Investment Management Germany GmbH | DE    | 3.794,6        |
| BNY Mellon Service Kapitalanlage-Gesellschaft mbH          | LU    | 9.865,8        |
| Commerz Funds Solutions S.A.                               |       | 219.286,4      |
| DaAM Gruppe  |       |                |

## VERWAHRSTELLENSTATISTIK

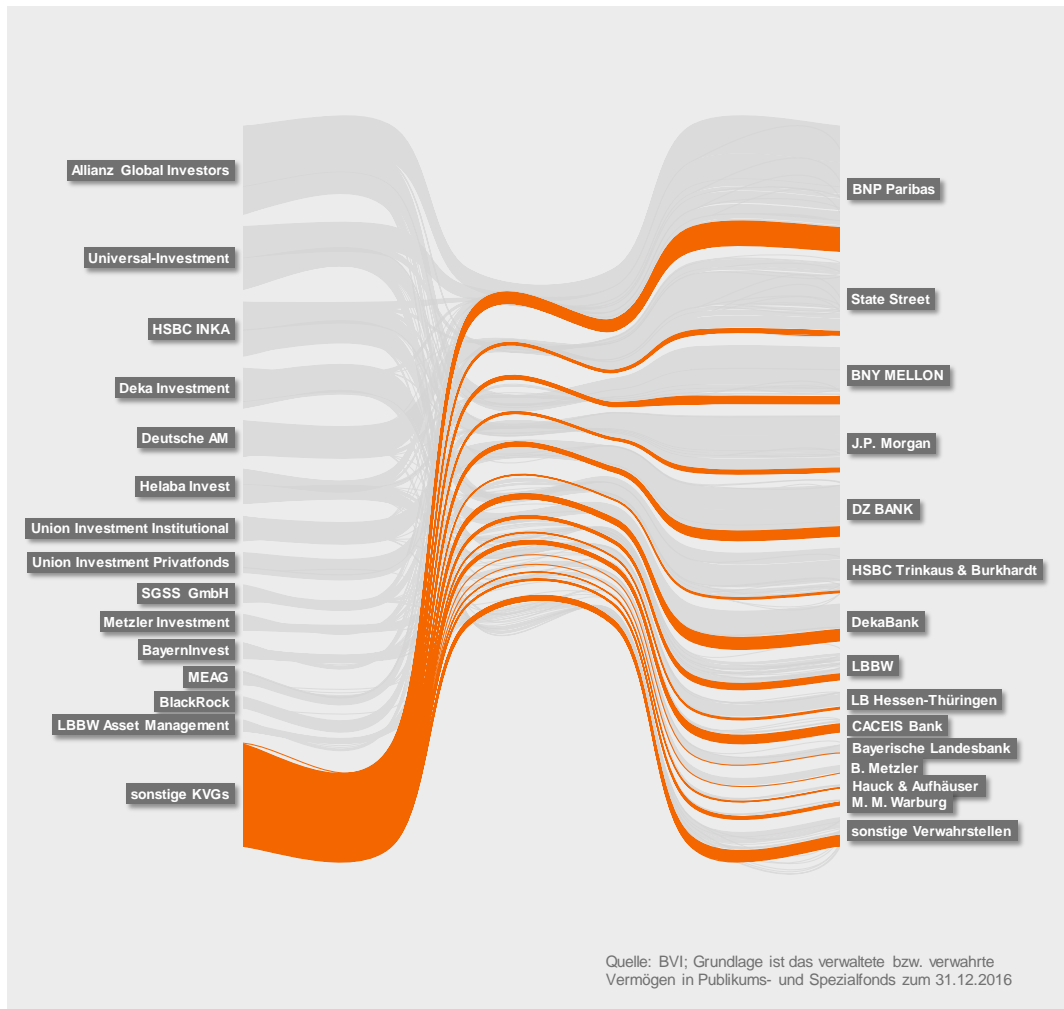
Verwahrstellenstatistik des BVI<sup>1)</sup>

| Verwahrstelle   | offene Wertpapierfonds |              |
|---|------------------------|--------------|
|   | Publikumsfonds         | Spezialfonds |
| <b>verwahrtes Fondsvermögen in Millionen Euro</b>                     |                        |              |
| Aareal Bank AG  |                        |              |
| Augsburger Aktienbank AG  | 111                    |              |
| B. Metzler seel. Sohn & Co. KGaA                                      | 2.441                  | 19.201       |
| Bankhaus Ellwanger & Geiger KG  |                        | 13           |
| Bankhaus Hallbaum AG  |                        | 2.361        |
| Bankhaus Lampe KG   | 1.962                  | 2.161        |
| Bayerische Landesbank   | 117                    | 29.191       |
| BNP Paribas Securities Services, Zweigniederlassung Frankfurt am Main | 34.067                 | 363.671      |
| CACEIS Bank Deutschland GmbH  | 7.790                  | 3.871        |
| Commerzbank AG  | 281                    |              |
| Degussa Bank GmbH   | 562                    | 31           |
| DekaBank Deutsche Girozentrale  | 69.232                 | 90.407       |
| Deutsche Apotheker- und Ärztebank eG                                  | 2.348                  | 7.881        |
| DONNER & REUSCHEL Aktiengesellschaft                                  | 5.223                  | 1.831        |
| DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank                       | 44.104                 | 66.551       |
| Evangelische Bank eG  |                        | 2.121        |
| Frankfurter Volksbank eG  | 124                    | 1.831        |
| Hamburger Sparkasse AG  |                        | 8.271        |
| Hauk & Aufhäuser Privatbankiers KGaA                                  | 7.497                  | 2.741        |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG  | 8.581                  | 147.941      |
| Joh. Berenberg, Gossler & Co.   | 1.588                  | 27           |
| J.P. Morgan AG  | 89                     | 184.001      |
| KAS BANK N.V. - German Branch   | 508                    | 2.621        |
| Kreissparkasse Köln   | 1.472                  | 2.861        |
| Landesbank Baden-Württemberg  | 5.014                  | 72.351       |
| Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale                              | 3.305                  | 46.321       |
| M.M. Warburg & CO KGaA  | 1.658                  | 1.741        |
| Merck Finck & Co. OHG   | 200                    | 221          |
| Nassauische Sparkasse   | 73                     | 61           |
| NATIONAL-BANK AG  | 561                    |              |
| NORD/LB Norddeutsche Landesbank Girozentrale                          | 15                     | 10.001       |
| SaarLB Landesbank Saar  |                        | 3.851        |
| Société Générale S.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main           | 1.602                  | 6.091        |
| Sparkasse KölnBonn  | 269                    | 2.801        |
| Stadtsparkasse Rostock GmbH   | 198.997                | 114.011      |

Vermögen deutscher Fonds: 1,9 Billionen Euro

# GESCHÄFTSBEZIEHUNGEN ZWISCHEN KVGS UND VERWAHRSTELLEN

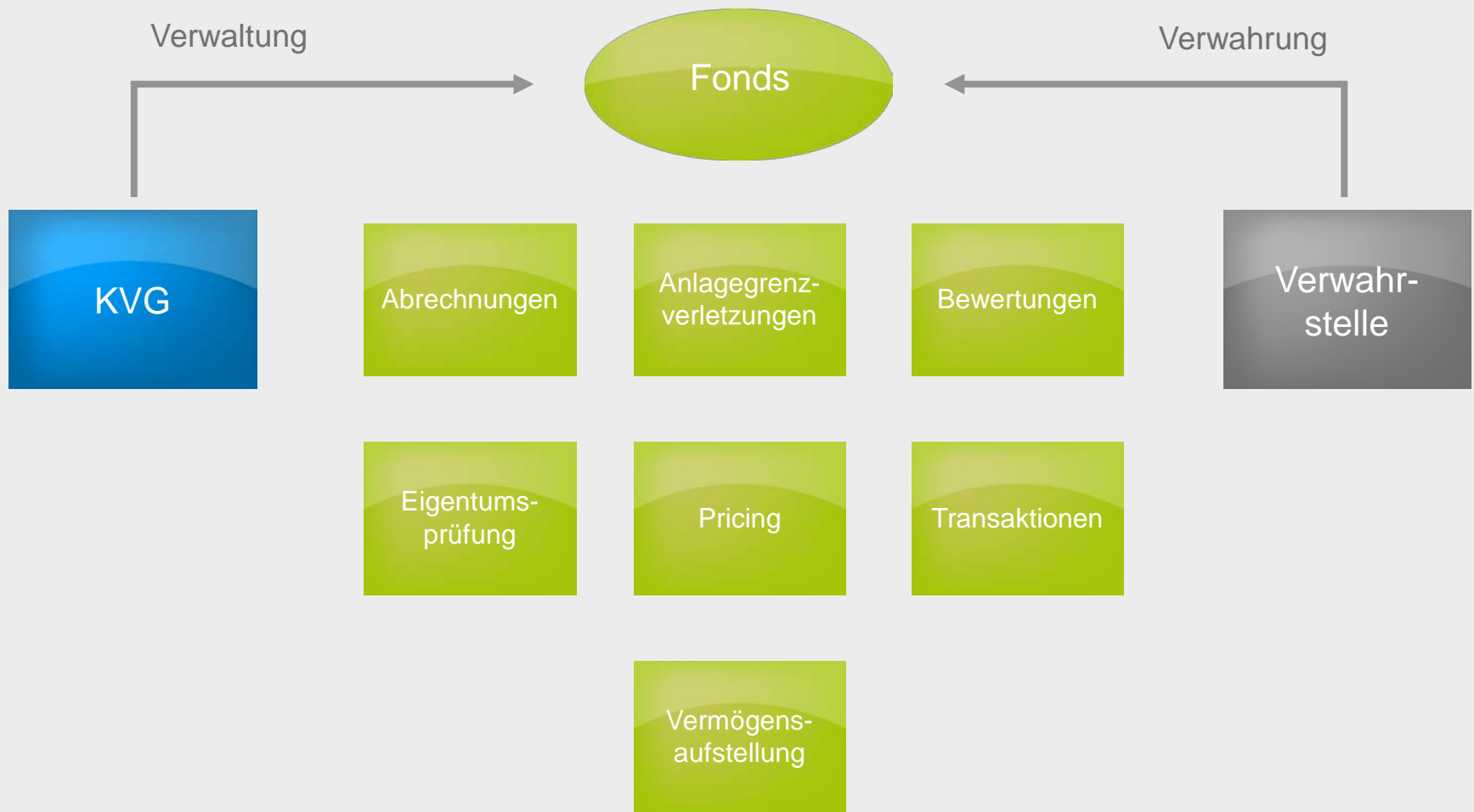
| KVG                            |
|--------------------------------|
| Allianz Global Investors       |
| Universal-Investment           |
| HSBC INKA                      |
| Deka Investment                |
| Deutsche AM                    |
| Helaba Invest                  |
| Union Investment Institutional |
| Union Investment Privatfonds   |
| SGSS GmbH                      |
| Metzler Investment             |
| BayernInvest                   |
| MEAG                           |
| BlackRock                      |
| LBBW Asset Management          |
| sonstige KVGS                  |



| Verwahrstelle             |
|---------------------------|
| BNP Paribas               |
| State Street              |
| BNY MELLON                |
| J.P. Morgan               |
| DZ BANK                   |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt |
| DekaBank                  |
| LBBW                      |
| LB Hessen-Thüringen       |
| CACEIS Bank               |
| Bayerische Landesbank     |
| B. Metzler                |
| Hauck & Aufhäuser         |
| M. M. Warburg             |
| sonstige Verwahrstellen   |

Quelle: BVI; Grundlage ist das verwaltete bzw. verwahrte Vermögen in Publikums- und Spezialfonds zum 31.12.2016

# DATENAUSTAUSCH ZWISCHEN KVG UND VERWAHRSTELLE



### Was bisher geschah

- Die Arbeitsgruppe hat beschlossen, mit der Vermögensaufstellung als erste Schnittstelle zu beginnen. Die Verwahrstellen haben daraufhin die für die Abstimmung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens nötigen Informationen auf Feldebene zusammengetragen.
- Prüfung der Datenfelder gegen den FundsXML-Standard
- Erarbeitung von Lösungen für die Darstellung in FundsXML
- Strukturelle Festlegungen für die Datenlieferung und die Granularität der Lieferungen
- Beschluss zur Verwendung von FundsXML

# FUNDSXML

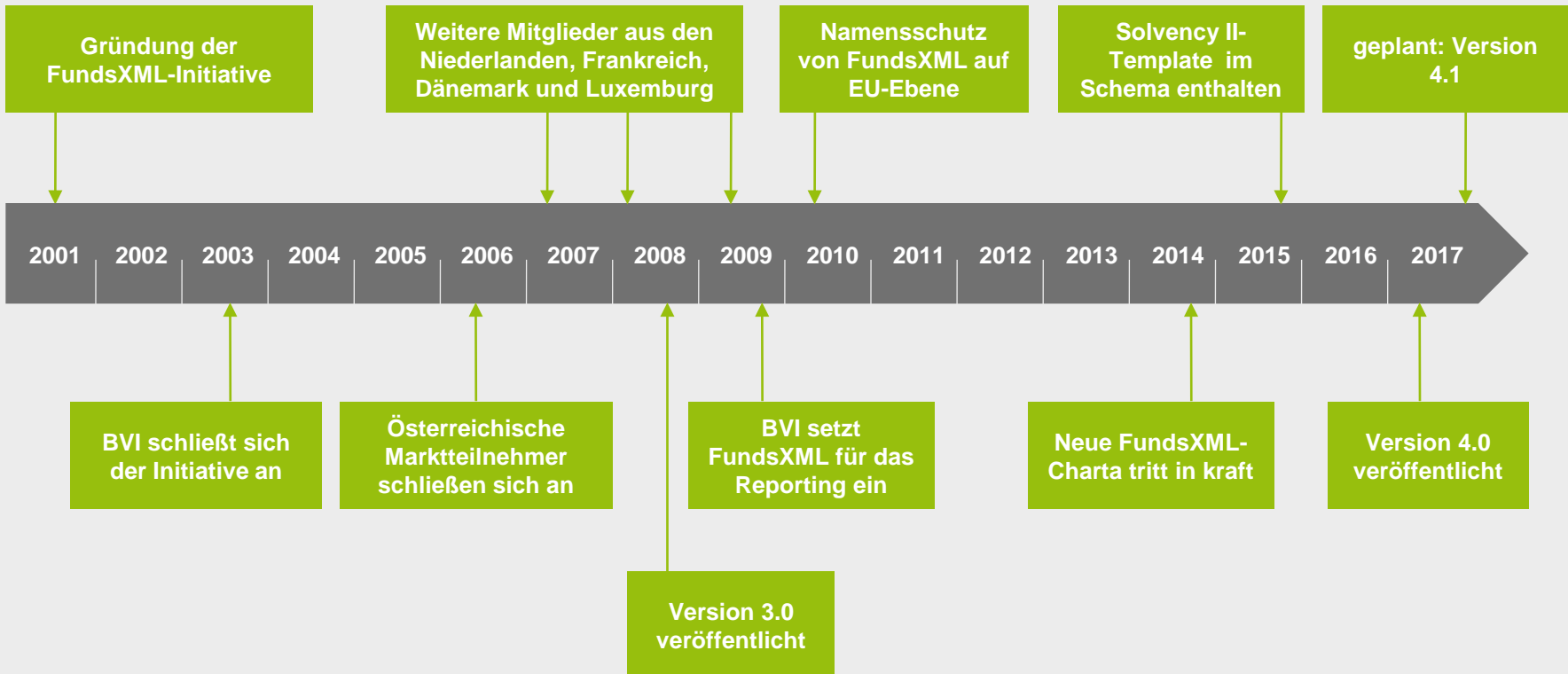
Mitglieder des FundsXML Standards Committee

.BVI



# FUNDSXML

## Entwicklung der FundsXML-Initiative

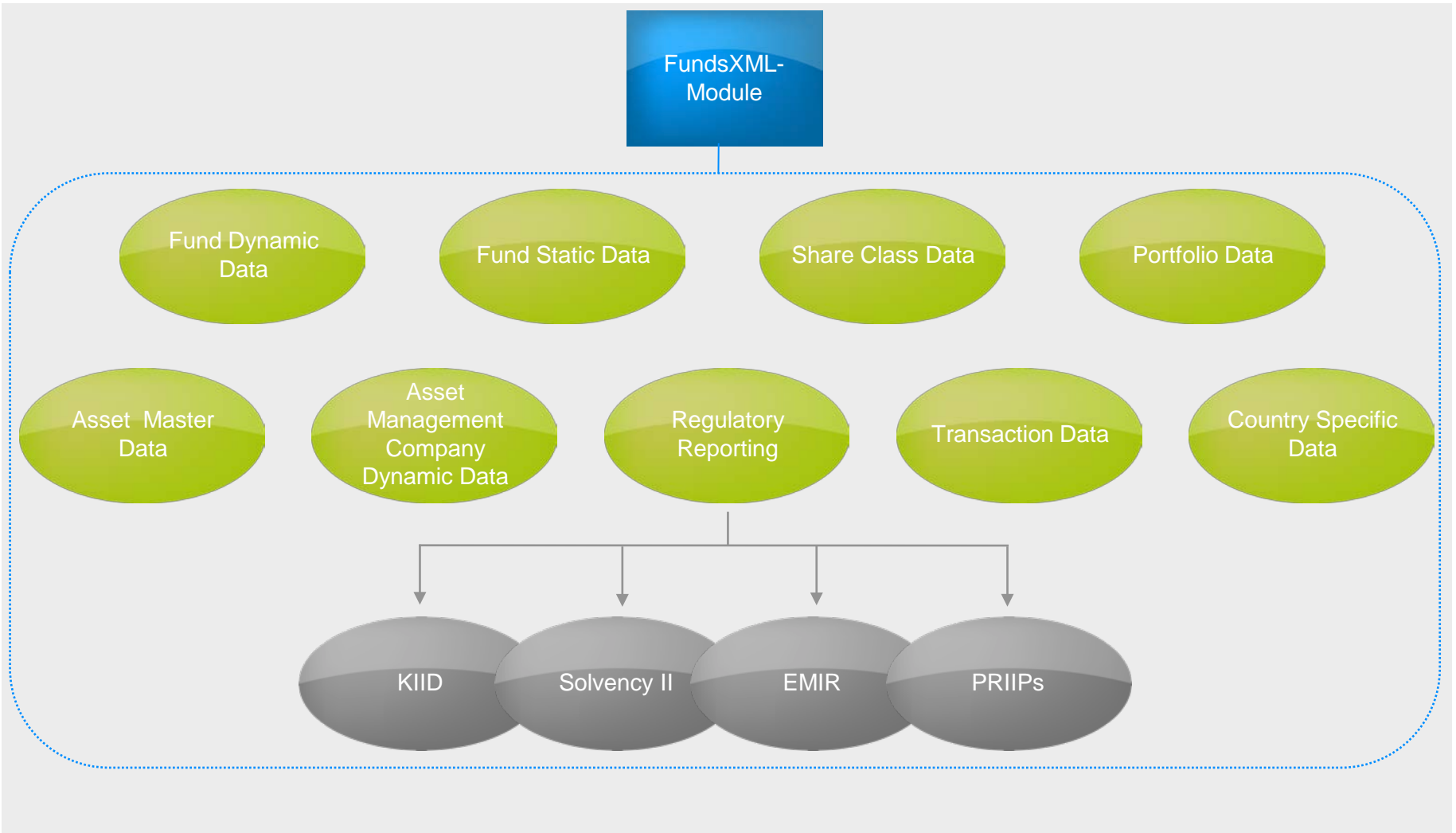


- Bereinigung um überflüssige und redundante Datenfelder
- Klare Strukturierung der Hierarchieebenen
- Felddesreibungen einheitlich in englischer Sprache
- Verbesserte Dokumentation
- Leichter Einstieg für neue Nutzer
- Modularisierung



# FUNDSXML

## Struktur des Schemas



Seit 2009 wird FundsXML für die Lieferungen der statistischen Meldungen an den BVI verwendet. Dies war eine Entscheidung der Geschäftsführer der BVI Mitgliedsgesellschaften.

Diese Lieferungen umfassen die Meldungen zu

- Fondsstammdaten (Neuaufgabe, Änderungen wie Löschungen und Verschmelzungen)
- Bewegdaten wie Mittelaufkommen und Fondsvermögen
- Spezielle Informationen zu Offenen Immobilienfonds
- KVG-Informationen für die Gesamtstatistik
- Informationen zu laufenden Kosten und Performance Fees
- Informationen über Anzahl und Volumen zu VL- und Riester
- Datenlieferung an die DPG für die Wertentwicklung

### Zahl der erhaltenen FundsXML-Dateien im Jahr 2016

|                   |             |
|-------------------|-------------|
| ■ Stammdaten      | 201 (1.886) |
| ■ Absatzdaten     | 2.055       |
| ■ Gesamtstatistik | 1.066       |
| ■ Laufende Kosten | 196         |
| ■ VL/Riester      | 43          |
| ■ Anlage 1 (OIFs) | 2.117       |
| ■ Anlage 3 (OIFs) | 636         |

6.300 FundsXML-  
Dateien...

...von 57  
Lieferstellen...

...für 107  
Gesellschaften:

158.000  
Datensätze

## Die Darstellung im Detail

- Datenlieferung
- Fondsdaten
- Asset Master Data
- Wertpapiervermögen
- Optionen und Futures
- Swaps
- Anlage-/ Auslagerungskonto
- Dividenden und Quellensteuern
- sonstige Forderungen und Verbindlichkeiten

- Das FundsXML-Format trennt zwischen Stamm- und Bewegdaten. Zur eindeutigen Kennzeichnung von Dateien werden Informationen zum Datenlieferanten (z.B. Kontaktdaten) angegeben.
- Der Vorteil dieser Struktur vereinfacht die Darstellung und verkürzt den Datenumfang.
- Die Stammdaten eines Wertpapiers sind pro Datenlieferung einmalig enthalten. Sie können an verschiedenen Stellen genutzt werden

Innerhalb der Vermögensaufstellung werden verschiedene Datenblöcke gefüllt:

- <DataSupplier> - Übermittler der Daten
- <Companies> - Kapitalverwaltungsgesellschaft
- <Funds> - Fondsdaten (Daten des Fonds für den die Vermögensaufstellung erstellt wird)
  - <ProcessData> - NAV Daten
    - <Portfolio> - Vermögensgegenstände, Konten ...
      - Asset - Vermögensgegenstände
      - Accounts - Konteninformationen
- <AssetMasterData> - Stammdaten zu den verschiedenen Assets

Innerhalb einer Datei können mehrere Fonds dargestellt werden. Die Stammdaten können einmal geliefert werden. Als Verbindung zwischen Stamm- und Bewegdaten dienen die Security Codes.

Die einzelnen Datenblöcke können beliebig viele Datensätze enthalten. Beispiel:

- <Funds> - Fonds mit 2 Anteilscheinklassen
- <FundFacts> <ShareClassSecurityType> ... - **Anteilscheinklasse 1**
  - <ProcessData> - NAV Daten Anteilscheinklasse 1
    - <Portfolio> - Vermögensgegenstände, Konten zu Anteilscheinklasse 1
      - Asset - Wertpapier 1
      - Asset - Wertpapier 2
- <FundFacts> <ShareClassSecurityType> ... - **Anteilscheinklasse 2**
  - <ProcessData> - NAV Daten Anteilscheinklasse 2
    - <Portfolio> - Vermögensgegenstände, Konten zu Anteilscheinklasse 2
      - Asset - Wertpapier 1
      - Asset - Wertpapier 2
- <AssetMasterData> - Stammdaten zu den einzelnen Assets

Die Anteilscheinklassen werden mit ISIN in den Fondsstammdaten definiert.

## Datenumfang pro Datei

- Eine Datei für jede juristische Einheit
- Bei Tranchen- bzw. Anteilsscheinklassenfonds wird die Aufteilung des Vermögens über eine Ratio (prozentuale Verteilung) dargestellt. Hier soll für das Konstrukt eine gemeinsame Datei geliefert werden.
- Bei Master/Sub Konstrukten soll eine Datei für den Masterfonds und je eine Datei für jeden Single Fonds geliefert werden.

## Dateinamenskonventionen

- Der Dateiname wird zusammengesetzt aus KVG Kennung (Legal Entity Identifier), Fondsidentifikation (ISIN; bei Tranchen Fonds die erste ISIN nach Alphabet), Rechentag bzw. NAV Datum, Erstelldatum und Uhrzeit (in Sekunden). Die einzelnen Informationen sind durch das Trennzeichen Unterstrich zu trennen.
- Als Referenzzeit für die Erstellung des Dateinamens soll GMT+1 gewählt werden.



# EMPFOHLENER DATENFELDUMFANG FÜR DIE VERMÖGENSAUFSTELLUNG

- Die Arbeitsgruppe hat rund 260 Datenfelder für die Übermittlung der Vermögensaufstellung identifiziert.
- Davon ist knapp ein Fünftel der Felder optional zu liefern.
- Der Großteil der Datenfelder entfällt auf den Bereich Asset Master Data.

|  |     |
|--|-----|
| Asset Master Data                          | 111 |
| Swaps                                      | 54  |
| Dividenden und Quellensteuern              | 25  |
| Fondsdaten                                 | 21  |
| Wertpapiervermögen                         | 12  |
| sonstige Forderungen und Verbindlichkeiten | 12  |
| Optionen und Futures                       | 11  |
| Anlage-/ Auslagerungskonto                 | 10  |
| Datenlieferung                             | 7   |

### Was zu tun bleibt

- Klärung der letzten offenen Fragestellungen
- Anpassung an FundsXML-Version 4
- Prüfung des Standards mit IT-Abteilungen
- Klärung der Darstellungsform und der Beschreibung des Standards
- Kommunikation über Verbände BdB und BVI

## Thomas Koop

Fon +49 69 15 40 90 277

[thomas.koop@bvi.de](mailto:thomas.koop@bvi.de)

[www.bvi.de](http://www.bvi.de)

---

### **BVI Berlin**

Unter den Linden 42  
10117 Berlin

### **BVI Brüssel**

Rue du Trône 14-16  
1000 Bruxelles

### **BVI Frankfurt**

Bockenheimer Anlage 15  
60322 Frankfurt am Main

### **Kontakt**

Fon +49 69 15 40 90 0  
[www.bvi.de](http://www.bvi.de)