

Transaction Reporting Change Controller

Schaffung von Benutzerfreundlichkeit, Sichtbarkeit und Transparenz beim Transaktions-Reporting

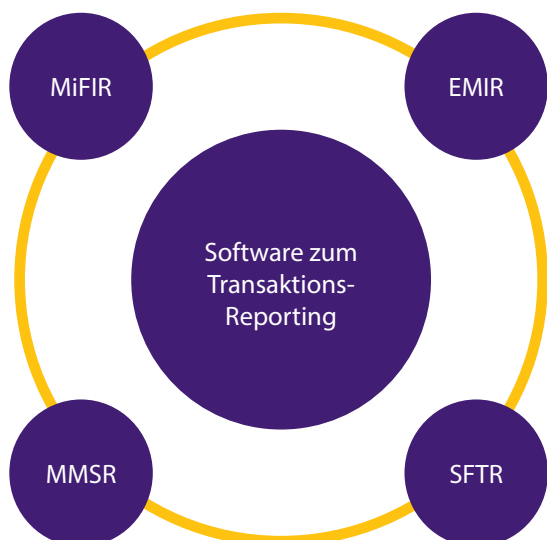
Regulatorisches Reporting von Transaktionen: Änderungsprojekte

Nach der globalen Finanzkrise 2008 haben die Aufsichtsbehörden eine Reihe von Meldeauflagen für Finanzmarkttransaktionen eingeführt, um Transparenz zu schaffen und das Systemrisiko in unserem Finanzsystem zu reduzieren. Die Einrichtung automatisierter Prozesse zur Erfüllung dieser Meldepflichten bedeutet einen hohen Projektaufwand für Finanzinstitute.

Da der Prozess der Vereinheitlichung der Meldungen noch anhält, verursacht die Anpassung bestehender Meldeformate und -inhalte bei den Marktteilnehmern budgetintensive Änderungsprojekte. Hieraus ergibt sich ein Bedarf für intelligente technische Lösungen, um den Aufwand für anstehende Anpassungsprojekte zu reduzieren.

Herausforderungen

Die Herausforderungen von Veränderungsprojekten in einem regulatorischen Umfeld sind vielfältig und von zentraler Bedeutung. Erfolgen die Umsetzungsanforderungen nicht rechtzeitig oder nur in unzureichender Qualität, drohen den Finanzinstituten hohe Geldstrafen und ein erheblicher Imageschaden. Die Definition von Zielen, die Transparenz von Ergebnissen und die Zusammenarbeit zwischen Fach- und Umsetzungsteams sind weitere kritische Erfolgsfaktoren eines Veränderungsprojekts.



targens

Als Expertenhaus für Banking, Compliance und Digital Innovation ist targens der führende Anbieter von Beratungs- und Softwarelösungen. Das Unternehmen mit Sitz in Deutschland, Österreich und der Schweiz kombiniert 30 Jahre Erfahrung in der Entwicklung international bewährter Compliance Services für Finanzinstitute mit zukunftsweisenden und disruptiven Technologien. Durch den Einsatz von Artificial Intelligence und Blockchain-Technologie entstehen so innovative Produkte, die unseren Kunden höchsten Mehrwert bieten. Mit dem Consulting-Portfolio unterstützt targens Kunden bei der Bank- und Unternehmenssteuerung, ihren Handelsaktivitäten und dem Schutz von Geschäftsprozessen.



Unsere Lösungen für unsere Kunden

Unsere **Software zum Transaktions-Reporting** schafft Transparenz über Validierungsregeln sowie RTS/ITS durch intelligente Funktionen.

- » Eine dynamische Benutzeroberfläche zeigt Pflichtfelder auf Basis definierter Eingabewerte an und aktualisiert sich automatisch nach jeder Eingabe. So werden die Abhängigkeiten und Bedingungen zwischen den einzelnen Feldern sichtbar.
- » Die Software zeigt die Auswirkungen von Änderungen gegenüber einer früheren Reporting-Version an, indem neue Felder und Änderungen von Feldern hinsichtlich ihrer Logik und ihres Formats gekennzeichnet werden.
- » Die Software erzeugt eine XML-Reporting-Datei, die den aktuellen Anforderungen und Standards von Behörden und Transaktionsregistern entspricht. Außerdem vergleicht sie die generierte Reporting-Datei mit einer vom Kunden generierten Input-Reporting-Datei und klärt die Ursache für auftretende Unterschiede zur Qualitätssicherung.



Zusammenfassung und Ausblick

Planung und Verfolgung

Spezifikation und agile Entwicklung

Testen des Kontrollrahmens

Dokumentation

Die Meldepflicht für eine Vielzahl von Geschäften und die sich ständig ändernden Anforderungen an Format und Inhalt dieser Meldungen führen zu komplexen Implementierungs- und Änderungsprojekten und wirken sich auf die gesamte Systemlandschaft eines Finanzmarktteilnehmers aus. Eine skalierbare Softwarelösung für eine Vielzahl von Berichtssystemen, die Transparenz über die Auswirkungen von Änderungen und erforderlichen Anpassungen sowie Sichtbarkeit von Feldbeschreibungen und Abhängigkeiten schafft, ist unser Ansatz, um diesen Herausforderungen zu begegnen.

Transaction Reporting Change Controller

» Beschleunigung des Projekts zur Umsetzung des EMIR-Refit

EMIR-Refit

Das EMIR-Refit wird zu grundlegenden Änderungen der EMIR-Meldedateien in Bezug auf Inhalt und Format führen. Die Einführung von Ereignisarten, die Neugestaltung von Sicherheitsmeldungen und die Berücksichtigung von Risikominderungstechniken stellen die wichtigsten inhaltlichen Änderungen dar und führen zu einer Erhöhung der Anzahl der Meldungsfelder von 129 auf 203. Aus technischer Sicht stellt die Umstellung auf ein XML-MeldefORMAT nach ISO 20022 eine Herausforderung für das Änderungsprojekt dar.

Das Veränderungsprojekt

Die Software kann in allen Phasen der EMIR-Refit-Implementierung von der Planung bis zum Go-Live eingesetzt werden.



Eingabe und Validierung von Geschäfts/ Sicherheitsdaten

Art des Berichts auswählen

Pflichtfelder ausfüllen

Zusammenfassung der Auswirkungen der Änderungen

EMIR Transaction

- Reports
- SFTR Re-use
- EMIR Collateral
- SFTR Collateral
- SFTR Transaction
- EMIR Transaction

M	2.151	Action type	NEWT	✓
M	2.151	Level	TCTN	✓
M	1.1	Reporting timestamp	2021-12-03T15:48:26Z	✓
M	1.2	Report submitting entity ID	123456789ABCDEFGHIJK	✓
M	1.3	Entity responsible for reporting	ABCDEFGHIJK123456789	✓
M	1.4	Counterparty 1 (Reporting counterparty)	AAAAA11111BBBBB22222	✓
M	1.5	Nature of the counterparty 1	F	✓
M	1.6	Corporate sector of the counterparty 1	CDTI	✓
M	1.7	Clearing threshold of counterparty 1	FALSE	✓
M	1.8	Counterparty 2 identifier type	TRUE	✓
M	1.11	Nature of the counterparty 2	F	✓
M	1.12	Corporate sector of the counterparty 2	CDTI	✓
M	1.13	Clearing threshold of counterparty 2	TRUE	✓
M	1.9	Counterparty 2	YYYYY88888ZZZZ09999	✓
M	1.10	Country of the counterparty 2	DE	✓
M	1.14	Reporting obligation of the counterparty 2	TRUE	✓
O	1.15	Broker ID		✓

Show change impact

Relevant Fields: 46

New	9	19%
Logic	5	10%
Format	15	32%
Unchanged	17	36%

```

<TradData>
<Rpt>
<New>
<Dvl>TCTN</Dvl>
<CtrptySpofData>
<RptgTmStmp>2021-12-03T15:48:26Z</RptgTmStmp>
<Ctrpty>
<SubmitgAgt>
<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI>
</SubmitgAgt>
<NttyRspnblForRpt>
<LEI>ABCDEFGHIJK123456789</LEI>
</NttyRspnblForRpt>
<RptgCtrpty>
<Id>
<LEI>AAAAA11111BBBBB22222</LEI>

```

Angabe der Auswirkungen der Änderung durch Farbcodierung

- Neue Felder
- Änderungen im Format
- Änderungen bei der Logik
- Unveränderte Felder

Validierung der Eingabedaten gemäß EMSA-Validierungsregeln und -Formatanforderungen

XML-Generierung basierend auf Eingangsdaten, konform mit ISO 20022

Die generierte XML-Datei ist eine Referenz für Testzwecke

Generiertes XML basierend auf Kunden XML – importiert Eingabedaten

Kunden XML – importiert Eingabedaten über Drag and Drop

←
EMIR 3.0

Created XML

```

<TradData>
  <Rpt>
    <New>
      <Lvl>TCTN</Lvl>
      <CtrPtySpofcData>
        <RptgTmStmp>2021-12-03T15:48:26Z</RptgTmStmp>
        <CtrPty>
          <SubmitgAgt>
            <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI>
          </SubmitgAgt>
          <NttyRspnsblForRpt>
            <LEI>ABCDEFGHIJK123456789</LEI>
          </NttyRspnsblForRpt>
          <RptgCtrPty>
            <Id>
              <LEI>AAAAA1111BBBBB2222</LEI>
            </Id>
          </CtrPty>
        </New>
      </Rpt>
    </TradData>
          
```

Dropped XML

```

<TradData>
  <Rpt>
    <New>
      <Lvl>TCTN</Lvl>
      <DerivEvt>
        <DerivEvtTp>TRAD</DerivEvtTp>
        <EvtTmStmp>2021-11-15</EvtTmStmp>
      </DerivEvt>
      <CtrPtySpofcData>
        <RptgTmStmp>2021-11-15T10:36:39Z</RptgTmStmp>
        <CtrPty>
          <NttyRspnsblForRpt>...</NttyRspnsblForRpt>
          <RptgCtrPty>...</RptgCtrPty>
          <OthrCtrPty>...</OthrCtrPty>
          <SubmitgAgt>
            <LEI>ABCDEFGHIJK123456789</LEI>
          </SubmitgAgt>
        </CtrPty>
      </New>
    </Rpt>
  </TradData>
          
```

Identifizierung von Fehlern beim Kunden XML-Datei mit Rückverfolgung entsprechend EMIR-3.0- Feld

Sie haben Fragen oder möchten weitere Informationen? Dann melden Sie sich bei uns!



Ihr direkter Kontakt
Competence Center
Handelsregulierung

handelsregulierung@targens.de