



DEX Regulatory Suite

MiFID ii

Dit whitepaper bespreekt de regelgeving voor MiFID II en de oplossing die DEX Regulatory Suite biedt voor deze regelgeving.

Markets In Financial Instruments Directive (MiFID)

MiFID II is een wettelijk kader dat door de Europese Unie (EU) is ingesteld om financiële markten te reguleren en de bescherming van beleggers te verbeteren. Het doel is om praktijken in de hele EU te standaardiseren en het vertrouwen in de industrie te herstellen, vooral na de financiële crisis van 2008.

MiFID II harmoniseert de toepassing van toezicht tussen de lidstaten en verbreedt het toepassingsgebied van de regeling. Het legt met name meer rapportagevereisten en tests op om de transparantie te vergroten en het gebruik van dark pools (particuliere financiële beurzen waarmee beleggers kunnen handelen zonder hun identiteit te onthullen) en OTC-handel (Over The Counter trading) te verminderen.



Een herziene versie van de originele MiFID werd op 3 januari 2018 uitgerold. Op 23 september 2019 is een nieuwe versie van de richtlijnen de nieuwe standaard geworden.

Transaction reporting

4 januari 2018 was de eerste dag dat financiële instellingen in heel Europa hun transacties aan de toezichthouder moesten melden onder de nieuwe MiFID II-verordening. Dagelijkse transactierapporten moeten worden ingediend bij een lokale bevoegde autoriteit, in Nederland is dit de AFM. De richtlijnen voor MiFID II-transactierapportage zijn vastgesteld door ESMA.

DEX Data Explorers heeft de MiFID II Transactierapportage opgenomen in DEX Regulatory Suite.

DEX
ESMA

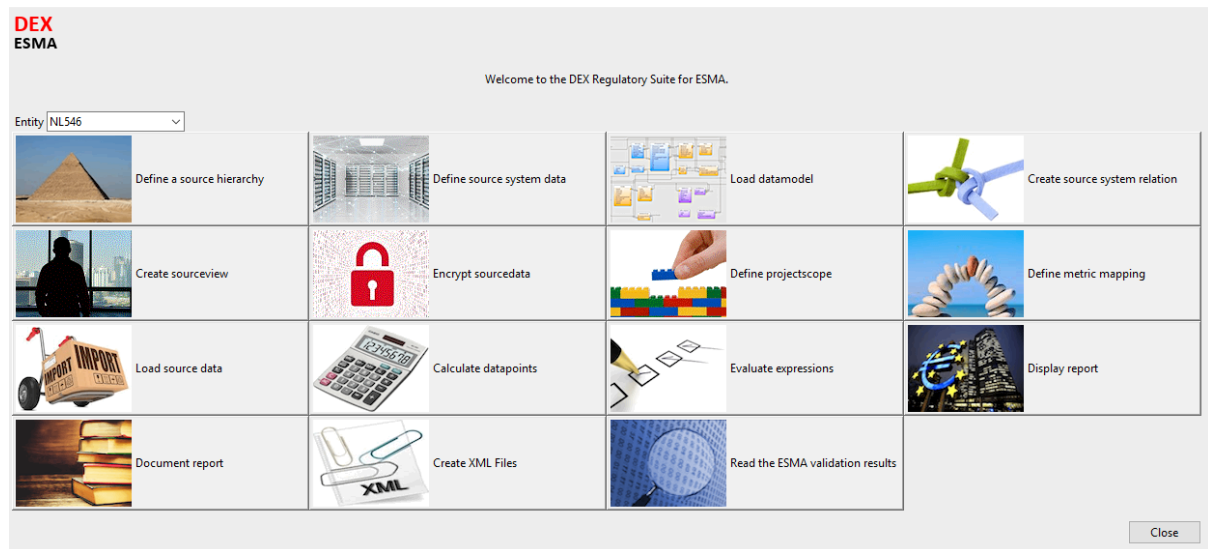
Table 7 - Transaction details Export to Excel

Frequency: daily
Period: 2019-09-21

		Tx		Qty	
TransactionIdentification #		TradeDate	TradingCapacity	Unit	NominalValueCcy
C010		C030	C040	C060	C070
6	0	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro
7	1	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro
8	2	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro
9	3	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro
10	4	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro
11	5	2017-10-19T10:00:00.000000Z	Any other trading capacity		Euro

DEX Regulatory Suite voor ESMA

Om het ESMA-proces te ondersteunen, biedt DEX Data Explorers DEX Regulatory Suite voor ESMA aan. DEX RS genereert wettelijke rapportages op basis van de ESMA-specificaties.



DEX Regulatory Suite voor ESMA genereert de XML-berichten die worden gebruikt in de MiFID II-processen. Deze XML-berichten zijn gebaseerd op dezelfde ISO 20022-berichtstandaarden die ook worden gebruikt voor SFTR-transactierapportage.

DEX Regulatory Suite biedt de volgende functionaliteit voor rapporterende entiteiten:

- Rapporten gegenereerd volgens de nieuwste normen
- Analysetools voor het in mappen van eigen datasets op het ESMA-model
- Validatie van de gegevens volgens de door ESMA gedefinieerde validatieregels; dit geeft u de mogelijkheid om de rapporten te valideren voordat u ze opstuurt
- XML-generatie volgens de normen van ESMA
- Verwerking van de feedback van ESMA
- Automatisch gegenereerde documentatie
- Ondersteuning van workflows

Hieronder wordt een voorbeeld getoond van een MiFID ii-rapport gegenereerd door DEX RS.

DEX ESMA

Table 2 - Buyer Accountowner Export to Excel

Frequency: daily

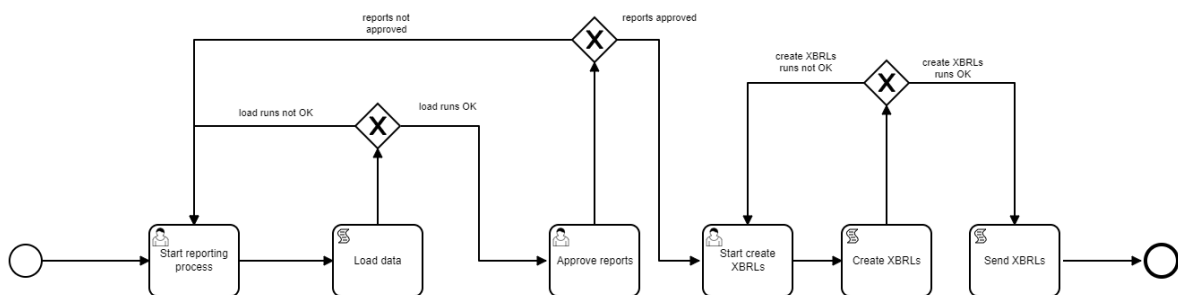
Period: 2019-09-21

Transaction/identification	Transaction/identification	Buyeridentification	AcctOwNr			Prsn	
			LEI	MIC	Prsn	Prsn	Prsn
C010	C020	C030	C050	C060	C080	C090	
972450041U07ULWV9L86	0	6	72450041U07ULWV9L86	72450041U07ULWV9L86			
772450041U07ULWV9L86	1	7	72450041U07ULWV9L86	72450041U07ULWV9L86			
9NLSB2163761	3	8	NLSB2163761		HANS	ACHTER, NAAM...	15
972450041U07ULWV9L86	4	8	72450041U07ULWV9L86	72450041U07ULWV9L86			
9NL19632808HARMIPRINS	6	9	NL19632808HARMIPRINS		HARM	PRINS	15
9NLSB2163761	7	9	NLSB2163761		HANS	ACHTER, NAAM...	15
972450041U07ULWV9L86	8	9	72450041U07ULWV9L86	72450041U07ULWV9L86			
10US19632808HARMIPRINS	10	10	US19632808HARMIPRINS		HARM	PRINS	15

DEX Data Explorers hanteert de normen van de toezichthouder voor de definities van de rapporten. Wanneer updates van de normen worden gepubliceerd, ontvangt u als klant een update over de set rapportagedefinities.

Workflow support

DEX RS biedt workflow-integratie. De DEX RS-functionaliteit is geïntegreerd met workflowsystemen. Gebruikers worden door het regelgevingsproces geleid; handmatige stappen zijn geïntegreerd met geautomatiseerde stappen. Alle acties worden vastgelegd.



Ontwerp uw eigen rapportages

Naast het leveren van de vereiste wettelijke rapportages biedt DEX RS u de mogelijkheid om uw eigen rapporten te ontwerpen. Op deze manier kunt u de gegevens die u gebruikt voor wettelijke rapportages opnieuw gebruiken voor bijvoorbeeld interne rapporten.

DEX
ESMA

Tableversion: 2: buyractownrmd - 2 - Buyer Accountowner
X-axisordinate: 22: LEI0100 - LEI Y-axisordinate: 2: x999 - x999

ExpressionId	ExpressionCode	Type	Severity	Formula	Message
4	LEI0100_4	Pattern	Blocking	[A-Z0-9]{18,18}[0-9]{2,2}	Value is not conform pattern [A-Z0-9]{18,18}[0-9]{2,2}

Scope:
 Row
 Column
 Cell

Select report Close

Beschikbare oplossingen

DEX Regulatory Suite ondersteunt de volgende regelingen:

- CRD iv (COREP, FINREP, Funding Plans, Asset Encumbrance, Supervisory Benchmarking Portfolio)
- AnaCredit
- Residential Real Estate
- Depositogarantiestelsel
- MIFID ii
- SFTR
- Sociaal-economische rapportages
- Digitale Rapportage (DRA)
- Solvency
- IORP ii
- Landenrisico
- Financieel toetsingskader (FTK)
- Premiepensioeninstellingen (PPI's)
- Fiscale rapportage (VIA, Fatca)

Addition Knowledge House en DEX Regulatory Suite

Addition Knowledge House (www.addition.nu) is een reseller van DEX Regulatory Suite. Addition Knowledge House biedt de volgende diensten met betrekking tot DEX Regulatory Suite:

- Ondersteuning bij de implementatie
- Support
- Business Process Outsourcing



Elke situatie is uniek. Addition Knowledge House bespreekt graag hoe we uw proces optimaal kunnen ondersteunen.

DEX Data Explorers

info@dataexplorers.nl

<http://www.dataexplorers.nl>