Raportowanie do Repozytorium Transakcji

Spółka Bazy i Systemy Bankowe wspiera instytucje finansowe dla sprawnego i bezpiecznego działania, dostarczając im wysokiej jakości systemy IT. BSB posiada kompetentnych specjalistów z wieloletnim doświadczeniem, dzięki czemu naszym klientom oferujemy bezpieczne rozwiązania dostosowane do ich potrzeb.

BSB
emirOBLIGO

Profesjonalne wsparcie procesu raportowania informacji o zawartych transakcjach na instrumentach pochodnych oraz ich wycenie do Repozytorium Transakcji prowadzonego przez KDPW_TR.

Funkcjonalność aplikacji:

- Generowanie komunikatów w formacie XML zgodnie z wytycznymi publikowanymi przez KDPW_TR i przekazywanie ich do Repozytorium Transakcji za pomocą jednego z dostępnych interfejsów (U2A, A2A).
- Przygotowanie informacji o nowych transakcjach, zmianach w zarejestrowanych transakcjach, anulowaniu transakcji, wycenie i zabezpieczeniach.
- Import danych transakcji i kontrahentów z systemów wewnętrznych Banku oraz ręczna rejestracja danych transakcji i klientów w aplikacji.
- Zakładanie relacji między podmiotem raportującym, a stroną transakcji.
- Walidację danych wejściowych według algorytmów zdefiniowanych przez KDPW_TR.
- Wczytanie i obsługa komunikatów odpowiedzi z KDPW_TR oraz odpowiednia ich interpretacja (przyjęcie/odrzucenie transakcji, prezentacja przyczyny odrzucenia).
- Zarządzanie transakcjami przechowywanymi w rejestrze transakcji.
- Automatyzacja procesów importu danych, generowania, przekazywania i odbioru komunikatów XML wymienianych z KDPW_TR.
- Wczytywanie komunikatów rekoncyliacji.
- Możliwość raportowania w imieniu Banku oraz w imieniu kontrahenta.
- Możliwość automatycznego generowania UTI na podstawie określonych algorytmów.

Korzyści z wdrożenia aplikacji:

- Spełnienie ustawowego obowiązku raportowego nałożonego przez dyrektywę EMIR*.
- Skrócenie czasu potrzebnego na obsługę transakcji w KDPW_TR dzięki automatyzacji procesów, wykonujących kluczowe funkcje w systemie.
- Zapewnienie zgodności formatu wymiany danych w KDPW_TR dzięki regułom walidacji komunikatu XML na zgodność ze schemą KDPW_TR.
- Przejrzysta analiza i weryfikacja danych przekazywanych transakcji.
- Gromadzenie danych dotyczących transakcji oraz kontrahentów w odrębnych rejestrach.
- Łatwa kontrola procesu raportowego dzięki wysyłanym powiadomieniom mail'owym.
- Minimalizacja kosztów dzięki automatyzacji obsługi procesu.

Dostosowanie do innych Repozytoriów Transakcji:

- BSB oferuje dostosowanie formatu wymiany danych do wymagań pozostałych zarejestrowanych Repozytoriów Transakcji, w tym w szczególności DTCC GTR.
- Oprogramowanie zostało z sukcesem wdrożone w podmiotach sektora bankowego odgrywających znaczącą rolę na krajowym rynku instrumentów pochodnych.

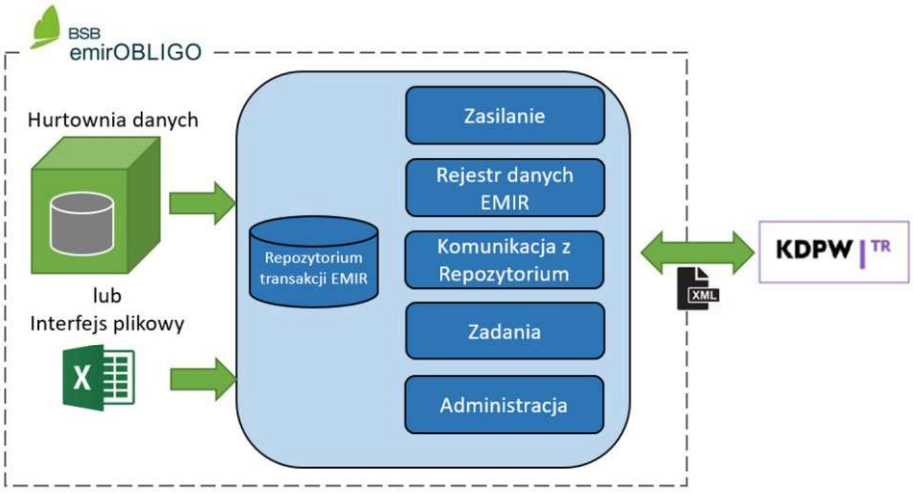
Partnerstwo technologiczne

BSB up to excellence

KDPW

KDPW CCP

Przebieg procesu sprawozdawczego:



Moduły systemu:

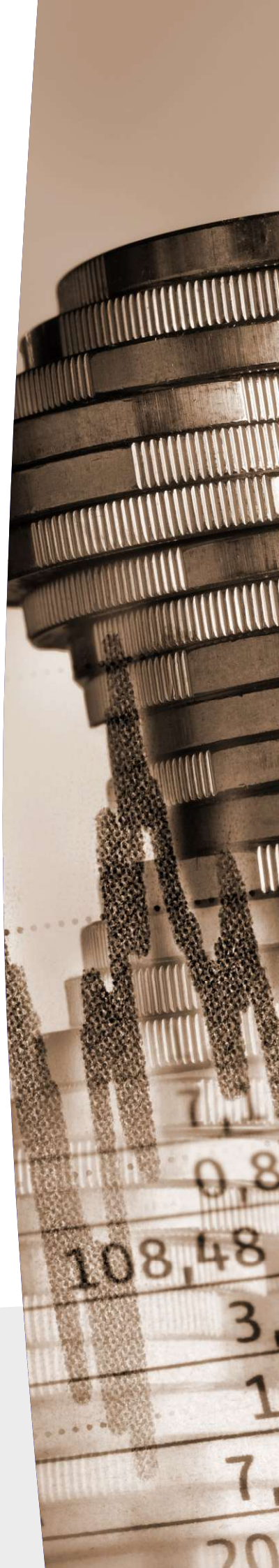
- **Zasilanie –** moduł umożliwia import danych o transakcjach, przeglądanie raportów z procesu zasilania ze wskazaniem zidentyfikowanych nieprawidłowości, ręczne nadawanie UTI transakcji, przeglądanie, oraz aktywację/dezaktywację reguł walidacji danych, a także wczytywanie plików reguł standaryzacji danych i generowania komunikatów XML.
- **Rejestr danych EMIR** – moduł związany z przechowywaniem danych transakcji, mutacji, zarządzanie słownikiem klientów, a także przeglądaniem historii zmian danych. Ponadto moduł umożliwia ręczną edycję danych transakcji, wczytywanie korekt z pliku wsadowego, kopiowanie transakcji, zatwierdzanie transakcji do wysyłki oraz wysyłkę relacji między podmiotem raportującym, a stroną transakcji.
- **Komunikacja z Repozytorium –** moduł pozwalający na konwersję i generowanie plików zgodnych ze schematem wymaganym przez KDPW_TR oraz ich automatyczną wysyłkę, a także automatyczne zaczytywanie odpowiedzi z Repozytorium.
- **Zadania –** moduł umożliwiający zarządzanie zadaniami uruchamianymi automatycznie lub manualnie przez użytkownika.
- **Administracja –** wspiera zarządzanie dziennikiem zdarzeń, danymi instytucji raportującej oraz powiadomieniami mailowymi.

Zapewniamy:

- Wsparcie informatyczne i merytoryczne Klienta w trakcie całego procesu analizy i wdrażania oprogramowania.
- Bieżący nadzór nad zmianami legislacyjnymi oraz dostosowanie oprogramowania do aktualnych wymogów prawnych.
- Możliwość prezentacji Systemu działającego na naszym środowisku testowym.

W przypadku ewentualnych pytań jesteśmy do Państwa dyspozycji.

** Dyrektywa EMIR - Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (EMIR).*



Siedziba
Bydgoszcz

ul. Kasprzaka 3, 85-321 Bydgoszcz
tel. 52 325 13 00

Biuro
Warszawa

ul. Połczyńska 31 A, 01-377 Warszawa

e-mail: office@bsb.pl, www.bsb.pl