

TREM reporting

Zistenia k plneniu povinnosti
oznamovať transakcie



ODK



Workshop 8.4.2022

TREM reporting - úvod

MiFIR čl. 26

Investičné spoločnosti, ktoré vykonávajú transakcie s finančnými nástrojmi, oznamujú úplné a presné podrobné údaje o takýchto transakciách príslušnému orgánu čo najskôr, najneskôr však na záver nasledujúceho pracovného dňa....

RTS 2017/590

Normy, formáty, definície, špecifikácia jednotlivých polí ...

ESMA GL

Usmernenia ako vypíňať výkazy v rôznych prípadoch

ESMA Q&A

Pravidelne aktualizovaný dokument otázok a odpovedí s cieľom zabezpečiť jednotný postup v celej EÚ

Ďalšie

Technické špecifikácie, Príručka používateľa IS ŠZP ...

ESMA TREM Data Quality Review

frekvencia

- polročná

testovaná vzorka

- dáta za jeden vybraný mesiac (rovnaký pre celú EÚ)
- minimálne 500tisíc transakcií (inak dáta za 3 mesiace)

zameranie

- technické testy - 104
- analytické testy - 20

ESMA TREM Data Quality Review

Ciele:

1. identifikovať problémy v kvalite TREM dát s cieľom konštantného zvyšovania ich kvality
2. vyhodnotiť dôvody týchto problémov a toho či vyžadujú riešenie na národnej alebo medzinárodnej úrovni
3. hľadať a implementovať riešenia
4. monitorovať zlepšovanie kvality dát

ESMA TREM Data Quality Review

Proces:

- návrh a schválenie harmonogramu i obsahu testov (vrátane príslušnej metodiky) na úrovni ESMA
- zber dát – na národnej úrovni
- uskutočnenie testov, analýza zistení, follow up – najmä na národnej úrovni
- odoslanie výsledkov do ESMA
- ďalšie kroky smerujúce k zlepšeniu kvality dát
- vyhodnotenie a príprava správy za EÚ

TREM DQR – technické testy

neplatný finančný
nástroj

nástroj nie je platný/nenachádza sa v referenčných dátach (FIRDS)

referenčné číslo
transakcie

výkaz ku transakcii s už zaslaným a nezrušeným referenčným číslom (vo výkaze je potrebné uviesť jedinečné identifikačné číslo vykonávajúcej spoločnosti pre každý výkaz o transakcii)

zrušenie

- transakcia, ktorej zrušenie sa žiada, nemožno nájsť
- transakcia, ktorej zrušenie sa žiada, už bola zrušená
- odmietnutie celého súboru, časti súboru, transakcie

iné

- CONCAT identifikátor je nesprávny
- neplatný/nesprávny ISIN, problém s xml schémou, deal, nekonzistentné kódy

TREM DQR – analytické testy

oneskorené
vykazovanie

transakcia vykázaná neskôr ako na záver nasledujúceho pracovného dňa

cena

- uvádzanie defaultnej ceny 0 (zaokrúhľovanie)
- uvádzanie NOAP (non applicable price)

čas transakcie

- uvádzanie času mimo tzv. opening hours príslušného obchodného miesta

iné

- nesprávne vyplňanie poľa, či vykonávajúci subjekt je investičnou spoločnosťou, na ktorú sa vzťahuje smernica 2014/65
- podkladový index bez ISINu

Ďalšie zistenia/informácie

pobočka

polia 8, 17, 37, 58, 60 – kód krajiny pobočky

ISO normy

nevyhnutné dodržiavať ISO normy (dátum a čas, kód krajiny, kód meny...) i interné normy

referenčné
databázy

dáta sa kontrolujú na jednotlivé referenčné databázy a preto je potrebné ich aj uvádzať v súlade s týmito referenčnými databázami (MIC, ISIN, LEI ...)

povinnosť
(ne)vyplniť pole

viaceré polia medzi sebou vzájomne súvisia a preto (ne)vyplnenie môže ovplyvniť spôsob vyplnenia iných polí

Ďalšie kroky

- testovanie za prvý polrok 2022 sa uskutoční na dátach za mesiac **apríl 2022**
- máj 2022 – príprava dát na testovanie a uskutočnenie testov
- jún 2022 – analýza a vyhodnotenie zistení, follow up a následne odoslanie výsledkov a hodnotenia do ESMA

Ďakujem za pozornosť