

TRS II tekur við af TRS

Kynningarfundur, 30. maí 2017



FJÁRMÁLAEFTIRLITID

THE FINANCIAL SUPERVISORY AUTHORITY, ICELAND

Dagskrá

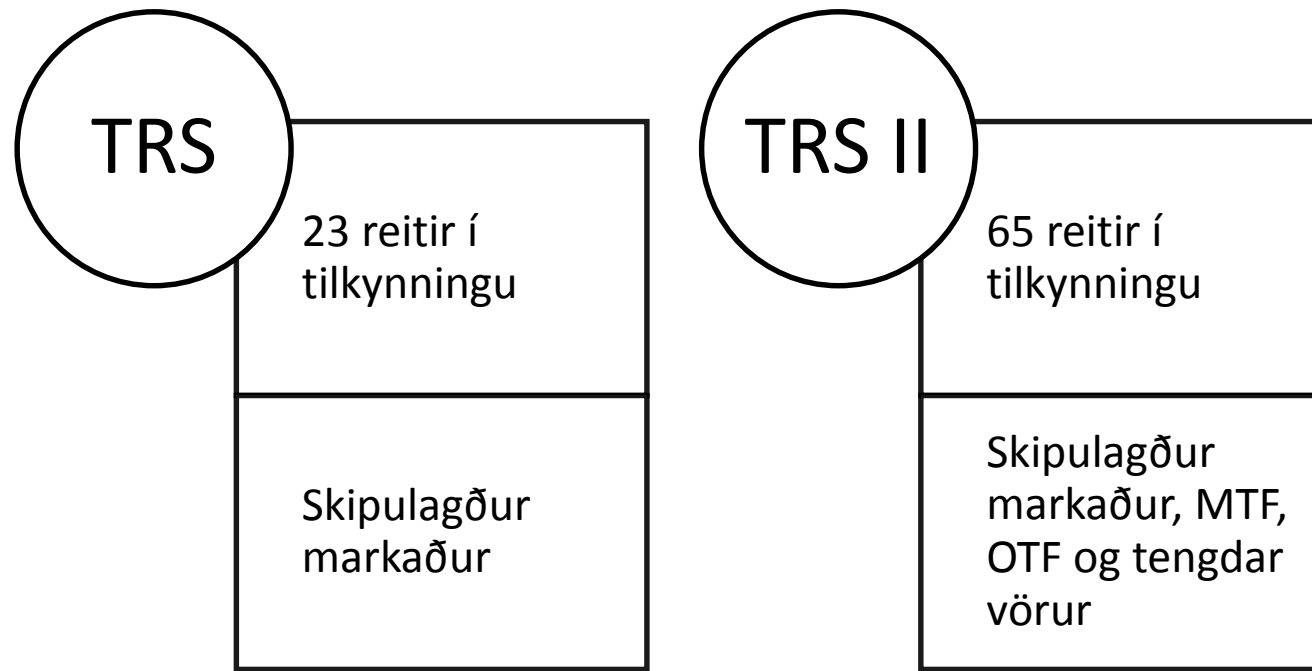
- Almennt um TRS og breytingar í tengslum við innleiðingu MiFID II og MiFIR
 - Yfirlit yfir TRS kerfið
 - Helstu breytingar á kerfinu
 - Mikilvægi þess að innleiða nýtt kerfi um áramótin
- TRS II kerfið
 - Inngangur
 - Flæði gagna
 - Færsluskrá: Uppbygging XML
 - Færslur
 - Villuprófanir
 - Svarskrá
 - Vefþjónusta
 - Viðmiðunargögn
 - Tímalínur
 - Annað
- Spurningar

Hvaðan kemur TRS og TRS II?

- TRS kerfið er tilkomið vegna innleiðingar MiFID
 - Skýrslugjöf um viðskipti með fjármálagerninga
 - Kerfið nýtist við athuganir á innherjasvikum, markaðsmisnotkun og einstaka rannsóknum á verðbréfamarkaði
 - Breyting varð árið 2014 þegar skylda var að auðkenna viðskiptavini með kennitölu
- Innleiðing MiFID II og MiFIR mun kalla á breytingar
 - Gildistaka í Evrópu verður 3. janúar 2018
 - Nauðsynlegt verður fyrir íslenskan markað að innleiða TRS II á sama tíma

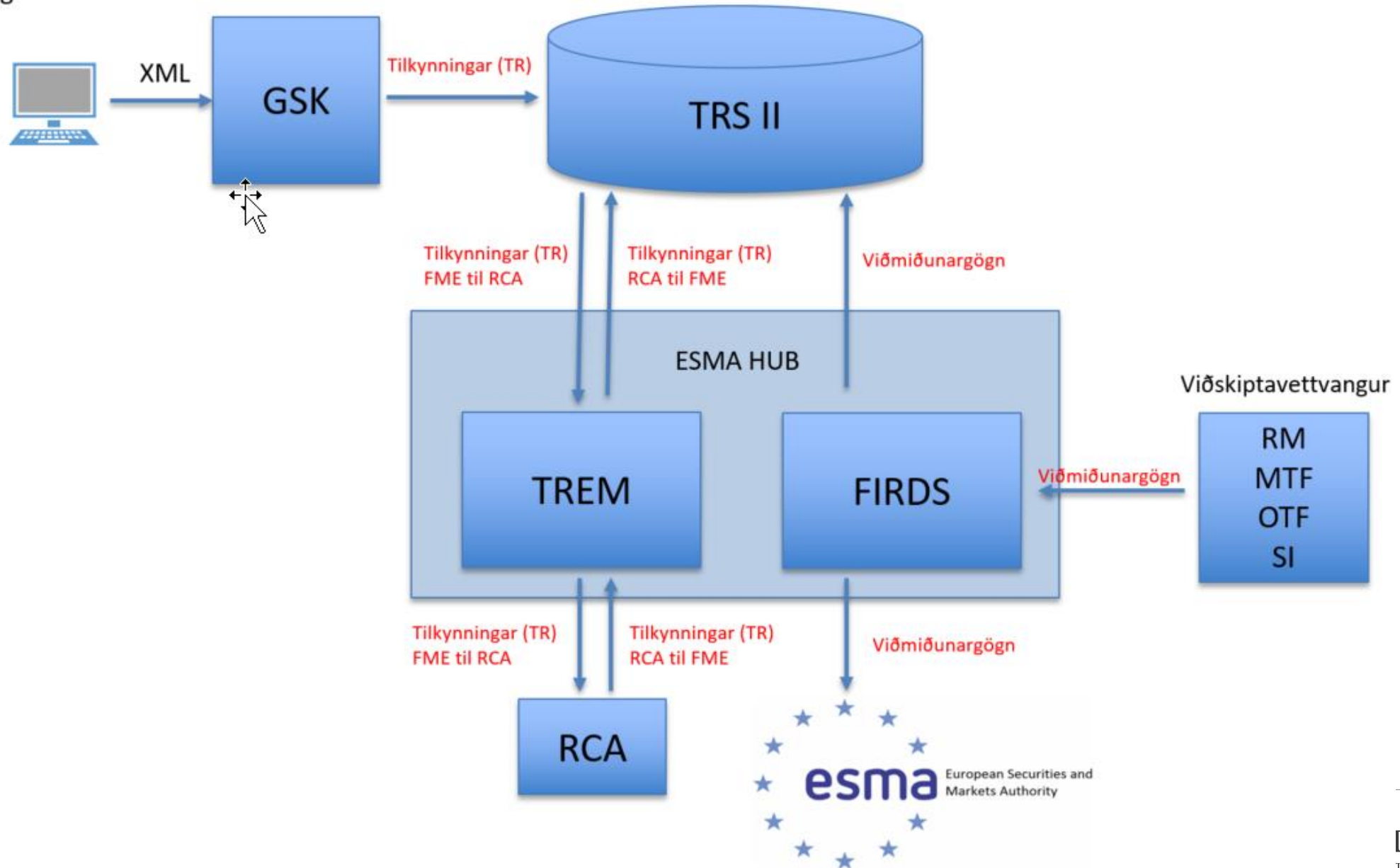
Íslenskir skilaaðilar

- Fyrir íslenska aðila sem skila TRS-skýrslum er það helst umfang sem kemur til með að breytast.



TRS II - Yfirlitsmynd

Gagnaskilaaðili



TRS II á undan MiFID II og MiFIR - Nauðsyn

- Gögnin sem kerfið safnar eru nauðsynleg í eftirlit og rannsóknum hjá flestum eftirlitsstjórnvöldum innan EES.
- Viðmiðunargögn sem kerfið styðst við verða á öðru formi frá gildistöku MiFID II og MiFIR.
- Tilkynningar munu fara í gegnum villuprófanir og því ekki komast til skila til viðeigandi eftirlitsstjórnvalda nema þær séu á formi sem MiFIR skilgreinir.
- Sparar tíma og vinnu, bæði hjá eftirlitsstjórnvöldum og skilaaðilum ef gögnin eru nákvæm og rétt.

Sérstök mál sem vert er að vekja athygli á

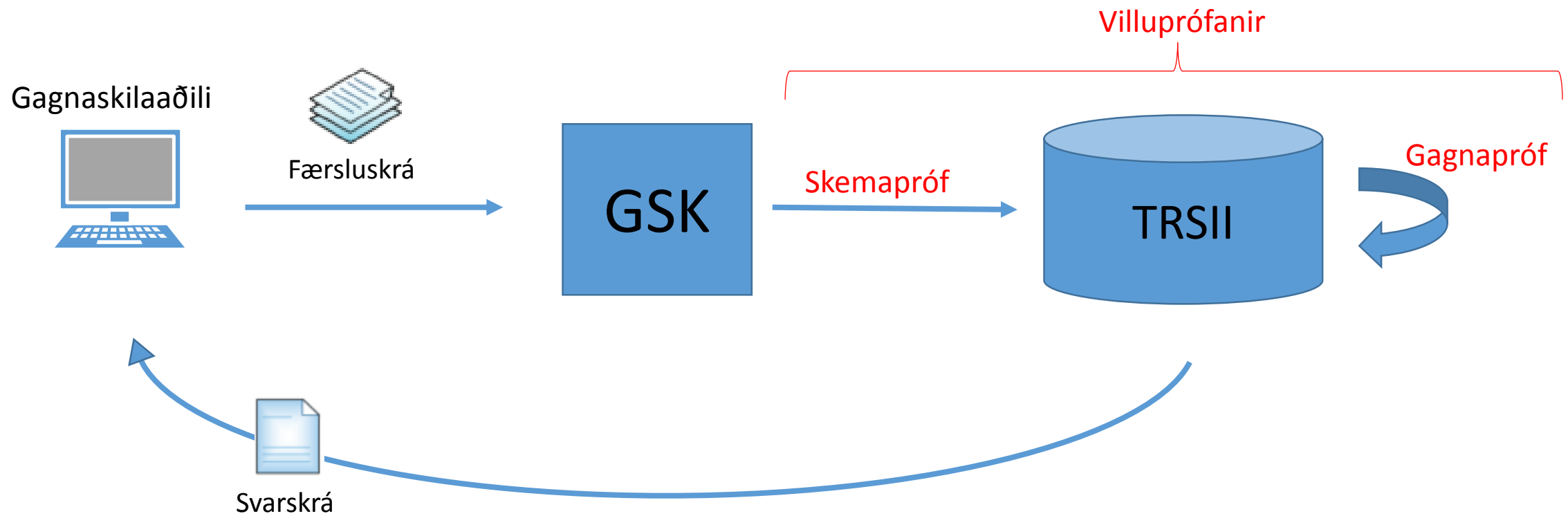
- LEI-kóðar
 - Lögaðilar verða auðkenndir með „*Legal Entity Identifier*“
- Mismunandi auðkenni fyrir einstaklinga
 - Auðkenni einstaklinga mun fara eftir þjóðerni
 - Dæmi: IS+kennitala
 - Sjá nánar töflu í öðrum viðauka [reglugerðarinnar](#)
- CFI flokkun
 - 1. júlí 2017 mun taka í gildi ný flokkun á fjármálagerningum, „*Class of Financial Instrument*“

TRS II: Tæknileg atriði

Inngangur

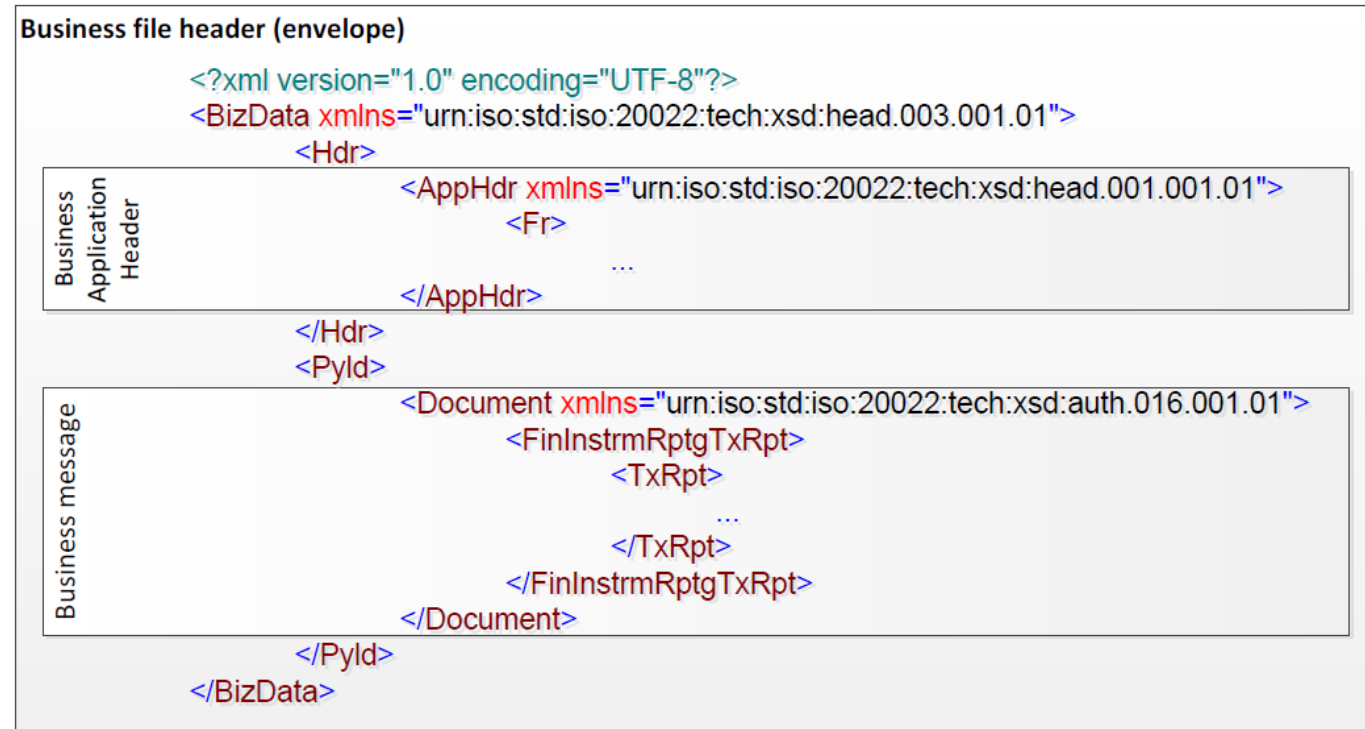
- Þarfa- og greiningarvinna hófst í janúar 2016
- Þróun hófst í október 2016
- Kerfið innbyggt í gagnaskilakerfi (GSK) FME
- Helstu breytingar frá TRS:
 - Flóknara XML
 - Umfangsmikil gagnapróf byggð á viðmiðunargögnum frá FIRDS kerfi ESMA
 - Vefþjónusta og svarskrá

Flæði gagna



Færsluskrá: Uppbygging XML

- Samanstendur af
 - Business file header (envelope)
 - Business Application Header (BAH)
 - Sendandi, móttakandi, tímastimpill
 - Business message (færslurnar)
- ISO 20022
- Skemu
 - <http://test.schemas.fme.is/>
 - <http://schemas.fme.is/>



Færslur

- Viðskipti með fjármálagerninga (færslur) geta verið ný eða afturkölluð
 - Afturköllun á við um færslur sem þegar hafa verið sendar inn
- Ef breyta þarf færslu eða uppfæra
 - Afturkalla færsluna og senda inn uppfærða sem nýja
- Tilvísunarnúmer færslu (reference number)
 - Sama númer á að nota fyrir breytingar og uppfærslu á færslur
 - Ólíkt númerandi kerfi á að nota sama númer aftur

Villuprófanir

- Skemapróf og gagnapróf
- Skemapróf
 - Uppbygging á XML
 - Fall á prófi: skrá hafnað
- Gagnapróf
 - Viðmiðunargögn (ISIN, ISO 3166, 4217, 10383...) og tengsl milli svæða í XML
 - 88 próf í 8 settum
 - Fall á prófi: færslu hafnað

Svarskrá

- Ein svarskrá send á móti einni innsendri færsluskrá
- Upplýsingar um niðurstöður villuprófana
 - Staða á skrá:
 - ACPT: Skrá hefur staðist skemapróf og allar færslur í skrá hafa staðist gagnapróf
 - PART: Skrá hefur staðist skemapróf en a.m.k. ein færsla í skrá hefur fengið eftirfarandi stöðu:
 - PNDG, RCVD, RJCT
 - RJCT: Skrá hefur fallið á skemaprófi
 - Stöður á færslum:
 - ACPT: Færsla hefur staðist allar prófanir
 - PNDG: Vantar upplýsingar úr stoðgögnum um nýja fjármálagerninga
 - RCVD: Færsla berst sama dag og hún var framkvæmd
 - RJCT: Færslu er hafnað, féll á gagnaprófi
- Svarskrá getur innihaldið upplýsingar um færslur frá fleiri en einni skrá



Vefþjónusta

- <https://webservice.fme.is/ReportRepositoryService.asmx>
- Til að stofna aðgang þarf að kalla á CreateSession
 - Breytur: notandi, aðgangsorð
 - Notandi og aðgangsorð skilgreint í GSK
- Til að senda inn þarf að kalla á StoreAsynchronousByAccountingDate
 - Breytur: templateID, viðskiptadag, færsluskrá og sessionToken
 - Viðskiptadagur er dagsetning viðskipta fyrir færslur sem verið er að senda inn
 - SessionToken fæst þegar kallað er á CreateSession
 - Þetta kall svarar með DocumentID
 - Engin nafnagift á færsluskránni
- Til að fá svarskrá þarf að kalla á FetchStoreResult
 - Breytur: SessionToken og DocumentID
 - DocumentID fæst þegar kallað er á StoreAsynchronous
- Leiðbeiningar á fme.is

Viðmiðunargögn - FIRDS

- Viðmiðunargögn sótt í FIRDS kerfi ESMA
- Fjármálagerningar, CFI, LEI, MIC, lönd, gjaldmiðlar
- Samræmi við flokkun á fjármálagerningum
- Notað við gagnapróf
 - Kóðar í gögnum þurfa að vera virkir á viðskiptadegi
 - Fjármálagjörningar þurfa að vera í til í viðmiðunargögnum fyrir þann viðskiptadag sem gefinn er upp



Tímalína

- Forprófanir 30. júní
 - Notendaaðgangur að GSK
 - LEI kóði
- Formleg opnun á prófunarumhverfi 1. september
- Ekki senda raungögn í prófunarumhverfi
- Próffasi á móti ESMA með stoðgögnum
- 3. janúar 2018: TRS II kerfið opnar fyrir móttöku raungagna

Annað

- Heimsíða ESMA
 - <https://www.esma.europa.eu/policy-rules/mifid-ii-and-mifir/mifir-reporting-instructions>
 - 2016-ITMG-66 - Annex 1 Validation rules_v1.1.xlsx
- Heimasíða FME
 - <https://www.fme.is/thjonustugatt/rafraen-skil/trs-ii/>
 - Q&A on MiFIR data reporting (ESMA70-1861941480-56)



- Upplýsingasíða fyrir LEI: <https://www.gleif.org/en/>
- Netfang fyrir fyrirspurnir: mifid2@fme.is
- Ef þörf er á verður önnur kynning