


# Abacus Transactions

Modulare Standardsoftwarelösung für das  
transaktionsbasierte Meldewesen



# Die Kompaktlösung für das transaktionsbasierte Meldewesen

Die wachsende Komplexität finanzwirtschaftlicher Produkte und Märkte führte in den vergangenen Jahrzehnten bei stetig steigendem globalem Handelsvolumen zu einer mangelnden Risikotransparenz. Mit Ausbruch der Finanzkrise kamen diese Defizite schmerzlich ans Licht: Das Ausmaß der Risiken und Abhängigkeiten konnte weder von den Aufsichtsbehörden noch von Marktteilnehmern selbst ausreichend schnell und umfassend beziffert werden. Für die Aufarbeitung der Krise gilt deshalb: Kein Finanzmarkt, kein Finanzmarktakteur und kein Produkt soll künftig ohne angemessene Aufsicht bleiben. Um diese Regulierungsvorgaben wirksam umsetzen zu können, müssen den zuständigen Aufsichtsbehörden relevante Informationen über Umsätze und Positionen an den Finanzmärkten zeitnah vorliegen.



Abacus Transactions bietet größtmögliche Synergien durch die Nutzung einer Softwarelösung für verschiedene transaktionsbasierte Meldungen

Mit einer Reihe legislativer Beschlüsse sind die erkannten Schwachstellen, sowohl im Bereich des börslichen als auch des außerbörslichen Handels (Over-The-Counter, OTC), entsprechend angegangen worden. Zu diesen Regulierungen zählen unter anderem::

- European Market Infrastructure Regulation (EMIR)
- EZB-Geldmarktstatistiken (MMSR)
- Markets in Financial Instruments Directive II / Regulation (MiFID II, MiFIR)
- Securities Financing Transactions Regulation (SFTR)
- Schweizer Finanzmarktinfrastrukturgesetz (FMIA / FinfraG)

Sie beinhalten neben besonderer risikomindernder Maßnahmen wie beispielsweise Clearing-, Besicherungs- oder Handelsplatzpflicht auch eine Reihe transaktionsbasierter Meldevorschriften. Durch sie sollen Risiken und Ungleichgewichte an den Finanzmärkten frühzeitig erkannt und transparent gemacht werden.

Die so entstandene Fülle an transaktionsbasierten Meldepflichten für unterschiedliche Produkte und Märkte mit eigens definierten Meldeinhalten und -frequenzen stellen Banken vor die Herausforderung eines flexiblen und möglichst redundanzfreien Datenhaushalts.

Mit Abacus Transactions hat Regnology seine marktführende Abacus Solution Suite um eine Standardsoftware für das transaktionsbasierte Meldewesen erweitert.

Abacus Transactions trägt dem gestiegenen Bedarf an immer granulareren täglichen Meldepflichten Rechnung: Abacus Transactions unterstützt die Meldung von Derivaten an Transaktionsregister (Modul TR2) nach EMIR(II), FMIA / FinfraG und CSA. Das Modul MMSR deckt die Meldung nach EZB-Geldmarktstatistiken ab, das MIFIR Modul unterstützt die Transaktionsmeldung nach Art. 26 MiFIR sowie die Positionsmeldung für Warenderivate nach Art 58 MiFID II Die zu verarbeitenden Daten werden in der Regel aus den Front- und Back-Office-Systemen der Banken über definierte Standardschnittstellen an Abacus Transactions angeliefert Das Produkt wurde im Mai 2018 um das Modul SFTR erweitert.

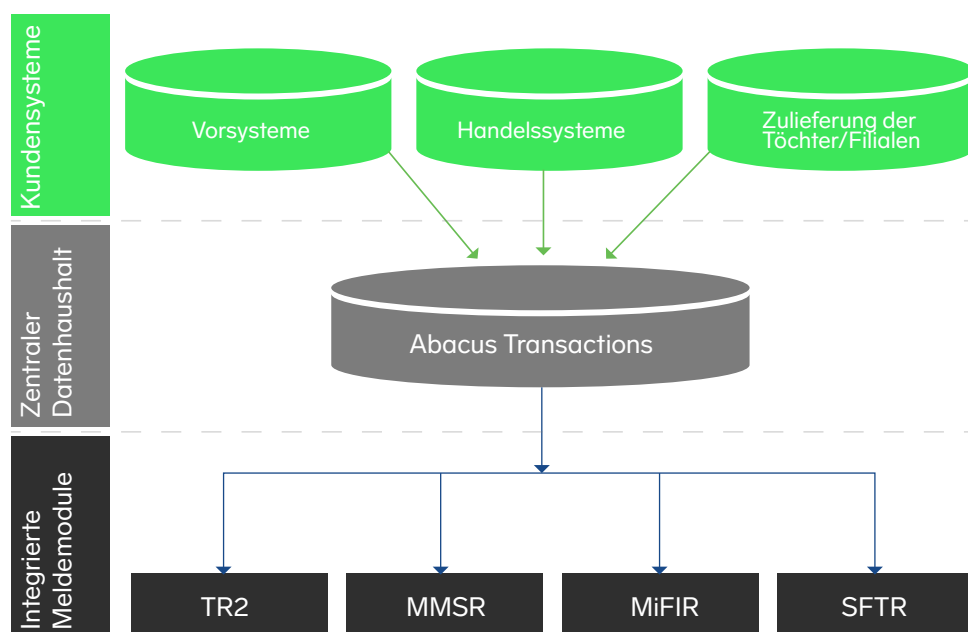


Abbildung 1: Grösstmögliche Synergien durch Nutzung einer Softwarelösung

In Abacus Transactions werden angelieferte Transaktionen und Positionen in den einzelnen Modulen unabhängig voneinander verarbeitet. Hierbei wird pro Datensatz die entsprechende Modulrelevanz ermittelt. Durch die vorhandene Layer-Struktur hat der Kunde die Möglichkeit, die Module sowohl einzeln als auch in Kombination zu nutzen. Abacus Transactions ist eine eigenständige Lösung, basierend auf dem bewährten Abacus-Framework, das bei vielen Kunden seit Jahren für ein breites Spektrum an aufsichtsrechtlichen Meldungen erfolgreich im Einsatz ist.

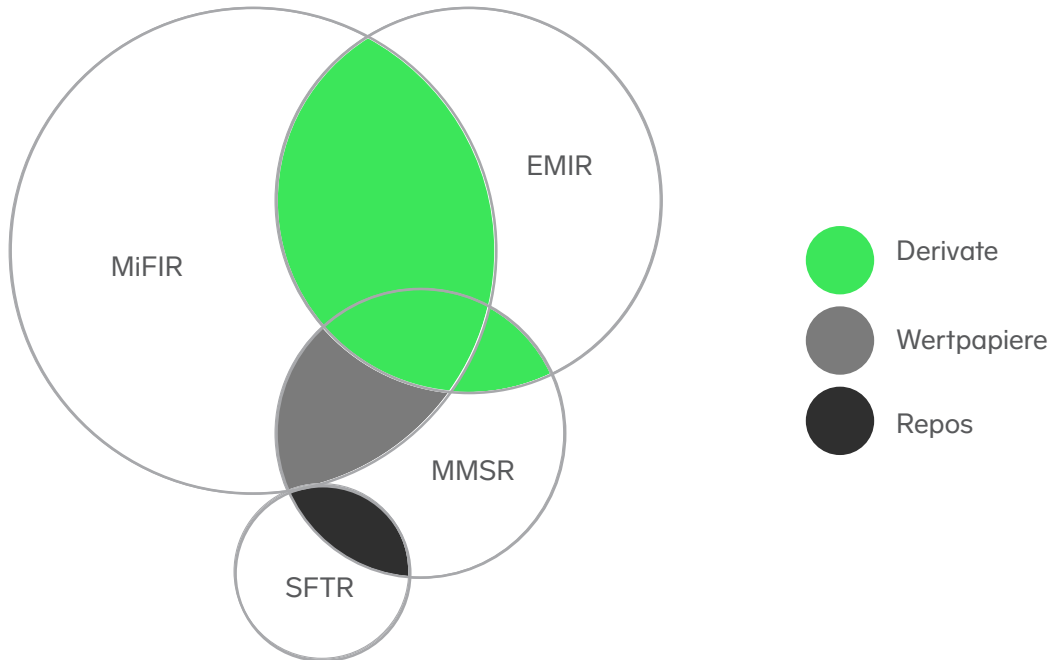


Abbildung 2: Produktüberschneidungen in den Regulierungen

Die einzelnen Regulierungen haben ihren gemeinsamen Ursprung im G20-Gipfel von 2009, beleuchten die Marktaktivitäten aber aus unterschiedlichen Perspektiven. Überschneidungen in den modulrelevanten Produkten stehen somit deutlichen Unterschieden in den meldepflichtigen „Life Cycle Events“ gegenüber.


Affected institutions	EMIR	MMSR	EMIR II	MiFIR	SFTR
New	✓	✓	✓	✓	✓
Modify	✓	✓	✓	(Cancel + New)	✓
Correction	x	✓	✓	x	✓
Termination / Cancel	✓	✓	✓	x	✓
Compression	✓	x	✓	x	(✓)
Error / Cancel	✓	x	✓	✓	✓
Other	✓	x	x	x	x
Position component	x	x	✓	x	x
Valuation update	✓	x	✓	x	✓
Collateral update	✓	x	✓	x	✓

✓ report relevant      (✓) partially/potentially report relevant      x partially/potentially report relevant

Abbildung 3: Life Cycle Events

# Nutzen für den Kunden durch den Einsatz von Abacus Transactions

- Eine gemeinsame Schnittstelle für mehrere Module – Module flexibel zuschaltbar
- Umfassendes Benutzer- / Rollenkonzept zum Management der Nutzerrechte
- Unterschiedliche Möglichkeiten der Datenanlieferung durch Clustertrennung, Additives Laden und Nebenbestand
- Flexible Anbindung multipler Vorsysteme
- Konsistenzprüfung auf die Eingangsdaten mit parametrisierbaren Fehlerlevels
- Manuelle Korrekturmöglichkeiten, beispielsweise bei Konsistenzfehlern oder „Rejects“
- Darstellung der Ergebnisdaten pro Modul
- Bestandsabgleich mit Zusatzfunktionalitäten (Differenzenreport, Vorschlagstransaktionen) sowie Melderelevanzprüfung mit Relevanzreport
- Fachliche Validierung anhand der formulierten Regeln der Meldungsempfänger
- Erstellung der Meldedateien inklusive technische XSD-Schema-Validierung (xml-Dateien)
- Einlesen und Zuordnen der Rückmeldungen des Meldungsempfängers
- Flexibles Prozessmanagement über Cockpit, Prozessleiste oder automatisiert via Batch Skript
- Einfaches Erstellen verschiedener Ansichten / Layouts
- „Einträge kopieren“ - Funktion mit diversen Optionen zur Unterstützung eines revisions sichereren Korrekturprozesses
- Historische Ansicht (Meldeverlauf über einen definierbaren Zeitraum)
- Analytisches Reporting (beispielsweise Kundenreporting)
- Tabellen Import- und Exportfunktionalität (xml, csv / xlsx)
- Revisions sicherheit (umfangreiche Protokollierung bei manuellen Änderungen)
- Archivierungsfunktion
- Benutzerleitfaden, Schulungen, Hotline / Servicedesk, Online-Wiki



Look & Feel  
Hoher  
Wiedererkennungswert  
durch einheitliche  
Prozessabläufe in den  
einzelnen Modulen

Die Verarbeitungsschritte in den Abacus Transactions-Modulen sind standardisiert und haben einen hohen Wiedererkennungswert:

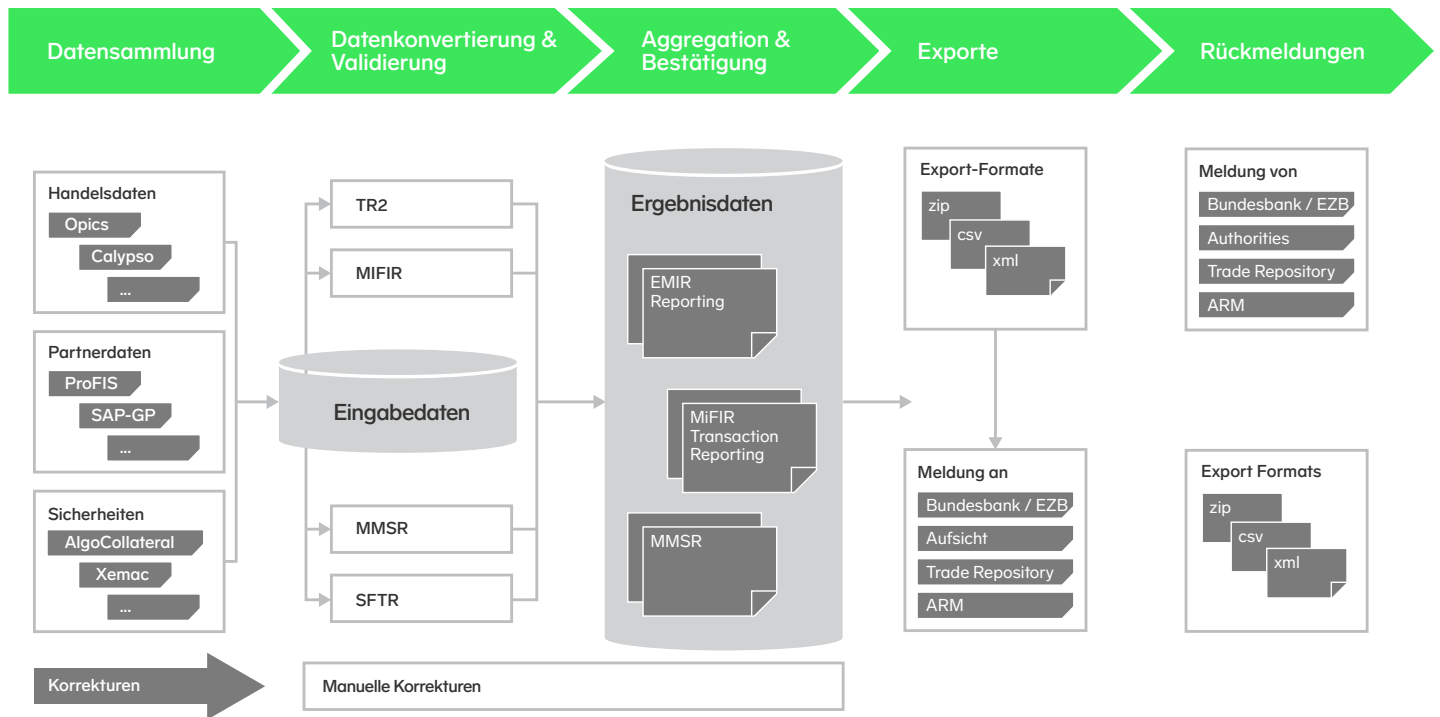


Abbildung 4: Vom Vorsystem bis zur Meldung – der Arbeitsprozess im Überblick

## Modul TR2

### Regulatorische Anforderungen

#### European Market Infrastructure Regulation (EMIR)

Ziele des Art. 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (EMIR) sind vor allem eine erhöhte Transparenz sowie die Überwachung systemischer Risikokonzentrationen im Markt für Finanzderivate. EMIR, in Kraft seit dem 16.08.2012, kann als Auftakt für das umfassende transaktionsbasierte Meldewesen in Europa gesehen werden. Gemäß Art. 9 ist von finanziellen, nicht finanziellen und zentralen Gegenparteien sicherzustellen, dass jeder Abschluss, jede Änderung und Beendigung eines Derivatekontraktes – unabhängig davon, ob außerbörslich oder börslich gehandelt – bis zum Ende des folgenden Geschäftstages an ein autorisiertes Transaktionsregister gemeldet wird. Der Meldeumfang wurde von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) in Form von technischen Standards (RTS / ITS) definiert.

Im Mai 2015 wurden die Regulatory und Implementing Technical Standards (RTS / ITS) seitens der ESMA umfassend überarbeitet und verfeinert. Sie wurden am 27.01.2017 im Amtsblatt der EU veröffentlicht und sind seit 30.10.2017 anzuwenden. Abacus unterstützt die EMIR-Meldung an die Transaktionsregister DTCC und RegisTR.



## Schweizer Finanzmarktinfrastrukturgesetz (FMIA/FinfraG)

Vor dem Hintergrund der internationalen Anstrengungen zur Regulierung der Derivatemärkte sowie der Konsolidierung diverser Schweizer Gesetzgebungen im Bereich der Finanzmarktregulierung (unter anderem Börsengesetz und Bankgesetz) hat das Eidgenössische Finanzdepartement der Schweiz FMIA / FinfraG entwickelt. Diese an EMIR angelehnte Regulierung fasst verschiedene Pflichten für die Marktteilnehmer zusammen, darunter die Pflicht zur Meldung aller Derivate an ein Transaktionsregister. Die Meldungseinreichung selbst folgt einer durch die Regulierung festgelegten Hierarchie, die sich an der Branche (finanziell, nicht finanziell), dem Marktgewicht (+/-) und dem Sitzland (innerhalb / außerhalb der Schweiz) der Gegenparteien orientiert. Das Modul R2 unterstützt die Derivatemeldung nach FMIA / FinfraG für alle Kontrahentenklassen an das Register RegisTR.

## Canadian Securities Administrators TR Rules (CSA)

CSA stellt einen wichtigen Schritt der kanadischen Regierung zur Schaffung einer gemeinsamen Wertpapieraufsicht dar. Die Regeln zum Reporting von Derivaten wurden von den kanadischen Provinzregulatoren, die gemeinschaftlich als Canadian Securities Administrators (CSA) zusammenarbeiten, vorgeschlagen und ausgearbeitet.

Die Regulierung wurde als Folge des G20-Gipfels mit der Maßgabe gebildet, ein neues regulatorisches Regime für den Handel mit OTC-Derivaten in Kanada zu schaffen. Das Reporting erfolgt hierbei einseitig an ein Transaktionsregister (TR). Die Meldepflicht folgt einer festgelegten Hierarchie, die sich an der Branche, dem Marktgewicht und dem Sitzland der Gegenparteien orientiert. Abacus Transactions unterstützt die CSA-Meldung für kleinere Marktteilnehmer an das Register DTCC.


## Unsere Lösung

Im Modul TR2 können EMIR-Meldungen an die Transaktionsregister RegisTR und DTCC generiert werden. Dies gilt sowohl für einzelne Institute als auch für Institutgruppen.

Auch die Meldung nach dem Schweizer FMIA / FinfraG (RegisTR) sowie die Meldung nach CSA (für die Assetklassen FX und Interest Rates, DTCC) können über das Modul TR2 erstellt und an die unterstützten Transaktionsregister übermittelt werden.

Das Modul TR2 unterstützt neben der korrekten Meldungserstellung weitere Funktionalitäten, wie beispielsweise Modulrelevanzermittlung, Konsistenzprüfung, integrierter Bestandsabgleich, Validierung der Ergebnisdaten, revisionssichere Korrekturmöglichkeiten (unter anderem bei Konsistenzfehlern), Tabellenimporte und -exporte (xml, csv / xlsx) sowie analytisches Reporting. Als Antwort auf die eingereichten Daten generieren die Transaktionsregister Rückmeldungen, die wiederum in das Modul TR2 eingelesen und der jeweiligen Transaktion zugeordnet werden. Dadurch sind alle relevanten Informationen in einer Lösung zusammengefasst und können dort bearbeitet und weiter analysiert werden.

Die in ABACUS/Transactions etablierte Bestandsabgleichsfunktionalität inklusive der Erzeugung von Vorschlagstransaktionen unterstützt eine nachvollziehbare Meldungsabgabe sowie einen einheitlichen, abgestimmten Datenhaushalt zwischen den Systemen. Das Prozessmanagement erfolgt flexibel über das Cockpit (GUI), die Prozessleiste oder automatisiert (via Batch Skript).



Verlässliche  
Produktstrategie  
Regulatorische Änderungen  
und Erweiterungen werden  
zeitnah implementiert

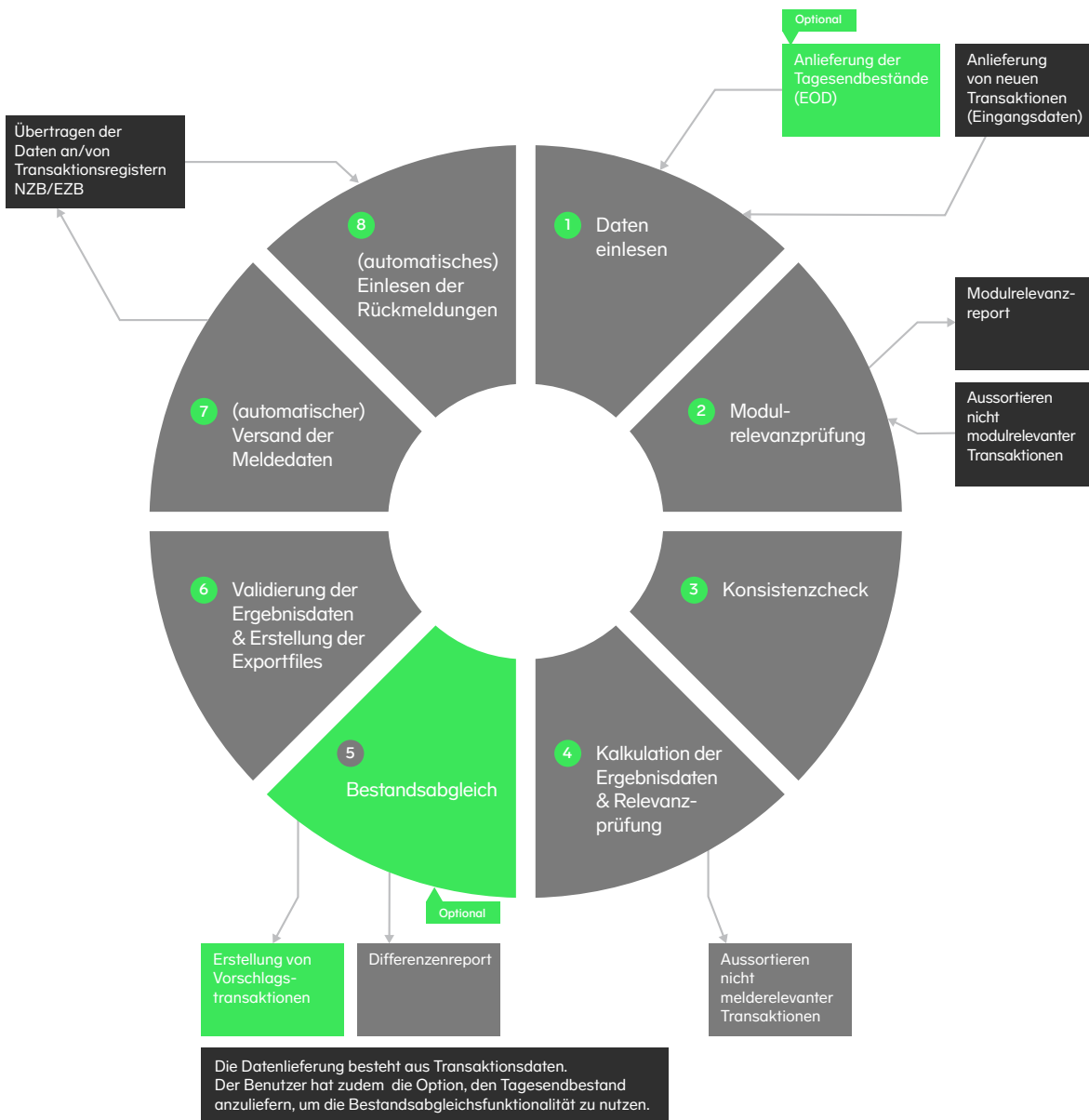


Abbildung 5: Darstellung des Prozesszyklus inklusive Bestandsabgleich

## Modul MMSR

Angesichts der strukturellen Änderungen an den Finanzmärkten besteht die geldpolitische Notwendigkeit, die Funktionsweise des Geldmarktes und die diesbezüglichen Aktivitäten umfassender als früher zu erheben. Aus diesem Grund hat die Europäische Zentralbank (EZB) die Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 vom 26.11.2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2014/48) verabschiedet.



## EZB-Verordnung über Geldmarktstatistiken (MMSR)

Ziel dieser EU-Verordnung ist die Gewinnung von Informationen über die Geldmarktaktivitäten und -konditionen in der Europäischen Währungsunion. Hierzu erhebt die EZB seit April 2016 statistische Daten über getätigte Geldmarktgeschäfte in Euro. Es handelt sich dabei um transaktionsbasierte Meldungen, die der EZB ein umfassendes Bild über die Aktivitäten an den Geldmärkten vermitteln sollen, um die Wirksamkeit der geldpolitischen Impulse zu erfassen und die Erfüllung der Aufgaben im Bereich der Finanzmarktstabilität zu unterstützen. Die Erhebung soll ferner den Einheitlichen Aufsichtsmechanismus (Single Supervisory Mechanism, SSM) gemäß der Verordnung (EU) Nr. 1024/2013 des Rates in analytischer und statistischer Hinsicht stärken. Nach einer dreimonatigen Testphase sind die Meldungen seit dem 01.07.2016 produktiv bis 06:30 Uhr MEZ des auf den Handelstag folgenden Geschäftstages (T+1) bei der Bundesbank bzw. bis 07:00 Uhr bei der EZB einzureichen).


## Unsere Lösung

Über vordefinierte Standardschnittstellen werden die benötigten Transaktionsdaten für die Meldung nach EZB-Geldmarktstatistiken aus den Quellsystemen wie beispielsweise Front- und Back-Office-Systemen täglich angeliefert. Durch die Layer-Struktur hat der Anwender die Möglichkeit, das Modul MMSR sowohl einzeln als auch in Kombination mit den anderen Modulen in ABACUS/Transactions zu nutzen. Die Prozesskette vom Datenimport bis zur Meldungsabgabe ist dabei in hohem Maße standardisiert.

Das Modul MMSR unterstützt neben der korrekten Meldungserstellung weitere Funktionalitäten, wie beispielsweise Modulrelevanzermittlung, Konsistenzprüfung, Melderelevanzprüfung, integrierter Bestandsabgleich mit korrigierenden Vorschlagstransaktionen, Validierung der Ergebnisdaten analog der Regeln der Meldungsempfänger, reversionssichere Korrekturmöglichkeiten (unter anderem bei Konsistenzfehlern), Tabellenimporte und -exporte (xml, csv / xlsx) sowie analytisches Reporting.

Besonders hervorzuheben ist hierbei die Funktionalität der unter- und übertägigen Melderelevanzermittlung sowie die Konsolidierung der Datensätze am Stichtag. Diese Prozesse sind optional und tragen den MMSR-spezifischen Vorgaben der EZB Rechnung, dass lediglich ein relevanter Datensatz pro Geschäft und Stichtag an die EZB gemeldet werden darf. Auch diverse Korrekturmöglichkeiten von Datensätzen wie beispielsweise das Kopieren vollständiger Marktsegmente, die nicht an die EZB / Bundesbank geliefert werden konnten und am nächsten Stichtag mitgemeldet werden müssen, sind im Modul MMSR integriert. Spezielle Prozesse für die tägliche automatisierte Neu-Meldung von BAW-Geldern / Call Money und Open Repos wurden ebenfalls integriert.

Die in Abacus Transactions bereits etablierte Bestandsabgleichsfunktionalität inklusive der Erzeugung von Vorschlagstransaktionen sowie die Identifizierung nicht melderelevanter Transaktionen unterstützen eine nachvollziehbare Meldungsabgabe sowie einen einheitlichen, abgestimmten Datenhaushalt zwischen den Systemen. Das Prozessmanagement erfolgt flexibel über das Cockpit (GUI), die Prozessleiste oder automatisiert (via Batch Skript).



Unter- und übertägige  
Relevanzprüfung  
Implementierte Logik zur  
Ermittlung des korrekten  
Meldestatus pro Transaktion  
(PTI)

# Modul MIFIR

Die überarbeitete Richtlinie über Märkte in Finanzinstrumenten (Markets in Financial Instruments Directive, MiFID II) sowie die begleitende Verordnung (Markets in Financial Instruments Regulation, MiFIR) definieren die Regeln für die Erbringung von Wertpapierdienstleistungen in einer Vielzahl von Finanzinstrumenten an regulierten, multilateralen und organisierten Handelsplätzen.

## Regulatorische Anforderungen

### Markets in Financial Instruments Regulation (MiFIR)

This new legislative framework came into force on July 1, 2014. Its implementation  
Der neue Rechtsrahmen ist am 1. Juli 2014 in Kraft getreten. Die Anwendung wurde um ein Jahr auf den 3. Januar 2018 verschoben.

Die Richtlinie sowie die Verordnung sehen eine Ausweitung der unter MiFID I geltenden Transparenzbestimmungen sowie eine Stabilisierung und Neuordnung der Finanzmarktinfrastruktur vor. Wesentliche Elemente sind hierbei die Einführung einer neuen Handelsplatzkategorie, das sogenannte „organisierte Handelssystem“ („Organised Trading Facility“, OTF), eine Handelsplatzpflicht für bestimmte Finanzinstrumente sowie eine Clearingpflicht für Derivate, die an geregelten Märkten gehandelt werden.

Gemäß Art. 26 MiFIR sind Wertpapierfirmen und Handelsplatzbetreiber dazu verpflichtet, sämtliche Änderungen in ihrer Position bzw. in der Position ihrer Kunden in bestimmten Finanzinstrumenten bis zum Ende des folgenden Geschäftstages an die zuständige Aufsicht zu melden.

Die Meldepflicht bezieht sich auf Finanzinstrumente,

- die zum Handel an einem Handelsplatz zugelassen sind oder deren Zulassung beantragt wurde
- deren Basiswerte diesen Kriterien entsprechen
- deren Basiswert ein Index oder Basket ist, dessen Komponenten diesen Kriterien entsprechen.

Der Meldeumfang wurde von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) in Form von Technischen Standards (ESMA/2015/1464, RTS 22) sowie den Level III Guidelines (ESMA/2016/1452) definiert. Die Meldung muss bis zum Ende des auf den Handelstag folgenden Geschäftstages (T+1) entweder direkt, über den Handelsplatz oder über einen sogenannten ARM (Approved Reporting Mechanism) an die zuständige nationale Aufsicht (in Deutschland BaFin) erfolgt sein. Das technische Abgabeformat ist xml, basierend auf dem ISO20022 Standard.

## Unsere Lösung

Im Modul MIFIR können Meldungen an die Nationalen Aufsichtsbehörden (ISO20022) oder an den ARM Service der Deutsche Börse Group generiert werden. Dies gilt sowohl für einzelne Institute als auch für Institutsgruppen.

Das Modul MIFIR unterstützt neben der korrekten Meldungserstellung weitere Funktionalitäten, wie beispielsweise Modulrelevanzprüfung, Konsistenzprüfung, Melderelevanzprüfung, integrierter Bestandsabgleich für OTC-Derivate, Validierung der Ergebnisdaten analog der Regeln des Meldungsempfängers, reversionssichere Korrekturmöglichkeiten (unter anderem bei Konsistenzfehlern), Tabellenimporte und -exporte (xml, csv / xlsx) sowie analytisches Reporting.

Hierbei werden über vordefinierte Standardschnittstellen die benötigten Meldedaten aus den Quellsystemen wie beispielsweise Front- und Back-Office-Systeme täglich angeliefert.

Durch die Layer-Struktur hat der Anwender die Möglichkeit, das Modul MIFIR sowohl einzeln als auch in Kombination mit den anderen Modulen in Abacus Transactions zu nutzen. Die Prozesskette vom Datenimport bis zur Meldungsabgabe ist dabei in hohem Maße standardisiert.

Die Bestandsabgleichsfunktionalität und die Erzeugung von Vorschlagstransaktionen beziehungsweise die Identifizierung nicht melderelevanter Transaktionen unterstützen eine nachvollziehbare Meldungsabgabe sowie einen einheitlichen, abgestimmten Datenhaushalt zwischen den Systemen. Das Prozessmanagement erfolgt flexibel über das Cockpit (GUI), das Prozessmenü oder automatisiert (via Batch Skript).

## Markets in Financial Instruments Directive II (MiFID II)

Als Ergänzung zur Transaktionsmeldung nach Art. 26 MiFIR, unterstützt Abacus Transactions auch das Positionsreporting in Warenderivaten nach Art. 58 (2) und (3) MiFID II. Neben der Positionsmeldung an den Regulatory Reporting Hub der Deutsche Börse Group können in Abacus auch die Meldungen von Börsenkontrakten an die jeweiligen Handelsplätze sowie die Positionsmeldungen an die nationalen Aufsichten erzeugt werden (ISO20022). Die Verarbeitung der Daten erfolgt analog der etablierten Prozesse in Abacus und bietet neben der Modulrelevanz- und Konsistenzprüfung einen Prozess zur Ermittlung ökonomisch äquivalenter OTC-Kontrakte (EEOTC) zu den angelieferten ETD-Positionen. Nach Ermittlung und Konsolidierung der Einzelpositionen erfolgt die Erzeugung der Meldedateien nach den regulatorischen Anforderungen sowie die Verarbeitung der Rückmeldungen. Abacus unterstützt die Meldung an die Nationalen Aufsichten sowie den RRH der Deutsche Börse Group.

Komplexe Meldelogik unter MiFIR  
Abacus Transactions deckt die verschiedenen Meldeszenarien inklusive Delegation und Third Party Reporting ab

Die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung von gestellten Sicherheiten sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (SFTR) wurde im Dezember 2015 verabschiedet und trat am 12. Januar 2016 in Kraft.

## Regulatorische Anforderungen

### Securities Financing Transactions Regulation (SFTR)

Die SFTR regelt im Wesentlichen die Pflichten im Hinblick auf Wertpapierfinanzierungsgeschäfte. Als „Schwesterregulierung“ ist die SFTR stark an EMIR angelehnt, vor allem, was die Meldepflicht betrifft. Gemäß Art. 4 SFTR ist von finanziellen, nicht finanziellen und zentralen Gegenparteien sicherzustellen, dass jeder Abschluss, jede Änderung und die Beendigung eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts bis zum Ende des folgenden Geschäftstages an ein autorisiertes Transaktionsregister gemeldet wird.

Der Meldeumfang wurde von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) in Form von technischen Standards (RTS / ITS) definiert. SFTR soll die noch bestehenden Lücken im Bereich der Wertpapierfinanzierungsmärkte schließen, führt erweiterte Transparenzanforderungen für die Manager von Investmentfonds (UCITS und AIFMD) ein und stellt Anforderungen an die Weiterverwendung von gestellten Sicherheiten.

In Art. 4 SFTR wird – ähnlich Art. 9 EMIR – zwischen finanziellen und nicht finanziellen Gegenparteien unterschieden. Zwar gelten die genannten Meldepflichten grundsätzlich für beide Gruppen, jedoch obliegt die Verantwortung für die Erfüllung der Meldepflichten für ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft, das zwischen einer finanziellen Gegenpartei und einer nicht finanziellen Gegenpartei abgeschlossen wird, der finanziellen Gegenpartei, sofern die nicht finanzielle Gegenpartei an ihren Bilanzstichtagen die Grenzen von mindestens zwei der drei folgenden Schwellenwerten nicht überschreitet: (i) EUR 20.000.000 Bilanzsumme, (ii) EUR 40.000.000 Nettoumsatzerlöse und (iii) 250 Beschäftigte im Durchschnitt des Geschäftsjahres. Folgende Instrumente unterliegen der Berichtspflicht:

- Pensionsgeschäfte,
- Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte,
- Kauf- / Rückverkaufgeschäfte bzw. Verkauf- / Rückkaufvereinbarungen
- Lombardgeschäfte.

Ausgenommen hiervon sind Geschäfte mit Zentralbanken. Die Meldeanforderungen wurden von der ESMA in Form von Technischen Standards (RTS / ITS) spezifiziert und am 31.03.2017 der Europäischen Kommission zur Entscheidung vorgelegt. Die Meldungen sind künftig – analog zur EMIR – bis zum Ende des auf den Handelstag folgenden Geschäftstages (T+1) bei einem autorisierten Transaktionsregister einzureichen.

Advantages of market maturity  
Adaption of the EMIR reporting logic and infrastructure already implemented in Abacus Transactions for the SFTR module.

Die Meldepflicht nach SFTR wird voraussichtlich Ende 2018 in Kraft treten, die Anwendung erfolgt stufenweise für die einzelnen Gegenparteiklassen.

### Adressatenkreis

### Anwendbarkeit (nach Inkrafttreten der Verordnung)

Kreditinstitute und Wertpapierfirmen	12 Monate
Zentrale Gegenparteien i.S.d. EMIR und Zentralverwahrer	15 Monate
Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen, Manager von Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) oder Alternative Investmentfonds (AIFs) sowie regulierte Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung	18 Monate
Nicht finanzielle Gegenparteien	21 Monate

Abbildung 6: Anwendbarkeit der Verordnung nach Institutklassen

## Unsere Lösung

Über vordefinierte Standardschnittstellen werden die benötigten Transaktionsdaten für die Meldung nach SFTR aus den Quellsystemen wie beispielsweise Front- und Back-Office-Systeme täglich angeliefert. Durch die Layer-Struktur hat der Anwender die Möglichkeit, das Modul SFTR sowohl einzeln als auch in Kombination mit den anderen Modulen in Abacus Transactions zu nutzen. Die Prozesskette vom Datenimport bis zur Meldungsabgabe ist dabei in hohem Maße standardisiert.

Im Modul SFTR können Meldungen an die Transaktionsregister RegisTR und DTCC generiert werden. Dies gilt sowohl für einzelne Institute als auch für Institutsgruppen.

Das Modul SFTR unterstützt neben der korrekten Meldungserstellung weitere Funktionalitäten, wie beispielsweise Modulrelevanzermittlung, Konsistenzprüfung, Melderelevanzprüfung, integrierter Bestandsabgleich, Validierung der Ergebnisdaten analog der Regeln der Meldungsempfänger, reversionssichere Korrekturmöglichkeiten (unter anderem bei Konsistenzfehlern), Tabellenimporte und -exporte (xml, csv / xlsx) sowie analytisches Reporting.

Die Bestandsabgleichsfunktionalität und die Erzeugung von Vorschlagstransaktionen beziehungsweise die Identifizierung nicht melderelevanter Transaktionen bei Anlieferung von Tagesendbeständen unterstützen eine nachvollziehbare Meldungsabgabe sowie einen einheitlichen, abgestimmten Datenhaushalt zwischen den Systemen. Das Prozessmanagement erfolgt flexibel über das Cockpit (GUI), das Prozessmenü oder automatisiert (via Batch Skript).

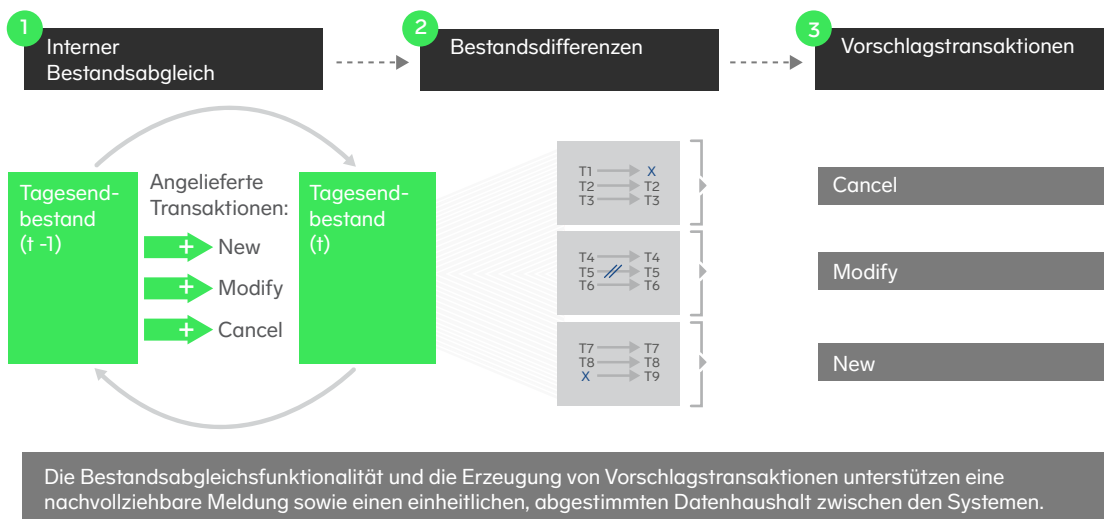


Abbildung 7: Der interne Bestandsabgleich identifiziert Differenzen und generiert korrigierende Vorschlagstransaktionen

# Abacus – mehrfach ausgezeichnete RegTech Lösungen

Abacus Transactions basiert auf BearingPoints bewährter Abacus-Plattform. 2.000 Unternehmen aus mehr als 20 Ländern vertrauen den Produkten der Abacus Solution Suite, darunter große Zentralbanken, Aufsichtsbehörden, bekannte Finanzinstitute, der Großteil der 129 wichtigsten europäischen Banken unter Aufsicht des SSM und führende Versicherungsunternehmen. Die Produkte der Abacus Solution Suite wurden von führenden Analysten ausgezeichnet und auf industriespezifischen Reports geführt. Mit Abacus Transactions konnte sich BearingPoint als „enterprise solution provider“ mit der Tendenz zum „category leader“ im Chartis FinTech Quadrant™ für „MiFID II reporting solutions 2017“ positionieren. Darüber hinaus war Abacus Transactions Finalist des prestigeträchtigen Financial Innovation Award 2017 in der Kategorie „Technology Vendors – Best Financial Services Solutions“ sowie der Banking Technology Awards 2017 in der Kategorie „Best Use of RegTech“. Das Produkt war auch auf der Shortlist der RegTech Markets Spotlight Awards 2017 in der Kategorie „Market Integrity and Transparency“ und der RegTech Awards 2018 in der Kategorie „Best Solution for Securities Financing Transactions Regulation“.

## Regulatorische Expertise, Beratung und Dienstleistungen

BearingPoint, eines der führenden Management- und Technologieberatungsunternehmen, verfügt über langjährige Expertise im Meldewesen. Wir sind in stetigem Austausch mit Regulierungsbehörden wie beispielsweise Deutsche Bundesbank, EZB und ESMA

und stehen in engem Kontakt mit den entsprechenden Meldungsempfängern in Europa und den USA. Wir verbinden regulatorisches Know-how mit unserer bewährten, zuverlässigen und zukunftsorientierten Abacus Solution Suite sowie umfassenden Dienstleistungen von Beratung über Schulungen bis hin zu Managed Services.

## Schnelle Implementierung und umfassende Kundenbetreuung

Abacus Transactions Anwender profitieren vor allem von der schnellen Anpassung der Module an Veränderungen der regulatorischen Anforderungen, sowohl auf fachlicher als auch auf technischer Ebene. Unsere Kundenbetreuung umfasst eine Telefon- und E-Mail-Hotline, unser webbasiertes Ticket System (OTRS) und einen hilfreichen Online-Service, der Dokumentation, Downloads von Software- Paketen und andere Ressourcen beinhaltet. Darüber hinaus bieten das Abacus Transactions Wiki, Releasepläne und Treffen der User Group verschiedene Möglichkeiten für den Informationsaustausch über neue Regulierungen und Produktstrategien zwischen Anwendern und BearingPoint.





Regnology  
Speicherstrasse 1  
60327 Frankfurt  
Germany  
regnology.net

Marketing/Sales Contact:  
info@regnology.net

# Über Regnology

Regnology ist ein international führender Anbieter für innovative Lösungen im Bereich Regulatory Supervisory Technology (RegTech und SupTech), für AEOI und Steuerreporting sowie für Services für das aufsichtsrechtliche Meldewesen entlang der regulatorischen Wertschöpfungskette. Regnology ist seit 25 Jahren ein Partner für Banken und Regulierungsbehörden. Bis Ende 2020 war das Unternehmen Teil der BearingPoint-Gruppe und firmierte unter dem Namen BearingPoint RegTech. Seit dem Verkauf des RegTech-Geschäfts an das Private-Equity-Unternehmen Nordic Capital ist das Unternehmen unabhängig. Im Juni 2021 hat sich das Unternehmen mit Vizor Software zusammengeschlossen und kürzlich den Namen in Regnology geändert. Insgesamt nutzen mehr als 7.000 Firmen, darunter Banken, Versicherungen und Finanzdienstleister, Reporting-Lösungen von Regnology. Gleichzeitig setzen mehr als 50 Aufsichtsbehörden und Steuerbehörden auf fünf Kontinenten die SupTech-Lösungen des Unternehmens ein, um Daten von 34.000 Firmen in 60 Ländern zu erfassen und zu analysieren. Regnology beschäftigt insgesamt über 770 Mitarbeiter an 17 Standorten in 12 Ländern.

Weitere Informationen:  
[www.regnology.net](http://www.regnology.net)

