

MiFIR – RAPORTOWANIE TRANSAKCJI

- TRYB I ZASADY RAPORTOWANIA -
- KDPW JAKO ZATWIERDZONY MECHANIZM SPRAWOZDAWCZY (ARM) -
- IMPLEMENTACJA WYMOGU OD STRONY IT -



30.05.2017

HOTEL SOFITEL VICTORIA

WARSZAWA

SEMINARIUM POPROWADZĄ:

Mariusz Więckowski, ARETO

Marcin Wrona, KDPW_ARM

Cezary Goćłowski, RISCO SOFTWARE

PARTNERZY SEMINARIUM

Areto

KDPW | ARM

RISCO
SOFTWARE

Wdrażany obecnie pakiet regulacyjny MiFID II/MiFIR nakłada m.in. wymóg raportowania transakcji do organów nadzoru. Dotychczas obowiązujący (na mocy art. 93a ustawy o obrocie instrumentami finansowymi) tryb raportowania ulega fundamentalnej zmianie: właściwie jedynym elementem pozostającym bez zmian jest czas raportowania: „do końca następnego dnia po zawarciu transakcji”. Znacznemu rozszerzeniu ulega zakres instrumentów podlegających raportowaniu (np. część transakcji pochodnych tradycyjnie zawieranych na OTC), zakres zdarzeń (np. część transferów instrumentów finansowych między rachunkami) oraz tryb raportowania (przez nowe podmioty specjalizujące się w pośrednictwie w raportowaniu: zatwierdzone mechanizmy sprawozdawcze, ARM). Istotnie rozszerza się zakres informacji przekazywanych w raporcie (np. PESEL osoby podejmującej decyzję inwestycyjną). Dotychczasowy tryb raportowania wszystkich transakcji giełdowych przez rynki regulowane jest usunięty – co oznacza pełną odpowiedzialność domów i biur maklerskich za raportowanie transakcji giełdowych.

Powyższe zmiany oznaczają dla podmiotów objętych wymogiem (firmy inwestycyjne i banki) konieczność weryfikacji zakresu zdarzeń objętych raportowaniem oraz wdrożenie nowych mechanizmów obsługujących raportowanie. W związku z możliwością raportowania przez ARM konieczne jest ustanowienie relacji z takim podmiotem.

W trakcie seminarium będzie omówiony szczegółowo zakres i tryb raportowania, z uwzględnieniem aktów wykonawczych oraz wytycznych ESMA. Szczegółowo omówiony będzie tryb współpracy z KDPW, który na polskim rynku będzie pełnić rolę ARM. Uwzględnione będą również aspekty technologiczne procesu raportowania, na przykładzie aplikacji CESARZ firmy Risco Software.

Szkolenie jest adresowane do:

- Jednostek Sprawozdawczych,
- Pracowników Front Office,
- Pracowników Back Office,
- Pracowników Audytu,
- Inspektorów Nadzoru,
- Prawników,
- Pracowników Compliance

- - - ZAPRASZAMY - - -

SZCZEGÓŁOWY PLAN SEMINARIUM

Godz. 08.30 – 09.00 Rejestracja uczestników

1. Geneza i harmonogram wymogu raportowania MiFIR

- Pakiet MiFID II/MiFIR: struktura, tryb wdrażania
- Akt wykonawczy: RTS 22
- ESMA „Guidelines on transaction reporting, reference data, ...”
- Raportowanie MiFIR a MAR
- Harmonogram wdrożenia wymogu raportowania MiFIR

2. Zakres podmiotowy i przedmiotowy

- Podmioty objęte raportowaniem
 - Jednostronne raportowanie MiFIR
 - Zwolnienie z raportowania przy przyjęciu i przekazaniu zlecenia
 - Pełna odpowiedzialność firm inwestycyjnych za raportowanie transakcji giełdowych; Możliwe scenariusze przy raportowaniu transakcji giełdowych
- Zdarzenia objęte raportowaniem
 - Definicja „transakcji”
 - Usługi maklerskie implikujące wymóg raportowania
 - Wyłączenia niektórych zdarzeń z raportowania
- Instrumenty objęte raportowaniem
 - Zakres instrumentów objętych wymogiem
 - Problemy z definicją „będący przedmiotem obrotu w systemie obrotu”

Godz. 10.15 – 10.30 Przerwa kawowa

3. Właściwość organu nadzoru

- Raportowanie transakcji na rynkach zagranicznych
- Raportowanie transakcji przez oddziały zagraniczne

4. Zakaz podwójnego i nadmiarowego raportowania; komunikacja z KNF

- Dodatkowe ograniczenia procesu raportowania – nacisk na poprawność raportu
- Powiadamianie KNF w sytuacji błędnego/nadmiarowego raportowania
- Uzgadnianie „próbek danych KNF” z systemami transakcyjnymi

5. Odpowiedzialność podmiotów raportujących

- Częściowe wyłączenie odpowiedzialności przy raportowaniu przez ARM

6. Raportowane informacje

- „65 raportowanych pól”
- Oznaczenie kontrahentów: osób prawnych i osób fizycznych; obowiązek uzyskania kodu LEI od klienta
- Oznaczanie instrumentów; ISIN dla transakcji pochodnych OTC
- Pola dotyczące osób/algorytmów podejmujących decyzje i wykonujących transakcję

7. Wymogi dla mechanizmów raportowania: bezpieczeństwo, identyfikacja błędów przechowywanie informacji.

Godz. 12.30 – 13.30 Lunch

8. Raportowanie za pośrednictwem ARM - stan prawny

9. Funkcjonalności ARM

10. Przewidywane tryby raportowania

11. Komunikacja w KDPW_ARM

12. Harmonogram wdrożenia usługi ARM

13. Dlaczego KDPW_ARM?

Godz. 15.00 – 15.15 Przerwa kawowa

14. Wyzwania projektowe podczas wdrażania systemu raportującego zdarzenia dla regulacji MIFID II/MIFIR:

- Identyfikacja systemów źródłowych, transakcji i zdarzeń objętych wymogiem raportowania;
- Mapowanie danych źródłowych na pola raportu;
- Logika przetwarzania danych, walidacji i notyfikacji;
- Projekt przepływu danych ze wskazaniem niezbędnych zmian biznesowych, procesowych i systemowych;
- Interfejsy do systemów źródłowych oraz rejestrów zewnętrznych (np. ESMA) sposób dostępu dla różnych typów źródła danych;
- Przechowywanie danych;
- Bezpieczeństwo informacji w aplikacji a nowa regulacja RODO/GDPR;
- Wybór trybu raportowania do ARM: U2A lub A2A;
- Raportowanie transakcji banku / domu maklerskiego;
- Zmiany w cyklu życia aplikacji wynikające ze zmian źródeł danych / reguł raportowania;
- Dostęp do środowiska testowego ARM;
- Rekoncyliacja danych z KNF (uzgodnienie próbek danych na żądanie);
- Raportowanie danych referencyjnych do KNF (eksport danych referencyjnych);
- Przekazywanie do APA danych w ramach przejrzystości posttransakcyjnej;

Godz. 17.00 – Koniec seminarium



FORMULARZ ZGŁOSZENIOWY

MiFIR – RAPORTOWANIE TRANSAKCJI

30 maja 2017 r., Hotel Sofitel Victoria w Warszawie

WOJCIECH KAGAN

wojciech.kagan@kaganpartners.pl

Tel: + 48 (22) 734 05 60, Fax: + 48 (22) 427 51 05

Dane do faktury:

Firma (podmiot zgłaszający):

.....

Adres:

NIP:

Adres do korespondencji:

Firma (podmiot zgłaszający):

Osoba do kontaktu:

Adres:

Tel./e-mail:

Dane uczestnika (1)

Imię i Nazwisko:

Stanowisko:

E-mail:

Tel.:

Dane uczestnika (2)

Imię i Nazwisko:

Stanowisko:

E-mail:

Tel.:

KOSZT: 1 600 PLN + VAT / uczestnik

PROCEDURA POTWIERDZENIA UCZESTNICTWA I PŁATNOŚCI

Podmiot zgłaszający wyraża zgodę na następującą procedurę potwierdzenia uczestnictwa w ww. seminarium i płatności związanych z tym uczestnictwem. Po otrzymaniu przez organizatora seminarium prawidłowo wypełnionego zgłoszenia, KAGAN & PARTNERS prześle fakturę proforma osobie do kontaktu wskazanej przez podmiot zgłaszający. Warunkiem uczestnictwa w seminarium osób wskazanych przez podmiot zgłaszający jest pełne opłacenie faktury proforma w terminie do 7 dni od daty jej otrzymania. Zapłata faktury proforma musi nastąpić przed rozpoczęciem seminarium. Po uznaniu przez KAGAN & PARTNERS wpływu środków pieniężnych z tytułu płatności faktury proforma na wskazany numer rachunku bankowego, KAGAN & PARTNERS prześle osobie do kontaktu wskazanej przez podmiot zgłaszający potwierdzenie uczestnictwa w seminarium osób wskazanych przez ten podmiot wraz z właściwą fakturą VAT na adres podany w niniejszym zgłoszeniu.

Wyrażam zgodę na otrzymanie faktury w formie elektronicznej, E-mail:

OŚWIADCZENIA DOTYCZĄCE VAT*

- Oświadczam, że podmiot zgłaszający jest płatnikiem podatku VAT i posiada numer identyfikacji podatkowej NIP: _____ oraz, że podmiot zgłaszający upoważnia KAGAN & PARTNERS do wystawienia mu faktury VAT bez jego podpisu.
- Oświadczam, że podmiot zgłaszający nie jest płatnikiem podatku VAT.

ODWOŁANIE ZGŁOSZENIA I ZMIANY DOTYCZĄCE SEMINARIUM

Podmiot zgłaszający oświadcza, że przyjął do wiadomości fakt iż odwołanie niniejszego zgłoszenia wymaga zachowania formy pisemnej pod rygorem nieważności, a także że zapłacony koszt uczestnictwa w seminarium nie podlega zwrotowi jeśli odwołanie zgłoszenia nastąpi w terminie krótszym niż 7 dni przed datą rozpoczęcia seminarium, jak również że organizator zastrzegł sobie prawo do zmiany prelegentów oraz miejsca i daty seminarium w przypadku wystąpienia okoliczności niezależnych od niego.

ZGODA NA PRZETWARZANIE DANYCH OSOBOWYCH I NAZWY PODMIOTU ZGŁASZAJĄCEGO

Zgodnie z ustawą o świadczeniu usług drogą elektroniczną (tj. Dz.U. nr 144 z 2002., poz.1204) prowadząc niniejszą korespondencję wyrażają Państwo zgodę na przetwarzanie swoich danych osobowych przez Kagan & Partners w celach handlowych oraz prowadzenia marketingu bezpośredniego własnych produktów i usług. Administratorem Danych Osobowych w rozumieniu Ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 roku o Ochronie Danych Osobowych (Dz. U. z 2002r., nr 101, poz. 926 z późn. zm.) jest Kagan & Partners ul. Krótka 10 05-090 Raszyn. Informuje się o dobrowolności podania danych i przysługujących prawach, w szczególności o prawie wglądu do danych osobowych, ich poprawiania oraz żądania zaprzestania przetwarzania danych osobowych i ich usunięcia z bazy.

_____ data i pieczęć firmowa podmiotu zgłaszającego

_____ podpis osoby upoważnionej

* w przypadku złożenia oświadczenia należy postawić znak „X” w odpowiednim kwadracie.