



SFT Reporting

EliData's solution

SFT Reporting: : El módulo de GRS que garantiza el cumplimiento de la nueva normativa SFTR (Securities Financing Transaction Regulation)



ALCANCE FUNCIONAL

Gestiona el ciclo operativo completo:

- INCORPORACIÓN DE OPERACIONES
- REGISTRO DE OPERACIONES
- ELABORACIÓN Y VALIDACIÓN DEL REPORTING
- ENVÍO DEL REPORTING
- GESTIÓN DE LA RESPUESTA

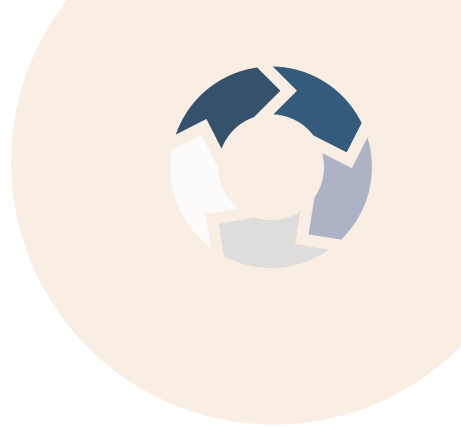


INFORME DIARIO
al repositorio de
operaciones

FUNCIONALIDADES DESTACADAS

- ✓ Incorporación automática de operaciones
- ✓ Introducción manual para completar la ausencia de información
- ✓ Gestión del ciclo de vida de las operaciones
- ✓ Enriquecimiento de la información de las operaciones con datos estáticos
- ✓ Production of reports and transmission to a Trade Repository
- ✓ Reporting de operaciones en nombre de determinadas categorías de clientes
- ✓ Reporting delegado de operaciones en nombre de contrapartes
- ✓ Control y gestión de:
 - incorporación de operaciones
 - generación y validación del reporting
 - envío del reportin al TR
 - respuesta del TR
- ✓ Gestión de errores e incidencias

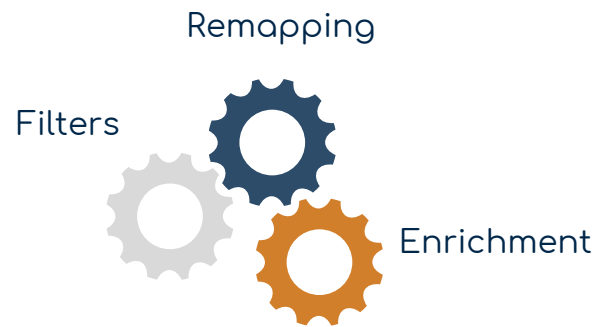
Flujo de trabajo



1 DEAL CAPTURE & MODIFY



2 ENRICHMENT



3 PRE-MATCHING



Reconciliation



4 REPORTING

Acknowledge

Reporting

Trade Repository



Contenido del reporting



- Nuevas operaciones, modificaciones, cancelaciones y eventos ocurridos durante el ciclo de vida
- La normativa SFTR obliga a las contrapartes a reportar 4 tablas de datos diferenciadas, con un máximo de 153 campos por reporting:
 - Datos de la contraparte
 - Datos relativos al préstamo y a la garantía real
 - Datos del margen
 - Datos de rutilización, reinversión de efectivo y fuentes de financiación



- Datos específicos para identificar intervinientes, instrumentos financieros y transacciones:
 - códigos LEI e identificador nacional
 - código sSIN
 - Identificador único de operación (UTI)



- Reporting en formato ISO 20022 XML en D+1

Nuestra propuesta

FASE PRELIMINAR

ANÁLISIS DE SITUACIÓN



VISIÓN GENERAL
PLAN DE ACCIÓN

FASE DE DISEÑO

DEFINICIÓN DE PROCESOS



PROCESOS DE MAPEO
ESPECIFICACIONES FUNCIONALES

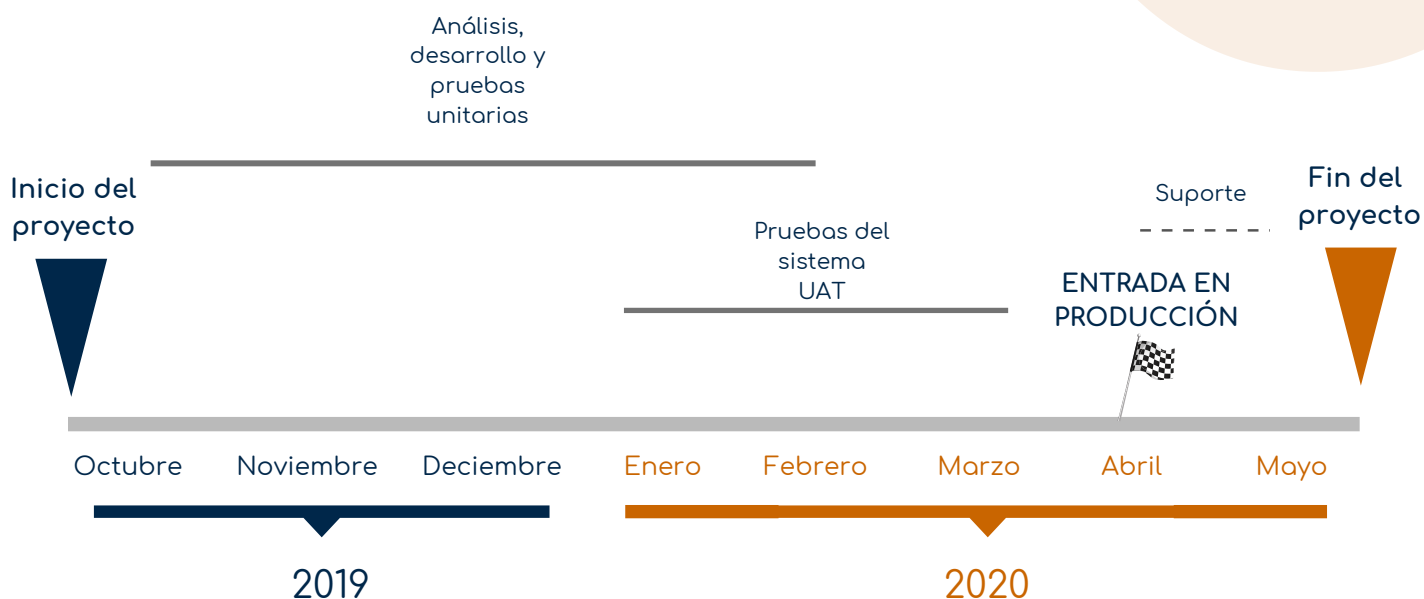
FASE OPARATIVA

PLAN DE PROYECTO



ANÁLISIS TECNOLÓGICO TI
PLANIFICACIÓN FASE DE PRUEBAS UNITARIAS
DETECCIÓN Y CORRECCION DE INDIDENCIAS

Ejemplo Plan de Proyecto



14 de abril de 2020

ENTRADA EN VIGOR

La iniciativa se concreta en el Reglamento (UE) 2015/2365 sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización del colateral que entró en vigor el 12 de enero de 2016. No obstante, la fecha de inicio real para el reporte de transacciones de financiación de valores (SFTR) se aplicará de forma escalonada desde el 11 de abril de 2019, fecha de aplicación de las normas técnicas de regulación (RTS):

- 12 meses después para entidades de crédito y empresas de servicios de inversión
- 15 meses después para entidades de contrapartida central CCPs y depositarios
- centrales de valores CSDs
- 18 meses después para otras entidades financieras: empresas de seguros y reaseguros, UCITS, FIA, sus sociedades gestoras y fondos de pensiones
- 21 meses después para contrapartes no financieras