

Fejl i indberetningerne

Som vi beskrev i nyhedsbrevet den 5. februar 2010, forventede vi, at de fejl vi nævnte i nyhedsbrevet var rettet ultimo februar. Vores løbende gennemgang af indberetningerne har vist, at mange af disse fejl stadig optræder.

De mest gennemgående fejl er nævnt i det tidligere nyhedsbrev under punkt 3: ”Indberetning af intern kode af professionel kunde/modpart der har en BIC-kode”, punkt 4: ”Eksempel på indberetning” (specielt vedrørende indberetning af modpart som kunde) og punkt 6: ”Tidsstempler”.

Vi skal bede om, at fejlene rettes hurtigst muligt.

TradeID

Vi gør opmærksom på, at hvis transaktionen er foregået på en af de i dokumentationen anførte markedspladser eller MTF'er skal TradeID fremover indberettes. De nærmere detaljer findes på side 14 i dokumentationen ”[Report format for reporting party](#)” under Venue reference transaction number. Der må ikke anvendes andre formater eller tilføjelser til dette. Bemærk, at der findes TradeID (matchID) for manuelt indberettede handler i Inet. Disse skal også indberettes.

Fremtidige ændringer

TREM 3.0

TREM (Transaction Reporting Exchange Mechanism) er det system, der benyttes i CESR (den Europæiske samarbejdsorganisation af tilsyn med værdipapirhandlere) til udveksling af transaktions og reference data mellem CESRs medlemmer.

Den 1. november 2010 skal der implementeres en ny version kaldet TREM 3.0. TREM 3.0 kan opdeles i tre elementer:

1. Flere valideringskontroller. Der er stadig behov for at forbedre kvaliteten af de indberetninger, der sendes via TREM og derfor vil den nye version indeholde flere valideringskontroller.
2. Forbedring af de nuværende reference data. Dette dækker instrument, MIC og BIC koder samt landekoder og valutakoder.
3. OTC derivater. Indberetningspligten vil fremover blive udvidet til at omfatte transaktioner med OTC derivater, som f.eks. CFD.

BEMÆRK, AT OTC DERIVATER IKKE SKAL INDBERETTES FRA DEN 1.

NOVEMBER 2010. Den endelige dato for hvornår indberetning af transaktioner med OTC derivater vil træde i kraft er endnu ikke fastlagt. Datoen for ikrafttrædelsen vil blive fastlagt i koordinering med vores nordiske kollegaer og forventningen er at kravet vil træde i kraft primo 2011.

I forbindelse med opdatering til TREM 3.0 vil det også blive et krav at indberette Client Code og Client Name for alle transaktioner foretaget på vegne af kunder. Tidligere var Client Name kun obligatorisk for transaktioner, hvor TradingCapacity = A (Agent). Den fremgår allerede nu af ”[Report format for reporting party](#)”, men vil som nævnt først blive et krav per 1. november 2010.

Orienteringsmøde

TREM 3.0 vil medføre schema ændringer, og i den forbindelse vil der blive afholdt et orienteringsmøde om ændringerne.

Dagsordnen er

1. Data kvalitet
2. Ændringer – et overblik
 - Baggrund
 - Ændringer per 1. november 2010
3. Schema ændringer
 - Teknisk information
4. Reporting Parties
5. OTC derivater
 - Baggrund
 - Nyt schema

- Tidsplan

6. Eventuelt

Orienteringsmødet vil blive afholdt mandag den 26. april kl. 10:00-12:00 hos

Finanstilsynet
Århusgade 110
2100 København Ø

Tilmeldinger bedes sendt til Mette Birch Jørgensen senest den 14. april 2010 på mail mbj@fnet.dk

Såfremt der er spørgsmål til ovenstående bedes de rettet til Kim Hjortshøj Bederholm på tlf. 33 55 82 45 eller på mail kb@fnet.dk