

Risiken im Derivatemarkt reduzieren.

EMIR-Anforderungen umsetzen mit FINCON.



Mit EMIR (European Market Infrastructure Regulation) sollen systemische Risiken im europäischen Derivatemarkt reduziert und mehr Transparenz im außerbörslichen Handel erreicht werden.

Für die Teilnehmer an Derivatemärkten stellen sich erweiterte Anforderungen an Abwicklungs- und Meldeprozesse:

- Clearing-Pflicht für außerbörsliche (Over The Counter = OTC) Derivate über eine Zentrale Gegenpartei (Central Counterparty = CCP)
- Besicherungspflicht mit Collateral für bilateral abgeschlossene (OTC)-Derivate, die nicht zentral über einen CCP abgewickelt werden
- Meldung von Transaktionen in Derivaten an ein Transaktionsregister

Handel und Abwicklung sind zwischen Marktteilnehmern bisher weitgehend unreguliert. EMIR unterscheidet bei Marktteilnehmern zwischen „Financial Institutions“ und „Non Financial Institutions“. Für Letztere gelten die Clearing-Pflichten, wenn sie Derivate in einem Umfang einsetzen, der über eine Absicherung von wirtschaftlichen Risiken aus originärer Geschäftstätigkeit hinausgeht.

Durch den Zugriff von Aufsichtsbehörden auf die Daten der – aktuell sechs zugelassenen – Transaktionsregister können systemische Risiken rasch identifiziert werden. Dafür werden Transaktionsdaten konsolidiert und den Aufsichtsbehörden in aggregierter Form zur Verfügung gestellt. Die Aufsicht über die Transaktionsregister obliegt der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA).

Für das Reporting ist eine eindeutige Firmenidentifikationsnummer (Legal Entity Identifier – LEI) erforderlich.

► Unser Angebot für Sie.

Praxiserprobte Methoden und Kompetenzen

- Einbringen von Know-how aus durchgeführten Derivate/CCP-Projekten
- Bewährte funktionale Modelle
- Best Practice-Verfahren
- Konsequenter Themenfokus unserer Berater
- Fundierte Expertise in der Informationstechnologie

Ergebnisse

- Zielbild
- Modellierung von Clearing-Prozessen mit Anbindung an CCP
- Anpassung des Reportings
- Auswahl von Service Providern (z.B. Clearing-Broker, CCP)
- Entscheidungsvorlagen
- Roadmap

► Das Ziel erreichen mit FINCON.

- Praktische Projekterfahrung mit Derivaten und CCPs
 - Auswahl einer Workflow-Anwendung für die Abwicklung von OTC-Derivaten
 - Konzeption eines Prozessmodells für die Abwicklung von Exchange Traded Derivatives
 - Analyse von Industriestandards für Clearing, Collateral- und Liefer-Management von Derivaten
 - Planung und Umsetzung von Wertpapierabwicklungsprozessen zur Anbindung an einen CCP
- Mitarbeiter mit umfassenden Kenntnissen über Aufbauorganisationen von Finanzdienstleistern
- Methodische Vorgehensweisen für Analysen und Implementierung
- FINCON-Experten-Team vor Ort

Haben wir Ihr Interesse geweckt? Gerne präsentieren wir unsere EMIR-Kompetenz und erstellen Ihnen ein auf Ihre individuelle Ausgangssituation zugeschnittenes Angebot.

Zahlen, Daten, Fakten über die FINCON.

- Wir sind das Beratungs- und Lösungshaus für Banken, die Sparkassenorganisation und die Versicherungswirtschaft.
- Wir beschäftigen in der FINCON rund 300 Mitarbeiter, erfahrene Consultants und IT-Spezialisten – allesamt spezialisiert auf Finanzdienstleister.
- Wir verfügen über 5 Geschäftsstellen in Deutschland, Sitz des Unternehmens ist Hamburg.

www.fincon.eu

Direkter Kontakt

Kastor-Tower, 20. Etage, Platz der Einheit 1 | 60327 Frankfurt/Main
Tel: +49 69 9511664-88 | Fax: +49 69 9511664-25
info@fincon.eu