

Software | Daten | Service

MAD II – Eine Herausforderung für die IT!?

Mittwoch, 17. September 2014
Compliance Solution Day

Beginn der Schaffung eines gemeinsamen Rechtsrahmens für den Finanzmarkt der Europäischen Union

- Sicherstellung der Integrität der Finanzmärkte in der Union
 - Anlegerschutz
 - Stärkung des Anlegervertrauens in deren Finanzmärkte
-
- Insidergeschäfte
 - Marktmissbrauch
-
- Neue Aufgabenstellung bei der Überwachung

- Handelstätigkeit
 - Algorithmischer Handel / Hochfrequenzhandel
 - Außerbörsliche Geschäfte
 - Allein der Versuch, inkl. Orderänderung und -storno
- Verpfändung und Verleihung
- Finanzinstrumente
 - Erweiterung verbundener Titel, z.B. Indizes
- Insiderlisten
 - Führung und rasche Aktualisierung
 - Zurverfügungstellung an Behörden

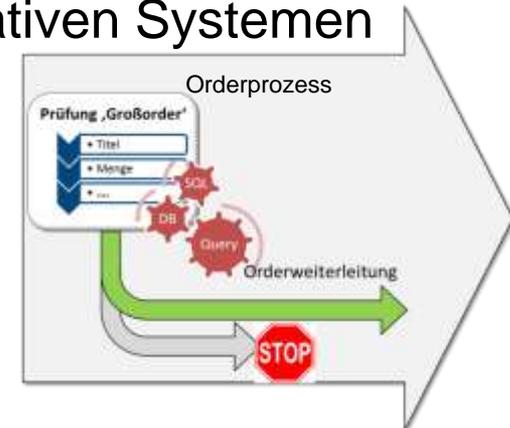
- Zusammenarbeit
 - Verpflichtende Meldungen an ESMA
 - Behörden anderer Mitgliedsstaaten / Drittstaaten
- Erweiterte Befugnisse der zuständigen Behörden
- Vereinheitlichung verwaltungsrechtliche Sanktionen
 - Verbot weiter Führungsaufgaben wahrzunehmen
 - Entzug / Aussetzung der Zulassung einer Wertpapierfirma
 - Finanzielle Sanktionen
 - Einzug der erzielten Gewinne
 - Natürliche Personen bis zu EUR 5 Mio
 - Juristische Personen bis zu EUR 515 Mio / 15 % Jahresumsatzes

... und wie sieht die Systemlandschaft heute großteils aus?

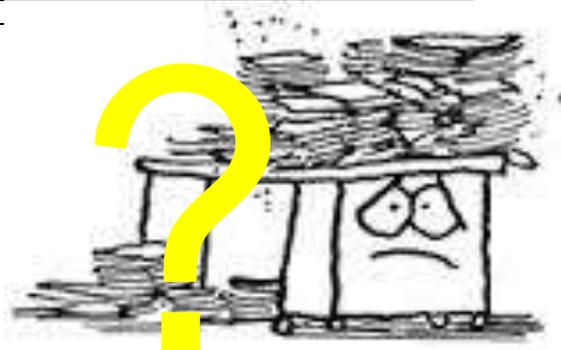
Manueller Abgleich

Kundentransaktionen						
Depot-Nr.	Name	Titel	Kauf / Verkauf	Menge	Datum	Uhrzeit
312-23456-879	Halsinger Andrea	AUA Stamm	Kauf	150	02.09.2014	09:20:17
312-29876-880	Mayer Ludwig	Wienerberger	Verkauf	20	02.09.2014	10:17:56
Mitarbeitertransaktionen						
Depot-Nr.	Name	Titel	Kauf / Verkauf	Menge	Datum	Uhrzeit
376-20909-882	Müller Herberich	AUA Stamm	Kauf	150	02.09.2014	09:20:17
376-20909-882	Müller Herberich	Wienerberger	Verkauf	20	02.09.2014	10:17:56
345-98076-771	Hofer Renate	AUA Stamm	Kauf	170	02.09.2014	10:17:56
345-98076-771	Hofer Renate	Flughafen Wien	Verkauf	30	04.09.2014	11:47:18
376-20909-882	Wagner Michael	IBM	Kauf	210	05.09.2014	12:19:17
341-12909-931	Zauner Erwin	IBM				

Funktionalitäten in operativen Systemen



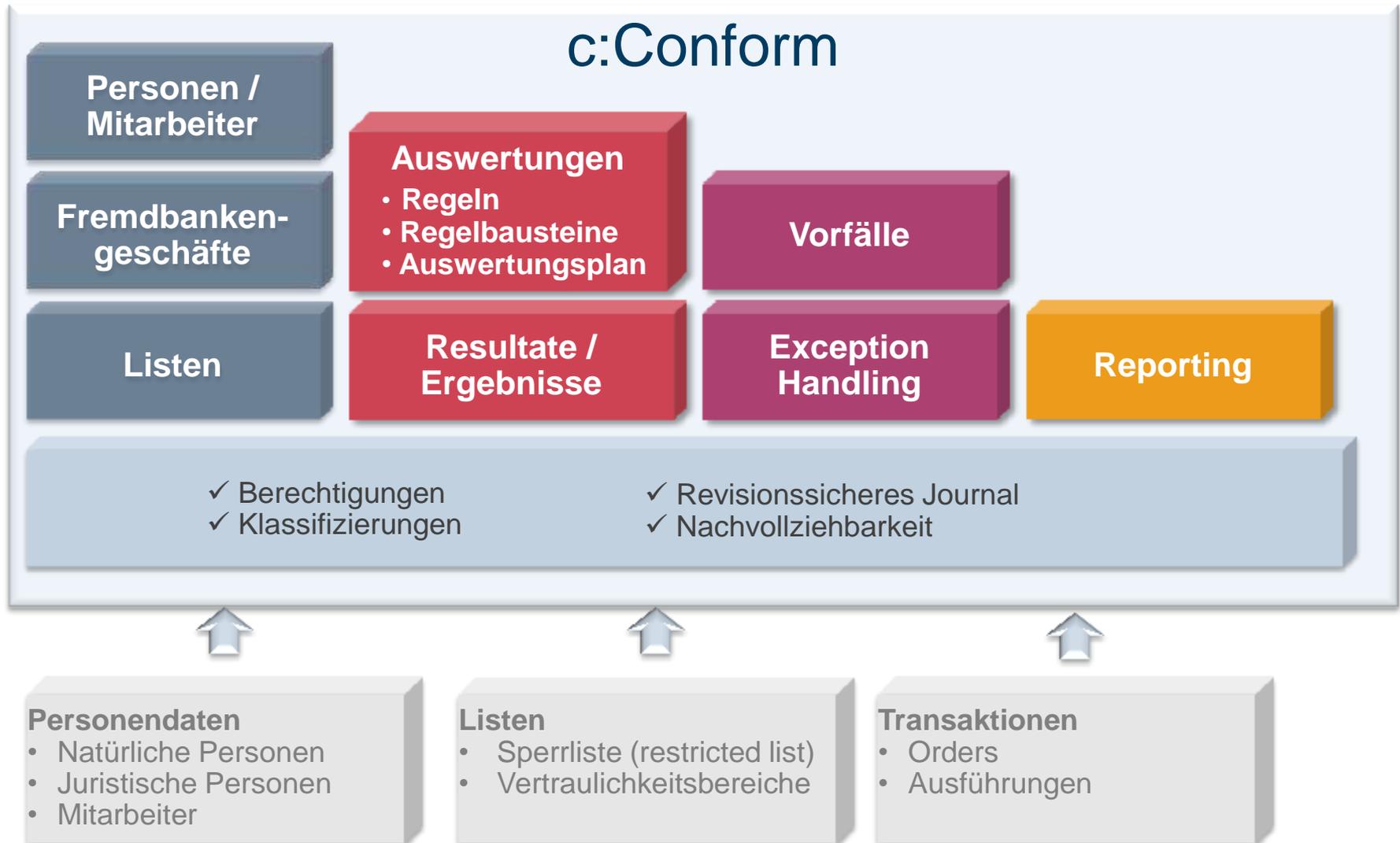
Dokumentenablage



2013	2013	2013	2014	2014	2014
Insider	Unterlagen zu Sperrlisten	MA-Infos	Insider	Unterlagen zu Sperrlisten	MA-Infos
Compliance Office	Compliance Office	Compliance Office	Compliance Office	Compliance Office	Compliance Office

IT_Anforderungen

	Periodizität
Mitarbeitergeschäfte	Täglich
Sperrlistentransaktionen	Täglich
Beobachtunglistentransaktionen	Woche
Monatsstatistik	Monat
Quartalsstatistik	Quartal
Geschäftsbericht	Halbjahr
...	
...	
...	



- Zentrale Lösung für Wertpapier und Derivate Compliance
- Lückenlose Dokumentation aller relevanten Informationen
- Systematische Überprüfung auf Regelkonformität
 - Ex post
 - Ex ante
- Vermeidung redundanter Datenhaltung (Single truth)
- Rasche Anpassung direkt durch das Compliance Office
- Verschiedene Betriebs- und Dienstleistungsmodelle

Datenhaushalt und Funktionen

- Compliance-relevante Daten
 - Rollen, z.B. Führungskräfte (MAD II Art.19)
 - Beziehungen, z.B. Personen in enger Beziehung (MAD II Art.19)

 - Mitarbeiterinformationen (z.B. zulässiges Handelsvolumen)
 - Fremdbankenverbindungen
 - Vertraulichkeitsbereiche

- Allgemeine Stammdaten

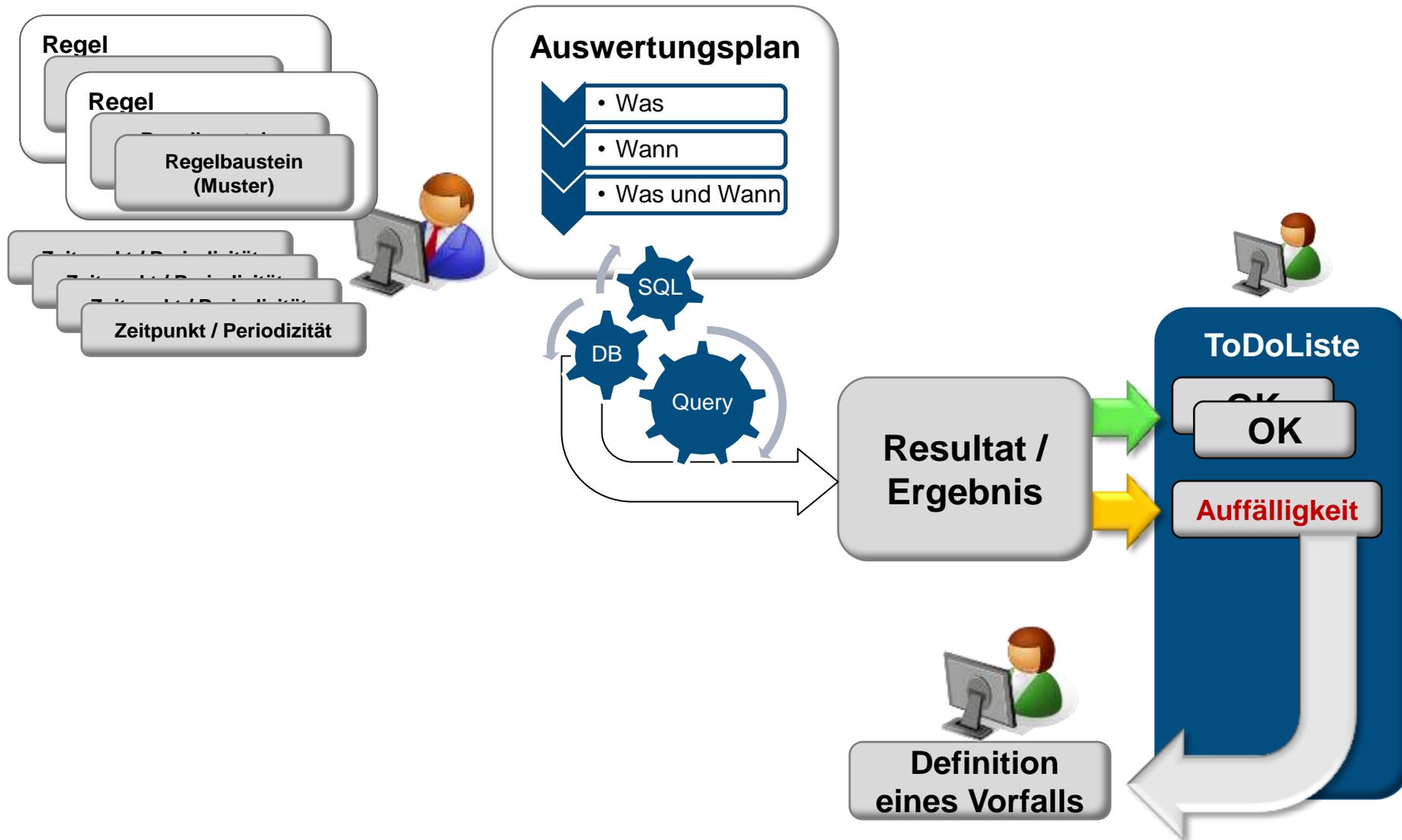
- Insiderverzeichnis (MAD II Art.18)
 - Automatische Erstellung aus Personendaten
 - Für (interne) Mitarbeiter oder externe Mitarbeiter
 - Definierte Zeiträume
- Handelsplatzliste
 - Geregelter Märkte / Börsen
 - Organisierte Handelssysteme
- Vertraulichkeitsbereiche
- Sperrliste (restricted list)
- Beobachtungsliste (watch list)

- Regeln
 - Auswertungsregeln (ex post)
 - Regeln für Echtzeitprüfungen (ex ante)
- Auswertungsplan
 - Automatisierte periodische Auswertung von ex post-Regeln
- Ergebnisse
 - Sortierung nach unterschiedlichen Kriterien
 - Manuelle Bearbeitung

- Stornos, Orders ohne Ausführungen
MAD II, Art. 8 (2), Art. 12 (2) c iii,)
- Transaktionen zum Börseschluss (MAD II, Art.12 (2) b)
- Eigengeschäfte von Führungskräften (MAD II, Art. 19)
- Transaktionen rund um Ereignistermine

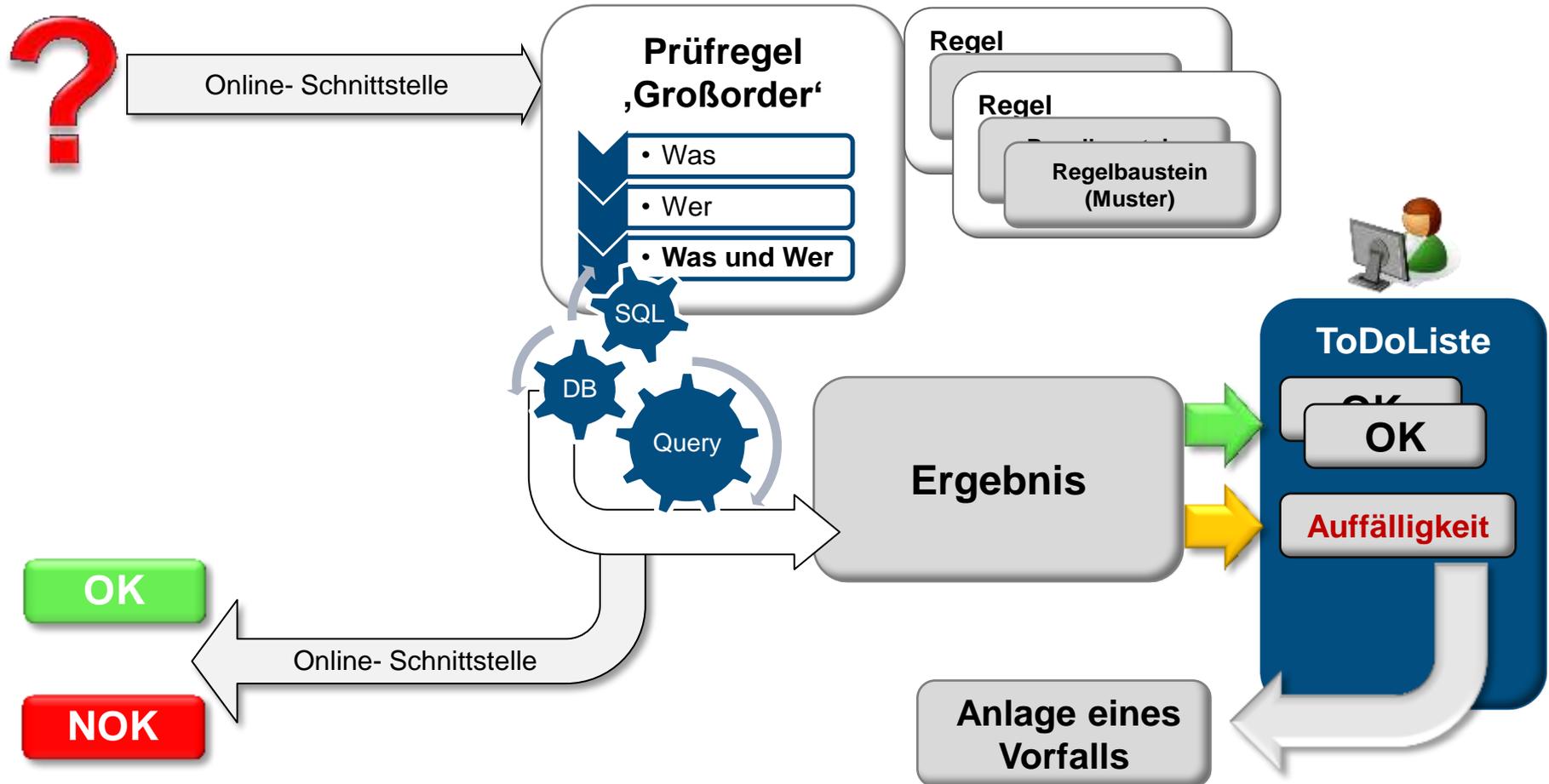
- Transaktionen ohne Besitzwechsel (Wash trades)
- Abgleich von Transaktionen unterschiedlicher Personengruppen
- Großorder
- Front- / Parallel-Running
- Beobachtungs- und Sperrliste
- ...

Use Case: Einmeldung bzw. Erkennung einer Auffälligkeit



Use Case: Echtzeitprüfung

Vollautomatische Prüfung Online



- Führung und Verwaltung von Auffälligkeiten
 - Führung von spezifischen Listen und Personendaten
 - Umfangreiche und detaillierte Ex-post-Prüfungen
 - Zeitnahe ex-ante-Prüfungen bei Bedarf
 - Konsequente, automatisierte Überwachung
-
- Nachvollziehbarkeit und Sicherheit
 - Vermeidung finanzieller Verluste und Reputationsschäden
 - Fit & Proper

Gerne präsentieren wir Ihnen unsere
Lösung live am Ausstellungsstand.

Vielen Dank für Ihre Aufmerksamkeit!

Hrvoje Kajzer
Senior Sales Manager

Hrvoje.Kajzer@sds.at
+43 676 88241 5182

Software Daten Service GmbH
Rennweg 97-99
A-1030 Vienna, Austria
www.sds.at

Internet: www.sds.at

Christa Riedel
Produktmanagerin

Christa.Riedel@sds.at
+43 676 88241 3676

Software Daten Service GmbH
Rennweg 97-99
A-1030 Vienna, Austria
www.sds.at

Betriebs- und Dienstleistungsmodelle

Zentrale Servicierung mehrerer Depotmandanten auf Basis eines durchgängigen Mandantenkonzepts

- Innerhalb einer Installation
 - Verwaltung allgemein gültiger Datenbereiche
 - Führung von Listen, z.B. institutsweite Beobachtungsliste
 - Parametrisierung von Regeln
 - Zentrale Durchführung von
 - Auswertungsplänen
 - Statistische Auswertungen, z.B. monatliche Statistik bzgl. Spekulationsgeschäften von Mitarbeitern
 - Depotmandanten-übergreifende Abfragen
- Aufwandsoptimierung für die einzelnen Depotmandanten

- **Depotmandant** (analog zu GEOS)
juristisch eigenständige Einheit,
führt Depots, deren Handelsgeschäfte und seine c:Conform-Daten
- **Mustermandant** (analog zu GEOS)
,technischer Mandant', führt z.B. allgemein gültige SVZs
- **Servicemandant** (analog zu GEOS)
kann zu GEOS unterschiedliche Depotmandanten servicieren,
z.B. Durchführung von Auswertungsplänen
- **Vorlagenmandant** (neu)
parametrisiert c:Conform-Vorlagen für mehrere Depotmandanten,
z.B. für Auswertungsregeln
- Ein Servicemandant kann mehrere Vorlagenmandanten zur Servicierung von Depotmandanten mit unterschiedlichen Anforderungen nutzen