

美国存管信托和结算公司（DTCC）提出在衍生品交易 报告中采用关键数据要素（CDE）实现 全球数据一致性

2021年3月16日，全球金融市场情报网站 mondovisione 发表文章《DTCC 提出在衍生品交易报告中实现全球数据一致性的方法》¹，主要介绍了 DTCC 建议采用 CDE 实现衍生品交易报告数据一致性的三个步骤。文章主要内容如下：

为进一步实现衍生品交易报告中数据一致性要求，提高交易透明度并监控系统风险，完成 20 国集团（G20）在匹兹堡 2009 年峰会上制定的目标，DTCC 发布了一篇题为“路线修正：在衍生品交易报告中寻找全球数据一致的新途径”的文章，对在场外衍生品市场实现全球数据一致性提出相关途径建议。

一、交易报告标准化面临的挑战

由于不同司法管辖区对场外衍生品交易报告的要求不一致，可能会影响场外衍生品交易数据的全球汇总和分析。一些监管机构正在着手采用支付与市场基础设施委员会（CPMI）和国际证监会组织理事会协调工作组确定的衍生品交易报告 CDE，旨在促进对实现数据汇总和系统风险透明度至关重要的数据的统一。然而，不同司法管辖区对 CDE 和其他报告标准使用不一，阻碍了 G20 风险缓解目标的实现，并给市场参与者带来诸多负担。

¹ 文章详见：

<https://mondovisione.com/media-and-resources/news/dtcc-proposes-way-forward-to-achieving-global-data-harmonization-in-derivatives/>

二、未来的新途径

DTCC 概述了改善交易报告数据一致性的三个步骤:

一是行业、监管机构和其他主要关键利益相关方必须共同努力,消除在采用 CDE 贸易报告要求方面的跨司法管辖区差异。这就需要 将 110 份 CDE 清单缩减为最重要的要素,实现跨司法管辖区进行汇总。

二是在 ISO 20022 衍生品工作组的帮助下,必须完成场外衍生品的 ISO 20022 CDE 报文方案,制定明确的完成时间表,并普遍采用单一 ISO 20022 报文作为向交易存储库报告的通用数据标准和格式。

三是需要向全球法人识别编码监督管理委员会 (LEI ROC) 提供足够的资源,以使其能够成功地成为金融稳定理事会 (FSB) 于 2020 年 10 月 1 日指定的关键数据要素 (CDE)、唯一产品识别码 (UPI) 和唯一交易识别码 (UTI) 的国际治理机构。

原文链接:

<https://mondovisione.com/media-and-resources/news/dtcc-proposes-way-forward-to-achieving-global-data-harmonization-in-derivatives/>