
Operational Notice

12 aprile 2019
ON_24/2019

T2S Release 3.0 – CR-520

All'attenzione di:

ICP/DCP

Argomento:

T2S Release 3.0 – CR-520

Gentile Cliente,

come preannunciato in sede di Post Trade Participants Committee (PT PC -) & T2S Change Management del 14 marzo 2019, riportiamo la lista degli eventi societari programmati per consentire la verifica delle implementazioni introdotte dalla CR-520 della release 3.0 di T2S

Piano delle prove

Attraverso la CR-520 si identificano le operazioni di CAOF (Market Claim e Trasformation) nei messaggi di risposta alle istruzioni inviate a T2S con il messaggio SWIFT sese.023 e si introducono alcuni campi nel messaggio di cancellazione sese.020 riferito all'operazione di Transformation.

Operational Notice

12 aprile 2019

ON_24/2019

In dettaglio le modifiche introdotte:

1. Per le istruzioni generate a fronte di CAOF, verrà inserito nel relativo messaggio sese.023, nel link type = INFO, la T2S reference dell'istruzione sottostante (underlying SI); la sequenza del linkage verrà riportata nei messaggi sese.024 e sese.025. Nei messaggi sese.024 la sequenza del linkage verrà riportato soltanto nel primo sese.024 di acceptance e non nei successivi stati di riscontro e/o cancellazione.
2. Nell'istruzione di cancellazione (messaggio sese.020), automaticamente predisposta da parte di Monte Titoli, di una operazione di Trasformation, viene introdotta la reason code CANT, per indicare che si tratta di cancellazione di una Trasformation e il Corporate Action Event Identifier.

I partecipanti ai test esterni sono tenuti a:

- provvedere, a fronte degli eventi societari di cui al paragrafo A), che si precisa non essere oggetto di test ma sono stati creati solo per il collaudo delle CAOF, a creare le condizioni necessarie affinché vengano generate le istruzioni di Market Claim e Trasformation
- verificare che:
 - le informazioni relative alle modifiche di cui al punto 1) siano presenti nell'informativa G56 (RNI/A2A) per i clienti ICP e nella messaggistica SWIFT 15022 - messaggi sese.024 e sese.025 per i DCP
 - le informazioni relative alle modifiche di cui al punto 2) siano presenti nell'informativa push di X-TRM per i clienti ICP e nella messaggistica SWIFT 15022 - messaggio sese.024 per i DCP

Operational Notice

12 aprile 2019

ON_24/2019

A) Lista degli eventi societari:

1° settimana 15-19 aprile 2019

CAEV	EVENT TYPE	CA ISIN		CA ISIN type	Announcement	Ex date	Stacco diritto	Record date	Payment date	Instruction deadline date	Option Category	Currency	Outturn ISIN	Rate/Ratio
INTR	MAND	IT0003546154	GRUMOLO ABB.2023TV	Bond	3/29/2019	NA		4/15/2019	4/16/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1623/19
PCAL	MAND	IT0003546154	GRUMOLO ABB.2023TV	Bond	3/29/2019	NA		4/15/2019	4/16/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1297/19
CONV	MAND	IT0005022683	INTESA SP 14/21 TV	Bond	3/29/2019			4/15/2019	4/16/2019	NA		EUR	IT0000072618	Vedi disp.ne n° 1614/19

2° settimana 22-26 aprile 2019

CAEV	EVENT TYPE	CA ISIN		CA ISIN type	Announcement	Ex date	Stacco diritto	Record date	Payment date	Instruction deadline date	Option Category	Currency	Outturn ISIN	Rate/Ratio
INTR	MAND	IT0003656854	MONTEBELLUNA 19 TV	Bond	3/29/2019	NA		4/22/2019	4/23/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1624/19
REDM	MAND	IT0003656854	MONTEBELLUNA 19 TV	Bond	3/29/2019	NA		4/22/2019	4/23/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1374/19
RHDI	MAND	IT0004093263	ASCOPIAVE ORD.	AZ.	3/29/2019		4/18/2019	4/17/2019	4/23/2019	4/23/2019		EUR	IT0004093263	Vedi disp.ne n° 1615/19
EXRI	VOLU	IT0000ASCOP3	DIRITTO ASCOPIAVE ORD.	Diritto	3/29/2019		4/18/2019	4/17/2019	4/23/2019	4/23/2019		EUR	IT0004093263	Vedi disp.ne n° 1616/19

Operational Notice

12 aprile 2019

ON_24/2019

3° settimana 6-10 maggio 2019

CAEV	EVENT TYPE	CA ISIN		CA ISIN type	Announcement	Ex date	Stacco diritto	Record date	Payment date	Instruction deadline date	Option Category	Currency	Outturn ISIN	Rate/Ratio
INTR	MAND	IT0005014441	B.DESIO 14/19 TF	Bond	5/3/2019	NA		5/6/2019	5/7/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1733
REDM	MAND	IT0005014441	B.DESIO 14/19 TF	Bond	5/3/2019	NA		5/6/2019	5/7/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1732

4° settimana 13-17 maggio 2019

CAEV	EVENT TYPE	CA ISIN		CA ISIN type	Announcement	Ex date	Stacco diritto	Record date	Payment date	Instruction deadline date	Option Category	Currency	Outturn ISIN	Rate/Ratio
INTR	MAND	IT0003034920	CENTROB 00/20 4%	Bond	5/3/2019	NA		5/14/2019	5/15/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1832
PCAL	MAND	IT0003034920	CENTROB 00/20 4%	Bond	5/3/2019	NA		5/14/2019	5/15/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° 1831
CONV	MAND	IT0005022725	INTESA SP 14/21 TV	Bond	5/3/2019			5/16/2019	5/17/2019	NA		EUR	IT0000072618	Vedi disp.ne n° 1886

Operational Notice

12 aprile 2019

ON_24/2019

5° settimana 20-24 maggio 2019

CAEV	EVENT TYPE	CA ISIN		CA ISIN type	Announcement	Ex date	Stacco diritto	Record date	Payment date	Instruction deadline date	Option Category	Currency	Outturn ISIN	Rate/Ratio
INTR	MAND	IT0004496938	BANCA SELLA 2009/2019 TF	Bond	5/3/2019	NA		5/20/2019	5/21/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° (non ancora creata)
REDM	MAND	IT0004496938	BANCA SELLA 2009/2019 TF	Bond	5/3/2019	NA		5/20/2019	5/21/2019	NA	CASH	EUR	NA	Vedi disp.ne n° (non ancora creata)
RHDI	MAND	IT0001384590	AEFFE ORD.	AZ.	5/3/2019		5/22/2019	5/21/2019				EUR		Vedi disp.ne n° 1887
EXRI	VOLU	IT0000AEFFE8	DIRITTO AEFFE ORD.	Diritto	5/3/2019				5/24/2019			EUR	IT0001384590	Vedi disp.ne n° 1888

Documentazione rilevante

Come già comunicato con la ON n. 73 del 29 novembre 2018, la documentazione tecnica Standard per Utenti X-TRM modalità RNI e A2A e gli adeguamenti alla messaggistica SWIFT, che delineano la struttura tecnica dei messaggi e le informazioni per la gestione degli stessi modificati in base a quanto previsto dalla R3.0 di T2S, sono disponibili nella sezione documentale di MT-X nella cartella: “Documentazione / Documentazione Tecnica / Tracciati utente – In lavorazione” e nella sezione dedicata a MonteTitoli di Swift MyStandards raggiungibile tramite il link:

https://www2.swift.com/mystandards/#/group/Monte_Titoli!usage_guidelines

Operational Notice

12 aprile 2019

ON_24/2019

Per ogni necessità di supporto durante la fase di test si prega di fare riferimento al seguente indirizzo:

Settlement

Email: mt-test-sett@lseg.com