
Operational Notice

19 dicembre 2019

ON_64/2019

T2S Release 4.0 – CR671 non-binding XSDs delivery - integrazione

All'attenzione di:

Argomento:

DCPs

T2S Release 4.0 – CR671 non-binding XSDs delivery - integrazione

Gentile Cliente,

con la prossima release 4.0 di T2S verrà implementata, , la change request 671, il cui scopo è consentire l'archiviazione e la comunicazione, in alcuni messaggi inviati da T2S, dell'indicatore relativo al Final Beneficiary, presente nelle istruzioni di regolamento in T2S, in caso di trasferimento di conto di un portafoglio che comporta un cambio effettivo di proprietà.

Il contesto a cui la CR-671 fa riferimento è quello contenuto nel regolamento MiFIR, articolo 26, i suoi rispettivi RTS e le linee guida, secondo i quali, in caso di trasferimenti di conto di un portafoglio, è necessario fornire informazioni se il trasferimento del conto contiene un cambio di proprietà effettiva, segnalabile entro l'ultimo giorno lavorativo. Nell'eventualità che il trasferimento sia senza cambio di proprietà effettiva, questa non sarà segnalabile

Attualmente, in T2S, è già possibile indicare se un determinato trasferimento comporterà un cambiamento di proprietà effettiva tramite il flag facoltativo "Beneficial Ownership", nella sequenza "Settlement Parameters" del messaggio "sese.023". Questo flag contiene un indicatore (che può assumere i valori "Y/N"), che informa se il trasferimento comporta o meno un cambio di proprietà.

Si precisa che la valorizzazione dell'indicatore di cui sopra è facoltativa in quanto, per la gestione del portfolio transfer, viene attualmente adottata dal sistema la Market Practice a suo tempo condivisa.

Queste informazioni sono attualmente classificate come "informazioni aggiuntive", e quindi non vengono né archiviate in T2S né fornite nei messaggi. Ne consegue che la controparte di una istruzione di regolamento non può essere informata tramite questo indicatore se un determinato trasferimento comporta o meno un cambio di proprietà. La CR-671 prevede che, queste informazioni siano archiviate in T2S e riportate nei seguenti messaggi in uscita da T2S, quando il flag è impostato nel messaggio "sese.023",:

- Sese.028 Securities Settlement Transaction Allegements
- Sese.024 Securities Settlement Transaction Status Advice
- Sese.025 Securities Settlement Transaction Confirmation

Operational Notice

19 dicembre 2019

ON_64/2019

- Semt.017 Securities Transaction Posting Report
- Semt.019 Securities Settlement Transaction Allegement Report
- Semt.027 Securities Settlement Transaction Query Response

Per recepire quanto sopra descritto, pubblichiamo la documentazione denominata “non-binding XSD schemas for Release 4.0”, ancorché non definitiva, dei dizionari dei messaggi della CR-671, pubblicati dalla Banca Centrale Europea in data 13 dicembre 2019, sia nella versione “non formattata” (plain) che arricchita (enriched).

Si ricorda che la documentazione definitiva denominata “binding XSD” è previsto sia pubblicata il 28 gennaio 2020, prima del rilascio della R 4.0 in ambiente EAC che avverrà il 7 febbraio 2020.

Documentazione rilevante

I dizionari dei messaggi di cui al pacchetto CR-0671 non-binding XSDs delivery sono pubblicati nella sezione documentale di MT-X, nel percorso HOME > Docs > T2S - Release Management > T2S releases - Incidents & Problems > T2S Release 4.0

Per ogni necessità di supporto si prega di fare riferimento al seguente indirizzo:

mt-t2s-test@lseg.com