
Market Notice

21 Agosto 2015

T2S – External Settlement– indicazioni operative

Gentile Cliente,

come anticipato bilateralmente nel corso del Community Test ai soggetti interessati, desideriamo riepilogare le modalità operative transitorie da adottare per la gestione delle operazioni di External Settlement nel primo periodo d'esercizio di T2S, come conseguenza del non corretto funzionamento della piattaforma segnalato al T2S Operator e identificato come problema il 3 agosto 2015, con il riferimento "PBI000000157080".

L'anomalia impatta le seguenti fattispecie operative:

1. Istruzioni inserite dai partecipanti in mancanza di capienza titoli sul SAC: MT recepisce correttamente l'operazione e la inoltra a T2S per il regolamento. La piattaforma conferma correttamente l'acquisizione della transazione tramite messaggio sese.024, con reason code "LACK of securities" ma, al costituirsi della disponibilità titoli, non prende in considerazione queste transazioni pending, impedendone di fatto il regolamento.
2. Istruzioni con valuta di regolamento differita: MT recepisce correttamente l'operazione e la inoltra a T2S per il regolamento. La piattaforma conferma correttamente l'acquisizione della transazione tramite messaggio sese.024 ma, alla ISD, non invia il sese.024 di reporting con l'informazione "COSD active". Come conseguenza, l'operazione rimane pending senza produrre i relativi messaggi SWIFT di notifica per i CSDs esterni.



London
Stock Exchange Group

Market Notice

3 July 2015

T2S – External Settlement– indicazioni operative

Per ovviare al problema, sono possibili i seguenti workaround amministrativi, da attivare a cura dei partecipanti interessati:

- a) Operazioni non regolate a seguito di mancata capienza sul SAC: i partecipanti devono cancellare le transazioni pending e istruirle nuovamente, avendo cura di accertare la disponibilità in conto;
- b) Operazioni con scadenza differita: i partecipanti devono cancellare le transazioni pending e istruire a ISD.

Si precisa che le modalità operative sopra descritte saranno applicate a partire dal prossimo 31 agosto 2015, fino al completamento, con esito positivo, dei test (interni e di Community) delle sistemazioni applicative il cui rilascio in produzione è attualmente pianificato dal T2S Operator per il prossimo 30 Gennaio 2016.

Per qualsiasi necessità di chiarimento o supporto operativo è possibile contattare:

External Settlement

e-mail: helpdesk.internationalsettlement@lseg.com;

tel. +39 02 33635390.

Cordiali saluti.