



Protokoll

Teilnehmer Fabio Colombo (Vorsitz), SIX
Andreas Kolb, LGT
Sergio De-Jesu, UBS
Davide Catania, UBS
Maureen Wiebe, SNB
Philipp auf der Maur, SIX
Urs Frey, BNP
Olga Leis, Swisscom
Sandy Kroll, SIX
André Dirlewanger, Sarasin
Manuel Alonso, SIX
Désirée Leimer, Vontobel
Rene Bertschi, SNB
Thomas Amstad, SIX
Myrvete Deskaj, SIX
Edi Dahinden, SIX
Weiwei Wang, SIX
Michaela Ashiwaju-Dema, Baumann
Marc Richard, CS
Thomas Roth, Rothschild

SIX Group AG
Pfungstweidstrasse 110
CH-8005 Zürich

Postanschrift:
Postfach
CH-8021 Zürich

T +41 58 399 2111
www.six-group.com

Kontaktperson:
Fabio Colombo
T +41 58 399 6567
fabio.colombo@six-group.com

Entschuldigt Maurizio La Rosa, Avaloq Sourcing
Christian Taragos, Safra Sarasin
Patrick Kegele, Safra Sarasin
Daniel Lehmann, UBS
Reto Caviezel, ZKB
Michael Hajagos, UBS
Marc Wüst, SIX
Corinna Bader, SIX
Sarah Baumann, Vontobel
Pascal Baumann, CS
Maike Bechtel, Citibank
Niculin Rauch, Vontobel
Gabriele Pizi
Benjamin Berger, Rothschild

Kopie an An die Entschuldigten
Datum 03.09.2021
Ort Telefonkonferenz
Dauer 14:00 – 16:00
Klassifikation öffentlich
Referenz
Dateiname Protokoll 17 (03.09.2021)
Betreff Fachgremium Settlement



Protokoll

Agenda

1. Begrüssung / Einleitung
2. Informationen
3. Pendenzen
4. Schwerpunkt T2S-Harmonisierung
5. Varia
6. Folge Meetings

	Verantwortlich	Datum
1. Begrüssung / Einleitung		
- Begrüssung (TELKO) der Teilnehmer durch Fabio Colombo	FC	
2. Informationen		
- Die 17. Sitzung fand am 03.09.2021 aufgrund der aktuellen COVID-19-Situation als Telefonkonferenz statt.	FC	
- Genehmigung des letzten Protokoll	FC	
- Thomas Amstad hat den Teilnehmern den Chatbot «Gianna» vorgestellt	TA	

3. Pendenzen

FAMT/UNIT Problematik

FC

14.03.2018

Andreas Kolb (LGT) hat das Problem nochmals für den BFI-Vertreter Manuel Alonso erläutert. FAMT kann überall instruiert werden ausser bei der SIX. BFI ist das einzige Institut, das sich nach dem Termsheet richtet und UNITS anstelle von FAMT möchte. Die Problematik betrifft hauptsächlich US-BONDS.

Die BFI haltet sich aus rechtlichen Gründen stets auf das Termsheet. Gemäss BFI, muss das Problem jedoch zwischen der SIS und BFI gelöst werden können. Denn die BFI stellt verschiedene Datenfeeds zur Verfügung (Repository-Feeds vs. BASIC-Datafeed).

Fabio nimmt die Thematik mit Thomas Eggenschwiler (Masterfile-SIS) und der BFI auf.

Ordinario vs. Segregation (Position Type)

FC

14.03.2018

Die Banken werden zukünftig via Frontline über bevorstehende Segregierungen informiert. Mehrere grössere Segregationen wurden aufgeschoben und werden den Teilnehmer im Monat September 2021 via Frontline Bestandes Trennung mitgeteilt. Nachdem der erste Frontline verschickt wurde, wird das Thema von der Agenda genommen.

Die FG-Teilnehmer wurden nach Ihren bevorzugten Emailadressen via Email gefragt.

End of Day & End of Month 22:00 Uhr SECOM Öffnungszeit-Verlängerung

GP

18.06.2021

Infoschreiben ist an die Teilnehmer rausgegangen. Die Teilnehmer sind aufgefordert Ihr Feedback bis zum 15. Oktober 2021 zu geben, ob die SIS mit der Umsetzung weiterfahren kann oder nicht.

CSDR / Settlement Disziplin

18.03.2018

Ausser Gerüchte gab es keine offiziellen Updates zum Thema CSDR.

CLAIM-Problematik

Die BNP, Sarasin, Rothschild und die CS wären an einem CLAIM-Report interessiert. Der Report soll aufzeigen, wenn ein Underlying von einem aktivem CLAIM gelöscht oder rejected wird.

Fabio überprüft die Umsetzung eines solchen Report mit der C/A-Abteilung.

FC

20.03.2019

Eröffnung von CH-ISINs in Clearstream

Aktuell sind Beispiele bei der CBL in Prüfung.

SK

19.03.2021

Spanien Put-Through

Das Thema "Beendigung des Put-Through-Services" wird vom Publication MarketGuide Team nicht mehr weiterverfolgt, da der Markt Spanien im Juli die OTC purchases und OTC sales Fees abgeschafft hatte und deshalb davon auszugehen ist, dass der Put-Through in Zukunft immer weniger bis gar nicht mehr genutzt wird.

Der Put-Through Service wird jedoch unter anderem separat in einem internen Projekt geprüft.

Das Traktandum wird von der Agenda genommen.

CB

19.03.2021

CBF account 7215 matchpflichtig

Weil die SIX-Teilnehmer keine Dumpings mehr auf das CBF account 7215 erhalten möchten, soll das account neu matchpflichtig werden. Seitens SIX wurde ein Change Request initiiert.

Feedback seitens CBF weiter ausstehend, ob via Change Request eine Änderung möglich wäre.

SK

19.03.2021

Settlement Deadlines innerhalb SECOM

PA

18.06.2021

Alle Informationen sind in der PPT «Settlement-Deadlines in SECOM_Fachgremium Settlement» auffindbar.

Keine Einwände seitens den Teilnehmern, somit fahren wir SIX-intern mit der Analyse weiter.

DTC-Mismatches (new)

SK

03.09.2021

Da wir immer wieder Mismatches haben, wurde via Depotstelle Citi USA geklärt, dass es eine Möglichkeit gibt, dass ein zusätzliches Feld in DTC von den CPs belegt werden kann, so dass eine Art matching stattfindet und bei Angabe dann das Allegement nur mit dem angegebenen BP settlen kann. Dieser Service müsste allerdings systemseitig via Citi initiiert und implementiert werden.

Besteht ein allgemeines Interesse? Soll dies mit Citi weiter verfolgt werden?

Sandy überprüft den Punkt mit der LGT und der Bank Rothschild

4. Schwerpunkt T2S-Harmonisierung

PA

18.06.2021

Partials/Split von OTC Instruktionen

Alle Informationen sind in der PPT «Partial Settlement in Swiss Market_Fachgremium Settlement» auffindbar.

Keine Einwände seitens den Teilnehmern. SIX wird am nächsten FG-Settlement Call berichten wie eine mögliche Umsetzung aussehen könnte. Der Partial Release wird dabei auch berücksichtigt.

BUYR/SELL als Matching Kriterium

FC / PA

Crossmatchings verhindern
Optional einfügen? Analyse SIX noch ausstehend

Wird bis zum nächsten FG-Settlement Call SIX-intern analysiert.



5. Varia

6. Folge Meetings

- 03.12.2021 – Einladung folgt