



Protokoll

Teilnehmer Fabio Colombo (Vorsitz), SIX
Andreas Kolb, LGT
Davide Catania, UBS
Olga Leis, Swisscom
Sandy Kroll, SIX
André Dirlewanger, Sarasin
Désirée Leimer, Vontobel
Michaela Ashiwaju-Dema, Baumann
Thomas Roth, Rothschild,
Thomas Eggenschwiler, SIX
Andreas Trottmann
Ngoc Ly, Frankfurter BG
Silvan Burgermeister, Frankfurter BG
Christian Taragos, Safra Sarasin
Reto Caviezel, ZKB
Pascal Baumann, CS
Maïke Bechtel, Citibank

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
Patrick Kegele, Safra Sarasin
Daniel Lehmann, UBS
Michael Hajagos, UBS
Marc Wüst, SIX
Niculin Rauch, Vontobel
Benjamin Berger, Rothschild
Sergio De-Jesu, UBS
Maureen Wiebe, SNB
Philipp auf der Maur, SIX
Urs Frey, BNP
Rene Bertschi, SNB
Marc Richard, CS

Kopie an An die Entschuldigten
Datum 08.12.2021
Ort Telefonkonferenz
Dauer 11:00 – 12:00
Klassifikation öffentlich
Referenz
Dateiname Protokoll 18 (08.12.2021)
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 18. Sitzung fand am 08.12.2021 aufgrund der aktuellen COVID-19-Situation als Telefonkonferenz statt.	FC	
- Genehmigung des letzten Protokoll	FC	

3. Pendenzen

FAMT/UNIT Problematik

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 an das Termsheet.

Thomas Eggenschwiler gibt Auskunft, eine Umstellung kann nicht erfolgen, weil sonst der Datafeed unterbrochen wird. Die Thematik ist schon über 10 Jahre bekannt.

Die Problem wird aktuell nicht beim BAWV platziert, Andreas Kolb und Thomas Eggenschwiler sind noch im Austausch.

FC

14.03.2018

Ordinario vs. Segregation (Position Type)

Die Banken werden zukünftig via Frontline über bevorstehende Segregierungen informiert. Damit alle SIX-Teilnehmer informiert werden, muss das Frontline via den offiziellen Publikationsprozess gehen. Das Frontline wird auf Deutsch und Englisch versandt, anschliessend ist das Frontline auf der Private Site unter dem Punkt «Bestandestrennung nach Märkten» auffindbar. Das Erste Frontline wird in Kürze versendet.

FC

14.03.2018

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

Kein SIX-Teilnehmer hat sein Veto eingereicht. SIX klärt gerade mit der IT wann der nächstmögliche Umsetzungszeitpunkt ist. Die Teilnehmer werden rechtzeitig via Frontline/Update informiert.

GP

18.06.2021

CSDR / Settlement Disziplin

Das Thema wird von der Agenda genommen. Die meisten Teilnehmer sind in der SIX CSDR-Arbeitsgruppe vertreten. Ansonsten bitte Kontakt aufnehmen mit csdr-securities-exchanges@six-group.com

FC

18.03.2018

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.

Kein Update per 08.12.2021

FC

20.03.2019

Eröffnung von CH-ISINs in Clearstream

SIX ist mit CBL,UBS in Kontakt – aktuell nur Möglichkeit, dass Teilnehmer uns proaktiv ISINs melden und wir proaktiv auf CBL und UBS zugehen, um Verzögerungen zu vermeiden – dieser manuelle Workaround kreiert bei SIX und den Teilnehmern grosse Mehraufwände, die in der Zukunft wieder vermieden werden sollen.

SK

19.03.2021

CBF account 7215 matchpflichtig

Keine Priorisierung auf Seite CBF für den November Release und auch den June Release in 2022. Nichtsdestotrotz startet CBF im Laufe des nächsten Jahres eine grundsätzliche Analyse hinsichtlich ihrer Links in die Schweiz und im Rahmen dessen wird auch dieses Thema angeschaut. – Thema wird somit aktuell parkiert und auf 2022 verschoben.

SK

19.03.2021

Settlement Deadlines innerhalb SECOM

Der Change Request wurde erstellt und muss noch dem MC vorgestellt werden.

PA

18.06.2021

DTC-Mismatches (new)

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.

Citi US ist am Prüfen wegen den Kosten – laut Network kann sich das Feedback noch hinziehen.

SK

03.09.2021

4. Schwerpunkt T2S-Harmonisierung

Partials/Split von OTC Instruktionen

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.

Kein Update per 08.12.2021

PA

18.06.2021

BUYR/SELL als Matching Kriterium

Crossmatchings verhindern
Optional einfügen? Analyse SIX noch ausstehend

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

FC / PA

5. Varia

6. Folge Meetings

- Die Daten für das Jahr 2022 folgen