

GRUPO NACIONAL DE USUARIOS - ESPAÑA Target-2 Securities

REUNIÓN DEL GNU de T2S

Cambios en los requerimientos de usuario

Madrid, 26 de septiembre de 2011

Cambios en los requerimientos de usuario

0290_URD

Agrupación obligatoria de mensajes en ficheros durante el periodo nocturno.

- Se equipara el modo de comunicación al los usuarios con el proceso de liquidación nocturna, que se realiza en secuencias.
- Reduce el tráfico de mensajes y el coste asociado.
- Solo para las notificaciones relativas al estado de liquidación.
- El resto de las notificaciones (aceptación, case, ...) se envían individualmente.

Cambios en los requerimientos de usuario

0291_SYS

Mejora de la información sobre las anotaciones de efectivo y nuevo atributo en el servicio de suscripción de mensajes.

- Para las instrucciones DVP, además de la confirmación de la liquidación de valores se envía una notificación de adeudo/abono sobre la cuenta de efectivo.
- Sujeto a suscripción.
- Además, el tipo de instrucción se añade como parámetro para la suscripción de este mensaje.
- Requiere la modificación de los mensajes ISO de notificación de adeudo/abono

Cambios en los requerimientos de usuario

0293_SYS

Inclusión de la marca de “already matched” como criterio para la suscripción de mensajes.

- Cuando se envía una instrucción casada a T2S, se separan en dos instrucciones. T2S envía mensajes de confirmación y de cambio de estado para cada una de estas dos instrucciones.
- Con este CR los usuarios podrán elegir recibir sólo uno de estos dos mensajes de confirmación o cambio de estado.

Cambios en los requerimientos de usuario

0282_URD

Introducción de la cuenta de valores como un campo de case opcional.

- Como resultado de las conclusiones de la TF on Smooth Cross-CSD settlement.
- Campo de case opcional: se convierte en obligatorio si ambas partes lo informan. Puede casar en blanco.

Cambios en los requerimientos de usuario

0288_SYS

Envío de “technical acknowledgements” a nivel de Infraestructura

- El propósito es disminuir el número de mensajes que se envían desde la aplicación.

Cambios en los requerimientos de usuario

277_URD Creación intradía de Securities CSD links

0294_SYS Mantenimiento en A2A de “Security CSD links”

- El principal argumento es poder permitir, intradía, la emisión de valores y su liquidación transfronteriza. Principalmente para los instrumentos con más corto plazo del mercado monetario.
- Requiere la creación de varios mensajes ISO.

Cambios en los requerimientos de usuario

0279_URD

Eliminación del “Allegement removal” y el “Allegement cancellation” de las instrucciones de cancelación.

- Se suprime la funcionalidad para cancelar una petición de cancelación. No se ha encontrado un caso de negocio relevante.
- El “allegement removal” de una instrucción de cancelación se enviaba cuando la instrucción de liquidación, sobre la que actuaba la cancelación, se cancelaba finalmente tras recibir la petición de cancelación de la contrapartida.
- El “allegement cancellation” de una instrucción de cancelación estaba previsto cuando la contrapartida cancelaba la petición de cancelación sobre instrucción casada

Cambios en los requerimientos de usuario

285_URD

Nuevo atributo para diferenciar las instrucciones de “account allocation”

- Se añade el campo “End Investor Account Flag” a las cuentas de valores, para indicar que pertenece a un inversor final en un mercado de tenencia directa.
- Requiere la modificación de mensajes.

Cambios en los requerimientos de usuario

285_URD

Deshabilitar la liquidación parcial de las instrucciones de bloqueo

- Para facilitar las prácticas de mercado de eventos corporativos que requieren la realización íntegra del bloqueo.
- Si no hay valores/efectivo disponible la instrucción se reciclará para posteriores intentos.
- Tampoco se permitirá la liquidación parcial de las instrucciones de desbloqueo.

Cambios en los requerimientos de usuario

299_URD

Eliminación de inconsistencias en el capítulo 13 referidas a la comunicación del estado “unmatched”.

- Para indicar claramente que después del primer intento de case NO se comunica el estado “unmatched”.
- No tiene impacto en resto de la documentación funcional.