

# Cash Collateral

(De)Mobilisierung U2A & A2A - Testgrundsätze und Ausfüllhilfen für ECMS

Testfälle: ECMS\_TC\_CPTY\_8 und ECMS\_TC\_CPTY\_9

Version	Datum	Beschreibung der Änderungen
1.0	10.08.2023	Erstfassung
1.1	23.10.2023	Aktualisierung der Testgrundsätze hinsichtlich Testablauf und Hintergrundinformationen zur Nutzung von Cash Collateral
1.2	27.11.2023	Aktualisierung der Cut-Off-Zeiten (jetzt 14.15 Uhr für Mobilisierungen), Verdeutlichung der Hinweise für A2A-Nachrichten

1. Testgrundsätze
2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen
  - 2.1 U2A - Instruktionserteilung
  - 2.2 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.010
  - 2.3 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.009
  - 2.4 U2A/A2A – Monitoring

# 1. Testgrundsätze

Testangebot und Voraussetzungen

## Testangebot:

- **Manuelle** (De-)Mobilisierung durch Geschäftspartner via U2A oder A2A
- **Automatische** Mobilisierung (14:15 Uhr) und Demobilisierung (19:25 Uhr) durch ECMS.

## Benötigte Rollen:

- Das 4-Augen-Prinzip ist aktuell **nicht verfügbar**. Die Eingabe der Instruktion erfolgt daher im **2-Augen-Prinzip**. Bitte überprüfen Sie, ob Ihr User dementsprechend über die Rolle „Super Validator“ verfügt.
- Für U2A User: ECMS ENTITY - U2A CASH COLLATERAL EXECUTION - #61
- Für A2A User: ECMS ENTITY - A2A CASH COLLATERAL AND MAXIMUM CREDIT LINE EXECUTION

**CLM MCA:** Grundsätzlich muss ein bestehendes Main Cash Account in T2/CLM PreProd/UTEST mit Ihrem Sicherheitenpool verknüpft sein. Die Verknüpfung wurde durch die Bundesbank vorgenommen. Prüfungsmöglichkeit s. Folgeseite.

Bei End-to-End Tests (**CPT2c**) stellt die Bundesbank sicher, dass auf den MCAs auf der CLM UTEST genügend Liquidität für die Einlieferung von Cash Collateral bereit steht.

# 1. Testgrundsätze

## Prüfung der Verknüpfung zwischen MCA und Pool:

Collateral and Credit >> Pool overview >> Pool overview >> Search >> Pool auswählen >> View

Pool Overview

Display : Counterparty Pool

List Pools Overview > View : Pool

**POOL GENERAL DETAILS**

Pool Identifier DEPOOL000010040001	Pool Reference EUCODES0090-5000099090	Counterparty DES0090	RTGS ACCESS No
<b>CLM MCA ZYRMDEFFXXX</b>	CLM CB Account MARKDEFFCMS	Contingency Cash Account ----	CB Contingency Cash Account ----
Absolute Credit Limit	NCB MaCL 0	Counterparty Maximum Credit Line Value 0	

**LAST MODIFICATION DETAILS**

Update Date 19/10/2023 04:32:26:634	Modification Reason ValuationEvent	Last Movement Details DEPM23101957701001	Amount 0
Pool Variation Amount -271,961.75	MCL Online 0	CP Online 0	Last Pool Position ID DEPLP01023045001
Position Date 19/10/2023	Last Cash Collateral Interest Calcul Date	Last Cash Collateral Mobilization Date	

**POOL POSITIONS**

Bitte beachten Sie,...

...dass durch die Bundesbank versandte Informationsschreiben zur Testdurchführung. Für jeden Geschäftspartner werden individuelle Testzeiträume inklusive Uhrzeiten geschaffen.

...dass Tests anderer Funktionalitäten ggf. nicht möglich sind bzw. Einfluss auf die für den Test geschaffene Unterdeckung haben könnten.

## Ablauf der Cash Collateral Tests:

### A. Einlieferung

1. **Auslösen einer Unterdeckung im Sicherheitenpool** („Margin Call“) mittels Einbuchung einer Sperre (Credit Freezing) durch die Bundesbank.
2. **Manuelle Einlieferung** von Cash Collateral, max. in Höhe der Unterdeckung (centgenau), via U2A oder A2A durch den Geschäftspartner möglich.
3. **Falls notwendig: Automatisierte Einlieferung** von Cash Collateral durch ECMS (ca. 14:15 Uhr).
4. **Verzinsung** des eingelieferten Cash Collateral um 19:00 Uhr in Höhe des Zinssatzes der Einlagenfazilität.

## B. Auslieferung

1. **Ausbuchung der Sperre** am Folgetag durch die Bundesbank zur Gewährleistung eines freien Beleihungswertes im Sicherheitenpool.
2. **Manuelle Auslieferung** von Cash Collateral, max. in Höhe des freien Beleihungswertes, via U2A oder A2A durch den Geschäftspartner möglich.
3. **Falls notwendig: Automatisierte Auskehrung** von Cash Collateral durch ECMS um 19:25 Uhr.

Cash Collateral kann lediglich zur centgenauen Sicherheitenverstärkung im Falle eines Margin Calls genutzt werden. Die Schaffung eines freien Beleihungswertes mittels Cash Collateral bzw. die Nutzung von Cash Collateral zur Besicherung neuer Kreditpositionen ist nicht zulässig. (gem. AGB BBk Abschnitt V Nr. 3 Abs. 4 und Nr. 13a)



## **2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen Ausföhlhilfe und Monitoring**

## 2. Manuelle Mobilisierungsinstruktionen

### 2.1 U2A - Instruktionserteilung

Collateral and Credit >> Collateral >> Cash Collateral >> **Input Cash Collateral Instruction**

Input Cash Collateral Instruction

Counterparty Details

Pool ID

Instruction Details

Cash Collateral Instruction ID: PLMDE00000140896

Party's Instruction Reference

Instruction Type

Total Cash Collateral

Amount

Collateral Asset Id

Margin Call Value

Intended Settlement Date: 08/11/2023

**Pool ID:** Mit einem Klick auf die Lupe öffnet sich die Liste Ihrer Sicherheitenpools

**Cash Collateral Instruction ID:** wird automatisch vergeben

**Party's Instruction Reference:** individuell zu vergebende Referenz je Instruktion (max. 35 Zeichen)

**Instruction Type:** Wahl der Art der Cash Collateral Instruction mittels Drop Down (im Screen können sowohl **Mobilisierung als auch Demobilisierung** erfasst werden)

**Amount:** wird automatisch befüllt, manuelle Betragsänderung möglich (**max. bis zur Höhe des „Margin Call Values“**)

**Collateral Asset ID:** nur optional zu befüllen

Die restlichen, grau hinterlegten Felder werden von ECMS automatisch gesetzt.

## 2. Manuelle Demobilisierungsinstruktionen

### 2.1 U2A - Instruktionserteilung

Collateral and Credit >> Collateral >> Cash Collateral >> **Input Cash Collateral Instruction**

Instruction Details		
Cash Collateral Instruction ID	Party's Instruction Reference	Instruction Type
PLMDE00000145976		Demobilisation of cash collateral
Total Cash Collateral	Amount	Collateral Asset Id
1,639,230.58	1,639,230.58	
Margin Call Value	Intended Settlement Date	
	09/11/2023	

**Pool ID:** Mit einem Klick auf die Lupe öffnet sich die Liste Ihrer Sicherheitenpools

**Cash Collateral Instruction ID:** wird automatisch vergeben

**Party's Instruction Reference:** individuell zu vergebende Referenz je Instruktion (max. 35 Zeichen)

**Instruction Type:** Wahl der Art der Cash Collateral Instruction mittels Drop Down (im Screen können sowohl

**Mobilisierung als auch Demobilisierung** erfasst werden)

**Amount:** wird automatisch befüllt, manuelle Betragsänderung möglich (**max. bis zur Höhe des freien Beleihungswertes bzw. Cash Collateral Betrags im Pool**)

**Collateral Asset ID:** nur optional zu befüllen

Die restlichen, grau hinterlegten Felder werden von ECMS automatisch gesetzt.

## 2. Manuelle Mobilisierungsinstruktionen

### 2.2 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.010

Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!

#### Application Header:

```
<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
  <Fr>
    <FIId>
      <FinInstnId>
        <BICFI>INSTITUTS-BIC</BICFI>
        <ClrSysMmbId>
          <ClrSysId>
            <Prtry>ECMS</Prtry>
          </ClrSysId>
          <MmbId>A2A-USER-REFERENZ</MmbId>
        </ClrSysMmbId>
        <Othr>
          <Id>MARKDEFFXXX</Id>
        </Othr>
      </FinInstnId>
    </FIId>
  </Fr>
  <To>
    <FIId>
      <FinInstnId>
        <BICFI>TRGTXETTECM</BICFI>
        <Othr>
          <Id>MARKDEFFXXX</Id>
        </Othr>
      </FinInstnId>
    </FIId>
  </To>
  <BizMsgIdr>202303050002</BizMsgIdr>
  <MsgDefIdr>admi.005.001.01</MsgDefIdr>
  <CreDt>2023-05-03T06:41:24Z</CreDt>
</AppHdr>
```

Bitte prüfen Sie Ihren A2A User im Referenzdaten-Modul:

1. User-Referenz
2. Sind die notwendigen Rollen vergeben?
3. Ist die DN\* des Signatur-Zertifikats hinterlegt?

\*DN: Distinguished Name

<BizMsgIdr> muss einem individuellen, einmaligen Wert entsprechen

<MsgDefIdr> entspricht für Cash Collateral Mobilisierungen dem Wert „pacs.010.001.03“

# 2. Manuelle Mobilisierungsinstruktionen

## 2.2 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.010

Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!

```
<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">...</AppHdr>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:pacs.010.001.03">
  <FIDrctDbt>
    <GrpHdr>
      <MsgId>NONREF</MsgId>
      <CreDtTm>2023-06-29T10:29:25+02:00</CreDtTm>
      <NbOfTxs>1</NbOfTxs>
    </GrpHdr>
    <CdtInstr>
      <CdtId>CC20230629003</CdtId>
      <InstgAgnt>
        <FinInstnId>
          <BICFI>MARKDEFFCMS</BICFI>
        </FinInstnId>
      </InstgAgnt>
      <InstdAgnt>
        <FinInstnId>
          <BICFI>INSTITUTS-BIC DES CLM MCA</BICFI>
        </FinInstnId>
      </InstdAgnt>
      <Cdt>
        <FinInstnId>
          <BICFI>MARKDEFFXXX</BICFI>
        </FinInstnId>
      </Cdt>
      <DrctDbtTxInf>
        <PmtId>
          <InstrId>CC20230629003</InstrId>
          <EndToEndId>CC20230629003</EndToEndId>
          <UETR>f8efbf14-b9e0-4c73-8155-ea1f473d787d</UETR>
        </PmtId>
        <PmtTpInf>
          <LclInstrm>
            <Prtry>CCOL/INTERNAL POOL ID IHRES POOLS</Prtry>
          </LclInstrm>
        </PmtTpInf>
        <IntrBkSttlmAmt Ccy="EUR">1439189.14</IntrBkSttlmAmt>
        <IntrBkSttlmDt>2023-06-29</IntrBkSttlmDt>
        <Dbtr>
          <FinInstnId>
            <BICFI>INSTITUTS-BIC IN ECMS</BICFI>
          </FinInstnId>
        </Dbtr>
      </DrctDbtTxInf>
    </CdtInstr>
  </FIDrctDbt>
</Document>
```

Passen Sie die Pflichtfelder an.

Informationen zum Ausfüllen des Message-Bereichs für jeden ECMS-gängigen Nachrichtentyp finden Sie auch im veröffentlichten Catalogue of Messages.

[ECMS catalogue of messages and credit claim files \(europa.eu\)](https://ecms.europa.eu)

## 2. Manuelle Demobilisierungsinstruktionen

### 2.3 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.009

Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!

#### Application Header:

```
<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
  <Fr>
    <FIId>
      <FinInstnId>
        <BICFI>INSTITUTS-BIC</BICFI>
        <ClrSysMmbId>
          <ClrSysId>
            <Prtry>ECMS</Prtry>
          </ClrSysId>
          <MmbId>A2A-USER-REFERENZ</MmbId>
        </ClrSysMmbId>
        <Othr>
          <Id>MARKDEFFXXX</Id>
        </Othr>
      </FinInstnId>
    </FIId>
  </Fr>
  <To>
    <FIId>
      <FinInstnId>
        <BICFI>TRGTXTETECM</BICFI>
        <Othr>
          <Id>MARKDEFFXXX</Id>
        </Othr>
      </FinInstnId>
    </FIId>
  </To>
  <BizMsgIdr>202303050002</BizMsgIdr>
  <MsgDefIdr>admi.005.001.01</MsgDefIdr>
  <CreDt>2023-05-03T06:41:24Z</CreDt>
</AppHdr>
```

Bitte prüfen Sie Ihren A2A User im Referenzdaten-Modul:

1. User-Referenz
2. Sind die notwendigen Rollen vergeben?
3. Ist die DN\* des Signatur-Zertifikats hinterlegt?

\*DN: Distinguished Name

<BizMsgIdr> muss einem individuellen, einmaligen Wert entsprechen

<MsgDefIdr> entspricht für Cash Collateral Demobilisierungen dem Wert „pacs.009.001.08“

## 2. Manuelle Demobilisierungsinstruktionen

### 2.3 A2A – Instruktionserteilung mit pacs.009

Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:pacs.009.001.08">
  <FICdtTrf>
    <GrpHdr>
      <MsgId>NONREF</MsgId>
      <CreDtTm>2023-06-29T10:41:27+02:00</CreDtTm>
      <NbOfTxs>1</NbOfTxs>
      <SttlmInf>
        <SttlmMtd>CLRG</SttlmMtd>
        <ClrSys>
          <Cd>TGT</Cd>
        </ClrSys>
      </SttlmInf>
    </GrpHdr>
    <CdtTrfTxInf>
      <PmtId>
        <InstrId>CCDEM0820230629005</InstrId>
        <EndToEndId>CCDEM0820230629005</EndToEndId>
        <UETR>79b42e55-894e-4916-98ef-dc5f56b20ca5</UETR>
      </PmtId>
      <PmtTpInf>
        <LclInstrm>
          <Prtry>CCOL/INTERNAL POOL ID IHRES POOLS</Prtry>
        </LclInstrm>
      </PmtTpInf>
      <IntrBkSttlmAmt Ccy="EUR">500000</IntrBkSttlmAmt>
      <IntrBkSttlmDt>2023-06-29</IntrBkSttlmDt>
      <InstgAgnt>
        <FinInstnId>
          <BICFI>INSTITUTS-BIC DES CLM MCA</BICFI>
        </FinInstnId>
      </InstgAgnt>
      <InstdAgnt>
        <FinInstnId>
          <BICFI>MARKDEFFCMS</BICFI>
        </FinInstnId>
      </InstdAgnt>
      <Dbtr>
        <FinInstnId>
          <BICFI>MARKDEFFXXX</BICFI>
        </FinInstnId>
      </Dbtr>
      <Cdtr>
        <FinInstnId>
          <BICFI>INSTITUTS-BIC IN ECMS</BICFI>
        </FinInstnId>
      </Cdtr>
    </CdtTrfTxInf>
  </FICdtTrf>
</Document>
```

Passen Sie die Pflichtfelder an.

Informationen zum Ausfüllen des Message-Bereichs für jeden ECMS-gängigen Nachrichtentyp finden Sie auch im veröffentlichten Catalogue of Messages.

[ECMS catalogue of messages and credit claim files \(europa.eu\)](https://ecms.europa.eu)

## 2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen

### 2.4 U2A/A2A - Monitoring

Monitoring der erteilten Instruktionen:

Collateral and Credit >> Collateral >> Cash Collateral >> **Cash Collateral Display**

>> Klick auf Search Button (falls erforderlich davor Suchkriterien eingeben) >> die erteilte Instruktion auswählen und auf View Button klicken.

The screenshot shows the 'Cash Collateral Display' search interface. At the top, there is a title bar with a star icon and a close button. Below it, the main search area is titled 'Display Cash Collateral Instruction'. This area contains several search filters: 'Cash Collateral Instruction ID', 'Party's Instruction Reference', 'Intended Settlement Date', 'Counterparty', 'Pool ID', 'Instruction Status', 'Instruction Type', 'U2A', 'Update Date', and 'Creation Date'. Each filter has a dropdown menu and a search icon. A 'Reset' button is located on the left, and a 'Search' button is on the right. Below the search filters, there are two sections: 'Latest Searches' and 'Stored Searches'. The 'Latest Searches' section has a table with columns for 'Date' and 'Criteria'. The 'Stored Searches' section contains a message: 'You have no stored search. To start customizing, launch a search and use the "I favorite" button to start your first search.'



## 2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen

### 2.4 U2A/A2A - Monitoring

Monitoring der aufgelaufenen Zinsen (am Folgetag der Einlieferung):

Collateral and Credit >> Collateral >> Cash Collateral >> Cash Collateral Interest >> **Monitor Cash Collateral Accrued Interests**

>> Klick auf Search Button (falls erforderlich davor Suchkriterien eingeben) >> die erteilte Instruktion auswählen und auf View Button klicken.

Monitor Cash Collateral Accrued Interests

Cash Collateral Accrued Interest

Movement Reference \*\* Pool Identifier \*\* Calculation Date \*\*

Creation Date \*\* Update Date \*\*

Reset Search

Latest Searches

Date	Criteria
------	----------

Stored Searches

Date	Name
27/12/2021	Cash Collateral Interest

# 2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen

## 2.4 A2A - Monitoring

**Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!**

Monitoring der Cash Collateral Instruction Nachrichten (pacs. 010/pacs.009):

Collateral and Credit >> Notification >> Counterparties Notifications >> Cash Collateral Notifications >> **CCOL Instructions**

>> Klick auf Search Button (falls erforderlich davor Suchkriterien eingeben) >> die erteilte Instruktion auswählen und falls erwünscht mit einem Klick auf Download Button runterladen.

The screenshot shows the 'CCOL Instructions' search page. At the top, there is a search criteria section titled 'Search Criteria : Exposures Notification'. Below this, there are several input fields with dropdown menus for 'Message Id', 'Pool Id', 'Instructed Agent', 'Update Date', 'Instruction Id', 'Instructing Agent', 'Creditor', 'End-to-End Id', 'Debtor', and 'Settlement Date'. A 'Reset' button is located on the left, and 'Create' and 'Search' buttons are on the right. Below the search criteria, there are two sections: 'Latest Searches' and 'Stored Searches'. The 'Latest Searches' section has a table with columns 'Date' and 'Criteria'. The 'Stored Searches' section contains a message: 'You have no stored search. To start customizing, launch a search and use the "I favorite" button to start your first search.'

# 2. Manuelle (De-)Mobilisierungsinstruktionen

## 2.4 A2A - Monitoring

**Nur bei Nutzung von A2A-Nachrichten relevant!**

Monitoring der Cash Collateral Status Nachrichten (pacs. 002):

Collateral and Credit >> Notification >> Counterparties Notifications >> Cash Collateral Notifications >> **CCOL Instructions Status Notifications**

>> Klick auf Search Button (falls erforderlich davor Suchkriterien eingeben) >> die erteilte Instruktion auswählen und falls erwünscht mit einem Klick auf Download Button runterladen.

Cash Collateral Instruction Status Notifications

Search: CCOL Instruction Status notifications (pacs.002)

Cash Collateral Instruction ID \*\* ▾ Party's Instruction Reference \*\* ▾ Original Instruction Type \*\* ▾

Counterparty \*\* ▾ Notifications Status \*\* ▾ Update Date \*\* ▾

Creation Date \*\* ▾

Reset Create Search

Latest Searches

Date	Criteria
------	----------

Stored Searches

You have no stored search.  
To start customizing, launch a search and use the "Favorite" button to start your first search.