



# **TRIPARTY** U2A - Testgrundsätze und Ausfüllhilfen für ECMS



# AGENDA

#### Testgrundsätze

Testszenario / Voraussetzungen Testfälle

#### Triparty

ECMS Triparty Suchmasken Monitoring (ECMS Operator Sicht) ECMS Triparty Suchmasken Monitoring (Kundensicht)

#### Annex

Cut-off Zeiten



**Testgrundsätze** Testszenario und Voraussetzungen



Bitte berück Testangebot	<ul> <li>sichtigen Sie folgende Grundsätze für einen erfolgreichen Test</li> <li>Increase/Decrease of the triparty transaction</li> <li>Substitution of Assets</li> <li>Cancelation of triparty transaction instruction</li> <li>Unilateral Removal Request</li> <li>Closure of a Triparty Transaction</li> </ul>
Erforderliche Rechte / Rollen	Bitte stellen Sie sicher, dass Ihr User über die Rolle "Super Validator" oder "Validator" verfügt. Für U2A User: U2A TRIPARTY REFERENCE DATA READ ONLY - #57
<ul> <li>Bitte beachten Sie die aktuellen T conditions" werden alle zwei Woc</li> <li>Bitte beachten Sie, dass Kunden</li> </ul>	<mark>esteinschränkungen</mark> gemäß den "Testing conditions" der EZB. <u>ECMS - Professional use (europa.eu)</u> Die "Testing hen veröffentlicht. während des Triparty-Tests (geführter Test und kostenloser Test) andere ECMS-Funktionen NUR über die ECMS-

- GUI testen können (A2A-Kommunikation zwischen Kunden und ECMS ist während des Triparty-Tests nicht verfügbar). Wenn Kunden ihren Triparty-Test abgeschlossen haben und andere ECMS-Funktionen im A2A-Modus testen möchten, sollten sie die Bundesbank und Clearstream entsprechend informieren.
- Für die Ausführung von Testfall 05 warten Sie bitte auf die Freigabe durch die Bundesbank



#### Bitte berücksichtigen Sie folgende Grundsätze für einen erfolgreichen Test

Zyklus	s 2		Verpfl	ichtende Test-l	SINs		
Group	Dates	ISIN CA with event (TC 02)	ISIN with interest payment (TC 04)	ISIN for CR exclusion (TC06)	Free ISIN for testing	Free ISIN for testing	Free ISIN for testing
Α	26/08/2024 -	PTOTVMOE0000	DE0001468361 – 10	EU000A1G0DE2	DE0001345908 – 40	DE0001468361 -	XS1243251375 - 40
	30/08/024	- 10 MM	MM	- 10 MM	MM	40 MM	MM
в	02/09/2024 -	NL0011819040 –	AT0000A0VRQ6 –	DE0001143469 –	DE0001345908 – 40	DE0001468361 -	XS1243251375 - 40
	06/09/2024	10 MM	10 MM	10 MM	MM	40 MM	MM

# 1. Testgrundsätze - Testfälle (1/2)



Test Ca	ises						
Day	Test Description	Number	Test Steps	Client Instruction	ECMS Action	Client Instruction Status	Expected Test Results
			Client instructs an increase of the triparty transaction (via Swift or Xact)	PADJ (Swift) Change Principal (Xact)	-	NMAT (Swift) Unmatched (Xact)	
Day 1	Client instructs an increase of the trinarty transaction	TC 01	System automatically matches instruction	-	Simulated by CBL	TREA (Swift) Released (Xact)	Reporting shows full collateralization of transaction amount
	anparty dansaction		Transaction is fully collteralized	-	-	AOLF (Swift) Settled (Xact)	
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	
			System communicates Ineligibility Periods for Corporate Actions	-	-	-	Collateral report indicates that ISIN subject
Day 2	Corporate Action (guided)	TC 02	System generates a substitution and sends out Report on Flows to ECMS	-	-	-	to CA event is not used as collateral
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	
			Client instructs a decrease of the trinarty	PADI (Swift)		NMAT (Swift)	
			transaction (via Swift or Xact)	Change Principal (Xact)	-	Unmatched (Xact)	
	Client instructs a degrapse of the		ECMS sends matching transaction decrease	-	ECMS instructs a decrease of the triparty transaction	TREA (Swift) Released (Xact)	Updated collateral reporting indicates new exposure.
Day 2	triparty transaction	TC 03	Transaction is fully collteralized	-	-	AOLF (Swift) Settled (Xact)	Collateral excess released from collateral
			Client receives Collateral Reporting	-			-
			System pays a coupon on Collateralized Position to NCBs DCA A/C	-	-	-	
Day 3	System generates a coupon payment on collateralized	TC 04	ECMS sends Debit Authorization to Clearstream	-	ECMS instructs Clearstream to debit its DCA and credit the Collateral Giver	-	Cash proceeds are transferred on the clients cash account
	position (guided)		Clearstream processes retrocession	-	-	-	client received INT300-
			Client receives reporting for retrocession processing	-	-	-	
			Client instructs a decrease of the triparty transaction (via Swift or Xact)	PADJ (Swift) Change Principal (Xact)	-	NMAT (Swift) Unmatched (Xact)	-No changes in transaction amount and
Day 4	Client instructs a Cancelation of Triparty Instruction (guided)	TC 05	ECMS does $\underline{not}$ send matching transaction decrease	-	-	-	collateral No pending instructions
			Client instructs cancellation request (via Swift or Xact)	CANC (Swift) Cancel Instruction (Xact)	-	CAND (Swift) Cancelled (Xact)	No changes in reporting -

# 1. Testgrundsätze - Testfälle (2/2)



Test	Cases						
Day	Test Description	Number	Test Steps	Client Instruction	ECMS Action	Client Instruction Status	Expected Test Results
			ECMS communicates which security is to be excluded on given transaction	-	ECMS instructs the Unilateral Exclusion Request	-	-Eligibility report shows the
Day 4	ECMS Send a Unilateral Exclusion Request (guided)	TC 06	System generates a substitution and sends out Report on Flows to ECMS	-	-	-	-
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	-
			Client instructs a Closure of a Triparty Transaction	TERM (Swift) Change Closing Date (Xact)	-	NMAT (Swift) Unmatched (Xact)	-Transaction amount changes to 0.
Day 4	Client instructs a Closure of a Triparty Transaction	TC 07	ECMS sends matching Closure of Triparty Transaction	-	ECMS instructs a closure of the triparty transaction	TREA (Swift) Released (Xact)	Collateral is fully released. Reporting stats 0 exposure and 0
			Client receives Collateral Reporting				collateral in use . -



# 2. TRIPARTY Einführung Kundensicht

# **Pool Overview - Klickstrecke**



#### Beschreibung

Um eine Übersicht zu den Pool zu bekommen muss man in den Pool Overview gehen

Pfad: Collateral and credit >> Pool overview >> Pool Overview



#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

Pool Identifier		Pool Reference		Counterparty	
•		•		•	
Pool Type		Insufficient Collateral		Is Active	
	-		•		
Validity Start Date		Validity End Date			
	<b>—</b>	•	<b>—</b>		

Der Pool kann angewählt werden und durch klicken auf das "Sicht" Symbol werden die Details gezeigt



# **Triparty Transaction Create / Display**



#### Beschreibung

Um Triparty Transaktionen anzuschauen muss der Benutzer die Suchmaske "Triparty Transaction Create / Display" öffnen

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> Triparty Transaction Create / Display



#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

iparty Transaction: Create / Display			
Triparty Transaction id	Triparty Transaction Reference	Triparty Agent	
== •	== •	== 🔻	
Collateral Giver Id	Pool Identifier	T2S External Asset Account	
== <b>v</b> Q	• Q	== •	
Triparty Cross NCB	Validity Start Date	Validity End Date	
== <b>v</b>	<b>*</b>	== •	
Refinancing NCB	Creation Date	Update Date	
•	== 👻 📛	== 🔻	

# **Triparty Collateral Movements**



#### Beschreibung

Um den Transfer von Sicherheiten zu überwachen, muss der Benutzer den Suchbildschirm "**Triparty Collateral Movements** "öffnen.

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> Triparty Collateral Movements



#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

Pool Movement ID	Pool Identifier	Q	Triparty Transaction Reference		Triparty Collateral M Status	ovement
nstruction Reference	Value Update Reason	•	== ▼ Update Date == ▼	ĉ	Creation Date	č
Validity Start Date == ▼	Validity End Date	Ċ				

# **Triparty Collateral Positions**



#### Beschreibung

Um die Triparty Positionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für "**Triparty Collateral Positions**" öffnen.

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> Triparty Collateral Positions



#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

A Collateral Position Sear	ch					$\star$
Pool Identifier	Counterparty	Q	Position Nature	•	Triparty Agent	•
Refinancing NCB	Triparty Cross NCB	•	Triparty Transaction Reference		Is Valuated	•
s Mature	Latest Valo Process Id		ISIN == <b>▼</b>	Q	Position Start Date	č
Position End Date	Removal Request	•	Eligibility	•	Close Link	•

# List of colr.019 Instruction to TPA



#### Beschreibung

Um die Liste der Triparty Instruktionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für List of colr.019 Instruction to TPA öffnen.

۹	×	
Del Structure	~	
Pool overview	~	
C ELA Operation	~	
C Payment And Credit Line Instruction	*	
Collateral	~	
C Exposure	~	
OMO Interest Rates	~	
🗘 Transfer	~	
Validation / Rejection	~	
Notification	^	
admi.007 - Acknowledgement Notification		
CLM Notifications	>	
Standing Facilities Notifications	>	
Credit Freezing Notifications	>	
MaCL Notifications	>	
Pool Position	>	
Counterparties Notifications	>	
Triparty Notifications	<	List of colr. 019 Instruction to
🗘 Credit Claim	>	List of colf. UZU Status Advice
C Reporting	~	from TPA
🗘 Setup	~	List of colr.021 Decrease/Closure Allegement
C ECMS Core	~	nom IPA

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> List of col.019 Instruction to TPA

#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

arch Criteria: Colr.019 Instr	ruction to TPA		
Message id	Allegement Reference	Triparty Transaction Reference	Triparty Agent Service Provider Collateral Transaction Identification
Client Collateral Transaction Identification	Triparty Agent	Collateral Giver	Collateral Taker
Notification Status	Instruction Type	Creation Date	Closing Date

# List of col.020 Instruction to TPA



#### Beschreibung

Um die Liste der Triparty Instruktionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für "List of col.020 Instruction to TPA" öffnen.

Q	×	
Pool Structure	~	
Pool overview	~	
C ELA Operation	~	
C Payment And Credit Line Instruction	~	
Collateral	~	
C Exposure	~	
OMO Interest Rates	~	
🗘 Transfer	~	
💭 Validation / Rejection	~	
Notification	^	
admi.007 - Acknowledgement Notification		
CLM Notifications	>	
Standing Facilities Notifications	>	
Credit Freezing Notifications	>	
MaCL Notifications	>	
Pool Position	>	
Counterparties Notifications	>	
Triparty Notifications	<	List of colr. 019 Instruction to
🗘 Credit Claim	>	<ul> <li>List of colr. 020 Status Advice</li> </ul>
C Reporting	~	from TPA
🗘 Setup	~	Decrease/Closure Allegement
C ECMS Core	~	from TPA

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> List of col.020 Status Advice

#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

Aessage Id ==  ▼	Instruction Reference	Allegement Reference	Collateral Taker	
Triparty Transaction Reference	Instruction Type	Collateral Giver	Closing Date	Ĕ
lotifications Status	Creation Date			

# List of colr.021 Triparty Decrease / Closure Alignment from TPA



#### Beschreibung

Um die Liste der Triparty Decrease / Closure Alignment anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für "List of colr.021 Triparty Decrease / Closure Alignment from TPA" öffnen.

Pfad: Collateral and credit >> Collateral >> Triparty >> List of col.021 Instruction to TPA



#### Maske / Erläuterungen

Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.

Aessage id	Allegement Reference	Triparty Transaction Reference	Client Collateral Transaction Identification
Collateral Giver	Collateral Taker	Instruction Type	Notification Status
iligibility Set Profile Number	Creation Date == ▼ <sup>™</sup>		



# 4. Annex - Weitere Informationen für den Test und die Nutzung nach Go-Live

# Annex Cut-off Zeiten Time Slots (1/2)



Time slot	Timing for Report on Flow	Timing of Report on Stock	Comment
08.07 - 19.07.24	07:00 till 17:45 every 15 minutes	18:30	ECMS is in Live-Timing (as well as T2S)
22.07 – 16.08.24	07:00 till 15:15 every 15 Minutes	16:00	ECMS is in a non-live-timing
19.08 - 06.09.24	07:00 till 17:45 every 15 Minutes	18:30	Will change, if we recognise issues in the first testing live timing cycle

# Annex Cut-off Zeiten (verkürzter Geschäftstag - ECMS UTEST) (2/2)

ECMS Instruktionstyp/Ereignis	ECMS Cut-off Standard Tag Montag - Donnerstag	ECMS Cut-off Release Tag Freitag
FTDs & OMOs	15:15	13:45
Cash Collateral	15:15	13:45
Credit Freezing	15:15	13:45
Maximum credit line	15:15	13:45
Mobilisation & Demobilisation	15:15	13:45
Triparty reports & decrease requests	15:15	13:45
MLOR (Geschäftspartner)	15:45	14:15
MLOR (NZB act on behalf)	16:10	14:40
Ende Geschäftstag	16:10	14:40
CLM	16:15	14:45