

TRIPARTY

U2A - Testgrundsätze und Ausfüllhilfen für ECMS

AGENDA

- **Testgrundsätze**
Testscenario / Voraussetzungen
Testfälle
- **Triparty**
ECMS Triparty Suchmasken Monitoring (ECMS Operator Sicht)
ECMS Triparty Suchmasken Monitoring (Kundensicht)
- **Annex**
Cut-off Zeiten

Testgrundsätze

Testscenario und Voraussetzungen

Bitte berücksichtigen Sie folgende Grundsätze für einen erfolgreichen Test

Testangebot

- Increase/Decrease of the triparty transaction
- Substitution of Assets
- Cancellation of triparty transaction instruction
- Unilateral Removal Request
- Closure of a Triparty Transaction

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

- Bitte beachten Sie die aktuellen **Testeinschränkungen** gemäß den „Testing conditions“ der EZB. [ECMS - Professional use \(europa.eu\)](#) Die „Testing conditions“ werden **alle zwei Wochen** veröffentlicht.
- Bitte beachten Sie, dass Kunden 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

1. Testgrundsätze (2/2)

Bitte berücksichtigen Sie folgende Grundsätze für einen erfolgreichen Test

Zyklus 2

Verpflichtende Test-ISINs

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
A	26/08/2024 - 30/08/024	PTOTVMOE0000 – 10 MM	DE0001468361 – 10 MM	EU000A1G0DE2 – 10 MM	DE0001345908 – 40 MM	DE0001468361 - 40 MM	XS1243251375 - 40 MM
B	02/09/2024 - 06/09/2024	NL0011819040 – 10 MM	AT0000A0VRQ6 – 10 MM	DE0001143469 – 10 MM	DE0001345908 – 40 MM	DE0001468361 - 40 MM	XS1243251375 - 40 MM

1. Testgrundsätze - Testfälle (1/2)

Test Cases							
Day	Test Description	Number	Test Steps	Client Instruction	ECMS Action	Client Instruction Status	Expected Test Results
Day 1	Client instructs an increase of the triparty transaction	TC 01	Client instructs an increase of the triparty transaction (via Swift or Xact)	PADJ (Swift) Change Principal (Xact)	-	NMAT (Swift) Unmatched (Xact)	Reporting shows full collateralization of transaction amount
			System automatically matches instruction	-	Simulated by CBL	TREA (Swift) Released (Xact)	
			Transaction is fully collateralized	-	-	AOLF (Swift) Settled (Xact)	
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	
Day 2	Substitution generated due to Corporate Action (guided)	TC 02	System communicates Ineligibility Periods for Corporate Actions	-	-	-	Collateral report indicates that ISIN subject to CA event is not used as collateral
			System generates a substitution and sends out Report on Flows to ECMS	-	-	-	
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	
				-	-	-	
Day 2	Client instructs a decrease of the triparty transaction	TC 03	Client instructs a decrease of the triparty transaction (via Swift or Xact)	PADJ (Swift) Change Principal (Xact)	-	NMAT (Swift) Unmatched (Xact)	Updated collateral reporting indicates new exposure. Collateral excess released from collateral account- -
			ECMS sends matching transaction decrease	-	ECMS instructs a decrease of the triparty transaction	TREA (Swift) Released (Xact)	
			Transaction is fully collateralized	-	-	AOLF (Swift) Settled (Xact)	
			Client receives Collateral Reporting	-	-	-	
Day 3	System generates a coupon payment on collateralized position (guided)	TC 04	System pays a coupon on Collateralized Position to NCBs DCA A/C	-	-	-	Cash proceeds are transferred on the clients cash account Client received MT566-
			ECMS sends Debit Authorization to Clearstream	-	ECMS instructs Clearstream to debit its DCA and credit the Collateral Giver	-	
			Clearstream processes retrocession	-	-	-	
			Client receives reporting for retrocession processing	-	-	-	
Day 4	Client instructs a Cancellation of Triparty Instruction (guided)	TC 05	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 collateral No pending instructions No changes in reporting -
			ECMS does <u>not</u> send matching transaction decrease	-	-	-	
			Client instructs cancellation request (via Swift or Xact)	CANC (Swift) Cancel Instruction (Xact)	-	CAND (Swift) Cancelled (Xact)	

1. Testgrundsätze - Testfälle (2/2)

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

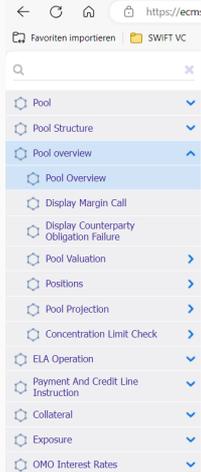
2. TRIPARTY

Einführung Kundensicht

Beschreibung

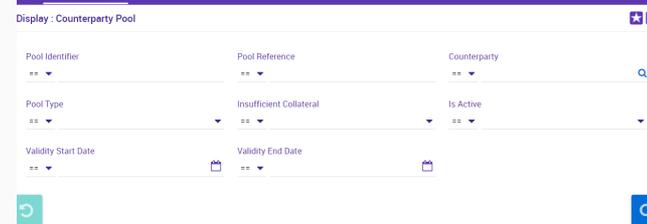
Um eine Übersicht zu den Pool zu bekommen muss man in den Pool Overview gehen

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.



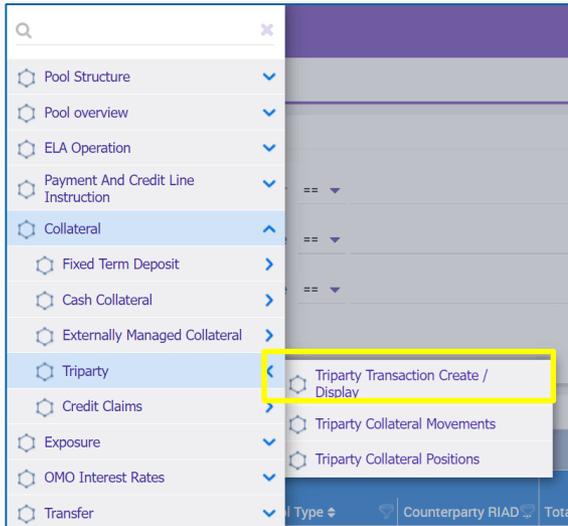
Der Pool kann angewählt werden und durch klicken auf das „Sicht“ Symbol werden die Details gezeigt

Pool I.	Pool T.	Count.	Total	SCL	ECL	RCL	Collat.	Insuff.	Is Val.	ELA C.	Total	Is Acti.	Updat.	Updat.	Is Loc.	Lock...
DEPO...	SCP	DE95...	3,856	0	3,856	3,738	3,738	0	No	Yes	0	0	Yes	02/07	ECMS	No

Beschreibung

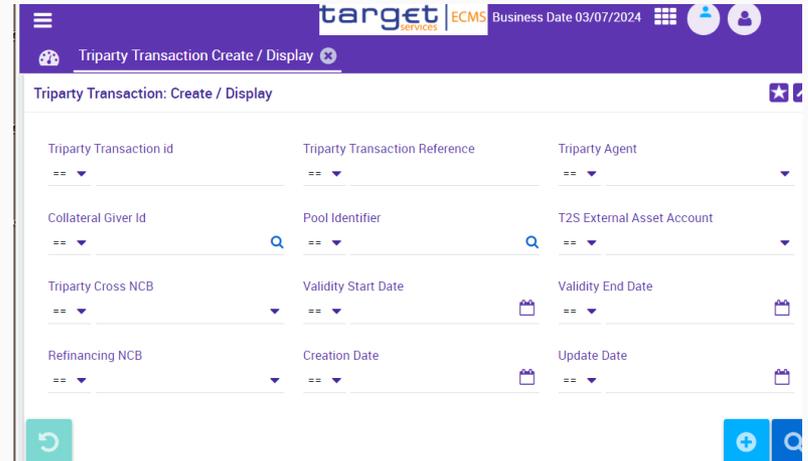
Um Triparty Transaktionen anzuschauen muss der Benutzer die Suchmaske „**Triparty Transaction Create / Display**“ öffnen

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



Maske / Erläuterungen

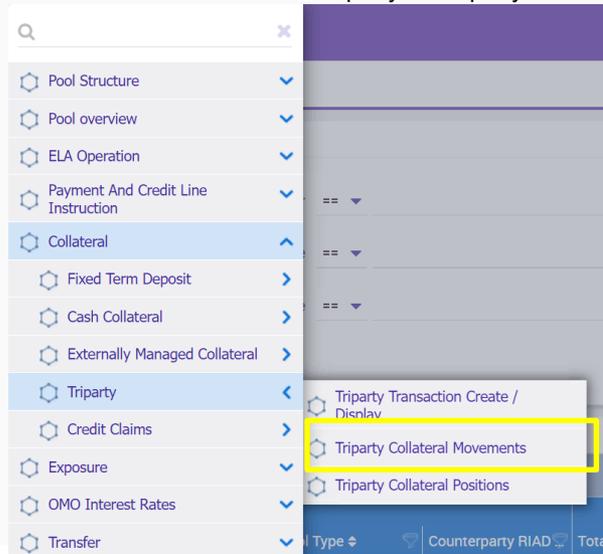
Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.



Beschreibung

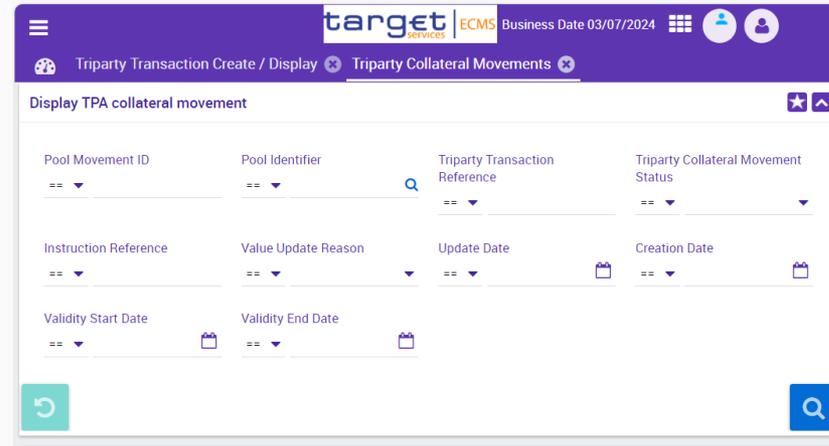
Um den Transfer von Sicherheiten zu überwachen, muss der Benutzer den Suchbildschirm „**Triparty Collateral Movements**“ öffnen.

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



Maske / Erläuterungen

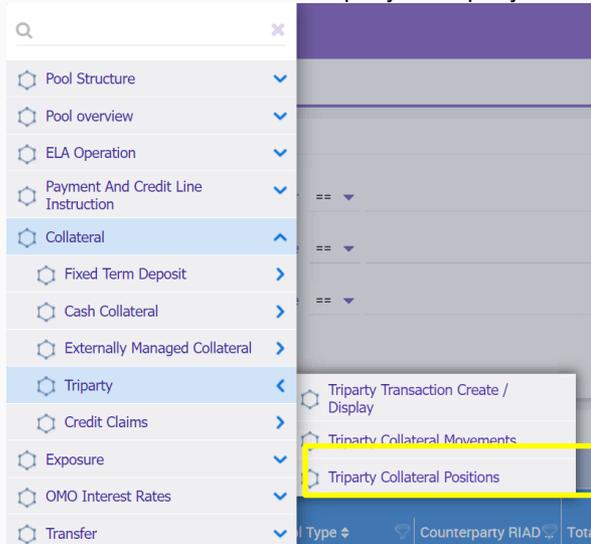
Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.



Beschreibung

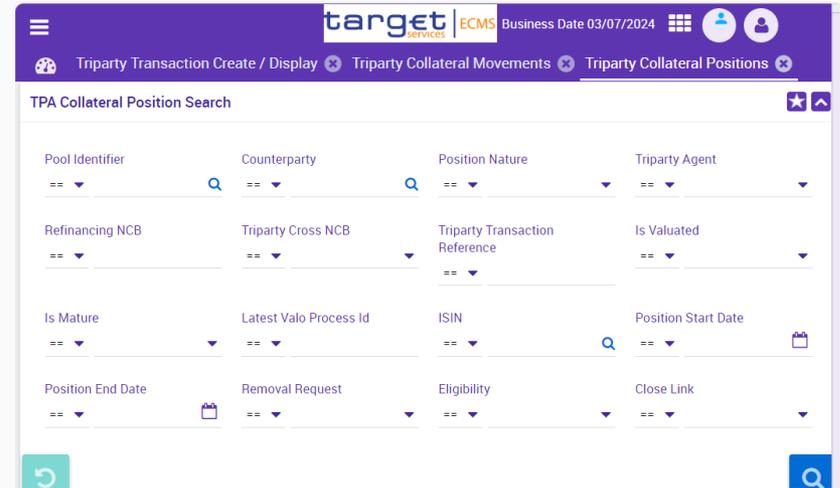
Um die Triparty Positionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für „**Triparty Collateral Positions**“ öffnen.

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



Maske / Erläuterungen

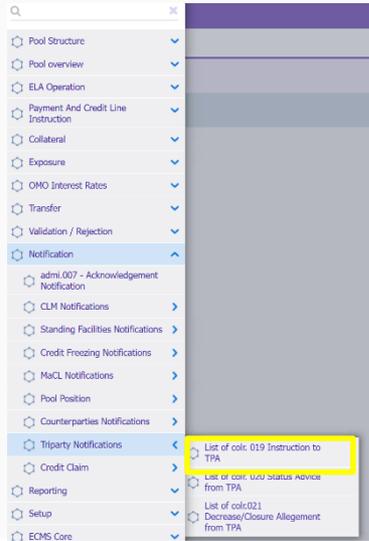
Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.



Beschreibung

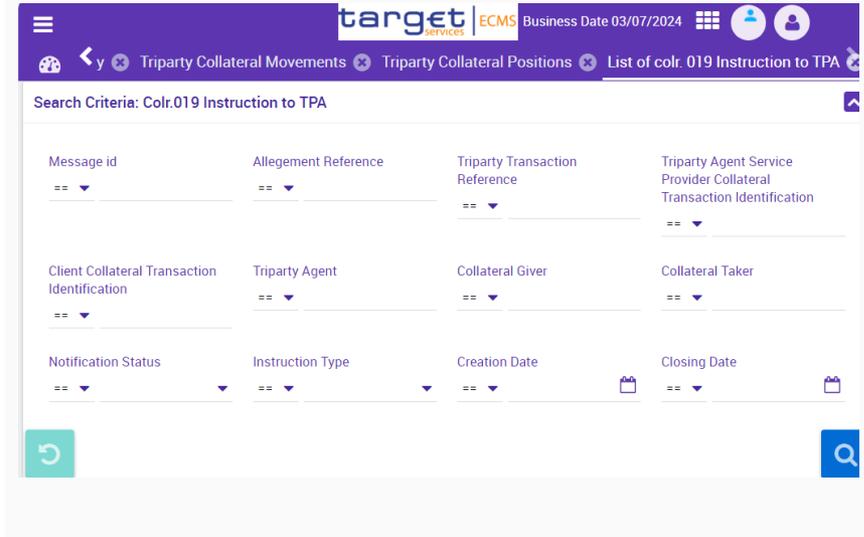
Um die Liste der Triparty Instruktionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für **List of colr.019 Instruction to TPA** öffnen.

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



Maske / Erläuterungen

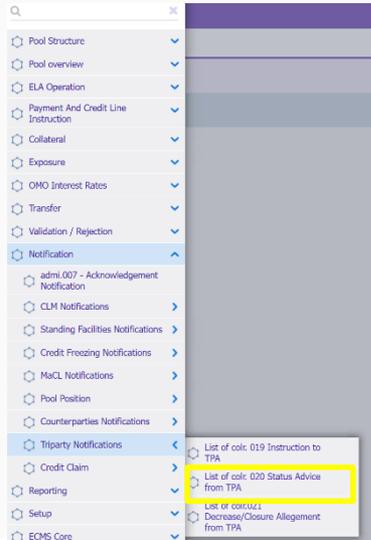
Die Suchfelder sind keine Pflichtfelder, aber durch die Eingabe der bestimmter Daten können Sie Ihre Nachrichten effizienter suchen.



Beschreibung

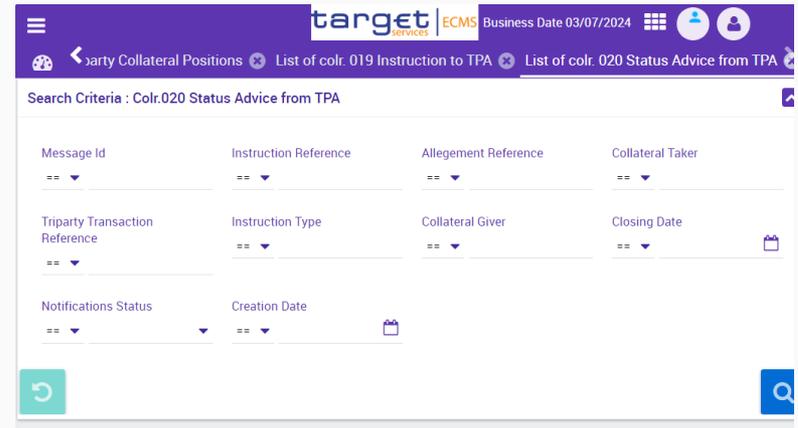
Um die Liste der Triparty Instruktionen anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für „List of col.020 Instruction to TPA“ öffnen.

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.

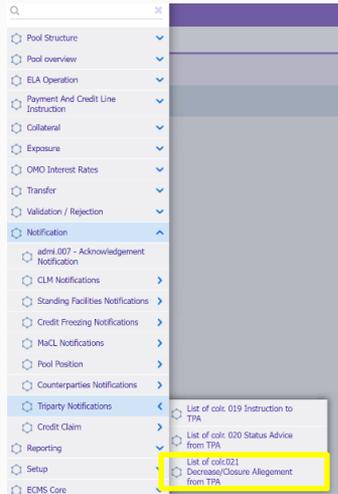


List of colr.021 Triparty Decrease / Closure Alignment from TPA

Beschreibung

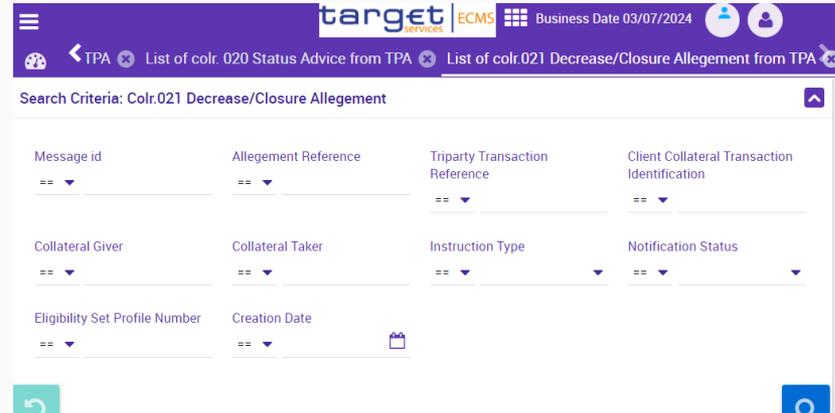
Um die Liste der Triparty Decrease / Closure Alignment anzuschauen muss der Nutzer den Suchbildschirm für „List of colr.021 Triparty Decrease / Closure Alignment from TPA“ öffnen.

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.



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

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