



TEST MANAGER CALL

Réunion de suivi

ARC – DMPM – DGSO

17 octobre 2024

POINT D'ACTUALITÉ

Annulation du TMC du 24/10/2024

Réunion de place le 28/11/2024

Nouvelle Release ECMS prévue le 19/10:

- ▶ La Final Release Note sera partagée sur l'extranet

Feu vert pour reprendre les tests créances privées sur des petits volumes

- ▶ Suite au déploiement de la dernière version en Pré-Production, vous pouvez reprendre, pour le domaine Créances privées, les tests sur des petits volumes comme indiqué précédemment. Toutes les fonctionnalités sont ouvertes y compris les démobilisations.
- ▶ De plus, les notations ICAS sont de nouveau actualisées quotidiennement depuis le 14/10/2024.
- ▶ Pour les gros volumes, reprise des tests prévue la semaine prochaine (21/10/2024) sous condition de feu vert de la Banque de France.
- ▶ SERI24100713516

POINT D'ACTUALITÉ

Communication 16/10/2024 : (SERI241016135577) Questionnaire concernant les besoins documentaires des contreparties sur la partie Créances privées :

- ▶ Questionnaire besoin documentaire
- ▶ Liste de la documentation applicative ECMS publiée par la BCE

- ▶ Retour attendu le 25/10/2024

ACTUALITÉ RELATIVE AUX TESTS

La dernière version des [ECMS Testing Conditions](#) a été publiée le 25/09/2024 sur le site ECMS Professional use

Publication BdF

- ▶ Partage par mail (SERI241016135557) de la liste des ISINs utilisables pour les tests ECMS v1.5:
 - Titres utilisables pour les tests avec Euroclear France;
 - Titres utilisables pour les tests avec CBL;
 - Titres utilisables pour les tests CCBM hors CBL.
- ▶ Partage à venir sur l'extranet
- ▶ Communication complémentaire: SERI241014135434 (feu vert CBL)

Pour mémoire, publication de la FAQ sur l'extranet

Cette FAQ fournit les réponses aux questions les plus fréquentes des contreparties.

Lien d'accès : <https://www.target2bf.fr/ecms/assistance-banque-de-france>

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ : CREANCES PRIVEES

Participation

- ▶ Depuis la reprise des tests au 23 septembre, la participation a pu être réalisée sur de petits volumes, les gros volumes dépendant de livraison des correctifs.
- ▶ Les contreparties qui utilisent uniquement la source ECAI pouvaient (jusqu'à la suspension au 1^{er} octobre) continuer les tests sans être impactées par le problème de chargement du fichier FIBEN.
- ▶ Les notations ICAS datent du 24 septembre 2024. Le chargement automatique avec les nouvelles notations devrait reprendre demain.

Tests avec Gros volumes

- ▶ **Le feu vert pour la reprise des envois en volumes iso-production n'a pas été octroyé par la Banque de France les correctifs correspondants n'ayant pas été livrés.**

Nouvelles restrictions introduites avec la livraison des correctifs du 28 septembre 2024 :

Limited volume on Credit Claims are to be used. As an example, these are the current timings for processing of the files:

- 251 CCR, 61 CCU and 100 MOB → 33 minutes to be processed.
- 100 CCR AND 100 MOB → 35 MINUTES TO BE PROCESSED.

SERI240930134908

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ : CORPORATE ACTIONS

➤ Pas de nouveauté

**Boîte mail dédiée
aux tests OST**

4045-ECMS-OST-TESTS-UT@banque-france.fr

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

POOL POSITIONS AND PROJECTION & STATEMENTS AND REPORTS

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ Pool Positions Report (depuis le 26/02)
- ▶ Report Statement of Holding (depuis le 18/03)
- ▶ Report Statement of Transactions (depuis le 18/03)

Point sur les tests

- ▶ Le PBI-141639, qui devait être livré ce weekend, sera finalement livré ultérieurement (pas de nouvelle date pour l'instant). Il est donc normal de toujours rencontrer des problèmes de réception pour le colr.016 (Pool Position Report).

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

POOL POSITIONS AND PROJECTIONS & STATEMENTS AND REPORTS

ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|---|----------------------|
| 116925 | Medium | <i>Pool Projection does not include maturing Credit Claims</i> | 05/10/2024 |
| 142373 | Low | <i>[Pool Position & Pool Projection]: EMC Instruction on not allowed EMC Types are still accepted</i> | 28/09/2024 |
| 141537 | Low | Haircut Value always 0% at Pool Position Report | 28/09/2024 |
| 141639 | Low | Colr.016 Report should be generated automatically unfortunately no report was generated nor send to counterparty. | 05/10/2024 |
| 141237 | Low | Pool projection not showing maturity of Non-EUR LPO | 05/10/2024 |
| 140875 | Medium | Pool variation amount in the pool position history screen missing for some cases | 05/10/2024 |
| 126140 | Medium | For FR30056, invalid value for PreHrcutCollVal Ccy field in colr.16 message | TBD |
| 139065 | High | Pool position report generated but not received via A2A by counterparties Actual behaviour: Counterparties did not receive the colr.016 | TBD |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ (Dé)Mobilisation de titres domestiques
- ▶ (Dé)Mobilisation de titres transfrontaliers (CCBM)
- ▶ **Rappel : il est nécessaire d'instruire sur T2S en plus de l'instruction sur ECMS (selon les modalités propres à chaque CSD)**
- ▶ Annulation de (dé)mobilisation de titres domestiques

- ▶ Rappel: Euroclear Bank demande aux contreparties souhaitant tester avec eux de s'inscrire dans un cycle de tests en écrivant à l'adresse EB.Testing@euroclear.com.
- ▶ Les tests avec Clearstream sont de nouveau possibles depuis cette semaine.
- ▶ En revanche, Euroclear Bank est indisponible pour les tests le 17/10 et le 18/10/2024.

- ▶ FTC10: T2S relocation of collateral: **fonctionnalité disponible**
 - Mode opératoire accessible sur l'extranet : Mode opératoire pour la gestion des opérations d'auto-collatéralisation des titres et de neutralisation des titres dans ECMS v1.0

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

INC / PBIs BdF:

- ▶ Certaines instructions de (dé)mobilisation restent en statut Sent for settlement malgré un rejet de l'instruction par T2S:
 - INC-145413 rattaché à l'INC-146664: INC résolu par les 4CB.

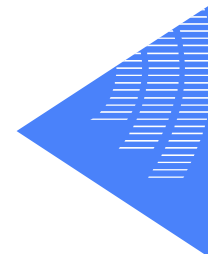
Clearstream Bank Luxembourg

- ▶ Feu vert donné pour démarrer les tests avec Clearstream Bank Luxembourg:
 - Nécessité de disposer d'une position dans votre pool afin de démobiliser avant de mobiliser;
 - Pour ce faire, merci de sélectionner dans la liste v1.5 les ISINs que vous souhaitez utiliser dans vos tests et de nous adresser votre demande de création de position à l'adresse utest-ecms@banque-france.fr
 - Merci de vous baser sur les modes opératoires de la Banque de France et celui rédigé par CBL et la Banque du Luxembourg pour instruire (accessibles sur l'extranet).
- ▶ Rappel:
- ▶ Rappel: Après la MEP d'ECMS, LuxCSD sera le CSD LU et non plus CBL.
- ▶ Pas de lien éligible entre LuxCSD et Euroclear Finland donc pas possible de (dé)mobiliser des titres FI en LuxCSD.
- ▶ Banque du Luxembourg n'accepte pas de titres PT donc impossible de passer par le CSD LU pour dénouer ses titres PT

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Par place de dénouement en CTP2e depuis la purge



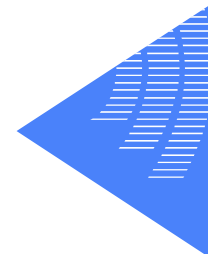
| Place de dénouement | Statut |
|---------------------------------|--------------------------|
| Autriche (OeKB CSD GmbH) | CTP2E: Tests concluants |
| Belgique (Euroclear Bank) | CTP2E: Tests concluants |
| Belgique (NBBE) | CTP2E: Tests concluants |
| Allemagne (CBF) | CTP2E: Tests concluants |
| Espagne (Iberclear) | CTP2E: Tests concluants |
| Finlande (Euroclear Finland) | CTP2E: Tests concluants |
| Italie (ES-MIL) | CTP2E: Tests concluants |
| Luxembourg (CSD LU LuxCSD S.A.) | CTP2E: Ouverts aux tests |

| Place de dénouement | Statut |
|--------------------------------------|--------------------------|
| Pays-Bas (Euroclear Nederland) | CTP2E: Tests concluants |
| Portugal (Euronext Securities Porto) | CTP2E: Tests concluants |
| Slovénie (CSD SI) | CTP2E: Ouverts aux tests |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Par place de dénouement en CTP2e depuis la purge – Focus avec Euroclear Bank



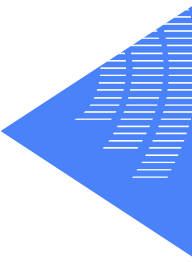
| Place de dénouement | Statut |
|---------------------------------|-------------------------|
| Autriche (OeKB CSD GmbH) | CTP2E: Tests concluants |
| Belgique (Euroclear Bank) | CTP2E: Tests concluants |
| Belgique (NBBE) | CTP2E: Tests en cours |
| Allemagne (CBF) | CTP2E: Tests concluants |
| Espagne (Iberclear) | CTP2E: Tests concluants |
| Finlande (Euroclear Finland) | CTP2E: Tests concluants |
| Italie (ES-MIL) | CTP2E: Tests concluants |
| Luxembourg (CSD LU LuxCSD S.A.) | NA |

| Place de dénouement | Statut |
|--------------------------------------|--------------------------|
| Pays-Bas (Euroclear Nederland) | CTP2E: Tests concluants |
| Portugal (Euronext Securities Porto) | CTP2E: Tests concluants |
| Slovénie (CSD SI) | CTP2E: Ouverts aux tests |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

AUCUN PBI EN COURS



ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

MULTIPOOLING ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|---|----------------------|
| 142957 | Low | <i>Multipooling MA transfer and sese.024</i> | 19/10/2024 |
| 134038 | Medium | <i>Multiple issues with internal transfer of CCs</i> | 19/10/2024 |
| 142309 | Low | <i>VNCB Task Asses credit claim eligibility FAILED: Transfer pending but positions and pool updated</i> | 05/10/2024 |
| 136582 | Medium | Update of position on internal asset account is only provisional | 05/10/2024 |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

OPÉRATIONS DE POLITIQUE MONÉTAIRE

Fonctionnalité ouvertes

- ▶ Demande de prêt marginal (= MLOR)
- ▶ Prêt marginal automatique (= AML)
- ▶ Interactions avec TOP
- ▶ Liquidity Absorbing Operations (LAO)
- ▶ Liquidity Providing Operations (LPO)
- ▶ Gestion des intérêts

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

OMOs : campagne d'octobre terminée

- ▶ Périmètre : MRO, LTRO et LTRO ER, FTD, USD (< 7 and >7 days)
- ▶ Incidents créés par la BDF:
 - 1 allotment LTRO non chargé et incident sur le Early Repayment
 - Problème lors du passage à SETTLED de l'USD 20550003 (PBI 146886 en cours)
- ▶ PBI déployé pour cette version et vérifié : impact d'un FTD sur le pool sur le parameter BCE FTD_UsedAsCollateral=False.

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

OPÉRATIONS DE POLITIQUE MONÉTAIRE ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|--|----------------------|
| 143651 | Medium | MPO Expected Payment - Netted payment ID is empty | 19/10/2024 |
| 131841 | Medium | Netting results - remove the reference to ML contract and ML Movement | TBD |
| 142508 | Medium | variation in interest amount between Provisional Interest in EUR and Accrued Interest | 05/10/2024 |
| 142484 | Medium | ECB current OMO campaign - UTEST - OMO 20240091 not received | 05/10/2024 |
| 142366 | Low | MPO Expected Payment Status "Netted" instead of Instructed and settled | 05/10/2024 |
| 142330 | Medium | concurrency when impacting the direct payment | 05/10/2024 |
| 142120 | Medium | Unjustified interest amounts appearing in the pool after closing of OMO operations | 05/10/2024 |
| 100225 | Medium | Collateral reserve in settlement-1 not available | TBD |
| 120932 | Medium | Interests seen twice, strange maturity date, missing principal amounts, no early repayments seen | TBD |
| 105835 | High | Report with duplicated records TOP test campaign | TBD |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

GLOBAL CREDIT AND COLLATERAL POSITION

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ Update of Maximum Credit Line value and Credit lines
- ▶ Global credit position management
- ▶ Update of credit and collateral position due to the change of business date
- ▶ Margin call
- ▶ Credit freezing

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

GLOBAL CREDIT AND COLLATERAL POSITION ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|---|----------------------|
| 143031 | Medium | <i>ECMS test (ECONS II) - Credit freezing orders rejected, but no associated error displayed on screen</i> | 19/10/2024 |
| 142135 | Low | <i>Button Edit for CPTY on Display credit freezing</i> | 28/09/2024 |
| 142128 | Low | <i>Missing Fields in Potential Obligation Failures – Search screen/ List Screen</i> | 28/09/2024 |
| 112671 | Medium | <i>Instruction remains blocked in status Pending Settlement instead of being rejected due to collateral insufficiency</i> | TBD |
| 143165 | Medium | <i>ECMS should valuate the position of a ISIN of Countries that need Tax Certification when ALLOW_MISSING_TAX_CERTIFICATION parameter is True</i> | 05/10/2024 |
| 140866 | Medium | <i>Wrong button structure in Obligation Failure</i> | TBD |
| 137424 | Medium | GCCP - Valuation of the pool with the reception of new event | 28/09/2024 |
| 139711 | Medium | No change of CL instruction sent to CLM | 05/10/2024 |
| 139462 | Medium | APPR AML instruction stuck in WaitingPaymentConfirmation | 05/10/2024 |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

CASH AS COLLATERAL

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ U2A and A2A mobilization of cash collateral
- ▶ U2A and A2A demobilization of cash collateral
- ▶ Automatic mobilization and demobilization of cash collateral

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

CASH AS COLLATERAL ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|---|----------------------|
| 140190 | Medium | Cash Collateral Instruction stuck in CashInstructed | 28/09/2024 |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

DONNÉES RÉFÉRENTIELLES / REFERENCE DATA

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ Création / Mise à jour / Suppression des utilisateurs contrepartie U2A et A2A et des paramétrages de droits d'accès correspondants
- ▶ Réconciliation via le GUI des configurations des comptes titres et des pools réalisées par les BCNs

Fonctionnalités futures

- ▶ N/A

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

DONNÉES RÉFÉRENTIELLES / REFERENCE DATA ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| Problem ID | Priority | Business Description/Summary/testing limitation | Target delivery date |
|------------------------|----------|---|----------------------|
| 142623 | Medium | <i>Parameter Payment date does not work in the search screen List Confirmed Payment</i> | 28/09/2024 |
| 142346 | Low | <i>When selecting multiple rows only registerCAentitlement and View button should be displayed on Send Client CAPA Screen</i> | 28/09/2024 |
| 130699 | Medium | <i>Excel export ignored when the search contains more than 10000 lines</i> | 05/10/2024 |
| 143706 | Medium | <i>Semt.017 field <SttImDt> must be informed with the Intended Settlement Date of the Instruction.</i> | 19/10/2024 |
| 143203 | Low | <i>Role validator able to instruct MLOR instruction all alone by himself without validation</i> | 19/10/2024 |
| 143063 | Medium | <i>AML Instruction Status closed, but status reason 'Waiting for payment confirmation'</i> | 05/10/2024 |
| 142761 | Low | <i>Edit and create buttons should not be visible for CTPTY</i> | 05/10/2024 |
| 142757 | Low | <i>Edit buttons for CPTY in Create Display EMC Types</i> | 05/10/2024 |
| 142695 | Medium | <i>Screens for parameter which should not be editable</i> | 05/10/2024 |

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

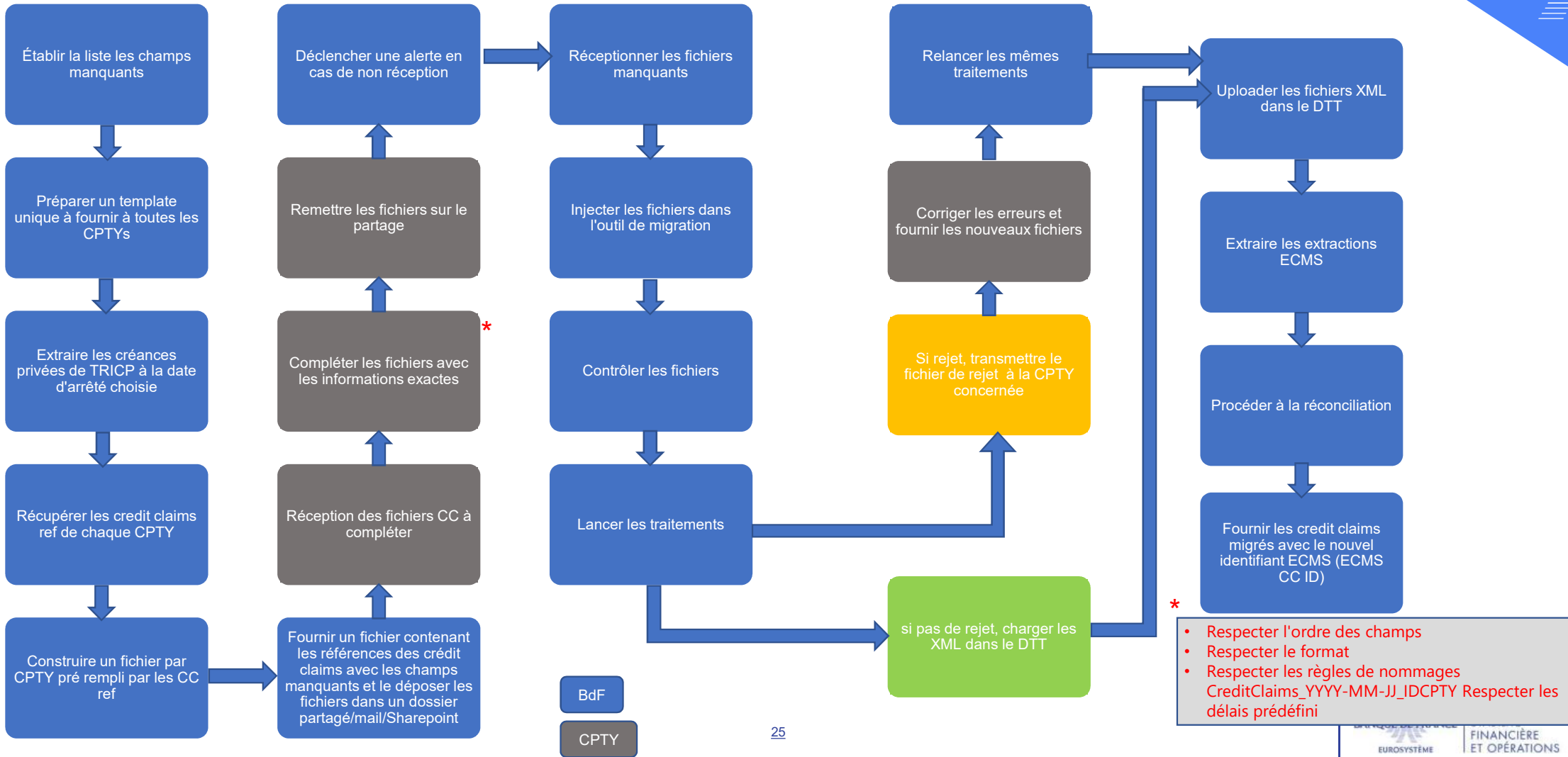
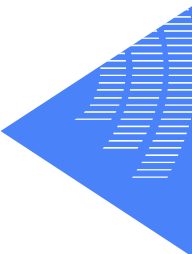
DONNÉES RÉFÉRENTIELLES / REFERENCE DATA ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

| | | | |
|------------------------|--------|---|------------|
| 142371 | Medium | <i>Error when updating the CA event. "Not matching..." 2. The field "Official CA Event Id" must be read-only mode</i> | 05/10/2024 |
| 142141 | Low | <i>Include Party's Instruction Reference in screen Instruction Status</i> | 05/10/2024 |
| 141558 | Medium | <i>Wrong download report format and content at Concentration Limit Check Report</i> | 05/10/2024 |
| 141318 | Medium | <i>Account Currency and Servicer must not be read only when the Account Type is Non-euro Cash Account</i> | TBD |
| 134628 | Low | <i>Only 10K out of 100K results on Monitor MA Price are downloaded</i> | 05/10/2024 |
| 143672 | Medium | Button "Create" to be removed from screen "Client pending movement" and "Market pending movement" | 19/10/2024 |
| 134437 | Low | Alerts dashboard – not harmonised and containing wrong values across business processes | TBD |
| 134056 | Low | Brush is not displayed | TBD |
| 140917 | Low | Alert screen does not allow filtering REGRESSION | 05/10/2024 |
| 141978 | Low | Create/Display User Screen raise an error in Edit mode when sort by Assigned roles | 05/10/2024 |
| 123224 | Medium | MegaCommon – Alerts dashboard – not harmonised and containing wrong values across business processes | 05/10/2024 |

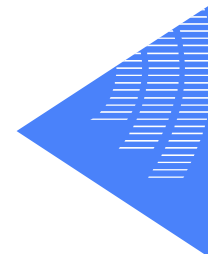


ANNEXES

ANNEXE 1 : STRATÉGIE DE COLLECTE DES CHAMPS MANQUANTS CREDIT CLAIMS



ANNEXE 1 : STRATÉGIE DE COLLECTE DES CHAMPS MANQUANTS CREDIT CLAIMS



| ACC N° | Champs | Description | Format | Oblig. O/N | Contrôle en entrée |
|--------|---------------------------------------|---|--------------------|--|---|
| 1 | Creditor RIAD Code | Code RIAD | String | O | o le champ Creditor_RIAD_Code doit contenir la code Riad du créancier si la créance vient du TRICP ou le code riad par défaut pour les créances ACC qui peut être le code Riad de la contrepartie elle-même |
| 2 | Changing Interest Rate Indicator | Champ utilisé s'il y a un changement de taux (le taux d'intérêt change de FIX à VAR et vice versa) | Booléen | O | Cette valeur doit égale à true / false |
| 3 | Changing Interest Rate Indicator Date | c'est la date du changement de taux | Date YYYY-MM-DD | O si Changing Interest Rate Indicator = true | |
| 4 | Loan Type | Définir le type du loan | loanType | O | |
| 5 | Agent Bank | | optionalString50 | N | |
| 6 | Contract Number | le numéro du contrat | mandatoryString121 | O | Respecter le critère d'unicité |
| 7 | Resetting_Period_More_Than_One_Year | | true ou false | O si taux variable | |

| TRICP N° | Champs | Description | Format | Oblig. O/N | Contrôle en entrée |
|----------|---------------------------------------|--|--------------------|--|---|
| 1 | Origination Date | Origination date of the credit claim | Date YYYY-MM-JJ | O | Cette valeur doit respecter le format Date |
| 2 | Changing Interest Rate Indicator | Champ utilisé s'il y a un changement de taux (le taux d'intérêt change de FIX à VAR et vice versa) | Booléen | O | Cette valeur doit égale à true/ false |
| 3 | Changing Interest Rate Indicator Date | La date du changement de taux | Date YYYY-MM-JJ | O si Changing Interest Rate Indicator = true | Obligatoire pour Changing Interest Rate Indicator égal à True |
| 4 | Loan Type | Définir le type du loan | loanType | O | |
| 5 | Agent Bank | | optionalString50 | N | |
| 6 | Contract Number | Le numéro du contrat | mandatoryString121 | O | Respecter le critère d'unicité |
| 7 | Resetting_Period_More_Than_One_Year | | true ou false | O si taux variable | |



STABILITÉ
FINANCIÈRE
ET OPÉRATIONS