



Mode opératoire pour la saisie
d'une (dé)mobilisation et d'une
annulation de (dé)mobilisation de
titres domestiques et
transfrontaliers en U2A et A2A via
ECMS.

Couvre les cas de tests
fondamentaux 1,2,3 et 4
V1.5

Ce Mode opératoire a été préparé à la demande des contreparties pour les aider à instruire dans ECMS.

Il n'a aucune vocation à être un document officiel.

Les données sont purement fictives.

La BDF ne peut pas être tenue responsable d'un défaut d'instruction sur la base de ce document.

Le document officiel à considérer est le UHB :

https://www.ecb.europa.eu/paym/target/ecms/profuse/shared/pdf/ecb.targetecms230315_ECMS_User_Handbook_Counterparties.en.pdf?0be47b145a022c7370e88feec983ed19

Table des matières

| | |
|--|----|
| • Prérequis : | 4 |
| • Accéder à MegaCustody : | 4 |
| • Connaître la liste des ISINs en ECMS et en T2S : | 4 |
| • Instruire la jambe T2S : | 6 |
| • (Dé)Mobilisation de titre domestique (ECMS_TC_CPTY_1 et ECMS_TC_CPTY_3) et transfrontalier (CCBM): | 8 |
| Domestique / Transfrontalier (U2A) : | 8 |
| Domestique / Transfrontalier (A2A) : | 13 |
| Expected results: | 18 |
| • Annulation d'une (dé)mobilitation de titre domestique (ECMS_TC_CPTY_2 et ECMS_TC_CPTY_4) et transfrontalier (CCBM) : | 22 |
| Domestique / Transfrontalier (U2A) : | 22 |
| Domestique / Transfrontalier (A2A) : | 26 |
| Expected results: | 30 |
| • Monitoring d'une instruction : | 32 |
| Gestion du Business Sub Status: « Waiting for global collateral position update »: | 32 |
| Gestion du statut Rejected : | 34 |
| • Annexes : | 38 |
| Point de vue de l'agent qui a instruit une annulation (il ne pourra pas rejeter ou valider) : | 38 |
| Schéma des différents statuts possibles suite à une (dé)mobilitation : | 39 |
| Informations des différents CSDs et BCNs : | 40 |
| SSIs fournis par Euroclear Bank : | 41 |
| Exemples de sese.023 en CBL : | 45 |

Historique des versions

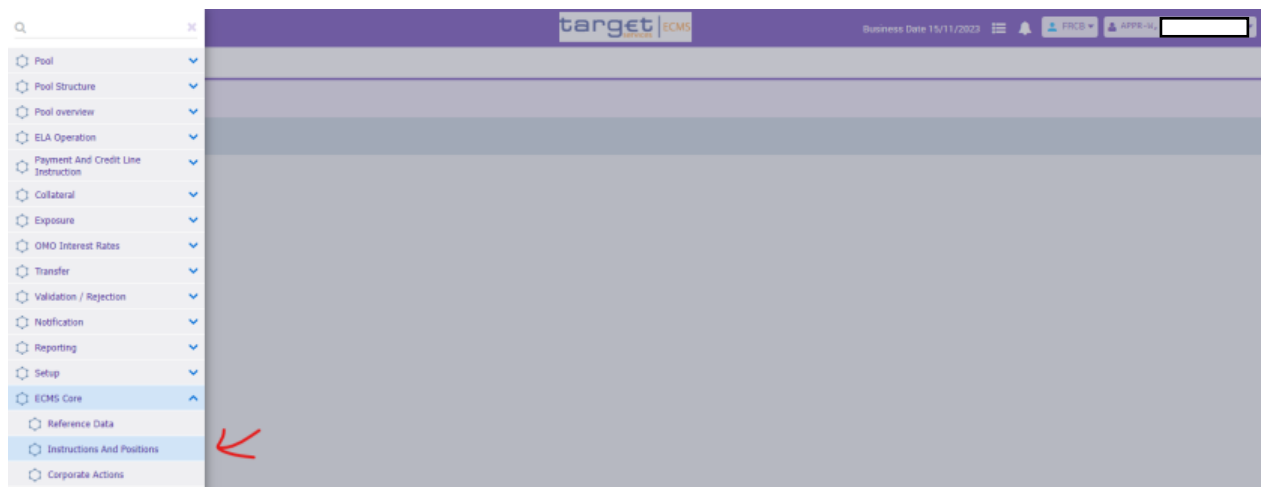
| Version | Date | Problématique | Statut |
|----------------|-------------|---|---------------|
| V1.0 | 05/12/2023 | | Final |
| V1.1 | 12/02/2024 | Ajout d'informations sur le CCBM | Final |
| V1.2 | 15/08/2024 | Ajout d'informations sur la gestion du BSS « Waiting for Global Collateral Position Update » et sur la Banque de Slovénie (Cf Informations des différents CSDs et BCNs en Annexe) | Final |
| V1.3 | 25/09/2024 | Ajout d'informations sur les FTC d'annulation et suppression de la mention du PBI-128412 | Final |
| V1.4 | 28/10/2024 | Ajout d'informations sur la gestion du statut Rejected | Final |
| V1.5 | 08/11/2024 | Ajout d'exemples de sese.023 en CBL et suppression de l'annexe « Exemple d'un sese.023 de mobilisation » | Final |

- **Prérequis :**

Disposer des rôles « ECMS Entity U2A Marketable Asset (De)Mobilisation » et « ECMS Entity A2A Marketable Assets » (si (dé)mobilité en A2A).

- **Accéder à MegaCustody :**

La saisie des mobilisations et des démobilitations se fait via le Module Custody, accessible depuis le module MegaLend.



- **Connaître la liste des ISINs en ECMS et en T2S :**

Une liste d'ISINs (domestiques et transfrontaliers) paramétrés en T2S et en ECMS est disponible sur [l'extranet de la Banque de France](#), fenêtre Assistance Banque de France.

Important : Avant de (dé)mobilité un ISIN, vous devez valider auprès de votre custodian l'existence du titre dans les systèmes de votre custodian.

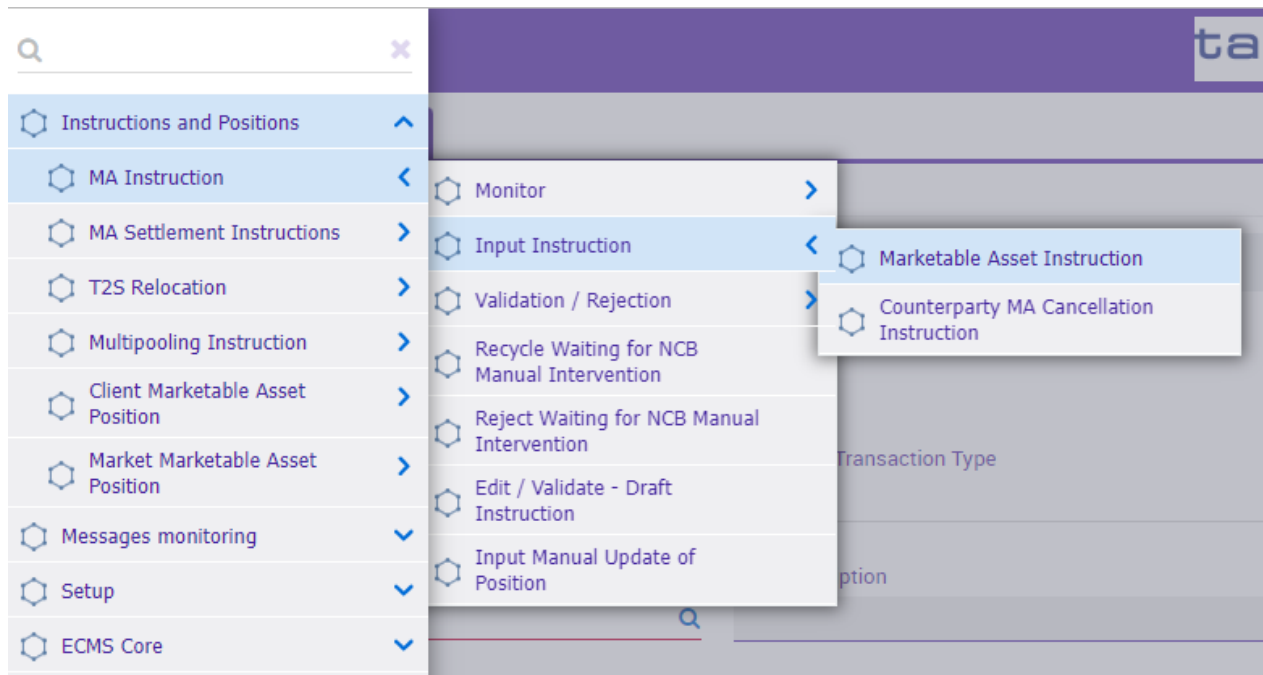
Vous pouvez également accéder à une liste plus large d'ISINs via la méthode décrite ci-dessous :

La liste des ISINs FR paramétrés en T2S est accessible sur le site d'Euroclear France :

https://my.euroclear.com/eses/shared/en/reference/ESES-Testing-Services-Projects/ESES-T2S_For_Testing_PH.html

La liste des ISINs paramétrés en ECMS est accessible via MegaCustody puis Instructions and positions → MA Instruction → Input Instruction → Marketable Asset instruction

Cliquez ensuite dans la barre de recherche ISIN, renseignez le code pays de l'ISIN voulu (FR pour un titre français par exemple) puis faites F2.



Une fois dans la fenêtre Marketable Asset Instruction, saisissez le code pays de l'ISIN (FR pour un titre français par exemple) que vous souhaitez mobiliser puis faites F2.

Marketable Asset Instruction

Input: Counterparty MAI

General Informations

Party's Instruction Reference

Instruction Type

ISIN

- Instruire la jambe T2S :

Pour qu'une instruction se dénoue correctement, qu'il s'agisse d'une instruction de mobilisation ou d'une instruction d'annulation, domestique ou transfrontalière, la contrepartie doit instruire la jambe ECMS (processus détaillé dans les parties ci-après) et la jambe T2S.

Lorsque vous saisissez une instruction via ECMS, ECMS envoie cette même instruction à T2S et génère une Settlement instruction Id.

Votre custodian doit ensuite instruire la jambe marché pour matcher l'instruction et donc qu'elle se dénoue.

Pour que votre custodian puisse instruire la jambe marché, vous devez donc lui fournir la Settlement instruction Id, qui se trouve ici dans votre instruction après l'avoir saisie:

target services | ECMS Business Date 29/01/2024

Counterparty Instructions

Being Cancelled: No Action To Validate: Is Rejected: No

Other Details

MA Settlement Instruction Client Marketable Asset Movement Client Asset Position

Business Validation Errors [0] Receiving/Delivering Settlement Parties [4] Notifications

Foot Print

List: Marketable Asset Settlement Instructions

| Instruct | Settlement Instruct | T2S Ref | Instruct | Busines | Busines | ISIN | Quantit | Trade D | Intende | Party C | Party C | CSD of | CSD of | Being C | Updater | Update | Creatio | Identifi | Identifi | Party R | Effectiv |
|----------|---------------------|---------|----------|---------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|----------|----------|---------|----------|
| MAI202 | FRFR2024012500020 | 240126 | Markets | Confirm | FR0013 | 10,000 | 26/01/2 | 26/01/2 | FR5420 | CSD FR | FR5420 | CSD FR | No | STP | 26/01/2 | 26/01/2 | | | | | 26/01/2 |

Vous pouvez également l'obtenir via :

Instructions and Positions

MA Instruction

MA Settlement Instructions

T2S Relocation

Marketable Asset Settlement Instructions

Marketable Asset Settlement Instructions

- (Dé)Mobilisation de titre domestique (ECMS_TC_CPTY_1 et ECMS_TC_CPTY_3) et transfrontalier (CCBM):

Domestique / Transfrontalier (U2A) :

General Informations

- Party's instruction reference : Référence unique aléatoire
- Instruction Type :
 - Mobilisation : Marketable Asset Mobilisation (RECE)
 - Démobilisation : Marketable Asset Demobilisation (DELI)
- Securities Transaction Type : Champ non obligatoire
- Counterparty : choisir votre CIB en cliquant sur la loupe
- NCB Participant asset Account : choisir le compte FR+CIB+MA047.....
- ISIN : Remplir le champ puis tabuler pour remplir la description de l'ISIN
- ISIN Description : Se remplit automatiquement
- Quantity in FAMT : Renseigner la quantité
- Trade date : Date de négociation
- Intended Settlement Date : date de dénouement

Additional Informations

- Common Reference : à remplir selon la réponse attendue par le simulateur en cas d'utilisation d'un simulateur (valable uniquement lorsqu'il n'y a pas d'interconnexion entre ECMS et CLM et T2S), ce champ est non obligatoire pour les cas de saisie sans simulateur

Custody chain :

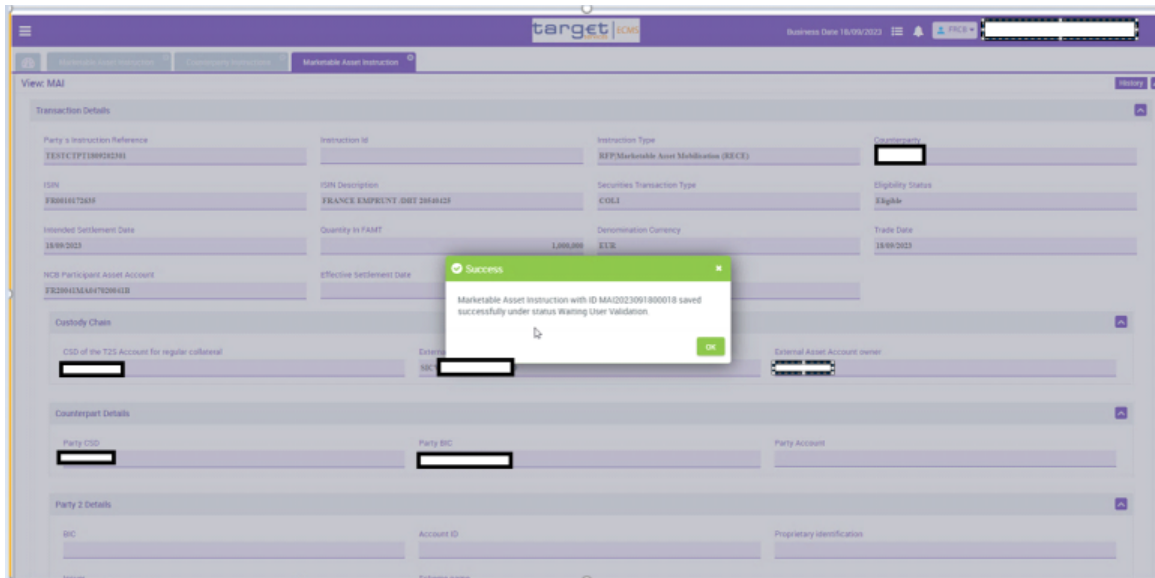
- CSD of the T2S Account for regular collateral : le CSD à utiliser
 - Domestique : choisir EUROCLEAR France
 - Transfrontalier : choisir le CSD de la banque centrale correspondante (IBERCLEAR par exemple);
- External Asset Account : se remplit automatiquement
- External Asset Account Owner : se remplit automatiquement

Counterpart Details :

- Party CSD : le CSD délivrant le titre dans le cas d'une mobilisation / recevant le titre dans le cas d'une démobilisation.

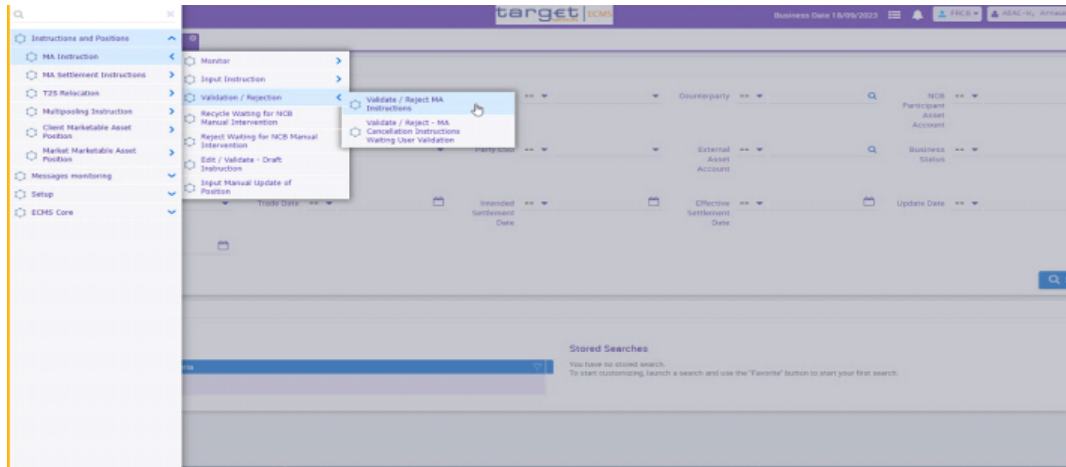
Pour le domestique, sauf cas particulier, il s'agit d'EUROCLEAR FranceParty BIC : l'agent de règlement/custodian/party CSD participant délivrant / le titre dans le cas d'une mobilisation / recevant le titre dans le cas d'une démobilisation (Équivalent de DEAG / REAG sous ISO15022). C'est votre custodian qui pourra vous fournir cette information.

Appuyer sur Save :

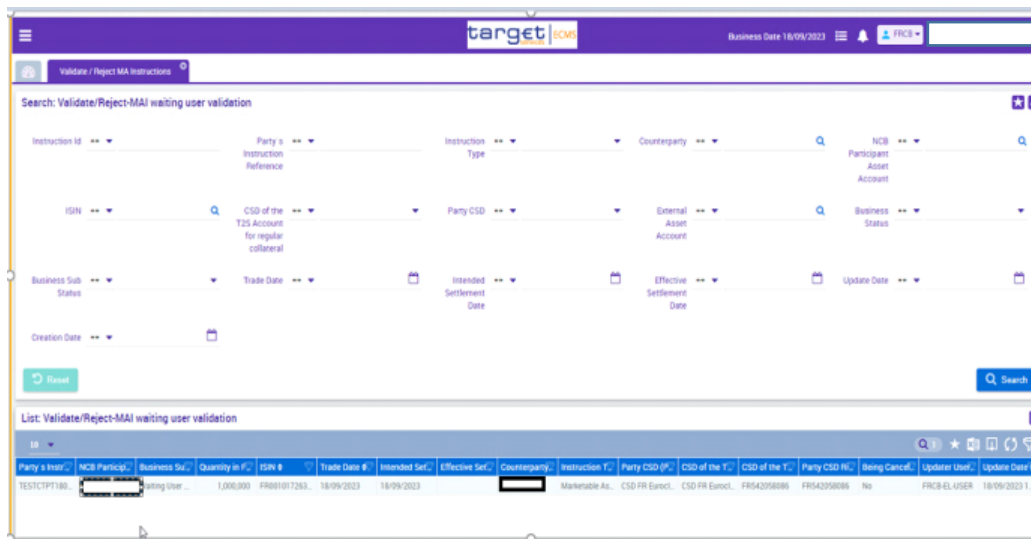


Un autre user doit valider l'instruction :





Search via la référence de l'instruction



Cliquer sur l'instruction

Search: Validate/Reject-MAI waiting user validation

Reset Search

List: Validate/Reject-MAI waiting user validation

| Party & Instr. | NCB Particip. | Business Sub. | Quantity in F | ISIN | Trade Date | Intended Set | Effective Set | Counterparty | Instruction Type | Party CSD | CSD of the T | CSD of the T | Party CSD N | Being Canc. | Updater User | Update Date |
|----------------|---------------|---------------|---------------|-------------|------------|--------------|---------------|--------------|------------------|---------------|---------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|
| TESTCPT180 | FR0001MA0 | Waiting User | 1,000,000 | FR001017263 | 18/09/2023 | 18/09/2023 | | | Marketable As. | CSD FR Eurod. | CSD FR Eurod. | FR542098086 | FR542098086 | No | FR08-EL-USER | 18/09/2023 1 |

Reject Validate View

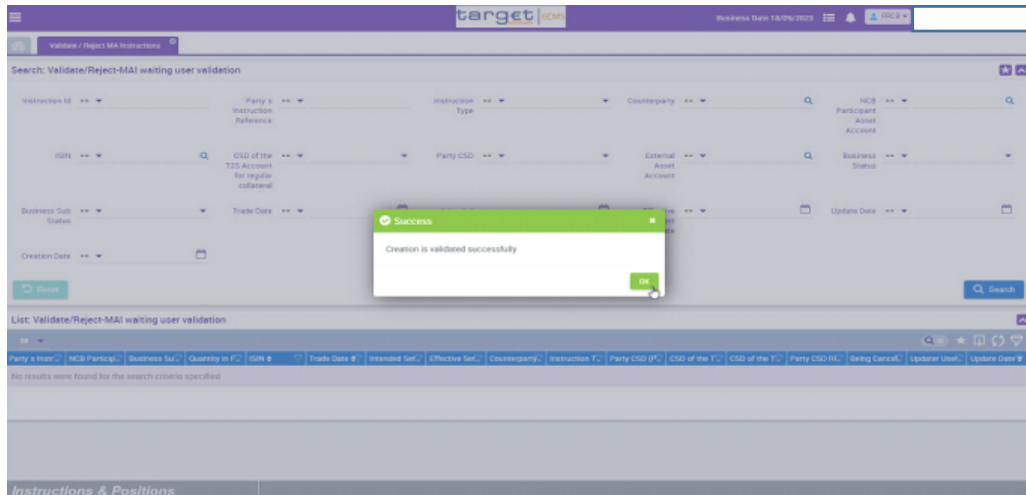
Appuyer sur Validate

Confirm

Confirm the validation?

Yes No

Cliquer sur Yes



Appuyer sur OK

Domestique / Transfrontalier (A2A) :

Uniquement pour les contreparties faisant du A2A

Plus d'informations sur le format des messages et les balises sur :

- Le portail [MyStandard](#) ;
- Le [catalogue of messages](#).

1. *Constitution du general header :*

Les éléments en **rouge** sont à la main de la contrepartie.

```
<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
  <Fr>
    <FIld>
      <FinInstnId>
        <BICFI>Counterparty BIC</BICFI>
        <ClrSysMmbld>
          <ClrSysId>
            <Prtry>ECMS</Prtry>
          </ClrSysId>
          <Mmbld>A2A-User-Reference</Mmbld>
        </ClrSysMmbld>
        <Othr>
          <Id>BDFEFR2LXXX</Id>
        </Othr>
      </FinInstnId>
    </FIld>
  </Fr>
  <To>
    <FIld>
      <FinInstnId>
```

```

        <BICFI>TRGTXE2SXXX</BICFI>
        <Othr>
            <Id>BDFEFR2LXXX</Id>
        </Othr>
    </FinInstnId>
</FIld>
</To>
<BizMsgIdr>Renseigner une reference unique permettant d'identifier le message</BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>sese.023.001.09</MsgDefIdr>
<CreDt>2023-11-21T12:00:00Z</CreDt>
</AppHdr>

```

2. Constitution du corps du message :

Les éléments en rouge sont à la main de la contrepartie.

```

<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema">
    <SctiesSttlmTxInstr>
        <TxId>Renseigner une reference permettant d'identifier l'instruction</TxId>
        <SttlmTpAndAddtlParams>
            <SctiesMvmntTp>Renseigner « RECE » ou « DELI » pour une mobilisation /
démobilisation </SctiesMvmntTp>
            <Pmt>FREE</Pmt>
        </SttlmTpAndAddtlParams>
        <TradDtls>
            <TradDt>
                <Dt>
                    <Dt>Renseigner la Trade date</Dt>
                </Dt>
            </TradDt>

```

```

    <StlmDt>
        <Dt>
            <Dt> Renseigner la Settlement date</Dt>
        </Dt>
    </StlmDt>
</TradDtIs>
<FinInstrmId>
    <ISIN>Renseigner l'ISIN à (dé)mobiliser</ISIN>
</FinInstrmId>
<QtyAndAcctDtIs>
    <StlmQty>
        <Qty>
            <FaceAmt>Renseigner la quantité à (dé)mobiliser</FaceAmt>
        </Qty>
    </StlmQty>
    <SfkpgAcct>
        <Id>Renseigner l'Internal Asset Account vers lequel (dé)mobiliser
(format : coderiadMA047xxxxxx)</Id>
    </SfkpgAcct>
</QtyAndAcctDtIs>
<StlmParams>
    <SctiesTxTp>
        <Cd>Renseigner « COLI » ou « COLO » pour une mobilization /
démobilisation</Cd>
    </SctiesTxTp>
    <StlmTxCond>
        <Cd>NOMC</Cd>
    </StlmTxCond>
    <PrtlStlmInd>NPAR</PrtlStlmInd>
    <ModCxlAllwd>
        <Ind>>false</Ind>

```

</ModCxlAllwd>

</SttImParams>

<DlvrgSttImPties>

<Dpstry>

<Id>

<AnyBIC> Dans le cas d'une mobilisation, renseignez le BIC du CSD du custodian délivrant le titre que vous mobilisez (ces BICs sont listés en annexe). Dans le cas d'une démobilisation, renseignez le BIC du CSD de la correspondant central bank délivrant le titre que vous démobilisez (ces BICs sont listés en annexe).</AnyBIC>

</Id>

</Dpstry>

<Pty1>

<Id>

<AnyBIC> Dans le cas d'une mobilisation, renseignez le BIC du custodian délivrant le titre que vous mobilisez (votre custodian vous fournira cette information). Dans le cas d'une démobilisation, renseignez le BIC de la correspondant central bank délivrant le titre que vous démobilisez (ces BICs sont listés en annexe).</AnyBIC>

</Id>

</Pty1>

</DlvrgSttImPties>

<RcvgSttImPties>

<Dpstry>

<Id>

<AnyBIC> Dans le cas d'une mobilisation, renseignez le BIC du CSD de la correspondant central bank recevant le titre que vous mobilisez (ces BICs sont listés en annexe). Dans le cas d'une démobilisation, renseignez le BIC du CSD du custodian recevant le titre que vous démobilisez (ces BICs sont listés en annexe).</AnyBIC>

</Id>

</Dpstry>

<Pty1>

<Id>

<AnyBIC> Dans le cas d'une mobilisation, renseignez le BIC de la correspondant central bank recevant le titre que vous mobilisez (ces BICs sont listés en annexe). Dans le

cas d'une démobilitation, renseignez le BIC du custodian recevant le titre que vous démobilisez (votre custodian vous fournira cette information).</AnyBIC>

```
</Id>  
</Pty1>  
</RcvgSttlmPties>  
</SctiesSttlmTxInstr>  
</Document>
```

3. Exemple d'une instruction de MOB en IBRC :

```
<DlvrgSttlmPties>  
  <Dpstry>  
    <Id>  
      <AnyBIC>IBRCESMMXXX</AnyBIC>  
    </Id>  
  </Dpstry>  
  <Pty1>  
    <Id>  
      <AnyBIC>BSSSESMMXXX</AnyBIC>  
    </Id>  
  </Pty1>  
</DlvrgSttlmPties>  
<RcvgSttlmPties>  
  <Dpstry>  
    <Id>  
      <AnyBIC>IBRCESMMXXX</AnyBIC>  
    </Id>  
  </Dpstry>  
  <Pty1>  
    <Id>  
      <AnyBIC>ESPBESMMCCB</AnyBIC>  
    </Id>  
  </Pty1>
```

Dans cet exemple, IBRCESMMXXX correspond au BIC du CSD de l'entité pour les titres ES.

Dans cet exemple, BSSSESMMXXX correspond au BIC du custodian de l'entité pour les titres ES.

Dans cet exemple, IBRCESMMXXX correspond au BIC du CSD de la Banque d'Espagne.

Dans cet exemple, ESPBESMMCCB correspond au BIC de la Banque centrale d'Espagne.

Expected results:

4. *Montant de collatéral disponible sur le pool de collatéral augmenté (ECMS_TC_CPTY_1) / diminué (ECMS_TC_CPTY_3)*

“The amount of collateral available on the counterparty collateral pool is increased / decreased (if applicable also the credit line in CLM).”

Pour vérifier que le montant de collatéral disponible sur le pool a bien évolué, à la hausse comme à la baisse, se rendre sur MegaLend → Pool Overview puis cliquer sur Search.

Sélectionner le pool de la contrepartie puis cliquer sur View, qui apparaît en bas à droite de votre écran.

The screenshot shows the 'Pool Overview' interface. At the top, there are search filters for Pool Identifier, Pool Reference, Counterparty, Pool Type, Insufficient Collateral, Is Active, Validity Start Date, and Validity End Date. Below the filters is a 'Reset' button and a 'Search' button. The main area displays a 'List Pools Overview' table with 17 columns: Pool Identifier, Pool Type, Counterpart, Total Collat., Total Credit, SCL, ECL, RCL, Collateral E, Insufficient, Is Valuated, ELA Collat., Total ELA C, Is Active, Update Date, Updater User, Is Locked, and Lock Origin. The table contains 7 rows of data, all with 'SCP' as the Pool Type and 'No' for 'Insufficient' and 'Is Valuated'.

| Pool Identifier | Pool Type | Counterpart | Total Collat. | Total Credit | SCL | ECL | RCL | Collateral E | Insufficient | Is Valuated | ELA Collat. | Total ELA C | Is Active | Update Date | Updater User | Is Locked | Lock Origin |
|-----------------|-----------|-------------|---------------|--------------|-----|-----|-----|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-------------|--------------|-----------|-------------|
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 23/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |
| POOL0000... | SCP | | | | | | | | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 22/11/2023 | | No | |

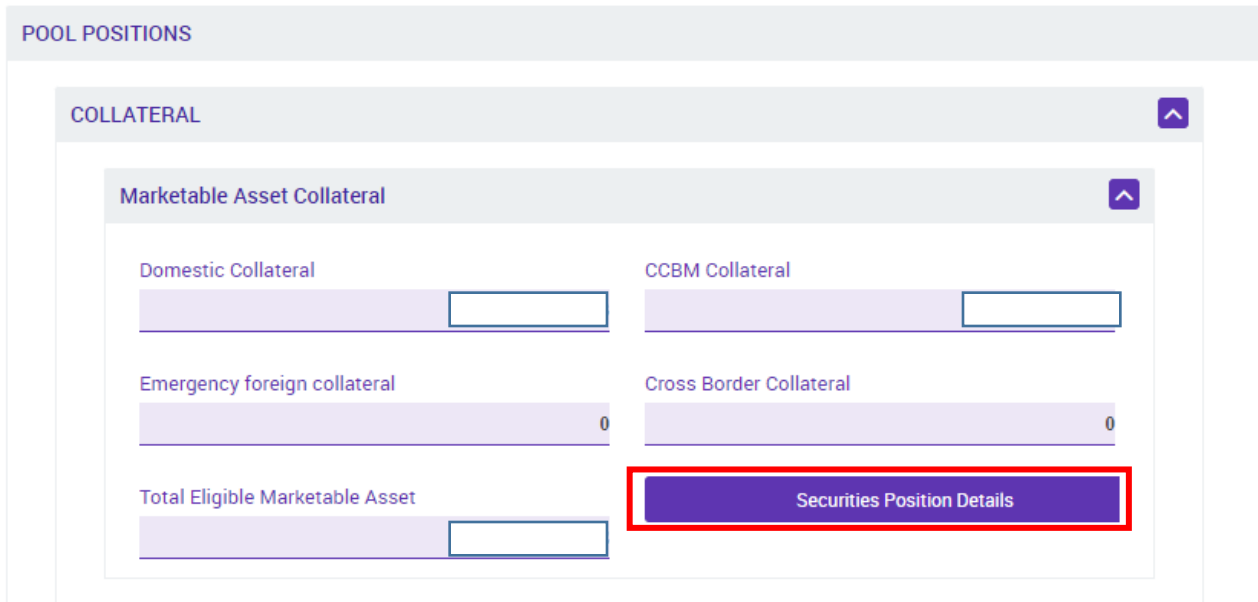
Une fois sur votre pool, retrouver le détail de la dernière modification dans la fenêtre Last Modification Details.

Cette fenêtre indique le détail du dernier mouvement ayant impacté votre pool.

The screenshot shows the 'LAST MODIFICATION DETAILS' window. It contains several fields with their values:

| | | | |
|-------------------------|---|--|-----------------------|
| Update Date | Modification Reason | Last Movement Details | Amount |
| 22/11/2023 19:04:12:232 | Credit/Claim/Valuation | | 0 |
| Pool Variation Amount | MCL Online | CP Online | Last Pool Position ID |
| 0 | 0 | 0 | |
| Position Date | Last Cash Collateral Interest Calcul Date | Last Cash Collateral Mobilization Date | |
| 23/11/2023 | | | |

Une fois sur votre pool, vous pouvez également accéder au détail de vos positions en Marketable Asset Collateral en cliquant sur Securities Position Details.



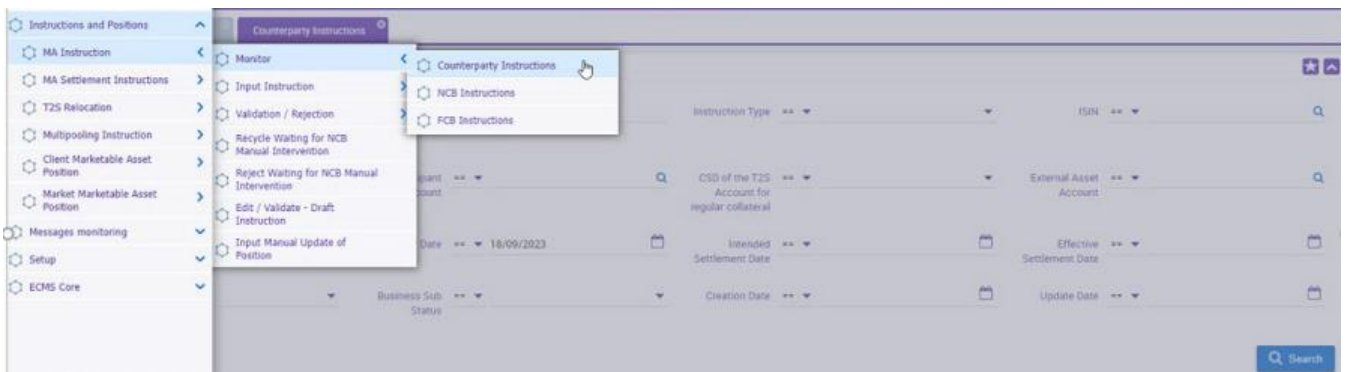
→ Si vous retrouvez le collatéral mobilisé dans cet écran, alors cet *expected result* est obtenu.

5. U2A : Le statut de la (dé)mobilisation est Confirmed :

« U2A: The status of the mobilisation instruction in the in the marketable asset instruction list screen and the marketable asset instruction details screen is “confirmed”. »

Pour vérifier le statut de l’instruction :

Une fois dans Counterparty instructions, cliquer sur Search en bas à droite de votre écran.



Dans la liste des instructions apparaissant, chercher votre instruction et vérifier le statut en colonne Business Status.

Counterparty Instructions

Search: Counterparty MAI

Party's Instruction Reference, Instruction Id, Instruction Type, ISIN, Counterparty, NCB Participant Asset Account, CSD of the T2S Account for regular collateral, External Asset Account, Party CSD, Trade Date, Intended Settlement Date, Effective Settlement Date, Business Status, Business Sub Status, Creation Date, Update Date, Denomination Currency, Settlement Nature

Reset Search

List: Counterparty MAI

100 Page 1 of 3 296

| Party's Ins. | Instructio. | Instructio. | Business St. | Business | Counterpa. | NCB Parti. | ISIN | Quantity | Trade Dat. | Intended S. | Effective S. | CSD of the. | CSD of the. | Party CSD | Party CSD | Being Car. | Creation D. | Updater U. | Update Da. |
|--------------|--------------|-------------|----------------|----------|------------|------------|------|----------|------------|-------------|--------------|-------------|-------------|-----------|-----------|------------|-------------|------------|------------|
| CMS79577... | MAI202311... | Marketable. | Cancelled | | | | | | | | | | | | | | | | |
| CMS79577... | MAI202311... | Marketable. | Cancelled | | | | | | | | | | | | | | | | |
| CMS79577... | MAI202311... | Marketable. | Cancelled | | | | | | | | | | | | | | | | |
| CMS79577... | MAI202311... | Marketable. | Cancelled | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Test-MA-C... | MAI202311... | Marketable. | Sent for Se... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MIFR20231... | MAI202311... | Marketable. | Confirmed | | | | | | | | | | | | | | | | |

Le statut final est le statut Confirmed. Il indique que l'instruction a passé toutes les étapes de validation (cf schéma en annexe).

→Si votre instruction a le statut Confirmed, alors cet *expected result* est obtenu.

6. *A2A: Réception d'un sese.024 avec statut Accepted / d'un sese.024 avec statut "Matched" / d'un sese.025 pour confirmation*

"A2A: The counterparty receives a securities settlement transaction status advice sese.024 with status "accepted".

The counterparty receives a securities settlement transaction status advice sese.024 with status "matched".

The counterparty receives a securities settlement transaction confirmation sese.025 for confirmation"

Pour savoir si le sese.024 reçu a le statut Accepted, il doit contenir la borne :
/Document/SctiesSttlmTxStsAdvC/PrcgSts/AckdAccptd/NoSpCfdRsn

Pour savoir si le sese.024 reçu a le statut Matched, il doit contenir la borne
/Document/SctiesSttlmTxStsAdvC/MtchgSts/Mtchd

→Si vous avez reçu un sese.024 avec statut Accepted, un sese.024 avec statut Matched et un sese.025, alors cet *expected result* est obtenu.

- Annulation d'une (dé)mobilisation de titre domestique (ECMS_TC_CPTY_2 et ECMS_TC_CPTY_4) et transfrontalier (CCBM) :

Une instruction d'annulation peut être envoyée à ECMS en U2A ou A2A avant ou après que l'instruction à annuler ait été envoyée par ECMS à T2S.

Pour rappel, une instruction de (dé)mobilisation envoyée par ECMS à T2S mais n'étant pas encore dénouée aura le statut *Matched* ou *Sent for Settlement*.

Dans le cas où l'instruction a bien été envoyée à T2S par ECMS, l'annulation effective de cette instruction sera suivie de la réception d'un sese.024 Cancelled et d'un sese.027 Executed.

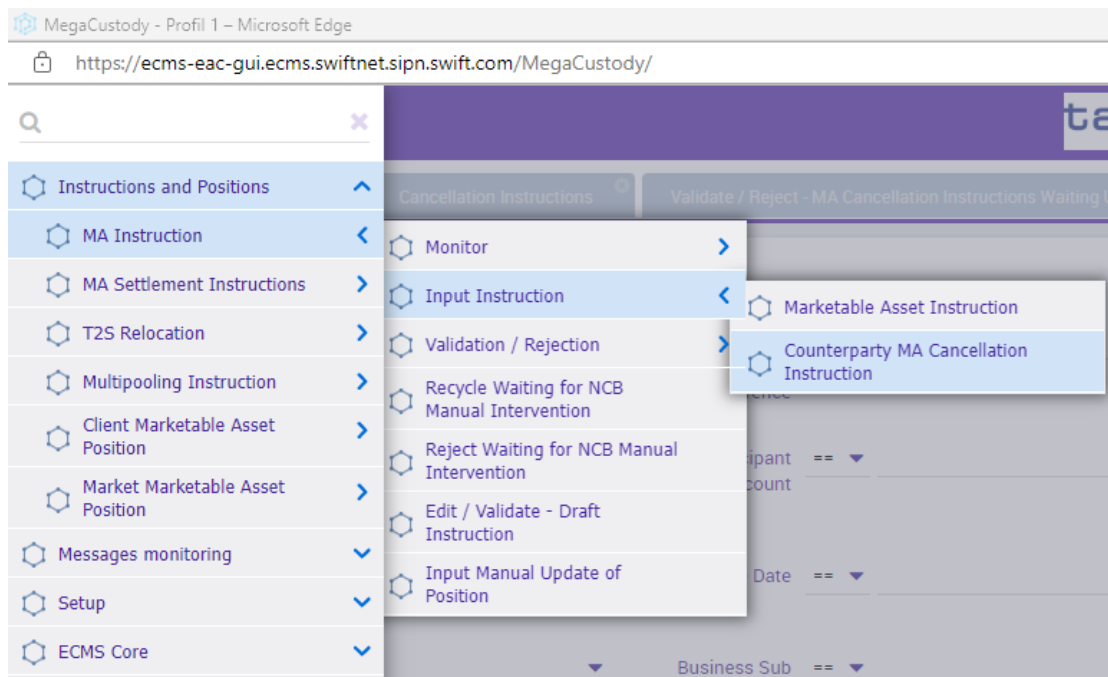
Les cas de test fondamentaux 2 et 4 consistent à tester l'annulation d'une instruction de (dé)mobilisation envoyée par ECMS à T2S.

Une instruction annulée avant envoi de l'instruction par ECMS à T2S ne permettra pas la validation de ces cas de test fondamentaux.

Domestique / Transfrontalier (U2A) :

Dans Megacustody :

Chercher l'instruction via Counterparty MA cancellation instruction :



Cliquez sur Search pour retrouver toutes les opérations instruites :

The screenshot shows the Target ECMS search interface. At the top, there is a navigation bar with the Target ECMS logo and the business date 02/11/2023. Below the navigation bar, there are tabs for 'Counterparty Instructions', 'Cancellation Instructions', and 'Validate / Reject - MA Cancellation Instructions Waiting User Validation'. The main search area is titled 'Search: MA Cancellation Instruction' and contains several search filters: Instruction Id, Party's Instruction Reference, External Asset Account, Instruction Type, Counterparty, NCB Participant Asset Account, ISIN, CSD of the T2S Account for regular collateral, Party CSD, Trade Date, Intended Settlement Date, Effective Settlement Date, Business Status, Business Sub Status, Creation Date, and Update Date. A 'Reset' button is located at the bottom left, and a 'Search' button is at the bottom right.

Sélectionner l'instruction à annuler :

The screenshot shows a table titled 'List: MA Cancellation Instruction'. The table has the following columns: Instruction, Instruction, Business S..., Business S..., NCB Partic..., ISIN, Quantity in..., Trade Date, Intended S..., Effective S..., Party CSD, CSD of the..., Being Canc..., Updater Us..., Update Dat..., Denominat..., Creation Da..., Party's Inst..., and Counterpar... The table contains several rows of data, with the first row highlighted in blue. Below the table, there are buttons for 'History', 'Cancel', and 'View'.

| Instruction | Instruction | Business S... | Business S... | NCB Partic... | ISIN | Quantity in... | Trade Date | Intended S... | Effective S... | Party CSD | CSD of the... | Being Canc... | Updater Us... | Update Dat... | Denominat... | Creation Da... | Party's Inst... | Counterpar... |
|--------------|-------------|-----------------|-----------------|---------------|------|----------------|------------|---------------|----------------|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|-----------------|---------------|
| MAI202311... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202311... | DFP | Validated | Waiting for ... | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | DFP | Validated | Waiting for ... | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MAI202310... | RFP | Sent for Set... | | | | | | | | | | | | | | | | |

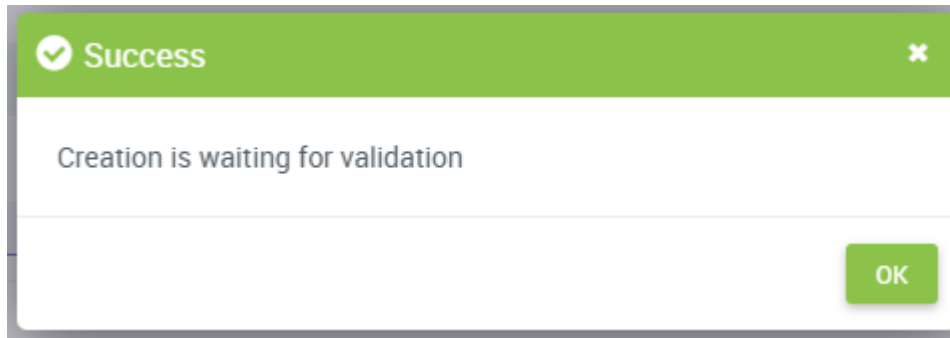
Une fois sélectionnée, l'instruction est bleutée et les boutons History, Cancel et View apparaissent.

Cliquer sur Cancel

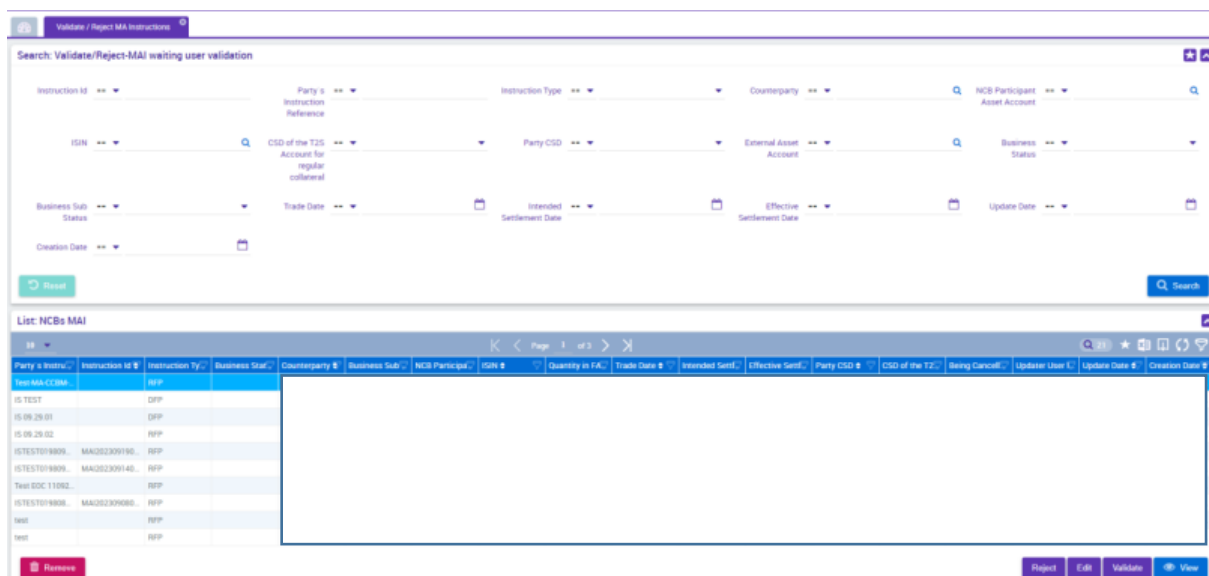
L'écran Input MA Cancellation Instruction apparaît :

The screenshot shows the 'Input MA Cancellation Instruction' form. The form has a title bar with the text 'Input MA Cancellation Instruction' and a close button. Below the title bar, there is a text input field labeled 'Request Reference'. At the bottom of the form, there are two buttons: 'Reset' and 'Save'.

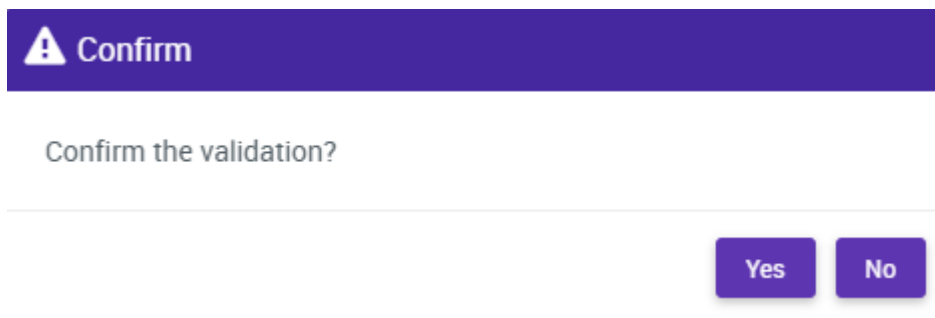
Renseigner une référence sans contrainte puis cliquer sur Save



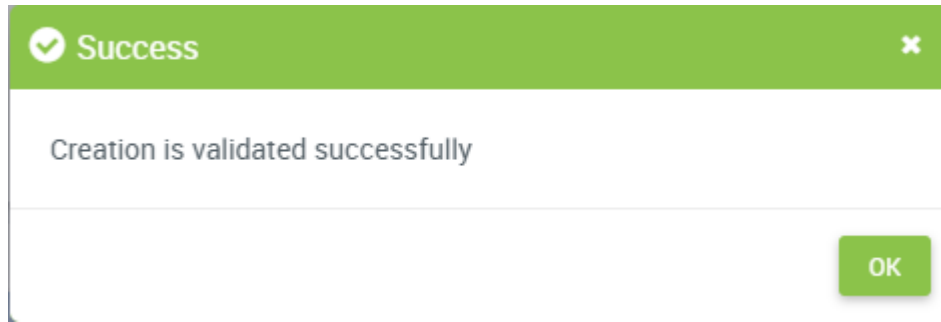
Pour valider l'instruction d'annulation, un autre user doit aller dans Validate / Reject – MA Cancellation Instructions waiting user validation, sélectionner l'instruction à annuler puis cliquer sur Validate.



Cliquer ensuite sur Yes.



L'instruction est bien annulée.



Domestique / Transfrontalier (A2A) :

Uniquement pour les contreparties faisant du A2A

Plus d'informations sur le format des messages et les balises sur :

- Le portail [MyStandard](#) ;
- Le [catalogue of messages](#).

7. *Constitution du general header :*

Les éléments en **rouge** sont à la main de la contrepartie.

```
<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
<Fr>
  <FIId>
    <FinInstnId>
      <BICFI>Counterparty BIC</BICFI>
      <ClrSysMmbld>
        <ClrSysId>
          <Prtry>ECMS</Prtry>
        </ClrSysId>
        <Mmbld>A2A-User-Reference</Mmbld>
      </ClrSysMmbld>
      <Othr>
        <Id>BDFEFR2LXXX</Id>
      </Othr>
    </FinInstnId>
  </FIId>
</Fr>
<To>
  <FIId>
    <FinInstnId>
```

```

        <BICFI>TRGTXE2SXXX</BICFI>
        <Othr>
            <Id>BDFEFR2LXXX</Id>
        </Othr>
    </FinInstnId>
</FIld>
</To>
<BizMsgIdr>Renseigner une reference unique permettant d'identifier le message</BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>sese.020.001.06</MsgDefIdr>
<CreDt>2023-11-23T14:36:13Z</CreDt>
</AppHdr>

```

8. Constitution du corps du message :

Les données de l'instruction d'annulation doivent correspondre aux données de l'instruction à annuler.

Pour retrouver ces données (notamment la référence de l'instruction à annuler), Instructions and positions → Monitor → Counterparty instructions → Search → Champ « Party's Instruction reference »

```

<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.020.001.06">
    <SctiesTxCxlReq>
        <AcctOwnrTxId>
            <SctiesSttlmTxId>
                <TxId>Renseigner la référence de l'instruction à annuler</TxId>
                <SctiesMvmntTp>Renseigner RECE ou DELI</SctiesMvmntTp>
                <Pmt>FREE</Pmt>
            </SctiesSttlmTxId>
        </AcctOwnrTxId>
        <SfkpgAcct>
            <Id>Renseigner le compte sur lequel a eu lieu l'instruction à annuler</Id>
        </SfkpgAcct>
    </SctiesTxCxlReq>
</Document>

```

```

<TxDtIs>
  <FinInstrmId>
    <ISIN>ISIN devant initialement être (dé)mobilisé</ISIN>
  </FinInstrmId>
  -<TradDt>
    <Dt>
      <Dt>Trade date de l'instruction à annuler</Dt>
    </Dt>
  </TradDt>
  <SttlmDt>
    <Dt>
      <Dt>Settlement date de l'instruction à annuler</Dt>
    </Dt>
  </SttlmDt>
  <SttlmQty>
    <Qty>
      <FaceAmt>FAMT devant initialement être
(dé)mobilisé</FaceAmt>
    </Qty>
  </SttlmQty>
  <DlvrSttlmPties>
    <Dpstry>
      <Id>
        <AnyBIC>Reprendre les données de l'instruction à
annuler</AnyBIC>
      </Id>
    </Dpstry>
  </DlvrSttlmPties>
  <RcvgSttlmPties>
    -<Dpstry>

```

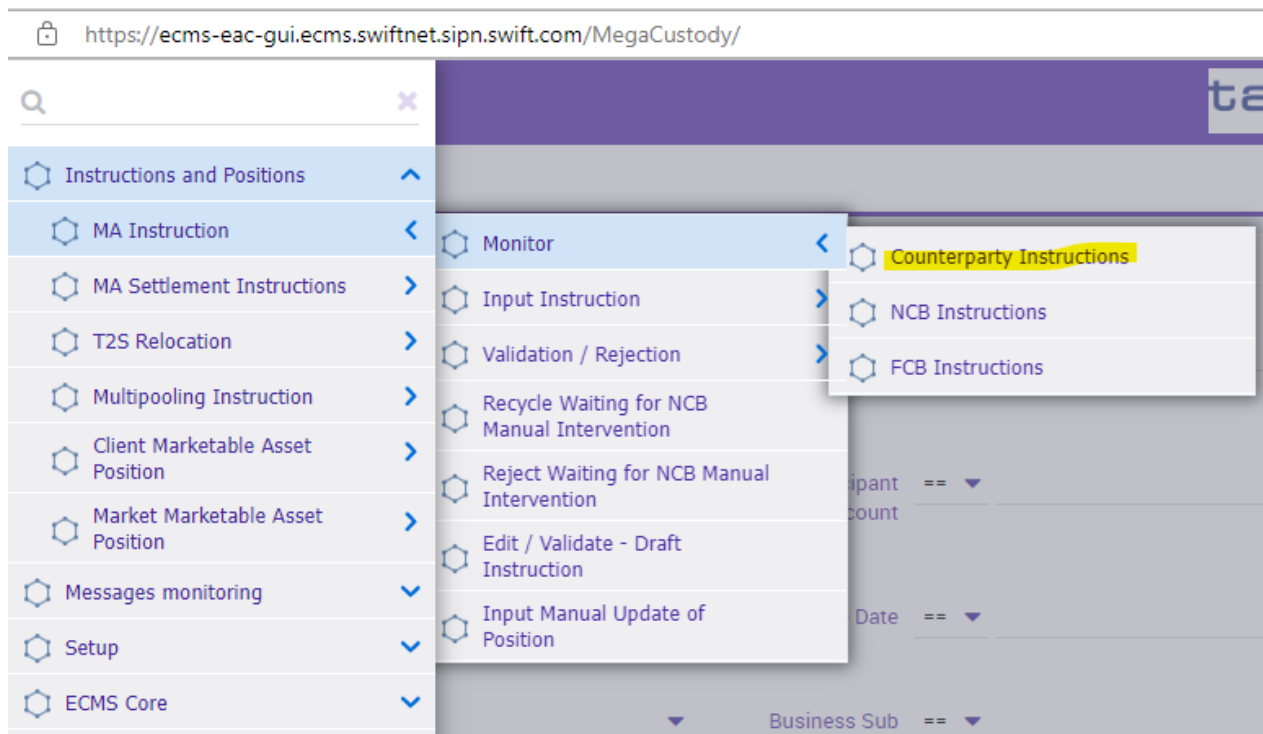
```
                <Id>
                    <AnyBIC> Reprendre les données de l'instruction à
annuler</AnyBIC>
                </Id>
            </Dpstry>
        <Pty1>
            <Id>
                <AnyBIC> Reprendre les données de l'instruction à annuler </AnyBIC>
            </Id>
        </Pty1>
    </RcvgSttlmPties>
</TxDtls>
</SctiesTxCxlReq>
</Document>
```

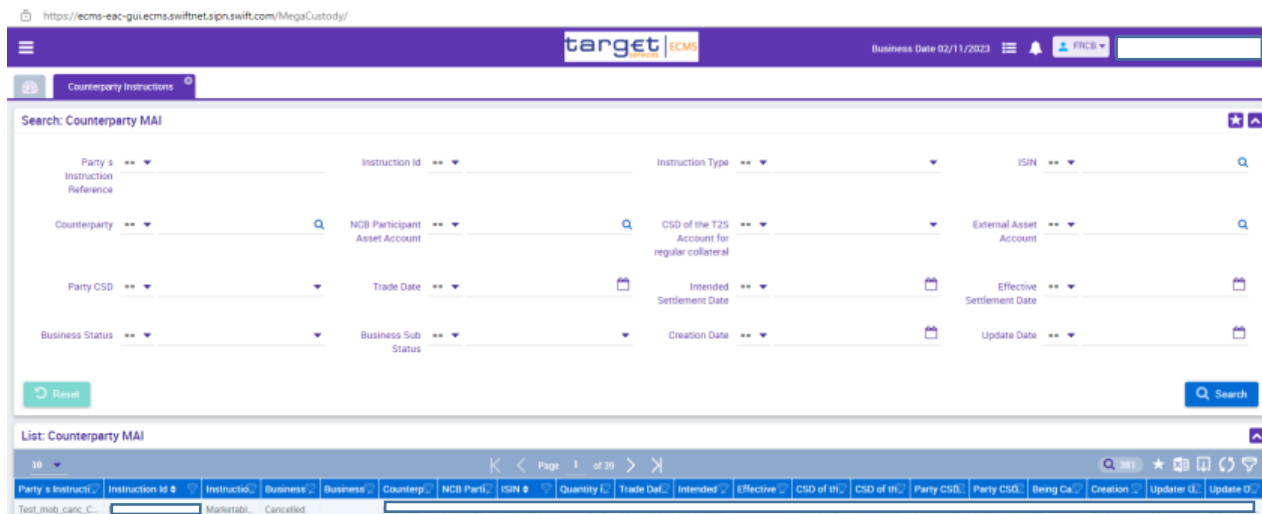
Expected results:

9. U2A : Le statut de l'instruction de mobilisation (ECMS_TC_CPTY_2) / démobilisation (ECMS_TC_CPTY_4) est Cancelled

« U2A: The status of the mobilisation instruction in the marketable asset instruction list screen and the marketable asset instruction details screen is “cancelled”.”

Counterparty Instructions →





→Si le statut de l'instruction de (dé)mobilisation est Cancelled, alors cet *expected result* est obtenu.

10. A2A : La contrepartie reçoit un sese.024 avec statut "Cancelled" ainsi qu'un sese.027 avec statut Executed :

"A2A: The counterparty receives a securities settlement transaction status advice sese.024 with status "cancelled" confirming the cancellation of its mobilisation instruction.

The counterparty receives a securities transaction cancellation request status advice sese.027 with status "executed" in response to its cancellation instruction. »

Pour savoir si le sese.024 reçu a le statut Cancelled, il doit contenir la borne /Document/ScitiesSttlmTxStsAdvC/PrcgSts/Canc

Pour savoir si le sese.027 a le statut Executed, il doit contenir la borne /Document/ScitiesTxCxlReqStsAdvC/PrcgSts/Canc

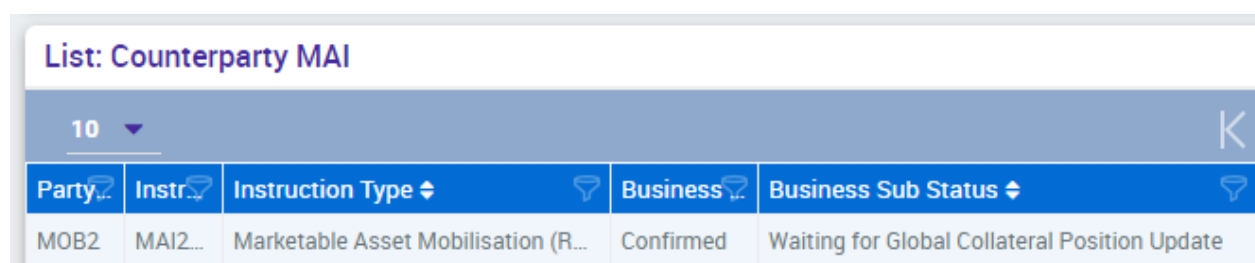
→Si vous avez reçu un sese.024 avec statut Cancelled et un sese.027 avec statut Executed, alors cet *expected result* est obtenu.

- Monitoring d'une instruction :

Une instruction totalement dénouée aura le status Confirmed sans Business Sub Status.

Gestion du Business Sub Status: « Waiting for global collateral position update »:

Le Business Sub Status (BSS) « Waiting for Global Collateral Position Update » résulte d'un dysfonctionnement de l'interconnexion entre CLM et ECMS.



| Party | Instr. | Instruction Type | Business | Business Sub Status |
|-------|---------|-------------------------------------|-----------|---|
| MOB2 | MAI2... | Marketable Asset Mobilisation (R... | Confirmed | Waiting for Global Collateral Position Update |

Figure 1: Exemple d'une instruction avec BSS « Waiting for Global Collateral Position Update »

Dans ce cas, vous ne pourrez pas démobiler le titre que vous avez cherché à mobiliser et inversement puisque l'instruction ne sera pas totalement dénouée.

Effectivement, bien que nous retrouvions la position dans le pool (MegaLend → Pool Overview → Securities Position Details), l'instruction n'impactera pas la ligne de crédit (MegaLend → Pool Overview → Credit Line Details).

→Ce dysfonctionnement est un incident à déclarer en envoyant le template de déclaration d'incident complété en anglais à l'adresse UTEST-ECMS@banque-france.fr.

11. Exemple :

La mobilisation de 15,000,000 de FR0013487238 (réf MAI2024071600226) a le statut Confirmed et le BSS Waiting for Global Collateral Position Update.

Elle présente une Effective Settlement Date au 18/07/2024.

List: Counterparty MAI

10

| Instruction Id | Instruction Type | Business Stat | Business Sub Status | Co | NC | ISIN | Quantity in F | Tr | Int | Effective Set |
|------------------|-----------------------------|---------------|---|-------|-------|--------------|---------------|--------|--------|---------------|
| MAI2024071600226 | Marketable Asset Mobilis... | Confirmed | Waiting for Global Collateral Position Update | FR... | FR... | FR0013487238 | 15,000,000 | 16/... | 16/... | 18/07/2024 |

Nous retrouvons bien la position dans le pool de la contrepartie :

Pool Overview

POOL POSITIONS

COLLATERAL

Marketable Asset Collateral

| | | | |
|---------------------------------|---------------|---|---|
| Domestic Collateral | 16,460,936.27 | CCBM Collateral | 0 |
| Emergency foreign collateral | 0 | Cross Border Collateral | 0 |
| Total Eligible Marketable Asset | 16,460,936.27 | Securities Position Details | |

Search Result : MA Collateral Position

25

| ISIN Code | Asset Positions | CSD | External Asset Ac | Value Before Hair | Collateral Position | Is Eligible | Is Mature | Close Link | Subject To CL | Is Valuated | Position Date | Validity Date |
|--------------|-----------------|-------------|--------------------|-------------------|---------------------|-------------|-----------|------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| FR0013487238 | 15,000,000 F... | FR542058086 | SICVBDFEPR2T121... | 14,535,564 | 14,390,208.36 | Yes | No | No | No | Yes | 15/08/2024 | 31/12/9999 |

Mais l'impact sur la ligne de crédit est au statut « Rejected » :

Pool Overview

CREDIT LINE DETAILS

SCL

15,460,873.77

Insufficient Collateral

No

Credit Line Details

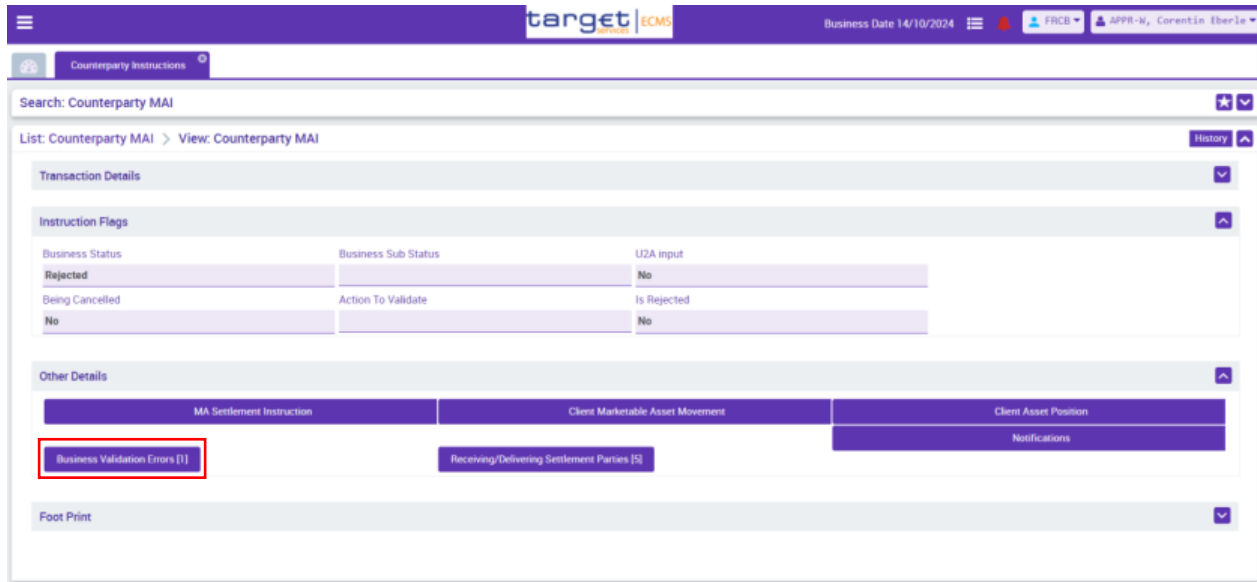
Search Result : Payment and Credit Line Instruction

| T | C | P | Payment Type | New Credit Lin | Credit Line Am | Payment Amou | Currency | Value Date | ECMS Reference | Event Description | Instruction Stat | Status | Update Date | Creation Date | Bundling Refer |
|---|---|---|--------------|----------------|----------------|--------------|----------|------------|------------------|-----------------------------------|------------------|----------|--------------------|--------------------|----------------|
| C | F | F | MCL | 14,336,264.25 | 14,336,264.25 | | EUR | 18/07/2024 | MAI2024071600226 | Marketable Asset (De) Mobilisa... | Rejected | Rejected | 07/07/2024 15:5... | 18/07/2024 15:5... | |

Gestion du statut Rejected :

1. Cas où l'instruction a été rejetée suite à un contrôle réalisé par ECMS :

Dans MegaCustody, Counterparty Instructions, chercher et sélectionner l'instruction dont le statut est à vérifier :



Liste des principales Business Validation Errors rencontrées :

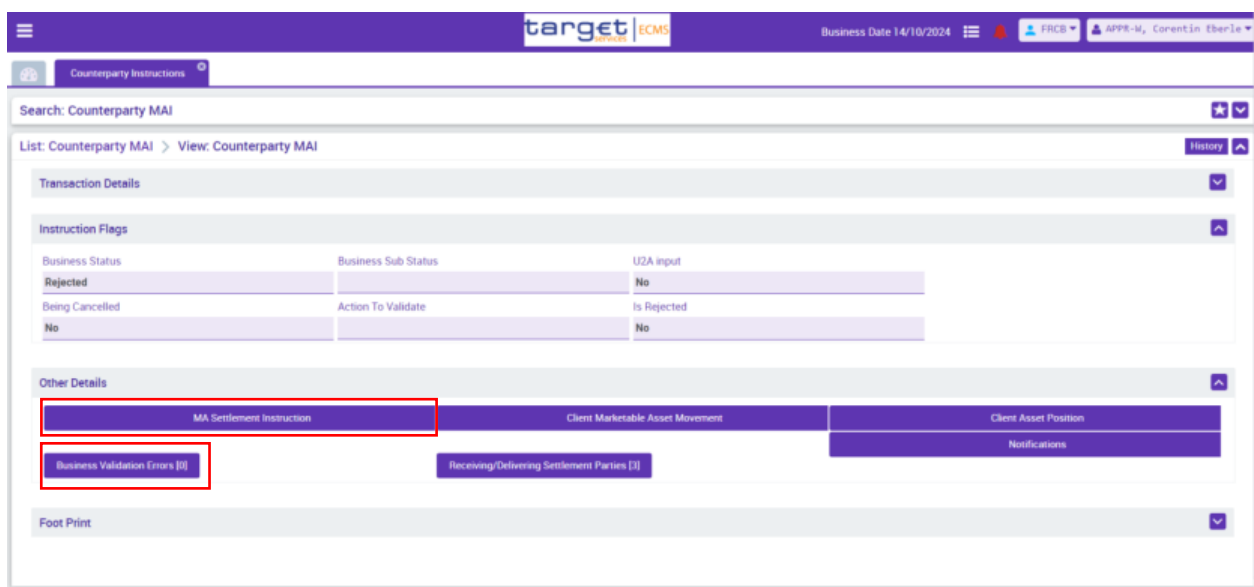
| Référence | Description | Solution |
|-----------|--|--|
| MAIN001 | A (De)mobilisation Instruction already exists in ECMS for the same Account owner and the same instruction reference. | La contrepartie doit saisir une nouvelle instruction avec une nouvelle Party's Instruction Reference. |
| MAIN011 | The Intended Settlement Date is before the date calculated via the predefined system parameter set by the ECMS operator | En cours de definition. |
| MAIN032 | When performing a demobilisation, the asset position must be equal or greater than the quantity informed in the demobilisation instruction | La contrepartie s'assure que la position à démobiliser est bien présente dans le pool de la contrepartie (MegaLend → Pool Overview) à la date à laquelle l'instruction est saisie. |
| MAIN033 | When performing a demobilisation, the settlement possibilities must exist in the ECMS Reference Data. | Cette erreur est obtenue quand la custody chain (soient les CSD via lesquels l'ISIN transite) utilisée n'est pas paramétrée dans ECMS. Action BdF : Vérifier que la custody chain est valide et paramétrée dans ECMS le cas échéant puis demander à la contrepartie de réinstruire en renseignant une custody chain bien paramétrée. |

| | | |
|---------|---|-------------------------------------|
| MAIN037 | The (de) mobilisation instruction has been received after the ECMS cut-off time | Instruire avant l'heure de cut off. |
|---------|---|-------------------------------------|

La liste intégrale des Business Validation Errors est accessible sur le [site de la BCE](#).

2. Cas où l'instruction a été rejetée suite à un contrôle de T2S :

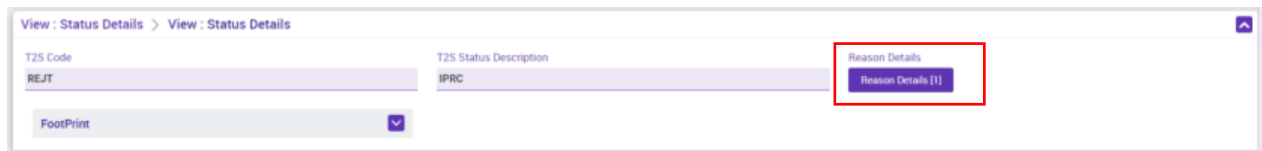
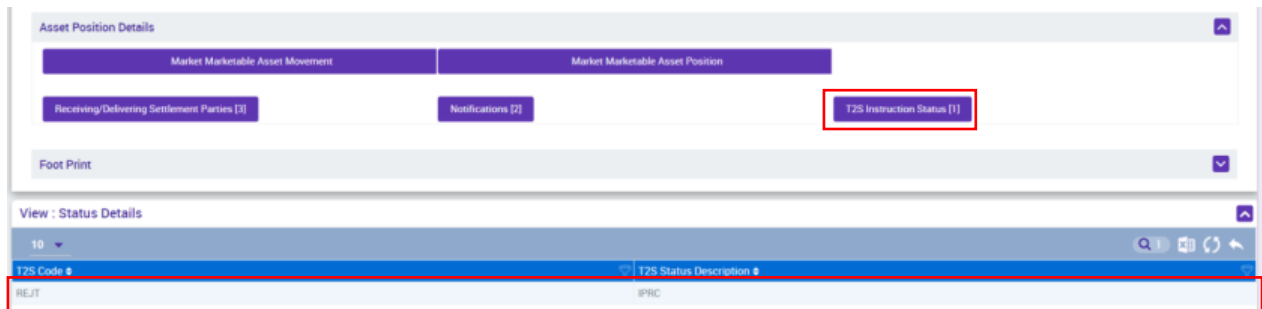
Dans ce cas, Business Validation Errors sera à 0. Il faut donc cliquer sur MA Settlement Instruction.



Puis double-cliquer sur l'instruction qui apparaît :



Cliquer sur T2S Instruction Status puis double cliquer sur la ligne qui apparaît pour avoir plus d'information :



Liste des T2S Codes :

| Message Reason Code Word | Reason Narrative | Solution |
|--------------------------|--|---|
| DSEC | MVIC315 - The ISIN Code of the Settlement Instruction is not eligible for settlement in the receiving CSD. | La contrepartie doit valider avec le CSD que l'ISIN utilisé est éligible. |
| SETR | MVCP085 - The sender of the Settlement Instruction is not authorised to send a Settlement Instruction using this ISO Transaction Code. | Attente retour BCE (JIRA ECMSQA1-649) |
| SAFE | MVCV002 - The Receiving Securities Account does not exist in T2S. | La contrepartie doit valider avec son custodian que le Party Account est bien lié au Party BIC renseignés dans l'instruction. |

Liste des T2S codes accessible dans les [UDFS T2S](#).

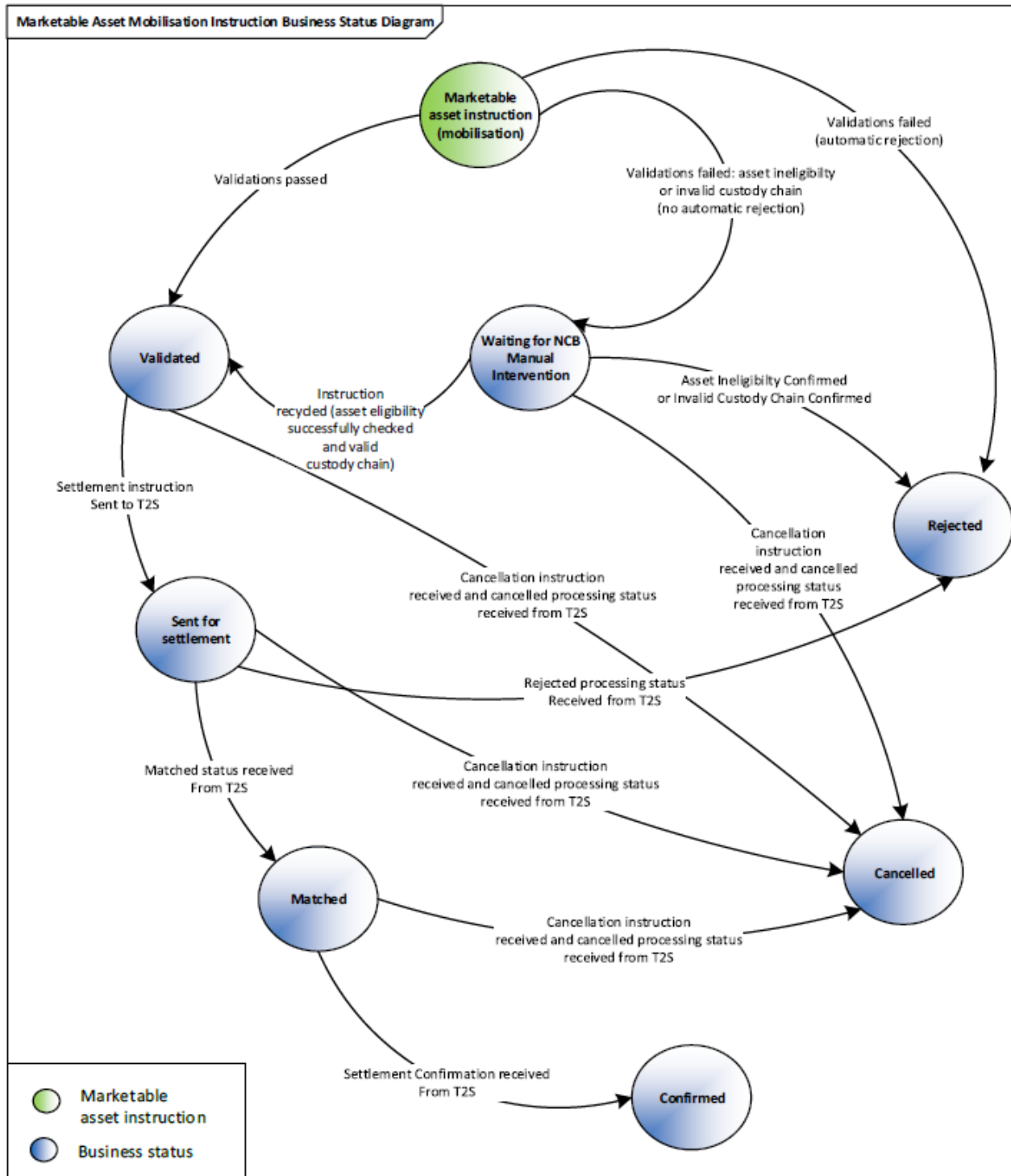
- Annexes :

Point de vue de l'agent qui a instruit une annulation (il ne pourra pas rejeter ou valider) :

The screenshot shows the 'target ECMS' web application interface. The browser address bar displays 'https://ecms-utest-gui.ecms.swiftnet.sipn.swift.com/MegaCustody/'. The page title is 'Validat / Reject - MA Cancellation Instructions Waiting User Validation'. The search criteria are set to 'Release/Reject On hold Notification'. Below the search filters, there is a 'List : Failed Notifications' table with the following data:

| Notification Name | Message Identifier | Direction | Notifications Status | Error Description | Update Date | Creation Date |
|---------------------------------------|--------------------|-----------|----------------------|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 20/11/2023 11:06:25:977 | 20/11/2023 11:06:25:977 |
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 11/09/2023 11:42:15:012 | 11/09/2023 11:42:15:012 |
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 08/09/2023 12:40:00:142 | 08/09/2023 12:40:00:142 |
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 08/09/2023 12:38:14:921 | 08/09/2023 12:38:14:921 |
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 06/09/2023 14:54:54:708 | 06/09/2023 14:54:54:708 |
| ManualCancellationRequestNotification | | In | WaitingValidation | | 06/09/2023 11:39:10:718 | 06/09/2023 11:39:10:718 |

Schéma des différents statuts possibles suite à une (dé)mobilisation :



Informations des différents CSDs et BCNs :

| Country code | Relevant for U2A | | | Relevant for A2A | | Central Bank |
|--------------|---|--|------------------------|------------------------------------|-------------|-------------------------------------|
| | CSD of the T2S Account for regular collateral | CSD Name | External Asset Account | CSD BIC | NCB BIC | |
| AT | AT0000181225903 | OeKB CSD GmbH | ATFRMAPOEKB | OCSDATWWXXX | NABAATWWXXX | CCBM Oesterreichische Nationalbank |
| BE | BE0203201340 | NBBE | BEFRMARNBBE | NBBEBEBB216 | ECMSBEBBCCB | CCBM Nationale Bank van België |
| BE | BE0429875591 | Euroclear Bank | BEFRMARMGTC | MGTCBE2SXXX | ECMSBEBBCCB | CCBM Nationale Bank van België |
| DE | DE05722 | CBF | DEFRMAPDAKV | DAKVDEFFXXX | MARKDEFFCCB | CCBM Deutsche Bundesbank |
| ES | ESA82695677 | Iberclear | ESFRMARIBRC | IBRCESMMXXX | ESPBESMMCCB | CCBM Banco de Espana |
| FI | FI10614460 | Euroclear Finland | FIFRMAPAPKE | APKEFIHHXXX | SPFBFIHHXXX | CCBM Suomen Pankki |
| FR | FR542058086 | Euroclear France | - | SICVFRPPXXX | BDFEFR2TXXX | CCBM Banque de France |
| IE | BE0429875591 | Euroclear Bank | IEFRMAPECLR | no CCBM: via Euroclear Bank | | CCBM Central Bank of Ireland |
| IT | IT0000139338170 | ES-MIL | ITFRMAPMOTI | MOTIITMMXXX | BITAITRRXXX | CCBM Banca d'Italia |
| LU | LURCSB0154449 | CSD LU LuxCSD S.A. | LUFMAPLUXC | LUXCLULLXXX | BCLXLULLXXX | CCBM Banque centrale du Luxembourg |
| NL | NL813943073B016 | Euroclear Nederland | NLFRMAPNECI | NECINL2AXXX | FLORNL2AXXX | CCBM DeNederlandscheBank |
| PT | PT502962275 | Euronext Securities Porto | PTFRMAPIBLS | IBLSPTPPXXX | BGALPTPLXXX | CCBM Banco de Portugal |
| SI | SI5893194000 | KDD (Full name: KDD - Centralna klirinško depotna družba, d.d.) | SIFRMARKDDS | KDDSSI22XXX | BSLJSI2XECM | CCBM Banka Slovenije |

SSIs fournis par Euroclear Bank :

PSET = Euroclear Bank

| Banque Centrale | PSET CSD | SSI's - mobilisations | Type de collatéral |
|------------------------------|----------------|---|--|
| Banque Nationale de Belgique | Euroclear Bank | T2S Receiving Party = ECMSBEBBCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = MGTCBE2SXXX | - ESCB eligible assets for which Euroclear Bank is Issuer CSD (Eurobonds & Irish Bonds) - ESCB eligible assets for which Euroclear Bank has a direct Eurosystem eligible link: OeKB (Austria), NBB-SSS (Belgium, Euronext Secs Copenhagen(Denmark), Euroclear Finland (Finland), Euroclear France (France), CBF (Germany), BOGS (Greece), Euronext Secs Milan (Italy), LuxCSD (Luxembourg), Euroclear Nederland (the Netherlands), CDCP (Slovakia), KDD (Slovenia), and CSD Prague (Czech Republic) |
| Central Bank of Ireland | Euroclear Bank | T2S Receiving Party = IRCEIE2DCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = MGTCBE2SXXX | |
| De Nederlandsche Bank | Euroclear Bank | T2S Receiving Party = FLORN2AXXX T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL Buyer = <i>ECMS Counterpart BIC</i> PSET = MGTCBE2SXXX | |

PSET = autres CSDs en T2S :

| Banque Centrale | PSET CSD | SSI's - mobilisations |
|-------------------------------|---------------------|---|
| Banque de France | Euroclear France | T2S Receiving Party = BDFEFR2T121 / BDFEFR2T282 (*) T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = SICVFRPPXXX |
| De Nederlandsche Bank | Euroclear Nederland | T2S Receiving Party = FLORN2AXXX T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL Buyer = <i>ECMS Counterpart BIC</i> PSET = NECINL2AXXX |
| Suomi Pankken | Euroclear Finland | T2S Receiving Party = SPFBFIHHXXX T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = APKEFIHHXXX |
| Banque Nationale de Belgique | NBB-SSS | T2S Receiving Party = ECMSBEBBCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = NBBEBEBB216 |
| Banque Centrale du Luxembourg | LuxCSD | T2S Receiving Party = BCLXLULLCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = LUXCLULLXXX |

| | | |
|-------------------------------|------|---|
| Deutsche Bundesbank | CBF | T2S Receiving Party = MARKDEFFCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET= DAKVDEFFXXX |
| Oesterreichische Nationalbank | OeKB | T2S Receiving Party = NABAATWWCCB T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET = OCSDATWWXXX |

Disponible à partir d’Août 2024 (date provisoire) – Espagne, Italie, Portugal

| Banque Centrale | PSET CSD | SSI’s – mobilisations (<i>information provisoire</i>) |
|-------------------|---------------------------|---|
| Banco d’Espana | Iberclear | T2S Receiving Party =ESPBESMMCCB T2S Delivering Party = BSSSESM2XXXX PSET = IBRCESMMXXX |
| Banca d’Italia | Euronext Securities Milan | T2S Receiving Party = BITAITRRXXX T2S Delivering Party = MGTCBEBEECL PSET =MOTIITMMXXX |
| Banco de Portugal | Euronext Securities Porto | T2S Receiving Party = BGALPTTGXXX T2S Delivering Party = PARBFRPPXXX PSET =IBLSPTPPXXX |

Exemples de sese.023 en CBL :

Les messages ci-dessous sont à compléter d'un Business Application Header, pour lequel des indications sont données ci-dessus (cf Constitution du general header).

Les messages ci-dessous sont des extraits d'ECMS d'instructions A2A faites par des contreparties dans le cadre de leurs tests, il est donc possible que ces messages doivent être adaptés aux contraintes de votre entité.

Les textes en **rouge** sont à compléter par la contrepartie.

3. Sese.023 de démobilitation en CBL pour titres autres que LU et XS :

<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">

<SctiesSttlmTxInstr>

<TxId> référence unique pour identifier l'instruction </TxId>

<SttlmTpAndAddtlParams>

<SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp>

<Pmt>FREE</Pmt>

</SttlmTpAndAddtlParams>

<TradDtls>

<TradDt>

<Dt>

<Dt>Date au format aaaa-mm-jj</Dt>

</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtls>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN autre que LU et XS</ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtls>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>

</QtyAndAcctDtls>

```
<SttImParams>
<SctiesTxTp>
<Cd>TRAD</Cd>
</SctiesTxTp>
<SttImTxCond>
<Cd>NOMC</Cd>
</SttImTxCond>
</SttImParams>
<DlvrgSttImPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
</DlvrgSttImPties>
<RcvgSttImPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>DAKVDEFFXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
```

```
<Pty1>
<Id>
<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Pty1>
</RcvgSttlmPties>
</SctiesSttlmTxInstr>
</Document>
```

4. *Sese.023 de mobilisation en CBL pour titres autres que LU et XS :*

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">
<SctiesSttlmTxInstr>
<TxId> reference unique pour identifier l'instruction </TxId>
<SttlmTpAndAddtlParams>
<SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp>
<Pmt>FREE</Pmt>
</SttlmTpAndAddtlParams>
<TradDtls>
<TradDt>
<Dt>
<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>
```


</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtIs>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN autre que LU et XS</ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtIs>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>

</QtyAndAcctDtIs>

```
<SttImParams>
<SctiesTxTp>
<Cd>TRAD</Cd>
</SctiesTxTp>
<SttImTxCond>
<Cd>NOMC</Cd>
</SttImTxCond>
</SttImParams>
<DlvrgSttImPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>DAKVDEFFXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
<Pty1>
<Id>
<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Pty1>
</DlvrgSttImPties>
<RcvgSttImPties>
```

```
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
</RcvgSttlmPties>
</SctiesSttlmTxInstr>
</Document>
```

5. *Sese.023 de démobilisation en CBL pour titres LU :*

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">
<SctiesSttlmTxInstr>
<TxId> reference unique pour identifier l'instruction </TxId>
<SttlmTpAndAddtlParams>
<SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp>
<Pmt>FREE</Pmt>
</SttlmTpAndAddtlParams>
<TradDtIs>
<TradDt>
<Dt>
```

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtls>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN LU </ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtls>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>

```
</QtyAndAcctDtls>
<SttImParams>
<SctiesTxTp>
<Cd>TRAD</Cd>
</SctiesTxTp>
<SttImTxCond>
<Cd>NOMC</Cd>
</SttImTxCond>
</SttImParams>
<DlvrGSttImPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
</DlvrGSttImPties>
<RcvGSttImPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>
</Id>
```

```
</Dpstry>
<Pty1>
<Id>
<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Pty1>
</RcvgSttlmPties>
</SctiesSttlmTxInstr>
</Document>
```

6. Sese.023 de mobilisation en CBL pour titres LU :

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">
<SctiesSttlmTxInstr>
<TxId> reference unique pour identifier l'instruction </TxId>
<SttlmTpAndAddtlParams>
<SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp>
<Pmt>FREE</Pmt>
</SttlmTpAndAddtlParams>
<TradDtIs>
<TradDt>
```

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtIs>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN LU </ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtIs>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>
</QtyAndAcctDtIs>
<SttlmParams>
<SctiesTxTp>
<Cd>TRAD</Cd>
</SctiesTxTp>
<SttlmTxCond>
<Cd>NOMC</Cd>
</SttlmTxCond>
</SttlmParams>
<DlvrgSttlmPties>
<Dpstry>
<Id>
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
<Pty1>
<Id>
<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Pty1>


```
</DlvrgSttlmPties>  
<RcvgSttlmPties>  
<Dpstry>  
<Id>  
<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>  
</Id>  
</Dpstry>  
</RcvgSttlmPties>  
</SctiesSttlmTxInstr>  
</Document>
```

7. Sese.023 de démobilisation en CBL pour titres XS :

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">  
<SctiesSttlmTxInstr>  
<TxId> reference unique pour identifier l'instruction </TxId>  
<SttlmTpAndAddtlParams>  
<SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp>  
<Pmt>FREE</Pmt>  
</SttlmTpAndAddtlParams>  
<TradDtls>
```

<TradDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtIs>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN XS </ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtIs>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>

</QtyAndAcctDtls>

<SttlmParams>

<SctiesTxTp>

<Cd>TRAD</Cd>

</SctiesTxTp>

<SttlmTxCond>

<Cd>NOMC</Cd>

</SttlmTxCond>

</SttlmParams>

<DlvrgSttlmPties>

<Dpstry>

<Id>

<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>

</Id>

</Dpstry>

</DlvrgSttlmPties>

<RcvgSttlmPties>

<Dpstry>

<Id>

```
<AnyBIC>CEDELULLCPI</AnyBIC>
</Id>
</Dpstry>
<Pty1>
<Id>
<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>
</Id>
</Pty1>
</RcvgSttlmPties>
</SctiesSttlmTxInstr>
</Document>
```

8. Sese.023 de mobilisation en CBL pour titres XS :

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:sese.023.001.09">
<SctiesSttlmTxInstr>
<TxId> reference unique pour identifier l'instruction </TxId>
<SttlmTpAndAddtlParams>
<SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp>
<Pmt>FREE</Pmt>
</SttlmTpAndAddtlParams>
```

<TradDtIs>

<TradDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</TradDt>

<SttlmDt>

<Dt>

<Dt> Date au format aaaa-mm-jj </Dt>

</Dt>

</SttlmDt>

</TradDtIs>

<FinInstrmId>

<ISIN>ISIN XS </ISIN>

</FinInstrmId>

<QtyAndAcctDtIs>

<SttlmQty>

<Qty>

<FaceAmt>Quantité</FaceAmt>

</Qty>

</SttlmQty>

<SfkpgAcct>

<Id>Numéro de compte titres; commence par votre code RIAD</Id>

</SfkpgAcct>

</QtyAndAcctDtls>

<SttlmParams>

<SctiesTxTp>

<Cd>COLI</Cd>

</SctiesTxTp>

<SttlmTxCond>

<Cd>NOMC</Cd>

</SttlmTxCond>

</SttlmParams>

<DlvrgSttlmPties>

<Dpstry>

<Id>

<AnyBIC>CEDELULLCPI</AnyBIC>

</Id>

</Dpstry>

<Pty1>

<Id>

<AnyBIC>CEDELULLXXX</AnyBIC>

</Id>

</Pty1>

</DlvrgSttImPties>

<RcvgSttImPties>

<Dpstry>

<Id>

<AnyBIC>LUXCLULLXXX</AnyBIC>

</Id>

</Dpstry>

</RcvgSttImPties>

</SctiesSttImTxInstr>

</Document>