

TEST MANAGER CALL

Réunion de suivi

ARC – DMPM – DGSO

10 octobre 2024

POINT D'ACTUALITÉ

Annulation du TMC du 24/10/2024

Release ECMS:

- ▶ Release RN-38.01-14.3.1 le 05/10/2024. Elle comportait 61 correctifs dont 8 pour la BdF.

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.
- ▶ En revanche, les notations ICAS datent du 24 septembre 2024. Le chargement automatique avec les nouvelles notations devrait reprendre demain.
- ▶ SERI24100713516

POINT D'ACTUALITÉ

CRM – gestion des demandes SERI

- ▶ Afin de faciliter la gestion des demandes SERI à venir, la Banque de France procède actuellement à la clôture des demandes issues des précédentes phases de test et n'étant plus vérifiables en raison des purges des données transactionnelles ayant eu lieu en environnement de pré-Production.
- ▶ La Banque de France vous informera lors de la clôture de votre demande SERI.
- ▶ Dans le cas où vous rencontrez un blocage déjà rencontré précédemment, merci de le déclarer à l'adresse UTEST-ECMS via une nouvelle demande et non via une référence SERI existante.

Publications Banque de France

- ▶ (SERI240904133807) [ECMS] Publications de la BCE et de la Banque de France sur l'harmonisation des règles de gestion des garanties de l'Eurosystème dans le cadre du lancement d'ECMS
- ▶ ECMS Final Release Note – Extranet / Assistance Banque de France
 - ECMS Final Release Note RN-37.01-14.2.X_v1.1
 - ECMS Final Release Note RN-37.02-14.2.X_v1.0

ACTUALITÉ RELATIVE AUX TESTS

La dernière version des ECMS Testing Conditions a été publiée le 25/09/2024 sur le site ECMS Professional use

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>

POINT D'ACTUALITÉ

Activités des contreparties en Production

Une communication a été diffusée le 23 septembre 2024, **SERI240923134599**, pour informer les contreparties que l'environnement de Production d'ECMS a été inhibé depuis cette date.

Une phase complémentaire sera prévue pour permettre aux contreparties des ajustements en pré-Migration selon la nouvelle date de la Mise en production d'ECMS.

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

- **Fin de la campagne de tests OST**
- **En attente du nouveau planning de testing en APPR suite au décalage de Go-Live.**

**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)mobilité 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.
- ▶ 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

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

Point sur la migration

- ▶ Les PBI-143165 et INC-144456, provoquant des écarts de valorisation entre la PROD et ECMS, sont clos:
 - Les positions non ou mal valorisées ne seront pas corrigées mais l'origine des écarts a été identifié.
- ▶ 20 positions retrouvées dans ECMS ne provenaient pas de positions issues de la production (en date du 19/09)
 - 5 positions sur des 047: proviennent du penny test réalisé dimanche 22/09
 - 15 positions sur des 052:
 - Proviennent d'instructions de relocation venant de T2S vers ECMS APPR;
 - Elles ont été valorisées le 20/09 et des paiements cash ont été générés le 23/09 par ECMS.

▶ La plupart des écarts constatés lors de l'exercice 11 de migration proviennent du fait qu'il y a des écarts entre environnements de tests et de production des différentes composantes (ECMS, T2S, C2D EA pour la valorisation, etc). Ces écarts n'auront pas lieu lors de la MEP d'ECMS puisque les données utilisées viendront toutes du même environnement, à savoir celui de production.

Point sur les tests

- ▶ Certaines instructions de (dé)mobilisation restent en statut Sent for settlement malgré un rejet de l'instruction par T2S:
 - INC-145413 pour suivre ce sujet, en attente d'un retour des 4CB.

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: Non ouverts aux tests

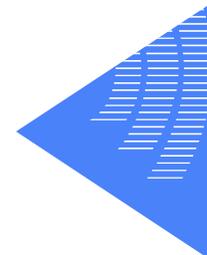
Place de dénouement	Statut
Pays-Bas (Euroclear Nederland)	CTP2E: Tests concluants
Portugal (Euronext Securities Porto)	CTP2E: Tests concluants
Slovénie (CSD SI)	CTP2E: Ouverts aux tests

+1

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

+1

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>	<i>19/10/2024</i>
134038	Medium	<i>Multiple issues with internal transfer of CCs</i>	<i>19/10/2024</i>
142309	Low	<i>VNCB Task Asses credit claim eligibility FAILED: Transfer pending but positions and pool updated</i>	<i>05/10/2024</i>
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 en cours

- ▶ Périmètre : MRO, LTRO et LTRO ER, FTD, USD (< 7 and >7 days)
- ▶ A ce jour:
 - MRO 20550001 SETTLED le 08/10, arrivera à maturité demain 11/10
 - FTD 20550002 : sera chargé et réglé aujourd'hui
 - USD 20250003 : réglé ce matin.
 - LTRO 20250004 : chargé le 08/11 (1 soumission non chargée, ticket en cours), sera réglé demain.
 - USD 20250005 : réglé hier 09/10, arrivera à maturité le 17/10.

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	<i>MPO Expected Payment - Netted payment ID is empty</i>	19/10/2024
131841	Medium	<i>Netting results - remove the reference to ML contract and ML Movement</i>	TBD
142508	Medium	<i>variation in interest amount between Provisional Interest in EUR and Accrued Interest</i>	05/10/2024
142484	Medium	<i>ECB current OMO campaign - UTEST - OMO 20240091 not received</i>	05/10/2024
142366	Low	<i>MPO Expected Payment Status "Netted" instead of Instructed and settled</i>	05/10/2024
142330	Medium	<i>concurrency when impacting the direct payment</i>	05/10/2024
142120	Medium	<i>Unjustified interest amounts appearing in the pool after closing of OMO operations</i>	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

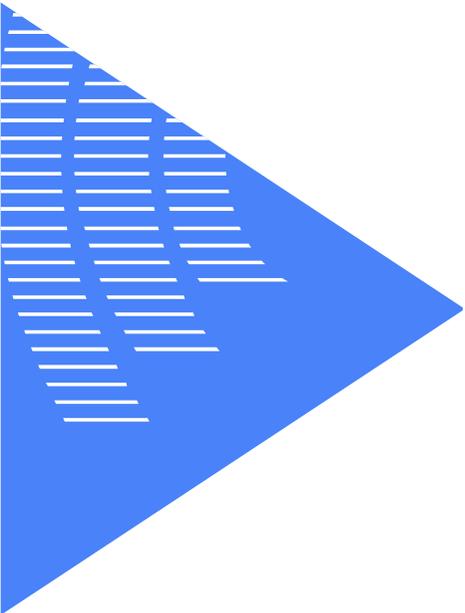
DONNÉES RÉFÉRENTIELLES / REFERENCE DATA ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

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 CPTY</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

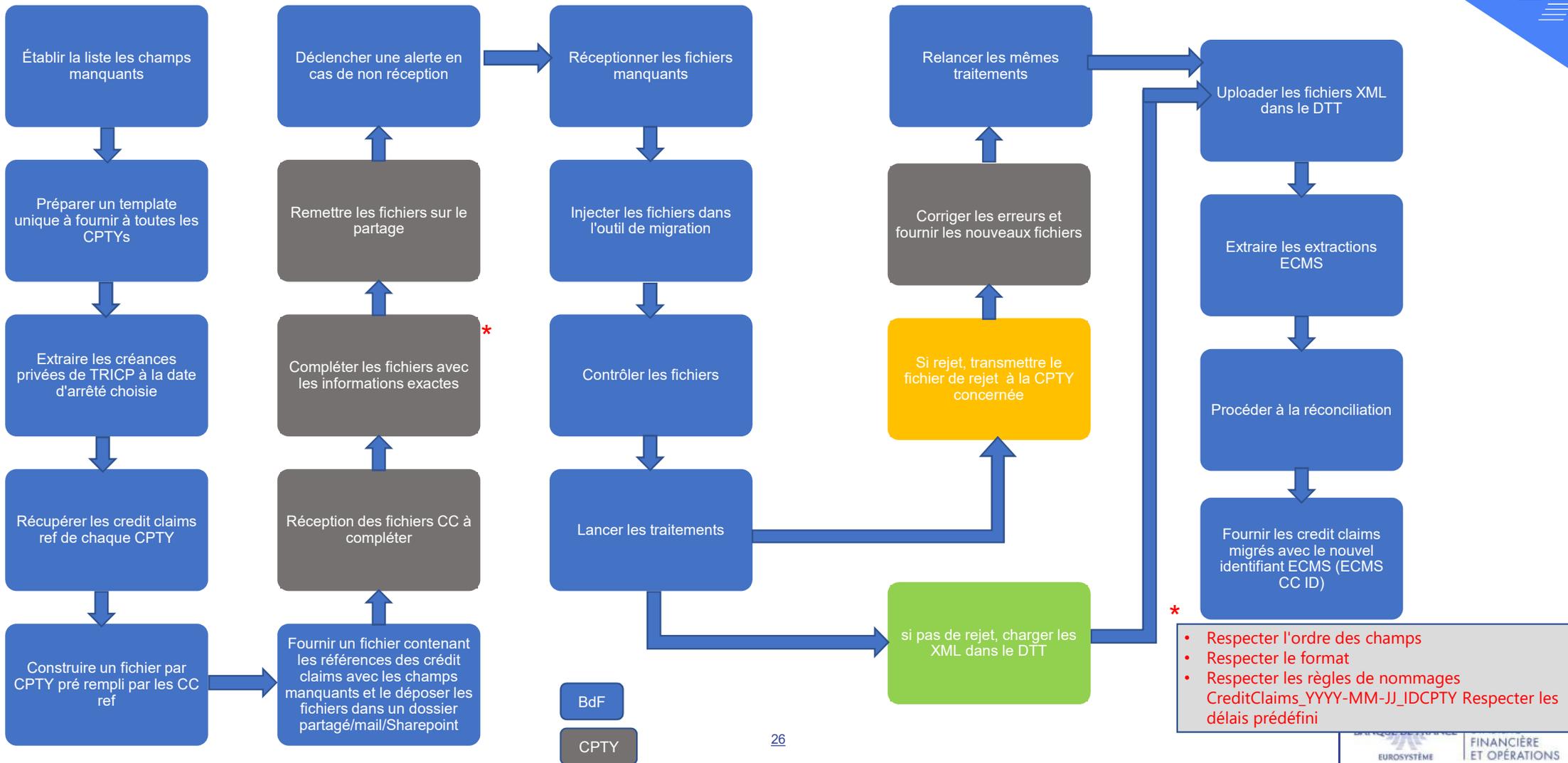
DONNÉES RÉFÉRENTIELLES / REFERENCE DATA ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

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