



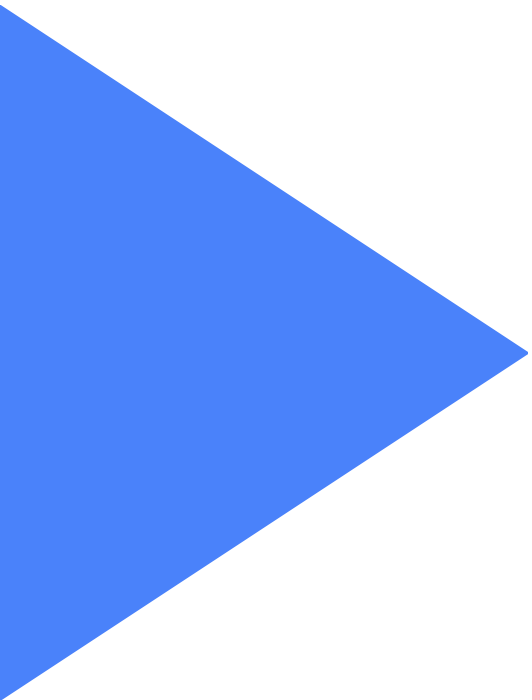
FORMATION DONNÉES RÉFÉRENTIELLES

ALEXIS BABAI
ARC – DMPM – DGSO

OBJECTIF

L'objectif de la formation est de présenter les données référentielles ECMS :

- Données référentielles relatives aux Participants et aux Utilisateurs,
- Données référentielles relatives aux Comptes,
- Données référentielles relatives aux Pools.



DONNÉES RÉFÉRENTIELLES DU PARTICIPANT

LA NOTION DE PARTICIPANT ECMS

Participant (ECMS Party) : un Participant est une entité configurée dans le référentiel de l'application et interagissant avec ECMS pour y effectuer des opérations de gestion du collatéral et des opérations de crédit.

Il y a plusieurs types de Participants ECMS :

- L'opérateur ECMS
- Les Banques centrales nationales,
- Les Entités ECMS.

La catégorie Entités ECMS contient elle-même plusieurs types d'acteurs :

- Les Dépositaires centraux de titres,
- Les Contreparties.

Pour qu'une contrepartie soit configurée dans ECMS, il faut qu'elle soit d'abord créée comme participant, puis qu'on lui attribue le rôle fonctionnel de contrepartie.

Le **périmètre de données (Data scope)** désigne les objets de donnée référentiels et dynamiques dont le Participant est responsable.

Par défaut, un Participant a uniquement accès aux données qui lui sont rattachées, et peut seulement consulter et faire des opérations sur ces données (Par défaut, le Participant CACEIS ne peut pas faire d'opérations sur les données du Participant Crédit Agricole).

La **fonctionnalité de Proxy** permet d'étendre le périmètre de données d'un Participant A à un Participant B, afin de permettre aux utilisateurs rattachés au Participant A de réaliser des opérations sur les données du Participant B.

LA NOTION DE CONTREPARTIE

La contrepartie est le Participant ECMS auquel appartient le pool ou le compte faisant l'objet de l'opération. Lorsqu'une opération est effectuée dans ECMS, le pool de la contrepartie est modifié.

La contrepartie et le Participant à l'origine de l'instruction ne sont pas forcément les mêmes : dans le cadre de la fonctionnalité du Proxy, les utilisateurs d'un Participant ont la possibilité d'effectuer des opérations pour le compte d'un autre Participant, si ce Participant appartient au périmètre de données du Participant auquel l'utilisateur est rattaché.

Ainsi, si on étend le périmètre de données de BPCE à Société Générale, les utilisateurs de BPCE pourront voir et faire des opérations sur les données de Société Générale.

LA CRÉATION DES PARTICIPANTS ET DES CONTREPARTIES

Pour qu'un Participant puisse se connecter à ECMS et effectuer des opérations, il doit être configuré dans le référentiel de l'application.

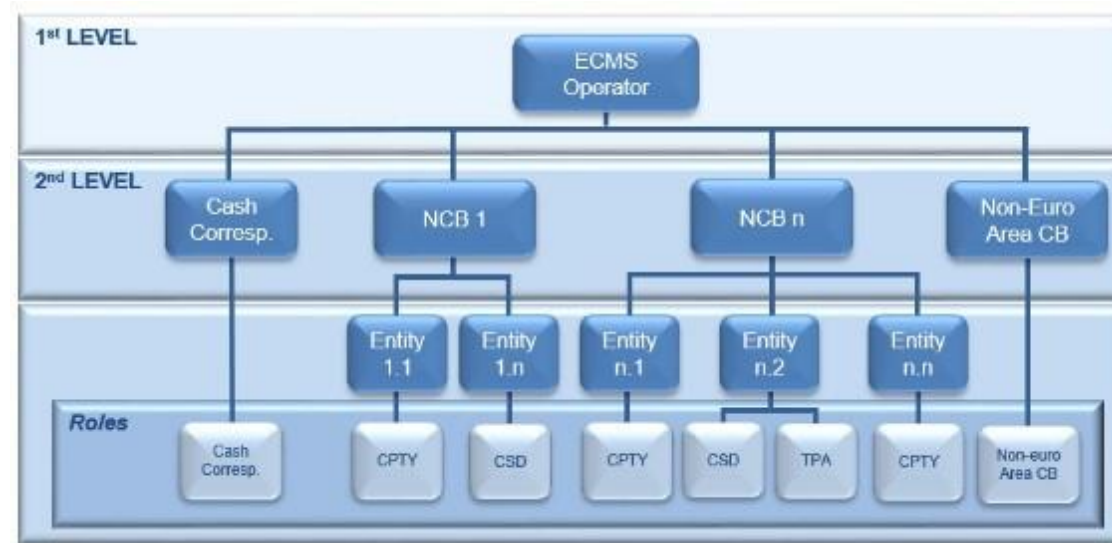
La création du Participant dans ECMS, et l'attribution du rôle de Contrepartie s'effectue sur la base des Registration Forms d'une part, et des données extraites des systèmes locaux de gestion du collatéral d'autre part.

Les Registration Forms sont un formulaire permettant de collecter un certain nombre d'informations nécessaires à la création de la contrepartie dans le référentiel, en particulier :

- les données d'identification de l'établissement de crédit,
- les données d'adresse,
- les données de connectivité.

Les autres données nécessaires à la configuration de la contrepartie (pools, comptes) sont elles extraites du système de gestion de collatéral de la Banque de France, elles ne sont donc pas collectées via le Registration Form.

MODÈLE HIÉRARCHIQUE DES PARTICIPANTS



PARTICIPANT (CREATE/DISPLAY PARTIES)

Create/Display Parties

Create / Display : Parties

Search Result : Parties > View : Party

GENERAL INFORMATION

Party RIAD Code

FR12345

Party Name

Contrepartie TEST

Party Short Name

Contrepartie TEST

Country Code

FR|FRANCE

Party Type

ECMS ENTITY

Address Details [7]

Additional Codes [1]

Contact Information [1]

BIC

CTPYBICBCMS

Party Internal Id

368913

Parent Tenant

FRCB

Activation Details

Is Active

Yes

Validity Start Date

10/01/2025

Validity End Date

(De)Activation Reason

Validation details

Action To Validate

Rejected

No

Foot Print

Party RIAD Code : identifiant de base de la contrepartie dans ECMS pour toutes les opérations de gestion du collatéral et des opérations de crédit , doit être unique. Pour les établissements de crédit français, la nomenclature est FR+CIB (par exemple FR30003).

Party Name : dénomination de la contrepartie, permet d'identifier facilement la contrepartie lors de la consultation dans les écrans.

Party Short Name : fixé par la Banque de France à partir du Party Name.

Country Code : pays de résidence du participant, FR pour les contreparties de la Banque de France.

Party Type : type de Participant, toujours « ECMS Entity » pour les contreparties.

BIC code : Ce code BIC est utilisé pour identifier le Participant dans le cadre de certaines opérations dans ECMS, notamment en mode A2A.

Party Internal Id : Identifiant interne généré par ECMS à la création du Participant.

Parent Tenant : Banque centrale mettant ayant configuré le Participant.

CODE ADDITIONNEL LEI (DÉTAIL ADDITIONAL CODES)

Lors de la création du Participant, il est possible de spécifier des codes additionnels d'identification des Participants, pour l'heure le LEI. Donnée non utilisée par ECMS

The screenshot displays a web application interface for managing parties. The main header is 'Create/Display Parties'. Below it, there are navigation links: 'Create / Display : Parties', 'Search Result : Parties > View : Party', and 'View: Additional Code > View : Additional Code'. The 'View: Additional Code' section is active, showing two input fields: 'Provider' with the value 'LEI' and 'Additional Codes' with the value 'LEIFICTIF'. Below these fields is a 'Foot Print' section containing a table with the following data:

Creation Date	Creation User Id	Update Date
10/01/2025 16:41:55:451	FRCB-AB-USER-validator	10/01/2025 16:41:55:451

Below the table, there is an 'Updater User Id' field with the value 'FRCB-AB-USER-validator'.

Provider : LEI - seul code configurable actuellement.

Additional Codes : valeur du LEI

DETAIL ADRESSE – ADRESSE POSTALE DU PARTICIPANT

Lors de la création du Participant, il est possible de spécifier une adresse postale au niveau du Participant.

Create/Display Parties

Create / Display : Parties

Search Result : Parties > View : Party

Address Details

View : Mail Address Details

Purpose

Official

Street Address

ROUTE DE PARIS

House Number

1

Postal Code

67000

City

STRASBOURG

State or Province

GRAND EST

Country Code

FR/FRANCE

Foot Print

Creation Date

10/01/2025 16:41:55:451

Creation User Id

FRCB-AB-USER-validator

Update Date

10/01/2025 16:41:55:451

Updater User Id

FRCB-AB-USER-validator

ECMS utilise cette adresse : l'application dispose d'une fonctionnalité de production de relevés de portefeuilles (statement of holdings, semt.002) et de transactions (statement of transactions, semt.017 et semt.018) dit « officiel », en format pdf. Ces relevés se présentent sous la forme d'une lettre, adressée à la contrepartie. **L'adresse fournie dans la lettre s'appuie sur cette table.**

PRÉCISION SUR LA FONCTIONNALITÉ DE RELEVÉS OFFICIELS PDF

Cette fonctionnalité a été demandée afin de pouvoir **générer des relevés de portefeuilles et de transactions en format pdf pour répondre à des obligations légales ou réglementaires.**

Les relevés en format pdf se présentent **sous la forme d'une lettre** qui donne la liste des actifs mobilisés (relevé de portefeuilles) ou des opérations en cours (relevé de transactions).

La lettre spécifie l'adresse de la contrepartie : **ECMS se sert de l'adresse renseignée dans cette table.**

En termes d'information, **ECMS fournit les mêmes informations dans les relevés officiels que dans les relevés en U2A** (sur les écrans, exportables en format excel) **et en A2A** (semt.002, semt.017, semt.018).

La génération et la récupération des relevés de portefeuilles et des relevés de transactions officiels s'effectue via le module Reference Data d'ECMS, sur des écrans dédiés aux Statement of holdings official et aux Statement of transactions official.

INFORMATION DE CONTACT DES PARTICIPANTS (DÉTAIL CONTACT INFORMATION)

Lors de la création du Participant, il est possible de spécifier des contacts. Il s'agit de personnes employées de la contrepartie. ECMS ne fait pas d'utilisation particulière de ces informations.

The screenshot displays a web application interface for managing parties. The main section is titled 'Contact Information' and contains several input fields for contact details. Below this, there is a 'Foot Print' section with fields for creation and update dates and user IDs.

Contact Information		
Contact Name Prénom NOM	Email2	Fax
	Email prenom.nom@contrepartie.fr	Telephone 0033123456789
Function / Business area		

Foot Print		
Creation Date 10/01/2025 16:41:55:451	Creation User Id FRCB-AB-USER-validator	Update Date 10/01/2025 16:41:55:451
Updater User Id FRCB-AB-USER-validator		

Contact Name : Prénom NOM

Email : Adresse électronique du contact

Fax : Fax du contact

Fonction / Business Area : Fonction du contact

Telephone : Numéro de téléphone du contact.

GROUPE BANCAIRE

Lors de la création du Participant, il est possible de spécifier un **Banking Group Manager**, dans le cadre de la fonctionnalité ECMS du Groupe Bancaire (Banking Group).

Cette fonctionnalité est propre à ECMS, il n'y a pas de lien avec les Groupes bancaires dans T2 et T2S.

Cette fonctionnalité permet aux utilisateurs rattachés au Participant qui est Banking Group Manager de visualiser les pools des entités rattachées au Groupe Bancaire, et d'avoir accès à une information consolidée sur la situation du pool des contreparties rattachées au Groupe Bancaire. La fonctionnalité de Groupe bancaire fonctionne uniquement en consultation seule.

Exemple : si HSBC Malta est rattaché au Banking Group dans HSBC France est Banking Group Manager, les utilisateurs rattachés à HSBC France pourront consulter non seulement le pool de HSBC France mais aussi celui de HSBC Malta via des écrans dédiés.

2

DONNÉES RÉFÉRENTIELLES COMPTES

TYPES DE COMPTES DANS ECMS

ECMS maintient différents types de comptes

Comptes d'actifs internes

- Utilisés pour enregistrer les positions de collatéral
- Comptes ouverts et gérés directement dans ECMS

Comptes d'actifs externes

- Utilisés pour le dénouement des instructions Titres.
- Comptes ouverts et enregistrés dans les livres des Dépositaires centraux de titres et configurés dans T2S
- Doivent tout de même être configurés dans ECMS, pour refléter les positions de marché et afin qu'ECMS réalise des contrôles fonctionnels

Comptes espèces externes

- Utilisés pour le dénouement des opérations en espèces et la liquidité intrajournalière
- Comptes ouverts dans les livres de la BCN et gérés dans des systèmes externes, tels CLM.
- Doivent tout de même être configurés dans ECMS, afin qu'ECMS les utilise pour envoyer des ordres de paiement. En revanche, ECMS n'en enregistre pas les soldes

COMPTES D'ACTIFS INTERNES DE CONTREPARTIE

- Comptes que les Contreparties ouvrent dans les livres de leur Banque centrale de refinancement, utilisés dans ECMS pour mobiliser du collatéral.
- Le propriétaire du compte est la Contrepatrie. Le teneur de compte est la BCN agissant en tant que Banque centrale de refinancement.
- Ces comptes peuvent détenir soit des positions de collatéral titres ou des positions de collatéral créance privée, mais pas les deux dans le même compte.
- La technique de collatéralisation utilisée lors de la mobilisation est renseignée (Pledge, Repo). Seule une technique de collatéralisation est utilisée pour chaque compte.

COMPTES D'ACTIFS INTERNES DE CONTREPARTIE

Create/Display Parties

Create/Display Users

Create/Display Internal Asset Account

Search: Internal Asset Accounts

List : Internal Asset Accounts > View : Internal Asset Account

Account Details

Account Reference	Account Name	Account Owner
FR12345MAP	Compte-titres Contrepartie TEST	FR12345 Contrepartie TEST
Account Servicer	Account Type	Asset Category
FR30001	ECMS Counterparty Asset Account	MARKETABLE ASSETS ACCOUNT
Collateralisation technique	Account Owner BIC	
PLEDGE	CTPYBICBCMS	

Activation details

Is Active	Validity Start Date	Validity End Date
Yes	10/01/2025	

Validation details

Action To Validate	Rejected
	No

ADDRESS DETAILS

ADDRESS DETAILS [0]

Foot Print

Account Reference : Référence du compte d'actifs interne, doit être renseignée lors de la mobilisation/démobilisation de l'actif

Account Name : Utilisé pour décrire le compte

Account Owner : Propriétaire du compte (la contrepartie)

Account Servicer : la BCN

Account Type : Type de compte, ici un compte d'actif interne de contrepartie

Catégorie d'actif : soit titres uniquement, soit créances privées uniquement

Technique de collatéralisation : Pledge/Repo, a une incidence sur les contrôles effectués sur les instructions titres.

Account Owner BIC : BIC du propriétaire du compte (BIC défini au niveau du Participant obligatoirement).

COMPTES D'ACTIFS ECMS CROSS-BCN

- Comptes que la BCN de refinancement ouvre dans les livres d'une autre Banque centrale nationale afin de matérialiser la mobilisation de collatéral via le canal CCBM. Ces comptes détiennent les positions que la Banque centrale correspondante détient en faveur de la Banque centrale de refinancement.
- En effet, via le canal CCBM, Les actifs sont déposés dans un compte T2S ouvert par la Banque centrale correspondante dans les livres du dépositaire étranger (pour les Titres) ou sont conservés par la Banque centrale correspondante dans ses propres livres (pour les Créances privées).
 - Ainsi, si une contrepartie souhaite mobiliser des titres espagnols, le plus souvent, elle doit les livrer à Iberclear dans un compte détenu par la Banque d'Espagne au nom de la Banque de France. Le compte cross-BCN titres matérialise ces positions.
 - Si une contrepartie souhaite mobiliser des créances privées espagnoles, elle doit les transférer à la Banque d'Espagne qui les conserve au nom de la Banque de France. Le compte cross-BCN créances privées matérialise ces positions.
- Ces comptes sont configurés par la BCN correspondante. La BCN de refinancement doit également configurer le compte en tant que compte miroir dans son propre périmètre de données.

COMPTES D'ACTIFS ECMS DE BANQUE CENTRALE HORS ZONE EURO

- Comptes que des banques centrales hors zone euro ouvrent dans les livres d'une BCN et qui sont utilisés pour recevoir des actifs dans le cas d'un accord de refinancement d'une Banque centrale hors zone euro par l'Eurosystème.
- Ces comptes détiennent les positions que la Banque centrale hors zone euro détient dans les livres de la BCN qui la refinance

COMPTES D'ACTIFS INTERNES DE BCN

- Comptes ouverts par les BCNs dans leurs propres livres.
- Ces comptes sont utilisés pour enregistrer les actifs dont la propriété n'est pas clairement établie, ou en cas de réalisation du collatéral. Les BCN peuvent transférer des actifs détenus sur un autre compte vers ce type de compte via le Multipooling.

COMPTES D'ACTIFS EXTERNES

- Il y a deux types de comptes d'actifs externes :
 - les comptes titres ouverts par les Dépositaires dans T2S (Securities Account T2S),
 - les comptes d'actifs cross-BCN miroir (dans le cadre du CCBM).
- Ces comptes titres sont dits externes parce qu'ils ne sont pas directement gérés dans ECMS mais sont la simple référence à des comptes existants hors ECMS (dans le cas des SAC T2S) ou parce qu'ils sont le reflet de comptes existants dans ECMS mais ouverts dans le périmètre d'une autre BCN (dans le cas des comptes d'actifs cross-BCN pour le CCBM).

TYPES DE COMPTES TITRES EXTERNES DANS ECMS

ECMS maintient différents types de comptes

Comptes titres pour le collatéral régulier

- Comptes titres où la contrepartie transfère les titres pour la mobilisation classique de collatéral et la neutralisation
- Ouverts au nom de la BCN (repo) ou de la Contrepartie (pledge). Peut être omnibus ou individuel. Le teneur de compte est le Dépositaire central.
- Utilisés pour envoyer les instructions de règlement-livraison de titres et pour refléter les positions titres mobilisées dans T2S (positions dites marchés)

Comptes titres pour le collatéral tripartite

- Comptes titres ouverts par les Dépositaires centraux de titres dans T2S où les titres mobilisés par un Agent Tripartite sont transférés ou gagés.
 - Utilisés pour refléter les positions de tripartite et pour réaliser des contrôles ex-post

Comptes titres pour l'autocollatéralisation intrajournalière

- Comptes-titres ouverts par les Dépositaires centraux de titres dans T2S détenant les positions intrajournalières de titres mobilisées par la fonctionnalité d'auto-collatéralisation
 - utilisés pour refléter les positions d'auto-collatéralisation de fin de journée.

COMPTES D'ACTIFS EXTERNES

Create/Display External Asset Account

Create / Display : External Asset Account

Search Result : External Asset Account > View: External Asset Account

Account Reference

SICVBICNCBFRXXX

Account Name

T2S Securities Account Nostro

Account Owner

FR12345

Account Servicer

FR542058086|CSD FR Euroclear France

T2S Account Owner BIC

BICNCBFRXXX

Account Type

T2S Securities Account for Regular Collateral

Validity Start Date

13/01/2025

Validity End Date

Validation Details

Action To Validate

Rejected

No

Activation Details

Is Active

Yes

Foot Print

Creation Date

10/01/2025 19:46:41:287

Creation User Id

FRCB-AB-USER-validator

Update Date

10/01/2025 19:46:41:287

Updater User Id

FRCB-AB-USER-validator

COMPTES D'ESPÈCES EXTERNES

- ECMS utilise divers types de comptes espèces externes pour le dénouement des opérations en espèces et pour fournir de la liquidité intra-journalière.
- Ces comptes espèces sont des comptes ouverts dans les livres de la BCN dans CLM et dans T2S ou à des comptes-espèces en devise ouverts dans les livres d'un correspondant espèce. Ainsi, un compte espèce n'est pas un compte ouvert dans ECMS mais juste la référence à un compte existant hors ECMS.

TYPOLOGIES DE COMPTES ESPÈCES EXTERNES DANS ECMS

Comptes CLM

- Les comptes CLM sont des comptes ouverts dans les livres de la BCN dans CLM.
- Leur propriétaire peut être la BCN ou une de ses contreparties (auquel cas il s'agit d'un Main Cash Account).
- Les comptes CLM sont principalement utilisés par ECMS pour le dénouement de paiements destinés à fournir ou absorber de la liquidité. ECMS est responsable de la gestion de la ligne de crédit des MCA des contreparties utilisés pour le crédit intrajournalier.

DCA T2S

- Les T2S DCA sont des comptes espèces ouverts dans les livres de la BCN dans T2S.
- Ces comptes sont utilisés pour la réception des paiements des CSD concernant les OST sur les titres détenus dans les SAC T2S (de la BCN).
- Ils sont également utilisés par ECMS pour retrouver le compte de la contrepartie impacté en cas de neutralisation, suite au non-remboursement de la liquidité fournie à ces DCA T2S dans le cadre de la fonctionnalité d'auto-collatéralisation dans T2S.

Comptes espèces non euro

- Ces comptes sont des comptes ouverts dans les livres des correspondants espèces.
- Ces comptes sont principalement utilisés par ECMS pour notifier en U2A les utilisateurs de la nécessité de procéder à des paiements en devises, ces paiements n'étant pas pris en charge par ECMS.

Comptes espèces de contingence

- Ces comptes sont des comptes ouverts dans les livres de la BCN dans ECONS II.
 - Leur propriétaire peut être la BCN ou une de ses contreparties.
- Ces comptes sont utilisés par ECMS en cas d'activation du mode de contingence de CLM.
- Chaque BCN est responsable de la configuration des comptes espèces de ses contreparties dans le référentiel d'ECMS.

COMPTES ESPÈCES EXTERNES

Create/Display External Asset Account

Create/Display NCB Cash Accounts

Create / Display : NCB Cash Account

Search Result : NCB Cash Account > View : NCB Cash Account

Account Details

Account Reference

CLMMCAFRBDF

Account Name

CLM MCA BDF

Account Currency

EUR

Account Owner

FR30001

Account Servicer

FR30001

Account Type

CLM CB Account

Account Owner BIC

BDFEFR2TXXX

Activation details

Is Active

Yes

Validity Start Date

10/01/2025

Validity End Date

(De)Activation Reason

Validation Details

Action To Validate

Rejected

No

Foot Print

2

DONNÉES RÉFÉRENTIELLES POOLS

POOLS

Pool Overview

List Pools Overview > View : Pool

POOL GENERAL DETAILS

Pool Identifier

FRPL000120001001

Pool Reference

EUOFR12345

Counterparty

FR12345

RTGS ACCESS

No

CLM MCA

CTPYBICBCMS

CLM CB Account

CLMMCAFRBDF

Contingency Cash Account

....

CB Contingency Cash Account

....

Absolute Credit Limit

NCB MaCL

500,000

Counterparty Maximum Credit Line Value

99,999,999,999

LAST MODIFICATION DETAILS

Update Date

13/01/2025 13:12:17:504

Modification Reason

Max Credit Line Update

Last Movement Details

PMLFR00001269684

Amount

500,000

Pool Variation Amount

0

MCL Online

0

CP Online

0

Last Pool Position ID

FRPLP08590473001

Position Date

13/01/2025

Last Cash Collateral Interest Calcul Date

Last Cash Collateral Mobilization Date

Adjusted CL

0

Pool identifier : Identifiant unique du pool dans ECMS, généré par ECMS à la création du pool

Pool Reference : Référence du compte donnée par la Banque centrale de refinancement

Pool Type : Type de pool (parmi les 2 types : Single Collateral Pool ou Emergency Liquidity Assistance)

Counterparty : code RIAD de la Contrepartie à qui le pool appartient.

CLM MCA : Identifiant du CLM MCA à utiliser pour le règlement des opérations de politique monétaire, pour le collatéral espèces et pour la configuration de la ligne de crédit dans le pool.

CLM CB Account : Identifiant du compte CLM de la BCN à utiliser pour le règlement des opérations de politique monétaire, pour le collatéral espèces et pour la configuration de la ligne de crédit dans le pool.

Absolute Credit Limit : Montant maximum de crédit qui peut être accordé à une contrepartie, défini par la BCN en valeur absolue.

Relative Credit Limit : Montant maximum de crédit qui peut être accordé à une contrepartie, défini par la BCN en proportion de la valeur totale de collatéral.

COMPOSITION DÉTAILLÉE DU POOL

Pool Overview	
POOL POSITIONS	
COLLATERAL	
Marketable Asset Collateral	
Domestic Collateral	CCBM Collateral
0	0
Emergency foreign collateral	Cross Border Collateral
0	0
Total Eligible Marketable Asset	Securities Position Details
0	
Externally Managed Collateral	
Credit Claims	Other Collateral
0	0
Total Externally Managed Collateral	EMC Position Details
0	
Cash Collateral	
Total Cash Collateral	
0	
Cash Collateral Positions	
Fixed Term Deposit	
Total FTD used as Collateral	Total FTD used as Collateral Interest
0	0
FTD Positions	
TRIPARTY COLLATERAL	
Total Triparty Collateral	Triparty Securities Position Details
0	
Credit Claims	
Domestic Credit Claim	Domestic ACC
0	0
EXPOSURE	
Credit Freezing	
Total Credit Freezing	
0	
Credit Freezing Position	
Euro LPO	
Total Euro LPO	Total Euro LPO Margin
0	0
Total Euro LPO Interest	
0	
Non-Euro LPO	
Total Non-Euro LPO	Total Non-Euro LPO Margin
0	0
Total Non-Euro LPO Interest	
0	
Marginal Lending Facility	
Total Marginal Lending	Total Marginal Lending Interest
0	0
Total Exposure	
Total Credit	
0	

TYPES D'OPÉRATIONS DE POLITIQUE MONÉTAIRE AUTORISÉES

- Après avoir créé le pool, la BCN doit configurer les types d'opération de politique monétaire auxquels une contrepartie peut accéder et si nécessaire, le pool où ces opérations se matérialisent.

The screenshot displays a web interface for managing authorised monetary policy operations (MPOs). The main title is 'Create/Display Authorised Monetary Policy Operations'. Below it, the search criteria are set to 'Authorised MPOs'. The search results show a single entry for 'Authorised MPOs' with a view of 'Authorised MPOs'. The results are organized into several sections:

- context**:
 - Counterparty: FR12345/Contrepartie TEST
 - Monetary Policy Operation Type: Standard tender operation
- result**:
 - Pool Identifier: FRPL000120001001|FR12345
 - Validity Start Date: 13/01/2025
 - Validity End Date: 31/12/9999
- Validation Details**:
 - Action To Validate: (empty field)
 - Is Rejected: No
- Foot Print**:
 - Creation Date: 10/01/2025 18:44:35:035
 - Creation User Id: FRCB-AB-USER-validator
 - Update Date: 10/01/2025 18:44:35:035
 - Update User Id: FRCB-AB-USER-validator

- Les comptes espèces CLM utilisés pour le règlement des opérations de politique monétaire sont ceux définis au niveau du pool, à l'étape précédente.
- Afin d'identifier de façon univoque le pool couvrant un type d'opération, seule une autorisation peut être valide pour un type d'opération et une contrepartie donnée (autrement dit, le prêt marginal d'une contrepartie ne peut pas être couvert par plusieurs pools différents).

ASSOCIATION COMPTE-POOL

- Les positions de collatéral titres et créances privées mobilisés directement dans ECMS sont détenues dans des comptes d'actifs internes. Pour que ces positions de collatéral soient affectées à un pool, il est nécessaire de lier ces Comptes d'actifs à un pool.

Pool - Counterparty Asset Account Links

List : Pool - Counterparty Asset Account Links > View : Pool - Counterparty Asset Account Link

context

ECMS Counterparty Asset Account Identifier

FR12345CCP

result

Pool Identifier	Validity Start Date	Validity End Date
FR12345 FRPL000120001001	13/01/2025	31/12/9999

Activation Details

Rejected	Action To Validate
No	

Foot Print

- Plusieurs comptes peuvent être liés à un même pool, mais un compte ne peut être lié qu'à un seul pool.

CONFIGURATION DES SYSTÈMES EXTERNES DE GESTION DU COLLATÉRAL POUR UN POOL

- Une partie du collatéral peut être mobilisée en dehors d'ECMS dans le système de gestion local d'une BCN. Avant que ce collatéral géré en externe puisse être affectée à un pool, il est nécessaire de configurer la liste des systèmes de gestion des garanties externes autorisés pour le pool concerné. Cela permet d'affecter une position agrégée de collatéral fournie par un système de gestion de garantie externe à un pool.

The screenshot displays a web interface for configuring external CMS links for a pool. At the top, there are three tabs: 'Create/Display Pool - Cash Collateral Type Links', 'Create/Display Pool - External CMS Link' (which is active), and 'Create/Display Pool - Credit Freezing Type Links'. Below the tabs, the 'Search Criteria' is set to 'EMC Type Link'. The 'Search Result' section shows 'EMC Type Link' with a 'View' button and a 'History' button. The 'context' section contains two fields: 'Counterparty' with the value 'FR12345/Contrepatrie TEST' and 'Em C Type' with the value 'Individual ACC'. The 'result' section contains three fields: 'Pool Identifier' with the value 'FRPL000120001001', 'Validity Start Date' with the value '13/01/2025', and 'Validity End Date' with the value '31/12/9999'. The 'Activation Details' section contains two fields: 'Is Rejected' with the value 'No' and 'Action To Validate' which is empty.

context		
Counterparty	Em C Type	
FR12345/Contrepatrie TEST	Individual ACC	

result		
Pool Identifier	Validity Start Date	Validity End Date
FRPL000120001001	13/01/2025	31/12/9999

Activation Details	
Is Rejected	Action To Validate
No	

- Plusieurs types de garanties gérées en externe peuvent être liés à un pool. De plus, un type de garantie peut être lié à plusieurs pools d'une même contrepartie.

CONFIGURATION DES TYPES DE COLLATÉRAL ESPÈCES AUTORISÉS POUR LE POOL

- Enfin, les espèces remises en garantie peuvent également être prises en compte dans la valeur totale du collatéral d'un pool. Pour pouvoir mobiliser des espèces dans un pool, il est nécessaire de configurer le type d'espèces autorisées comme garantie pour le pool.

The screenshot displays a web application interface for configuring pool collateral types. It features a top navigation bar with two tabs: 'Create/Display Pool - Cash Collateral Type Links' (active) and 'Create/Display Pool - Credit Freezing Type Links'. Below the tabs, there's a search bar with the criteria 'Pool Cash Collat Type Link'. The search results section shows a single entry with the following details:

context		
Pool Identifier	Collateral Asset Id	
FR12345 FRPL000120001001		

result		
Cash Collateral Type	Validity Start Date	Validity End Date
Only Margin Call	13/01/2025	31/12/9999

Foot Print		
Creation Date	Creation User Id	Update Date
10/01/2025 19:09:02:194	FRCB-AB-USER-validator	10/01/2025 19:09:02:194
Update User Id		
FRCB-AB-USER-validator		

Activation Details	
Rejected	Action To Validate
No	

- Les comptes espèces utilisés pour le règlement des espèces mobilisées en garantie sont ceux définis à la création du pool. Un seul type d'espèces peut être configuré pour un pool à un moment donné.

CONFIGURATION DES TYPES DE CRÉDIT RÉSERVÉS COUVERTS PAR UN POOL

- La configuration des types de crédits réservés couverts par un pool est utilisée pour donner l'autorisation à une contrepartie d'accéder à un ou plusieurs types de crédits réservés dans son pool.
- Un crédit réservé désigne un montant réservé de garantie utilisé pour couvrir d'autres objectifs que ceux des Opérations de Politique Monétaire et des crédits intrajournaliers du pool.

Create/Display Pool - Credit Freezing Type Links

Search Criteria : Pool Credit Freezing Link

Search Result : Pool Credit Freezing Link > Edit : Pool Credit Freezing Type Link

context

Counterparty	Credit Freezing Type Identifier
FR12345	DISC

result

Pool Identifier	Validity Start Date	Validity End Date
FRPL000120001001	13/01/2025	31/12/9999

Validation details

Action To Validate	Rejected
	No

Foot Print

Creation Date	Creation User Id	Update Date
10/01/2025 19:10:11:757	FRCB-AB-USER-validator	10/01/2025 19:10:11:757
Update User Id		
FRCB-AB-USER-validator		

- Un pool peut être lié à plusieurs types de crédit réservé. En revanche, un type de crédit réservé ne peut être lié qu'à un seul type de crédit réservé.

CONFIGURATION DE LA LIGNE DE CRÉDIT COUVERTE PAR UN POOL

- La configuration de la ligne de crédit couverte par un pool est requise lorsque les positions de collatéral excédentaires d'un pool (c'est-à-dire le montant de collatéral dépassant les positions de crédit du pool) sont transférées pour être utilisées comme collatéral disponible pour le crédit intrajournalier dans le CLM MCA. Le CLM MCA où la facilité de crédit intrajournalier est accordée est celui défini au niveau du pool.

Create/Display Pool - Credit Line Setup

Search Criteria : Credit Line Setup

Search Result : Credit Line Setup > View: Pool - Credit Line Setup

context

Counterparty
FR12345/Contrepartie TEST

result

Pool Identifier FRPL000120001001	NCB Maximum Credit Line Value 500,000
Validity Start Date 13/01/2025	Validity End Date 31/12/9999

Validation Details

Action To Validate	Is Rejected
	No

Foot Print

- La configuration d'une ligne de crédit est optionnelle. Si aucune ligne de crédit n'est attachée au pool, les garanties excédentaires de ce pool restent inutilisées.
- Une contrepartie ne peut avoir qu'une seule ligne de crédit. La ligne de crédit ne peut être rattachée qu'à un seul pool. Ainsi, si la contrepartie possède plusieurs pools, un seul peut être configuré avec une ligne de crédit.



STABILITÉ
FINANCIÈRE
ET OPÉRATIONS