



TEST MANAGER CALL

Réunion de suivi

ARC – DMPM – DGSO

16 avril 2025

BDF-Public

POINT D'ACTUALITÉ

AGENDA

Live timing:

- ▶ La dernière fenêtre de live timing se déroule du 07/04/25 et prendra fin le 25/04/25
- ▶ Fin des tests CTP : 22 avril 2025

- ▶ Test ECONS : vendredi 25 avril 2025

Décision du Go/Nogo annonce le 16 mai 2025 sur le site de la BCE.

Communication dans les jours à venir sur l'activation ou non du MT14.

Réunion de Place

- ▶ La prochaine réunion de Place se déroulera :
 - Le lundi 5 mai 2025 de 16h30 à 18h00, sur site et à distance
 - Sera suivie d'un cocktail

POINT D'ACTUALITÉ

FERMETURE ECMS PRODUCTION

- L'environnement de production est fermé jusqu'à la mise en production sauf contre-indication.

FERMETURE PRE-PRODUCTION

JOURS DE FERMETURE TARGET/MIGRATION	
MARS 2025	Lundi 31(migration)
AVRIL 2025	1 au 6 (migration), 18 , 21 , 29(R2025.JUN)
MAI 2025	1
DECEMBRE 2025	24,25,26,31

PROBLÈME DÉPHASAGE BUSINESS DATE ENTRE ECMS ET CLM

- Incident sur le « Cut-off CLM RTS » survenu dans la nuit du 14/04
- Retardement du traitement ECMS/APPR du NTP
- Intervention manuelle dans la soirée dans ECMS en forçant la Business Date au 15/04/25

Ce déphasage a eu pour conséquence le rejet par CLM des paiements et des instructions de ligne de crédit.

POINT D'ACTUALITÉ

TMC créances privées intègre le TMC général

- ▶ A compter de la semaine prochaine et jusqu'à début juin, il n'y aura plus de TMC CP dédié. Celui-ci sera combiné avec le TMC général du jeudi.

Site internet Banque de France

- ▶ La dernière version d'ECMS V.14.8.4 a été déployée en Pré-Production le mardi 8 avril 2025 (voir annexe)
- ▶ Désormais seuls les PBIs bloquants ou critiques seront corrigés après validation

Site internet BCE ECMS – Professional use

- ▶ La dernière version des **ECMS User Test Execution -Testing Conditions** a été publiée le 28/03/2025.
- ▶ Résumé de la focus session du 21 mars 2025

POINT D'ACTUALITÉ

Bilan du MT13

- ▶ Exercice globalement réussi
- ▶ 6 bulletins d'information envoyés
- ▶ Forte mobilisation des contreparties notamment sur les CP

Recommandations

- ▶ Il est impératif de participer aux activités contreparties lors du week-end de migration : réconciliation des positions et de la valorisation dans les délais impartis
- ▶ Problème de connexion: Veuillez à supprimer vos cookies et cache avant de redémarrer votre navigateur et recommencer la connexion.
- ▶ Nous recommandons de ne pas répondre sur le SERI dédié aux bulletins d'information pour une meilleure gestion de vos demandes.
- ▶ Il est également demandé de faire des retours distincts MA/CP.
- ▶ Attention à ne pas faire de mail avec des pièce jointe chiffrée.

En vue du prochain exercice de migration

- ▶ En annexe, le schedule prévisionnel des activités contreparties pour le week-end de migration du go-live
- ▶ Pour le week-end de migration de la mise en production le schedule des activités contreparties sera présenté la dernière semaine de mai et précisé par la suite. => TMC prévisionnel dédié migration le 28 mai

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ : CREANCES PRIVEES

Live Timing

- ▶ Participation active des contreparties
- ▶ Flux quotidiens sur ECMS pour une grande partie des contreparties
- ▶ Résultats globalement positifs depuis la reprise des tests le 07 avril

Traitement des débiteurs

- ▶ Traitement quotidien par les équipes ARC de l'analyse des débiteurs
- ▶ Envoi quotidien aux contreparties concernées d'un fichier Excel sur Sharebox de la liste des débiteurs à exclure
- ▶ Création dans RIAD au bout d'une semaine des débiteurs si il n'y a pas de retour négatifs sur les filtres d'éligibilité
- ▶ Explication détaillée donnée lors du TMC CP du 09/04

Exercice de bordereau trimestriel

- ▶ La date d'arrêté pour cet exercice est au jeudi 17 avril avec un délai de retour d'une semaine
- ▶ Cf TMC de ce matin pour les modalités de l'exercice

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

CREDIT CLAIMS ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

Problem ID	Priority	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
162228	Medium	DEMOB instructions missing in Final PR (ECONS)	ND
162670	Medium	Error BRCCRU06 unjustified	ND
157559	Low	SoH _Différence Structure Pg & et Pg 2	ND

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ : CORPORATE ACTIONS

FIN DE LA CAMPAGNE OST

- Dernière campagne de tests OST en cours
- L'équipe reste disponible pour programmer des tests spécifiques selon les besoins des contreparties et en fonction des possibilités EOF

CAMPAGNE DE TESTS

Le détail des cas de tests « iso-prod » est disponible sur le sharebox

Cases	Group	CAEV	Isin	CA Event Status	Processing status	Commentaires
C01	INTR0000028230	INTR (Reversal IPRI)	FR0013313020	Closed	Confirmed	Reversal KO - Positions non alignées avec le dépositaire
C02	BIDS0000028235	BIDS	FR0013371531	Activated	Receiving Instructions	En cours
C03	INTR0000028232	INTR (USD)	FR0014001L06	Activated	Confirmed	OK
C04	PRED0000028234	PRED	FR0013459047	Activated	Confirmed	OK
C05	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR0013286820	Activated	Confirmed	Reversal KO - Incident en cours
C06	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR0014009N55	Activated	Confirmed	OK
C07	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR0014009O88	Activated	Confirmed	OK
C08	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR001400H8X1	Activated	Confirmed	OK
C09	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR0013507092	Activated	Notified	En cours
C10	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR0013329638	Activated	Notified	En cours
C11	Reorg	REDM (Same as Production)	FR0013329638	Activated	Notified	En cours
C12	Cash distri	INTR (Same as Production)	FR001400HAC0	Activated	Notified	En cours

Boîte mail BDF OST

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

Sharebox

<https://share-box.banque-france.fr/share-access/sharings/EqzqgxYs.Eqqqgms0#/filer/share-access>

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

CORPORATE ACTIONS

ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

Problem ID	Priority	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
<u>161795</u>	Medium	ITCB	<i>Market and client entitlement calculation not correct when there is a change of the client position before the record date.</i>	<i>Prior to Go-live</i>

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

POOL POSITIONS AND PROJECTION & STATEMENTS AND REPORTS

Fonctionnalités ouvertes

- ▶ Pool Positions Report
- ▶ Report Statement of Holding
- ▶ Report Statement of Transactions

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

POOL POSITIONS AND PROJECTIONS & STATEMENTS AND REPORTS

ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

Problem ID	Priority	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
<u>145081</u>	Medium	IECB	Pool Projection report showing Failed for counterparty	TBD

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

MULTIPOOLING ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

Problem ID	Priority	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
<u>157314</u>	Medium	ITCB	Data segregation should be enforced on the screen "Display Credit claim transfer"	TBD

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

OPÉRATIONS DE POLITIQUE MONÉTAIRE

Fonctionnalité ouvertes

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

Campagne actuelle OMO : du 09/04 au 22/04

- Contenu : 1 MRO, 1 FTD, 2 USD (1 duration=7 days, 1 duration>7 days), 1 LTRO (pour Early Repayment), 1 Early Rept LTRO.
- 17 contreparties FR y participent.
- 1 seul incident ouvert à ce jour: le 10/04 sur chargement MRO : rejet de 2 contreparties qui avaient eu même n° d'OMO issu de la migration MT13: intervention des 4CB, problème réglé. C'est le comportement normal d'ECMS (erreur au niveau de la génération du fichier TOP Pré-Production)
- Tous les autres OMOs ont été chargés normalement, leurs statuts, calculs d'intérêts sont normaux.
- Le Early repayment a été chargé hier 15/04, et réglé ce matin.

Tenders	Tender Name	09/04/25	10/04/25	11/04/25	12/04/25	13/04/25	14/04/25	15/04/25	16/04/25	17/04/25	18/04/25	19/04/25	20/04/25	21/04/25	22/04/25
1	MRO fixed rate	AN	AL/SE					MAT							
2	FTD (standard)		AN	AL/SE						MAT					
3	USD operation	AN	AL	SE						MAT					
4	LTRO for early repayment	AN/AL		SE						MAT					
5	USD operation for period > 7 days	AN	AL/SE FX rates file					FX rates		FX rates	EASTER Friday			EASTER Monday	MAT
6	Early repayment on LTRO	AN					AL	SE							
ECMS Operator actions / Value of system parameters															
A1	Parameter: automatic mobilisation	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes
A2	Parameter: netting	netting parameter)					ALL (default netting parameter)								ALL (defa
A3	MRO values set up	4	4	4			3,65	3,65	3,65	3,65	3,65			3,65	3,65

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

OPÉRATIONS DE POLITIQUE MONÉTAIRE ANNEXE PROBLEMES OUVERTS

Problem ID	Priority	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
<u>161503</u>	Medium	HR	<i>LTRO Creation via top file, a null pointer exception is raised for one counterparty</i>	TBD
<u>161910</u>	Medium	SICB	<i>PACS.002 impact failed with null pointer exception, when reprocess the flow it was impacted correctly</i>	TBD
<u>161514</u>	Medium	ATCB	<i>Wrong netting Status Not enough Collateral applied - Netting for OMO in EUR is created with status Waiting FX Confirmation, the Netting for OMO in EUR is created with status Not enough Collateral</i>	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	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
158969	Medium	ITCB	<i>Series of CCs demobilisations, one cancel the previous one, the last one was settled but the cancelled credit Line instruction linked events are not released</i>	TBD
157371	Medium	ITCB	<i>No increase of the Credit line when the absolute credit limit is set to 0 or null</i>	TBD
155770	Medium	ITCB	<i>The event recheck collateral insufficiency should not create a pool position</i>	TBD

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 : TITRES

EXERCICE DE LIVE TIMING AVRIL 2025

Act on behalf

► Mode dégradé « On-Behalf », les contreparties recevront les templates à remplir pour les fonctionnalités suivantes :

- Statement of Holdings,
- Statement of Transaction,
- Statement of Pending transactions,
- Credit freezing,
- Cash as collateral,

Les contreparties sélectionnées devront nous renvoyer les templates signés (**1 signataire A ou 2 signataires B**) pour les fonctionnalités qui leur auront été communiquées.

Lors du live timing de mars, nous avons reçu les formulaires de 29 contreparties, merci pour votre participation.

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

Fonctionnalités ouvertes

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

- ▶ Organisation des tests avec Clearstream Bank Luxembourg:
 - Les contreparties devant encore valider des tests avec CBL ont été approchées hier et aujourd'hui par la BdF.
 - **18 avril est un jour férié TARGET et fin des tests le 18 avril 2025 au soir pour Clearstream Bank Luxembourg donc les contreparties ont jusqu'au 17 avril au soir pour valider leurs tests.**

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

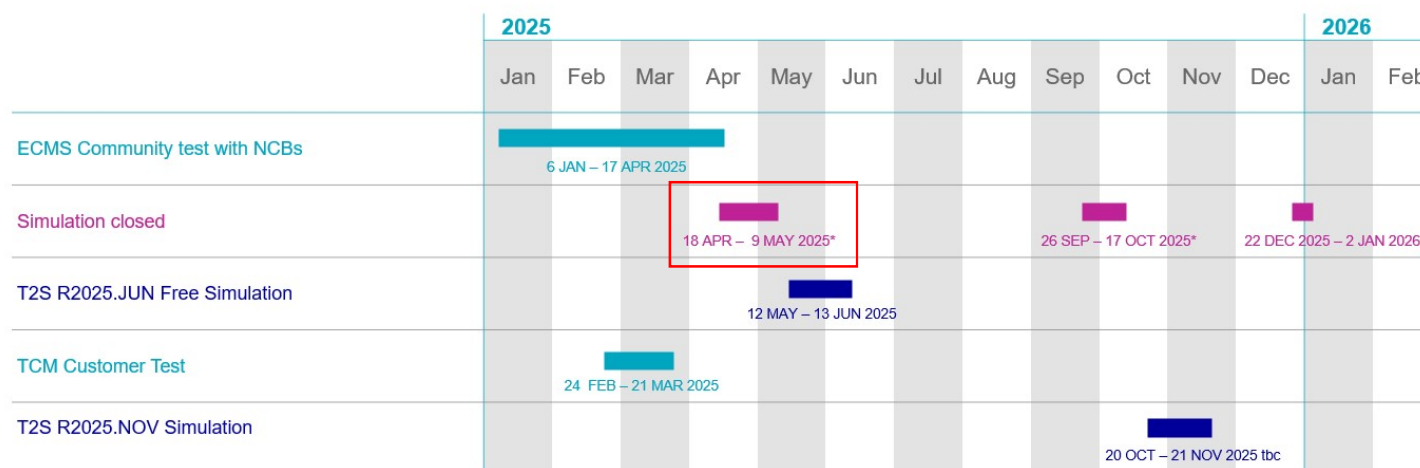
ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

Indisponibilité passée, en cours et à venir des plateformes de test

► Clearstream Bank Luxembourg (indisponibilité à venir):

- L'environnement de test de Clearstream Bank Luxembourg sera indisponible à partir du 18 avril au soir jusqu'au 04 mai 2025 (SERI250414143628).
- Pour plus d'informations, nous vous invitons à vous rapprocher de votre correspondant chez Clearstream Bank Luxembourg ou à consulter leur [page dédiée](#).



* From 6 to 9 May and 13 to 17 October, the simulation environment will only be technically available without simulation support.

21

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

Indisponibilité passée, en cours et à venir des plateformes de test

► Euroclear France (indisponibilité à venir):

- Newsflash - ESES-T2S Pre Production Testing – PH - **ESES closed whereas T2S is open 22 April 2025**
- *“We would like to inform you that our PH Pre-Production environment will be closed for technical maintenance. However, the T2S pre-production platform remains open.*
- *This means that no settlement will occur on the PH platform. Settlement instructions with this intended settlement date and pending settlement instructions that are recycled during that day will generate sese.024 with status Unsettled (USET) with reason 'BLOC' (Settlement instruction is not settled because of an intraday restriction).*
- *We advise to avoid sending any instruction with an intended settlement date on this day.*
- *Link to [ESES SBI testing calendar 2025](#)”*
- Pour plus d'informations, nous vous invitons à vous rapprocher de votre correspondant chez Euroclear.

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS LE DERNIER TMC

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Gel du périmètre des tests MA CCBM

- ▶ Les contreparties françaises ont **jusqu'au 25 avril 2025 au soir** pour valider leurs tests CCBM;
- ▶ Les tests (et l'évolution du périmètre d'activité des contreparties le cas échéant) pourront reprendre après la mise en production.

Migration des positions depuis CBL vers LuxCSD

- ▶ Les positions détenues en Clearstream Bank Luxembourg par les contreparties françaises seront migrées vers LuxCSD le **03 juin 2025** et non le 07 mai 2025 comme initialement prévu.

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Par place de dénouement en CTP2e

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: Tests concluants

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

**PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS
LE DERNIER TMC**

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Par place de dénouement en CTP2e – 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 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.)	NA

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

**PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS
LE DERNIER TMC**

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES - CCBM

Par ISIN en CTP2e – Focus avec Clearstream Bank Luxembourg

ISIN	Canal	Statut
AT	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
BE	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
DE	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
EE	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
ES	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
EU	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
FI	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants

ISIN	Canal	Statut
FR	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
GR	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
HR	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Ouverts aux tests
IE	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
IT	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
LT	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
LU	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants

ISIN	Canal	Statut
LV	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
MT	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Ouverts aux tests
NL	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
SI	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
SK	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants
XS	A2A	CTP2E: Tests concluants
	U2A	CTP2E: Tests concluants

PAS DE NOUVEAUTÉ DEPUIS
LE DERNIER TMO

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	Raiser	Business Description/Summary/testing limitation	Target delivery date
<u>161716</u>	Medium	DECB	<i>Price coefficient rejected in CRDM due to Price format limitation exceeded</i>	TBD



ANNEXES

ACTIVITÉS DE TEST DE MIGRATION MEP PROD – CORPUS TRANSACTIONNEL

CHRONOGRAMME PREVISIONNEL DES ACTIVITÉS PRÉVISIONNELLES CTPY

Activité	Actor	Duration	Start	End
Reception of the ECMS CC ID and integration	CTPYs	--	From 13/06/2025 12:00	
Reception of the IRB ratings and integration	CTPYs	--	From 13/06/2025 12:00	
Reception of the CC valuation and integration	CTPYs	--	From 15/06/2025 07:00	

Activité	Actor	Duration	Start	End
Inform Counterparty they can access to the ECMS	NCBs	0 mins	15/06/2025 07:00	15/06/2025 07:00
Counterparties checks of the migrated positons	--	5 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 12:00
Pool positions checks by the counterparties in U2A	Counterparties	5 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 12:00
Generation of the pool positon reports upon reception of admin.005	Counterparties	5 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 12:00
Penny testing	Sample CTPYs & CSDs	4 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 11:00
Sample MA mobilisation instructions as part of the penny test	Selected CTPYs	4 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 11:00
CSD payments on T2S CBCA to ensure camt.054 are received to ECMS	Selected CSDs	4 hrs	15/06/2025 07:00	15/06/2025 11:00

ACTIVITÉS DE TEST DE MIGRATION MEP PROD – CORPUS TRANSACTIONNEL

Indications préliminaires:

- ▶ Cut-off en APPR à 14h le vendredi 13 juin
- ▶ Date de valeur du 16/06/2025 pour le pool position report et pour la réconciliation
- ▶ Faire les remontées dans les délais
- ▶ Connexion: Veillez à supprimer vos cookies et vider votre cache avant de redémarrer votre navigateur et recommencer la connexion.
- ▶ Nous recommandons de ne pas répondre sur le SERI dédié aux bulletins d'information pour une meilleure gestion de vos demandes.
- ▶ Il est également demandé de faire des retours distincts Marketable Assets/Créances Privées.
- ▶ Attention à ne pas faire de mail avec des pièces jointes chiffrées.

Questions en cours d'étude:

- ▶ À quelle heure seront envoyées les MT535 le dernier vendredi avant la mise en production (vendredi 13 juin)?
- ▶ Quel ISIN sera utilisée pour le penny test de la mise en production ?

ACTIVITÉS DE TEST DE MIGRATION MEP PROD – CORPUS TRANSACTIONNEL

Indications préliminaires:

- ▶ Cut-off en APPR à 14h le vendredi 13 juin
- ▶ Date de valeur du 16/06/2025 pour le pool position report et pour la réconciliation
- ▶ Faire les remontées dans les délais
- ▶ Connexion: Veillez à supprimer vos cookies et vider votre cache avant de redémarrer votre navigateur et recommencer la connexion.
- ▶ Nous recommandons de ne pas répondre sur le SERI dédié aux bulletins d'information pour une meilleure gestion de vos demandes.
- ▶ Il est également demandé de faire des retours distincts Marketable Assets/Créances Privées.
- ▶ Attention à ne pas faire de mail avec des pièces jointes chiffrées.

ANALYSE PAR DOMAINE DE FONCTIONNALITÉ

TITRES

ECONS (pour faire suite à une question posée lors du dernier TMC sur l'ouverture et l'alimentation ECONS)

Situation normale, CLM OK :

- ▶ Les contreparties doivent s'assurer d'avoir un credit freezing de type ECONS dans leur pool et un Excess ECL (en fonction de leur particularité).

Bascule en mode ECONS : CLM KO et le module ECONS est activé :

- ▶ Le passage d'ECMS en mode contingence (ECONS) est réalisé uniquement par les 4CB,
- ▶ Le credit freezing de type ECONS bascule automatiquement dans ECONS via le camt.050,
- ▶ Les contreparties peuvent augmenter leur liquidité dans ECONS avec de nouveaux apports de collatéral dans ECMS,
- ▶ Le credit freezing ECONS ne pourra être augmenté que si la contrepartie dispose d'un Excess ECL.

Retour en situation normale CLM OK :

- ▶ Dès que les credit freezing sont récupérés par BDF dans CLM (pacs010 au débit de votre MCA émis suite à re-bascule des soldes ECONS vers CLM) l'équipe ECMS de la BDF renseigne le flag pour les credit freezing afin que les contreparties puissent diminuer, si elles le souhaitent, leur credit freezing ECONS dans ECMS.
- ▶ Un prochain test est prévu le 25 avril 2025.
Un mode opératoire mis à jour sera transmis aux contreparties avec le détail des actions attendues.

RELEASE NOTE FINALE RN-43.04-14.8.4 VERSION 14.8.4

1.1.1 Defect information

This release provides the fixes for the 16 following Problems:

PBI	Category	Summary	User
162227	ECMS.Application.Corporate Actions	Reversal impact for a CA Event with two seev.036 confirmation messages	LV
162899	ECMS.Application.Corporate Actions	Seev.035 for reversal unprocessed despite difference is within the tolerance parameter value	IT
162808	ECMS.Application.Credit Claims	[EAC]U2A CC DEMOB caused decrease movement on wrong account - BRDMB03 is not checked for the U2A case	IT
161797	ECMS.Application.OMO	[TOP] in case of Full ER settled by Netting -a Wrong update for interest Mvnt Amount is detected	IT
161778	ECMS.Application.OMO	[EAC] For OMO in Currency -Repaid interest in correctly calculated but Accrued interest in EUR/Currency in OMO operation are wrongly updated after ER	DE
161691	ECMS.Application.C2D/UC	[APPR] Triparty MA positon in IF with value 0 for collateral value before and after HC MA positions with nominal amount at blanc	LU
161581	ECMS.Application.C2D/UC	[APPR] C2D-UC initial data fails with FTD missing OtherRegistrationNumber	FI
161514	ECMS.Application.OMO	OMO-Wrong netting Status Not enough Collateral applied	AT
161457	ECMS.Application.C2D/UC	Misalignment between the mkt collateral positions in the IF and the collateral positions in the Reference Data and pool position report : ISIN changes to Not Eligible is ignored	ES
161454	ECMS.Application.C2D/UC	Mandatory attribute Mobilisation channel missing for Triparty Collateral Position	LU
161160	ECMS.Application.C2D/UC	Empty screen DisplayUpdate FIF (Suspect Case)	AT
160207	ECMS.Application.Legal Archiving	NRO not working smoothly	SK
157924	ECMS.Application.C2D/UC	[C2D/UC]: Reporting>C2D-UC>Display/Update IF/FIF details - missing actions edit and delete + serach criteria to be amended	DE
155021	ECMS.Application.OMO	In case of ER for pool in margincall The pool is impacted with nominal amount twice instead of Interest	DE
145081	ECMS.Application.Pool Position and pool projection	[APPR][Pool Position & Pool Projection]: Pool Projection report showing Failed for counterparty	IE
143980	ECMS.Application.DDF	[APPR] [CTP2] Review query for LDE ExpectedPayments to include records at maturity date	IT



STABILITÉ
FINANCIÈRE
ET OPÉRATIONS