

SÉPTIMO EJERCICIO DE SEGUIMIENTO SOBRE ARMONIZACIÓN DE GESTIÓN DE COLATERAL (H2 2023 SCORE)

Isabel Rodríguez

GRUPO AMI-SECO ESPAÑA

Madrid

5 de diciembre de 2023

DEPARTAMENTO DE SISTEMAS DE PAGO



ÍNDICE

1. Participación
2. Calendario de hitos
3. Expectativas de cumplimiento
4. Implementación ISO20022

Nivel de participación



TPA Collateral Management



Corporate Actions



Billing Processes

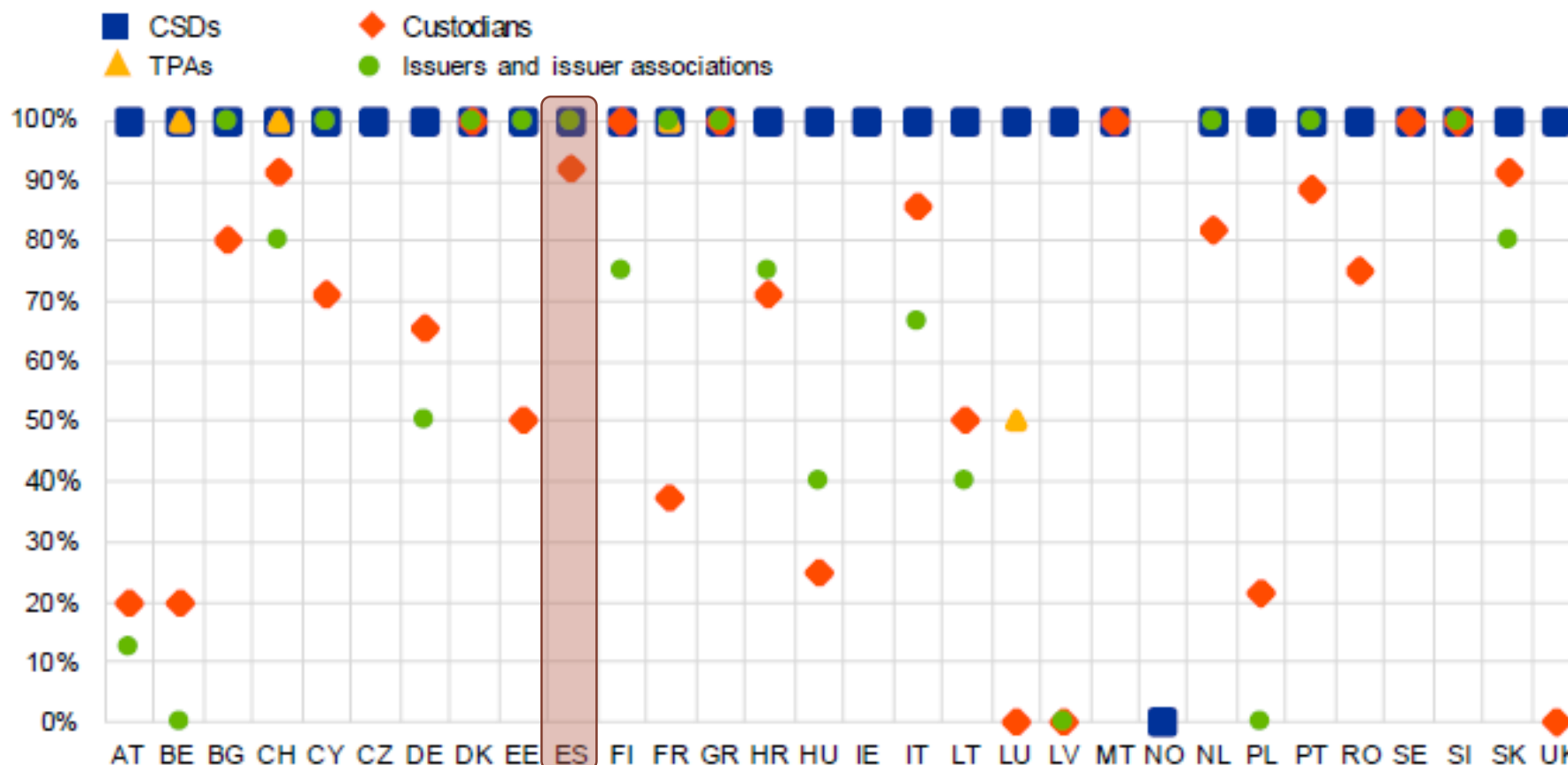


29 mercados AMI-SeCo

- ✓ TPAs: 6
- ✓ CSDs: 37
- ✓ Custodios: 100+
- ✓ Emisores y Asociaciones: 45

AMI-SeCo -España

- ✓ CSDs: 1 (100%)
- ✓ Custodios: 13 (100%)
- ✓ Emisores y Asociación: 2 (100%)



HITO	DESCRIPCIÓN	FECHA
M1	Análisis comenzado	30/06/2020
M2	Comunicación iniciada	01/03/2021
M3	Análisis completado	31/07/2021
M4	Documentación completada	31/12/2021
M5	Comunicación externa detallada	31/12/2021
M6	Adaptaciones de procesos y procedimientos SCoRE comenzada	01/01/2022
M7	Adaptación SCoRE completada	30/06/2022
M8	Pruebas internas SCoRE iniciadas	01/07/2022
M9	Pruebas internas SCoRE completadas	10/03/2023
M10	Pruebas externas SCoRE iniciadas	22/05/2023
M11	Comunicación externa final sobre SCoRE	22/05/2023
M12	Pruebas externas SCoRE completadas	16/02/2024
M13	Estándares SCoRE implementados	08/04/2024



TPA Collateral Management

Ningún TPA

implementará los estándares (cumplirán M13) **a tiempo**

5 TPAs

implementarán los estándares en nov/dic 2024

	Milestones 1-13												
	M1	M2	M3	M4	M5	M6	M7	M8	M9	M10	M11	M12	M13
BE - BNY Mellon	Yes	Yes	Yes	01/24	Yes	Yes	11/24	Yes	11/24	11/24	12/24	11/24	11/24
BE - Euroclear Bank	Yes	Yes	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	Yes	03/24	12/24
CH - SIX SIS	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	04/25	04/25	04/25	04/25	04/25
FR - BNP Paribas	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	03/24	03/24	01/24	09/24	12/24
FR - Euroclear France	Yes	Yes	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	03/24	Yes	03/24	12/24
LU - Clearstream Banking Luxembourg	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	Yes	06/24	Yes	08/24	Yes	Yes	10/24	11/24
LU - JP Morgan	R	R	R	R	R	R	R	R	R	R	R	R	R



Corporate
Actions

Mercado español	M1	M2	M3	M4	M5	M6	M7	M8	M9	M10	M11	M12	M13
CSD – IBERC	SI	SI	SI	SI	SI	SI	12/23	SI	03/24	SI	10/23	03/24	06/25
Custodios	100%	85%	77%	69%	69%	77%	62%	77%	46%	46%	62%	77%	92%

A nivel agregado....

CSDs

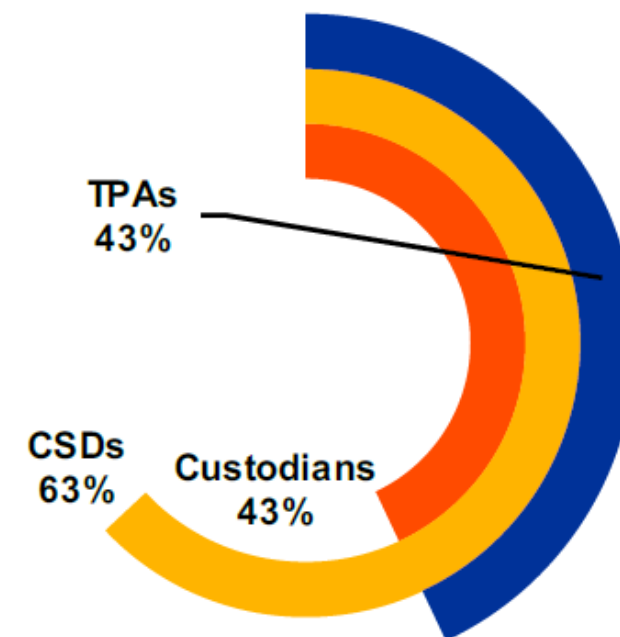
- 24 CSDs confían en cumplir M13, aunque esperan retrasos en hitos intermedios
- 4 CSDs reportan retrasos específicos, sin repercusión en otras áreas

TPAs

- 3 TPAs confían en cumplir M13

Custodios

- Por ahora, se observa poca preparación





Mercado español	M1	M2	M3	M4	M5	M6	M7	M8	M9	M10	M11	M12	M13
CSD – IBERC	SI	SI	SI	SI	SI	SI	10/23	SI	11/23	12/23	10/23	03/24	SI
Custodios	69%	69%	46%	46%	38%	31%	23%	31%	31%	31%	31%	38%	46%

A nivel agregado....

CSDs

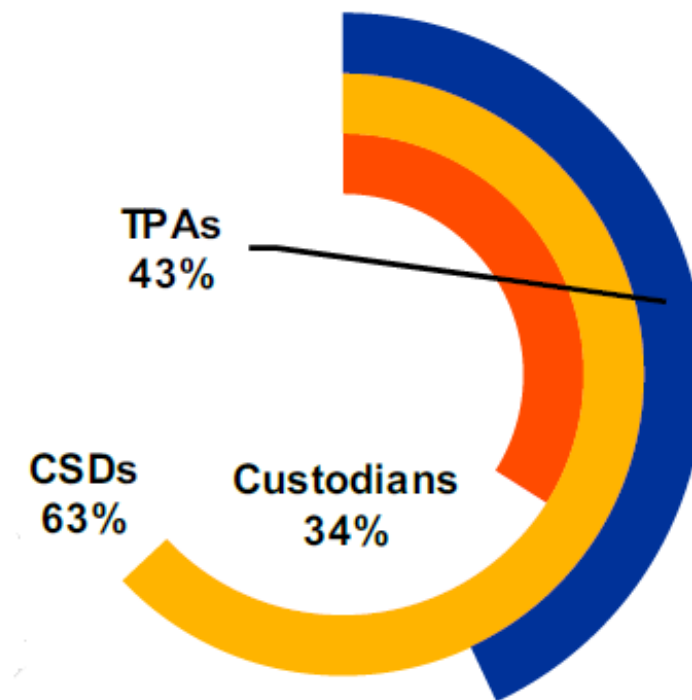
- La mayoría de CSDs confían en cumplir M13, aunque 13 tienen retrasos en hitos intermedios

TPAs

- 3 TPAs confían en cumplir M13

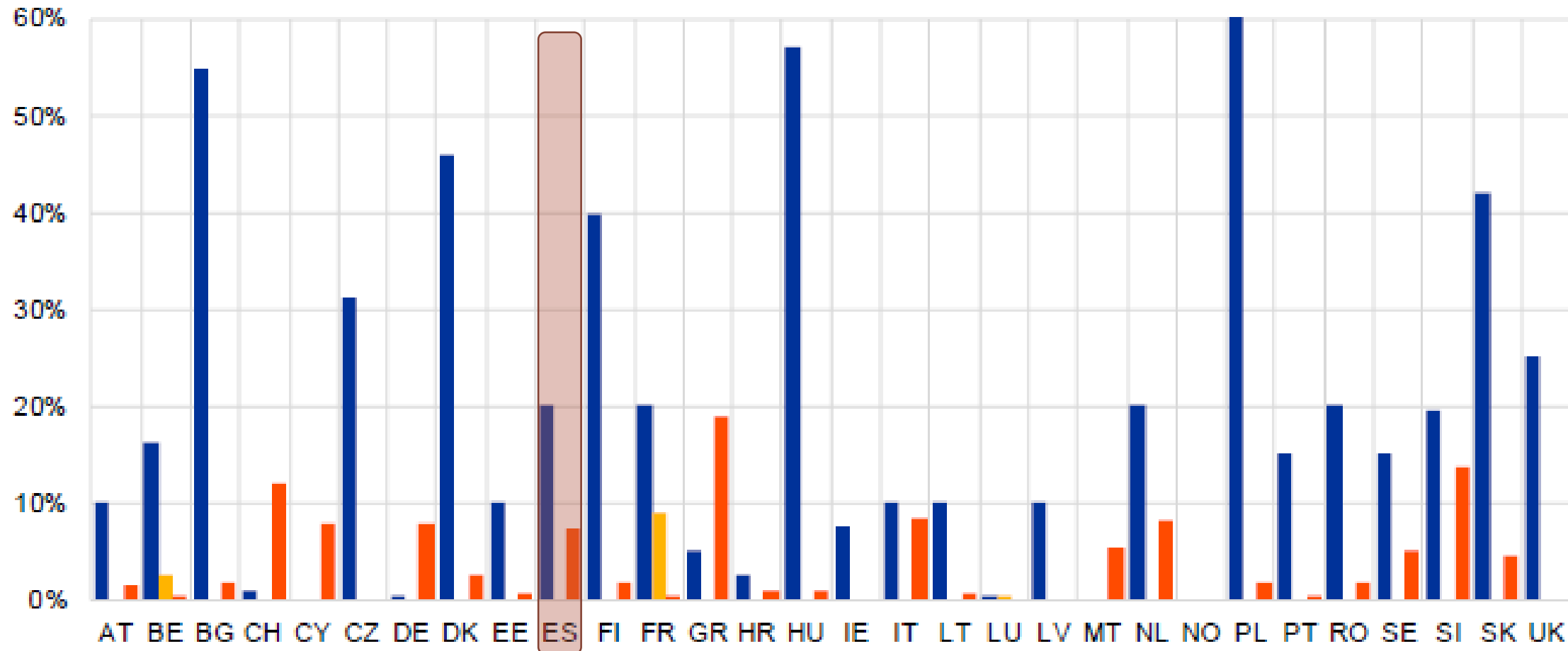
Custodios

- Por ahora, se observa poca preparación
- Se espera que muchos inicien su preparación durante el siguiente periodo de seguimiento.



- CSDs
- TPAs
- Custodians

Clientes de CSDs, TPAs y custodios con capacidad ISO 2022



GRACIAS POR SU ATENCIÓN

