

# **ECMS CASOS DE PRUEBA OBLIGATORIOS**

<b>Versión:</b>	<b>1.0</b>
<b>Estado</b>	
<b>Fecha:</b>	<b>28/11/2022</b>

## **CONTENIDO**

<b>1</b>	<b>INTRODUCCIÓN.....</b>	<b>3</b>
1.1	ENFOQUE .....	3
1.2	ESQUEMA DE LOS CASOS DE PRUEBA OBLIGATORIOS .....	3
<b>2</b>	<b>CASOS DE PRUEBA OBLIGATORIOS.....</b>	<b>4</b>
2.1	LISTADO DE LOS CASOS DE PRUEBA OBLIGATORIOS.....	4
2.2	DETALLE DE LOS CASOS DE PRUEBA OBLIGATORIOS .....	6
2.2.1	<i>ECMS_TC_CPTY_1 A – Movilización satisfactoria de un valor transfronterizo .....</i>	<i>6</i>
2.2.2	<i>ECMS_TC_CPTY_3 A – Desmovilización satisfactoria de un valor transfronterizo .....</i>	<i>7</i>
2.2.3	<i>ECMS_TC_CPTY_5 A – Registro y movilización de un préstamo no hipotecario transfronterizo .....</i>	<i>9</i>
2.2.4	<i>ECMS_TC_CPTY_6 A – Actualización del pendiente de reintegro de un préstamo no hipotecario transfronterizo .....</i>	<i>10</i>
2.2.5	<i>ECMS_TC_CPTY_7 A – Desmovilización de un préstamo no hipotecario transfronterizo ....</i>	<i>11</i>
2.2.6	<i>ECMS_TC_CSD_42 – Creación de un evento corporativo transfronterizo y envío de la notificación. Técnica Prenda. ....</i>	<i>12</i>
2.2.7	<i>ECMS_TC_CSD_43 – Creación de un evento corporativo transfronterizo y envío de la notificación. Técnica Repo.....</i>	<i>13</i>
2.2.8	<i>ECMS_TC_CSD_44 – Registro y envío de la confirmación del movimiento del evento corporativo transfronterizo. Técnica Prenda.....</i>	<i>14</i>
2.2.9	<i>ECMS_TC_CSD_45 – Registro y envío de la confirmación del movimiento del evento corporativo transfronterizo. Técnica Repo. ....</i>	<i>15</i>

## 1 Introducción

El presente documento enumera y describe de forma detallada los casos de prueba obligatorios que Banco de España ha decidido solicitar a su comunidad para complementar los casos de prueba fundamentales.

### 1.1 Enfoque

Estos casos de prueba son obligatorios para aquellas entidades españolas que tengan intención de participar en las operaciones de crédito del Eurosistema a través del sistema ECMS a partir de noviembre de 2023.

Se ha determinado la realización de estos casos de prueba con la finalidad de asegurar la preparación de las contrapartidas para el *Go-live*. Es responsabilidad de cada entidad asegurarse de que se probarán todas las funcionalidades relacionadas con su negocio.

Se recomienda a las entidades realizar estos casos de prueba obligatorios de manera conjunta con los casos de prueba fundamentales, si bien no hay una fase específica para llevarlos a cabo.

Sin embargo, deben ser ejecutados durante las fases en las que hay conexión con T2S y CLM y terminados con anterioridad a la fase operacional y día de negocio.

### 1.2 Esquema de los casos de prueba obligatorios

Identificador de caso de Prueba	ECMS_TC_( CSD o CPTY) seguido por un número para identificarlo.
Nombre del caso de Prueba	Nombre descriptivo del caso de prueba.
Relevante para (actor)	CPTY, CSD  “Y” Obligatorio para el actor de ECMS siempre que esté habilitado a realizar esta funcionalidad en producción. En caso contrario, informar de que no aplica dicha prueba.  “-” No aplica para el actor.
Dominio	- Gestión de colateral.  - Posición global de crédito y colateral.  - Operaciones de política monetaria.  - Funcionalidades de apoyo (facturación, eventos contables).
Sub-dominio	Qué funcionalidad de ECMS se prueba.

Modo A2A/U2A	U2A o A2A (el usuario selecciona el modo correspondiente al que usará en producción).  -U2A (el caso de prueba solo puede realizarse en U2A).  -A2A (el caso de prueba solo puede realizarse en A2A).
Descripción del caso de prueba	Breve descripción con los pasos necesarios para llevar a cabo el caso de prueba.
Condiciones previas	Precondiciones necesarias para realizar el caso de prueba.
Resultados esperados	El resultado esperado del caso de prueba en U2A y A2A (si procede).
Privilegios necesarios	Privilegios necesarios para llevar a cabo el caso de prueba.

## 2 Casos de prueba obligatorios

### 2.1 Listado de los casos de prueba obligatorios

Identificador del caso de prueba	Dominio	Sub-dominio	Nombre del caso de prueba	Relevante para	
				CTP Y	Iberc lear
ECMS_TC_CPTY_1 A	Gestión de colateral	Movilización de valor transfronterizo	Movilización satisfactoria de un valor transfronterizo	Y	-
ECMS_TC_CPTY_3 A	Gestión de colateral	Desmovilización de valor transfronterizo	Desmovilización satisfactoria de un valor transfronterizo.	Y	-
ECMS_TC_CPTY_5 A	Gestión de colateral	Préstamo no hipotecario transfronterizo	Registro y movilización satisfactoria de un préstamo no hipotecario transfronterizo.	Y	-
ECMS_TC_CPTY_6 A	Gestión de colateral	Préstamo no hipotecario transfronterizo	Actualización del pendiente de reintegro de un préstamo no hipotecariotransfronterizo.	Y	-
ECMS_TC_CPTY_7 A	Gestión de colateral	Préstamo no hipotecario transfronterizo	Desmovilización satisfactoria de un préstamo no hipotecario transfronterizo.	Y	-

ECMS_TC_CSD_42	Gestión de colateral	Notificación de un evento corporativo transfronterizo. Técnica Prenda.	<p>Creación satisfactoria del evento corporativo y envío de la notificación o anuncio a ECMS.</p> <p>La CSD puede elegir entre uno de los siguientes eventos corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>	-	Y
ECMS_TC_CSD_43	Gestión de colateral	Notificación de un evento corporativo transfronterizo. Técnica Repo.	<p>Creación satisfactoria del evento corporativo y envío de la notificación o anuncio a ECMS.</p> <p>La CSD puede elegir entre uno de los siguientes eventos corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>	-	Y
ECMS_TC_CSD_44	Gestión de colateral	Confirmación de un evento corporativo transfronterizo. Técnica Prenda.	<p>Registro satisfactorio y envío a ECMS de la confirmación del movimiento del evento corporativo.</p> <p>La CSD puede elegir entre uno de los siguientes eventos corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>	-	Y
ECMS_TC_CSD_45	Gestión de colateral	Confirmación de un evento corporativo transfronterizo. Técnica Repo.	<p>Registro satisfactorio y envío a ECMS de la confirmación del movimiento del evento corporativo.</p> <p>La CSD puede elegir entre uno de los siguientes eventos corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>	-	Y

## 2.2 Detalle de los casos de prueba obligatorios

### 2.2.1 ECMS\_TC\_CPTY\_1 A – Movilización satisfactoria de un valor transfronterizo

Identificador del Caso de Prueba	ECMS_TC_CPTY_1 A
Nombre del caso de Prueba	Movilización satisfactoria de un valor transfronterizo
Relevante para (actor)	CPTY
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Movilización de un valor transfronterizo
Modo A2A/U2A	U2A o A2A
Descripción del caso de prueba	<p>Este caso de prueba describe los pasos mediante los que una contrapartida moviliza un activo negociable transfronterizo en su cuenta de activos de ECMS.</p> <p>-U2A: El usuario introduce una instrucción de movilización de un activo transfronterizo a través de la GUI de ECMS.</p> <p>-A2A: La contrapartida envía una instrucción de liquidación de un activo transfronterizo sese.023 (RECE).</p>
Condiciones previas	<p>La contrapartida está configurada.</p> <p>La CSD receptora está configurada (<i>receiving</i> CSD).</p> <p>La cuenta de activos interna de la contrapartida en ECMS está configurada.</p> <p>El activo está configurado (activo elegible).</p> <p>La cuenta de valores pignorada en T2S en la CSD extranjera está configurada.</p> <p><i>Settlement possibilities</i> está configurado.</p> <p>Se ha alcanzado la fecha de liquidación prevista en la instrucción de movilización.</p> <p>-A2A: Se ha realizado previamente la subscripción de mensajes para el aviso del estado de la operación de liquidación de valores (sese.024) y para la confirmación de liquidación de valores (sese.025).</p>
Resultados esperados	<p>Aumenta el importe de colateral disponible en el pool de la contrapartida (si aplica, también la línea de crédito en CLM).</p> <p>-U2A: El estado de la instrucción de movilización en ECMS es "confirmed"</p> <p>-A2A:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>La contrapartida recibe un aviso de estado de la operación de liquidación de valores sese.024 con el estado "accepted".</li></ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>La contrapartida recibe un aviso de estado de la operación de liquidación de valores sese.024 con el estado “matched”.</li> <li>La contrapartida recibe una confirmación de operación de liquidación sese.025 para su confirmación.</li> </ul>
Privilegios necesarios	-U2A: Rol de la contrapartida U2A para (des)movilización de activos. -A2A: Rol de la contrapartida A2A para activos negociables.

### 2.2.2 ECMS\_TC\_CPTY\_3 A – Desmovilización satisfactoria de un valor transfronterizo

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CPTY_3 A
Nombre del caso de prueba	Desmovilización satisfactoria de un valor transfronterizo
Relevante para	CPTY
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Desmovilización de un valor transfronterizo
Modo A2A/U2A	U2A o A2A
Descripción del caso de prueba	<p>Este caso de prueba describe los pasos mediante los cuales una contrapartida desmoviliza satisfactoriamente un activo negociable transfronterizo de su pool en ECMS.</p> <p>- U2A: El usuario introduce una instrucción de desmovilización de activos a través de la GUI de ECMS.</p> <p>- A2A : La contrapartida envía una instrucción de liquidación de activos sese.023 (DELI) a ECMS.</p>
Condiciones previas	<p>La contrapartida está configurada.</p> <p>La CSD que entrega está configurada (<i>delivering</i> CSD).</p> <p>La cuenta de activos interna en ECMS de la contrapartida está configurada.</p> <p>El activo está configurado (activo elegible).</p> <p>La cuenta de valores pignorada en T2S en la CSD extranjera está configurada.</p> <p><i>Settlement possibilities</i> está configurado.</p> <p>El activo transfronterizo a desmovilizar está disponible en el pool de la contrapartida.</p> <p>Se ha alcanzado la fecha de liquidación prevista en la instrucción de desmovilización.</p> <p>-A2A: Se ha realizado previamente la subscripción de mensajes para el aviso del estado de la operación de liquidación de valores (sese.024) y para la confirmación de liquidación de valores (sese.025).</p>

Resultados esperados	<p>Disminuye el importe de colateral disponible en el pool de la contrapartida (si aplica, también la línea de crédito en CLM).</p> <p>-U2A: El estado de la instrucción de desmovilización en ECMS GUI es “confirmed”.</p> <p>-A2A:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• La contrapartida recibe un aviso de estado de la operación de liquidación de valores sese.024 con el estado “accepted”.</li> <li>• La contrapartida recibe un aviso de estado de la operación de liquidación de valores sese.024 “matched”.</li> <li>• La contrapartida recibe una confirmación de operación de liquidación sese.025 para su confirmación.</li> </ul>
Privilegios necesarios	<p>-U2A: Rol de la contrapartida U2A para (des)movilización de activos.</p> <p>-A2A: Rol de la contrapartida A2A para activos negociables.</p>



### 2.2.3 ECMS\_TC\_CPTY\_5 A – Registro y movilización de un préstamo no hipotecario transfronterizo

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CPTY_5 A
Nombre del caso de prueba	Registro y movilización satisfactoria de un préstamo no hipotecario transfronterizo.
Relevante para	CPTY
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Préstamo no hipotecario
Modo A2A/U2A	U2A o A2A
Descripción del caso de prueba	<p>Este caso de prueba describe los pasos mediante los cuales una contrapartida registra y moviliza un préstamo no hipotecario transfronterizo (deudor perteneciente al Eurosistema no español) en su pool de ECMS.</p> <p>-U2A:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>El usuario registra el préstamo no hipotecario transfronterizo en la GUI de ECMS.</li> <li>El usuario moviliza el préstamo no hipotecario transfronterizo en la GUI de ECMS.</li> </ul> <p>-A2A: La contrapartida envía una instrucción de registro de Préstamo no hipotecario(CCR) y la correspondiente instrucción de movilización (MOB) bien como parte del mismo fichero de préstamos no hipotecario o en dos diferentes.</p>
Condiciones previas	<p>La contrapartida está configurada correctamente.</p> <p>El pool de la contrapartida está configurado correctamente.</p> <p>La cuenta de activos de la contrapartida está configurada correctamente.</p> <p>El acreedor y deudor están configurados correctamente y los datos RIAD se han recibido y almacenado correctamente.</p>
Resultados esperados	<p>Aumenta el importe de colateral disponible en el pool de la contrapartida (si aplica, también la línea de crédito en CLM).</p> <p>-U2A: El estado del préstamo no hipotecario transfronterizo en la GUI de ECMS es "mobilised".</p> <p>-A2A: La contrapartida recibe una notificación a través del informe de procesamiento con el estado "confirmed" para las instrucciones CCR y MOB.</p>
Privilegios necesarios	<p>-U2A: Rol de la contrapartida U2A para gestión de préstamos no hipotecarios.</p> <p>-A2A: Rol de contrapartida A2A para préstamos no hipotecarios.</p>

#### 2.2.4 ECMS\_TC\_CPTY\_6 A – Actualización del pendiente de reintegro de un préstamo no hipotecario transfronterizo

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CPTY_6 A
Nombre del caso de prueba	Actualización del importe pendiente de reintegro de un préstamo no hipotecario transfronterizo
Relevante para	CPTY
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Préstamo no hipotecario
Modo A2A/U2A	U2A o A2A
Descripción del caso de prueba	<p>Este caso de prueba describe los pasos mediante los cuales una contrapartida actualiza correctamente el importe pendiente de reintegro de un préstamo no hipotecario transfronterizo (deudor perteneciente al Eurosistema no español).</p> <p>-U2A: El usuario actualiza el pendiente de reintegro a través de la GUI de ECMS.</p> <p>-A2A: La contrapartida envía una instrucción de actualización del pendiente de reintegro (CCOAU o CCU) en el archivo de préstamos no hipotecarios.</p>
Condiciones previas	<p>El préstamo no hipotecario transfronterizo está registrado en ECMS.</p> <p>Los ratings están disponibles para el deudor al que se refiere el préstamo no hipotecario transfronterizo.</p>
Resultados esperados	<p>-U2A: El importe pendiente de reintegro del préstamo no hipotecario transfronterizo esta actualizado en la GUI de ECMS.</p> <p>-A2A: La contrapartida recibe una notificación mediante el informe de procesamiento con el estado “confirmed” para la instrucción CCOAU o CCU.</p>
Privilegios necesarios	<p>-U2A: Rol de contrapartida U2A para la gestión de préstamos no hipotecarios.</p> <p>-A2A: Rol de contrapartida A2A de préstamos no transfronterizos.</p>

### 2.2.5 ECMS\_TC\_CPTY\_7 A – Desmovilización de un préstamo no hipotecario transfronterizo

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CPTY_7 A
Nombre del caso de prueba	Desmovilización satisfactoria de un préstamo no hipotecario transfronterizo
Relevante para	CPTY
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Préstamo no hipotecario
Modo A2A/U2A	U2A o A2A
Descripción del caso de prueba	<p>Este caso de prueba describe los pasos mediante los cuales una contrapartida desmoviliza satisfactoriamente un préstamo no hipotecario transfronterizo (deudor perteneciente al Eurosistema no español) en su pool de ECMS.</p> <p>-U2A: El usuario desmoviliza el préstamo no hipotecario transfronterizo en la GUI de ECMS.</p> <p>-A2A: La contrapartida envía una instrucción de desmovilización (DEMOB) en el fichero de préstamos no hipotecarios.</p>
Condiciones previas	El préstamo no hipotecario transfronterizo ha sido previamente movilizado en ECMS.
Resultados esperados	<p>Se reduce el importe de colateral disponible en el pool de la contrapartida (si aplica, también la línea de crédito en CLM).</p> <p>-U2A: El estado del préstamo no hipotecario transfronterizo en la GUI de ECMS es "demobilised".</p> <p>-A2A: La contrapartida recibe una notificación mediante el informe de procesamiento con el estatus "confirmed" para la instrucción DEMOB.</p>
Privilegios necesarios	<p>-U2A: Rol de la contrapartida U2A para gestión de préstamos no hipotecarios.</p> <p>-A2A: Rol de la contrapartida A2A para préstamos no hipotecarios.</p>

**2.2.6 ECMS\_TC\_CSD\_42 – Creación de un evento corporativo transfronterizo y envío de la notificación. Técnica Prenda.**

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CSD_42
Nombre del caso de prueba	<p>Creación satisfactoria del evento corporativo y envío de la notificación o anuncio a ECMS.</p> <p>Para un caso de evento corporativo a elegir entre los siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>
Relevante para	Iberclear
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Anuncio de evento corporativo
Modo A2A/U2A	A2A
Descripción del caso de prueba	Iberclear envía una notificación de evento corporativo seev.031 de tipo CANO NEWM (INTR, PRED, REDM, según corresponda) para un valor depositado en Iberclear y movilizado por parte de alguna contrapartida transfronteriza mediante la técnica prenda.
Condiciones previas	<p>Iberclear está configurada en ECMS y creado el rol A2A.</p> <p>La contrapartida tiene posición en el activo transfronterizo en su pool de ECMS.</p>
Resultados esperados	<p>Se registra el evento corporativo en ECMS.</p> <p>El evento corporativo tiene el estado de “announced”.</p>
Privilegios esperados	Rol de CSD A2A.

**2.2.7 ECMS\_TC\_CSD\_43 – Creación de un evento corporativo transfronterizo y envío de la notificación. Técnica Repo.**

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CSD_43
Nombre del caso de prueba	<p>Creación satisfactoria del evento corporativo y envío de la notificación o anuncio a ECMS.</p> <p>Para un caso de evento corporativo a elegir entre los siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>
Relevante para	Iberclear
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Anuncio de evento corporativo
Modo A2A/U2A	A2A
Descripción del caso de prueba	Iberclear envía una notificación de evento corporativo seev.031 de tipo CANO NEWM (INTR, PRED, REDM, según corresponda) para un valor depositado en Iberclear y movilizado por parte de alguna contrapartida transfronteriza mediante la técnica repo.
Condiciones previas	<p>Iberclear está configurada en ECMS y creado el rol A2A.</p> <p>La contrapartida tiene posición en el activo transfronterizo en su pool de ECMS.</p>
Resultados esperados	<p>Se registra el evento corporativo en ECMS.</p> <p>El evento corporativo tiene el estado de “announced”.</p>
Privilegios necesarios	Rol de CSD A2A.

**2.2.8 ECMS\_TC\_CSD\_44 – Registro y envío de la confirmación del movimiento del evento corporativo transfronterizo. Técnica Prenda.**

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CSD_44
Nombre del caso de prueba	<p>Registro satisfactorio y envío a ECMS de la confirmación del pago del evento corporativo.</p> <p>Para un caso de evento corporativo a elegir entre los siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>
Relevante para	Iberclear
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Confirmación de evento corporativo
Modo A2A/U2A	A2A
Descripción del caso de prueba	Iberclear envía un mensaje de confirmación del pago del evento corporativo seev.036 de tipo CACO (INTR, PRED, REDM, según corresponda) para un valor depositado en Iberclear y movilizado por parte de alguna contrapartida transfronteriza mediante la técnica prenda.
Condiciones previas	<p>Iberclear está configurada en ECMS y creado el rol A2A.</p> <p>Se ha enviado a ECMS una notificación de evento corporativo seev.031 de tipo CANO NEWM.</p>
Resultados esperados	<p>-Para el caso de pago de cupón transfronterizo:</p> <p>Se ha abonado el pago a la cuenta de T2S de Banco de España y registrado la confirmación en ECMS.</p> <p>-Para el caso de amortización (parcial o final) transfronteriza:</p> <p>Se reduce la posición en el valor de la contrapartida.</p> <p>Se ha abonado el pago a la cuenta de T2S de Banco de España y registrado la confirmación en ECMS.</p>
Privilegios necesarios	El rol de CSD A2A

**2.2.9 ECMS\_TC\_CSD\_45 – Registro y envío de la confirmación del movimiento del evento corporativo transfronterizo. Técnica Repo.**

Identificador de Caso de Prueba	ECMS_TC_CSD_45
Nombre del caso de prueba	<p>Registro satisfactorio y envío a ECMS de la confirmación del pago del evento corporativo.</p> <p>Para un caso de evento corporativo a elegir entre los siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>-Pago de cupón transfronterizo.</li> <li>-Amortización parcial transfronteriza.</li> <li>-Amortización final transfronteriza.</li> </ul>
Relevante para	Iberclear
Dominio	Gestión de colateral
Sub-dominio	Confirmación de evento corporativo
Modo A2A/U2A	A2A
Descripción del caso de prueba	Iberclear envía un mensaje de confirmación del pago del evento corporativo seev.036 de tipo CACO (INTR, PRED, REDM, según corresponda) para un valor depositado en Iberclear y movilizado por parte de alguna contrapartida transfronteriza mediante la técnica repo.
Condiciones previas	<p>Iberclear está configurada en ECMS y creado el rol A2A.</p> <p>Se ha enviado a ECMS una notificación de evento corporativo seev.031 de tipo CANO NEWM.</p>
Resultados esperados	<p>-Para el caso de pago de cupón transfronterizo:</p> <p>Se ha abonado el pago a la cuenta de T2S de Banco de España y registrado la confirmación en ECMS.</p> <p>-Para el caso de amortización (parcial o final) transfronteriza:</p> <p>Se reduce la posición en el valor de la contrapartida.</p> <p>Se ha abonado el pago a la cuenta de T2S de Banco de España y registrado la confirmación en ECMS.</p>
Privilegios necesarios	Rol de CSD A2A.