



Reforma de la Compensación  
y Liquidación en España

Settlement  
Iberclear

# Grupo Nacional de Usuarios

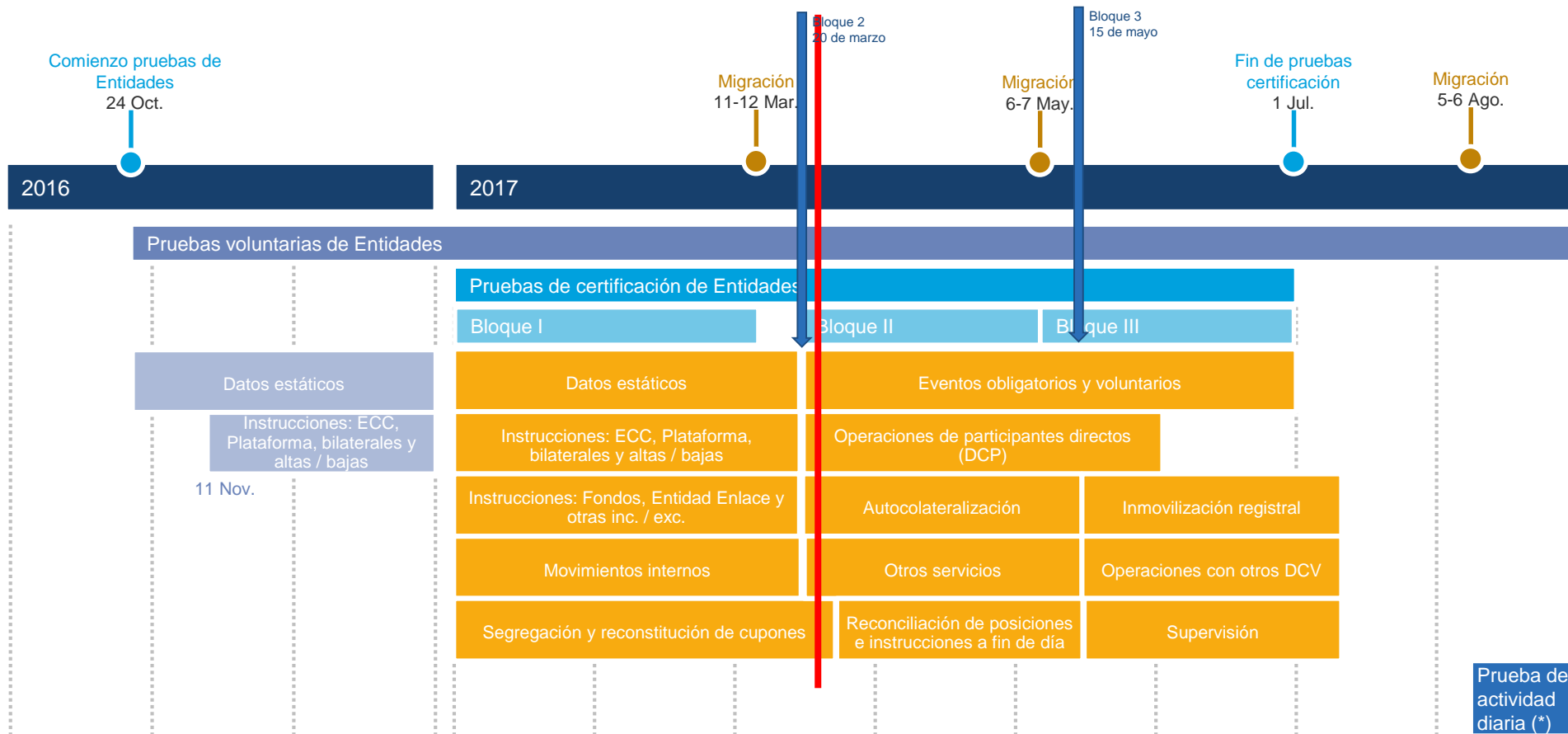
27 de Marzo 2017

*iberclear* BME X



# Calendario del proyecto

# Calendario de pruebas de Entidades



(\*) Pendiente planificar las semanas de pruebas de actividad diaria y la decisión sobre la prueba de migración de junio..

# Documentación de IBERCLEAR



## Cambios en el Manual de Procedimientos

- Se publicará la semana del 27 de marzo una nueva actualización al manual de procedimientos.
- Finalmente, se decide en el Comité de Coordinación de la Reforma que el Party 2 no se modifica.



## Documentación de migración

- Publicación del documento de migración actualizado previsto para la semana del 27 de marzo.
- Pendiente análisis de algunas peticiones de Entidades que se incluirán en versiones posteriores.
- Publicación del documento de resultados de la prueba de marzo prevista para la semana del 27 de marzo.

# Resultados de la prueba de migración (1/2)

## Conformidad de saldos

El 74% de las Entidades que tenían que confirmar saldos de CADE y/o ARCO lo han hecho.

- Aquellas Entidades que no confirmaron, en general, es porque no participaban en la prueba o delegan medios.

## Migración de posiciones

El 99% de las posiciones se migraron a T2S.

- 49.353 instrucciones enviadas.
- 514 rechazadas.

Aspectos identificados que se corregirán para la prueba de mayo:

- Los rechazos se debieron a Warrants cuya cuenta de Entidad Enlace no era correcta. Se informó a las Entidades afectadas por estos rechazos.
- Se migró el saldo a vencimiento de CADE en lugar del disponible.
- Algunas de las solicitudes de Entidades para trasladar sus saldos de CADE y ARCO 1 a cuentas de Entidades de ARCO 2 no se han realizado según lo especificado por la Entidad.
- Los saldos bloqueados de las cuentas de tipo P0BX se han migrado al sub-saldo AS01 en lugar del AWAS.
- En todas las cuentas asignadas, se ha incluido el saldo en AWAS en lugar de en el sub-saldo definido por defecto en cada cuenta.
- Se ha enviado mensajería ISO 15022 a los DCP.

## Migración de operaciones de ARCO 1

El 92,3% de las operaciones pendientes de ARCO 1 a transformar, fueron migradas.

De las 46.614 instrucciones enviadas:

- 43.034 aceptadas
- 3.580 rechazadas por T2S

Aspectos identificados que se corregirán para la prueba de mayo:

- La transformación de instrucciones parcialmente liquidadas se hizo por el efectivo original, y no por el pendiente de liquidar.

Otros aspectos identificados:

- Las canceladas, en su mayor parte se debieron a cuentas DCA que no estaban activas.

# Resultados de la prueba de migración (2/2)

## Ventana de comunicaciones del sábado

Las Entidades e infraestructuras (10 en total) comunicaron en esta ventana:

- 7.108 operaciones aceptadas.
- 810 operaciones rechazadas.

- El tiempo de la ventana de comunicaciones se redujo de 2 horas a 1 hora y media.

## Otros aspectos

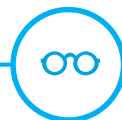
El lunes las Entidades comunicaron en total 171.150 operaciones:

- 170.072 aceptadas.
- 1.078 rechazadas.

El ratio de liquidación de todas las operaciones (migradas de ARCO 1 y comunicadas con FTL lunes 13 de marzo) es del 66,09% al final de la semana.

El final de la semana se cancelaron aproximadamente 80.000 operaciones pendientes.

- Retrasos en los envíos de ficheros desde los entornos de pruebas de IBERCLEAR.
- Algunas Entidades no disponían de acceso al entorno de pruebas de FORM CADE o han tenido dificultades para recuperar los ficheros.
- Los cambios en la planificación durante la prueba han tenido impacto en el desarrollo de la prueba en cada Entidad. Se tratará de establecer tiempos mínimos de aviso para cambios, que no podrán ser modificados.
- Se revisarán los canales de comunicación desde / hacia las Entidades para asegurar la corrección de los envíos/recepciones.



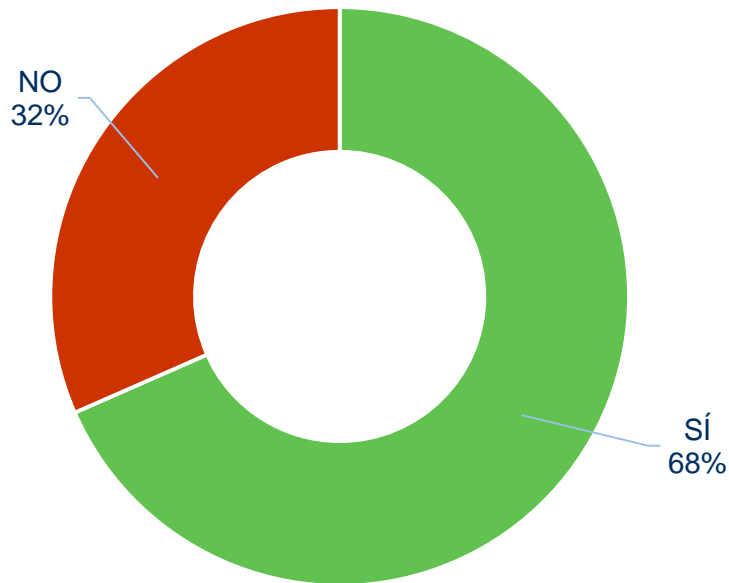
**En IBERCLEAR se están realizando las correcciones necesarias para la prueba de mayo.**

An abstract graphic on the left side of the slide, consisting of a complex network of interconnected nodes and lines in shades of blue and white, set against a dark blue background. The nodes are small circles, and the lines are thin, creating a web-like structure that suggests connectivity and data flow.

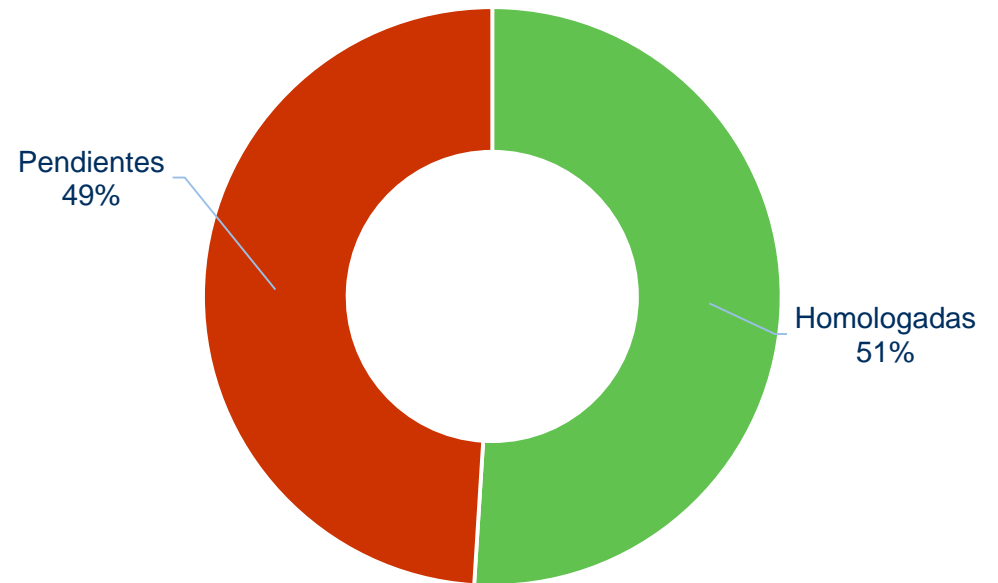
# **Soporte a Entidades**

# Estado de la homologación del Bloque I

## Entidades que están homologándose



## Pruebas homologadas



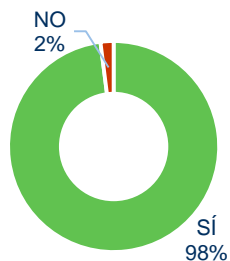


# Cuestionario de estado del proyecto

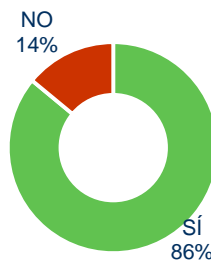


## Planificación del proyecto

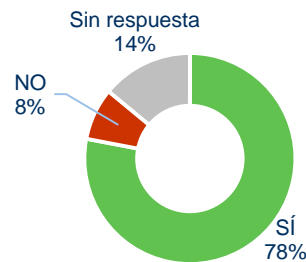
### Llega a septiembre



### Pruebas



### Clientes



## Documentación

- Publicación del Manual de BME-PC

## Homologación

- Revisión y contestación a las peticiones de exoneraciones de pruebas de homologación atendiendo a una definición por bloques de pruebas.

## Prueba de migración y operativa

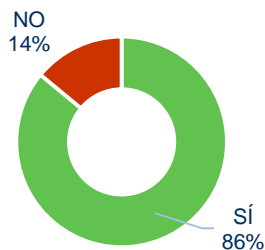
- Necesidad de intensificar la participación de las entidades para la prueba de migración de mayo.
- Definición de próximas pruebas de migración y operativa: análisis conjunto, propuesta y documentación.

## UCR

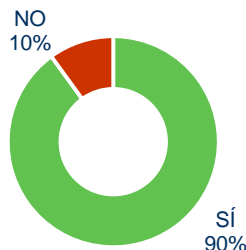
- Revisión y seguimiento de tiempos y respuestas del UCR

## Documentación del proyecto

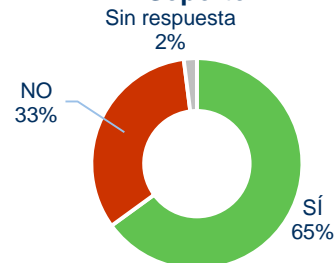
### Manual de procedimientos



### Migración



### Soporte



# Documentación de soporte

2016	2017		
Pruebas voluntarias de Entidades			
	Pruebas de certificación de Entidades		
	Bloque I	Bloque II	Bloque III
Documentación del Bloque I	Documentación del Bloque II	Documentación del Bloque III	
<p><b>9 diciembre</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Instrucciones: Fondos, Entidad Enlace y otras inc. / exc.</li> <li>Movimientos internos</li> <li>Segregación y reconstitución de cupones</li> </ul>	<p><b>27 enero</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Operaciones de participantes directos (DCP)</li> <li>Servicio de conciliación de efectivos</li> </ul>	<p><b>7 abril</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Eventos III (CONV, SPLR, MRGR, MCAL, PCAL, REDM, CHAN, INCR, DECR, PARI, SPLF)</li> </ul>	
	<p><b>10 febrero</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Autocolateralización</li> <li>Eventos I (DVCA, DVCP, SHPR, LIQU, OTHR, RHDI, BONU, DVSE, SOFF, INTR)</li> </ul>	<p><b>21 abril</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Eventos IV (OPAE, OPAN, BIDS, TEND, BPUT, EXWA, CONV, EXOF, TREC)</li> <li>Inmovilización Registral</li> <li>Operaciones con otros DCVs</li> </ul>	
<p><b>16 diciembre</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Reconciliación de posiciones e instrucciones a fin de día.</li> </ul>	<p><b>3 marzo</b></p> <p>Eventos II (EXRI, DVOP, MEET, OMET, BMET, XMET, REDM)</p>		



Plaza de la Lealtad, 1 · 28014 Madrid  
UCR.Iberclear.T2S@grupobme.es