

ESTADO DE LAS ADAPTACIONES DEL BANCO DE ESPAÑA A T2S

XXII REUNIÓN DEL GRUPO NACIONAL DE USUARIOS DE TARGET2-SECURITIES

Madrid

9 de junio de 2014

DEPARTAMENTO DE SISTEMAS DE PAGO



Overall Status G	Overall Status Description We can confirm that it is feasible to adapt our IT systems and processes to interoperate with T2S from a functional, technical and time perspective.
----------------------------	---

Key Risks Status G	Key Risks Status Description <i>We have not identified any risks.</i>
------------------------------	---

Overall SP9 (Former SP7) Status G	Overall SP9 (Former SP7) Status Description <i>On the cash side, Banco de España will connect directly to T2S via a VAN provider, in A2A and U2A modes. On the securities side, we intend to operate indirectly via IBERCLEAR. We foresee to have completed the adaptation of our IT systems and filled in the registration forms according to T2S specifications: T2S reference data, network services, technical addresses and message subscription services.</i>
---	---

Overall SP9 (Former SP8) Status G	Overall SP9 (Former SP8) Status Description <i>We expect to be ready for interoperability testing and to have completed the training of the staff involved in testing.</i>
---	--

Overall SP10 Status G	Overall SP10 Status Description <i>Banco de España expects to have achieved internal operational readiness when entering this test phase.</i>
---------------------------------	---

PRUEBAS DE LA COMUNIDAD BANCARIA EN T2S: HITOS RELEVANTES



CONECTIVIDAD U2A a T2S:

- **T2S GUI** (Participantes conectados directamente a T2S) ó
 - **ICM SERVICIOS DE VALOR AÑADIDO** (Conexión indirecta)
- ✓ **Fecha Comunicación opción elegida: diciembre 2014** (3 meses antes de las pruebas de comunidad ola 1)
- ✓ **Pruebas Certificación:**
- **T2S GUI:** Certifican Banco de España y BCE
 - **ICM SERVICIOS DE VALOR AÑADIDO:** Certifica el Banco de España

PERIODO PRUEBAS CON LA COMUNIDAD DE LA OLA 1 :

- ✓ **Pruebas conectividad DCPs :** 01/12/2014-27/02/2015
- ✓ **Pruebas de comunidad :** 02/03/2015-15/05/2015
- ✓ **Pruebas día de negocio:** 18/05/2015-12/06/2015

PRUEBAS DE LA COMUNIDAD BANCARIA EN T2S: ENSAYO GENERAL FIN DE SEMANA DE MIGRACIÓN (I)

TERMINOS DE REFERENCIA DE LAS PRUEBAS DE T2S. Principios Generales :

- ✓ Ensayo general del fin de semana de migración: Pruebas realizadas en fin de semana en las que se **replicarán exactamente todos los procesos y con el mismo horario que se realizarán en el fin de semana de migración** y hasta dos días adicionales de liquidación, utilizando el set completo de datos estáticos de producción.
- ✓ TARGET2 CUST estará conectado al entorno de T2S (*community environment*) donde se realizarán estas pruebas.
- ✓ Durante el periodo de pruebas de comunidad, las DCVs y los BCs **ejecutarán al menos una vez un ensayo general del fin de semana de migración con su comunidad.** Este ensayo será repetido hasta que sea ejecutado con éxito.

PRUEBAS DE LA COMUNIDAD BANCARIA EN T2S: ENSAYO GENERAL FIN DE SEMANA DE MIGRACIÓN (II)

- ✓ PMG ha aprobado un número máximo de 5 fines de semana por ola para realizar estas pruebas.

- ✓ La comunidad bancaria participará:
 - enviando **transferencias de liquidez** desde T2
 - enviando los activos elegibles y precios para los procesos de **autocolateralización de clientes** (en caso de ser ofrecidos)
 - **reconciliando** los movimientos producidos en sus DCA tras la liquidación del ciclo nocturno.

- ✓ En **abril de 2015** empezaran los ensayos del fin de semana de migración de la ola 1.