

Casos de pruebas de autorización para titulares de DCA

Los tenedores de DCA (cuentas dedicadas de efectivo) deben realizar las pruebas propuestas.

Las actividades se desarrollaran en el entorno de pruebas de comunidad, TARGET2 estará conectado a este entorno.

Finalizadas las pruebas deben reportar la realización de las mismas por medio del Formulario_Pruebas_T2T2S-AUT_DP.

1.1.1 Disponibilidad

El entorno de pruebas estará, en principio, disponible todos los días laborables. De lunes a viernes de 7:00 a 19:00.

| | T2S Standard Day | T2S Synchronised Standard Day |
|---|-------------------------|--------------------------------------|
| Start of Testing | 07:00 | 07:00 |
| Real time Settlement | | |
| - Partial settlement | 14:00-14:15 | 12:30-12:45 |
| - Partial settlement | 15:45-16:00 | 14:15-14:30 |
| - DVP/ Cash SR cut-off | 16:00 | 14:30 |
| - Collateral reimbursement | 16:20 | 14:50 |
| - BATM / CBO cut-off | 16:40 | 15:10 |
| - Inbound LTO cut-off / Automatic cash sweep | 16:45 | 15:15 |
| - Securities SR / FOP cut-off | 17:00 | 15:30 |
| End-of-day/start-of-day | | |
| - Change of business date | 17:45 | 16:15 |
| - Feeds from CMS | 18:00 | 16:30 |
| Start of Night-time settlement / cash injection | 18:30 | 17:00 |
| Night-time settlement | | |
| End of Testing | 19:00 | 19:00 |

Las pruebas se realizarán siguiendo los horarios de « T2S Synchronised Standard Day ». Los horarios de la descripción de los casos se refieren al « T2S Standard Day ».

1.1.2 Descripción detallada de los casos de prueba

La tabla bajo estas líneas proporciona un resumen de los casos de prueba a realizar. Las páginas a continuación en este anexo detallan la descripción de dichos casos.

| Caso | Identificación | Función | Tipo ¹ | Aplicable a ² |
|------|----------------|---|-------------------|----------------------------|
| 1 | AUTOCOL0010 | Recibir crédito vía autocolateralización on flow | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 2 | AUTOCOL0020 | Recibir crédito vía autocolateralización on stock | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 3 | RIGMN0010 | Creación de un usuario de negocio | O | Tenedor DCA-U2A |
| 4 | RIGMN0020 | Entregar rol a un usuario | O | Tenedor DCA-U2A |
| 5 | RIGMN0030 | Entregar privilegios a un usuario | O | Tenedor DCA-U2A |
| 6 | RIGMN0080 | Crear certificado DN | O | Tenedor DCA-U2A |
| 7 | RIGMN0090 | Crear vínculo certificado DN-usuario | O | Tenedor DCA-U2A |
| 8 | LIQTF0040 | Introducir una transferencia de liquidez | C | Tenedor DCA-U2A |
| 9 | LIQTF0070 | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez inmediata desde una DCA a una cuenta RTGS en Target2 | O | Tenedor DCA-U2A |
| 10 | LIQTF0080 | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez desde una DCA a una cuenta RTGS basándose en un evento | O | Tenedor DCA-U2A |
| 11 | LIQTF0090 | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez desde una DCA a una cuenta RTGS basándose en un momento del tiempo | O | Tenedor DCA-U2A |

1 O - Obligatorio, es decir casos que deben ser realizados por todos los usuarios a los que les sea aplicable según la columna siguiente.
C - Condicionado a su uso, es decir, deben ser realizados por todos los usuarios que vayan a utilizar la funcionalidad.

2 DCA - Cuenta dedicada de efectivo. MAP - Participante con más de una DCA vinculada al mismo Payment Bank. ICP - Participantes indirectamente conectados.

| | | | | |
|-----------|-------------|---|---|---------------------------------------|
| 12 | RPRT0010 | Configuración de un informe | O | Tenedor DCA-U2A |
| 13 | RPRT0020 | Recibir el informe con el extracto de cuenta | O | Tenedor DCA-U2A |
| 14 | QUERY0010 | Ejecutar consulta de saldo DCA Balance Query en U2A | O | Tenedor DCA-U2A |
| 15 | RESTR0010 | Introducir una settlement restriction en bloqueo de efectivo | C | Tenedor DCA-U2A |
| 16 | RESTR0020 | Introducir restricción de pago sobre la reserva de efectivo | C | Tenedor DCA-U2A |
| 17 | AUTOCOL0010 | Recibir crédito vía autocolateralización on flow | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 18 | AUTOCOL0020 | Recibir crédito vía autocolateralización on stock | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 19 | LIQUM0010 | Crear límites en el marco de colateralización de clientes | C | Tenedor DCA-U2A |
| 20 | LIQUM0020 | Actualizar límites en el marco de colateralización de clientes | C | Tenedor DCA-U2A |
| 21 | CMBMG0010 | Creación CMB secundario | C | Tenedor DCA-U2A |
| 22 | CMBMG0020 | Actualización del CMB secundario | C | Tenedor DCA-U2A |
| 23 | CLCOL0020 | Actualizar la información sobre valores elegibles en U2A | C | Tenedor DCA-U2A |
| 24 | CLCOL0030 | Eliminar valor de la lista de elegibles en U2A | C | Tenedor DCA-U2A |
| 25 | CLCOL0050 | Actualizar la información sobre valoración de activos elegibles en U2A | C | Tenedor DCA-U2A |
| 26 | CLCOL0070 | Cambiar la información sobre valoración de activos elegibles en U2A | C | Tenedor DCA-U2A |
| 27 | CLCOL0080 | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización on flow | C | Tenedor DCA-U2A y A2A |
| 28 | CLCOL0090 | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización on stock | C | Tenedor DCA-U2A y A2A |
| 29 | LIQTF0180 | Introducir en U2A una transferencia de liquidez inmediata entre DCAs del mismo Payment Bank | C | Tenedor de más de una DCA (MAP) |
| 30 | LIQTF0130 | Notificaciones de liquidaciones de efectivo en RTS | O | Tenedor DCA- A2A |

| | | | | |
|-----------|-------------|--|---|----------------------------------|
| 31 | QUERY0020 | Ejecutar una consulta del balance de una DCA (DCA Balance Query) en A2A | C | Tenedor DCA-A2A |
| 32 | AUTOCOL0010 | Recibir crédito vía autocolateralización on flow | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 33 | AUTOCOL0020 | Recibir crédito vía autocolateralización on stock | C | Tenedor DCA-U2A, A2A e ICP |
| 34 | CLCOL0010 | Actualizar la información sobre valores elegibles en A2A | C | Tenedor DCA-A2A |
| 35 | CLCOL0040 | Actualizar la información sobre la valoración de activos elegibles en A2A | C | Tenedor DCA-A2A |
| 36 | CLCOL0060 | Cambiar la información acerca de la valoración de activos elegibles en A2A | C | Tenedor DCA-A2A |
| 37 | CLCOL0080 | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización on flow | C | Tenedor DCA-U2A y A2A |
| 38 | CLCOL0090 | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización on stock | C | Tenedor DCA-U2A y A2A |

Gestión de los derechos de acceso.

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-RIGMN-0010 |
| Función | Creación de un usuario de negocio |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | El usuario debe disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none">- ARM_CreateUser- ARQ_T2SSysUserQueryT2SActorQuery |
| Descripción | <p>Un usuario es un objeto de datos estáticos que permite a un individuo o aplicación interactuar con T2S.</p> <p>En la pantalla de la GUI de T2S:</p> <ol style="list-style-type: none">1) Seleccione los usuarios en la pantalla search/list: <i>Static Data >> Access Rights >> Users</i>2) Haga Click el botón "New"3) Introduzca toda la información obligatoria. El usuario se define con el 'Login Name' y el 'System User Reference' que tendrá que ser único en el sistema.4) Haga Click en el botón "Submit" |
| Resultados esperados | <p>Se crea un usuario en el sistema</p> <p><i>Nota: Con sólo este escenario de prueba el usuario no podrá realizar ninguna acción en T2S, hacen falta otros tres pasos:</i></p> <ol style="list-style-type: none">1- <i>Crear Certificado DN.</i>2- <i>Crear el link usuario-certificado DN.</i>3- <i>Entregar roles o privilegios al usuario</i> |
| Referencias | <p>T2S-UHB 2.5.6.21 User - New/Edit Screen</p> <p>T2S-UHB 3.2.4.1 Create a New User</p> <p>T2S-UDFS 1.3.3.2.1 Configuration of users</p> |

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-RIGMN-0020 |
| Función | Entregar rol a un usuario |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | <p>Para entregar un rol a un usuario se debe ser administrador del rol. El administrador sólo puede entregar un rol a un usuario que pertenezca a su misma entidad en T2S.</p> <p>Privilegios:</p> <ul style="list-style-type: none"> - ARQ_RoleListQuery ARM_GrantRole <p>El rol no contendrá ningún privilegio que se solape con algún otro privilegio ya entregado al usuario vía privilegio o rol.</p> |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI de T2S GUI:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1- Vaya a la pantalla: <i>granted roles – search</i>: <i>Static Data >> Access Rights >> Grant/Revoke Roles</i> 2- Introduzca el login name del usuario en el campo ‘User’ y haga click en el botón Search 3- Seleccione el rol/roles que desee entregar al usuario en el cuadro ‘Roles’ 4- Haga click en el icono de flecha (apuntando hacia la derecha). |
| Resultados esperados | El rol es entregado al usuario. <input type="checkbox"/> |
| Referencias | <p>T2S- UHB 2.5.6.10 Grant/Revoke Role - New/Edit Screen T2S- UHB 3.2.4.5 Assign a Role to a User T2S- UDFS 1.3.3.2.3 Configuration of roles</p> |

| Test ID | AUTH-T2S-RIGMN-0030 |
|--------------------------------|---|
| Función | Otorgar privilegios a un usuario |
| Categoría | Obligatorio |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/ Night time |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • El usuario debe estar previamente creado. • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ ARQ_GrantedSysPrivilegesListQuery ○ ARQ_GrantedObjectPrivilegesListQuery ○ ARM_GrantPrivilege <p>El privilegio que se va a otorgar no debe solaparse con ningún otro privilegio otorgado al usuario vía privilegio o rol.</p> |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI de T2S:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Acceda a <i>Static Data</i>>><i>Access Rights</i> >> <i>Grant/Revoke Privileges</i> 2. Introduzca el Login name del usuario en el recuadro “User”. 3. Haga click en el botón Search. 4. Seleccione el privilegio/s que se desee otorgar al usuario en el recuadro “Privileges”. 5. Al pinchar en el icono de la flecha que apunta hacia la derecha (otorgar) se abrirá una nueva ventana. 6. Seleccione las opciones escogidas (Deny, 4-eyes o Administration) de la ventana <i>Input additional data</i>. 7. Pulse el botón Ok. <p>Si se va a otorgar un privilegio objeto:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Pinche en la flecha situada en la columna “Objetct” y aparecerá la pantalla <i>Grant/revoke object privilege – new/edit</i>. 2. Seleccione el objeto de datos estáticos o el secured group al que ha de otorgarse el privilegio, introduzca toda la información requerida en el recuadro “Object Privileges” y haga clic en los botones “add” y “submit”. |
| Resultados esperados | <p>El privilegio/s se ha otorgado al usuario <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UHB 2.5.6.7</p> <p>T2S-UHB 3.2.4.4</p> <p>T2S-UHB 1.3.3.1.2</p> |

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-RIGMN-0080 |
| Función | Crear Certificado DN |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | Privileges: - ARQ_CertificateDNQuery - ARM_CreateCertificateDN |
| Descripción | En la pantalla de la GUI de T2S: 1- Vaya a la pantalla Distinguished Names – search/list: <i>Static Data >> Access Rights >> Certificate Distinguished Names>> New Certificate Distinguished Name</i> 2- Rellene con la información del certificado 3- Haga click en "Submit" |
| Resultados esperados | Se crea el certificado DN pero todavía no está vinculado a un usuario. <input type="checkbox"/> |
| Referencias | T2S UHB 3.2.4.2 Create a New User Certificate Distinguished Name T2S UDFS 1.3.2 Authentication and authorisation |

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-RIGMN-0090 |
| Función | Crear vínculo certificado DN-usuario |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | <p>Se han creado previamente el usuario y el certificado DN.</p> <p>El usuario que ejecute la acción dispone de los siguientes privilegios:</p> <p>ARM_CreateUserCertificateDNLink</p> <p>ARM_DeleteUserCertificateDNLink</p> <p>ARQ_UserCertificateDNLinkQuery</p> |
| Descripción | <p>En la pantalla de la T2S GUI:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Vaya a la pantalla “user certificate distinguished name links – search/list” : <i>Static Data >> Access Rights >> User Certificate Distinguished Name Links</i> 2. Haga click en el botón “New”. 3. Introduzca toda la información necesaria en ‘User Certificate Distinguished Name Links’. 4. Haga click en “Submit” |
| Resultados esperados | El Certificado DN está ahora vinculado al usuario de modo que ahora dispone de acceso a la GUI. |
| Referencias | <p>T2S UHB 2.5.6.23 User Certificate Distinguished Name Link - New Screen</p> <p>T2S UHB 3.2.4.3 Create a New User Certificate Distinguished Name Link</p> <p>T2S UDFS 1.3.2 Authentication and authorisation</p> |

Gestión de la liquidez

| Test ID | AUTH-T2S-LIQUM-0010 |
|--------------------------------|--|
| Función | Crear límites en el marco de colateralización de clientes |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/ Night time |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• El participante tiene abierta una DCA con un CMB y, al menos, un Payment Bank registrado en dicho CMB como BIC Autorizado.• Disponer de los siguientes privilegios:<ul style="list-style-type: none">○ DCA Create limit○ DCQ Limit Query |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: Cash Accounts>>Limits</p> <ol style="list-style-type: none">1. Presione el botón “New”, en la esquina inferior izquierda de la pantalla.2. En el espacio “Valid from” introduzca fecha y hora para el comienzo de la validez del límite (no anterior a la fecha actual).3. En el espacio “Authorised BIC” introduzca BIC del Client Bank.4. En el espacio “Amount” introduzca la cuantía del límite en euros.5. En el espacio “Limit Type”, elija el tipo de límite adecuado (por ejemplo, “Auto-collateralisation...”).6. En el espacio “T2S Dedicated Cash Account Number”, introduzca la DCA incluida en el CMB7. Presione el botón “Submit” |
| Resultados esperados | <p>El nuevo límite se ha creado. Los datos son accesibles a través de la GUI : Cash Accounts>>Limits . <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS 1.6.2.2 T2S-UHB 2.5.4.7-2.5.4.8</p> |

| Test ID | AUTH-T2S-LIQUM-0020 | | | | |
|--------------------------------|--|--------------|--------------------|---------------|---------------------|
| Función | Actualizar límite/s en el ámbito de la colateralización de clientes | | | | |
| Categoría | Condicionada a su uso | | | | |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados | | | | |
| Fase del día de negocio | Day trade/ Night time | | | | |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Poseer los siguientes privilegios: Limitar consulta Actualizar límite • El participante debe tener abierta una DCA, con un CMB asignado. El DCP tiene al menos un payment bank registrado en el CMB como BIC autorizado, y se ha establecido un límite para dicho BIC. | | | | |
| Descripción | <p>En la pantalla <i>Cash>>Cash Account>>Limits</i> Seleccione el límite existente a modificar y haga clic en el botón "Edit". Modifique el campo "Amount" y pulse "Submit".</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th><i>Field</i></th> <th><i>Description</i></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><i>Amount</i></td> <td>Amount of the limit</td> </tr> </tbody> </table> | <i>Field</i> | <i>Description</i> | <i>Amount</i> | Amount of the limit |
| <i>Field</i> | <i>Description</i> | | | | |
| <i>Amount</i> | Amount of the limit | | | | |
| Resultados esperados | <p>El límite se ha actualizado conforme a la modificación realizada. Se puede acceder a los nuevos datos desde la pantalla de búsqueda <i>Cash>>Cash Account>>Limits</i>. <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> | | | | |
| Referencias | <p>T2S UDFS 1.6.2.2 T2S UHB 2.5.4.7-2.5.4.8</p> | | | | |

Transferencias de liquidez

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-LIQTF-0040 |
| Función | Orden de transferencia de liquidez |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/ Night time |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• El participante tiene abierta una DCA .• Disponer de los siguientes privilegios:<ul style="list-style-type: none">○ DCQ Liquidity transfer order list query○ DCQ Liquidity transfer order detail query |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: <i>Cash>>Liquidity>>Standing-Predefined Liq. Transfers.</i></p> <ol style="list-style-type: none">1. Presione el botón “New”, en la esquina inferior izquierda de la pantalla2. En el espacio “Order reference“ introduzca un texto identificativo de la transferencia de liquidez.3. En el espacio “Valid from” introduzca el primer día de negocio para la ejecución de la transferencia de liquidez. Para el objetivo de esta prueba, el siguiente día de negocio debe especificarse.4. En el espacio “Valid to” introduzca el último día de negocio para la ejecución de la transferencia de liquidez (se puede dejar en blanco y tomará por defecto la fecha 9999/12/31)5. En el espacio “Amount” introduzca cantidad de la transferencia de liquidez en euros, no superior a la liquidez actual en la DCA.6. En el espacio “Execution time” introduzca hora a la que la transferencia de liquidez será ejecutada..7. En el espacio “Order Type”, seleccione “Standing Order”.8. En el espacio “Credited External RTGS Account” introduzca una RTGS accesible desde T2S (para conseguir el propósito del test, la RTGS debe pertenecer al mismo participante).9. En el espacio “Debited T2S Dedicated Cash Account Number”, seleccione una DCA de las incluidas en la pestaña. Las DCAs incluidas dependerán de los derechos y privilegios de acceso. Si solo hay una posible DCA este campo será de solo lectura.10. Presione el botón “Submit”. |

Resultados esperados Una nueva Standing Order se ha creado. Los datos son accesibles a través de la GUI : *Cash>>Liquidity>>Liquidity Transfer Orders*. El usuario puede manejar la ejecución en todos los días de negocio del intervalo especificado.

Comentarios :

Referencias T2S-UDFS 1.6.2.1
T2S-UHB 2.5.4.9-2.5.4.11

| Test ID | AUTH-T2SI- LTF0070 | | | | | | | | | | | | |
|--|---|--------------|--------------------|--|--|-----------------------|--|---------------|----------------------|------------------------------------|---|-----------------------|-------------------|
| Función | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez inmediata desde una DCA a una cuenta RTGS en TARGET2. | | | | | | | | | | | | |
| Categoría | OBLIGATORIO | | | | | | | | | | | | |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados | | | | | | | | | | | | |
| Fase del día de negocio | Day trade | | | | | | | | | | | | |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Disponer del privilegio: CAM_Send New Liquidity Transfer • Liquidez suficiente en la cuenta DCA | | | | | | | | | | | | |
| Descripción | <p>El usuario que genera la transferencia de Liquidez debe acceder a la pantalla <i>Cash>>Liquidity>>Immediate liquidity Transfer>> Immediate liquidity Transfer Details>> New Immediate Liquidity Transfer</i> Rellene los siguientes campos y presione el botón “Submit”</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Campo</th> <th>Descripción</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><i>Account Number Debit Cash Account</i></td> <td>Identificación de la cuenta DCA que va a ser adeudada; si el usuario solamente tiene permiso para una DCA, el campo ya estará rellenado.</td> </tr> <tr> <td><i>User Reference</i></td> <td>Introduzca la identificación de la transferencia: max. 35 caracteres</td> </tr> <tr> <td><i>amount</i></td> <td>Importe a transferir</td> </tr> <tr> <td><i>Outbound liquidity transfer</i></td> <td>Seleccione el botón “outbound liquidity transfer”</td> </tr> <tr> <td><i>Account number</i></td> <td>Cuenta RTGS en T2</td> </tr> </tbody> </table> | Campo | Descripción | <i>Account Number Debit Cash Account</i> | Identificación de la cuenta DCA que va a ser adeudada; si el usuario solamente tiene permiso para una DCA, el campo ya estará rellenado. | <i>User Reference</i> | Introduzca la identificación de la transferencia: max. 35 caracteres | <i>amount</i> | Importe a transferir | <i>Outbound liquidity transfer</i> | Seleccione el botón “outbound liquidity transfer” | <i>Account number</i> | Cuenta RTGS en T2 |
| Campo | Descripción | | | | | | | | | | | | |
| <i>Account Number Debit Cash Account</i> | Identificación de la cuenta DCA que va a ser adeudada; si el usuario solamente tiene permiso para una DCA, el campo ya estará rellenado. | | | | | | | | | | | | |
| <i>User Reference</i> | Introduzca la identificación de la transferencia: max. 35 caracteres | | | | | | | | | | | | |
| <i>amount</i> | Importe a transferir | | | | | | | | | | | | |
| <i>Outbound liquidity transfer</i> | Seleccione el botón “outbound liquidity transfer” | | | | | | | | | | | | |
| <i>Account number</i> | Cuenta RTGS en T2 | | | | | | | | | | | | |
| Resultados esperados | <ul style="list-style-type: none"> • La transferencia de Liquidez inmediata se crea satisfactoriamente y se liquida por el importe indicado. <input type="checkbox"/> | | | | | | | | | | | | |
| Referencias | T2S-UHB 3.5.1.1 T2S-UDFS 3.3.3.13 | | | | | | | | | | | | |

AUTH-T2S-LIQTF-0080

| | |
|--------------------------------|--|
| Función | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez desde una DCA a una cuenta RTGS en TARGET2 basándose en un evento |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> Disponer del privilegio : DCA_CreateLiquidityTransferOrder Liquidez suficiente en la cuenta DCA |

Descripción El Usuario genera una transferencia de Liquidez vía T2S GUI. Por tanto el usuario tiene que ir a la pantalla
Static Data >> T2S Dedicated Cash Accounts >> Liquidity Transfer Orders
 Haga “click” en el botón “New”,
 Rellene los siguientes campos y presione el botón “Submit”

| Campo | Descripción |
|-------------------------------|--|
| <i>Order Reference*</i> | Muestra la descripción única de la orden de transferencia de liquidez. |
| <i>Valid From*</i> | Introduzca manualmente la fecha desde la que la orden de transferencia de liquidez tiene validez o utilice el icono del calendario. La fecha valid from deberá ser igual o posterior a la fecha del día. |
| <i>Valid To</i> | Introduzca manualmente la fecha hasta la que la orden de transferencia de liquidez tiene validez o utilice el icono del calendario. La fecha valid to deberá ser posterior a la fecha del día y a la fecha indicada en valid from. |
| <i>Amount*</i> | Importe a transferir |
| <i>Order Type*</i> | Seleccione el tipo de orden: Standing order Predefined order |
| <i>Event Code</i> <i>Type</i> | Seleccione el tipo de evento al que se asocia el envío de la orden de transferencia de liquidez. |
| <i>External RTGS Account</i> | Elija la RTGS de abono |

| | | |
|--|---|-----------------------------|
| | <i>Number Credit*</i> | |
| | <i>Debited T2S Dedicated Cash Account Number*</i> | Seleccione la DCA de adeudo |

Resultados esperados La Standing o Predefined order se crea satisfactoriamente.

Referencias T2S UDFS 1.6.2.1, 4.2.2
T2S UHB 2.5.4.11

AUTH-T2S-LIQTF-0090

| | |
|--------------------------------|---|
| Función | Introducir vía U2A una transferencia de liquidez permanente desde una DCA a una cuenta RTGS en TARGET2 especificando un momento del tiempo |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• Disponer del privilegio : DCA_CreateLiquidityTransferOrder• Liquidez suficiente en la cuenta DCA |

Descripción El Usuario genera una transferencia de Liquidez vía T2S GUI. Por tanto el usuario tiene que ir a la pantalla:
Static Data >> T2S Dedicated Cash Accounts >> Liquidity Transfer Orders
Haga click en el botón "New",
Rellene los siguientes campos y presione el botón "Submit"

| Campo | Descripción |
|------------------------------|--|
| <i>Order Reference*</i> | Muestra la descripción única de la orden. |
| <i>Valid From*</i> | Introduzca la fecha desde la que la orden de transferencia de liquidez tiene validez o utilice el icono del calendario. La fecha valid from deberá ser igual o posterior a la fecha del día. |
| <i>Valid To</i> | Introduzca la fecha hasta la que la orden de transferencia de liquidez tiene validez o utilice el icono del calendario. La fecha valid to deberá ser posterior a la fecha del día y a la fecha indicada en valid from. |
| <i>Amount*</i> | Importe a transferir |
| <i>Order Type*</i> | Seleccione el tipo of orden: Standing order Predefined order |
| <i>Hora de ejecución</i> | Seleccione la hora a la que se desee que se procese el envío de la orden de transferencia de liquidez. |
| <i>External RTGS Account</i> | Elija la RTGS de abono |

| | |
|---|----------------------------|
| <i>Number Credit*</i> | |
| <i>Debited T2S Dedicated Cash Account Number*</i> | Selecione la DCA de adeudo |

**Resultados
esperados**

La Standing o Predefined order se crea satisfactoriamente.

Referencias

T2S UDFS 1.6.2.1, 4.2.2
T2S UHB 2.5.4.11

| Test ID | AUTH-T2S-LIQTF-0130 |
|--------------------------------|--|
| Función | Notificaciones de liquidaciones de efectivo durante el RTS |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados (A2A) |
| Fase del día de negocio | Liquidación en tiempo real (RTS) |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Privilegios: <ul style="list-style-type: none"> NCQ_DisplayTechAddressNetSerLink NCQ_RoutingListQuery NCO_Create_Routing • El participante de efectivo debe tener la technical address correcta en sus datos estáticos. |
| Descripción | <p>En la pantalla:</p> <p><i>SD>>Network Configuration>>Routings</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Haga click en “New” 2. Describa la ruta, por ejemplo “<i>Cash Settlement Notifications during RTS</i>” 3. Elija el servicio de red (Swift.msgsnf) 4. Introduzca los dos BICs necesarios 5. La technical address debe aparecer en la lista desplegable 6. No haga click en “Default Routing” y elija mensaje comprimido si fuese necesario. 7. Elija un número de secuencia de ruta que no se esté utilizando. 8. Pinche en el recuadro “Positive”. 9. Elija la moneda. 10. Elija el tipo de mensaje (camt.054). 11. Haga click en “Submit” |
| Resultados esperados | <ul style="list-style-type: none"> • La ruta se ha creado correctamente. • El usuario puede acceder a los mensajes camt054. <p>Comentarios :</p> |

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-LIQTF-0180 |
| Función | Introducir en U2A una transferencia de liquidez inmediata entre DCAs del mismo Payment Bank |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Participante Directo, MAP (Tenedor de múltiples DCA) |
| Fase del día de negocio | Day trade |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Suficiente liquidez en la DCA. • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ CAM Send new Liquidity Transfer |
| Descripción | <p>El usuario introduce una transferencia de liquidez vía GUI. En la pantalla de la GUI: <i>CASH/LIQUIDITY/INMEDIATE LIQUIDITY TRANSFER DETAILS/NEW INMEDIATE LIQUIDITY TRANSFER</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Presione el botón “New”, en la esquina inferior izquierda de la pantalla 2. En el espacio “T2S Dedicated Cash Account Number” introduzca la DCA a adeudar. Si el usuario sólo tiene privilegios para una DCA, ésta vendrá indicada por defecto. 3. En el espacio “User Reference” introduzca la identificación de la transferencia de liquidez (máximo 35 caracteres). 4. En el espacio “Amount” inserte la cantidad de la transferencia en euros. 5. Seleccione el campo “Internal Liquidity Transfer”. 6. Dentro del campo “Credit Cash Account”, en el espacio “T2S Dedicated Cash Account Number”, introduzca la DCA a abonar. 7. Presione el botón “Submit” |
| Resultados esperados | <p>La cantidad adeudará una DCA y abonará otra <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS 2.13</p> <p>T2S-UHB 2.3.2.5</p> |

CMB Secundario

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-CMBMG-0010 |
| Función | Creación de un CMB secundario |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Liquidación en tiempo real (RTS) |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• Privilegios: DCA_CreateCMB DCQ_CMBDetailsQuery DCQ_CMListQuery• Deben haberse creado la DCA y la cuenta de valores Receiving del PB.• Debe haber sido creado un CMB primario. |
| Descripción | <p>Acceda a la pantalla: SD>>T2S DCA>>CMBs</p> <ol style="list-style-type: none">1. Haga click en el botón "New"2. Seleccione la DCA3. Asegúrese de que no está marcado "Primary CMB"4. Añada un "Wildcard Pattern" haciendo click en "+". Introduzca el BIC del cliente.5. Haga click en "Inclusion"6. Haga click en ✓ para guardar.7. Introduzca en "Receiving Securities Account" la cuenta de valores apropiada.8. Establezca una fecha de validez inicial de al menos D+19. Establezca un final de validez si fuera necesario10. Pulse "Submit" |
| Resultados esperados | Creación de un CMB secundario <input type="checkbox"/> Comentarios : |

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-CMBMG-0020 |
| Función | Actualización del CMB Secundario |
| Categoría | Condicionado a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Real Time Settlement |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • El CMB Secundario debe haber sido creado. • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ DCA Update CMB ○ DCQ CMB Details Query ○ DCQ CM List Query |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: <i>Static Data>>T2S Dedicated Cash Accounts>>CMBs</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Introduzca toda la información conocida del CMB. 2. Elija el CMB que desee actualizar. 3. Presione el botón "Edit". 4. Es posible: <ul style="list-style-type: none"> - Añadir, modificar o borrar un Authorized BIC Rule - Editar la cuenta Receiving de valores, o el campo "Valid To". 5. Presione el botón "Submit" |
| Resultados esperados | <p>CMB Secundario actualizado <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |

Restricciones

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-RESTR-0010 |
| Función | Introducir una settlement restriction en bloqueo de efectivo |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Liquidación en tiempo real (RTS) |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• Privilegio para introducir una settlement restriction<ul style="list-style-type: none">○ DDQ_IntraBalanceMovQuery○ CAM_SNDRC○ CAM_UCBBI○ SIG_LIPRP○ SIG_SIUIP |
| Descripción | <p>El usuario introduce una settlement restriction en bloqueo de efectivo a través de la pantalla:</p> <p><i>Cash>>Settlement>>Intra-balance movements</i></p> <ol style="list-style-type: none">1. Haga click en “New”2. Introduzca toda la información requerida en el apartado “Intra-Balance Movement”3. Para esta prueba seleccione un tipo de restricción de bloqueo como “Restriction Type Balance to”4. Opcionalmente, el usuario puede introducir información adicional acerca de la restricción a la liquidación en efectivo en los campos opcionales5. Para unir la restricción a la liquidación en efectivo a otra instrucción haga click en “+” para añadir un nuevo link.6. Si se ha realizado el punto 5: Seleccione y añada toda la información requerida para identificar la instrucción, que debe estar enlazada a la restricción a la liquidación en efectivo. Una vez que toda la información ha sido introducida haga click en ✓ en la columna “Options”.7. Haga click en “Submit” |
| Resultados esperados | <p>Se debe haber creado una nueva restricción a la liquidación en efectivo</p> <p><input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS 2.5.1</p> <p>T2S-UHB 2.3.3.7, 3.16.2.1</p> |

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-RESTR-0020 |
| Función | Introducir restricción de pago sobre la reserva de efectivo |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Liquidación en tiempo real (RTS) |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Disponer de los siguientes privilegios para introducir restricciones de pago: <ul style="list-style-type: none"> ○ CAM SNDRC ○ CAM UCBBI ○ SIG LIPRP ○ DDQ IntraBalanceMovQuery. ○ SIG SIUIP |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: <i>Cash>>Settlement>>Intra-balance movement</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Pulse el botón “new” 2. Introduzca toda la información obligatoria en el área “Intra Balance Movement 3. Para esta prueba seleccione una reserva a la restricción como “Restriction Type Balance to”. 4. Opcionalmente el usuario introduce información adicional sobre la restricción en los campos opcionales. 5. Para enlazar la restricción de pago con alguna otra instrucción pulse en el icono “+” y añada el link (no es obligatorio). 6. De haber realizado el punto 5, seleccione y añada toda la información requerida para identificar la instrucción que debe estar ligada a la restricción. Una vez que toda la información ha sido introducida pulse el botón Submit changes en la columna de opciones. 7. Pulse el botón “submit”. |
| Resultados esperados | <p>La nueva restricción de efectivo se ha creado. <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S UDFS 2.5.1</p> <p>T2S-UHB 2.3.3.7,3.16.2.1</p> |

Autocolateralización

| Autocolateralización | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-AUTCOL0010 |
| Función | Recibir crédito vía autocolateralización on flow |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directa e indirectamente conectados. |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• La DCA cumple los requisitos para recibir autocolateralización de un Banco Central.• Identificar los valores elegibles como colateral <p>Para asegurar el crédito intradía, T2S coge primero el colateral on flow, complementándolo, en caso de ser necesario, con colateral on stock. El colateral on flow se obtiene de valores enviados a posiciones de valores señaladas para autocolateralización.</p> <p>Entre cuentas de valores para las que un link para suministro de colateral con una DCA ha sido establecido.</p> |

Descripción T2S intenta la autocolateralización (on flow en primer lugar) durante el case provisional si todas las siguientes condiciones se cumplen, en relación con los límites de crédito intradía:

- Existencia de insuficiencia de recursos
- Suficiente límite sin consumir
El límite de autocolateralización asociado al CMB es suficiente para liquidar la instrucción del cliente.
- La instrucción que conlleva autocolateralización on flow:
 - Implica un movimiento de recepción de valores
 - Disminuye el efectivo disponible en una DCA con insuficiencia de fondos
- La cuenta de valores identificada para proveer de colateral:
 - La cuenta de valores involucrada en la instrucción de recepción de valores está unida a través de un CMB para proveer colateral con el crédito.
 - La cuenta de valores para proveer de colateral no está sujeta a ninguna restricción intradía.
- El ISIN implicado en la instrucción de recepción de valores es elegible como colateral para el proveedor de crédito (el Banco Central Nacional)
- El ISIN implicado en la instrucción de recepción de valores es elegible para liquidar en el CSD que posee la cuenta de valores a la que se mueve el colateral.
- El ISIN implicado no tiene vínculos estrechos con la entidad identificados en T2S.
- El ISIN implicado en la instrucción de recepción de valores no está sujeto a ninguna restricción intradía.
- La Settlement Instruction / Restriction susceptible de colateralizarse no está sujeta a CSD rejection, CSD Validation o reglas CoSD.

La Settlement Instruction con colateral resultante de seleccionar dicho colateral on flow no está sujeta a CSD rejection, CSD validation o reglas CoSD.

Resultados esperados

Se ha establecido la configuración de la colateralización on flow

Si la capacidad de crédito intradía calculada cubre la insuficiencia de efectivo o el límite insuficiente; T2S selecciona los valores que va a tomar como garantía entre el colateral disponible.

El colateral on flow es el primero en seleccionarse, complementándose de ser necesario con el colateral on stock.

El tenedor de DCA debe ser capaz de monitorizar el crédito recibido con la autocolateralización a través de la GUI de T2S o los mensajes A2A, pues todo el crédito recibido debe ser reembolsado como tarde a las 16.30. De no reembolsarse el crédito recibido desencadenaría el proceso de recolocación.

El crédito recibido por autocolateralización pendiente de reembolsar por el tenedor de DCA puede monitorizarse en:

- Outstanding Auto-Collateralisation Credits

Comentarios :

Referencias

T2S-UHB 3.13.4 Configuration for Central Bank Collateralisation

T2S-UDFS 1.6.1.9.4 Auto-collateralisation

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-AUTOCOL0020 |
| Función | Recibir crédito vía Autocolateralización “on stock” |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directa e indirectamente conectados. |
| Fase del día de negocio | Todas la fases |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • La DCA cumple los requisitos para recibir Autocolateralización de un Banco Central. • Identificar los valores elegibles como colateral <p>El titular de la DCA sólo recibirá crédito vía Autocolateralización si los valores de la cuenta están segregado y son elegibles para Autocolateralización :</p> <p>En la casilla del valor “Earmarking for auto-collateralisation” para la divisa actual o todas las divisas;</p> <p>Entre cuentas de valores para las que se ha establecido un link para proveer de colateral a una DCA de T2S.</p> |
| Descripción | <p>Una vez terminada la configuración, T2S automáticamente proporciona crédito vía Autocolateralización “on stock” cuando sea necesario. Las condiciones requeridas para ello son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ausencia de efectivo suficiente en la DCA. • Capacidad suficiente para el pago (sumando el efectivo existente más el crédito disponible) • La cuenta de valores implicada en la instrucción ha de estar vinculada vía CMB para colateralizar el crédito. • La cuenta de valores no debe tener restricciones intradía. • Los valores son elegibles para Autocolateralización <ul style="list-style-type: none"> · El ISIN es elegible por el NCB proveedor del crédito. · El ISIN es elegible por el CSD en el que se encuentra la cuenta de valores a la que va a ir a parar el colateral. · El ISIN no tiene vínculos cercanos identificados en T2S con el consumidor del crédito. · El ISIN objeto no tiene ninguna restricción intradía. · La instrucción de pago colateralizable no es objeto de restricciones en la CSD. · La instrucción generadora de colateral resultante de la selección de colateral on stock no está sujeta a ninguna restricción en la CSD |
| Resultados esperados | <p>Configuración para la colateralización « on stock » realizada.</p> <p>Si la capacidad de crédito intradía cubre la ausencia de efectivo, T2S elige los valores que garantizan la operación entre el colateral disponible. (el colateral « on stock » sólo saltará si no hay colateral « on flow » suficiente)</p> |

El titular de la DCA debe ser capaz de monitorizar los balances de autocolateralización vía GUI o A2A. Todo el crédito recibido debe ser reembolsado a las 16 :30 (hora límite) La falta de reembolso desencadenará el proceso de Relocation.

El montante total de autocolateralización recibida y no reembolsada puede ser monitorizada en « Outstanding Auto-Collateralisation Credits »

Comentarios :

Referencias T2S-UDFS 1.6.1.9.4 Auto Collateralisation
T2S-UHB 3.13.14 Configuration for Central Bank Collateralisation

Colateralización de clientes

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0010 |
| Función | Actualizar la información sobre valores elegibles en A2A |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA Participantes Directos |
| Fase del día de negocio | Todas las fases (los cambios sólo serán tenidos en cuenta para el día siguiente) |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none">• Conexión A2A• Usuario válido en A2A con el siguiente privilegio:<ul style="list-style-type: none">○ SDN Create auto-collateralisation eligibility link. |
| Descripción | <p>Los titulares de DCA son responsables de la elegibilidad de los valores para la colateralización de clientes, así como de su valoración.</p> <p>Los titulares de DCA o las partes autorizadas por ellos, enviarán a T2S la “EligibleSecuritiesCreationRequestV01” (reda.025.001.01). A través de este mensaje se proporcionan detalles de la elegibilidad del valor para la colateralización de clientes. El mensaje está compuesto de las siguientes partes:</p> <ul style="list-style-type: none">• MessageIdentification• EligibleSecurity <p>T2S responde con el mensaje “CollateralDataStatusAdviceV01” (reda.028.001.01) cuando la clasificación del valor como elegible se ha procesado con éxito, encolado o ha sido rechazada.</p> |
| Resultados esperados | <p>La información sobre los valores elegibles está actualizada y es tenida en cuenta para los procesos de T2S del próximo día de negocio. <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS 1.2.3 y 2.26</p> <p>T2S-UDFS 1.6.3.3.3 Validity of static data objects</p> <p>T2S-UDFS3.3.6.19 EligibleSecuritiesCreationRequestV01 (reda.025.00101)</p> <p>MyStandards:http://www.swift.com/mystandards/T2S/reda.025.001.01</p> <p>T2S</p> |

| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0020 |
|--------------------------------|---|
| Función | Actualizar la información acerca de valores elegibles en T2S en U2A |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <p>El usuario debe tener los siguientes privilegios:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Auto-collateralisation eligibility links query • Create auto-collateralisation eligibility link |
| Descripción | <p>En la pantalla T2S GUI entre en:</p> <p><i>Static Data>>Securities>>Auto-Collateralisation Eligibility Links</i></p> <p>En la pantalla Auto-collateralisation eligibility links search/list haga click en “New”.</p> <p>El Usuario debe rellenar los campos con la información referente al participante de efectivo y el link elegible.</p> |
| Resultados esperados | <p>La información sobre los valores elegibles se ha actualizado y se tendrá en cuenta en los procesos de T2S desde el día siguiente <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS Chapters 1.2.3 y 2.26</p> <p>T2S-UDFS 1.6.3.3.3 Validity of static data objects</p> <p>T2S-UHB 2.5.2.2 Auto-Collateralisation Eligibility Link – New Screen</p> |

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0030 |
| Función | Eliminar valor de la lista de elegibles en U2A |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA Participantes Directos |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ Auto-collateralisation eligibility links query. ○ Delete Auto-collateralisation eligibility link. |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: Static Data>>Securities>>Auto-collateralisation Eligibility Links</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Introducir los filtros relevantes y pulsar “search” 2. Elegir el CMB que queremos actualizar. 3. Seleccionar el ISIN a eliminar y pulsar “delete”. 4. Confirmar la eliminación. |
| Resultados esperados | <p>La condición de elegible del valor es borrada y se tendrá en cuenta en los procesos de T2S del próximo día de negocio. <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | T2S UHB 2.5.2.1 Auto-collateralisation Eligibility Links Search/List Screen |

| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0040 |
|--------------------------------|---|
| Función | Actualizar la información sobre valoración de activos elegibles en A2A |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Antes de las 19:00 |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> - Comunicación A2A permitida - Usuario válido en A2A - Inclusión en la white list (lista) Privilegios requeridos: <ul style="list-style-type: none"> - Create Securities Valuation |

Descripción Los tenedores de DCA son responsables de definir la elegibilidad para la colateralización de clientes de los valores referidos y de proporcionar precios para valorar las posiciones de valores susceptibles de colateralización de clientes.

El esquema XML que se utiliza para insertar el archivo en un mensaje "store and forward" es:

```
<?xml version="1.0" ?>
<xs:schemaxmlns="urn:T2S:SecuritiesValuationBulkFile"
xmlns:xs="http://www.w3.org/2001/XMLSchema"
targetNamespace="urn:T2S:SecuritiesValuationBulkFile" 7
elementFormDefault="qualified">
<xs:simpleType name="RestrictedFileType">
<xs:restriction base="xs:string">
<xs:pattern value="(.{183,183})+"/>
</xs:restriction>
</xs:simpleType>
<xs:element name="File" type="File"/>
<xs:complexType name="File">
<xs:simpleContent>
<xs:extension base="RestrictedFileType">
<xs:attribute name="fileId" type="xs:string" default="" />
</xs:extension>
</xs:simpleContent>
</xs:complexType>
</xs:schema>
```

En el archivo de respuesta T2S proporciona el mismo valor FileId aportado por T2S:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<FilefileId="T2SSVAFile20150630"
xmlns="urn:T2S:SecuritiesValuationBulkFile">Record1
Record
Recordn
</File>
```

El archivo respuesta enviado de T2S al T2S Actor contendrá el File Tag con un número variable de líneas dependiendo del número de errores desencadenados. Si no se ha rechazado nada, el archivo insertado estará vacío:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<FilefileId="T2SSVAFile20150630"
xmlns="urn:T2S:SecuritiesValuationBulkFile"></File>
```

Resultados esperados La información sobre la valoración de los activos elegibles se ha actualizado una vez que el evento se ha desencadenado en T2S
Comentarios :

Referencias T2S-UDFS Chapter 1.2.3 y 2.26

| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0050 |
|--------------------------------|---|
| Función | Actualizar la información sobre valoración de activos elegibles en U2A |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA Participantes Directos |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ Securities valuations-search/list screen. ○ Securities valuations-new/edit screen |
| Descripción | <p>En la pantalla de la GUI: Static Data>>Securities>>Securities Valuations.</p> <ol style="list-style-type: none"> 5. Pulsar el botón “new”. 6. Aparecerá la pantalla de valoración de valores 7. Introducir toda la información obligatoria (un ISIN existente y el parent BIC y el BIC de la parte activa). La combinación de valor, party y fecha de valoración debe ser única. El campo “price” ha de ser cumplimentado con el tipo de pago de valores definido para ese ISIN 8. Pulsar el botón “Submit”. |
| Resultados esperados | <p>Una nueva valoración de activos ha sido creada . <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S UHB 3.14.1.3 Create a New Securities Valuation 2.5.2.9 Securities Valuation-New Screen</p> <p>T2S UDFS 1.2.3 Auto-Collateralisation eligibility, securities valuation and close links</p> |

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0060 |
| Función | Cambiar la información acerca de la valoración de los activos elegibles en A2A |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Todas las fases. Sin embargo, las 7.00 pm son límite para aceptar actualizaciones de datos efectivas para la fecha corriente, de los sistemas de gestión del colateral y payment/settlement Banks. |
| Pre-condiciones | Comunicación A2A permitida Usuario válido en A2A Privilegio requerido: Create Securities Valuation |
| Descripción | <p>Este caso no difiere del AUTH-T2S-CLCO0050 (Actualizar la información sobre la valoración de los activos elegibles en U2A). La única diferencia es que en este caso el tenedor de DCA ha dado una valoración previa al ISIN.</p> <p>Los tenedores de DCA son responsables de definir la elegibilidad para colateralización de clientes de los valores y de proporcionar los precios para la valoración de las posiciones de valores para colateralización de clientes.</p> |
| Resultados esperados | <p>La valoración de activos elegibles se ha modificado una vez se ha producido el evento desencadenante en T2S <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S-UDFS Chapters 1.2.3 y 2.26</p> <p>T2S-UDFS 3.3.6.18 CollateralValueCreationRequestV01 (reda.024.001.01)</p> <p>http://www.swift.com/mystandards/T2S/reda.024.001.01_T2S</p> |

| | |
|--------------------------------|---|
| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0070 |
| Función | Cambiar la información sobre valoración de activos elegibles en U2A |
| Categoría | Condicionada a su uso. |
| Aplicable a | Tenedores de DCA Participantes Directos |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Disponer de los siguientes privilegios: <ul style="list-style-type: none"> ○ Securities valuations-search/list screen. ○ Securities valuations-new/edit screen |
| Descripción | <p>Se trata del mismo caso AUTH-T2S-CLCOL0050, solo que en este caso existía una previa valoración</p> <p>En la pantalla de la GUI: Static Data>>Securities>>Securities Valuation.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Pulsar el botón “new”. Se abrirá la pantalla de valoración de valores. 2. Introducir toda la información obligatoria (un ISIN existente y el parent BIC y el BIC de la parte activa) El campo “price” ha de ser cumplimentado con el tipo de pago de valores definido para ese ISIN 3. Pulsar el botón “Submit”. |
| Resultados esperados | <p>Una nueva valoración de activos ha sido creada . <input type="checkbox"/></p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | <p>T2S UHB 3.14.1.3 Create a New Securities Valuation 2.5.2.9 Securities Valuation-New Screen</p> <p>T2S UDFS 1.2.3 Auto-Collateralisation eligibility, securities valuation and close links</p> |

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0080 |
| Función | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización on flow |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <p>Configuración de parámetros en los datos estáticos, aplican a tenedor de DCA:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Static data <ul style="list-style-type: none"> • Procedimiento de gestión del colateral. No se requiere configuración específica pues el procedimiento REPO se aplica a todas las operaciones de colateralización de clientes. • Cuentas de valores para la gestión del colateral en el procedimiento de REPO Los Payment/Settlement Banks deben determinar, para cada uno de sus clientes autorizados a usar su T2S DCA, la cuenta de valores donde se mantiene el colateral elegido. • Colateral elegible y precios del colateral El Payment/Settlement Bank debe proporcionar a T2S una lista de los valores que acepta como colateral y, cada día de liquidación, sus precios asociados. • Cuantía máxima que puede otorgarse a cada receptor de crédito Los Payment/Settlement Banks han de establecer en los datos estáticos el máximo crédito intradía que puede otorgarse a través de colateralización de clientes a cada uno de sus clientes autorizados para usar su T2S DCA. 2. Identificación de colateral disponible por el receptor de crédito <ul style="list-style-type: none"> • Links entre las cuentas de valores para suministro de colateral A través de un CMB el CSD del receptor del crédito con colateralización de clientes debe establecer links entre la T2S DCA y la cuenta de valores. • Identificación de posiciones de valores elegibles como colateral |

| | |
|--------------------|--|
| Descripción | <p>T2S intenta realizar colateralización de clientes (primero on flow) durante el chequeo provisional, en el caso de que se cumplan las siguientes condiciones relacionadas con los límites de crédito intradía:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ausencia de recursos El límite de la garantía externa es insuficiente para liquidar de Settlement Instruction de un cliente de un Payment/Settlement Bank. • Suficiente límite disponible La suma de los techos de todos los tipos de límites asociados al CMB es suficiente para liquidar la Settlement Instruction del cliente. • La Settlement Instruction identificada para colateralización: <ul style="list-style-type: none"> - Tiene un movimiento de recepción de valores - Disminuye el techo de la garantía externa insuficiente. • Cuenta de valores identificada para proveer colateral: La cuenta de valores implicada en la Settlement Instruction de recepción tiene un link a través de un CMB para proveer de colateral, en el caso de que el CMB tenga un límite de garantía externa insuficiente. La cuenta de valores que provee colateral no está sujeta a ninguna restricción intradía. • El ISIN implicado en la Settlement Instruction es elegible como colateral por el proveedor de crédito. • El ISIN implicado en la Settlement Instruction es elegible para liquidación en la CSD que posee la cuenta de valores a la que se transfiere el colateral. • El ISIN implicado en la Settlement Instruction no tiene vínculos estrechos con el receptor de crédito. • El ISIN implicado en la Settlement Instruction no está sujeto a ninguna restricción intradía. • La Settlement Instruction / Restriction susceptible de colateralizarse no está sujeta a CSD rejection, CSD Validation o reglas CoSD. <p>La Settlement Instruction con colateral resultante de seleccionar dicho colateral on flow no está sujeta a CSD rejection, CSD validation o reglas CoSD.</p> |
|--------------------|--|

| | |
|-----------------------------|--|
| Resultados esperados | <p>Se ha establecido la configuración para colateralización on flow. <input type="checkbox"/></p> <p>Si la cantidad de crédito intradía calculada cubre la falta de efectivo o el límite insuficiente, T2S selecciona los valores que tomará como garantía entre el colateral disponible :</p> <p style="padding-left: 40px;">El colateral on flow se selecciona primero, complementándose de ser necesario con colateral on stock.</p> <p>Comentarios :</p> |
|-----------------------------|--|

| | |
|--------------------|---|
| Referencias | <p>T2S-UHB 3.13.5 Configuration for Client Collateralisation T2S-UDFS 1.6.1.9.4 Auto-collateralisation.</p> |
|--------------------|---|

| Test ID | AUTH-T2S-CLCOL0090 |
|--------------------------------|---|
| Función | Proporcionar crédito (a un cliente) vía colateralización “on stock” |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA Participantes Directos |
| Fase del día de negocio | Todas las fases |
| Pre-condiciones | <p>Configuración de parámetros en los datos estáticos, aplican a tenedor de DCA:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Static data <ul style="list-style-type: none"> • Procedimiento de gestión del colateral. No se requiere configuración específica pues el procedimiento REPO se aplica a todas las operaciones de colateralización de clientes. • Cuentas de valores para la gestión del colateral en el procedimiento de REPO Los Payment/Settlement Banks deben determinar para cada uno de sus clientes autorizados a usar su T2S DCA la cuenta de valores donde se mantiene el colateral elegido. • Colateral elegible y precios del colateral El Payment/Settlement Bank debe proporcionar a T2S una lista de los valores que acepta como colateral y cada día de liquidación sus precios asociados. • Cuantía máxima que puede otorgarse a cada receptor de crédito Los Payment/Settlement Banks han de establecer en los datos estáticos el máximo crédito intradía que puede otorgarse a través de colateralización de clientes a cada uno de sus clientes autorizados para usar su T2S DCA. 2. Identificación de colateral disponible por el receptor de crédito <ul style="list-style-type: none"> • Links entre las cuentas de valores para suministro de colateral A través de un CMB el CSD del receptor del crédito con colateralización de clientes debe establecer links entre la T2S DCA y la cuenta de valores. • Identificación de posiciones de valores elegibles como colateral El consumidor de crédito intradía vía colateralización debe segregar los valores disponibles como colaterales. |

| | |
|--------------------|---|
| Descripción | <p>Una vez hecha la configuración, T2S provee automáticamente crédito vía colateralización de clientes “on stock” cuando sea necesario.</p> <ul style="list-style-type: none">• Ausencia de recursos El límite de la garantía externa es insuficiente para liquidar de Settlement Instruction de un cliente de un Payment/Settlement Bank.• Suficiente límite disponible La suma de los techos de todos los tipos de límites asociados al CMB es suficiente para liquidar la Settlement Instruction del cliente.• Cuenta de valores identificada para proveer colateral: La cuenta de valores implicada en la Settlement Instruction de recepción tiene un link a través de un CMB para proveer de colateral en caso de que el límite de garantía externa sea insuficiente.• La Settlement Instruction identificada para colateralización:<ul style="list-style-type: none">○ El ISIN implicado en la Settlement Instruction es elegible como colateral por el proveedor de crédito.○ El ISIN implicado en la Settlement Instruction es elegible para liquidación en la CSD que posee la cuenta de valores a la que se transfiere el colateral.○ El ISIN implicado en la Settlement Instruction no tiene vínculos estrechos con el receptor de crédito.○ El ISIN implicado en la Settlement Instruction no está sujeto a ninguna restricción intradía.○ La Settlement Instruction / Restriction susceptible de colateralizarse no está sujeta a CSD rejection, CSD Validation o reglas CoSD. |
|--------------------|---|

| | |
|-----------------------------|---|
| Resultados esperados | <p>Se ha establecido la configuración para colateralización on stock. <input type="checkbox"/></p> <p>Si la cantidad de crédito intradía calculada cubre la falta de efectivo o el límite insuficiente, T2S selecciona los valores que tomará como garantía entre el colateral disponible :</p> <p>El colateral on flow se selecciona primero, complementándose de ser necesario con colateral on stock.</p> <p>Comentarios :</p> |
|-----------------------------|---|

| | |
|--------------------|---|
| Referencias | <p>T2S-UHB 3.13.5 Configuration for Client Collateralisation T2S-UDFS 1.6.1.9.4 Auto-collateralisation.</p> |
|--------------------|---|

Informes

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-RPRT-0010 |
| Función | Configuración de los informes |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade |
| Pre-condiciones | Disponer de los privilegios: <ul style="list-style-type: none">- Report configuration list query (RCO_ReportConfigListQuery)- Report configuration details query (RCO_ReportConfigDetailQuery)- Create report configuration (RCO_CreateReportConfiguration) |
| Descripción | <p>En la GUI de T2S acceda a la pantalla: “Report configurations – search/list: Static Data >> Messages and Reports >> Report Configurations”:</p> <ol style="list-style-type: none">1. Haga click en el botón “New”. Se despliga la pantalla “Report configuration – new screen”.2. Introduzca toda la información requerida en ‘Report Configuration’3. Seleccione el icono “x changes left”.4. Introduzca la información sobre el destinatario del informe y el modo de ejecución (no marque push mode en U2A) en el cuadro “Report Configuration Party Links”5. Haga click en el icono “Submit changes” de la columna “Opciones”.6. Haga click en “Submit”. |
| Resultados esperados | <p>Se crea una configuración del informe.</p> <p>Se recibirá el informe de acuerdo a la configuración definida.</p> |
| Referencias | T2S-UHB 3.9.1.1, 6.3.3.132 and 6.3.3.133 T2S-UDFS 1.3.3.1.2 |

| Test ID | AUTH-T2S- RPRT-0020 |
|--------------------------------|---|
| Función | Recibir el informe con el extracto de cuenta |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Day trade/Night Time |
| Pre-condiciones | <p>Disponer de los privilegios:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Report Details Query (RCO_ReportDetailsQuery) - Report list query (RCO_ReportListQuery) <p>Ha configurado previamente el informe con el extracto de cuenta.</p> |
| Descripción | <p>1. Se ha configurado la recepción de “<i>Statement of Accounts Report</i>”.</p> <p>2. El usuario comprueba la generación del informe a través de las siguientes pantallas :</p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>Services >> Additional Services >> Reports >> Available reports – search/list screen >> Select the report >> Haga click en el botón the “details” , o</i> - <i>Services >> Additional Services >> Reports >> Available reports – search/list screen >> Cumplimente el criterio para buscarSearch >> Haga click en el botón “search”>> Select the report >> Haga click en el botón “details” , o</i> - <i>Static Data >> Messages and Reports >> Report Configuration >> Report configurations – search/list screen >> Cumplimente el criterio para buscar Search >> Haga click en el botón “search” >> Select the report >> Report configuration – details screen >> Haga click en el botón “display generated report”.</i> |
| Resultados esperados | El informe de extracto de cuenta se genera de acuerdo a las especificaciones definidas. |
| Referencias | <p>T2S-UHB 3.9.1.2, 2.4.1.4 and 6.3.3.17</p> <p>T2S-UDFS 1.3.3.1.2 and 1.6.4.2</p> |

Otros informes disponibles:

- Receive Current Settlement Day Cash Information Report
- Receive Following Settlement Day Cash Forecast Report
- Receive Statement of executed amendment instructions for Intra-Balance Movements
- Receive Statement of pending amendment instructions for Intra-Balance Movements
- Receive Statement of executed cancellation instructions for Intra-Balance Movements

- Receive Statement of pending cancellation instructions for Intra-Balance Movements
- Receive Statement of pending intra-balance movements
- Receive Statement of settled intra-balance movements
- Receive Statement of static data for party Report
- Receive Statement of static data for DCA Report

Consultas

| | |
|--------------------------------|--|
| Test ID | AUTH-T2S-QUERY-0010 |
| Función | Consulta de saldo de la DCA en modo U2A |
| Categoría | OBLIGATORIO |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día de negocio | Todas las fases, excepto, cuando la conexión U2A no es posible por ventana de mantenimiento T2S de 03:00 a 05:00, y (para consultas de saldo) durante el procesamiento de secuencias de los ciclos nocturnos |
| Pre-condiciones | Un usuario U2A que disponga del privilegio: <ul style="list-style-type: none">- T2S Dedicated Cash Account Balance Query (DDQ_T2SDedicatedCashACCBalanceQuery) |

Descripción El usuario comprueba el saldo de la DCA en T2S navegando en la pantalla de la GUI de T2S mediante alguna de las siguientes formas :

- *Cash >> Cash Account>> Cash Account Balances o,*
- *Monitoring >> Monitoring >> Cash Account Balances*

El usuario introduce para buscar los datos conocidos sobre saldos de las cuentas que desee consultar (también selecciona la opción “*Nil cash Balance*” cuando desee que se muestren las cuentas con saldo cero)

A continuación hace Clic en el botón “*Search*” y los resultados se muestran en la pantalla.

De manera adicional, para consultar el saldo de la DCA de manera detallada se puede navegar a través de las pantallas : de la GUI de T2S mediante alguna de las siguientes formas :

- *Cash >> Cash Account>> Cash Account Balances>>T2S DCA Balances – search/list screen >> presionar el botón “Search” >> (Si se devuelve más de un resultado, se genera una lista con los resultados en pantalla>>Seleccionamos una entrada de la lista>>Click en el botón “details”); o*

- *Monitoring >> Monitoring >> Cash Account Balances >>T2S DCA Balances – search/list screen >> presionar el botón “Search” >> (Si se devuelve más de un resultado, se genera una lista con los resultados en pantalla>>Seleccionamos una entrada de la lista>>Click en el botón “details”); o*

- *Cash >> Settlement>> Intra-Balance Movements>> Intra-Balance Movements – search/list screen >> introducir al menos uno de los campos obligatorios >> Click en el botón “Search” o “Details” >> pantalla *Intra-Balance movement* >> Click en el botón “Cash balance details”.*

Resultados esperados Los saldos de las cuentas dedicadas de efectivo de T2S se muestran en una lista en pantalla, la cual está ordenada por la columna “*T2S Dedicated Cash Account Number*” de manera ascendente (Orden por defecto)

Adicionalmente, en la pantalla *T2S DCA Balance – Details Screen* el usuario también puede ver los detalles de los saldos por tipo de restricción

Referencias T2S-UHB 2.3.1.10/2.3.1.11 (3.7.1.1/3.7.1.2)

| Test ID | AUTH-T2S-QUERY-0020 |
|-----------------------------|---|
| Función | Ejecutar una consulta del balance de una DCA (DCA Balance Query) en el modo A2A |
| Categoría | Condicionado a su uso |
| Aplicable a | Tenedores de DCA directamente conectados |
| Fase del día | Todas las fases, interrumpidas (las consultas A2A se quedan en cola) por la ventana de mantenimiento de T2S entre las 03:00 y las 05:00 y, para consultas de balances, durante las secuencias de procesamiento de los ciclos nocturnos. |
| Pre-condiciones | <ul style="list-style-type: none"> • Conexión A2A establecida • Un usuario válido para el modelo A2A debe poseer el privilegio T2S Dedicated Cash Account Balance Query (DDQ_T2SDedicatedCashAccBalanceQuery) |
| Descripción | <p>El tenedor de DCA o cualquier otro participante autorizado por ella envía a T2S un mensaje GetAccountV05 (camt.003.001.05, Query Type: T2S Dedicated Cash Account Balance Query), con el campo RequestType rellenado con el código "CASB" para recibir información en los saldos de la(s) DCA(s) vinculadas a su cuenta RTGS.</p> <p>Los siguientes atributos pueden utilizarse para restringir la consulta (si un campo no es especificado por el usuario, la consulta devuelve toda la información consistente con los derechos de acceso): T2S Dedicated Cash Account Number, T2S Settlement Currency, BIC of the party, Parent (CB) BIC.</p> |
| Resultados esperados | <p>T2S envía un mensaje ReturnAccountV05 (camt.004.001.05, message usage : T2S Dedicated Cash Account Balance Query Response) como respuesta <input type="checkbox"/></p> <p>Este mensaje informa al que lo envía del estado actual de una o más T2S DCA. La respuesta se envía en tiempo real (excepto las fases del día de negocio anteriormente mencioandas), basado en el último saldo disponible en las cuentas.</p> <p>Comentarios :</p> |
| Referencias | T2S-UDFS 3.3.3.1/ 3.3.3.2 |

Otras consultas disponibles en U2A:

- Ejecutar DCA Posting Query in U2A mode
- Ejecutar Immediate Liquidity Transfer Order List Query in U2A mode
- Ejecutar Immediate Liquidity Transfer Order Detail Query in U2A mode
- Ejecutar Outstanding Auto-Collateralisation Credit Query in U2A mode
- Ejecutar T2S Overall Liquidity Query in U2A mode
- Ejecutar Cash Forecast Query in U2A mode
- Ejecutar Limit Query in U2A mode
- Ejecutar Limit Utilisation Query in U2A mode
- Ejecutar Limit Utilisation Journal Query in U2A mode
- Ejecutar Total Collateral Value per DCA Query in U2A mode
- Ejecutar Collateral Value per DCA Query in U2A mode
- Ejecutar Collateral Value of a Security Query in U2A mode
- Ejecutar DCA Posting Query in A2A mode
- Ejecutar Immediate Liquidity Transfer Order List Query in A2A mode
- Ejecutar Immediate Liquidity Transfer Order Detail Query in A2A mode
- Ejecutar Outstanding Auto-Collateralisation Credit Query in A2A mode
- Ejecutar T2S Overall Liquidity Query in A2A mode
- Ejecutar Cash Forecast Query in A2A mode
- Ejecutar Limit Query in A2A mode
- Ejecutar Limit Utilisation Query in A2A mode
- Ejecutar Limit Utilisation Journal Query in A2A mode
- Ejecutar Total collateral value per DCA Query in A2A mode
- Ejecutar Collateral Value per DCA Query in A2A mode
- Ejecutar Collateral Value of a Security Query in A2A mode