

ESTADO DE LAS ADAPTACIONES DEL BANCO DE ESPAÑA A T2S

T2S Grupo Nacional de Usuarios

Madrid

13 de junio de 2013

SISTEMAS DE PAGO

ADAPTACIÓN DEL BDE A T2S



Punto de sincronización 3. “T2S Programme Plan Comprehensiveness”.

Confirmar que el “T2S Programme Plan” es comprensible y refleja todas las actualizaciones de las especificaciones y documentación desde el PS2.

El Banco de España aportó una actualización del análisis de viabilidad de la adaptación a T2S, valorando la nueva información; ventanas de migración, conclusiones de los diversos grupos (armonización, etc) y actualización de la documentación (términos de referencia de las pruebas de usuario, UDFS V1.2.1, T2S programme plan)

Los BCs presentamos el análisis de viabilidad V2.0 el 16/04/2013.

En el PS10.4 “Start Community Testing (Wave 4)” los BCs han de confirmar que han preparado a su comunidad y tienen establecido el proceso de certificación.

MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Modos de conexión

1. Proveedor de servicios de red de valor añadido (VAN NSP):

1. SWIFT
2. SIA-COLT

Permite conexión directa con T2S en modos, U2A y A2A.

2. Conexión a través de internet.

Permite acceso U2A con funcionalidades restringidas.

Únicamente disponible para 100 usuarios.

3. Línea dedicada.

Desarrollo interno, está pensado para las CSDs.

4. Acceso a través de la interfaz de T2.

1. *Core: transferencias liquidez: T2-> T2S*
2. *Servicios de valor añadido: transferencias liquidez T2S-> T2*

saldo intradía de las DCAs en el ICM

MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Funcionalidades

	Tareas	Detalles	Modos de acceso		
			A2A	U2A	T2
1	Static Data	Access rights/Privileges	N	S	N
		User set-up	N	S	N
		Grant Roles	N	S	N
		Report Configuration	N	S	N
2	Settlement Restrictions	Intra-Balance Movements	S	S	N
3	Set-up Client Auto-collateralisation	Secondary CMB set-up	N	S	N
4	Static data for Client Auto-collateralisation	Eligible securities	S	S	N
		Securities Valuation	S	S	N
5	Client Auto-collateralisation Limit Management	External Guarantee Limit	N	S	N
		Client Collateralisation Limit	N	S	N
		Unsecured Limit	N	S	N

MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Funcionalidades

	Tareas	Detalles	Modos de acceso		
			A2A	U2A	T2
7	Limit Monitoring (Queries)	Limit Query	S	S	N
		Limit Utilisation Query	S	S	N
		Limit Utilisation Journal Query	S	S	N
8	Liquidity Management	Internal LTO	S	S	N
		Inbound LTO	N	N	S
		Outbound LTO	S	S	S
		Multiple Liquidity Provider set-up	N	S	N
9	Liquidity Monitoring (Queries & Reports)	Cash Forecast Reports/Query	S	S	N
		T2S DCA Balance/Posting Query	S	S	S
		LTO List/Detail Query	S	S	S
		T2S Overall Liquidity Query	S	S	N
10	Liquidity Monitoring (notifications)	BankToCustomerDebitCreditNotification	S	S	N

MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Funcionalidades

Servicios A2A que no ofrece T2.

Tareas	Detalles
Liquidity Monitoring (notifications)	Notificaciones de adeudos/abonos
<u>Static data for Client Auto-collateralisation</u>	Activos elegibles
	Valoración de los activos
Limit Monitoring (Queries)	Consulta de límites
Liquidity Management	Transferencias de liquidez entre DCAs
Liquidity Monitoring (Queries & Reports)	Consulta/informe proyección de la liquidez
	Consulta/informe de la liquidez total en T2S
Settlement Restrictions	Bloqueos y reservas en las cuentas DCA

MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Opciones

Opciones:

Perfil de conexión en A2A (VAN SWIFT , SIA-Colt o DL) + U2A:

- a. Las que reciben **notificaciones** de los movimientos de la DCA
- b. Las que **ofrecen crédito intradía** a sus clientes, **con colateralización**

Perfil de conexión sólo en U2A (VAN SWIFT o SIA-Colt):

- a. Las que **ofrecen crédito intradía** a sus clientes, **sin colateralización**
- b. Las que solicitan **informes**.

Perfil de conexión a través de los servicios de T2:

- a. Las que no reciben notificaciones de las DCAs, ni ofrecen crédito intradía, ni solicitan informes.
- b. Sus necesidades se limitan a:
 - ii. transferencias liquidez: T2 <-> T2S
 - iii. saldo intradía de las DCAs en el ICM



Implicaciones de conexión A2A a T2S:

- Notificar la intención de acceso directo (tanto A2A como U2A) antes del 31/10/2013.
- Adaptar su interfaz de comunicación para interactuar con T2S.
- Pruebas de certificación frente al Eurosistema más extensas y tempranas (al inicio de las pruebas de comunidad). SP10.4: 13/09/2016.
- Pruebas adicionales establecidas por el Banco Central.
- Gestión de autorizaciones (roles y privilegios).