

XI REUNIÓN DEL GNU de T2S

Documentación funcional - UDFS

Madrid, 5 de marzo de 2010

UDFS: “User Detailed Functional Specifications”

- ⌚ Aporta la información necesaria para que aquellos usuarios que se vayan a conectar directamente a T2S (DCVs o Participantes Directos) puedan diseñar y construir sus interfaces con T2S
 - Analistas Funcionales
 - Equipos de Desarrollo
- ⌚ Describe las interacciones con T2S desde la perspectiva del usuario;
- ⌚ Detalla la forma en la que los Requerimientos de Usuario (URD) se van a implementar en T2S, siempre desde el punto de vista del usuario;
- ⌚ Se centra en procesos A2A (“Application-to-Application”);
- ⌚ Documento independiente y completo, compuesto por tres Capítulos.

Capítulo 1

- ⌚ Descripción funcional (“User oriented”) de los procesos que tienen lugar en T2S, siempre desde el punto de vista del usuario;
- ⌚ Información concisa y pedagógica
- ⌚ No describe procesos internos de T2S ni comportamientos internos de los usuarios.
- ⌚ Incluye información necesaria para comprender los Capítulos 2 y 3
- ⌚ Contiene enlaces con el Capítulo 2, para facilitar la lectura del documento

Capítulo 1

READER'S GUIDE

UDFS Structure

1 GENERAL FEATURES OF T2S

1.1 T2S FEATURES OVERVIEW

1.2 CONFIGURATION OF PARTIES, SECURITIES AND ACCOUNTS

1.3 ACCESS TO T2S

1.4 SETTLEMENT DAY

1.5 POSSIBLE ACTIONS FROM T2S OPERATOR

1.6 APPLICATION PROCESSES DESCRIPTION

1.7 LIMITATIONS OF THE SYSTEM

Capítulo 2

- ⌚ Describe los diálogos A2A (Application-to-Application) entre los usuarios y T2S
- ⌚ Describe el comportamiento de T2S, no el comportamiento de los sistemas de los usuarios
- ⌚ Por cada mensaje de entrada, detalla la información que T2S envía al usuario
- ⌚ Diálogo entre los usuarios y T2S descritos a través de "Use Cases"
- ⌚ Contiene enlaces con el Capítulo 3, para facilitar la lectura del documento

Capítulo 2

2 DIALOGUE BETWEEN T2S AND T2S ACTORS

- 2.1 INTRODUCTION
- 2.2 Communication processing
- 2.3 Send Settlement Restriction on Securities Position
- 2.4 Send Settlement Restriction on Cash Balance
- 2.5 Send Release Instruction for CoSD by Administering Party
- 2.6 Send Cancellation Instruction for CoSD by Administering Party
- 2.7 Send Amendment Instruction of a Settlement Instruction or of a Settlement Restriction on Securities Position
- 2.8 Send Amendment Instruction of a Settlement Restriction on Cash Balance
- 2.9 Send Hold/Release Instruction

Capítulo 2

- 2.10 Send Cancellation Instruction of a Settlement Instruction or a Settlement Restriction on Securities Position
- 2.11 Send Cancellation Instruction of a Settlement Restriction on Cash Balance
- 2.12 Send Immediate Liquidity Transfer
- 2.13 Send RTGS answer
- 2.14 Execution of Liquidity Transfer from RTGS to T2S
- 2.15 Execution of Standing and Predefined Liquidity Transfer Orders from T2S to RTGS
- 2.16 End-of-Day Liquidity Transfer
- 2.17 Send Query
- 2.18 Maintain SD
- 2.19 Restrict SD
- 2.20 Start of Day processing
- 2.21 Resend Message

Capítulo 3

- ⌚ Detalla los mensajes en modo A2A;
- ⌚ Estructura XML detallando, tanto para mensajes de entrada como de salida:
 - campos obligatorios/opcionales
 - reglas de validación
 - uso de cada campo en el contexto de T2S
- ⌚ Usos del mensaje en el contexto de T2S (Ej. Status Advice “Accepted”)
- ⌚ Enlaces con diversos ficheros a través de la página web del Eurosistema:
 - “Schema files” enriquecidos para T2S en formatos xsd, html y xls
 - Ejemplos en formato xml
- ⌚ Incluye reglas para el periodo de coexistencia
- ⌚ Apéndices

Capítulo 3 y Apéndices

3 CATALOGUE OF MESSAGES

3.1 INTRODUCTION

3.1.1 Purpose and scope of the Catalogue of Messages

3.1.2 Structure of the Catalogue of Messages

3.2 GENERAL INFORMATION

3.2.1 Message validation

3.2.2 Communication infrastructure

3.3 LIST OF MESSAGES

3.3.1 Securities Management (semt)

4 APPENDICES

4.1 INDEX OF BUSINESS RULES AND ERROR CODES

4.2 INDEX OF STATUS VALUES AND CODES

4.3 INDEX OF MESSAGE REFERENCES

4.4 INDEX OF EXAMPLES

4.5 INDEX OF DIAGRAMS

Calendario

Elaboración de 3 versiones intermedias de carácter incremental:

- V0.20
- V0.25
- V0.30

Y una versión final

 UDFS v1.0

25 de marzo 2011

Consulta al mercado : hasta 27 de mayo 2011

Implicación del Mercado en las UDFS

Objetivo: Involucrar a los usuarios desde las primera etapas para comprobar:

- ⌚ Que la información incluida en las UDFS es suficiente para que los usuarios adapten sus sistemas
- ⌚ Que la información está adecuadamente estructurada y es clara
- ⌚ La idoneidad de las UDFS, antes de la consulta pública en marzo 2011

Calendario de reuniones y revisiones antes de la UDFS v1.0 (marzo 2011):

Primera reunión con el Mercado: 16 de junio de 2010

Versiones	Reuniones	Comentarios
UDFS v 0.2	5 Oct 2010	15 Oct 2010
UDFS v 0.25	22 Nov 2010	30 Nov 2010
UDFS v 0.3	13 Ene 2011	21 Ene 2011