

COLLAUDI DELLE PROCEDURE PER LE OPERAZIONI DI MERCATO
APERTO - NOTA TECNICA

Obiettivi dei collaudi

- L'attività di collaudo rappresenta un requisito obbligatorio per ottenere l'abilitazione alle operazioni di mercato aperto standard e di fine-tuning. Essa risulta altresì rilevante per quegli operatori, già abilitati, che hanno la necessità di testare le proprie procedure.

Calendario dei collaudi

- A tutti i nuovi operatori - in regola con gli adempimenti amministrativi - di cui al par. II.5.1 e II.5.2 della *Guida per gli operatori* - e a quelli già abilitati, la Banca d'Italia fornisce un calendario indicativo di sessioni di test - consultabile sul sito web dell'Istituto, sulla pagina Reuters BITI e sulla pagina Bloomberg BKIT5 - attraverso il quale ognuno di essi ha la possibilità di pianificare i propri collaudi.
- La Banca d'Italia si riserva la facoltà di modificare il calendario dei test e di prevedere, in caso di elevato numero di partecipanti, eventuali sessioni aggiuntive.

Caratteristiche tecniche delle sessioni di collaudo e adempimenti degli operatori partecipanti

- Ciascuna sessione, che si sviluppa su tre giornate lavorative, contempla la partecipazione, l'aggiudicazione e il regolamento di due o più operazioni (due MRO per la richiesta di partecipazione alle aste *standard* ed eventualmente

una di deposito a tempo determinato). L'iter prevede l'annuncio e lo svolgimento durante il primo giorno, la fase di spunta e il regolamento dei pronti nella mattina del secondo giorno e la cosiddetta fase di rientro durante il terzo e ultimo giorno - rimborso del capitale con gli interessi e contestuale svincolo delle garanzie nel conto pool.

- Gli operatori interessati devono comunicare la partecipazione inviando un'e-mail all'indirizzo bi.front_office@bancaditalia.it, entro una settimana prima della data d'inizio della sessione alla quale intendono partecipare, specificandone il motivo (es. prima abilitazione, modifiche architetture hardware, test di non regressione per implementazioni software etc).
- L'applicazione bancaria per lo scambio dei messaggi in ambiente di collaudo sulla RNI è la seguente:
01000 BI006 PI;
- Il conto pool dovrà essere alimentato con le seguenti garanzie:
 - **IT0000366655** - BTP 9,00% 1.11.1993/2023
 - **IT0001086567** - BTP 7,25% 1.11.1996/2026
 - **IT0001174611** - BTP 6,50% 1.11.1997/2027,ciascuna per un importo pari a **10 milioni** di euro.
- Il pool di test deve essere alimentato, dalla controparte o dalla banca custode, entro le ore 15:00 del giorno che precede l'avvio dei test.
- Nei 3 giorni che precedono l'avvio dei collaudi l'eventuale banca custode dovrà comunicare all'indirizzo IT.SECURITIES@bancaditalia.it il codice conto in Monte Titoli (conto terzi o specifico conto liquidatore) utilizzato per le movimentazioni.
- L'operatore dovrà inviare, nelle giornate precedenti alla sessione, un messaggio 6E1 di prova (cfr. Guida per gli operatori) in ambiente di collaudo e di comunicare ciò al front_office per verificarne l'esito.

- Durante lo svolgimento dei test saranno prodotti messaggi di notifica CAT di esito positivo (RNI 6AB) e negativo (RNI 6AC), i messaggi di chiusura della giornata contabile (RNI 6A1) e di estratto conto giornaliero (RNI 6A6).
- Per i dettagli sulla procedura telematica di gestione delle aste, si rinvia al documento "Strumenti di politica monetaria dell'Eurosistema - Guida per gli operatori" (di seguito "Guida per gli operatori") consultabile sul sito web della Banca d'Italia all'indirizzo:
http://www.bancaditalia.it/banca_centrale/polmon/strumenti (All. 3 - Operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema - Specifiche per gli operatori).

Contatti in Banca d'Italia

- Per le chiavi di crittografia/autenticazione:
SERVIZIO ELABORAZIONI E INFRASTRUTTURE
AREA GESTIONE TECNICA DELLA SICUREZZA
Indirizzo e-mail: SELI_AMMSICUREZZA@bancaditalia.it
tel. 06 4792 6392-7519-6402
- Per lo svolgimento del collaudo:
SERVIZIO OPERAZIONI DI BANCA CENTRALE
FRONT OFFICE (Divisione Operazioni di Politica Monetaria e in Cambi)
Indirizzo e-mail: BI.FRONT_OFFICE@bancaditalia.it;
tel. circolare: 06 4792 2525 / fax: 2086
- Per questioni legate al collateral:
SERVIZIO OPERAZIONI DI BANCA CENTRALE
DIVISIONE GESTIONE DELLE GARANZIE
Indirizzo e-mail: BI.COLLATERAL@bancaditalia.it;
tel. circolare: 4098 / fax 4962
- Per questioni di back-office:
SERVIZIO OPERAZIONI DI BANCA CENTRALE
BACK OFFICE (Ufficio Contabilità e Controllo)

Indirizzo e-mail: Obc_contabilita@bancaditalia.it;

tel. circolare: 2013 / fax: 3056

- Per le anagrafiche in Target2 e la gestione del pool:

SERVIZIO SISTEMA DEI PAGAMENTI

DIVISIONE SISTEMI DI PAGAMENTO ALL'INGROSSO

Indirizzo e-mail: TEST-TARGET2@bancaditalia.it;

tel. circolare: 5700 / fax: 3757

DIVISIONE SERVIZI DI PAGAMENTO E DI CORRISPONDENZA

Indirizzo e-mail: IT.SECURITIES@bancaditalia.it;

tel. circolare: 3868 / fax: 3853

Altri contatti esterni alla Banca D'italia

- per la verifica del censimento su RNI:
contattare unicamente, tramite Centro Applicativo prescelto dalla banca, Ufficio Confeas-società SIA:
confeas@siassb.eu

Riepilogo delle attività propedeutiche all'avvio del test

Tipologia attività	Descrizione/Modalità	Periodo di intervento
Richiesta partecipazione	attraverso e-mail dell'operatore	almeno sette giorni prima dell'avvio del test
Comunicazione c/liquidatore	attraverso e-mail a it.securities dall'eventuale banca custode	nei tre giorni precedenti il test
Alimentazione c/pool	Movimentazione diretta o attraverso banca custode delle garanzie sul c/pool della banca partecipante	entro le ore 15 del giorno precedente il test
Trasmissione del 6E1 di test	trasmissione del messaggio di 6E1 di test in ambiente di collaudo (cfr. <i>guida per gli operatori</i>)	nei giorni precedenti il test