

ECMS – Guida per l’inserimento del *credit freezing* in modalità U2A

Sommario

Sommario	1
1. Dati e controlli	2
2. Inserimento del Credit Freezing	4
3. Verifica dell’inserimento dell’istruzione.....	6

1. Dati e controlli

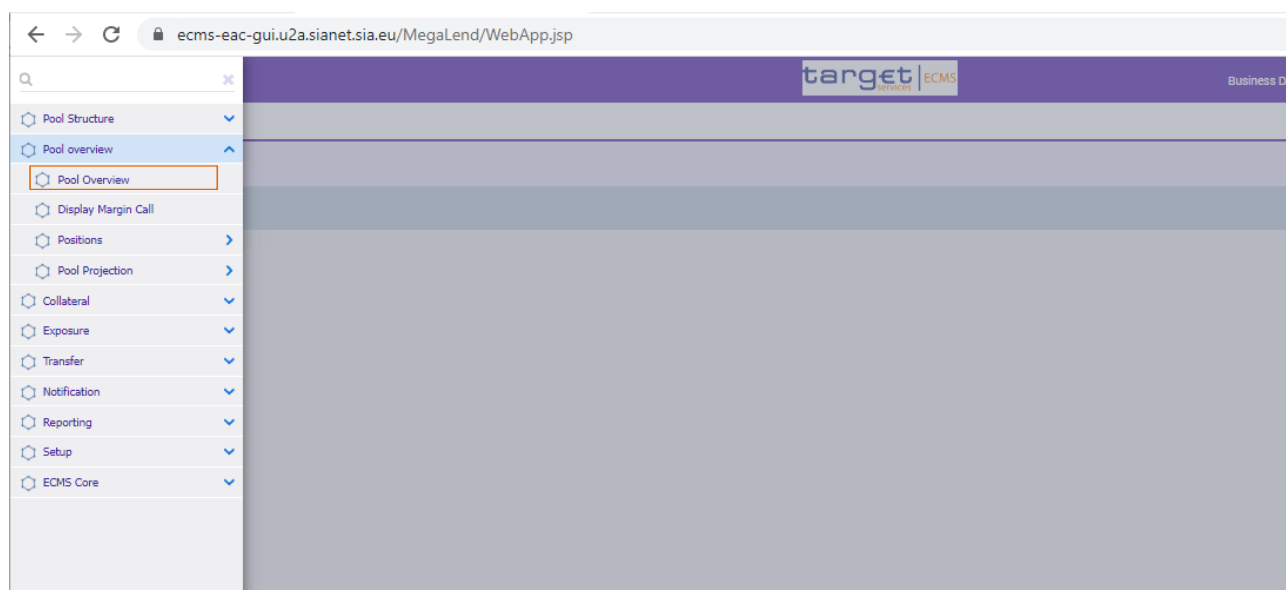
La funzionalità del *credit freezing* è descritta nel cap. 5.4 della Guida ECMS.


Si illustrano di seguito le maschere della GUI utilizzabili per l'inserimento e il monitoraggio delle operazioni di *credit freezing* per ECONS II.

Per l'inserimento dell'istruzione di *credit freezing* è necessario disporre dell'identificativo del pool (*Pool Identifier – pool id*)


Per identificare il *pool id* di politica monetaria eseguire i seguenti passi:

- Selezionare la voce di menu “*Pool Overview*” da **MegaLend**:





- Filtrare, ad esempio, per Counterparty (selezionare in precedenza l'icona ricerca , identificare la banca e selezionarla):

Display : Counterparty Pool

Pool Identifier ** Pool Reference ** Counterparty ** 

Pool Type ** Insufficient Collateral ** Is Active **


Validity Start Date ** Validity End Date **

- Se la controparte ha più conti, per ogni singola riga selezionare “View” e identificare il pool per la politica monetaria (il cui *pool reference* inizia per EUCO):

List Pools Overview

Pool Identifier	Pool Type	Counterparty	Total Collat.	Total Credit	SCL	ECL	RCL	Collateral E.	Insufficient	Is Valuated	ELA Collate.	Total ELA C.	Is Active	Update Da	Updater US
ITPOOL000000	SCP		10,383,367...	0	10,383,367...	0	0	10,383,367...	No	Yes	0	0	Yes	28/08/2023	ECMSOpera...
ITPOOL00000000	SCP		452,414,695...	0	452,414,695...	452,414,695...	452,414,695...	0	No	Yes	0	0	Yes	28/08/2023	ECMSOpera...

I dati del pool saranno visualizzati:

Edit: Pool General Reference Data

Pool Type SCP	Pool Identifier ITPOOL0000000	Pool Reference EUCO
CLM MCA [REDACTED]	CLM CB Account BITAITRRXXX	Contingency Cash Account [REDACTED]
CB Contingency Cash Account [REDACTED]	Counterparty [REDACTED]	Absolute Credit Limit [REDACTED]
Relative Credit Limit [REDACTED]	Validity Start Date 03/07/2023	Validity End Date 31/12/9999
Address Address [0]		

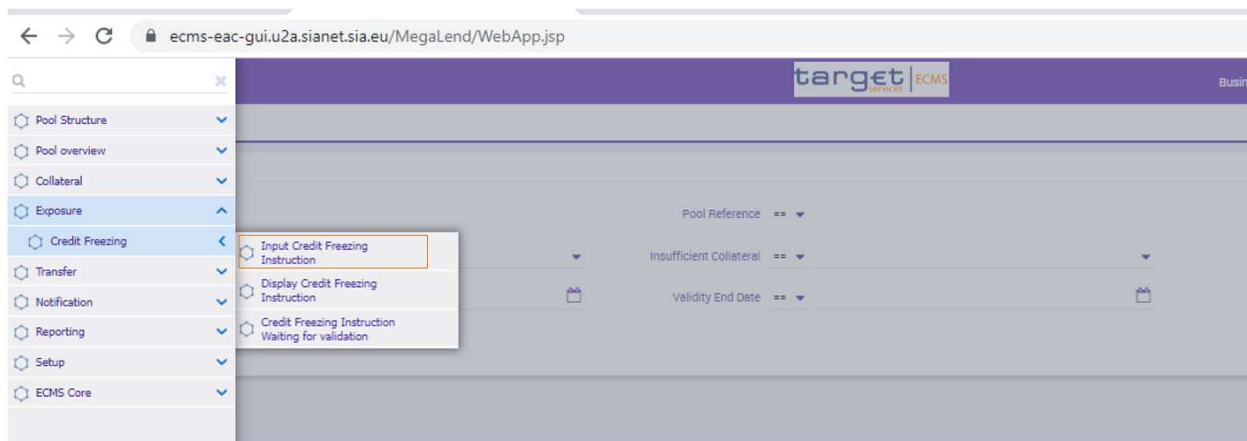
- Copiare il valore del *Pool Identifier* che servirà nella maschera di attivazione del credit freezing:

Pool Identifier
ITPOOL0000000

2. Inserimento del Credit Freezing

Per inserire il *credit freezing* seguire le seguenti indicazioni:

- Accedere alla voce di menù “*Input Credit Freezing instructions*” del modulo **MegaLend** (*Exposure/Credit Freezing/Input Credit Instruction*):



- Popolare i campi nel seguente modo:

- **Party's Instruction Reference:** identificativo univoco definito dalla controparte
- **Pool Identifier:** il *pool id* recuperato nella fase precedente
- **Credit Freezing Type:** nel menù a tendina il sistema propone più opzioni (definite da altre banche centrali per finalità specifiche), ma l'unica tipologia autorizzata dalla Banca d'Italia è quella relativa a ECONS II che in UTEST è individuata dalla *codeword* **PT_CF_ECONS** (in produzione sarà ECON)
- **Amount:** il valore di *credit freezing* che si vuole impostare deve essere sempre inferiore al valore della SCL (*suggested credit line*) (usare solo il “.” come separatore dei decimali: nell'esempio 100000.00)
- **Update mode:** il sistema propone due opzioni:
 - **CANCEL AND REPLACE:** permette di inserire il nuovo *credit freezing* sovrascrivendo quello già esistente (che comprende anche il valore 0.00)
 - **DELTA:** permette di aggiornare il valore del *credit freezing* esistente

Input Credit Freezing instruction

Transaction Details		
Transaction Reference Number ITCF230829000230003	Party's Instruction Reference 20231108IT0001	Pool Identifier ITPOOL000000 [REDACTED]
Counterparty [REDACTED]	Credit Freezing Type PT_CF_ECONS	Amount 100,000
Currency EUR	Intended Settlement Date 08/11/2023	Update mode CANCEL AND REPLACE
Compulsory Event No	Last Update Reason	

Reset Save

- Premere il pulsante “Save” per salvare e “YES” sulla successiva *pop-up*:

Confirm

Are you sure to save this data?

Yes No

- Alla ricezione del messaggio “Success” premere OK:

Success

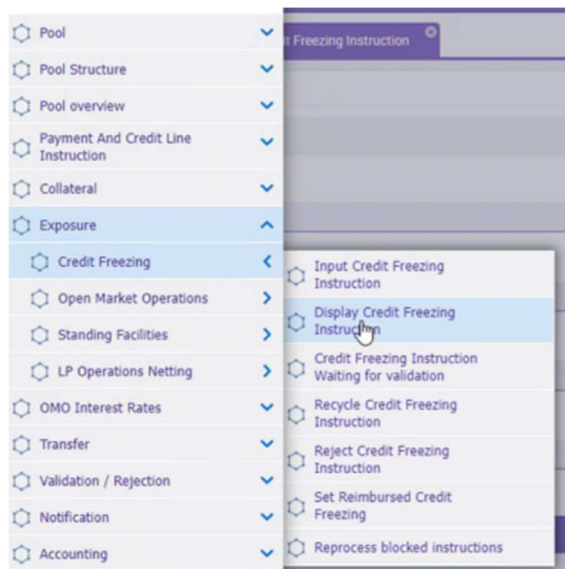
Credit Freezing Instruction with Transaction Reference Number ITCF230829000230003 and Counterparty IT0000 [REDACTED] is saved successfully under Status WaitingSettlement

OK

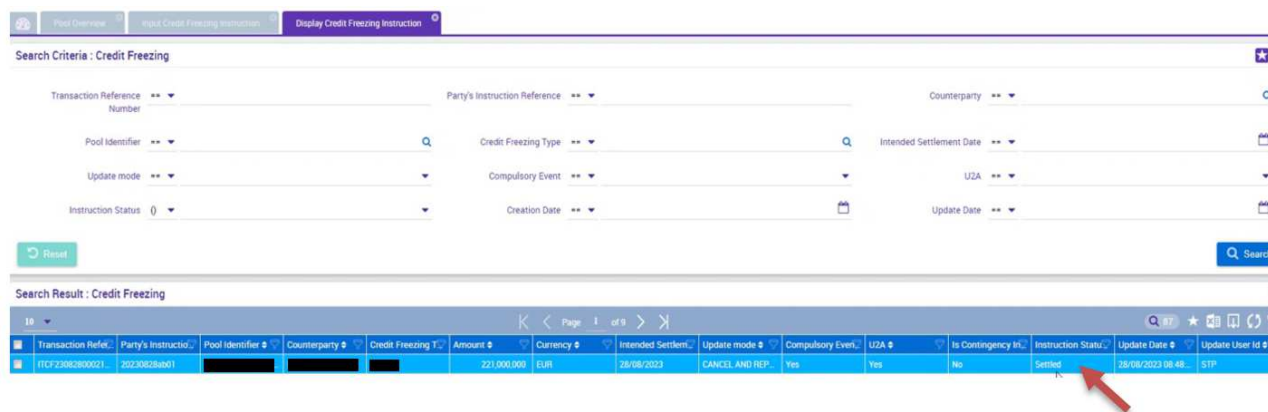
3. Verifica dell'inserimento dell'istruzione

Per verificare se l'inserimento è andato a buon fine:

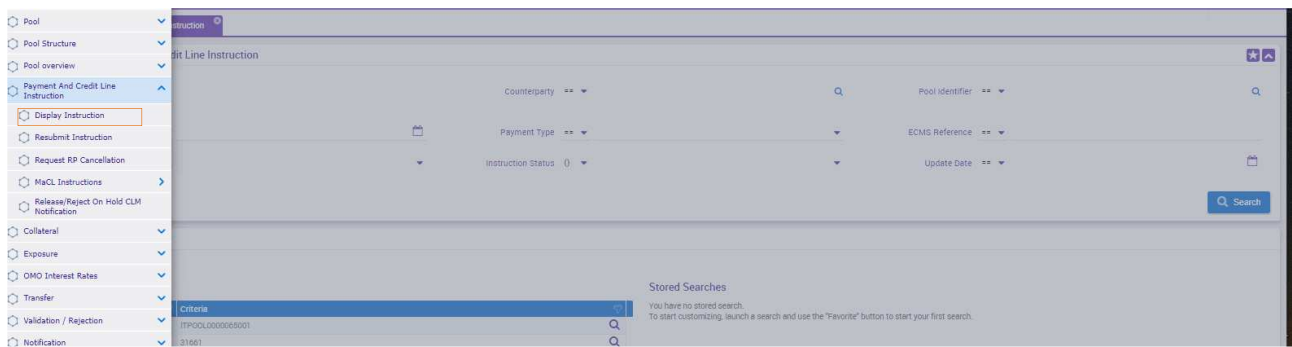
- Accedere alla voce di menù *"Display Credit Freezing Instruction"* del modulo **MegaLend** (*Exposure/Credit Freezing/Display Credit Freezing Instruction*):



- Eseguire la ricerca e verificare che *"Instruction Status"* sia Settled:



L'istruzione di *credit freezing* determina la riduzione della *credit line* (che si può monitorare accedendo al menù *"Payment And Credit Line Instruction"* del modulo Megalend e selezionando la voce *"Display Instruction"*)



Un esempio di risultato della ricerca è il seguente:

Search Criteria : Payment and Credit Line Instruction

Transaction Reference Number: [blank], Counterparty: [blank], Pool Identifier: [blank], Value Date: [blank], Payment Type: [blank], ECMS Reference: [blank], Variation Sign: [blank], Instruction Status: [blank], Update Date: [blank]

Reset Search

Search Result : Payment and Credit Line Instruction

Transaction Ref.	Counterparty	Pool Identifier	Payment Type	New Credit Line Amount	Credit Line Avail.	Payment Amount	Currency	Value Date	ECMS Reference	Event Description	Instruction Status	Status	Update Date	Creation Date
CLIT02701423001	IT0000400	ITPOOL0000000001		0	13.984177.28		EUR	10/01/2024	ITCP24011000100...	Credit Freezing Position incre...	Settled	Settled	10/01/2024 09:41...	10/01/2024 09:41...

Inoltre l'importo del *credit freezing* potrà essere visualizzato tra le *credit position* nell'inquiry sul *Pool overview* (vista sopra) nella sezione *Exposure*:

EXPOSURE

Credit Freezing

Total Credit Freezing

100,000

Credit Freezing Position

Euro LPO

Total Euro LPO

0

Total Euro LPO Margin

0

Total Euro LPO Interest

0

Non-Euro LPO

Total Non-Euro LPO

0

Total Non-Euro LPO Margin

0

Total Non-Euro LPO Interest

0