



ECMS: informativa e reportistica

Seminario banche
22 giugno 2021

Roberta Pullano

Banca d'Italia

Servizio Sistema dei Pagamenti

Antonio Attilio Toma

Banca d'Italia

Servizio Operazioni sui Mercati



Introduzione: overview del «pool»

L'ECMS fornisce alle controparti, tramite la modalità A2A e U2A, informazioni sulle posizioni aggregate di collateral e credit di uno **specifico conto pool**.

Counterparty details (code and name)

Pool details

Aggregated collateral position = \sum collateral positions linked to that pool

Aggregated credit position = \sum credit positions incl. accrued interest

In U2A mode, users can drill down to the smallest level of detail.

Aggregation of different pools is not possible.

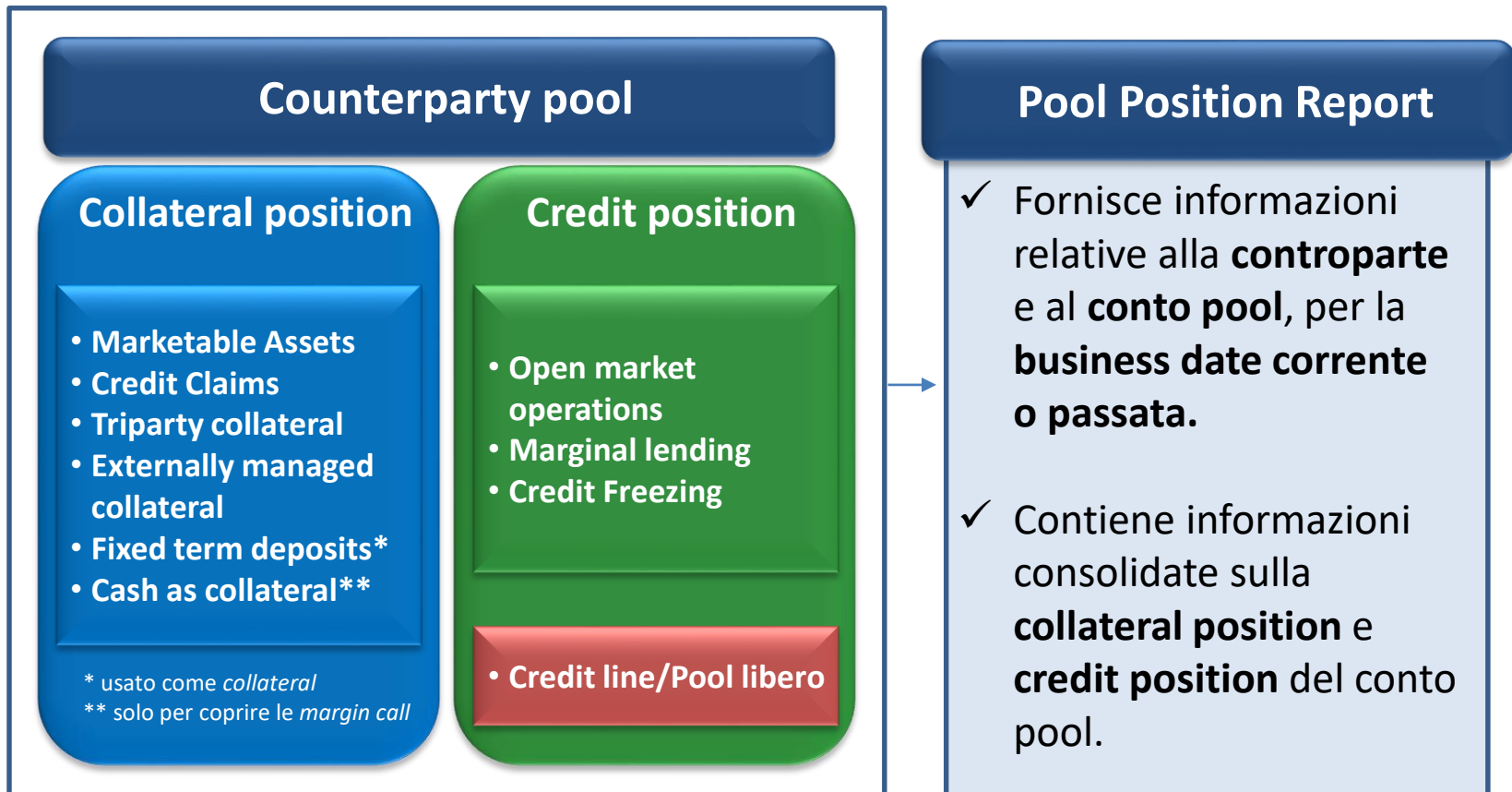
Credit line (maximum, suggested, expected and real)

Margin calls (if any)

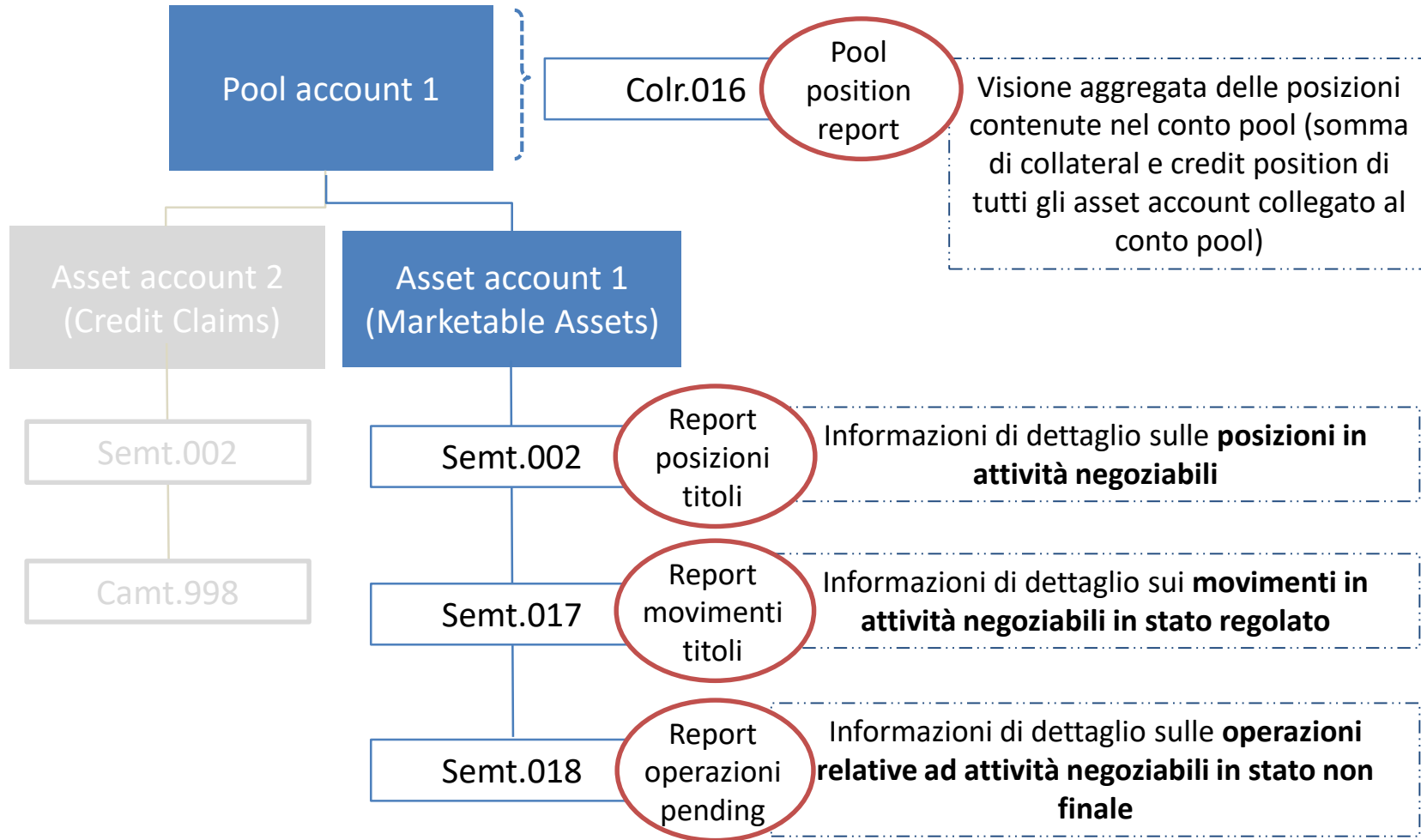


Pool position report (colr.016)

Tali informazioni sono contenute, a livello di pool, nel **pool position report**:

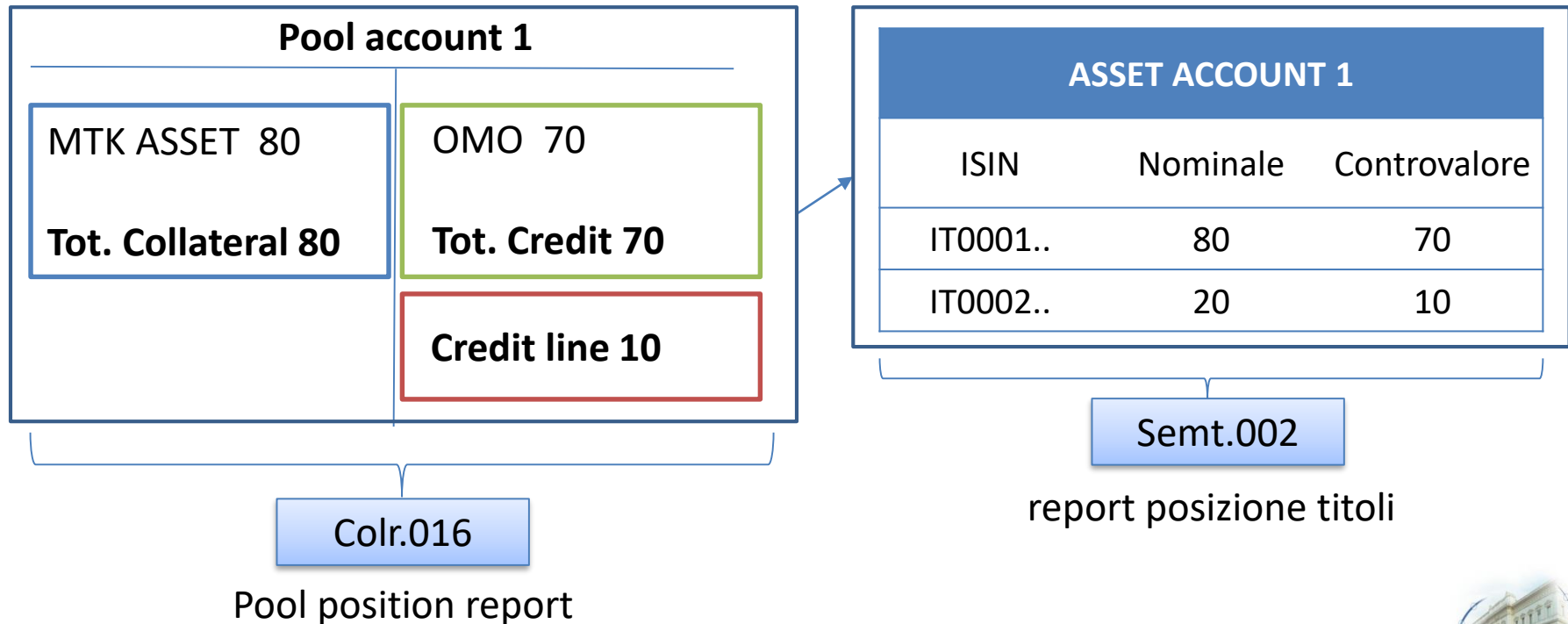


Configurazione reports per «pool account» - marketable assets



Configurazione reports per «pool account»: un esempio – marketable assets

- Nell'**Asset Account 1** del **Pool account 1** sono presenti attività negoziabili per un controvalore di 80.
- La controparte ha in essere operazioni di politica monetaria per un controvalore di 70.
- Nel suo **Pool account 1**, oltre ad avere titoli per un controvalore di 80 e una credit position di 70, la controparte ha una linea di credito di 10.



Modalità di ricezione della reportistica in formato ISO20022

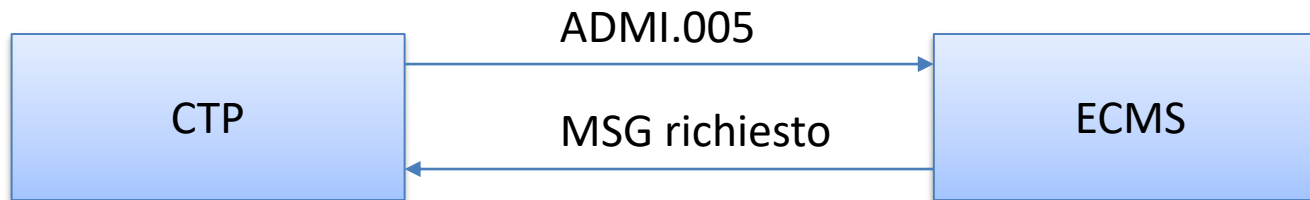
	Sottoscrizione report («push mode») dati di fine giornata	A richiesta («pull mode»)
Pool position report (Colr.016)		X
Report posizioni titoli (Semt.002)	X	X
Report movimenti titoli (Semt.017)	X	X
Report operazioni pending (Semt.018)	X	X

- ❖ **«push mode»** -
Sottoscrizione reportistica secondo la periodicità desiderata tra quelle disponibili (es. giornaliera) eccetto per colr.016
- ❖ **«pull mode»** -
Le controparti possono inviare ad ECMS la richiesta di generazione ad-hoc dei reports mediante l'invio del messaggio admi.005.



Reports a richiesta («pull mode») mediante l'invio del messaggio ADMI.005

Per richiedere un determinato report, la controparte deve inviare ad ECMS il messaggio admi.005 (in formato XML):



ADMI.005 informazioni da specificare:
<input type="checkbox"/> Tipo di report (colr.016,semt.002/017/018)
<input type="checkbox"/> Identificativo (pool o asset account)
<input type="checkbox"/> Business date (corrente* o passata**)

*informazioni riferite ai dati in tempo reale

** informazioni riferite ai dati di fine giornata della business date di riferimento



Altre funzionalità puramente informative

Pool Projection

- ✓ Proiezione del pool in **data futura**
- ✓ Disponibile **solo in U2A via GUI**
- ✓ Elaborato sulla base delle **informazioni conosciute dal sistema alla data della richiesta** (valore titoli, scadenza titoli e operazioni di politica monetaria)

Consolidated Pool Position on Banking Group level

- ✓ Visione aggregata dei pool del gruppo bancario (**business date corrente o passata**)
- ✓ Disponibile **solo in U2A via GUI**
- ✓ Elaborato sulla base del «**gruppo bancario**» configurato in ECMS



Dettaglio Report posizioni e movimenti (semt.002/017)

Informazioni report posizioni (marketable assets)

Internal asset account ID	Identifier of the internal asset account
Account owner ID and name	Identifier and name of the internal asset account owner
ISIN code	Identifier of the asset
Quantity	Quantity of the asset
Collateral value	Collateral value after haircut of the asset
Statement value date	Value date of the statement
Creation date and time	Date and time when the statement is created

Informazioni report movimenti (marketable assets)

Internal asset account ID	Identifier of the internal asset account
Account owner ID and name	Identifier and name of the internal asset account owner
Instruction reference	Reference of the instruction which triggered the asset movement
ISIN code and quantity	Identifier and quantity of the asset
Statement value date	Value date of the statement
ECMS settlement instruction ID	Settlement identifier from the ECMS database
Settlement type	Instruction type: DELI or RECE



Dettaglio Report operazioni pending (semt.018)

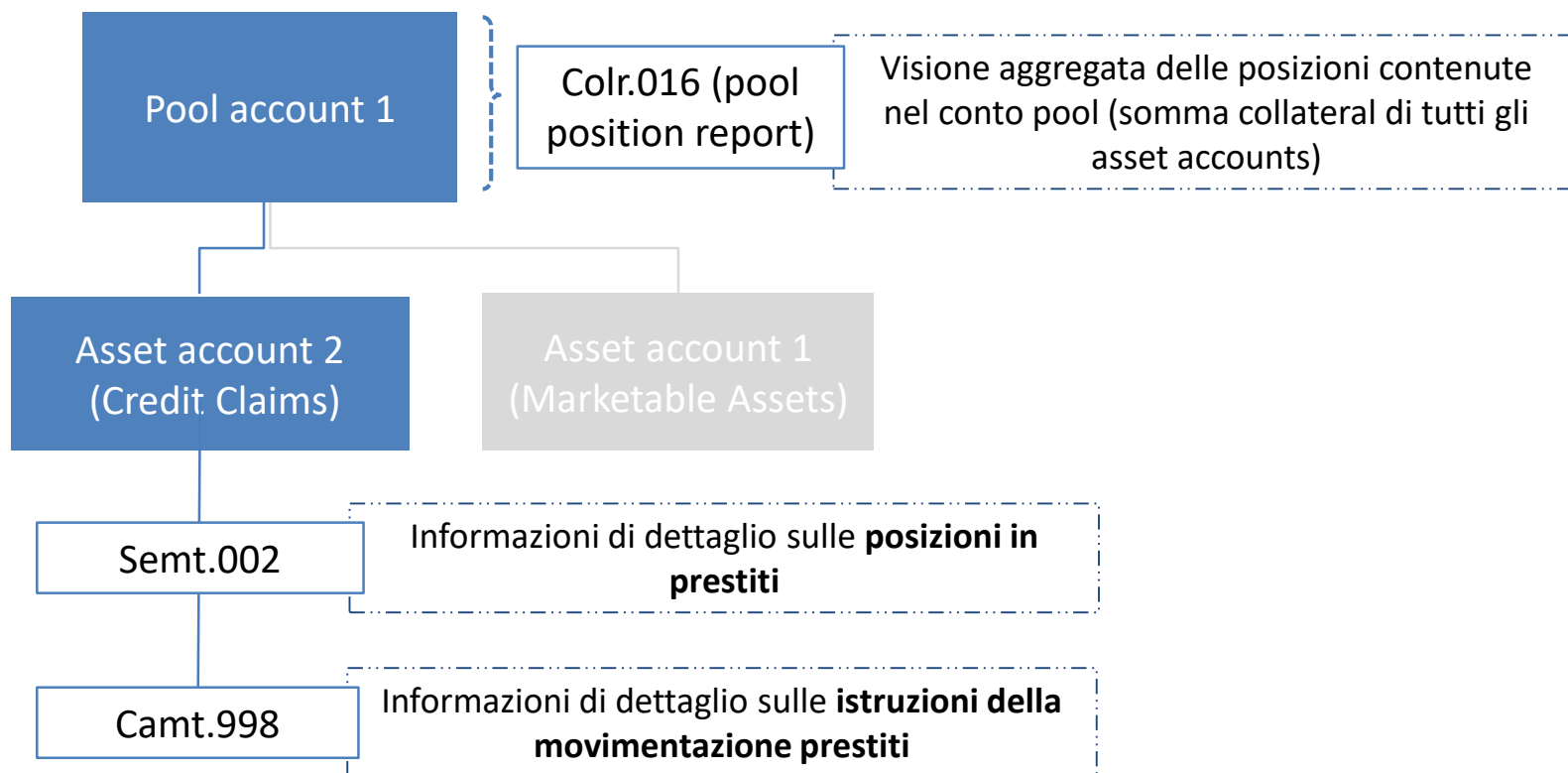
Informazioni report operazioni pending (marketable assets)

Contiene tutte le operazioni sospese non regolate nella giornata operativa corrente, non ancora ad uno stato finale al momento della generazione del report.

Internal asset account ID	Identifier of the internal asset account
Account owner ID and name	Identifier and name of the internal asset account owner
Instruction reference	Reference of the instruction which triggered the asset movement
ISIN code and quantity	Identifier and quantity of the asset
Statement value date	Value date of the statement
ECMS settlement instruction ID	Settlement identifier from the ECMS database
Settlement type	Instruction type: DELI or RECE
Intended settlement date	Date the instruction is intended to settle
Status and pending status reason	Instuction status and reason why it is not yet final



Configurazione reports per «pool account» - non marketable assets



Modalità di ricezione della reportistica sui prestiti

	«event based»	«push mode»	«pull mode»
Report posizioni prestiti (Semt.002)		X	X
Credit claims processing report file (Camt.998)	X		

❖ **«event based»** - prodotto a fronte di ogni invio del CC file (per le istruzioni che non richiedono intervento manuale es. registrazione di un debitore) o in chiusura di giornata (per le istruzioni che cambiano stato in seguito ad intervento manuale)



Dettaglio report sulle posizioni in prestiti (semt.002)

Campo in SoH	Origine
Internal asset account ID	Come specificato nell'istruzione MOB (SfkpgAcct)
Account owner ID	Come specificato nell'header del credit claims file
Account owner name	Recuperato dai reference data in ECMS a partire dall'Account owner ID
Credit claim ID	Come specificato da ECMS nella risposta all'istruzione CCR (Credit Claims File Processing Report/ECMSCCId)
Collateral value before HC	Come specificato nell'ultima istruzione CCR/CCU/CCOAU
Collateral value after HC	Calcolato da ECMS a seguito del conferimento e delle successive rivalutazioni
Statement value date	Calcolato da ECMS (più recente business day)
Creation date and time	Calcolato da ECMS



**Grazie per
l'attenzione**

