



ECMS: I test sui prestiti bancari

Seminario ECMS - 25 giugno 2024

Antonio Attilio Toma
Banca d'Italia
Servizio Operazioni sui Mercati



Stato dei test sui prestiti bancari in ECMS

- Dal 01/7/2024
 - Tutte le funzionalità disponibili
 - Le correzioni per tutti gli incidenti aperti durante la precedente sessione di test sono stati rilasciati e sono attualmente in test interno
 - Focus
 - Migrazione
 - Preparazione per cross-border test cases
 - Prestiti in portafoglio (pool di prestiti ABACO)



Migrazione (1/2)

- Dati di arricchimento delle informazioni necessarie alla migrazione dei CC
 - Simulati dalle procedure di migrazione durante i test
 - CCCNum: uguale a CCRef (cioè BKREF)
 - AgentBank: derivato da quanto in ABACO, dove possibile, altrimenti, uguale alla controparte
 - ChngIntrstRtInd: se tasso fisso, 'true', altrimenti, 'false'
 - ChngIntrstRtIndDt: se tasso fisso, MaturityDt – 1 giorno, altrimenti, '3999-12-31'
 - Da inviare entro l'inizio della preparation week per il go-live



Migrazione (2/2)

- Nuovi identificativi dei CC in ECMS
 - Disseminazione entro le ore 12:00 di sabato 29/06 per il test in corso
 - Disseminazione entro le ore 12:00 di sabato 16/11 per il go-live
 - Recepimento prima di nuove istruzioni sui prestiti migrati
- Riconciliazione (quadratura con lo stato in ABACO al 17/06)
 - In carico alle BCN come parte della migrazione stessa
 - Ripetibile, a discrezione delle controparti, dal 01/07



Preparazione per cross-border test cases

- Raccolta dei test case d'interesse
- Accordi con NCB coinvolte
- Identificazione dei soggetti coinvolti
- Dettagli via email questa settimana



Prestiti in portafoglio (pool di prestiti ABACO)

- Integrazione con ECMS
- Caricamento tramite portale
- Dettagli via email questa settimana



Grazie per l'attenzione.

