

CBF Customer Simulation – Umstellung von T2CUST auf UTEST

Clearstream Banking AG, Frankfurt¹ möchte Kunden über den Service zur Bereitstellung von Liquidität in der T2S Pre-Production Umgebung (UTEST) informieren.

Laut der Europäischen Zentralbank (EZB) wird die Umstellung der Anbindung der T2CUST² von der T2S Community Test Umgebung (MIG2) auf die UTEST am

Montag, 24. Juli 2017

stattfinden.

Gemäß dem EZB Umstellungsplan wird die Umstellung der Anbindung keine Ausfallzeiten in den verschiedenen Testumgebungen benötigen.

Nach der neuerlichen Anbindung von T2CUST an UTEST profitieren CBF Kunden von den Dienstleistungen zur Liquiditätsbereitstellung, die CBF in der Kundensimulationsumgebung (IMS23) anbietet.

Diese Kundeninformation zeigt die

- Voraussetzungen für Umstellung der Anbindung der T2CUST von MIG2 auf UTEST;
- Prozesse für Liquiditätsüberträge im Zeitraum 24. bis 26. Juli 2017;
- Auswirkungen der Umstellung auf die CBF Kundensimulationsumgebung.

Voraussetzungen für Umstellung der Anbindung der T2CUST von MIG2 auf UTEST

Gemäß dem Umstellungsplan der EZB wurden die angebotenen Nationalen Zentralbanken (NZB) aufgefordert, eine Aktualisierung der Stammdaten durchzuführen, um T2CUST und UTEST in Hinsicht auf RTGS Konten anzugleichen.

CBF Kunden werden von diesem Vorgehen profitieren, da die Stammdaten, die für diese Konten während der T2S Welle 4 hinterlegt wurden, bestehen bleiben. Die DCA und RTGS-Kontoinformationen, die für die vorangegangenen Kundensimulationsphasen bereitgestellt wurden, sind weiterhin in der IMS23 verfügbar. Ferner können die Daueraufträge für Liquiditätstransfers, die in CASCADE erstellt wurden, ohne weitere Maßnahmen auch zukünftig verwendet werden.

Prozesse für Liquiditätsüberträge im Zeitraum 24. bis 26. Juli 2017

Der letzte Geschäftstag („Business Day“) auf der UTEST in der Konfiguration, bei der MIG2 an T2CUST angebunden ist, ist Montag, 24. Juli 2017. An diesem Tag kommt der „T2S Special Schedule“ zum Tragen. Für Dienstag, 25. Juli 2017, und Mittwoch, 26. Juli 2017, kommt der „T2S Synchronised Standard Day“ wieder zum Tragen. Die zugehörigen Zeitpläne dieser Testtage sind in der Tabelle im Anhang A) „T2S Test Schedules“ im Vergleich aufgeführt.

¹ Diese Kundenmitteilung wurde herausgegeben von Clearstream Banking AG (CBF) mit Gesellschaftssitz Mergenthalerallee 61, 65760 Eschborn, Deutschland, eingetragen im Handelsregister des Amtsgerichts Frankfurt am Main, Deutschland, unter der Nummer HRB 7500.

² Testumgebung der Nationalen Zentralbanken (NZBs)

Hinsichtlich der Verarbeitung in UTEST werden CBF Kunden gebeten, zu berücksichtigen, dass

am Montag, 24. Juli 2017,

- Das Partial Settlement Window (Fenster) 1 um 08:00 Uhr ausgeführt wird und das zweite Fenster für 10:00 Uhr geplant ist. Die weiteren Fenster 3, 4 und 5 werden nicht durchgeführt.
- Die Bereitstellung der Liquiditätsüberträge (LTU) im Anschluss an die Umstellung des Geschäftstages (25. Juli 2017) nach 12:45 Uhr erfolgen muss.
- Nach Abschluss des Testtages werden die Testumgebungen UTEST und T2CUST um 15:00 Uhr geschlossen werden.

am Dienstag, 25. Juli 2017,

- Das Auskehren von Geldbeständen um 15:15 Uhr ausgeführt wird.
- Die Bereitstellung von Liquidität für den folgenden Geschäftstag (26. Juli 2017) ist nach 16:15 Uhr erforderlich.

am Mittwoch, 26. Juli 2017,

- Die Konfiguration von T2CUST und UTEST beendet sein soll.
- Die Liquiditätsbereitstellung unter Verwendung des T2S Synchronized Standard Day durchgeführt wird.

Auswirkungen der Umstellung auf die CBF Kundensimulationsumgebung

Seit 23. Januar 2017 ist T2CUST an MIG2 angebunden. Um CBF Kunden während der laufenden Simulation zu unterstützen, wird ein sogenannter „Cash Simulator“ genutzt. Dies bedeutet, dass bei CBF der Liquiditätstransfer immer als erfolgreich verbucht betrachtet wird, ohne dass tatsächlich Bewegungen auf den entsprechenden RTGS-Konten in T2CUST stattfinden. Einige NZBs bieten den Service, dass Liquiditätsüberträge simuliert werden, um auf den verknüpften DCA(s) Liquidität bereitzustellen.

Nach der Umstellung der Anbindung von T2CUST auf UTEST kann CBF die Liquiditätsüberträge zu Gunsten des DCAs³ initiieren. In der Kundensimulation können Liquiditätstransfers durch Einzel- oder Daueraufträge angestoßen werden.

In UTEST – wie auch in der Produktion – wird der CBF Cash Forecast zur Verfügung gestellt, um das Liquiditätsmanagement der Kunden in der Kundensimulation zu unterstützen. Der Zeitpunkt unterscheidet sich zur Produktion. In UTEST wird der Cash Forecast durch ein Ereignis („Event“) ausgelöst; dies ist der T2S Event „IDVP“, welcher für 14:30 Uhr geplant ist.

CBF Kunden, die den Liquiditätsservice in der Kundensimulationsumgebung (IMS23) nutzen, werden gebeten, zu berücksichtigen, dass

- **am Montag, 24. Juli 2017**, kein Liquiditätstransfer durchgeführt wird. Der CBF Simulator wird an diesem Testtag nach Vollendung der Maßnahmen zum Tagesabschluss deaktiviert.
- **beginnend am 25. Juli 2017** die Liquiditätsaufträge (Einzel- oder Dauerauftrag) für den folgenden Geschäftstag („Business Day“) bis spätestens 14:00 Uhr eingegeben werden müssen. Dieser Zeitpunkt ist gültig bis zum 5. August 2017. Für den „T2S Business Day Test“ der T2S Final Wave wird dieser Zeitpunkt angepasst.

³ Bitte die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) nutzen.
Die Bildschirmabbildungen finden Sie im Anhang B) „Erfassung von Geldaufträgen“

Kontakt

Das T2S Support Team von Clearstream steht Ihnen gerne bei Fragen zur Kundensimulation zur Verfügung. Unser Support Team ist an Testtagen von 09:00 Uhr bis 16:00 Uhr erreichbar.

Clearstream T2S Support Team

E-Mail: T2S-Support@clearstream.com

Tel. +49 (0) 69 / 211 18 27 8

Fax. +49 (0) 69 / 211 60 80 60

Clearstream Migrated to T2S - We Will Support You

Anhang

A) T2S Test Schedules⁴

T2S Settlement Procedure	T2S Synchronized Standard Day	T2S Special Schedule valid on 24 July 2017 only
Real-time Settlement		
Start of RTS after maintenance window and start of testing in UTEST (unattended)	Not applicable	05:00
T2S executes massive recycling	Not applicable	06:55
Start of Testing	07:00	07:00
T2S executes massive recycling	Not applicable	08:55
Partial Settlement 1	08:00	08:00
Partial Settlement 2	10:00	10:00
Partial Settlement 3	12:00	12:00 Not executed
Partial Settlement 4	12:30	12:30 Not executed
Partial Settlement 5	14:15	14:15 Not executed
DvP/Cash SR Cut-off	14:30	11:00
Collateral reimbursement	14:50	11:30
BATM/CBO Cut-off	15:10	11:40
Inbound LTO Cut-off / Automated cash sweep	15:15	11:45
Securities SR/FoP Cut-off	15:30	12:00
End of Day / Start of Day		
Change Business Day	16:15	12:45
Feeds from Collateral Management System	16:30	13:00
Start Night-Time / Cash Injection	17:00	13:30
Night-Time Settlement		
End of Testing	19:00	15:00

Legende

DvP: Delivery versus Payment, Cash SR: Cash Settlement Restrictions, BATM: Bilateral Agreed Treasury Management, CBO: Central Bank Operation, LTO: Liquidity Transfer Order, Securities SR: Securities Settlement Restrictions, FoP: Free of Payment

⁴ Bitte beachten Sie, dass CBF die Angaben von T2S verwendet und diese daher in englischer Sprache aufgeführt werden.

B) Bildschirmabbildungen “Erfassung von Geldaufträgen”

CASCADE HOST

```
TRAN: KNEE FC: DL SB:
DAUERAUFTRAG          E R F A S S U N G

CBF-KONTO/DCA REFERENZ : _____
NÄCHSTE GENERIERUNG FÜR: 06.07.2017  VERARBEITUNGSLAUF: DD2

DCA                    : _____
OPTIONSAUSWAHL:      _ (1 - FESTBETRAG,
                        2 - CASH FORECAST - AKT. SALDO T2S FORECAST
                        3 - CASH FORECAST - AKT. SALDO CBF FORECAST
                        4 - CASH FORECAST - AKT. DISPOSITIONSBETRAG
                        5 - POSITIVER BETRAG AUS DD-ZAHLUNG )

OPTION 1 : ANFORDERUNG = _____ EUR (FESTBETRAG)
OPTION 2-5: ANFORDERUNG = AKT. T2S SALDO/CBF SALDO/DISPO BETRAG/DD-ZAHLUNG
ZUSÄTZLICHE ANPASSUNG : + _____ %
                        + _____ EUR
MAXIMALE ANFORDERUNG : _____ EUR

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:          ----- B79074P4 -- 06/07/17 -- 10:08:07 --

PF1:Hilfe  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

CASCADE PC

The screenshot shows a Windows-style application window titled "CASCADE - PC selection: settlement of cash instructions information". It has a menu bar with "window" and "help". The main area is divided into two sections: "selection" and "additional selection".

selection:

- ☒ cash instructions
- ☐ standing instructions

additional selection:

- cash settlement account: [] []
- cash clearing date: [07-07-2017] up to: []
- processing cycle: [NTS - night time settlement 7:30 pm - 3:00 am]
- instruction type: []
- status: []

At the bottom, there are two buttons: "ok" and "cancel". The status bar at the very bottom displays: "Version 9.2 15.05.2017 IMS23 production T2S 7907123444 A KNGI 07-07-17 09:13:41 am".