

Offenmarktgeschäfte

Informationen zur Kundentestphase für Offenmarktgeschäfte
(Kreditgeschäft in Euro, Termineinlagen)

1. Testgrundsätze
2. Testzeitraum und Testfälle
 - 2.1. Hereinnahme von Termineinlagen
 - 2.2. Längerfristiges Refinanzierungsgeschäft
3. Monitoring der Geschäfte
 - 3.1. Pool Overview
 - 3.2. Exposure
 - 3.3. Reports

1. Testgrundsätze

Testscenario und Grundannahmen

- Die Offenmarktgeschäfte in Euro werden laut den Angaben im Testzeitplan von der Deutschen Bundesbank durchgeführt.
- Für die Zuteilung und die Abwicklung am Valutatag der beiden Kreditgeschäfte ist durch die Geschäftspartner nichts zu veranlassen.
 - Ein ausreichender Beleihungswert wird durch die Deutsche Bundesbank eingebucht.
 - Die Zuteilungsbeträge sind für alle Geschäftspartner im jeweiligen Offenmarktgeschäft einheitlich und werden durch die Deutsche Bundesbank erfasst.

- Die Überprüfung der Zahlungen in CLM muss an den Settlement- und Maturity-Tagen durchgeführt werden.
- Für das Settlement der Termineinlage sowie für die Fälligkeit des Kreditgeschäfts in Euro ist durch die Geschäftspartner für **ausreichende Liquidität in CLM** zu sorgen.
- Die Bundesbank BIC für die Verrechnung der Offenmarktgeschäfte lautet MARKDEFFCMS.

Sollten während des Testverfahrens bei Ihnen Auffälligkeiten oder Fragen aufkommen, melden Sie sich bitte bei uns unter

ecms-test@bundesbank.de

Allgemeiner Hinweis:

Bitte beachten Sie die aktuellen **Testeinschränkungen** gemäß den „Testing conditions“ der EZB. [ECMS - Professional use \(europa.eu\)](#) Die „Testing conditions“ werden **alle zwei Wochen** veröffentlicht.

Für weiterführende Informationen zum ECMS Kundentest: [Test und Migration | Deutsche Bundesbank](#)

In diesem Kundentest wird nur auf relevante Felder für die Prüfung der Geschäfte eingegangen, weitere Informationen finden Sie im UHB [ECMS User Handbook for Counterparties \(europa.eu\)](#).

Für die von Ihnen durchgeführten Testfälle benötigen wir eine Bestätigung über die erfolgreiche Durchführung. Bitte beantworten Sie die für diesen Zweck vorgesehene Umfrage.

2. Testzeitraum und Testfälle

19.03. – 26.03.

2. Testzeitraum / Testfälle

Testzeitraum

Testbeginn: 19. März 2024

Testende: 26. März 2024

| Dienstag, 19. März | Mittwoch, 20. März | Donnerstag, 21. März | Freitag, 22. März |
|-------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Termineinlage Valuta | LTRO Valuta | | |

| Montag, 25. März | Dienstag, 26. März |
|------------------|--|
| | Termineinlage Fälligkeit LTRO Fälligkeit |

Gerne können Sie das Kundentestforum am 08.04.2024 nutzen, um Ihre Fragen an uns zu adressieren.

2. Testzeitraum / Testfälle

2.1. Hereinnahme von Termineinlagen

| | |
|--------------------------|-------------------------|
| Valuta: | Dienstag, 19.03. |
| Fälligkeit: | Dienstag, 26.03. |
| Laufzeit: | 7 Tage |
| Zuteilungsbetrag: | 1 Mio € |
| Zinssatz: | 2,0 % |

Die Termineinlage ist sicherheitenrelevant, somit erhöht sich täglich die Sicherheitenposition im Pool um den Zinsbetrag von 55,56 €.

Die Buchung erfolgt in CLM via pacs 009.

* Zuteilungsbetrag und Zinssatz wurden einheitlich von der Deutschen Bundesbank erfasst und sind für alle Geschäftspartner identisch.

2. Testzeitraum / Testfälle

2.2. Längerfristiges Refinanzierungsgeschäft

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Valuta: | Mittwoch, 20.03. |
| Fälligkeit: | Dienstag, 26.03. |
| Laufzeit: | 6 Tage |
| Referenzinstrument: | Average MRO rate |
| Zuteilungsbetrag: | 2,5 Mio € |
| Spread: | 50 bp |

Die täglich aufgelaufenen Zinsen werden beleihungswertverändernd berücksichtigt, somit erhöht sich der zu besichernde Betrag im Pool täglich. Die MRO rate beträgt bis zum 21.03. 1,5 % und ab dem 22.03. 1,7 %.

Der Zinsbetrag beträgt zur Fälligkeit des Tenders 888,89 €.

Die Buchung erfolgt in CLM via pacs 009.

* Zuteilungsbetrag und Zinssatz wurden einheitlich von der Deutschen Bundesbank erfasst und sind für alle Geschäftspartner identisch.

3. Monitoring der Geschäfte

3. Monitoring der Geschäfte

Testfälle zur Prüfung der Offenmarktgeschäfte

Testaktivitäten zur Prüfung (der Erfüllung) der Fundamental Test Cases:

Zu 3.1. Pool Overview

- Das gebuchte Geschäft ist mit dem zugeteilten Volumen und dem berechneten Zins in der Poolübersicht zu sehen.

Zu 3.2. Exposure

- Bitte prüfen Sie, ob der berechnete Zinsbetrag für die offenen Offenmarktgeschäfte ausgewiesen wird.

Zu 3.3. Reports

- Bitte kontrollieren Sie, ob alle Zahlungen im Report „MPO Expected Payments“ mit den dazu passenden Status einzusehen sind.

Die Überprüfung der Zahlungen in CLM muss an den Settlement- und Maturity-Tagen durchgeführt werden.

Weitere Informationen zu den Fundamental Test Cases finden Sie unter [ECMS user testing - fundamental test cases \(europa.eu\)](#).

3. Monitoring der Geschäfte

Testfälle zur Prüfung der Offenmarktgeschäfte

Testaktivitäten, die über den Umfang der Fundamental Test Cases hinausgehen:

Zu 3.2. Exposure

- Sie haben die Möglichkeit die Anzeige der Zinsberechnung für einzelne Tage zu löschen.
- Bitte überprüfen Sie die zu nettenden Geschäfte hinsichtlich Höhe der Nominale, Zinsen und Verrechnungen.

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Modul: Collateral and Credit

Screen: Pool Overview >> Pool Overview >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „List Pools Overview“ >> „View“

Display : Counterparty Pool

Pool Identifier ** ▾ Pool Reference ** ▾ Counterparty ** ▾

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

Validity Start Date ** ▾ Validity End Date ** ▾

Reset Search

List Pools Overview

10

| Pool Identifier | | Pool Type | | Counterparty | | SCP Pool | | | SCP Pool | | | ELA Pool | | Is Active | | Update Date | Updater User | Is Locked | Lock Origin |
|-----------------|-----------|--------------|------------------|--------------|------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|-------------|----------------|----------------|-----------|------------------|--------------|-------------|--------------|-----------|-------------|
| Pool Identifier | Pool Type | Counterparty | Total Collateral | Total Credit | SCL | ECL | RCL | Collateral Exc. | Insufficient C. | Is Valuated | ELA Collateral | Total ELA Cre. | Is Active | Update Date | Updater User | Is Locked | Lock Origin | | |
| POOL0000000... | SCP | | 4,658,453,836.5 | 1,919,821.88 | 4,656,534,014... | 4,656,534,014... | 4,656,534,014... | 0 | No | Yes | 0 | 0 | Yes | 25/01/2024 22... | | No | | | |

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Erläuterungen:

- In der „List Pools Overview“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|------------------------|--|
| Pool Identifier | Die Pool-ID |
| Pool Type | Art des Pools |
| Counterparty RIAD Code | Ihr MFI-Code |
| Total Collateral Value | Konsolidierter Sicherheitenbestand |
| Total Credit | Konsolidierte Position an OMOs und Inanspruchnahme der Spitzenrefinanzierungsfazilität |
| SCL | Aktuelle Kreditlinie |

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.5.1.1.1.

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Modul: Collateral and Credit

Screen: Pool Overview >> Pool Overview >> „View“

POOL POSITIONS

COLLATERAL

- Marketable Asset Collateral
- Externally Managed Collateral
- Cash Collateral
- Fixed Term Deposit

| | |
|------------------------------|---------------------------------------|
| Total FTD used as Collateral | Total FTD used as Collateral Interest |
| 0 | 0 |

FTD Positions

TRIPARTY COLLATERAL

- Credit Claims

Total Collateral

| | |
|----------------------------------|------------------------|
| Total Collateral Operations | Relative Credit Limit |
| 4,658,453,836.5 | |
| Total Collateral affected to OMO | Total Collateral Value |
| 1,919,821.88 | 4,658,453,836.5 |

EXPOSURE

- Credit Freezing
- Euro LPO

| | |
|-------------------------|-----------------------|
| Total Euro LPO | Total Euro LPO Margin |
| 0 | 0 |
| Total Euro LPO Interest | |
| 87.5 | |

- Non-Euro LPO

| | |
|-----------------------------|---------------------------|
| Total Non-Euro LPO | Total Non-Euro LPO Margin |
| 919,793.97 | 1,000,000 |
| Total Non-Euro LPO Interest | |
| 715.41 | |

- Marginal Lending Facility

Total Exposure

| |
|--------------|
| Total Credit |
| 1,919,821.88 |

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Erläuterungen:

- Aus dem „View Screen“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen (Teil 1):

| Feld | Erläuterung |
|---------------------------------|--|
| FTD used as collateral | Sicherheitsrelevante FTD-Positionen |
| FTD used as collateral Interest | Angefallene Zinsen für die sicherheitenrelevanten FTDs |
| FTD Positions Button | Liste aller Termineinlagen (siehe Grafik) |

| Pool Id | Counterparty | Actual Position | Provisional Position | Conservative Position |
|------------------|--------------|-----------------|----------------------|-----------------------|
| POOL000000000433 | [redacted] | 0 | 0 | 0 |

- Auch nicht sicherheitsrelevante Termineinlagen werden ausgewiesen.

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.5.1.1.1.

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Erläuterungen:

- Aus dem „View Screen“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen (Teil 2):

| Feld | Erläuterung |
|-------------------------|--|
| Total Euro LPO | Summe der Nominale für alle Geschäfte in Euro |
| Total Euro LPO Margin | Margin für alle Geschäfte in Euro |
| Total Euro LPO Interest | Angefallene Zinsen für die ausgewiesenen Geschäfte in Euro |
| Total Credit | Summen aller Positionen auf der Kreditseite des Pools |

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Testaktivitäten zur Prüfung (der Erfüllung) der Fundamental Test Cases:

Prüfung zu 3.1. Pool Overview:

- Bitte prüfen Sie, ob die Nominalwerte und die Zinsen für Ihre Termineinlagen und liquiditätszuführenden Geschäfte in der Pool Overview mit den zugeteilten Geschäften übereinstimmen.

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> Open Market Operations >> Operations >> Display Calculated Interest >> „Search“

Search Criteria : Calculated Interest

Internal Reference ID == Date == Transaction Type ==

Creation Date == Update Date ==

Reset Search

Search Result : Calculated Interest

10 Page 1 of 5

| Internal Refer... | Counterparty # | Date | Transaction T... | Provisional In... | Provisional In... | Outstanding | Outstanding | Accrued Inter... | Accrued Inter... | Paid Accrued | Paid Accrued | Externally Co... | Not Externall... | Interest Rate # | Total Account... | Total Account... | Amount prep... | Amount prep... | Update Date | Update User |
|-------------------|----------------|------------|--------------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------|------------------|------------------|--------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|-------------|
| DELPO240110... | | 19/01/2024 | Interest Calcul... | 715.4 | 777.78 | 715.4 | 777.78 | 97.23 | 105.71 | 89.43 | | 0 | 89.43 | 3.5 | 715.4 | 777.78 | 89.43 | 97.23 | 19/01/2024 10... | STP |
| DELPO240110... | | 18/01/2024 | Interest Calcul... | 715.4 | 777.78 | 625.97 | 680.56 | 97.22 | 105.69 | 89.42 | | 0 | 89.42 | 3.5 | 625.97 | 680.55 | 94.94 | 103.22 | 18/01/2024 02... | STP |
| DELPO240110... | | 17/01/2024 | Interest Calcul... | 708.04 | 777.78 | 531.03 | 583.33 | 97.23 | 106.81 | 88.51 | | 0 | 88.51 | 3.5 | 531.03 | 583.34 | 88.51 | 97.23 | 17/01/2024 08... | |
| DELPO240110... | | 16/01/2024 | Interest Calcul... | 708.04 | 777.78 | 442.52 | 486.11 | 97.22 | 106.79 | 88.5 | | 0 | 88.5 | 3.5 | 442.52 | 486.11 | 88.5 | 97.22 | 16/01/2024 02... | STP |
| DELPO240110... | | 15/01/2024 | Interest Calcul... | 708.04 | 777.78 | 354.02 | 388.89 | 291.67 | 320.4 | 265.52 | | 0 | 265.52 | 3.5 | 354.02 | 388.89 | 265.52 | 291.67 | 15/01/2024 17... | STP |
| DEFTD240111... | | 15/01/2024 | Interest Calcul... | 388.89 | | 388.89 | | 291.67 | | | | | | 3.5 | 388.89 | | 291.67 | | 15/01/2024 11... | STP |
| DEFTD240111... | | 12/01/2024 | Interest Calcul... | 388.89 | | 97.22 | | 97.22 | | | | | | 3.5 | 97.22 | | 97.22 | | 12/01/2024 09... | STP |
| DELPO240109... | | 12/01/2024 | Paid Accrued L... | 777.78 | | 111.11 | | 222.22 | | 222.22 | | 0 | 222.22 | 1.5 | 0 | | 111.11 | | 12/01/2024 02... | STP |
| DELPO240109... | | 12/01/2024 | Paid Accrued L... | 0 | 0 | 0 | 0 | 138.89 | | 138.89 | | | | 2.5 | 0 | 0 | 138.89 | | 12/01/2024 02... | STP |
| DELPO240110... | | 12/01/2024 | Interest Calcul... | 708.04 | 777.78 | 88.5 | 97.22 | 97.22 | 106.79 | 88.5 | | 0 | 88.5 | 3.5 | 88.5 | 97.22 | 88.5 | 97.22 | 11/01/2024 19... | STP |

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure

Erläuterungen:

- In „Display Calculated Interest“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|----------------------|---|
| Transaction Type | Zinszahlung oder Zinsberechnung |
| Provisional Interest | Vorläufige Berechnung der endfälligen Zinszahlungen |
| Outstanding Interest | Bisher angefallene Zinsen |
| Accrued Interest | Tagfällige Zinsen |
| Interest Rate | Angewendeter Zinssatz |

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> Open Market Operations >> Operations >> Display Calculated Interest >> „View“

Search Result : Calculated Interest > View : Calculated Interest History

| Interest Details | | |
|--|--|-------------------------------------|
| Date | Internal Reference ID | Provisional Interest Amount |
| 19/01/2024 | [REDACTED] | 715.4 |
| Provisional Interest Amount in currency | Accrued Interest | Accrued Interest Amount in Currency |
| 777.78 | | 105.71 |
| Outstanding Accrued Interest | Outstanding Accrued Interest In Currency | Paid Accrued Interest |
| 715.4 | 777.78 | 89.43 |
| Paid Accrued Interest in currency | Externally Covered Interest Amt | Not Externally Covered Interest Amt |
| | 0 | 89.43 |
| Total Accounting Interest | Total Accounting Interest in Currency | Amount prepared for Accounting |
| 715.4 | 777.78 | 89.43 |
| Amount prepared for Accounting in Currency | | 97.23 |

FootPrint

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure

Erläuterungen:

- Aus dem „View Screen“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|--------------------------------|---|
| Provisional Interest | Vorläufige Berechnung der endfälligen Zinszahlungen |
| Outstanding Accrued Interest | Bisher angefallene Zinsen |
| Total Accounting Interest | Buchhalterisch angefallene Zinsen zum Ende der Laufzeit |
| Amount prepared for Accounting | Bisher buchhalterisch angefallene Zinsen |

Testaktivitäten zur Prüfung (der Erfüllung) der Fundamental Test Cases:

Prüfung zu 3.2. Exposure:

- Bitte prüfen Sie, ob die berechneten Zinsen zur Fälligkeit, sowie die täglichen Zinsupdates für Ihre Geschäfte mit dem zugeordneten Geschäft übereinstimmen.

Testaktivitäten, die über den Umfang der Fundamental Test Cases hinausgehen:

Zusätzliche Prüfung zu 3.2. Exposure:

- Im List-Screen kann für einzelne Tage die Zinsberechnung gelöscht werden, falls eine bessere Übersicht gewünscht wird. Bitte beachten Sie hierbei, dass der gelöschte Datensatz nicht wieder hergestellt werden kann.

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> LP Operations Netting >> „Display Netting Result LPO“

Pool Overview | Display Netting Result LPO

Search Criteria : Netting Result

Transaction Reference Number: -- Counterparty: -- Pool Identifier: --

Netting Currency: -- Netting Date: -- Creation Date: --

Reset Search

Search Result : Netting Result

| Transaction Reference | Pool Identifier | Counterparty RIAD Co. | Amount | Margin Amount | Netting Currency | Interest Amount | Netting Date | Netting Setup | Netting Status | Update Date | Update User Id |
|-----------------------|-----------------|-----------------------|-------------|---------------|------------------|-----------------|--------------|---------------|-------------------|-------------------------|----------------|
| DENET | POOL | DE | -919,793.97 | -110,375.28 | USD | 715.4 | 19/01/2024 | | Waiting FXPayment | 19/01/2024 07:03:05.774 | |
| DENET | POOL | DE | -3,000,000 | 0 | EUR | 361.11 | 12/01/2024 | MRO + LTR0 | Settled | 12/01/2024 02:26:21.996 | STP |
| DENET | POOL | DE | 910,332.27 | 109,239.87 | USD | 0 | 11/01/2024 | | Settled | 11/01/2024 08:47:26.620 | |
| DENET | POOL | DE | 3,000,000 | 0 | EUR | 0 | 10/01/2024 | MRO + LTR0 | Settled | 09/01/2024 19:15:58.090 | STP |
| DENET | POOL | DE | 0 | | EUR | | 24/11/2023 | | Failed | 24/11/2023 17:00:56.041 | |
| DENET | POOL | DE | -1,000,000 | 0 | EUR | 138.89 | 17/11/2023 | MRO + LTR0 | Settled | 17/11/2023 10:50:45.870 | STP |
| DENET | POOL | DE | 1,000,000 | 0 | EUR | 0 | 15/11/2023 | MRO + LTR0 | Settled | 15/11/2023 08:02:36.970 | STP |
| DENET | POOL | DE | 2,000,000 | 0 | EUR | 0 | 14/11/2023 | MRO + LTR0 | Settled | 14/11/2023 10:00:41.152 | STP |
| DENET | POOL | DE | 1,500,000 | 0 | EUR | 0 | 25/10/2023 | | Settled | 24/10/2023 19:17:07.033 | STP |
| DENET | POOL | DE | 2,000,000 | 0 | EUR | 0 | 29/09/2023 | MRO + LTR0 | Settled | 29/09/2023 15:11:47.547 | |

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Erläuterungen:

- In der Liste der „Netting Results LPO“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|------------------|------------------------------------|
| Amount | Netto Nominal |
| Margin Amount | Netto Margin bei FX Geschäften |
| Netting Currency | Währung der zu nettenden Geschäfte |
| Interest Amount | Netto Zinszahlungen |
| Netting Date | Datum des Nettings |
| Netting Setup | Art der genetteten Geschäfte |

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.3.3.2.3.1.

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> LPO Operations Netting >> Display Netting Result LPO >> „View“

Search Result : Netting Result > View : Netting Result History

| | | |
|--|--|--------------------------------------|
| Transaction Reference Number DENE[REDACTED] | Pool Identifier POOL000000000[REDACTED] | Counterparty RIAD Code [REDACTED] |
| Amount -3,000,000 | Margin Amount 0 | Interest Amount 361.11 |
| Netting Currency EUR | Netting Date 12/01/2024 | Netting Setup MRO + LTRO |
| Netting Status Settled | Error Description | |

Movements Details

| | | |
|---|--|----------------------|
| Netting Movement PMLDE0000[REDACTED] | Netting Interest Movement PMLDE0000[REDACTED] | Margin Movement = |
|---|--|----------------------|

Netting Details

Settling Operation [0] Maturing Operation [1] Maturing Early Repayment [1]

FootPrint

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> LP Operations Netting >> Display Netting Result LPO >> „View“
>> „Settling Operation“

| Internal Referenc. | Pool Identifier | OMORefNo | Accrued Interest | Fx Amount | Outstanding Amo. | Contract Currency | Fx Currency | Instruction Status | Used As Collater. | To Be Netted | Creation Date | Update Date | Creation User Id | Update User Id |
|--------------------|-----------------|----------|------------------|-----------|------------------|-------------------|-------------|--------------------|-------------------|--------------|---------------------|---------------------|------------------|----------------|
| DELPO | POOL | 20230184 | 0 | | 0 | EUR | --- | Closed | Yes | No | 09/01/2024 14:39... | 12/01/2024 02:26... | | STP |
| DELPO | POOL | 20230180 | 0 | | 0 | EUR | --- | Closed | Yes | No | 09/01/2024 14:34... | 12/01/2024 02:26... | | STP |

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Erläuterung:

- Über „View“ können Sie die Daten aus dem List-Screen für ein einzelnes Geschäft einsehen.
- Über die Buttons „Settling Operation“, „Maturing Operation“ und „Maturing Early Repayment“ können Sie detaillierte Infos zu den genetteten Geschäften sehen.
- In der Liste der Geschäfte können Sie folgende Infos der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|--------------------|--------------------------------|
| Accrued Interest | Aktuell angefallener Zins |
| Outstanding Amount | Aktuell ausstehendes Nominal |
| Contract Currency | Währung des Geschäfts |
| Instruction Status | Aktueller Status des Geschäfts |

Zu Beachten: Nach der Ausbuchung des Geschäfts betragen die Werte für angefallene Zinsen und die Nominalhöhe „0“ und können nicht mehr nachvollzogen werden!

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.3.3.2.3.3.

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Exposure (Netting)

Testaktivitäten, die über den Umfang der Fundamental Test Cases hinausgehen:

Zusätzliche Prüfung zu 3.2. Exposure:

- Bitte prüfen Sie, ob Ihre gebuchten und fällig gestellten Geschäfte anhand der vorliegenden Nominale, Zinsen und des Buchungsdatums korrekt verrechnet wurden.

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Reports

Modul: Collateral and Credit

Screen: Reporting >> Monetary Policy Operations >> MPO Expected Payments >> „Search“

Search Criteria : MPO Expected Payments

Countryparty RIAD Code Pool Identifier Operation Reference

Operation Type Principal or Interest Indicator Interest Payment Date

Search Result : MPO Expected Payments

| Payment Reference # | Internal Reference ID # | Operation Reference # | Operation Type # | Countryparty RIAD Code # | Amount # | Currency # | Interest Rate # | Expected Payment Date # | Principal or Interest Indicator # | Sign # | Event Description # | Payment Status # | Pool Identifier # |
|---------------------|-------------------------|-----------------------|------------------|--------------------------|-----------|------------|-----------------|-------------------------|-----------------------------------|--------|-----------------------------|------------------|-------------------|
| 3293006 | | 3293006 | Early Payment | | 2,000,000 | EUR | 0 | 10/11/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32321184 | | 32321184 | Early Payment | | 2,000,000 | EUR | 0 | 12/01/2024 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32321028 | | 32321028 | OMAO | | 1,379 | EUR | 4.9 | 08/10/2023 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Expire | |
| 32321028 | | 32321028 | OMAO | | 8,900,000 | EUR | 0 | 08/10/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32321028 | | 32321028 | OMAO | | 9,900,000 | EUR | 0 | 08/10/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32322000 | | 32322000 | OMAO | | 1,100,000 | EUR | 0 | 10/08/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32322000 | | 32322000 | OMAO | | 1,100,000 | EUR | 0 | 08/08/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | -0.33 | EUR | -0.33 | 11/08/2023 | Interest | In | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | 8,000,000 | EUR | 0 | 08/08/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | 9,000,000 | EUR | 0 | 11/08/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | 809.91 | EUR | 9 | 03/09/2023 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | 2,000,000 | EUR | 0 | 03/09/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32323000 | | 32323000 | OMAO | | 2,000,000 | EUR | 0 | 03/09/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32990001 | | 32990001 | OMAO | | 136.89 | EUR | 2.9 | 17/11/2023 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32990001 | | 32990001 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 19/11/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32990001 | | 32990001 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 17/11/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32990004 | | 32990004 | OMAO | | 3,000,000 | EUR | 0 | 14/11/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32990007 | | 32990007 | OMAO | | 134.44 | EUR | 9.9 | 18/11/2023 | Interest | Out | Approved Interest on FTD | Settle | |
| 32990007 | | 32990007 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 14/11/2023 | Principal | Out | Fixed Term Deposit Maturity | Settle | |
| 32990007 | | 32990007 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 18/11/2023 | Principal | In | Fixed Term Deposit Maturity | Settle | |
| 32321111 | | 32321111 | OMAO | | 898.94 | EUR | 2.9 | 09/10/2023 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32321111 | | 32321111 | OMAO | | 2,000,000 | EUR | 0 | 09/09/2023 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32321111 | | 32321111 | OMAO | | 2,000,000 | EUR | 0 | 09/10/2023 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32930004 | | 32930004 | Early Payment | | 205.29 | EUR | 1.28 | 18/11/2023 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32321011 | | 32321011 | OMAO | | 1,888.89 | EUR | 4.28 | 19/10/2023 | Interest | In | Approved Interest on FTD | Settle | |
| 32321011 | | 32321011 | OMAO | | 8,000,000 | EUR | 0 | 11/10/2023 | Principal | Out | Fixed Term Deposit Maturity | Settle | |
| 32321011 | | 32321011 | OMAO | | 8,000,000 | EUR | 0 | 19/10/2023 | Principal | In | Fixed Term Deposit Maturity | Settle | |
| 32321010 | | 32321010 | OMAO | | 138.89 | EUR | 2.9 | 12/01/2024 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32321010 | | 32321010 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 10/01/2024 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32321010 | | 32321010 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 12/01/2024 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32321184 | | 32321184 | OMAO | | 2,000,000 | EUR | 0 | 10/01/2024 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32321178 | | 32321178 | OMAO | | 777.78 | USD | 9.9 | 18/01/2024 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |
| 32321178 | | 32321178 | OMAO | | 1,000,000 | USD | 0 | 11/01/2024 | Principal | In | Credit Operation Settlement | Settle | |
| 32321178 | | 32321178 | OMAO | | 1,000,000 | USD | 0 | 18/01/2024 | Principal | Out | Credit Operation Maturity | Settle | |
| 32321178 | | 32321178 | OMAO | | 898.89 | EUR | 9.9 | 18/01/2024 | Interest | In | Approved Interest on FTD | Settle | |
| 32321178 | | 32321178 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 11/01/2024 | Principal | Out | Fixed Term Deposit Maturity | Settle | |
| 32321184 | | 32321184 | OMAO | | 1,000,000 | EUR | 0 | 18/01/2024 | Principal | In | Fixed Term Deposit Maturity | Expire | |
| 32321184 | | 32321184 | Early Payment | | 222.22 | EUR | 1.9 | 12/01/2024 | Interest | Out | Credit Operation Interest | Settle | |

Export Report On Export Report Error

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Reports

Modul: Collateral and Credit

Screen: Reporting >> Monetary Policy Operations >> MPO Expected Payments >> „View“

Search Result : MPO Expected Payments > View : MPO Expected Payment

| | | |
|---------------------|-----------------------|---------------------------------|
| Payment Reference | Internal Reference ID | Counterparty RIAD Code |
| | | |
| Pool Identifier | Not Identifier | Amount |
| POOL00000000 | | 5,500,000 |
| Currency | Intended Payment Date | Interest Rate |
| EUR | 26/10/2023 | 0 |
| Operation Reference | Operation Type | Principal or Interest Indicator |
| 20231025 | OMO | Principal |
| Sign | Creditor Account | Debtor Account |
| Da | | |
| Netting Indicator | Netted Payment ID | Event Description |
| Yes | | Credit Operation Settlement |

Payment Status
Settled

FootPrint

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Reports

Erläuterung:

- In der Liste „Expected Payments“ können Sie folgende Informationen der Übersicht entnehmen:

| Feld | Erläuterung |
|------------------------|--|
| Operation Reference | Tender-ID der Operation |
| Operation Type | Art des Geschäfts |
| Counterparty RIAD Code | Ihr MFI-Code |
| Interest Rate | Zins für die Zinszahlungen |
| Intended Payment Date | Geplanter Ausführungszeitpunkt der Zahlung |
| Principal or Interest | Nominal- oder Zinszahlung |
| Sign | Out = Zahlung an GP / In = Zahlung an NZB |
| Event Description | Zahlungsvorgang |
| Payment Status | Aktueller Zahlungsstatus |

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.3.3.1.1.

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Reports

Testaktivitäten zur Prüfung (der Erfüllung) der Fundamental Test Cases:

Prüfung zu 3.3. Reports:

- Bitte prüfen Sie, ob die Zahlungen (Zuteilung, Rückzahlung und Zins) für Ihre Geschäfte erstellt worden sind und die Nominale bzw. Zinsen der Zahlungen dem zugehörigen Geschäft entsprechen.

- Sollten während des Testverfahren bei Ihnen Auffälligkeiten oder Fragen aufkommen, melden Sie sich bitte bei uns unter **ecms-test@bundesbank.de**.
- Wenn Sie alle Testfälle von Seite 12 erfolgreich durchgeführt haben, bitten wir Sie dies in der vorgesehenen Umfrage zu bestätigen.