



X – TRM
Cross Border Transaction
Manager
Acquisizione Contratti nel
sistema di post-trading con
Regolamento presso siste-
mi di Liquidazione Esteri

Piano delle prove

INDICE

1. <i>PREMESSA</i>	3
1.1 Obiettivo del documento	3
1.2 Validità	3
1.3 Riferimenti	3
2. <i>SCOPO DEI COLLAUDI</i>	4
3. <i>LINEE GUIDA DI COLLAUDO</i>	5
3.1 Anagrafica strumenti finanziari	5
3.2 Anagrafica controparti	5
3.3 Verifiche del collaudo	6
4. <i>ESITO DEI COLLAUDI</i>	6
5. <i>MODALITA' TECNICO OPERATIVE PER I COLLAUDI</i>	6
5.1 Date dei collaudi	6
5.2 Personale di riferimento	6
5.3 Ambienti di collaudo	7
5.4 Documentazione	7

1. PREMESSA

A seguito della migrazione del mercato EuroMOT alla piattaforma tecnologica MTA e alla sua integrazione nel sistema di post trading gestito da Monte Titoli avvenuta con successo il 11 aprile u.s., Monte Titoli arricchisce la gamma dei suoi prodotti. Il nuovo servizio X-TRM consente agli utenti aderenti al sistema RRG la possibilità di inserire operazioni fuori mercato da liquidarsi presso sistemi di settlement diversi da Express II. Questo ulteriore sviluppo è dettato dalla volontà di offrire prodotti sempre più qualificati, orientati ad una più ampia internazionalizzazione del sistema Italia. Questa fase del progetto prevede:

- la possibilità per gli utenti di X-TRM di effettuare operazioni di riscontro e rettifica con il contestuale invio al regolamento presso sistemi di settlement esteri, più precisamente Euroclear e Clearstream

1.1 Obiettivo del documento

Il presente documento descrive il “Piano dei collaudi” delle nuove funzionalità.

1.2 Validità

Il presente documento ha validità esclusivamente nell’ambito del progetto X-TRM.

1.3 Riferimenti

1. Manuale dei Servizi - RRG gestito da Monte Titoli S.p.A.
<http://www.montetitoli.it/it/documentazione/normativa/manualedeiservizirrg/>.
2. Servizio di Riscontro e Rettifica Giornaliero – RRG – documentazione Tecnica gestiti da Monte Titoli S.p.A.
<http://www.montetitoli.it/it/documentazione/documentazionetecnica/servizidiriscontroerettificagiornalerirrg/>.

2. SCOPO DEI COLLAUDI

I collaudi hanno il fine di permettere ai partecipanti al servizio X-TRM di verificare il corretto funzionamento del sistema verificando le nuove funzionalità introdotte riguardo l’inserimento di operazioni fuori mercato da regolarsi all’estero. Di seguito le funzionalità in oggetto:

A. Tipo conto Negoziazione:

- Attualmente è possibile scegliere il “tipo conto negoziazione” per operazioni fuori mercato effettuate sulla piattaforma di post-trading regolate nei sistemi Express ed Express II. Analogamente i partecipanti potranno utilizzare la correlazione tra il tipo negoziazione (proprietà/terzi) ed il rispettivo conto di regolamento anche per le operazioni OTC destinate al regolamento presso i CSD esteri.

B. Sistema di Liquidazione:

- Come avviene attualmente, impostando il dato “sistema di liquidazione”, il sistema di post trading associa automaticamente il relativo sistema di custodia. La novità per X-TRM è l’inserimento dei due nuovi codici legati ai sistemi di settlement esteri:
 - a. 03 – Euroclear al quale è associata la sigla “ECLR”
 - b. 04 – Clearstream al quale è associata la sigla “CEDE”

Come già indicato per le prove della prima fase, verrà richiesta agli utenti la verifica dell’informativa del servizio X-TRM al fine di verificare la correttezza, nonché di effettuare la quadratura della stessa informativa con quella inviata loro dal sistema di settlement Euroclear. Per il sistema Clearstream ciò non è possibile in quanto la piattaforma in questione non prevede la gestione automatica dei messaggi in ambiente di test.

3. LINEE GUIDA DI COLLAUDO

Le sessioni di collaudo si terranno negli ambienti dedicati al test, avranno inizio il **20 giugno 2005** e si protrarranno fino al **1 luglio 2005**.

3.1 Anagrafica strumenti finanziari

Gli strumenti finanziari a disposizione per le sessioni di collaudo sono quelli ammessi al regolamento presso i sistemi Euroclear e Clearstream, negoziati sul mercato EuroMOT e altresì ammessi al sistema X-TRM. Qualora un utente avesse la necessità di utilizzare un particolare codice ISIN, dovrà richiedere all'ufficio HDE all'indirizzo di posta elettronica helpdesk@montetitoli.it il censimento in anagrafe.

3.2 Anagrafica controparti

Il collaudo è aperto a tutti i partecipanti RRG. D'ufficio sono ammesse al test quelle che già operano nel mercato EuroMOT e che hanno firmato la PoA di Monte Titoli con i sistemi di regolamento esteri. Per i partecipanti al collaudo verrà predisposta la configurazione anagrafica dei codici conto e dei BIC Code utilizzati in ambiente di produzione. Coloro che, per l'ambiente di collaudo, volessero utilizzare dei codici conto nonché un BIC Code diverso o coloro che non aderiscono a EuroMOT ma intendono effettuare i test, dovranno produrre la seguente documentazione:

1. per EUROCLEAR:
 - a. Gli utenti dovranno compilare ed inoltrare allo stesso il form "RG 466 – EUROCLEAR SWIFT TESTING ENVIRONMENT (allegato 1)" con i seguenti dati obbligatori:
 - i. Company name, Account Number, Swift BIC, Swift "test" BIC, Contact person for testing, Telephone, Fax e e-mail;
2. per CLEARSTREAM:
 - a. Nessuna documentazione in quanto nel loro ambiente di collaudo non è previsto il trattamento automatico del messaggio e la relativa contabilizzazione.

Si consiglia, per lo scambio delle chiavi l'utilizzo della "Manual Key" per evitare un ulteriore scambio bilaterale di chiavi.

Copia della suddetta documentazione dovrà essere inoltrata anche a Monte Titoli all'indirizzo di posta elettronica helpdesk@montetitoli.it.

3.3 Verifiche del collaudo

Nel corso delle sessioni di collaudo, invitiamo tutti gli operatori a svolgere le seguenti attività:

- verifica del contenuto delle mappe 3270, dei tracciati LU6.2 ed RNI per la gestione delle operazioni fuori mercato e la relativa informativa per le operazioni di propria pertinenza;
- verifica della coerenza dei messaggi SWIFT ricevuti da Euroclear e Clearstream con l'informativa ricevuta dal sistema X-TRM e le evidenze interne di ogni operatore.

Facciamo presente che non c'è la gestione dei "fail" in quanto i contratti non vanno al regolamento Express II ma ai sistemi esteri Euroclear e Clearstream.

4. ESITO DEI COLLAUDI

Al termine delle sessioni di collaudo del servizio X-TRM, ciascun partecipante dovrà predisporre un documento dove auto certificherà che i test hanno loro consentito di verificare la correttezza di tutte le funzionalità previste. Tale documento dovrà essere inviato tramite fax al servizio HDE Monte Titoli al numero 02 33635561 oppure tramite e-mail helpdesk@montetitoli.it.

5. MODALITA' TECNICO OPERATIVE PER I COLLAUDI

5.1 Date dei collaudi

- Dal 20/6/2005, disponibilità del sistema X-TRM in ambiente di collaudo ed avvio dei test con la partecipazione degli utenti ai quali sarà richiesto un contributo fattivo e continuativo.

5.2 Personale di riferimento

- Per tutti gli aspetti inerenti al servizio X-TRM, Vi invitiamo a contattare Monte Titoli all'indirizzo di posta elettronica: helpdesk@montetitoli.it, oppure all'indirizzo helpdesk.settlement@montetitoli.it, al numero di telefax 02 33635561 al numero verde 800 188 810

5.3 Ambienti di collaudo

Gli ambienti di collaudo utilizzati per il nuovo servizio X-TRM sono gli usuali ambienti di collaudo esterno PI.

L'ambiente di test relativo al servizio X-TRM sarà disponibile secondo i seguenti orari:

Servizio X - TRM:

- dalle 10.00 alle 16.00;
 - ✓ ore 10.00: apertura servizio
 - ✓ ore 15.00: I cut off
 - ✓ ore 15.30: II cut off
 - ✓ ore 16.00: chiusura del servizio

5.4 Documentazione

Dal **23 maggio 2005** sarà disponibile il Piano delle Prove sul sito di Monte Titoli (<http://www.montetitoli.it>). Per quanto riguarda il servizio X-TRM si segnala che i documenti di riferimento sono già pubblicati nell'apposita sezione del sito dedicata alla documentazione tecnica:

1. RRG/NET – Tracciati utente modalità RNI - vers. del 31-01-2005
2. RRG/NET – Tracciati utente modalità LU6.2 - vers. del 31-01-2005
3. RRG – Tracciati utente modalità SWIFT - vers. del 31-01-2005