

Offenmarktgeschäfte

Testinformationen

(Kreditgeschäft in Euro, Kreditgeschäft in Fremdwährung, Termineinlagen)

1. Testgrundsätze
2. Testfälle
3. Monitoring der Geschäfte
 - 3.1. Pool Overview
 - 3.2. Collateral
 - 3.3. Exposure

1. Testgrundsätze

Testscenario und Grundannahmen

- 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 werden durch die Deutsche Bundesbank erfasst.
- Die Überprüfung der Zahlungen in CLM sollte an den Valuta- und Fälligkeits-Tagen durchgeführt werden, ist aber im Nachgang auch noch möglich.
- Für die Abwicklung der Termineinlagen sowie für die Fälligkeit der Kreditgeschäfte in Euro ist durch die Geschäftspartner für **ausreichende Liquidität in CLM** zu sorgen.
- Geschäftspartner können auf der Zahlungsseite TARGET incl. CLM von ihrem Kopfinstitut abhängig sein, sofern die Liquiditätssteuerung auf dem MCA diesem Institut übertragen wurde. Diese Einheiten müssen dann auch (analog zu den aktuellen produktiven Prozessen) für die Disponierung der Liquidität sorgen. Bitte wenden Sie sich bei benötigter Disponierung an Ihren Co-Manager.
- Für die Fälligkeit der Offenmarktgeschäfte in Fremdwährung ist durch die jeweiligen Geschäftspartner nichts zu veranlassen.
- 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-nsd@bundesbank.de

1. Testgrundsätze

Über die Links erhalten Sie weiterführende Informationen zu ECMS:

[- Schulungs- und Begleitmaterial| Deutsche Bundesbank](#)

[- Eurosystem Collateral Management System](#)

[- ECMS User Handbook for Counterparties \(europa.eu\)](#)

2. Testfälle

Grundsätzlich können wir folgende Testfälle zur Verfügung stellen:

- Hereinnahme von Termineinlagen (ECMS_TC_CPTY 17-18)
- Offenmarktgeschäft in Fremdwährung (ECMS_TC_CPTY 15-16)
- Längerfristiges Refinanzierungsgeschäft (ECMS_TC_CPTY 13-14)
- Hauptrefinanzierungsgeschäft
- Für die Testdurchführung zu den Offenmarktgeschäften benötigen Sie die Rollen Nr. 65 (ECMS Entity – U2A Open Market Operations Read Only) und Nr. 72 (ECMS Entity - U2A Pool Position Execution).

Test case ID	Domain	Functionality	Test case name
ECMS_TC_CPTY_13	Monetary Policy Operations	Liquidity providing operations	Successful settlement of a LTRO operation with or without netting
ECMS_TC_CPTY_14	Monetary Policy Operations	Liquidity providing operations	Successful repayment of a LTRO operation at maturity with or without netting
ECMS_TC_CPTY_15	Monetary Policy Operations	Liquidity providing operations	Successful settlement of a non-euro LPO operation with or without netting
ECMS_TC_CPTY_16	Monetary Policy Operations	Liquidity providing operations	Successful repayment of a non-euro LPO operation at maturity with or without netting
ECMS_TC_CPTY_17	Monetary Policy Operations	Liquidity absorbing operations	Successful settlement of a LAO operation with or without netting
ECMS_TC_CPTY_18	Monetary Policy Operations	Liquidity absorbing operations	Successful repayment of a LAO operation at maturity with or without netting

3. Monitoring der Geschäfte

3. Monitoring der Geschäfte

Testfälle zur Prüfung der Offenmarktgeschäfte

Testaktivitäten zur Prüfung :

Zu 3.1. Pool Overview

- Bitte prüfen Sie, ob das gebuchte Geschäft mit dem zugeteilten Volumen und dem berechneten Zins in der Poolübersicht zu sehen ist.

Zu 3.2. Collateral

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

Zu 3.3. Exposure

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

Die Überprüfung der Zahlungen in CLM soll an den Abwicklungs- und Fälligkeitstagen durchgeführt werden, ist aber im Nachgang auch noch möglich.

3. Monitoring der Geschäfte

Testfälle zur Prüfung der Offenmarktgeschäfte

Zusätzliche Testaktivitäten:

Zu 3.2. Collateral

- 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“ >> Klick auf Button „View“

Pool overview

Pool Overview

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

			SCP Pool			SCP Pool			ELA Pool								
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
POOL00000000...	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

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

4,658,453,836.5

Relative Credit Limit

Total Collateral affected to OMO

1,919,821.88

Total Collateral Value

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

919,793.97

Total Non-Euro LPO Margin

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:

- 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 Spitzenrefinanzierungsfazität
SCL	Aktuelle Kreditlinie

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.6.1.1.

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)

- Um die Ansicht im nachfolgenden Screenshot aufzurufen, müssen Sie im Screen „Pool Overview“ auf den Button „FTD Positions“ klicken.

Pool Id	Counterparty	Actual Position	Provisional Position	Conservative Position
POOL0000000000		0	0	0

- Auch nicht sicherheitsrelevante Termineinlagen werden ausgewiesen.

Weitere Informationen zu den Feldern finden Sie im UHB unter Kapitel 3.6.1.1.

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

Feld	Erläuterung
Total Non Euro LPO	Summe der Nominale für alle Non-Euro Geschäfte in Euro
Total Non Euro LPO Margin	Margin für alle Non-Euro Geschäfte in Euro
Total Non Euro LPO Interest	Angefallene Zinsen für die ausgewiesenen Non-Euro Geschäfte in Euro

3. Monitoring der Geschäfte

3.1. Pool Overview

Testaktivitäten zur Prüfung:

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. Collateral

Modul: Collateral and Credit

Screen: Collateral >> Fixed Term Deposit >> Display FTD Operation >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Fixed Term Deposit“ >> Klick auf Button „View“

Search Criteria : Fixed Term Deposit

Internal Reference ID == OMORefNo == FTD Identifier ==

Bidder Id == Pool Identifier == Allotment Date ==

Settlement Date == Maturity Date == Used As Collateral ==

Allotment Status 0 U2A == Update Date ==

Search Result : Fixed Term Deposit

OMORefNo	Internal Refer...	FTD Identifier...	Bidder Id	Pool Identif...	Segregated O...	Nominal	Currency	Allotment Dat...	Settlement D...	Maturity Date	Used As Colla...	Interest Rate	Accrued Inter...	Last Interest	Next Interest	Allotment Sta...	Status Reaso...	Update Date	Update
20240170	DEFT0240525...	DEXSWF2400...		POOL0000000...	FTD	3,000,000	EUR	25/06/2024	25/06/2024	27/06/2024	No	2.5	0	27/06/2024		Pending Clo...		26/06/2024 19...	
20240046	DEFT0240528...	DEXSWF2400...		POOL0000000...	FTD	2,300,000	EUR	28/05/2024	28/05/2024	05/06/2024	Yes	3.75				Rejected		29/05/2024 10...	
20230531	DEFT0240515...	DEFBZM2400...		POOL0000000...	FTD	5,000,000	EUR	15/05/2024	16/05/2024	17/05/2024	No	3	0	17/05/2024		Closed		24/05/2024 11...	
20230535	DEFT0240516...	DEOOR02400...		POOL0000000...	FTD	10,000,000	EUR	16/05/2024	16/05/2024	17/05/2024	No	5	0	17/05/2024		Closed		23/05/2024 20...	
20230534	DEFT0240515...	DEQJFA24002...		POOL0000000...	FTD	1,000,000	EUR	15/05/2024	17/05/2024	22/05/2024	No	1	0	21/05/2024	22/05/2024	Closed		21/05/2024 11...	
20230507	DEFT0240424...			POOL0000000...	FTD	2,400,000	EUR	28/03/2024	28/03/2024	03/05/2024	Yes	-0.022917	0	03/05/2024		Closed		02/05/2024 19...	
20230506	DEFT0240424...			POOL0000000...	FTD	1,000,000	EUR	28/03/2024	28/03/2024	03/05/2024	Yes	0.1	100	03/05/2024		Closed		02/05/2024 19...	
20240001	DEFT0240424...	DENPVX24000...		POOL0000000...	FTD	5,000,000	EUR	24/04/2024	24/04/2024	26/04/2024	Yes	1	277.78	26/04/2024		Closed		25/04/2024 19...	

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Search Result : Fixed Term Deposit > View : Fixed Term Deposit

History

Operations Details

OMOREfNo 20230531	Revision 1	Transaction Type Fixed-Term Deposits
Operation Name Fine-tuning	Operation Type Liquidity Absorbing	Procedure Quick Tender
Auction Type Fixed Rate Tender	All Method	Business Value Type RATE
Quotation	Reference Entity	Allotment Date 15/05/2024
Maturity Date 17/05/2024	Settlement Date 16/05/2024	Duration in Days 1
Spread 0	Segregated Operation Type FTD	

Allotment Details

Internal Reference ID DEFTD24051500247	Bidder Id	NCB Identifier ED06999
Pool Identifier POOL00000000	Nominal 5,000,000	Currency EUR
FTD Identifier DEFBZM240010008	Used As Collateral No	Bids [1]

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Modul: Collateral and Credit

Screen: Display FTD Operation >> Nach unten scrollen >> Klick auf Button „Movements Details“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Exposure Movement“ >> Klick auf Button „View“

Amounts in EUR					
Provisional Interest in EUR	416.67	Provisional Maturity Amount in EUR	5,000,416.67	Outstanding Amount in EURO	5,000,000

Interest Details		
Reference Rate	Interest Rate	Accrued Interest
---	3	0
Is Different Accounting Rate	Accounting Rate	Accrued Accounting Interest
No		416.67
Trans Fee Amount	Last Interest Calculation Date	Next Interest Calculation Date
	17/05/2024	

Status Details		
Allotment Status	Status Reason	Is Amended
Closed		No
Action To Validate	U2A	Business Validation Errors (0)
	Yes	

Payment Details
Movements Details

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Search Result : Exposure Movement

10



Pool Movement ID	Main Reference	Counterparty	Pool Identifier	Amount	Pool Variation	Intended Settlement	Event Description	Collateral Insufficie	Absolut Credit Limi	Netting Indicator	Netting Reference	Movement Status	Update User Id	Update Date	Movement Type	Is From Migration
PMLDE	20230531		POOL0000000	0		17/05/2024	Accrued interest on ...	No	No	Yes	DENET24051770014...	Settled		16/05/2024 19:19:59...	Interest	No
PMLDE	20230531		POOL0000000	5,000,000		16/05/2024	Fixed Term Deposit ...	No	No	Yes	DENET24051650015...	Settled		15/05/2024 19:34:14...	Fixed Term Deposit	No
PMLDE	20230531		POOL0000000	5,000,000		17/05/2024	Fixed Term Deposit ...	No	No	Yes	DENET24051770014...	Settled		16/05/2024 19:19:56...	Fixed Term Deposit	No
PMLDE	20230531		POOL0000000	416.67		17/05/2024	Accrued interest on ...	No	No	No		Settled		16/05/2024 19:13:12...	Interest	No

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Erläuterungen:

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

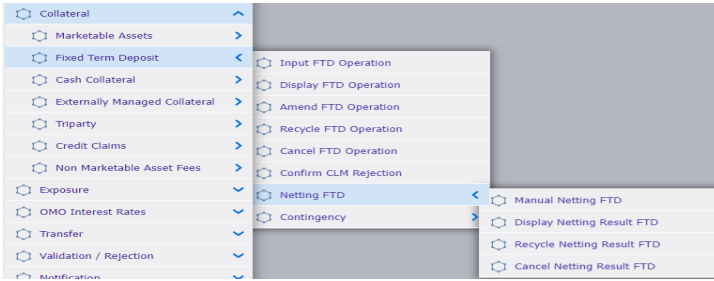
Feld	Erläuterung
Provisional Interest	Vorläufige Berechnung der endfälligen Zinszahlungen
Outstanding Accrued Interest	Bisher angefallene Zinsen
Total Accounting Interest	Buchhalterisch angefallene Zinsen zum Ende der Laufzeit
Amount prepared for Accounting	Bisher buchhalterisch angefallene Zinsen

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Modul: Collateral and Credit

Screen: Collateral >> Fixed Term Deposit >> Netting FTD >> „Display Netting Result FTD“ >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Netting Result“ >> Klick auf Button „View“



Display Netting Result FTD

Search Criteria : Netting Result

Transaction Reference Number: --, Counterparty: --, Pool Identifier: --, Netting Currency: --, Netting Date: --, Netting Status: --, 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
			-2,000,000	0	EUR	888.89	23/09/2024		Settled	23/09/2024 02:31:01:039	
			2,000,000	0	EUR	0	19/09/2024		Settled	19/09/2024 12:08:41:388	
			2,000,000	0	EUR	0	18/09/2024		Settled	18/09/2024 12:10:38:642	
			-1,500,000	0	EUR	208.34	18/09/2024		Settled	17/09/2024 20:00:45:294	
			1,500,000	0	EUR	0	16/09/2024		Settled	16/09/2024 02:31:08:117	
			-3,000,000	0	EUR	1,999.99	12/09/2024		Waiting T2Response	11/09/2024 19:44:11:232	
			-1,500,000	0	EUR	1,125	12/09/2024		Waiting T2Response	11/09/2024 19:44:09:822	
			3,000,000	0	EUR	0	06/09/2024		Settled	06/09/2024 09:40:58:367	
			1,500,000	0	EUR	0	06/09/2024		Settled	06/09/2024 09:40:56:840	
			3,000,000	0	EUR	0	06/09/2024		Settled	06/09/2024 09:40:56:840	

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Display Netting Result FTD

Search Criteria : Netting Result

Search Result : Netting Result > View : Netting Result

Transaction Reference Number	Pool Identifier	Counterparty RIAD Code
Amount	Margin Amount	Interest Amount
-2,000,000	0	888.89
Netting Currency	Netting Date	Netting Setup
EUR	23/09/2024	
Netting Status	Error Description	
Settled		

Movements Details

Netting Movement	Netting Interest Movement	Margin Movement
PMLDE00000	PMLDE00000

Netting Details

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

FootPrint

3. Monitoring der Geschäfte

3.2. Collateral

Testaktivitäten zur Prüfung:

Prüfung zu 3.2. Collateral:

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

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> Open Market Operations >> Operations >> Display OMO Instruction >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Allotment“ >> Klick auf Button „View“

The screenshot shows the target ECMS interface. On the left, a navigation menu is open, highlighting 'Operations' and its sub-items: 'Display OMO Instruction', 'Early Repayment', and 'TLTRO3 Process'. The main area displays the 'Display OMO Instruction' screen with search criteria for 'Allotment'. Below the search criteria, a table shows the search results for 'Allotment'.

OMORefNo	Internal Refer.	MP Operation	Segregated O.	Pool Identif.	Bidder Id	Allotment Dat.	Settlement D.	Maturity Date	Nominal	Initial Margin	Currency	FX Rate	FX Currency	FX Amount	Is Interest R.	Interest Rate	Spread	Accrued Inter.	Last Interest	Next Interest	Allotment Stat.	Status Reason	Update Date	Update User
20234029	DELPO240404	MRO	...	POOL0000000...	...	04/04/2024	05/04/2024	08/04/2024	2,900,000	...	EUR	Yes	4	0	0	05/04/2024	Valenced	Pending	04/04/2024 1...	...	
20234028	DELPO240404	MRO	...	POOL0000000...	...	04/04/2024	05/04/2024	11/04/2024	2,900,000	...	EUR	Yes	4.5	0	0	05/04/2024	Valenced	Pending	04/04/2024 1...	...	
20234026	DELPO240404	LTRO	...	POOL0000000...	...	04/04/2024	04/04/2024	08/04/2024	3,000,000	...	EUR	Yes	4.5	0.1	383.33	05/04/2024	08/04/2024	Settled		04/04/2024 1...	...
20234020	DELPO240221	MRO	...	POOL0000000...	...	21/03/2024	21/03/2024	27/03/2024	2,900,000	...	EUR	Yes	4	0	0	22/03/2024	Valenced	Pending	21/03/2024 1...	...	
20234002	DELPO240311	LTRO	...	POOL0000000...	...	11/03/2024	12/03/2024	13/03/2024	2,900,000	...	EUR	Yes	4.68	0	325	13/03/2024		Closed		12/03/2024 1...	...
20234001	DELPO240311	LTRO	...	POOL0000000...	...	11/03/2024	11/03/2024	13/03/2024	5,000,000	...	EUR	Yes	4.5	0.1	766.67	13/03/2024		Closed		12/03/2024 1...	...
20230212	DELPO240228	TLTRO-II	...	POOL0000000...	...	28/08/2023	30/08/2023	29/03/2024	1,000,000	...	EUR	Yes	4.996667	0	25,769.35	28/03/2024	02/04/2024	Settled		27/03/2024 1...	...
20230212	DELPO240228	TLTRO-II	...	POOL0000000...	...	28/08/2023	30/08/2023	29/03/2024	4,900,000	...	EUR	Yes	4.996667	0	115,962.08	28/03/2024	02/04/2024	Settled		27/03/2024 1...	...
20230424	DELPO240228	MRO	...	POOL0000000...	...	07/02/2024	07/02/2024	28/02/2024	1,100,000	...	EUR	Yes	0	0	0	28/02/2024		Closed		28/02/2024 1...	...
20230410	DELPO240228	MRO	...	POOL0000000...	...	23/01/2024	31/01/2024	04/03/2024	1,100,000	...	EUR	Yes	0	0	0	04/03/2024		Closed		04/03/2024 0...	...

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Search result: Allotment > View - Allotment

Operation Details		
OutID/RefID 2024002	Revision	Procedure Standard Transfer
Operation Name Leasingrate Refinancing	Original Operation Name LTRB	Operation Type Liquidy Financing
Transaction Type Reverse Transactions	Auction Type Fixed Rate Tender	All Method
Reference Entity Average MBO rate	Business Value Type	Question
Settlement Date 04/04/2024	Settlement Date 04/04/2024	Maturity Date 08/04/2024
Original Settlement Date	Original Termination Date	Duration In Days
Currency EUR	FX Currency	FX Rate
MF Operation Type LTRB		

Allotment Details		
Internal Reference ID DELPOI4H4002408	Score In [redacted]	Pool Identifier [redacted]
NCB Identifier 000009	Nominal 3,000,000	FX Amount
Allotment Status Settled	Status Reason	Provisionary Collateral Insufficiency No
Eligible to Early Repayment Yes	Is Partially Reimbursed No	Is Fully Early Repaid No
		Instruction Status Activated

Operation Amounts In EUR

Operation Amounts In EUR		
Initial Margin	Provisional Interest In EUR	3,633.33
Externally Covered Amount	Reimbursed Amount In EUR	0
	Provisional Maturity Amount In EUR	3,091,633.33
	Outstanding Amount In EUR	3,090,000

Amounts In Currency		
Provisional Interest in currency	Provisional Maturity Amount in Currency	Reimbursed Amount in Currency
		0
Outstanding Amount in Currency		

Interest		
Reference Rate ECB Main refinancing operations	Days Base Actual On 360	Interest Rate 4.5
Accrued Interest	Spread	Accrued Interest In Currency 0.3
Externally Covered Interest	Is Interest Rate Capped No	Accounting Rate
Accrued Accounting Interest	Is Different Accounting Rate No	Accrued Accounting Interest Currency
Last Interest Calculation Date 08/04/2024	Next Interest Calculation Date 08/04/2024	Next Renovation Date

Payments Details		
Microments Details		

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Modul: Collateral and Credit

Screen: Display OMO Instruction >> Nach unten scrollen >> Klick auf Button „Movements Details“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Exposure Movement“ >> Klick auf Button „View“

Search Result : Exposure Movement

Pool Movement ID	Main Reference	Counterparty	Pool Identifier	Amount	Pool Variation	Intended Settlement Date	Event Description	Collateral Insufficiency	Absolute Credit Limit Breac...	Netting Indicator	Netting Reference	Movement Status	Update User Id	Update Date	Movement Type
PMLDEI	20240026			1.533.33		08/04/2024	Credit Operation Interest	No	No	No		Prepared		04/04/2024 19:12:57.789	Interest
PMLDEI	20240026			3.000.000		04/04/2024	Credit Operation Settlement	No	No	No	DENET24040410002001	Settled		04/04/2024 12:02:41.874	Cash
PMLDEI	20240026			983.33	-983.33	05/04/2024	Credit Operation Interest	No	No	No		Settled		04/04/2024 19:19:43.674	Interest

Search Result : Exposure Movement > View : Credit Operation Settlement Movement History

MOVEMENT DETAILS

Counterparty	Pool Identifier	Pool Movement ID
██████████	██████████	PMLDEI
Main Reference	Amount	Mvt Currency
20240026	3.000.000	EUR
Counterparty's MCA	CLM CB Account	Real Settlement Date
BEGOD	MARKDEFFCMS	04/04/2024
Intended Settlement Date	Value Update Reason	MP Operation Type
04/04/2024	Exposure Initiation	LTRO

STATUS DETAILS

Instruction Status	Is Valuated	Collateral Insufficiency
Settled	No	No

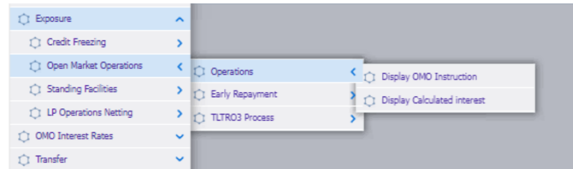
FootPrint

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> Open Market Operations >> Operations >> Display Calculated Interest >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Calculated Interest“ >> Klick auf Button „View“



Search Criteria : Calculated Interest

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

Creation Date == Update Date ==

Search Result : Calculated Interest

10 Page 1 of 5

Internal Refer.	Counterparty	Date	Transaction Ty.	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...	
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...	
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...	
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...	
DEFTD240111...		15/01/2024	Interest CalcuL...	388.89		388.89		291.67						3.5	388.89		291.67		15/01/2024 11...	
DEFTD240111...		12/01/2024	Interest CalcuL...	388.89		97.22		97.22						3.5	97.22		97.22		12/01/2024 09...	
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...	
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...	
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...	

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Erläuterungen:

- Um die berechneten Zinsen einem Tender zuordnen zu können benötigen Sie die „Internal Reference ID“ aus dem „Display OMO Instruction Screen“ (siehe Seite 25)
- 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

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. 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

3.3. Exposure

Testaktivitäten zur Prüfung:

Prüfung zu 3.3. Exposure:

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

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure

Beispielberechnung der Zinsen für LTRO

	11.10.2024	12.10.2024	13.10.2024	14.10.2024	15.10.2024	16.10.2024	17.10.2024
	Freitag	Samstag	Sonntag	Montag	Dienstag	Mittwoch	Donnerstag
Tage	Tag 1	Tag 2	Tag 3	Tag 4	Tag 5	Tag 6	Tag 7
Laufzeit: 6 Tage	2.000.000,00						
Für diesen Vortag angefallene Zinsen	0	202,78	202,78	202,78	202,78	222,22	222,22
Im System für diesen Tag gültige Leitzins	3,65	3,65	3,65	3,65	4	4	4
gewichteter Durchschnittssatz für die Berechnung der angefallene Zinsen		3,65	3,65	3,65	3,65	3,72	3,76666667
Spread	0	0	0	0	0	0	0
bisher angefallene Zinsen	0	202,78	405,56	608,33	811,11	1.033,33	1.255,56

Mittelwert aus den gültigen Leitzinsen von Tag 1-7

Berechnung des Zinsbetrages für Tag 6: $2.000.000 * 3,376666667 * 6 / 36000$

Berechnung des Zinsbetrages für Tag 5: $2.000.000 * 3,72 * 5 / 36000$

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure (Netting)

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> LP Operations Netting >> „Display Netting Result LPO“ >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Netting Result“ >> Klick auf Button „View“

Search Criteria : Netting Result

Transaction Reference Number: Counterparty: Pool Identifier:

Netting Currency: Netting Date: Creation Date:

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 + LTRO	Settled	12/01/2024 02:26:21:996	
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 + LTRO	Settled	09/01/2024 19:15:58:090	
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 + LTRO	Settled	17/11/2023 10:50:45:870	
DENET	POOL	DE	1,000,000	0	EUR	0	15/11/2023	MRO + LTRO	Settled	15/11/2023 08:02:36:970	
DENET	POOL	DE	2,000,000	0	EUR	0	14/11/2023	MRO + LTRO	Settled	14/11/2023 10:00:41:152	
DENET	POOL	DE	1,500,000	0	EUR	0	25/10/2023		Settled	24/10/2023 19:17:07:033	
DENET	POOL	DE	2,000,000	0	EUR	0	29/09/2023	MRO + LTRO	Settled	29/09/2023 15:11:47:547	

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure (Netting)

Search Result : Netting Result > View : Netting Result History ^

Transaction Reference Number DENET2401127	Pool Identifier POOL000000	Counterparty RIAD Code
Amount -3,000,000	Margin Amount 0	Interest Amount 361.11
Netting Currency EUR	Netting Date 12/01/2024	Netting Setup MIRO + LIRO
Netting Status Settled	Error Description	

Movements Details ^

Netting Movement PMLDE000	Netting Interest Movement PMLDE00	Margin Movement -
------------------------------	--------------------------------------	----------------------

Netting Details ^

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

FootPrint v

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. 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 3.4.3.1.13.2

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure (Netting)

Modul: Collateral and Credit

Screen: Exposure >> LP Operations Netting >> „Display Netting Result LPO“ >> Klick auf Button „Search“ >> Klick auf Datensatz in „Search Result: Netting Result“ >> Klick auf Button „View“ >> Klick auf Button „Settling Operation“

Internal Referenc...	Pool Identifier	OMORefNo	Accrued Interest	Fx Amount	Outstanding Amo...	Contract Currency	Fx Currency	Instruction Status	Used As Collatera...	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:...		
DELPO	POOL	20230180	0		0	EUR	Closed	Yes	No	09/01/2024 14:34:...	12/01/2024 02:26:...		

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. 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 3.4.3.1.13.2

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure (Netting)

Zusätzliche Testaktivitäten:

Zusätzliche Prüfung zu 3.3. Exposure:

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

3. Monitoring der Geschäfte

3.3. Exposure (Netting)

- Beispiel für das Netting in ECMS

Montag, 07. Oktober		Dienstag, 08. Oktober	Netting für den 08. Oktober	Mittwoch, 09. Oktober	Netting für den 09. Oktober	Donnerstag, 10. Oktober	Netting für den 10. Oktober	Freitag, 11. Oktober	Netting für den 11. Oktober
		MRO Valuta	+1,5 Mio	USD 1 Valuta	+5,5 Mio	FTD Valuta	-2 Mio	MRO Fälligkeit	-1,5 Mio
							2 Mio Buchung von Ihrem Konto auf CLM	LTRO Valuta	+2 Mio
			1,5 Mio Buchung auf Ihr Konto auf CLM		+5,5 Mio gesperrte Sicherheiten	USD 2 Valuta	+5,5 Mio		
							+5,5 Mio gesperrte Sicherheiten		0,5 Mio Buchung auf Ihr Konto in CLM
Montag, 14. Oktober	Netting für den 14. Oktober	Dienstag, 15. Oktober	Netting für den 15. Oktober	Mittwoch, 16. Oktober		Donnerstag, 17. Oktober	Netting für den 17. Oktober	Freitag, 18. Oktober	
USD 2 Fälligkeit	-5,5 Mio	FTD Fälligkeit	+2 Mio			LTRO Fälligkeit	-2 Mio		
							2 Mio Buchung von Ihrem Konto in CLM		
						USD 1 Fälligkeit	-5,5 Mio		
	-5,5 Mio gesperrte Sicherheiten		2 Mio Buchung auf Ihr Konto in CLM				-5,5 Mio gesperrte Sicherheiten		