

Migrazione ad Optiq – Linee Guida Test Clienti – Euronext Clearing



Migrazione ad Optiq – Linee guida Test Clienti

Numero revisione / Numero versione
1.0

Data
24 Ottobre 2022

Numero di pagine
6

Autore
Euronext Clearing

Obiettivo del documento

Lo scopo di questo documento è quello di fornire ai membri di Euronext Clearing alcune linee guida per la fase di test della Fase 1 della Migrazione Optiq (relativa ad Equity ed ETF). Poiché tutte le modifiche tecniche della Fase 1 non hanno un impatto diretto sul Clearing System o su BCS, il presente documento include i test di non regressione consigliati da eseguire su report e funzionalità principali, oltre ai test end-to-end richiesti per verificare la corretta la ricezione in clearing dei contratti e delle cancellazioni.

Destinatari del documento

Il documento è indirizzato a tutti i partecipanti ad Euronext Clearing.

Versioni del Documento

Versione	Data	Descrizione delle modifiche
1.0	24/10/2022	Linee guida per Test Clienti per Fase 1 della migrazione ad Optiq

Copyright Information

This document is for information purposes only. The information and materials contained in this document are provided 'as is' and Euronext does not warrant the accuracy, adequacy or completeness and expressly disclaims liability for any errors or omissions. This document is not intended to be, and shall not constitute in any way a binding or legal agreement, or impose any legal obligation on Euronext. This document and any contents thereof, as well as any prior or subsequent information exchanged with Euronext in relation to the subject matter of this presentation, are confidential and are for the sole attention of the intended recipient. Except as described below, all proprietary rights and interest in or connected with this publication shall vest in Euronext. No part of it may be redistributed or reproduced without the prior written permission of Euronext. Portions of this presentation may contain materials or information copyrighted, trademarked or otherwise owned by a third party. No permission to use these third party materials should be inferred from this presentation.

Euronext refers to Euronext N.V. and its affiliates. Information regarding trademarks and intellectual property rights of Euronext is located at <https://www.euronext.com/terms-use>.

© 2022 Euronext N.V. - All rights reserved.

Indice

Obiettivo del documento	2
Indice	2
Prerequisiti.....	3
1.1 Ambiente di test e requisiti	3
Strategia di Test – linee guida.....	3
2.1 Test Clienti Fase 1 (Cash Equities e ETFs).....	3
2.1.1 <i>Obiettivo dei test</i>	3
2.1.2 <i>Test referential data</i>	4
Monitoraggio avanzamento test	5
3.1 Client Readiness.....	5

Prerequisiti

1.1 Ambiente di test e requisiti

L'ambiente da utilizzare per i test sarà **CDS**. I partecipanti potranno scaricare i report di fine giornata attraverso i consueti canali disponibili per l'ambiente di test EUA (BCS, ICWS o SFTP, a seconda dei casi), tramite le utenze esistenti già rilasciate in ambiente EUA. Nel caso in cui fosse necessario reimpostare la password delle utenze BCS esistenti in ambiente EUA, i Clearing Member possono fare riferimento al nostro client-support@euronext.com; mentre per gli utenti ICWS o SFTP si faccia riferimento al nostro Tech Support Team: ccp-techsupport@euronext.com. Per richiedere nuove utenze BCS, ICWS o SFTP nell'ambiente EUA, i Clearing Member possono inviare un'e-mail a ccp-membership@euronext.com.

Strategia di Test – linee guida

2.1 Test Clienti Fase 1 (Cash Equities e ETFs)

Questo paragrafo descrive sia i test richiesti (sul routing dei contratti) sia quelli suggeriti (test di non regressione su report e funzionalità).

2.1.1 Obiettivo dei test

Una descrizione di alto livello dell'obiettivo dei test è riportata nella tabella sottostante.

Tipologia	Obiettivo	OWNER
Routing dei contratti da Optiq®	Obiettivo: verificare la corretta ricezione in clearing degli inserimenti / cancellazioni dei contratti in caso di strumento garantito.	Clienti
Report – Test di non regressione	Obiettivo: verificare che le principali reportistiche di Euronext Clearing funzionino correttamente senza impatti negativi sul sistema di clearing e sui dati previsti, causati del nuovo feed. Report e Data Files da testare: <ul style="list-style-type: none"> ▪ Posizioni: <ul style="list-style-type: none"> ✓ RP-MP21 Open positions su Share Section ✓ DP21 – Open Positions su Share Section ✓ D01B – Contratti Equities ▪ Initial Margin: <ul style="list-style-type: none"> ✓ RP-MS11 Financial position ✓ DS07 – Financial Position ✓ RP-MS22 Initial Margins – Derivati Equity e Share Sections 	Clienti

	<ul style="list-style-type: none"> ✓ D15B – Derivati/Equities Net Product Group Margins ✓ RP-MS24 Initial Margins per subaccount – Derivati Equity e Share Sections ✓ D15D – Derivati/Equities Gross Product Group Margins per subaccount ✓ RP-MS00 sommario Initial Margins ✓ D15F –Total Initial Margins ✓ RP-MS27 Failed Positions Margins - Share e Equity Derivatives Sections ✓ D15E – Failed Positions Margins ✓ RP-MS42 Initial Margins calcolato separatamente per sezione ✓ D15C – Derivati/Equities Gross Product Group Margins ✓ RP-ME30 Margined fails del giorno – sezione Share e Derivati Equity ✓ D15A – Derivatives/Equities Margins - Extended ▪ Intraday Margins: <ul style="list-style-type: none"> ✓ RP-MI00 Intraday Margins summary ✓ D15I –Total Intraday Margins 	
Funzionalità BCS – test di non regressione	<p>Obiettivo: verificare che le principali funzionalità dell'interfaccia BCS, per i clienti che utilizzano il servizio, funzionino correttamente senza impatti negativi sul sistema dovuti alla nuova alimentazione.</p> <p>Funzionalità da testare:</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ Static Data: verificare che gli static data siano riportati correttamente nel sistema; ▪ Executed Trades: verificare che tutti i contratti (azioni ed ETF) siano correttamente registrati e consultabili sul sistema; ▪ Open Positions: verificare che tutte le posizioni su azioni ed ETF siano riportate correttamente nel sistema; ▪ Report: verificare che tutti i report citati nella sezione precedente siano creati correttamente e scaricabili, senza che ci sia stato un impatto negativo sui dati. 	Clienti

2.1.2 Test referential data

I dati di riferimento disponibili sull-ambiente CDS per i test saranno pubblicati sul [sito web](#) non appena l'elenco degli ISIN sarà consolidato (prima della data di apertura dei test, il 31 ottobre 2022).

Monitoraggio avanzamento test

3.1 Client Readiness

Per verificare il livello di confidenza dei Clienti per il go-live, l'avanzamento dei test verrà periodicamente monitorato tramite la distribuzione di un questionario.

3.1.1 Questionario

Il questionario sarà condiviso periodicamente e conterrà le seguenti domande:

Oggetto	DESCRIZIONE	Peso
1	È stato possibile connettersi a ICWS e visualizzare, scaricare e salvare report e data file relativi ad attività in conto proprio, di trading client e per i conti segregati?	10%
2	È stato possibile connettersi a SFTP e visualizzare, scaricare e salvare report e data file relativi ad attività in conto proprio, di trading client e per i conti segregati?	10%
3	Se applicabile, è stato possibile connettersi a BCS e visualizzare static data (e.g. lista di clearing Members, Trading Client, prodotti garantiti e Collaterale elegibile)?	10%
4	Se applicabile, è stato possibile visualizzare, scaricare e salvare i trade garantiti in conto proprio, per conto di Trading Client e per account segregate?	15%
5	È stato possibile verificare la non regressione utilizzando il FIRM-ID di riferimento per allocare i trade negli account segregati associati attivi in Euronext Clearing CCP system?	15%
6	È stato possibile ricevere le cancellazioni dei trade (eseguite da Euronext Milan) dei trade garantiti in conto proprio, per Trading Clients e per account segregati?	10%
7	<p>È stato possibile eseguire i test di non regressione per i trade garantiti in conto proprio, per Trading Client e per account segregati, sui report sotto indicati ed estratti da ICWS, SFTP e BCS:</p> <p>Posizioni:</p> <ul style="list-style-type: none"> • RP-MP21 Open positions su Share Section • DP21 – Open Positions su Share Section • D01B – Contratti Equities <p>Initial Margin:</p> <ul style="list-style-type: none"> • RP-MS11 Financial position • DS07 – Financial Position 	15%

	<ul style="list-style-type: none"> • RP-MS22 Initial Margins – Derivati Equity e Share Sections • D15B – Derivati/Equities Net Product Group Margins • RP-MS24 Initial Margins per subaccount – Derivati Equity e Share Sections • D15D – Derivati/Equities Gross Product Group Margins per subaccount • RP-MS00 sommario Initial Margins • D15F –Total Initial Margins • RP-MS27 Failed Positions Margins - Share e Equity Derivatives Sections • D15E – Failed Positions Margins • RP-MS42 Initial Margins calcolato separatamente per sezione • D15C – Derivati/Equities Gross Product Group Margins <ul style="list-style-type: none"> ○ RP-ME30 Margined fails del giorno – sezione Share e Derivati Equity • D15A – Derivatives/Equities Margins - Extended Intraday Margins: <ul style="list-style-type: none"> • RP-MI00 Intraday Margins summary • D15I –Total Intraday Margins 	
8	È stato possibile supportare i Trading Member nel processo di riconciliazione delle operazioni front-to-back (grazie al TUI e/o a qualsiasi altro criterio)?	15%