

GESTIÓN DEL EFECTIVO

XXI REUNIÓN DEL GRUPO NACIONAL DE USUARIOS DE TARGET2-SECURITIES

Madrid

6 de febrero de 2014

SISTEMAS DE PAGO



Configuración cuenta efectivo / cuenta valores.

- ❑ Para que las instrucciones de liquidación de valores liquiden su pata de efectivo se deben enlazar, en la configuración de datos estáticos de T2S, la cuenta de valores y la DCA.
- ❑ Las cuentas de valores y las cuentas de efectivo se enlazan mediante el Credit Memorandum Balance (**CMB**), que para autocolateralización con el Banco Central se denomina CMB primario.



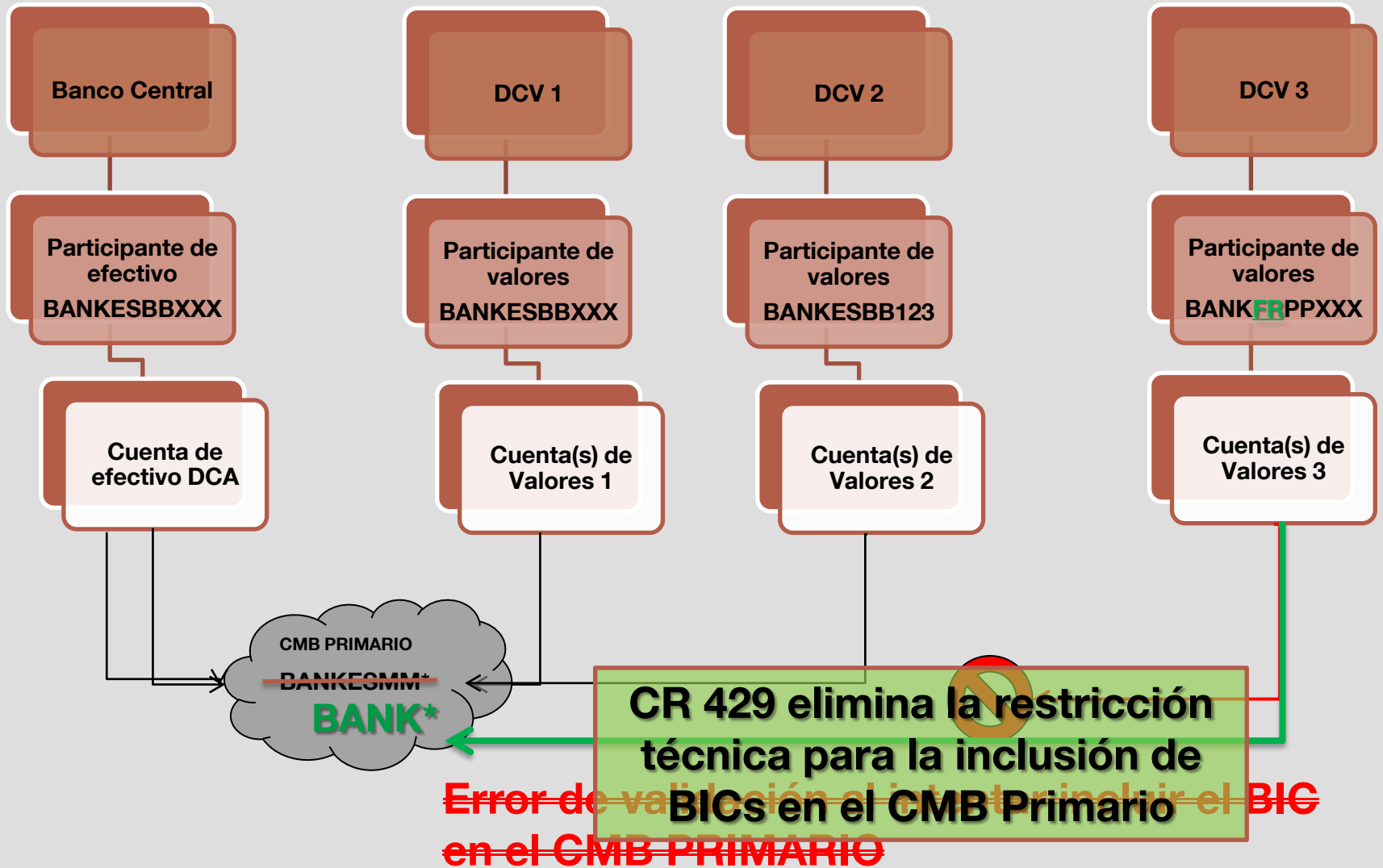
II Sesión informativa interacción T2 y T2S de 13 de noviembre de 2013:

- El participante de valores y el participante de efectivo se identifica con un BIC11.
- Cuando Banco de España configura el CMB primario, T2S valida que ~~el BIC8 del participantes de valores y el BIC8 del participante de efectivo es el mismo.~~
- ~~No es posible establecer excepciones a esta regla.~~

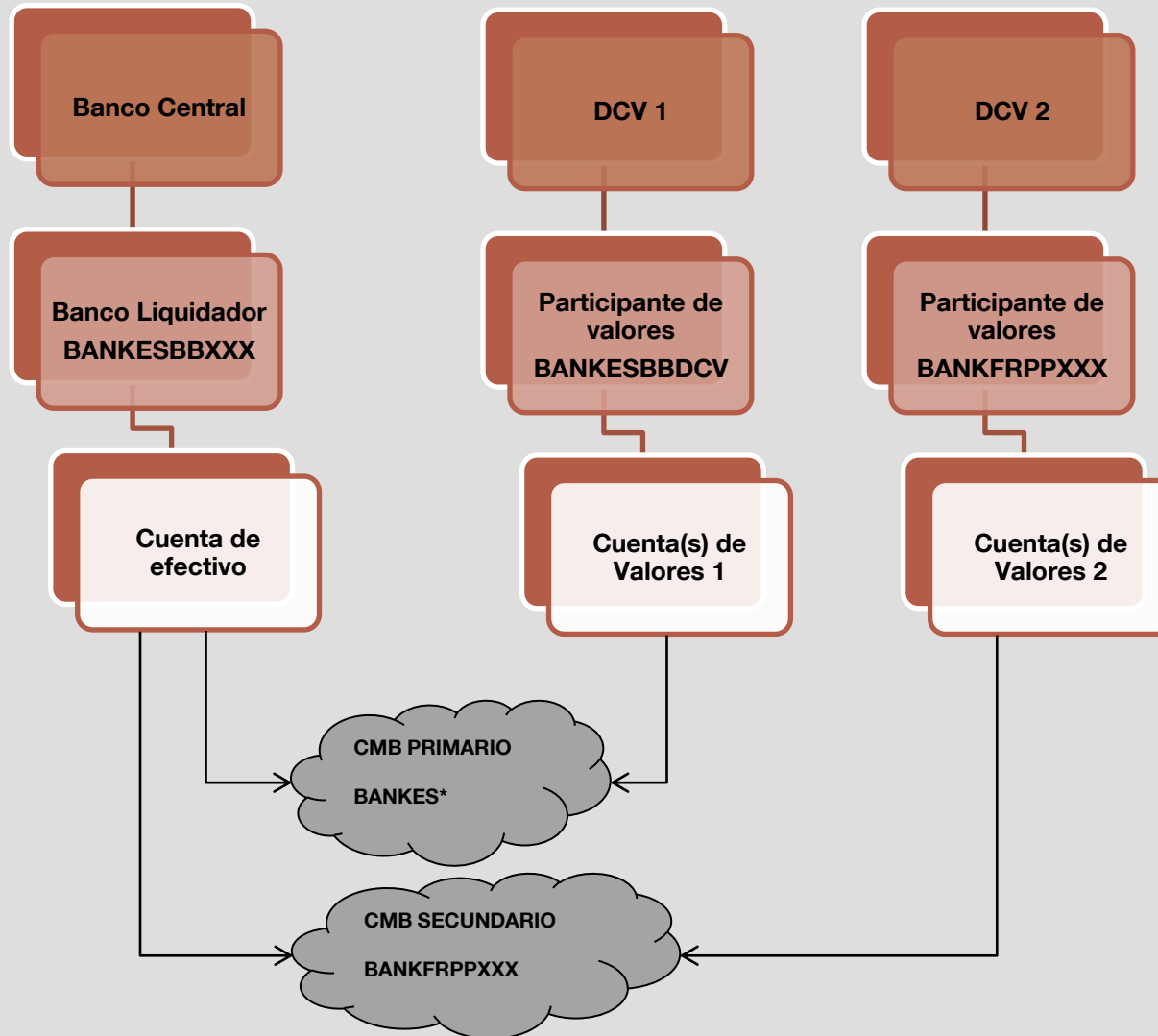
NOVEDADES

- Change Request T2S0429:** Permitirá unir una DCA con cualquier cuenta de valores (con independencia del BIC del participante de valores) a través del CMB primario.
- El Banco de España autorizará, en el CMB primario, los BIC que cumplan con los requisitos de financiación intradía.

POSIBLE CONFIGURACIÓN TÉCNICA PARA UN PARTICIPANTE DE EFECTIVO CON CUENTAS DE VALORES EN DIFERENTES DCV



CONFIGURACIÓN ALTERNATIVA PARA UN PARTICIPANTE DE EFECTIVO QUE ASOCIA DOS CUENTAS DE VALORES



MODOS DE CONEXIÓN A T2S PARA LA GESTIÓN DEL EFECTIVO



Modos de conexión

1. Proveedor de servicios de red de valor añadido (VAN NSP):

1. SWIFT
2. SIA-COLT

Permite conexión directa con T2S en modos, U2A (GUI*) y A2A.

2. Acceso a través de la interfaz de T2.

- *Servicios Comunes: transferencias liquidez: T2-> T2S*
- *Servicios de valor añadido:*
 1. transferencias liquidez T2S-> T2
 2. saldo intradía de las DCAs en el ICM
 3. ~~saldo dispuesto de autocolateral. En consulta, pendiente de aprobación~~

Además, opcionalmente, a través de los servicios de un tercero (por ejemplo una DCV).

* Graphical User Interface.



Pruebas a realizar por un Banco Liquidador

- Los participantes que opten por la conexión directa a T2S, en U2A o A2A, tendrán que realizar pruebas obligatorias de conectividad para la certificación del Eurosistema .
- Declarar el modo de conexión con antelación a las pruebas: A2A doce meses, U2A tres meses.
- Los bancos liquidadores que tenga una DCA con el Banco de España comenzarán sus pruebas al inicio de la fase de Comunidad de cada ventana.

	Ventana 1	Ventana 2	Ventana 3	Ventana 4
Modo de conexión A2A	Marzo 2014	Agosto 2014	Febrero 2015	Octubre 2015
Modo de conexión U2A	Diciembre 2014	Mayo 2015	Noviembre 2015	Julio 2016
Pruebas de comunidad	Marzo 2015	Agosto 2015	Febrero 2016	Octubre 2016