

30/05/2017

**Pruebas T2S con Banco de España.
Guía de Pruebas de Emisión de Deuda Pública.**

PROCESOS DEL MERCADO PRIMARIO y T2S

El traspaso de la plataforma CADE a la plataforma de liquidación ARCO y la conexión al sistema T2S, el próximo 18 de septiembre 2017, afectará a los principales procesos que se realizan en el Mercado de Deuda Pública en anotaciones (en adelante MDPA).

Por este motivo, se incluyen, para cada uno de estos procesos, dos documentos, uno con el correspondiente diagrama de flujos y otro, con el guion de seguimiento de las pruebas.

Para participar en estas pruebas deberán solicitarlo a través de un correo electrónico dirigido a la Unidad de Emisión de Deuda (emisiondeuda@bde.es), especificando los procesos en los que quieren tomar parte.

1.- Emisiones de Deuda Pública.

Las emisiones de la Deuda del Estado, de las Comunidades Autónomas y de otros Organismos Públicos, que son realizadas a través del Banco de España, se verán afectadas únicamente en la fase final de liquidación y anotación (diapositiva núm. 9 del diagrama de flujos).

En este proceso, aparece la figura de la Cuenta Principal de valores, como cuenta elegida por cada entidad para que se abonen en ella todos los valores que se suscriban en el mercado primario y, por consiguiente, en su cuenta de efectivo será donde se adeude toda la liquidación de su adjudicación.

Hay que destacar que los valores que se emitan se abonarán con subsaldo EEUR.

Archivo adjunto: Diagrama_flujos_emisiones.pdf 

Archivo adjunto: Pruebas_T2S_emisiones.pdf 

2.- Abono de cupones/intereses.

El Banco de España, como Agente de Pagos de todas las deudas inscritas en el MDPA, comprobará los nominales e importes netos que le sean presentados por Iberclear para el pago de los intereses de la deuda y le autorizará su abono a cada una de las cuentas de efectivo asociada a las cuentas de valores donde estén registrados.

Archivo adjunto: Diagrama_flujos_pago_cupon.pdf 

Archivo adjunto: Pruebas_T2S_pago_cupon.pdf 

3.- Devolución de la retención practicada sobre los intereses de la posición propia.

La retención (19%) practicada sobre los intereses de la posición propia será devuelta de oficio (RD 1145/2011) a la cuenta de efectivo que tenga asociada la cuenta Principal de valores. Se efectuará un único abono por el total agregado de la posición propia.

Archivo adjunto: Diagrama_flujos_devolucion_retenciones_cuenta_propia.pdf 

Archivo adjunto: Pruebas_T2S_DRD_cuenta_propia.pdf 

4.- Devolución de la retención practicada sobre los intereses de la posición de terceros.

La retención (19%) practicada sobre los intereses de la posición de terceros será devuelta, bajo petición expresa de la entidad gestora al Banco de España (RD 1145/2011), en la cuenta de efectivo que tenga la entidad en T2-BdE (cuenta RTGS). Los distintos saldos en cuentas de terceros, incluso el saldo de las cuentas Individuales, se agruparán y se solicitará de forma conjunta su devolución efectuándose de este modo un único abono.

Archivo adjunto: Diagrama_flujos_devolucion_retenciones_terceros.pdf 

Archivo adjunto: Pruebas_T2S_DRD_terceros.pdf 

5.- Amortizaciones.

El Banco de España, como Agente de Pagos de todas las deudas inscritas en el MDPA, comprobará los importes que le sean presentados por Iberclear para el pago de los nominales a amortizar y autorizará su abono a cada una de las cuentas de efectivo asociada a las cuentas de valores donde estén respectivamente registrados.

Archivo adjunto: Diagrama_flujos_amortizacion.pdf 

Archivo adjunto: Pruebas_T2S_amortizacion.pdf 