



BANCO DE ESPAÑA



COMUNICACIÓN 15/00

ASUNTO: FECHAS INHÁBILES PARA LA CENTRAL DE ANOTACIONES DEL MERCADO DE DEUDA PÚBLICA DURANTE EL AÑO 2000.

La Aplicación Técnica nº 66 del Servicio de Liquidación del Banco de España (S.L.B.E.) comunicó el acuerdo del Consejo de Gobierno del Banco Central Europeo que declaró inhábiles a efectos de la utilización del Sistema TARGET todos los sábados y domingos del año 2000, así como los siguientes días:

1 de enero de 2000
21 de abril de 2000 (Viernes Santo)
24 de abril de 2000 (Lunes de Pascua)
1 de mayo de 2000
25 de diciembre de 2000
26 de diciembre de 2000

Como consecuencia de lo anterior, la Central de Anotaciones del Mercado de Deuda Pública permanecerá, asimismo, cerrada en las citadas fechas tanto a efectos de liquidación de las operaciones como de su comunicación por parte de los miembros del Mercado. Además, en relación a los cuatro días que han sido declarados inhábiles a efectos de la utilización del sistema TARGET y que fueron operativos en el año anterior, los miembros del Mercado deberán tener en cuenta las reglas siguientes:

OPERACIONES A PLAZO Y SIMULTÁNEAS

Los miembros del Mercado que hayan comunicado a la Central de Anotaciones operaciones de este tipo con fecha-valor en cualquiera de las fechas de referencia, tanto en operaciones por cuenta propia como por cuenta de terceros, deberán proceder a su modificación, enviando al S.L.B.E. el oportuno escrito de corrección de la fecha-valor y, en su caso, de las otras características de la operación que se vean afectadas como consecuencia de la circunstancia señalada (importe efectivo), debidamente firmado por las dos entidades participantes en la operación. De no recibirse la citada rectificación antes del 31 de marzo de 2000, la fecha-valor de las operaciones afectadas será modificada, adelantándola al día hábil anterior a la fecha inicialmente comunicada.

OPERACIONES DE COMPRAVENTA CON PACTO DE RECOMPRA "REPOS"

En las operaciones de este tipo comunicadas por las entidades, tanto por cuenta propia como por cuenta de terceros, cuya fecha de retrocesión pactada coincida con alguno de los días de referencia, la fecha de vencimiento será adelantada al día hábil anterior correspondiente. La Central de Anotaciones ha modificado automáticamente los vencimientos pactados para los días 21 de abril y 1 de mayo. El día 3 de abril se modificarán, también automáticamente, los vencimientos inicialmente previstos para el 24 de abril y el 26 de diciembre. Los miembros del Mercado no tendrán que efectuar ninguna comunicación al S.L.B.E. por estas



BANCO DE ESPAÑA



variaciones. Las Entidades Gestoras anotarán en su Registro de Terceros el cambio de la fecha de vencimiento de estas operaciones contratadas con terceros, pero no es necesario incluir en la cinta semanal dichas modificaciones.

SERVICIO FINANCIERO DE LA DEUDA ANOTADA

El pago de los cupones y, en su caso, de las amortizaciones de la deuda negociada en el Mercado de Deuda Pública en anotaciones cuyo vencimiento coincida con las fechas de referencia, será retrasado hasta el día siguiente hábil a la fecha dispuesta inicialmente por los emisores.

PRIMER CICLO DE LIQUIDACIÓN DE LA CENTRAL DE ANOTACIONES Y FINANCIACIÓN INTRADÍA.

El primer ciclo de liquidación y la financiación intradía de fecha-valor 2 de mayo se realizará en la tarde del día hábil anterior - 28 de abril- en los horarios habituales.

No será así en los procesos correspondientes a las fechas 25 de abril y 27 de diciembre, ya que los días 24 de abril y 26 de diciembre son hábiles en Madrid y, en consecuencia, permanecerá abierto el servicio de Cuentas Corrientes del Banco de España. Por este motivo, en la tarde de los días 20 de abril y 22 de diciembre las Entidades Gestoras comunicarán las variaciones de sus cuentas de terceros con fecha-valor 25 de abril y 27 de diciembre, respectivamente, PERO A CONTINUACIÓN NO SE INICIARÁ EL PRIMER CICLO DE LIQUIDACIÓN Y LA FINANCIACIÓN INTRADÍA. Estos procesos se realizarán en la tarde de los días 24 de abril y 26 de diciembre, aproximadamente a las 16:00 horas, una vez finalizado el cierre de las cuentas corrientes ordinarias.

Para cualquier aclaración sobre el contenido de esta comunicación, pueden dirigirse a los teléfonos 91.338.6051 o 6052, de la Sección de Anotaciones en Cuenta de la Oficina de Operaciones.

Madrid, 1 de marzo de 2000

EL JEFE DE OPERACIONES