



BANCO DE ESPAÑA



## COMUNICACIÓN 21/00

### **ASUNTO: AMORTIZACIÓN PROPORCIONAL DE LAS OBLIGACIONES DE LA COMUNIDAD DE CANARIAS AL 9,315%, CÓDIGO-VALOR ES0000093080-5.**

La Central de Anotaciones procederá a efectuar el próximo 16 de mayo de 2.000, de acuerdo con las condiciones de emisión, la amortización proporcional del código valor ES0000093080-5, correspondiente a las Obligaciones de la Comunidad de Canarias al 9,315%, emisión 16/05/95, sobre los saldos de deuda que figuran anotados en las cuentas de la Central.

El tratamiento de este tipo de amortizaciones, así como las anotaciones que deberán llevar a cabo los Miembros del Mercado de Deuda Pública, se efectuarán según se detalla a continuación:

1. En la tarde del día hábil anterior a la amortización proporcional (15/05/2000) dentro del primer ciclo de liquidación, la Central de Anotaciones procederá a efectuar los adeudos por amortización, calculados con carácter provisional de acuerdo con el punto 3, directamente en las cuentas de valores propias o de terceros afectadas, y a abonar el efectivo correspondiente a dicha amortización proporcional en la cuenta de Tesorería de cada Entidad. Por consiguiente, las Entidades Gestoras no necesitarán comunicar movimientos desde las cuentas de terceros a las cuentas propias por los importes amortizados.
2. La amortización proporcional se efectuará sobre todos los saldos vivos al cierre del día hábil anterior a la fecha de la amortización proporcional del modo siguiente:
  - Saldos libres: por cuenta propia y por cuenta de Terceros. (Sobre el saldo de cada cuenta).
  - Saldos bloqueados: por cuenta propia y por cuenta de Terceros. (Sobre cada certificado de Inmovilización).

### **3. Cálculo del nominal a amortizar:**

Para un código de valor con porcentajes de amortización (en tanto por uno):  $P_1, P_2, \dots, P_i, \dots$ ; el nominal que se amortiza proporcionalmente,  $N_{amp}$ , en la amortización 'i' con porcentaje  $P_i$  será:

$$N_{amp} = N_{act} \frac{P_i}{1 - (P_1 + \dots + P_{i-1})}$$

donde  $N_{act}$  es el nominal actual antes de la amortización proporcional 'i'.

En el caso concreto de esta amortización proporcional del día 16 de mayo la fórmula a aplicar será:

$$N_{amp} = N_{act} \cdot 0,33$$

El resultado se redondeará al céntimo de euro más próximo; es decir, si el tercer decimal está entre 0 y 4, se redondeará por defecto, y si el tercer decimal está entre 5 y 9, se redondeará por exceso.



4. En la tarde del día 15/05/2000, las Entidades Gestoras tendrán disponible en la pantalla de control de listados UH96, los listados CATLAP02 (resumen, por tipo de saldo, de las amortizaciones proporcionales) y CATLAP04 (resultado de la amortización proporcional de los certificados de bloqueo).

Las Entidades Gestoras procederán, por su parte, a realizar las siguientes actuaciones:

- Calcular, registro a registro, sobre todas las anotaciones vivas al cierre del 15/05/2000, el saldo nominal amortizado de cada anotación, aplicando al nominal del alta de cada registro la fórmula incluida en el punto 3 y redondeando, en su caso, al céntimo de euro más próximo.

Si el saldo nominal a favor de un cliente estuviera constituido por más de un registro, la amortización afectará a cada uno de los registros por separado, siendo el saldo final amortizado el resultado de agregar los importes nominales amortizados de cada uno de esos registros.

- Cuando el saldo de un certificado de inmovilización expedido por la Central de Anotaciones esté amparado por dos o más registros, el cálculo del importe amortizado se realizará tomando como base la suma de los nominales de los registros que reflejan el saldo bloqueado en la Central y aplicando la fórmula recogida en el punto 3, para adaptarse exactamente al importe de "Nominal Amortizado" que calcula la Central de Anotaciones y que figura en el listado CATLAP04 a que se hace referencia en el punto 4.
- Respecto de los saldos bloqueados en la Central de Anotaciones, el efectivo procedente de la amortización proporcional continuará inmovilizado y será indisponible hasta el momento en que se solicite el levantamiento del importe total bloqueado que figura en el correspondiente certificado de inmovilización.
- Antes de las 12 horas del día 16/05/2000, todas las Entidades Gestoras con saldo de terceros en el código-valor que tiene amortización proporcional, deberán enviar un fax en el que figure el saldo total amortizado de la cuenta de terceros **libre**, una vez calculado el importe que se amortiza en cada uno de los registros vivos de saldo libre. El fax tendrá el siguiente formato:

AMORTIZACION PROPORCIONAL CÓDIGO VALOR ES0000093080-5 FECHA-VALOR 16-05-2000		
Entidad (CSB)	Saldo Amortizado de Terceros <b>Libre</b> según la Entidad	Saldo Amortizado de Terceros <b>Libre</b> según la Central de Anotaciones

Dicho fax deberán remitirlo, en cualquier caso, incluso cuando los saldos sean coincidentes, al número 91.338.55.07. En el caso de que no se recibiese el mencionado fax antes de la hora límite señalada en el párrafo anterior, se entenderá que los datos facilitados por la Central de Anotaciones son correctos, no admitiéndose ninguna modificación posterior.



**BANCO DE ESPAÑA**

**CADE**  
Central de Anotaciones

A continuación, la Central de Anotaciones procederá a ajustar el saldo amortizado para que coincida con el saldo obtenido por la Entidad Gestora, lo que provocará el correspondiente adeudo/abono en las cuentas de valores de Terceros y abono/adeudo de los efectivos en las cuentas de tesorería de la entidad.

- Respecto a las anotaciones a efectuar en el Libro Registro de Terceros de las Entidades Gestoras, se seguirá el procedimiento establecido en la Aplicación Técnica 1/97 de 29 de Octubre de 1.997, y que es el siguiente:

Con fecha-valor de la amortización proporcional, las Entidades Gestoras cancelarán en su registro de terceros todas las anotaciones vivas del código-valor correspondiente, mediante bajas con tipo de operación "30" –Baja por amortización proporcional– por el importe nominal amortizado. Simultáneamente, y con la misma fecha-valor, anotarán altas por el nominal que permanece sin amortizar; estas altas podrán adoptar una de las dos formas siguientes:

- Tipo de operación "03" – Alta por cancelación parcial -, si los registros que se cancelan reflejan saldos libres.
- Tipo de operación "12" – Alta por bloqueo -, si las anotaciones canceladas eran, a su vez, altas "12" por saldos bloqueados en la Central de Anotaciones. En ese caso deberán indicarse, de forma similar al alta "03", los datos del registro que se cancela en el campo "referencia técnica del registro asociado".

En hoja adjunta se detallan el contenido y las depuraciones de los campos de estos registros de alta y de baja.

Para cualquier aclaración sobre el contenido de esta nota, pueden dirigirse a los teléfonos 91.338.60.51 ó 91.338.60.52, de la Sección de Anotaciones en Cuenta.

Madrid, 13 de abril de 2000

EL JEFE DE OPERACIONES



## CONTENIDO Y DEPURACIONES DE LOS CAMPOS DE LOS REGISTROS DE ALTA Y BAJA POR AMORTIZACIÓN PROPORCIONAL

La información que deberá contener cada campo de estos Registros es la siguiente:

Campo 12.6 TIPO OPERACIÓN	(Baja por Amortización Proporcional) 30	(Alta por Amortización Proporcional) 12	(Alta por Amortización Proporcional) 03
Campo 12.1 FECHA CONTRATACIÓN	= Fecha Valor de Amortización Proporcional	= Fecha Valor de Amortización Proporcional	= Fecha Valor de Amortización Proporcional
Campo 12.2 FECHA VALOR	= Fecha Valor de Amortización Proporcional	= Fecha Valor de Amortización Proporcional	= Fecha Valor de Amortización Proporcional
Campo 12.4 ENTIDAD INTERMEDIA	= Declarante	= a la del Alta del Registro Asociado	= a la del Alta del Registro Asociado
Campo 12.5 CLASE INTER- MEDIACIÓN	= 0	= 0	= a la del Alta del Registro Asociado
Campo 12.7 NOMINAL	= Nominal que se amortiza propor- cionalmente	= Nominal Alta - Nominal Baja por Amort. Proporcional del Registro Asociado	= Nominal Alta - Nominal Baja por Amort. Proporcional del Registro Asociado
Campo 12.8 EFECTIVO	Efectivo de Amortización Proporcional.	Proporcional al Efectivo Alta del Registro Asociado	Proporcional al Efectivo Alta del Registro Asociado
Campo 12.9 FECHA REVENTA	= 0	= 0	= 0
Campo 12.10 EFECTIVO REVENTA	= 0	= 0	= 0
Campo 12.11 TIPO INTERÉS	= 0	= 0	= 0
Campo 17 REFERENCIA TÉCNICA DEL REGISTRO ASOCIADO	= 0	Identif. Rgtr. que se cancela parcialmente (Entidad, Código Valor, Fecha Valor, Nº Operación)	Identif. Rgtr. que se cancela parcialmente (Entidad, Código Valor, Fecha Valor, Nº Operación)