



Estructura archivo de emisiones vigentes y de *haircuts*

Versión 1.02

Mayo de 2022

Este documento está sujeto a cambios sin previo aviso por parte del Banco de la República- Su actualización será informada por las vías que el Banco de la República considere pertinentes. Para referencia de los lectores, se incluirá una descripción de los principales cambios en la sección de Historia del Documento.



HISTORIA DEL DOCUMENTO

FECHA	VERSIÓN	CAMBIOS
2021-06-01	1.00 APROBADO	Documento aprobado
2022-05-03	1.01 APROBADO	Ajuste en el reporte de emisiones vigentes sobre el campo Tasa de Interés y el Valor Tasa de interés
2022-05-23	1.02 APROBADO	Ajuste en el reporte de emisiones vigentes para incluir la fecha de emisión del ISIN



Tabla de Contenidos

1. Introducción	4
2. Emisiones vigentes	5
3. Haircuts Deuda Externa y Haircuts Repos BR	8



1. Introducción

La estructura y contenido de los archivos con que se publican en la página Web del Banco de la República las “Emisiones Vigentes” y los “*Haircuts* Deuda Externa” y “*Haircuts* Repos BR” sufrirán modificaciones debido a actualizaciones tecnológicas. La fecha esperada de liberación del nuevo formato es a finales del primer trimestre o inicios del segundo trimestre de 2022, fecha que será informada una vez sea definida.

En este documento se especifican los cambios a introducir en los mencionados archivos.



2. Emisiones vigentes

En la actualidad se publican en forma separada la información de las emisiones vigentes (archivo “Emisiones vigentes en el DCV”) de la información de los títulos transferidos en operaciones a plazo (archivo “Emisiones comprometidas operaciones a plazo vigentes”).

Con la nueva estructura se fusionará en un único archivo Excel la información de las emisiones con la de los títulos transferidos en operaciones a plazo, el que tendrá las siguientes especificaciones:

Información	Códigos ISIN vigentes
Nombre del archivo	CodigosISINVigentesWeb.xlsx
Descripción	Presenta los códigos ISIN vigentes en el DCV a la fecha de corte de la información, junto con las características financieras y el valor nominal comprometido en operaciones a plazo (Repos, simultáneas y préstamos de valores).
Disponibilidad	Público en general
Frecuencia de publicación	Diaria Días hábiles
Rangos de consulta	No aplica
Corte de información	Fecha en que se obtuvo la información.
Datos	Cabecera - Fecha de corte de la información. Detalle - Categoría del título: Nombre interno de la categoría del instrumento financiero. - ISIN: Código ISIN del instrumento financiero. - Mnemotécnico: Código inteligente que se le asigna al título para su identificación. - Denominación: Moneda o unidad (en denominación original) en que está expresado el valor facial o nominal de un título. - Plazo: Plazo del ISIN - Fecha de emisión: Fecha de inicio de conteo del plazo - Fecha de vencimiento: Fecha fin del plazo - Tipo de tasa: Tasa de interés del título (variable, fija o indexada). - Tasa de interés: Estará compuesto de la siguiente forma para títulos con rentabilidad atada a una tasa variable: (factor + índice) + signo + spread, donde



	✓ “factor”: Porcentaje por el que se afecta el indicador para determinar la rentabilidad del título. Si no está incluido, significa que el “factor” = 1, es decir, se toma el 100% del índice. El “factor” será incluido cuando el porcentaje a tomar del índice sea diferente al 100%, en cuyo caso se mostraría en porcentaje y con 4 decimales. A modo de ejemplo, como sigue: ▪ Si factor es igual a 1 y el índice es IPC se vería "IPC" ▪ Si factor es el 80% del IPC se vería "80,0000% IPC" ✓ “spread”: Puntos que se adicionan o restan a la tasa de rentabilidad del título. Si no se adicionan ni restan puntos, es decir, si el spread = 0, no será incluido. Cuando a la tasa se le deban adicionar o restar puntos, se mostrará el signo + o - y el valor con 4 decimales A modo de ejemplo, como sigue: ▪ Si el índice es DTF y no se le suman ni restan puntos; se vería "DTF" ▪ Si el índice es DTF y se le restan dos (2) puntos; se vería "DTF - 2,0000" ✓ Entre cada parte de la composición existirá un espacio En caso de representar la rentabilidad del título una tasa fija, se incluirá el valor correspondiente con 6 decimales. - Valor Tasa de Interés: contendrá el valor calculado de la tasa variable a la fecha del día hábil inmediatamente anterior. Tratándose de títulos con tasa fija, el valor corresponderá al mismo indicado en "Tasa de interés". - Periodicidad rendimientos: Periodicidad de pago de rendimientos del ISIN - Saldo: Monto en circulación del ISIN (en denominación original). Valores por ISIN en operaciones a plazo - Valores nominales - Repos: Valor nominal del ISIN en operaciones repo. - Simultáneas: Valor nominal del ISIN en operaciones simultáneas - Transferencia temporal de valores / objeto de la operación: Valor nominal del ISIN dado en préstamo de valores. - Transferencia temporal de valores / transferencia a cambio: Valor nominal del ISIN recibido como colateral en operaciones TTV.
--	---



Banco de la República | Colombia

A modo ilustrativo, con información que únicamente pretende facilitar la comprensión de la nueva estructura, adjunto al presente documento se publica el archivo "CodigosSINVigentesWeg.xlsx".



3. Haircuts Deuda Externa y Haircuts Repos BR

La información de los *haircut* de Repos BR se publica en un archivo Excel mientras que la información de los *haircut* de Deuda Externa en un archivo de formato PDF.

Con el cambio de formato, aunque se mantendrán dos archivos, se unificará el formato y la estructura, advirtiendo que los archivos históricos mantendrán la estructura en que fueron publicados.

Especificaciones de la nueva estructura (aplica tanto para “*Haircut Repos BR*” como para “*Haircuts Deuda pública*”):

Información	<i>Haircuts</i>
Nombre del archivo	Mes AAAA - <i>Haircuts</i> TipoDeuda.xlsx Donde: Mes corresponde al nombre del mes completo en letras AAAA corresponde al año seleccionado TipoDeuda corresponde al tipo de deuda: Interna o Externa
Descripción	Presenta el <i>haircut</i> calculado para cada uno de los ISIN vigentes en el sistema, de deuda externa o interna, asociado a cada uno de los plazos permitidos en operaciones a plazo. Cada archivo contiene la información por año y mes, para los últimos 24 meses.
Disponibilidad	Público en general
Frecuencia de publicación	Mensual Primer día hábil del mes
Rangos de consulta	El reporte incluye información desde el primer día calendario del mes hasta el último día calendario del mes correspondiente a la fecha de consulta del reporte.
Corte de información	No aplica.
Datos	Cabecera - Periodo: Rango de fechas al que corresponde la información. - Tipo de deuda: Indica si el archivo consultado corresponde a deuda externa o deuda interna. Detalle - ISIN: Identificador ISIN del instrumento financiero. - Plazo: Duración de la operación repo. - <i>Haircut</i>: Porcentaje en que se descuenta el valor de mercado del ISIN para proteger a quien lo reciba, en operaciones a plazo, del riesgo de mercado y de liquidez



A modo ilustrativo, con información que únicamente pretende facilitar la comprensión de la nueva estructura, adjunto al presente documento se publica el archivo “Septiembre 2020 – *Haircuts* Deuda Externa.xlsx”. No se publica archivo para deuda interna dado que el formato es el mismo de deuda externa.