



Depósito Central
de Valores - DCV

Proyecto de Modernización del DCV – Operaciones a Plazo

Versión 1.00

2023-07-07

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

Este documento no se puede copiar, redistribuir ni utilizar de manera alguna fuera de lo permitido en el contrato de vinculación al Depósito Central de Valores – DCV o a sus servicios, excepto con el consentimiento por escrito del Banco de la República.

Historia del documento

Versión 1.00

Fecha:2023-07-07

Cambios: Versión Inicial.

Tabla de contenido

Introducción.....	4
Alcance.....	5
Ubicación.....	5
Estructura.....	6
Encabezado.....	6
Detalle.....	7
Actualización periódica.....	11

Introducción

En el marco de la Modernización de la Infraestructura del DCV y para facilitar la identificación de las operaciones a plazo que se llevarán del sistema actual del Depósito al nuevo sistema, a través de una funcionalidad en el actual DCV, se proveerá una consulta que genera un archivo plano en formato CSV con la información suficiente para que los Depositantes Directos puedan conciliar las operaciones a plazo que podrían ser llevadas al nuevo DCV por encontrarse vigentes al momento de realizar la consulta. Es importante resaltar que la información puede variar entre el momento en que se haga una consulta y otra si se llegan a presentar vencimientos de los plazos de las operaciones.

El objetivo principal del documento es brindar información sobre las operaciones a plazo que serán migradas para la entrada en producción del nuevo sistema del DCV, para que los Depositantes cuenten con los datos necesarios que les permita certificar las operaciones a plazo que puedan llegar a tener vigentes al momento de realizar la migración, asegurando de esta forma la integridad de los datos en el nuevo sistema.

Alcance

A continuación, se detallan las operaciones a plazo que se informarán, entendiendo para el efecto operación a plazo aquellas cuyo cumplimiento es en la fecha de entrada en producción del nuevo sistema o posterior:

COD OPERACIÓN	NOMBRE DE LA OPERACIÓN
211	SOLICITUD TTV MHCP
422	COMPRAVENTA (OPERACIONES MARCADAS COMO FUTURAS)
430	REPO CONTRAPAGO
431	REPO BANCO REPUBLICA
432	REPO SISTEMAS EXTERNOS
433	REPO EN REVERSA
434	REPO ESPECÍFICO
435	SIMULTANEAS
436	REPO INTRADÍA
437	REPO LIBRE DE PAGO
438	REPO ABIERTO
440	DEPÓSITO REMUNERADO
497	OPERACIÓN DE EMBARGO
540	INTERBANCARIO
561	GARANTÍA ENTRE PARTICIPANTES – PRENDAS
562	GARANTÍA IMF- PRENDAS
770 - 771	CONSTITUCIÓN AUTOMÁTICA Y MANUAL DE GARANTÍA PARA RIESGO DE MERCADO

El reporte proporcionará a corte de la consulta, los atributos y valores relevantes de las operaciones.

Se debe tener presente que el reporte tiene el propósito de dar herramientas para certificar la información objeto de migración y permitir a los Depositantes Directos verificar las operaciones a plazo (con fecha de liquidación posterior a la obtención del reporte) vigentes al momento de la migración.

Ubicación

La consulta estará habilitada a usuarios pertenecientes a Depositantes Directos inscritos y activos en el DCV.

La ruta de acceso es la siguiente:

ProgramaMIT-DFV@banrep.gov.co

www.banrep.gov.co

Carrera 7 # 14 – 78 Tel. (601)3430444

1. Menú Depósito Central de Valores - DCV
 - a. Consulta / Informes
 - i. Generación de archivos planos



The screenshot shows the DCV website interface. At the top, there is a header with the DCV logo and the text 'Depósito Central de Valores'. Below the header, the main title is 'GENERACION DE ARCHIVOS PLANOS'. There are three input fields: 'Fecha Inicial:', 'Fecha Final:', and 'Intermediario: TO'. Below these fields, there are four links: 'Archivo de Saldos', 'Archivo de Pagos', 'Archivo de nuevas cuentas DCV', and 'Archivo de Operaciones a Plazo a migrar al nuevo DCV'. A large red arrow points to the last link. At the bottom, there are two more links: 'Regresar Menu Anterior' and 'Terminar Sesión'. On the left side, there is a sidebar with a user profile 'sen1' and a menu with options: 'Principal', 'Listados', 'Logs Reportes', 'Terminar Sesión', and 'Contáctenos'.

Seleccionar la opción “Archivo de Operaciones a Plazo a migrar al nuevo sistema del DCV”.

i Al hacer clic en el reporte puede salir un mensaje por defecto informando sobre las tasas. Por favor hacer caso omiso del mensaje.

i Para esta consulta no es necesario ingresar ninguna fecha (inicial o final), pues esta aplica exclusivamente para las consultas sobre saldos y pagos.

Estructura

La consulta está compuesta de dos partes, la primera (encabezado) contiene la información básica del usuario y la fecha en que se descargó el reporte y, la segunda (detalle), contiene el detalle de cada una de las operaciones.

Encabezado

El encabezado está compuesto de las siguientes líneas:

# LÍNEA	DATO	OBSERVACIONES
1	Fecha de la consulta: YYYY-MM-DD - HH:MI:SS,,,,,,,,,,,,,	Donde: YYYY: año de la consulta MM: Mes de la consulta DD: Día de la consulta HH: Hora de la consulta (En formato de 24 horas) MM: Minutos SS: Segundos Ejemplo: Fecha de la consulta: 2023-06-16 - 17:23:14,,,,,,,,,,,,,
2	Usuario: xxxxxxxx,,,,,,,,,,,,,	Donde: Xxxxxxxx: es el usuario que ejecutó la consulta Ejemplo: Usuario: abcdefg09099,,,,,,,,,
3	Código de intermediario, Portafolio, BIC, Nombre Intermediario-Portafolio, Tipo Participante, Código de Operación, Descripción de la Operación, Fecha de operación, Ciudad, Número de Operación, ISIN, Referencia de la Parte, Referencia Común, Número de Contrato, Valor Colateral, Valor del Contrato, Tasa, Sistema Negociación	Esta línea contiene el nombre de cada una de las columnas del detalle

Detalle

El detalle está compuesto de la siguiente estructura:

BANCO DE LA REPÚBLICA | Depósito Central de Valores - DCV

NOMBRE DEL CAMPO	POSICIÓN/ COLUMNA	TIPO DE DATO	MANDATORIO(M) CONDICIONAL(C) OPCIONAL (O)	DESCRIPCIÓN CONSIDERACIONES ESPECIALES
Código de intermediario	1	Número (3)	M	Código de Intermediario/Depositante Directo. Numero alineado a la derecha rellenado con cero (0) en la izquierda. Ejemplo: - 099 - 100
Portafolio	2	Número (2)	M	Número de portafolio. Numero alineado a la derecha rellenado con cero (0) en la izquierda. Ejemplo: - 00 - 20
BIC	3	Texto (50)	M	Código BIC asignado para el Depositante Directo. Ejemplo: BREPCOBBXXX
Nombre Intermediario-Portafolio	4	Número (6)	C	Nombre del portafolio
Tipo de Participante	5	Texto (1)	M	'C' en caso de que el Participante sea el comprador 'V' en caso de que el Depositante Directo sea la parte vendedora
Código de Operación	6	Número (3)	M	Código de operación asociado al registro informado.
Descripción de la Operación	7	Texto (50)	M	Nombre de la operación informada
Fecha de operación	8	Fecha	M	Fecha de la operación
Ciudad	9	Número (2)	M	Código de ciudad que se registró la operación.

BANCO DE LA REPÚBLICA | Depósito Central de Valores - DCV

NOMBRE DEL CAMPO	POSICIÓN/ COLUMNA	TIPO DE DATO	MANDATORIO(M) CONDICIONAL(C) OPCIONAL (O)	DESCRIPCIÓN CONSIDERACIONES ESPECIALES
Número de Operación	10	Número (6)	M	Número de la operación asociado al Depositante Directo
ISIN	11	Texto (12)	O	<p>Código ISIN del colateral usado para operación.</p> <p>Si la operación tiene más de un ISIN como colateral se repetirá el registro por cada uno de los ISIN asociados.</p> <p>i En caso de que la operación no contenga título como colateral este campo estará vacío</p>
Referencia de la Parte	12	Texto	C	Llave única que se usará para identificar la operación en el nuevo sistema de información.
Referencia Común	13	Texto	C	<p>Para operaciones Repo Banco República e intradía: Fecha informada por el sistema de subastas (8) + número de la oferta</p> <p>Para operaciones diferentes a Repo Banco República o intradía: Fecha de la operación externa (8) + número cierre realizado en el sistema de negociación o de registro de operaciones sobre valores.</p> <p>i En caso de que no tenga operación externa o</p>

NOMBRE DEL CAMPO	POSICIÓN/ COLUMNA	TIPO DE DATO	MANDATORIO(M) CONDICIONAL(C) OPCIONAL (O)	DESCRIPCIÓN CONSIDERACIONES ESPECIALES
				número de oferta, este campo estará vacío.
Número de Contrato	14	Texto		Llave única que se usará para identificar la operación en el nuevo sistema de información.
Valor Colateral	15	Numero	M	Valor nominal del colateral entregado para el contrato.
Valor del contrato	16	Número	C	Valor total del contrato.
Tasa	17	Número	C	Tasa que se usó para la operación a plazo. Si la operación no tiene tasa este campo va vacío
Sistema Negociación	18	Número	C	NIT del sistema de negociación que transmitió la operación. En caso de que no venga de algún sistema de negociación o de registro, el campo va vacío.

Actualización periódica

Con el fin de mantener actualizada esta información, el Banco de la República como administrador del DCV publicará una nueva versión de este documento, cuando haya actualizaciones que así lo ameriten.