



Banco de la República Colombia

BOLETÍN

No. 30
 Fecha 25 de Mayo de 2015
 Páginas 6

Página

CONTENIDO

Circular Reglamentaria Externa DODM-139 del 25 de mayo de 2015. "Asunto 1: "Posición Propia, Posición Propia de Contado, Posición Bruta de Apalancamiento e Indicadores de Exposición por Moneda de los Intermediarios del Mercado Cambiario"	1
Circular Reglamentaria Externa DODM-317 del 25 de mayo de 2015. "Asunto 19: "Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas"	5

Este Boletín se publica en desarrollo de lo dispuesto en el literal a) del artículo 51 de la Ley 31 de 1992 y del párrafo del artículo 108 de la Ley 510 de 1999

Secretaría Junta Directiva – Carrera 7ª. No. 14-78 Piso 6º. - Bogotá D.C. - Teléfonos: 343 11 11 – 343 1000



MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE OPERACIONES Y Hoja 19-00
DESARROLLO DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM - 317

Fecha: 25 MAYO 2015

Destinatario: Oficina Principal y Sucursales; Superintendencia Financiera de Colombia; Establecimientos Bancarios; Corporaciones Financieras; Compañías de Financiamiento; Cooperativas Financieras; Comisionistas de Bolsa; Financiera de Desarrollo Nacional; BANCOLDEX; Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas.

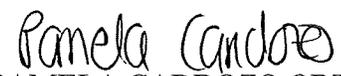
ASUNTO 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

La presente circular modifica la hoja 19-3 de la Circular Reglamentaria Externa DODM-317 del 20 de febrero de 2015, correspondiente al Asunto 19: “**SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**”, del Manual del Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados.

Las modificaciones se realizan con el fin de establecer que el registro dentro de los quince (15) minutos siguientes a las negociaciones de operaciones de derivados en divisas realizadas en el mercado mostrador por los Intermediarios del Mercado Cambiario, señalados en los Numerales 1 y 2 del Artículo 59 de la Resolución Externa 8 de 2000, con residentes distintos de entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia y la Nación - Ministerio de Hacienda y Crédito Público-, será obligatorio a partir del 1 de marzo de 2016.

Cordialmente,


HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico


PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Inversiones
Internacionales



Fecha: 30 ENE. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

1. ORIGEN

Esta circular reglamenta la Resolución Externa 4 de 2009 de la Junta Directiva del Banco de la República y demás normas que la modifiquen, adicionen o complementen.

2. REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

De acuerdo con lo establecido en el Capítulo VI de la Resolución Externa 4 de 2009, los intermediarios del mercado cambiario (IMC) señalados en los Numerales 1 y 2 del artículo 59 de la Resolución Externa 8 del 2000, están obligados a registrar, en un sistema de registro de operaciones sobre divisas debidamente autorizado, las operaciones sobre divisas que realicen en el mercado mostrador.

Los sistemas de registro de operaciones sobre divisas podrán recibir el registro de operaciones negociadas en sistemas de negociación.

Cuando el sistema de registro de operaciones sobre divisas opere mediante confirmación, se entiende que la operación está registrada cuando el afiliado que debe confirmar haya confirmado la operación.

2.1 OPERACIONES OBJETO DE REGISTRO

Los IMC deben registrar las operaciones sobre divisas, de contado y de derivados, diferentes a operaciones de derivados cuyo subyacente sean títulos de renta fija, índices accionarios o riesgo de crédito, que realicen en el mercado mostrador. Las operaciones de contado sobre divisas, celebradas entre IMC y los demás residentes, distintos de vigilados por la SFC y la Nación - Ministerio de Hacienda y Crédito Público, cuyo monto nominal sea inferior a doscientos cincuenta mil dólares de los Estados Unidos de América (USD \$250.000), o su equivalente en otras monedas, están exceptuadas de dicho registro.

2.2 CONTENIDO MÍNIMO DEL REGISTRO

Los sistemas de negociación y los sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán, como mínimo, tener el registro de la siguiente información para cada una de las operaciones negociadas o registradas por su conducto.

2.2.1 INFORMACIÓN GENERAL A TODAS LAS OPERACIONES

- Fecha y hora de negociación.
- Fecha y hora de registro.
- Fecha de vencimiento.



30 ABR. 2013

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

- Fecha de liquidación.
- Tipo de instrumento: forwards, opciones, swaps, swaps tasa de cambio y de interés, entre otros.
- Monedas involucradas (Moneda 1 y Moneda 2).
En operaciones peso-divisa la Moneda 1 corresponde a la divisa.
- Tipo de operación: compra o venta de Moneda 1.
- Monto de la operación (expresado en Moneda 1).
- Tasa pactada (cantidad de Moneda 2 por Moneda 1).
- Modalidad de cumplimiento (efectivo (*DF*) o financiero (*NDF*)).
- Identificación de las contrapartes.
- Identificación de los afiliados, operadores participantes de la operación.
- Modalidad de participación del afiliado (cuenta propia o cuenta de terceros).
- Identificación del cliente, cuando se trate de operaciones por cuenta de terceros.
- Opcionalidad (S/N).
- Descripción de la opcionalidad (si aplica).
- Información sobre si la liquidación se hace a través de una Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
- Operación proveniente de negociación o de registro.

2.2.2 INFORMACIÓN ADICIONAL POR TIPO DE OPERACIÓN

Opciones

- Tipo de operación: *call* compra, *call* venta, *put* compra, *put* venta (de divisas en el caso de operaciones peso-divisa, o de Moneda 1 en el caso de operaciones divisa-divisa).
- Tipo de opción (americana, europea u otra).
- Prima opciones (cantidad de Moneda 2 por Moneda 1).
- Condición de ejercicio.

Derivados con tasa de interés

- Tasa de interés en Moneda 1.
- Tasa de interés en Moneda 2.
- Periodicidad de los flujos Moneda 1
- Periodicidad de los flujos Moneda 2

FX Swaps

- Tasa pactada en operación de contado.

HVH

DJP



Fecha: 25 MAYO 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

2.3 PLAZO PARA REGISTRAR LAS OPERACIONES

Los IMC señalados en los Numerales 1 y 2 del Artículo 59 de la Resolución Externa 8 de 2000, deberán registrar las operaciones sobre divisas que realicen en el mercado mostrador con otros IMC, con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados o con otros residentes distintos de IMC, de acuerdo con lo establecido en el presente numeral.

Se exceptúan de la obligación de registro las operaciones de contado sobre divisas, celebradas entre IMC y los demás residentes, distintos de vigilados por la SFC y la Nación - Ministerio de Hacienda y Crédito Público, cuyo monto nominal sea inferior a doscientos cincuenta mil dólares de los Estados Unidos de América (USD \$250.000), o su equivalente en otras monedas.

De igual forma, los IMC que registren en un sistema de registro las operaciones sobre divisas que realicen en sistemas de negociación deberán hacerlo de acuerdo con los siguientes principios:

- i. Las operaciones que se realicen dentro del horario de operación establecido por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, se deberán registrar dentro de los quince (15) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento. Para el caso de las operaciones de derivados realizadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público- esta disposición entra en vigencia a partir del 1 de marzo de 2016. Hasta esta fecha, dichas operaciones deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro.
- ii. Las operaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán como si hubieran sido realizadas al primer instante de la apertura siguiente, es decir, el registro deberá efectuarse durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas.
- iii. Las operaciones cuya tasa se determine después del cierre de los sistemas de negociación y antes del cierre de los sistemas de registro, deberán ser registradas por el IMC antes del cierre de operación de estos sistemas de registro.
- iv. Las operaciones cuya tasa se conoce después del cierre de los sistemas de registro y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, deberán registrarse durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas del día hábil siguiente.
- v. El administrador del sistema de registro de operaciones sobre divisas podrá establecer los términos para recibir operaciones con cumplimiento en $t=0$ por fuera de su horario de operación. Cuando el administrador del sistema de registro de operaciones sobre divisas no haya establecido tales términos, dichas operaciones no podrán registrarse ese mismo día y por lo tanto su cumplimiento tampoco podrá realizarse en $t=0$.

HU 11

PC



Fecha: 20 FEB. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

2.4 ENVÍO DE OPERACIONES A UNA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE

En el caso de los derivados sobre divisas que realicen las Sociedades Comisionistas de Bolsa, conforme a lo establecido en el artículo 59, numeral 2, literal h de la Resolución Externa 8 de 2000, con otros residentes, distintos de los IMC señalados en el Numeral 1 del Artículo 59 de la Resolución Externa 8 de 2000, una vez las operaciones son negociadas en un sistema de negociación o registradas en un sistema de registro, deberán ser enviadas de forma inmediata a una cámara de riesgo central de contraparte para su compensación y liquidación.

En caso que la mencionada cámara rechace la operación, las Sociedades Comisionistas de Bolsa dispondrán de una (1) hora, posterior a la hora de registro, para adelantar los procedimientos necesarios para que las operaciones sean aceptadas por la cámara para su compensación y liquidación. Si transcurrido ese tiempo la cámara no acepta la operación, la Sociedad Comisionista de Bolsa deberá anular la operación en el sistema de negociación o de registro correspondiente, dentro de los siguientes quince (15) minutos.

2.5 ANULACIONES Y MODIFICACIONES DE OPERACIONES

Los administradores de sistemas de negociación de operaciones sobre divisas deberán establecer en el reglamento del sistema el procedimiento para realizar anulaciones de las operaciones realizadas mediante el sistema de negociación, atendiendo razones como el error material, fallas técnicas u otras. En cualquier caso, el plazo para la anulación de operaciones no podrá exceder quince (15) minutos y los administradores de los sistemas deberán conservar la información relativa a las anulaciones de las operaciones, de manera que permita a los organismos de vigilancia y control hacer seguimiento de cualquier operación.

Los administradores de sistemas de registro de operaciones sobre divisas podrán aceptar modificaciones a las operaciones registradas por su conducto, atendiendo errores de digitación dentro del mismo día en que se realizó el registro inicial y con anterioridad a la hora de cierre de los sistemas, y siempre y cuando los afiliados puedan acreditar dicha circunstancia ante los organismos de vigilancia y control. De igual manera, los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro sobre divisas deberán aceptar las modificaciones realizadas a las condiciones pactadas en las operaciones de derivados durante la vigencia de las mismas. En todos los casos, los administradores de los sistemas deberán conservar la información relativa a las modificaciones, de manera que permita al BR y a los organismos de vigilancia y control, hacer seguimiento de cualquier operación.

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán establecer en el reglamento del sistema el procedimiento para anular las operaciones de derivados sobre tasa de cambio que hayan sido enviadas a una cámara de riesgo central de contraparte conforme a lo establecido en el numeral 2.4 de esta Circular, cuando dichas operaciones no sean aceptadas por esta última para su compensación y liquidación. Las Sociedades Comisionistas de Bolsa podrán realizar las operaciones a las que se refiere el numeral 2.4 de esta

HUH

PC



Fecha: 20 FEB. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

Circular una vez los sistemas de negociación y/o de registro hayan incorporado los ajustes a sus reglamentos.

Los IMC deberán registrar las modificaciones que realicen sobre las condiciones de las operaciones de derivados, atendiendo la reglamentación establecida en la *Circular Reglamentaria Externa DODM-144 - Operaciones de Derivados* y siempre y cuando puedan acreditar los cambios ante los organismos de vigilancia y control. Este registro deberá realizarse de acuerdo con los siguientes principios:

- i. Las modificaciones que se realicen dentro del horario de operación establecido por los sistemas de negociación y por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, deberán ser registradas por el IMC antes del cierre de operación de estos sistemas.
- ii. Las operaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura siguiente de dichos sistemas.
- iii. Cuando se trate de modificaciones sobre operaciones entre IMC afiliados al mismo sistema, uno de los IMC deberá realizar la modificación al registro y su contraparte deberá verificar dicha modificación. Cuando uno solo de los IMC sea el afiliado al sistema, será responsabilidad de éste la modificación del registro.

3. DIVULGACIÓN DE INFORMACIÓN

Los administradores de sistemas de negociación y de sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán divulgar la información de las operaciones negociadas o registradas de acuerdo con los siguientes parámetros:

3.1 INFORMACIÓN AL BR

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, deberán enviar diariamente el reporte al BR de las operaciones de derivados sobre divisas negociadas, registradas o modificadas el día hábil inmediatamente anterior. La información deberá ser enviada al correo electrónico: DODM-divisas@banrep.gov.co, en los formatos del Anexo 1 de esta circular.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido, serán aceptados por el Banco. Sin embargo, si un sistema envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la Superintendencia Financiera de Colombia, a efectos de que dicha autoridad pueda imponer las sanciones conforme a sus competencias, en particular las previstas en el Estatuto Orgánico del Sistema Financiero.

HNH

PC



Fecha: 20 FEB. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

3.2 INFORMACIÓN A LA SFC

Enviar diariamente a la Superintendencia Financiera de Colombia toda la información relacionada con las operaciones negociadas o registradas, en la forma y términos en que ese organismo lo señale.

3.3 INFORMACIÓN AL PÚBLICO

Divulgar al público a lo largo de las sesiones de negociación o de registro, con un retraso máximo de 15 minutos, y al final de cada sesión de negociación o de registro por lo menos la siguiente información:

- i. Para operaciones de contado: tasa de apertura, tasa promedio, tasa mínima, tasa máxima y tasa de cierre de la última operación, observadas hasta el momento de la publicación; monto total negociado y registrado, número de transacciones que lo componen, monto promedio, monto mínimo, monto máximo y monto correspondiente al último cierre, observados hasta el momento de la publicación. Adicionalmente, la evolución de la tasa de las transacciones realizadas a lo largo de la sesión.
- ii. Para operaciones de derivados: tasa de apertura, tasa promedio, tasa mínima, tasa máxima y tasa de cierre de la última operación, observadas hasta el momento de la publicación; monto total negociado y registrado, número de transacciones que lo componen, monto promedio, monto mínimo, monto máximo y monto correspondiente al último cierre, observados hasta el momento de la publicación. Lo anterior por tipo de instrumento y por rangos de plazos.

La información de las operaciones que sean negociadas en un sistema de negociación y registradas por el IMC en un sistema de registro, debe ser divulgada únicamente por el administrador del sistema de registro.

3.4 INFORMACIÓN A LOS AFILIADOS OBSERVADORES

La información que suministran los sistemas de negociación y los sistemas de registro de operaciones sobre divisas a sus agentes observadores, será una decisión de dichos sistemas y deberá estar consignada en los reglamentos. Sin embargo, el Banco de la República, la Superintendencia Financiera de Colombia y los Organismos de Autorregulación podrán requerir información adicional en calidad de agentes observadores.

(ESPACIO DISPONIBLE)

7/10/15

R



30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

**INSTRUCTIVO PARA EL DILIGENCIAMIENTO Y TRANSMISIÓN DE LA
INFORMACIÓN DE LAS OPERACIONES SOBRE DIVISAS POR PARTE DE
ADMINISTRADORES DE LOS SISTEMAS DE NEGOCIACION Y SISTEMAS DE
REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

1. GENERALIDADES

Los administradores de los Sistemas de Negociación y de los Sistemas de Registro de Divisas (SN/SR) deberán informar al Banco de la República (BR) las operaciones de derivados negociadas o registradas a través de su conducto, sus modificaciones y fraccionamientos, y las aclaraciones por errores de digitación. Esta transmisión se realizará vía electrónica usando el archivo "*Modelo de formatos de reporte de operaciones sobre divisas*", cuyo contenido debe cumplir con el estándar XML, de acuerdo con el procedimiento señalado en este anexo. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico derivados@banrep.gov.co.

El informe de operaciones sobre divisas deberá ser presentado por los SN/SR al BR utilizando el sistema de transmisión de información HTRANS que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR. Una vez se reciba el archivo con la mencionada información, la plataforma realizará un proceso de validación del archivo, el cual consta de cuatro partes. La validación 1 de 4, corresponderá a garantizar que el nombre del archivo tenga la estructura correcta de tal forma que permita tener la trazabilidad de la información enviada por un SN/SR. La validación 2 de 4, corroborará que la estructura XML del archivo recibido sea compatible completamente con la versión vigente del modelo, entregada previamente por el BR. Si el archivo recibido incumple cualquiera de estas dos validaciones, el BR rechazará la información y SEBRA generará un archivo en formato XML para notificar al SN/SR que éste debe enviar nuevamente el archivo corregido. Una vez la información proporcionada por los SN/SR cumpla con las dos primeras validaciones, se procederá a cargar los registros y se realizará la validación 3 de 4 en la que se evalúa la consistencia de los mismos, de acuerdo a cada tipo de instrumento y sus respectivas condiciones de negocio. Al terminar esta validación, SEBRA generará un archivo de respuesta, en formato XML, el cual será enviado al SN/SR donde se le indicará cuáles registros fueron aceptados y cuáles rechazados, para que así proceda al envío de las correcciones respectivas. Una vez se haya recibido toda la información a conformidad, el BR podrá iniciar la validación 4 de 4 donde se evalúa que la información de las operaciones sea coherente.

La información de las operaciones, incluyendo aquella que deba ser corregida, producto del proceso de validación anterior, deberá ser enviada a más tardar el día hábil siguiente al registro de las mismas.

PC

HVH



Fecha: 30 MAYO 2014

**ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

2. MECANISMOS DE TRANSMISIÓN ELECTRÓNICA DE ARCHIVOS

Para efectos de la transmisión electrónica de los archivos con destino al BR, los SN/SR utilizarán la herramienta HTRANS, la cual hace parte del sistema SEBRA. Para esto, los SN/SR deberán enviar el respectivo archivo en formato XML que cumpla con las directrices del presente anexo.

Para hacer uso del mencionado sistema, los SN/SR deberán enviar previamente al BR la carta de solicitud y acuerdo de servicio que se encuentra en el Anexo 2 de la presente circular, junto con la documentación solicitada.

3. MECANISMOS DE CONTINGENCIA PARA TRANSMISIÓN DE ARCHIVOS

En el evento que el BR no tenga la disponibilidad de su sistema (SEBRA), o que existan problemas con la transmisión de los archivos a través de HTRANS, los SN/SR deberán notificar telefónicamente dicho inconveniente al BR al teléfono 3431111 extensión 0329. Una vez reportado el inconveniente, el Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados (DODM) procederá a enviar un correo de autorización al correspondiente SN/SR para que éste pueda utilizar como mecanismo de transmisión el buzón derivados@banrep.gov.co. De esta manera, la información deberá ser enviada al BR el mismo día en que se reciba el correo de autorización. El mensaje que contiene los archivos de los SN/SR deberá ser enviado desde la cuenta de correo electrónica establecida por la entidad para este fin. Una vez sea recibida la información y el sistema esté disponible, se realizará la carga de los archivos XML para que se inicien las validaciones.

En el caso en que se genere el archivo de respuesta con las verificaciones sobre el reporte de las operaciones informadas por los SN/SR, y se presenten fallas en la transmisión de dicha información a través del sistema SEBRA, el BR enviará el archivo al buzón del SN/SR establecido para estas contingencias.

4. NOMBRE DEL ARCHIVO

El estándar para identificar los archivos es el siguiente:

D01_aaaamddEEEEnnnnnnnnnnnnnrrrr.xml

En donde:

aaaamdd : Fecha de transmisión
EEE : Identificador del tipo de entidad que envía el archivo (SNR)
nnnnnnnnnnnn : El número de NIT del SN/SR (Con dígito de verificación).
Para completar los 12 dígitos se rellena con ceros a la izquierda.

PC

HUH



Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

rrrr : Número de archivo enviado. Cuando en un día se reporta más de un archivo, estos deben ir numerados consecutivamente.

Ejemplo: El Sistema de Negociación y Registro "SisNegReg" identificado con el NIT número 842.047.462-1 identificará el primer archivo reportado el día 02 de febrero de 2014 con la información de las operaciones a transmitir así:

Nombre del archivo: D01_20140202SNR0084204746210001.xml

Donde:

Fecha de transmisión : 20130202 (8 dígitos)
Tipo de entidad : SNR
NIT S.N.R : 008420474621 (12 dígitos)
Número de archivo : 0001
Extensión : xml

Notas:

1. Se debe observar que el NIT de SisNegReg consta de 10 dígitos (incluyendo el dígito de verificación) y se completan los 12 dígitos con ceros a la izquierda.
2. El número de archivo corresponde a 0001 dado que este es el primer archivo reportado el día 1 de octubre de 2013.

5. ESTRUCTURA DEL ARCHIVO

Los archivos deben ser documentos XML estándar, los cuales deben cumplir con las características descritas en este capítulo y ser válidos respecto al esquema XSD (XML Schema Definition) establecido por el BR. A continuación se describen las características principales de cada una de las partes del documento.

5.1. PRÓLOGO

El prólogo del documento debe incluir los siguientes elementos:

1. La especificación de XML empleada, la cual debe ser la establecida en la versión 1.0, Tercera edición.
2. El conjunto de caracteres utilizado en el documento XML, que debe ser el alfabeto latino No. 1: "UTF-8", (el archivo no debe contener caracteres acentuados).

PC

12/11



Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

5.2. CUERPO

El cuerpo del documento XML para la transmisión de operaciones estará identificado por las etiquetas <Reporte></Reporte>, y en él se manejarán dos elementos, un encabezado y un contenido. El encabezado estará definido entre las etiquetas <Encabezado></Encabezado> y el contenido, que representa las operaciones informadas, se incluirá entre las etiquetas <Operaciones></Operaciones>.

5.3. FORMATO DEL ENCABEZADO

La sección de encabezado cuya etiqueta inicial es <Encabezado> y su etiqueta final es </Encabezado>, contiene en su estructura los siguientes elementos: Nit (del SN/SR), Tipo de Entidad (SNR), fecha de transmisión, versión del formato, consecutivo del archivo y cantidad de registros. En la siguiente tabla, se encuentra la descripción de cada uno de los elementos mencionados.

Etiqueta de la variable	Tipo	Longitud Máxima	Validaciones	Observaciones
Nit	Entero	12		Nit del SN/SR incluyendo el dígito de verificación
Tipo de entidad	Entero	3	Debe ser SNR	
Fecha Transmisión	Fecha	10	Debe ser una fecha calendario	Debe corresponder a la fecha de envío.
Versión	Entero	2		Versión=1
Consecutivo Archivo	Entero	4	Debe ser un consecutivo para cada archivo enviado	
Cantidad Registros	Entero		Se envían archivos con máximo 100 registros, si se requiere enviar más de 100 registros se fraccionará la información en varios archivos de 100.	Cantidad de Registros reportados en el contenido

PC

HVH



30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

5.4. FORMATO DEL CONTENIDO

La sección de contenido será la que incluye la información de las operaciones reportadas, esta sección iniciará con la etiqueta <Operaciones> y finalizará con la etiqueta </Operaciones>.

5.4.1. Estructura de los instrumentos y sus atributos.

Cada elemento registrado en la sección de contenido corresponde a una operación reportada, así, para identificar el tipo de instrumento deben utilizarse las siguientes etiquetas:

Instrumento	Etiqueta	Entidad
Forward peso dólar	FYPD	SNR
Opciones peso dólar	OPPD	SNR
Swap peso dólar	SWPD	SNR
Swap interés peso dólar	SWPID	SNR
Forward otras monedas	FWOM	SNR
Opciones otras monedas	OPOM	SNR
Swap otras monedas	SWOM	SNR
Swap interés otras monedas	SWIOM	SNR
Forward tasa de interés	FWTI	SNR
Opciones tasa de interés	OPTI	SNR
Otros derivados	OD	SNR

5.4.2. Variables de los instrumentos negociados.

A continuación se describen las variables que deben incluirse en los registros de cada uno de los instrumentos reportados, teniendo en cuenta que algunas aplican para el reporte de todos los instrumentos, y otras solamente para un conjunto específico de estos. También se establecen las reglas de validación y la estructura que debe cumplir cada una de las variables reportadas.

Las siguientes consideraciones adicionales deben tenerse en cuenta para la formación del documento en todas las variables:

1. En la información de una variable en particular NO puede existir el carácter (‘) o (“)
2. El separador de los decimales es punto (.).

PC

HUT



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-6

30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

A continuación se muestra una relación de las variables requeridas por tipo de instrumento:

VARIABLE	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
	FYPD	OPPD	SWPD	SWPID	FWOM	OPOM	SWOM	SWIOM	FWTI	OPTI	OD
TipoNovedad	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NumeroRegistro	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
FechaOper	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NITSNRoIMC	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L
NITSNRoIMCRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NumRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaOpAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaVen	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
MontoOperacion	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Moneda1					X	X	X	X	X	X	X
TasaContado	X		X		X		X				X
TasaPactada1Precio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaPactada2			X	X			X	X			X
Moneda2					X	X	X	X			X
PeriodicidadFlujoM1				X				X			X
PeriodicidadFlujoM2				X				X			X
MontoDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
MontoNDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaReferenciaSubyacente	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Opcionalidad	X				X				X		X
TipoOpcionalidad	X				X				X		X
AceptadoCamara	X		X								X
FechaCRCC	X		X								X
TipoOpcion		X				X				X	X
TipoEjercicioOpcion		X				X				X	X
PrimalInicial		X				X				X	X
Condicion		X				X				X	X
PlazoTasa									X	X	X
RegistroPrevio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X

X = Obligatorio, O = Opcional, L = Se lee del Nombre del Archivo

PC

HH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1 -7

Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

Cada una de las variables mencionadas en la relación anterior, debe cumplir con las siguientes características:

TipoNovedad	Corresponde al tipo de novedad que se está reportando con el registro.		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe ser una de las cuatro descritas.	Inicial (I): Cuando la operación se reporta por primera vez; Modificación (M): Cuando durante la vigencia del contrato se modifica alguna de las condiciones; Aclaración (A): Cuando se reporta una corrección a la información reportada y aceptada inicialmente; Fraccionamiento (F): Cuando el reporte corresponde a la división de una operación ya reportada. En el archivo se deben organizar las operaciones, según el tipo de novedad, en el siguiente orden: Iniciales (I), Modificaciones (M), Aclaraciones (A) y Fraccionamientos (F).

El reporte de Modificaciones (M), Aclaraciones (A) o Fraccionamientos (F) sólo aplica para registros que ya han sido recibidos y aceptados por el BR. Como regla, cuando se reporte alguna de estas novedades, la operación se debe identificar de la siguiente forma: el NIT del SN/SR, el número de registro de la operación (Variable **NumeroRegistro**) y la fecha de Operación (**FechaOper** que corresponde a la fecha en que se realizó la Modificación (M), la aclaración (A), o el fraccionamiento (F)). Adicionalmente, se debe reportar el número de consecutivo de la operación anterior (a través de la variable: **NumRegAnterior**), el número de NIT del sistema de registro de la operación anterior (A través de la variable: **NITSNRoIMCRegAnterior**) y la fecha en que se realizó la operación anterior (a través de la variable: **FechaOpAnterior**).

Internamente, el BR, guardará la fecha y número de registro del reporte con que se informó la operación por primera vez. Igualmente, cuando un SN/SR reporta un tipo de novedad de Modificación (M), aclaración (A), o fraccionamiento (F), el BR verifica que la operación anterior se encuentre activa y procederá a desactivarla y dejará activa la última operación reportada.

En el caso de Modificaciones (M) o Aclaraciones (A), deben diligenciarse todas las variables de la operación; y únicamente la(s) variable(s) que se están modificando o aclarando, deben diferir de la información reportada inicialmente y deben realizarse antes del vencimiento de la operación. Las operaciones podrán ser modificadas en cualquiera de las variables y atributos con excepción de: TipoIDPuntaCompra, TipoIDPuntaVenta, IDPuntaCompra, IDPuntaVenta, NombrePuntaCompra y NombrePuntaVenta.

En los Fraccionamientos (F) la suma del valor de cada operación que conforma el fraccionamiento debe corresponder al valor del instrumento original. En un fraccionamiento no se pueden modificar las variables: TipoIDPuntaCompra, TipoIDPuntaVenta, IDPuntaCompra, IDPuntaVenta, NombrePuntaCompra y NombrePuntaVenta.

PC

HH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-8

30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

Número Registro		Número de registro de la operación.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	15	Para cada fecha de Operación debe existir una serie de caracteres recomendablemente consecutivos. Este campo no puede venir blanco, vacío o nulo.	Es un número único para cada uno de los instrumentos de una fecha de operación y para cada uno de los tipos de novedad.
FechaOper		Corresponde a la fecha de negociación del instrumento cuando la operación corresponde a una novedad de tipo I (Inicial). En el caso de una novedad tipo M, A, o F debe corresponder a la fecha en que se realizó la Modificación, la Aclaración o el Fraccionamiento.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Cuando la operación corresponde a una novedad de tipo I (Inicial), la fecha debe corresponder a la de negociación y en el caso de una novedad tipo M, A o F debe corresponder a la fecha en que se realizó la Modificación, la Aclaración, el Fraccionamiento. Para el tipo de novedad I, la fecha de operación debe ser la del día anterior a la fecha en la que se reportan las operaciones.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). Esta fecha debe corresponder a un día que exista en el calendario y debe ser un día hábil
NITSNRoIMC RegAnterior		Número de NIT del SN/SR con que se reportó la operación sujeta a modificación (en caso que el SN/SR sea distinta a inicial).	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	12	Únicamente debe diligenciarse cuando se reporta una novedad tipo M, A o F.	Se debe registrar el número de NIT del SN/SR con que se reportó la operación anterior. Debe existir el registro anterior en la base de datos del BR (El número de NIT anterior, el número de registro anterior y la fecha de operación anterior) y se debe encontrar vigente (El campo es último debe ser "S")
NumRegAnterior		Número de Registro con que se reportó la operación sujeta a modificación (en caso que el tipo de operación sea distinta a inicial).	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	15	Únicamente debe diligenciarse cuando se reporta una novedad tipo M, A o F.	Se debe registrar el número de registro con que se reportó la operación anterior. Debe existir el registro anterior en la base de datos del BR (El número de NIT anterior, el número de registro anterior y la fecha de operación anterior) y se debe encontrar vigente (El campo es último debe ser "S")

PC

1704



30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

FechaOpAnterior			
Corresponde a la fecha en la cual fue reportada la operación sujeta a modificación (en caso que el tipo de operación sea distinta a inicial).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Únicamente debe diligenciarse cuando se reporta una novedad tipo M, A o F. El formato de la fecha debe ser AAAA-MM-DD.	Se debe registrar la fecha con que se reportó la operación anterior. Debe existir el registro anterior en la base de datos del BR (El número de NIT anterior, el número de registro anterior y la fecha de operación anterior) y se debe encontrar vigente (El campo es último debe ser "S")
FechaVen			
Fecha de vencimiento del instrumento.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Esta fecha debe ser posterior a la fecha de negociación (Fecha de Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).
TipoIDPuntaVenta			
Tipo de documento de identificación de la parte vendedora en el contrato.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	2	Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones.	Tipo de documento del titular: CC: Cédula de ciudadanía CE: Cédula de extranjería NI: NIT PB: Pasaporte RC: Registro civil SW: Código swift para no residentes AB: Código ABBA para no residentes ID: Otro documento para no residentes
TipoIDPuntaCompra			
Tipo de documento de identificación de la parte compradora en el contrato.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	2	Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones.	Tipo de documento del titular: CC: Cédula de ciudadanía CE: Cédula de extranjería NI: NIT PB: Pasaporte RC: Registro civil SW: Código swift para no residentes AB: Código ABBA para no residentes ID: Otro documento para no residentes
IDPuntaVenta			
Número del documento de identificación de la parte vendedora en el contrato.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	12		Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. El IDPuntaVenta debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos.
IDPuntaCompra			
Número del documento de identificación de la parte compradora en el contrato.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	12		Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. El IDPuntaCompra debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos.

PC

HUH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-10

30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

NombrePuntaVenta		Nombre de la parte vendedora en el contrato.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	40		Razón social o nombre de la parte vendedora.
NombrePuntaCompra		Nombre de la parte compradora en el contrato.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	40		Razón social o nombre de la parte compradora.
SubsectorPuntaVenta		Código Sector de la actividad económica de la parte que desarrolla la venta.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	8	Debe corresponder al código CIU o en su defecto a una de las descritas en el Anexo	Código CIU/Tabla de Sectores
SubSectorPuntaCompra		Código Subsector de la actividad económica de la parte que desarrolla la compra en el contrato	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	8	Debe corresponder al código CIU o en su defecto a una de las descritas en el Anexo	Código CIU/Tabla de Sectores
MontoOperación		Valor nominal de la operación.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númerico	24	18 enteros y 6 decimales. El monto de la Operación debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos. Debe ser igual a la suma de MontoDF y MontoNDF.	El monto nominal de la operación expresado en términos de la Moneda 1.
Monedal		Código Moneda 1.	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	3	Debe corresponder con los códigos de moneda manejados por el Sistema SWIFT.	Se refiere a la moneda en que está representado el monto de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar (FX swap), opciones peso-dólar y swap peso dólar y de interés, donde la moneda 1 por defecto es el dólar. En los instrumentos swaps peso dólar e interés y swaps otras monedas y de interés se refiere a la moneda de los flujos atados a la primera tasa de interés pactada. Por otra parte, para los instrumentos que solo incluyen una moneda (forwards tasa de interés y opciones tasa de interés), este campo se refiere a la moneda en la cual se realiza la operación.
TasaContado		Tasa de contado vigente en el momento en que se negoció la operación de derivados (aplica para forward peso dólar, swaps peso dólar (FX swap), forward otras monedas y swap otras monedas)	
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númerico	11	5 enteros y 6 decimales. Cuando se reporta un instrumento tipo 1, es obligatorio el diligenciamiento de la Tasa de Contado.	Debe ser expresada en número de moneda 2 por moneda 1, por ejemplo (COP por USD). Ejemplo: para un tipo de cambio peso dólar de 2,164.00 se debe reportar: 2164.000000.

PC

12/11



Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

TasaPactada2	En los instrumentos Swap peso-dólar y swap otras monedas, se refieren a la tasa pactada para la punta spot de la operación. En los instrumentos swap peso-dólar e interés y swap otras monedas e interés, se refiere a la tasa de interés correspondiente a los flujos en la moneda 2.		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	11	5 enteros y 6 decimales	En los instrumentos swap peso-dólar e interés y swap otras monedas y de interés debe ser la tasa de interés correspondiente a los flujos en la moneda 2. En los instrumentos swap peso-dólar (FX swap), se refieren a la tasa pactada para la punta spot de la operación. Ejemplo: para un tipo de cambio de 2164 Pesos por Dólar, la tasa se debe reportar como 2164.000000; como Atributo Moneda 1 se debe reportar el Dólar (USD) y como Atributo Moneda 2 el Peso (COP).
Moneda2	Código de la Moneda 2.		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	3	Debe corresponder con los códigos de moneda manejados por el Sistema SWIFT	Se refiere a la segunda moneda de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar (FX swap), opciones peso-dólar, swap peso dólar e interés, forwards tasa de interés y opciones tasa de interés.
TasaPactada1Precio	<ul style="list-style-type: none"> - En los instrumentos que involucran tasas de cambio sin flujos de interés (spot, forward peso-dólar, swap peso-dólar (FX swap), opciones peso-dólar, forwards otra monedas, swaps otras monedas y opciones otras monedas), en este campo se debe llenar la tasa pactada en unidades de la moneda 2 que serán intercambiadas por la moneda 1. Por ejemplo: si moneda1 es euro y moneda 2 es dólar y el instrumento es uno de los mencionados anteriormente, la tasa a llenar sería cuantos dólares deben ser entregados por cada euro (por ejemplo 1.3USD por EUR). - En los instrumentos swaps peso-dólar y de interés, swaps otras monedas y de interés y forwards de tasa de interés, se debe llenar la tasa de interés correspondiente a la moneda 1. - En el caso de los forwards de tasa de interés, se debe especificar la tasa de interés pactada en la moneda1. 		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	11	5 enteros y 6 decimales.	En los instrumentos que involucran tasas de cambio sin flujos de interés (forward peso-dólar, swap peso-dólar (FX swap), opciones peso-dólar, forwards otra monedas, swaps otras monedas y opciones otras monedas), en este campo se debe llenar la tasa pactada en unidades de la moneda 2 que serán intercambiadas por la moneda 1. Por ejemplo: si moneda1 es euro y moneda 2 es dólar y el instrumento es uno de los mencionados anteriormente, la tasa a llenar sería cuantos dólares deben ser entregados por cada euro (por ejemplo 1.3USD por EUR). Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3USD por EUR la tasa se debe reportar como 1.300000. Como Moneda 1 sería Euro (EUR) y como Moneda 2 el Dólar (USD). Ejemplo: para un tipo de cambio de 2164 Pesos por Dólar, la tasa se debe reportar como 2164.000000; como Atributo Moneda 1 sería Dólar (USD) y como Atributo Moneda 2 el Peso (COP). En los instrumentos que involucran tasas de interés (swaps peso-dólar y de interés, swaps otras monedas e interés y forwards de tasa de interés), se debe llenar la tasa de interés correspondiente a la moneda 1. En el caso de los forwards de tasa de interés, la tasa de interés pactada. En las opciones sobre índices bursátiles se debe especificar el precio pactado por el subyacente en términos de la moneda1.

PC

27/14



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-12

30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

PeriodicidadFlujoM1			
Indica la periodicidad de los flujos en la moneda 1 (si aplica) en términos de meses. Puede contener decimales.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	11	5 enteros y 6 decimales.	Para los instrumentos swaps peso-dólar e interés y swaps otras monedas e interés, se refiere a la periodicidad de los flujos en la moneda 1.
PeriodicidadFlujoM2			
Indica la periodicidad de los flujos en la moneda 2 (si aplica) en términos de meses. Puede contener decimales.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	11	5 enteros y 6 decimales.	Para los instrumentos swaps peso-dólar e interés y swaps otras monedas e interés, se refiere a la periodicidad de los flujos en la moneda 2.
MontoDF			
Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento efectivo (DF).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	24	18 enteros y 6 decimales En un reporte inicial (TipoNovedad="I") debe estar diligenciado MontoDF y/o MontoNDF .	Ejemplo: el valor 1,452,560.900 se reporta como 1452560.90. La moneda en que está expresado el monto debe definirse en el atributo Moneda1 . Cuando no existe valor se debe diligenciar cero.
MontoNDF			
Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento financiero (NDF).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	24	18 enteros y 6 decimales En un reporte inicial (TipoNovedad="I") debe estar diligenciado MontoDF y/o MontoNDF .	Ejemplo: el valor 1,452,560.900 se reporta como 1452560.90. La moneda en que está expresado el monto debe definirse en el atributo Moneda1 . Cuando no existe valor se debe diligenciar cero.
TasaReferenciaSubyacente			
Tasa de referencia a la cual se realizará el cumplimiento del contrato o subyacente de referencia			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Númérico	11	5 enteros y 6 decimales. La tasa de referencia debe venir diligenciada, si el MontoNDF es diferente de cero.	Se define como la tasa de mercado, convenida entre las partes, con el fin de ser utilizada para la liquidación de los contratos cuyo cumplimiento es financiero (NDF).
AceptadoCamara			
Indica si la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser S o N.	Aceptado por una CRCC (S), o No Aceptado por una CRCC (N).
Opcionalidad			
Indica si el contrato forward tiene una opción implícita.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser S o N.	Sí tiene opción implícita (S), o no tiene opción implícita (N).
TipoOpcionalidad			
Describe la opción implícita del forward en caso que el campo anterior sea afirmativo.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	50		No debe ser vacía si el campo opcionalidad es (S).
TipoOpción			
Tipo de opción negociada: Call o Put.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser C o P	Call (C) o Put (P)

PC

HVH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-13

Fecha: **30 MAYO 2014**

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

FechaCRCC			
Fecha en que la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Para los instrumentos tipo 1 y 11 esta fecha debe ser anterior a la fecha de vencimiento de la operación. Esta variable debe ser mayor o igual a la fecha de negociación (Fecha de Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I). Mientras la operación no haya sido aceptada por una CRCC, esta variable no se debe incluir.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). Dado que la operación puede ser aceptada por la CRCC en cualquier momento durante la vigencia del contrato, un cambio en esta condición debe ser reportado como una modificación (M).
TipoEjercicioOpcion			
Tipo de opción negociada: Americana o Europea.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	3	Debe ser AME o EUR	Americana (AME) ó Europea (EUR)
Condicion			
Describe la condición de ejercicio de la opción.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	50		Se describe la condición de ejercicio. En el caso de opciones con strike, este campo se refiere al strike de la opción (en Opciones peso-dólar y Opciones Otras Monedas debe ser llenado en términos de unidades de moneda dos por moneda 1). Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3 Dólares por Euro la tasa se debe reportar como 1.300000 (euro es la moneda 1 y dólar la moneda 2. Aplica para opciones peso-dólar y opciones otras monedas. Para opciones de índices bursátiles y opciones tasa de interés se da en términos de moneda 1).
PrimalInicial			
Corresponde al pago inicial para entrar en el contrato (aplica para Opciones).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	14	8 enteros y 6 decimales Si no hay pago inicial esta variable no se debe reportar.	La moneda en que está expresado el monto debe definirse en el atributo moneda1.
PlazoTasa			
Para los instrumentos sobre tasa de interés (forward tasa de interés y opciones tasa de interés) se debe reportar el plazo que esta aplicará (en días).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	4		Esta variable aplica para forwards tasa de interés y Opciones Tasa de Interés
FechaVenSubyacente			
Fecha de vencimiento del subyacente.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Esta fecha debe ser posterior a la fecha de negociación (Fecha de Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I) y mayor a la variable Fecha ven.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).
RegistroPrevio			
Este campo debe indicar si esta operación fue negociada o registrada previamente en otro sistema (S/N).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser S o N.	Registrada o negociada previamente en otro sistema (S), o no (N).

PC

MUH



Fecha: 30 MAYO 2014

**ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

De acuerdo a la definición anterior de las variables para el reporte de operaciones de derivados, un ejemplo de una operación FWPD en formato XML será:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Reporte xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xmlns="http://www.banrep.gov.co"
  xsi:schemaLocation="http://www.banrep.gov.co reporte.xsd">
<Encabezado>
  <Nit>000845236987</Nit>
  <TipoEntidad>SNR</TipoEntidad>
  <FechaTransmision>2013-09-10</FechaTransmision>
  <Version>1</Version>
  <ConsecutivoArchivo>0001</ConsecutivoArchivo>
  <CantidadRegistros>1</CantidadRegistros>
</Encabezado>

<Operaciones>
  <FWPD>
    <TipoNovedad>I</TipoNovedad>
    <TipoIDPuntaVenta>NI</TipoIDPuntaVenta>
    <IDPuntaVenta>123456789</IDPuntaVenta>

    <NombrePuntaVenta><![CDATA[NombreParte]]></NombrePuntaVenta>
    <NumeroRegistro>123</NumeroRegistro>
    <FechaOper>2013-06-05</FechaOper>
    <FechaVen>2013-07-24</FechaVen>
    <TipoIDPuntaCompra>NI</TipoIDPuntaCompra>
    <IDPuntaCompra>987654321</IDPuntaCompra>

    <NombrePuntaCompra><![CDATA[Nombre]]></NombrePuntaCompra>
    <SubsectorPuntaVenta>F</SubsectorPuntaVenta>
    <SubsectorPuntaCompra>R</SubsectorPuntaCompra>
    <MontoOperacion>5007500.00</MontoOperacion>
    <TasaContado>2164.000000</TasaContado>
    <TasaPactada1Precio>2.10</TasaPactada1Precio>
    <MontoDF>2500000</MontoDF>
    <MontoNDF>2507500</MontoNDF>
    <TasaReferenciaSubyacente>2.20</TasaReferenciaSubyacente>
    <Opcionalidad>S</Opcionalidad>
    <TipoOpcionalidad><![CDATA[Describe la
opcion]]></TipoOpcionalidad>
    <AceptadoCamara>S</AceptadoCamara>
```

PC

HUH



Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

<FechaCRCC>2013-06-02</FechaCRCC>

<RegistroPrevio>N</RegistroPrevio>

</FWPD>

</Operaciones>

</Reporte>

5.5. VALIDACIONES GENERALES.

La información reportada tendrá el siguiente proceso de validación:

- Validación 1 de 4 - Nombre del archivo: Se valida que el formato de nombre de archivo sea correcto. Cuando se rechaza un archivo por cualquiera de las validaciones de nombre de archivo, no se continúa realizando las demás validaciones.
- Validación 2 de 4 – Estructura: Se valida que el archivo tenga la estructura XML de acuerdo a la versión de XSD vigente (proporcionada por el BR).
- Validación 3 de 4 – Datos: De acuerdo a las validaciones establecidas para cada uno de los campos reportados, y como resultado de dichas validaciones se procederá a aceptar o rechazar las operaciones. El resultado de dicha validación será informado a cada SN/SR y solo se considerará como información recibida aquellos registros que cumplan con todas las validaciones definidas.
- Validación 4 de 4 - Negocio: En esta etapa se evalúa que la información de las operaciones sea coherente con el mercado y las condiciones de los instrumentos.

6. CANCELACIÓN O ELIMINACIÓN DE OPERACIONES

Para la cancelación o eliminación de operaciones reportadas a través de archivos XML, los SN/SR deben enviar una comunicación escrita al BR, donde justifiquen la razón para la cancelación o eliminación de la operación.

7. TABLA DE CLASIFICACIÓN DE ACTIVIDADES ECONÓMICAS.

- A AGRICULTURA, GANADERIA, CAZA, SILVICULTURA, EXTRACCION DE MADERA, PESCA Y ACTIVIDADES DE SERVICIOS CONEXAS
- B EXPLOTACION DE MINAS Y CANTERAS, EXTRACCION PETROLEO CRUDO Y GAS NATURAL
- C INDUSTRIA MANUFACTURERA
- D SUMINISTRO DE ELECTRICIDAD, GAS, Y AGUA
- E CONSTRUCCION
- F COMERCIO
- G TURISMO, HOTELES Y RESTAURANTES

PC

17VH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-16

Fecha:

30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

H TRANSPORTE, MANIPULACION DE CARGA, ALMACENAMIENTO Y DEPÓSITO

I CORREO Y TELECOMUNICACIONES

J INTERMEDIACION FINANCIERA - EXCEPTO FINANCIACION PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS (DIVISIONES J1 A J14)

J1 BANCA CENTRAL

J2 BANCOS COMERCIALES Y BANCOS ESPECIALIZADOS EN CARTERA HIPOTECARIA

J3 CORPORACIONES FINANCIERAS (INCLUYE IFI)

J4 COMPAÑÍAS DE FINANCIAMIENTO COMERCIAL (INCLUYE COMPAÑÍAS DE LEASING)

J5 COOPERATIVAS FINANCIERAS Y FONDOS DE EMPLEADOS

J6 SOCIEDADES FIDUCIARIAS

J7 SOCIEDADES DE CAPITALIZACION

J8 ACTIVIDADES DE COMPRA DE CARTERA (FACTORING)

J9 BOLSA DE VALORES

J10 SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSA

J11 CASAS DE CAMBIO

J12 ENTIDADES FINANCIERAS OFICIALES ESPECIALES: FEN, ICETEX, BANCOLDEX, FINAGRO, FINDETER Y FONADE

J13 OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS

K ENTIDAD FINANCIERA NO RESIDENTE

L FINANCIACION DE PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS (DIVISIONES L1 A L5)

L1 PLANES DE SEGUROS GENERALES, SEGUROS DE VIDA Y REASEGUROS

L2 PLANES DE PENSIONES VOLUNTARIAS

L3 PLANES DE CESANTIAS

L4 PLANES DE PENSIONES DE AFILIACION OBLIGATORIA

L5 PLANES DE PENSIONES DEL REGIMEN DE PRIMA MEDIA (INCLUYE: SEGURO SOCIAL, CAJANAL, CAPRECOM, ENTRE OTROS)

M ACTIVIDADES EMPRESARIALES: ACTIVIDADES INMOBILIARIAS, ALQUILER DE MAQUINARIA Y EQUIPO, INFORMATICA Y ACTIVIDADES CONEXAS, INVESTIGACION Y DESARROLLO, OTRAS ACTIVIDADES EMPRESARIALES

N ADMINISTRACION PUBLICA Y DEFENSA

O EDUCACION, ACTIVIDADES CULTURALES Y DEPORTIVAS, ACTIVIDAD DE ASOCIACIONES

P SERVICIOS SOCIALES Y DE SALUD

PC

17 V14



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317
ANEXO No. 1

A1-17

Fecha: **30 MAYO 2014**

**ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

Q ORGANIZACIONES Y ORGANOS EXTRATERRITORIALES
R PERSONA NATURAL

PL

HUH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317 A2 -1
ANEXO No. 2

30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

CARTA DE SOLICITUD Y ACUERDO DE SERVICIO

Señores

BANCO DE LA REPÚBLICA
Dirección General de Tecnología
Carrera 7 No. 14 - 78
La Ciudad

Ref.: Solicitud y acuerdo para acceso al sistema SEBRA- HTRANS.
SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES
SOBRE DIVISAS.

Apreciados señores:

Yo _____, identificado con Cédula de Ciudadanía No. _____
de _____, actuando en mi calidad de representante legal de la sociedad
_____, entidad administradora del Sistema de Negociación/Sistema de Registro de
Operaciones sobre Divisas *nombre del Sistema de Negociación/Registro de Operaciones Sobre
Divisas*, autorizado por la Superintendencia Financiera de Colombia para operar mediante
Resolución N° _____ del _____ de _____ de _____, solicito el acceso al Sistema SEBRA
(Servicios Electrónicos del Banco de la República) para el uso de del mecanismo HTRANS
(Sistema para la Transferencia de Archivos), con el fin dar cumplimiento a los deberes de envío de
información señalados en la Resolución Externa 4 de 2009 de la Junta Directiva del Banco de la
República y en la Circular Reglamentaria Externa DODM-317, correspondiente al Asunto 19:
“Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas” y las demás
normas que las modifiquen, complementen o sustituyan.

Para el efecto, manifiesto que la sociedad que represento se compromete a aceptar y dar
cumplimiento a las condiciones técnicas y de seguridad para el acceso y uso del mencionado
sistema, establecidas en las circulares reglamentarias externas, en los manuales operativos y del
usuario, y en las demás normas que regulan el funcionamiento del SEBRA, así como las
Condiciones de Uso que se encuentran en el Anexo 3 de la circular reglamentaria externa antes
mencionada.

Adicionalmente, declaro que acepto los costos establecidos por el Banco de la República para el
suministro de los dispositivos de seguridad requeridos para el acceso al mencionado sistema.

Cordialmente,

Representante Legal¹

¹ Acompañar certificado de existencia y representación legal con fecha de expedición no mayor a treinta (30) días.

PC



30 MAYO 2014

Fecha:

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

**Condiciones de Uso del Sistema SEBRA -Servicios Electrónicos del Banco de la República
- Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas -**

Marco normativo del Sistema SEBRA

El SEBRA es un portal de seguridad que permite acceder a los servicios electrónicos del Banco de la República para realizar operaciones, recibir y/o transmitir información a través de una conexión segura. Dentro de los servicios electrónicos del SEBRA se encuentra el mecanismo denominado HTRANS, el cual es independiente de los demás servicios electrónicos.

El Sistema SEBRA se encuentra contemplado en la Circulares Reglamentaria Externas SGINF- 273, en los manuales operativos y del usuario, y en las demás normas que regulan el funcionamiento del SEBRA, disponibles en la página Web del Banco de la República en el siguiente vínculo <http://www.banrep.gov.co/es/wsebra>

HTRANS permite la transmisión segura de la información y la posibilidad de verificar su envío y recepción; en el caso de los Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas dicho envío se debe efectuar mediante el empleo de los formatos y con base en las instrucciones para su diligenciamiento y transmisión que se señalan en el Anexo No. 1 de la presente reglamentación.

La documentación para el uso de HTRANS se encuentra disponible en la página Web del Banco de la República (BR) en el enlace <https://wsebra.banrep.gov.co/HTRANS/manual>

Condiciones de Uso

Las condiciones de uso para el sistema informático de transmisión de información HTRANS a través de la plataforma electrónica del Sistema SEBRA, en adelante el Sistema, son las que se mencionan a continuación, por lo que deben ser leídas y conocidas antes de iniciar su utilización:

1. Definiciones

Para efectos de las Condiciones de Uso se definen los siguientes términos:

- a. Contenidos: Todas las formas de información o datos que se divulgan en el Sistema, entre los que se encuentran: textos, imágenes, fotos, logos, diseños, animaciones, entre otros.

R

27/04



Fecha: 30 MAYO 2014

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

- b. Internet: Herramienta de comunicación con decenas de miles de redes de computadoras unidas por el protocolo TCP/IP. Sobre esta red se pueden utilizar múltiples servicios como por ejemplo correos electrónicos, www, etc.
- c. Publicar: Hacer que una información esté disponible en el Sistema.
- d. Servicios: Son las ayudas en línea que el BR provee actualmente o que piensa proveer en el futuro a los usuarios, para este caso particularmente los relacionados con el mecanismo HTRANS.
- e. Usuario: Es toda persona que ingresa al Sistema.

2. Aceptación de Términos

Cuando el Usuario accede al Sistema lo hace bajo su total responsabilidad y por tanto, se entiende que acepta plenamente y sin reservas las Condiciones de Uso del mismo, así como la obligación de atenderlas.

El BR hace sus mejores esfuerzos para que el Sistema funcione con óptima calidad, y en tal sentido el Usuario acepta utilizarlo. No obstante, el BR no se hace responsable por el uso indebido del Sistema, ni por la suspensión parcial, total, transitoria o definitiva del mismo.

El Usuario asumirá el costo de los dispositivos de seguridad TOKENS- OTP conforme a lo señalado en la Circular Reglamentaria Externa SGINF- 273.

Responsabilidad por la información

El Usuario debe abstenerse de usar el Sistema para transmitir hacia él mismo, a otros usuarios o a cualquier otra persona, información de contenido obsceno, difamatorio, injurioso, calumnioso o discriminatorio contra cualquier persona, el BR, sus funcionarios o administradores del Sistema. No se aceptarán Contenidos que pueden ser considerados como ofensivos, sexistas, racistas o discriminatorios.

Así mismo, el Usuario se compromete a no difundir, comentar, divulgar, publicar, copiar o hacer uso diferente de la información que el BR ponga a su disposición para el uso del Sistema.

En general, el Usuario responderá por su conducta y por el contenido de textos, gráficos, fotos, videos o cualquier otro tipo de información de la cual haga uso o incluya en el Sistema.

El BR no será responsable de ningún daño ocasionado en virtud de cualquier alteración que se haya efectuado a los materiales, archivos de descarga o la información ingresada por el Usuario al Sistema.

PC

HVH



Fecha: 30 MAYO 2014

**ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO
DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

3. Obligaciones y responsabilidades del Usuario

Con la suscripción de la Carta de Solicitud y Acuerdo de Servicio y, en todo caso, por el ingreso al Sistema, el Usuario se obliga a cumplir con las siguientes obligaciones:

- a. Contar y mantener los requerimientos técnicos requeridos por el BR para el acceso y uso del Sistema.
- b. Adoptar las medidas que se requieran para mantener la seguridad de su contraseña y de los dispositivos de seguridad (TOKENS- OTP), los cuales son otorgados únicamente para acceder al Sistema. El Usuario podrán autorizar a uno o varias personas a su cargo, bajo su exclusiva responsabilidad, para utilizar tales elementos, por medio del formato de novedades de usuarios del portal de aplicaciones, disponible en el siguiente vínculo:
<http://www.banrep.gov.co/es/wsebra>.
- c. Atender las condiciones de seguridad informática y confidencialidad señaladas por el BR.
- d. Responder por cualquier actividad que se lleve a cabo bajo su registro, esto es, mediante el uso de su contraseña y dispositivos de seguridad.
- e. No abusar, acosar, amenazar o intimidar a otros usuarios del Sistema.
- f. No usar el Sistema como medio para desarrollar actividades ilegales o no autorizadas tanto en Colombia, como en cualquier otro país.
- g. Abstenerse de usar el Sistema en formas que malintencionadamente sobrecarguen, dañen o inutilicen las redes, servidores y demás equipos informáticos o productos y aplicaciones informáticas del BR o de terceros.
- h. Abstenerse de enviar correo electrónico no deseado (SPAM) a otros usuarios, o transmitirles virus o cualquier código de naturaleza destructiva.
- i. Abstenerse de explotar de cualquier forma los derechos de propiedad intelectual del BR, incluidos sus signos distintivos, patentes de invención, modelos de utilidad, diseño industriales, derechos de autor sobre el software y todos aquellos de los que tenga conocimiento por el uso del Sistema;

El BR no será responsable por el incumplimiento por parte de un Usuario a las Condiciones de Uso. El Usuario acepta eximir al BR y mantenerlo indemne de cualquier responsabilidad que se derive del incumplimiento a las Condiciones de Uso, lo cual incluye daños y perjuicios causados a otros usuarios y/o a cualquier tercero.

4. Ley aplicable y jurisdicción

- a. Las Condiciones de Uso se rigen por las leyes de la República de Colombia.
- b. Si cualquier disposición de las Condiciones de Uso pierde validez o fuerza obligatoria, por cualquier razón, todas las demás disposiciones conservan su fuerza obligatoria, carácter vinculante y generarán todos sus efectos.

PC

HWH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317 A3-4
ANEXO No. 3

Fecha: **30 MAYO 2014**

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

- c. Para cualquier efecto legal o judicial, el lugar de las Condiciones de Uso es la ciudad de Bogotá, República de Colombia, y cualquier controversia que surja de su interpretación o aplicación se someterá a los jueces de la República de Colombia.

5. Modificaciones a las Condiciones de Uso

El BR podrá actualizar y modificar, en cualquier momento, las Condiciones de Uso y los contenidos del Sistema. Tales ajustes entrarán en vigencia una vez hayan sido comunicados en la forma señalada en la presente Circular Reglamentaria Externa.

PC

WJH