



Banco de la República Colombia

BOLETÍN

No. 49
 Fecha 30 de Septiembre de 2015
 Páginas 11

Página

CONTENIDO

| | |
|--|---|
| Circular Reglamentaria Externa DODM-139 del 30 de septiembre 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-146 del 30 de septiembre de 2015 "Asunto 8: Metodología de cálculo de la Tasa de Cambio representativa del mercado". | 3 |
| Circular Reglamentaria Externa DODM-317 del 30 de septiembre 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 DESARROLLO DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM - 146**

Hoja 8-00

Fecha: 30 SET. 2015


Destinatario: Oficina Principal y Sucursales del Banco de la República; Superintendencia Financiera de Colombia; Ministerio de Hacienda y Crédito Público; Intermediarios del Mercado Cambiario.

ASUNTO 8: METODOLOGÍA DE CÁLCULO DE LA TASA DE CAMBIO REPRESENTATIVA DEL MERCADO

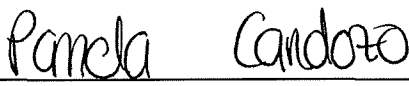
La presente circular reemplaza en su totalidad la Circular Reglamentaria Externa DODM-146, del 21 de septiembre de 2004, correspondiente al Asunto 8: “METODOLOGÍA DE CÁLCULO DE LA TASA DE CAMBIO REPRESENTATIVA DEL MERCADO” del Manual del Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados.

Las modificaciones se realizan con el objetivo de aclarar los días en los que no se calcula la TRM.

Cordialmente,



HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico



PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente
Monetario y de Inversiones Internacionales



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 146

Fecha: 30 SET. 2015

ASUNTO: 8 METODOLOGÍA DE CÁLCULO DE LA TASA DE CAMBIO REPRESENTATIVA DEL MERCADO

Para los efectos previstos en el artículo 80 de la Resolución Externa No. 8 de 2000 y sus modificaciones, se entiende por "tasa de cambio representativa del mercado" (TRM) el promedio aritmético simple de las tasas ponderadas de las operaciones de compra y de venta de divisas efectuadas por bancos comerciales, corporaciones financieras, sociedades comisionistas de bolsa, compañías de financiamiento, la Financiera de Desarrollo Nacional -FDN- y el Banco de Comercio Exterior de Colombia –BANCOLDEX, pactadas para cumplimiento en ambas monedas el mismo día de su negociación.

La TRM vigente para cada día será calculada y certificada por la Superintendencia Financiera de Colombia, conforme a esta metodología con las operaciones del día anterior. Para el cálculo de la TRM se deberá incluir, por lo menos, las operaciones realizadas en las ciudades de Bogotá D.C., Barranquilla, Cali y Medellín y se deberá excluir las operaciones de ventanilla y las de derivados sobre divisas.

La TRM del día hábil siguiente a un día festivo de los bancos de la Reserva Federal de los Estados Unidos de América será la misma TRM vigente en el día festivo. Por lo tanto, no se calculará la TRM con las operaciones realizadas en un día festivo de los bancos de la Reserva Federal de los Estados Unidos de América. La siguiente tabla ilustra una semana donde el miércoles es un día hábil en Colombia y festivo para los bancos de la Reserva Federal de Estados Unidos y los otros días son hábiles en ambos países.

| Martes (día hábil en Colombia y en los EE.UU.) | Miércoles (día hábil en Colombia, festivo de los bancos de la Reserva Federal de los EE.UU.) | Jueves (día hábil en Colombia y en los EE.UU.) |
|---|---|---|
| Está en vigencia la TRM calculada con operaciones del día lunes. | Está en vigencia la TRM calculada con operaciones del día martes. | Continúa en vigencia la TRM del día miércoles (calculada con operaciones del día martes). |

Para los días sábado, domingo, festivos y aquellos en los que el Banco de la República no preste los servicios del CUD, aplicará la TRM vigente en el día hábil inmediatamente siguiente.

HWH

PC