



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM - 317

Fecha: 31 JUL 2020

Destinatario: Oficina Principal y Sucursales, Superintendencia Financiera de Colombia, Bolsa de Valores de Colombia; Intermediarios del Mercado Cambiario; Ministerio de Hacienda y Crédito Público; Autorregulador del Mercado de Valores; Sistemas de Compensación y Liquidación de Divisas.

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

En la presente Circular se mantienen las modificaciones a las hojas 19-3 y 19-7 del 25 de mayo del 2018 y la hoja 19-4 del 28 de febrero de 2020 del Asunto 19: **“SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS”**, del Manual del Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados.

Lo anterior con el fin de ampliar de forma transitoria entre el 3 de agosto de 2020 y el 30 de octubre de 2020, el tiempo máximo para el registro de las operaciones sobre divisas sujetas a dicha obligación de 15 a 45 minutos.

Cordialmente,

HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico

PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente
Monetario y de Inversiones Internacionales

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317**Fecha: **28 FEB. 2020****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, 2 y 3 del artículo 8 de la Resolución Externa 1 del 2018, deben registrar las operaciones de contado de divisas y de derivados que realicen en el mercado mostrador que tengan como subyacente divisas o tasas de interés externas, salvo aquellos derivados cuyo subyacente sean títulos de renta fija. Los IMC también deben registrar las operaciones de derivados cuyo subyacente sean tasas de interés locales negociadas con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados. Las operaciones de contado sobre divisas, celebradas entre IMC y los demás residentes, distintos de vigilados por la Superintendencia Financiera de Colombia (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.

Las entidades vigiladas por la SFC, distintas de los IMC, que realicen en el mercado mostrador operaciones de contado sobre divisas con agentes del exterior o de derivados que tengan como subyacente divisas o tasas de interés con agentes del exterior autorizados para realizar derivados, deben registrarlas en un sistema de registro de operaciones sobre divisas debidamente autorizado. Se exceptúan del registro las operaciones de derivados que tengan como subyacente títulos de renta fija.

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

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

2.1. 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.

2.1.1. INFORMACIÓN GENERAL A TODAS LAS OPERACIONES

- Fecha y hora de ejecución.
- Fecha y hora de registro.



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317

Fecha: 25 MAYO 2018

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

- Fecha de vencimiento.
- Fecha de liquidación.
- Identificación de los afiliados, operadores participantes de la operación.
- 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*)).
- Opcionalidad (S/N).
- Descripción de la opcionalidad (si aplica).
- Modalidad de participación de la contraparte (por cuenta propia o por cuenta de terceros).
- Identificación de las contrapartes que negocien la compra o venta de las divisas, ya sea actuando por cuenta propia o por cuenta de terceros cuando están autorizados para este fin (En Colombia: sociedades fiduciarias, sociedades comisionistas de bolsa de valores, sociedades administradoras de inversión, sociedades administradoras de fondos de pensiones y cesantías y aseguradoras). En el caso de los fondos administrados (ejemplo: Fondos de Inversión Colectiva (FIC), Administración de Portafolios de Terceros (APT), Fondos Pensiones, Fondos de Cesantías) se debe identificar siempre a la entidad que negocie la compra o venta de las divisas (ejemplo: NIT y nombre de sociedad fiduciaria, NIT y nombre sociedad comisionista de bolsa). Cuando un IMC negocie la compra o venta de divisas directamente con otro residente o con un no residente se debe incluir la identificación respectiva.
- Identificación del tercero. Para este efecto se deberá identificar como tercero a alguno de los siguientes agentes: i) beneficiario de la operación, o ii) al ordenante de la misma. Adicionalmente, se debe señalar su calidad de residente o no residente. En el caso de las operaciones negociadas por las sociedades administradoras a nombre de terceros se debe identificar el tercero (ejemplo: NIT y nombre del FIC, NIT y nombre del APT, NIT y nombre del fondo de pensiones, NIT y nombre del fondo de cesantías). Cuando una contraparte del exterior actúe a nombre de terceros y no se conozca el beneficiario de la operación, la entidad del exterior deberá aparecer como contraparte y como ordenante y no deberá tener un NIT correspondiente a una entidad o fondo vigilado por la SFC.
- Información sobre si la liquidación se hace a través de una Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
- Si la operación registrada proviene de otro sistema de negociación indicar el nombre de dicho sistema o si la operación se efectuó en el mercado mostrador.

Para efectos de la información requerida se entiende por,

- a. **Contraparte:** la persona natural o jurídica que negocia los términos y condiciones de la compra o venta a través de cualquier medio verificable, como por ejemplo un sistema transaccional, teléfono, mensajes electrónicos, entre otros.
- b. **Ordenante:** la persona no residente natural o jurídica que por un mandato imparte órdenes de negociación o negocia la compra o la venta. Solo aplica para operaciones a nombre de

H-VH



Fecha: 30 ABR 2020

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

terceros. Cuando una contraparte del exterior actúe a nombre de terceros y no se conozca el beneficiario de la operación, la entidad del exterior deberá aparecer como contraparte y como ordenante.

- c. **Beneficiario:** la persona natural o jurídica a quien le corresponda contractualmente recibir o entregar el producto de la negociación. Solo aplica para operaciones a nombre de terceros.

Los afiliados a los sistemas deberán suministrar la información necesaria para el registro de sus operaciones de forma veraz, completa, exacta, actualizada, comprobable y comprensible. Así mismo, los administradores de los sistemas de negociación y registro de operaciones sobre divisas deberán incorporar los controles necesarios que velen por la calidad y consistencia de la información registrada en sus sistemas (completitud en la información de los campos, para las operaciones con entidades vigiladas por la SFC el NIT de la entidad debe coincidir con el nombre de la misma).

2.1.2. 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.

2.2. PLAZO Y REQUISITOS PARA REGISTRAR LAS OPERACIONES

Los IMC y las demás entidades vigiladas por la SFC que realicen operaciones sobre divisas en sistemas de negociación y las registren en un sistema de registro deben hacerlo de acuerdo con lo establecido en el presente numeral.

- i. Las operaciones que se ejecuten dentro del horario de operación establecido por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, se deberán registrar dentro de los cuarenta y cinco (45) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento, con excepción de las operaciones de derivados ejecutadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público-, que deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. También se

H. Vargas
PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317**

Fecha: 30 ABR 2020

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

exceptúan las operaciones sobre divisas con cruces de monedas que no incluyan al peso colombiano ejecutadas en el mercado mostrador por cualquier entidad vigilada por la SFC, que deberán ser registradas con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. Este registro deberá ser realizado por los IMC, cuando estos sean contraparte de la operación, o por las entidades vigiladas por la SFC, distintas de IMC, cuando se trate de sus operaciones de contado de divisas con agentes del exterior o de derivados sobre divisas con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados de manera profesional.

- ii. Las operaciones que se ejecuten con posterioridad a la hora de cierre operativo de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán como si hubieran sido ejecutadas al primer instante de la apertura siguiente, es decir, el registro deberá efectuarse durante los primeros cuarenta y cinco (45) minutos posteriores a la apertura de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas.
- iii. Las operaciones que se pacten a una tasa de mercado que no se conoce al momento de la negociación (ejemplo: tasa FIX del día de la negociación, tasa FIX del día del vencimiento, TRM, etc.) deberán ser registradas dentro de los cuarenta y cinco (45) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento, con excepción de las operaciones de derivados ejecutadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público- que deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. En cualquier caso, una vez se conozca la tasa, esta deberá ser ingresada en los sistemas de registro de operaciones sobre divisas antes del cierre de operación de dichos sistemas, o durante los primeros cuarenta y cinco (45) minutos posteriores a la apertura del día hábil siguiente, en caso que la tasa se conozca después del cierre de dichos sistemas.
- iv. En las operaciones de contado en las cuales no se negocie explícitamente la tasa de cambio de compra o venta para un plazo de cumplimiento específico, sino que la negociación involucre un diferencial de precios con otras operaciones de contado, como por ejemplo un margen de la tasa de una operación frente al de otra con un plazo de cumplimiento superior, deberán registrarse de acuerdo con lo establecido en el presente numeral pero no como operaciones de contado independientes.
- 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 $t=0$.
- vi. Cuando un IMC efectúe la compra o venta de divisas en el mercado de contado y de derivados con otra entidad vigilada por la SFC (que sea o no IMC) que actúe por cuenta de un tercero, el registro deberá indicar: (i) que la operación es por cuenta de terceros, (ii) la entidad vigilada que participó como contraparte en la negociación, (iii) el tercero beneficiario u ordenante de la operación, y (iv) la calidad de residente o no residente del

H. Vargas
PC



Fecha: 25 MAYO 2018

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

tercero beneficiario u ordenante. En el caso de operaciones negociadas por una entidad vigilada por la SFC a nombre de un tercero residente, el registro siempre debe identificar al tercero beneficiario de la operación.

A continuación, se presentan ejemplos, sin que las operaciones se limiten únicamente a estos casos:

- Cuando una entidad del exterior ordena a una entidad fiduciaria local que venda divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la fiduciaria y al IMC. Se debe señalar que la fiduciaria actuó a nombre de un tercero e identificar a la entidad del exterior como ordenante. El ordenante puede o no ser beneficiario de la operación.
- Cuando una entidad del exterior negocie directamente la venta de las divisas a cambio de moneda legal con el IMC, el registro deberá incluir a la entidad del exterior y al IMC como contrapartes y se deberá identificar al primero como entidad del exterior (su identificación debe corresponder a la de una entidad del exterior).
- Cuando una sociedad administradora actuando a nombre de un fondo administrado (ejemplo: FIC, APT, Fondos Pensiones, Fondos de Cesantías) negocie la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la sociedad administradora y al IMC. Se debe señalar que la sociedad administradora actuó a nombre de un tercero e identificar al fondo administrado como beneficiario.
- Cuando una entidad del exterior actuando a nombre de un fondo con inversión de portafolio en Colombia negocie la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la entidad del exterior y al IMC. Se debe señalar que la entidad del exterior actuó a nombre de un tercero e identificar al fondo como beneficiario. Se debe identificar a la entidad del exterior como tal, por tanto, no puede tener la identificación que lo asocie a una entidad vigilada o a un negocio administrado por una entidad vigilada. Si la entidad del exterior no suministra información sobre el fondo, se debe registrar a la entidad del exterior como contraparte y ordenante.
- Cuando una entidad del exterior actuando a nombre de un fondo con inversión de portafolio en Colombia ordene a una fiduciaria local la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la fiduciaria y al IMC. Se debe señalar que la fiduciaria actuó a nombre de un tercero e identificar a la entidad del exterior como ordenante o beneficiario.
- Cuando a través de un mecanismo de negociación (por ejemplo, vía telefónica) se encuentren de forma simultánea diferentes agentes: IMC comprador, fiduciaria vendedora (F1) actuando a nombre de un tercero ordenante del exterior, una segunda fiduciaria (F2) que se encargará de hacer el cumplimiento de la operación y el tercero ordenante, el registro debe incluir como contrapartes al IMC y a F1 dado que estas negociaron los términos y condiciones de la operación. Se debe señalar que F1 actuó a

THH

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317**Fecha: **25 MAYO 2018****ASUNTO 19: SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

nombre de un tercero e identificar a la entidad del exterior como ordenante. F2 no debe aparecer en el registro.

Cuando la negociación se pacte directamente entre un IMC y otro residente (vigilado o no vigilado por la SFC) o con un no residente, y el cumplimiento de dicha operación se efectúe por una entidad vigilada por la SFC facultada para desarrollar esta función y que no haya participado en la negociación, el registro no incluirá a la entidad encargada del cumplimiento.

Una operación se ejecuta cuando las partes cotizan y cierran por un medio verificable las condiciones de la operación que permitan calcular el precio. La hora de ejecución de una operación corresponde a la de cierre.

2.3. 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 8, numeral 3, literal e de la Resolución Externa 1 de 2018, 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.

2.4. 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 será de quince (15) minutos posteriores a su ejecución 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 antes de la hora de cierre de los sistemas de negociación y registro de divisas. Para las operaciones del mercado de contado que hacen parte del

H/2018

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317**

Fecha: 30 ABR 2020

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

cálculo de la Tasa Representativa del Mercado (TRM), según lo establecido en la CRE DODM-146, las modificaciones podrán efectuarse como máximo a la 1:25 pm. Los administradores de los sistemas deberán establecer los controles necesarios para que ninguna modificación pueda surtir efecto con posterioridad a dicho horario. 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 y afiliados de los sistemas deberán contar con un registro de auditoría que permita identificar la trazabilidad de las operaciones que se hayan procesado, el cual debe contener, como mínimo, la información que permita identificar con claridad los ingresos, modificaciones, anulaciones y otras actividades que se hayan procesado en el sistema, de manera que permita al Banco de la República (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 2.3 de esta Circular, cuando dichas operaciones no sean aceptadas por esta última para su compensación y liquidación.

Los IMC y las demás entidades vigiladas por la SFC deben registrar las modificaciones que se 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 debe 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, deben ser registradas antes del cierre de operación de estos sistemas.
- ii. Las modificaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre operativo de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, deben ser registradas durante los primeros cuarenta y cinco (45) minutos posteriores a la apertura siguiente de dichos sistemas.
- iii. Cuando se trate de modificaciones sobre operaciones entre afiliados al mismo sistema, uno de estos debe realizar la modificación al registro y su contraparte debe verificar dicha modificación. Cuando una sola de las contrapartes sea el afiliado al sistema, es 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:

PC
H. Vargas



Fecha: 25 MAYO 2018

ASUNTO 19: SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**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 a través del sistema de transmisión de información GTA que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR, 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.

3.2. INFORMACIÓN A LA SFC

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán enviar diariamente a la SFC 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 la última operación ejecutada, 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 a la última operación ejecutada, observados hasta el momento de la publicación. Adicionalmente, la evolución de la tasa de las transacciones ejecutadas a lo largo de la sesión.
- ii. Para operaciones de derivados: tasa de apertura, tasa promedio, tasa mínima, tasa máxima y tasa de la última operación ejecutada, 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 a la última operación ejecutada, 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 IMC o entidades vigiladas por la SFC distintas de los IMC en un sistema de registro debe ser divulgada únicamente por el administrador del sistema de registro.

HUT



Fecha: 25 MAYO 2018

ASUNTO 19: SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**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 BR, la SFC y los Organismos de Autorregulación podrán requerir información adicional en calidad de agentes observadores.

3.5. REPORTES DE INFORMACIÓN POR PARTE DE AGENTES DEL EXTERIOR

Para efectos de lo establecido en la Resolución Externa 2 de 2017 de la Junta Directiva del BR (*close-out netting*), los agentes del exterior que sean contraparte de operaciones de derivados o de productos estructurados podrán presentar un reporte electrónico de las operaciones celebradas con IMC o con los demás residentes, ante los sistemas de registro de operaciones sobre divisas autorizados por la SFC, de acuerdo con lo que para el efecto establezcan esos sistemas.

La información de que trata este numeral no será objeto divulgación por parte de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas. Sin embargo, el BR, las entidades de vigilancia y control y los Organismos de Autorregulación podrán requerir dicha información.

Los sistemas de registro de operaciones sobre divisas deben enviar la información de las operaciones de derivados reportadas a las entidades que la soliciten, siempre y cuando sean contrapartes en dichas operaciones.

(ESPACIO DISPONIBLE)

17/11



Fecha: 25 MAYO 2018

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 GTA que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR.

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 GTA, 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. La documentación para el uso del sistema GTA ("Manual de usuario interactivo: gestión de transferencia de archivos del Banco de la República") se encuentra disponible en la página del Banco en el siguiente enlace:

<http://www.banrep.gov.co/es/documentos-formatos-e-informacion-adicional-sebra/gestion-transferencia-archivos-gta-html5>.

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 GTA, 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

HH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

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_aaaammddEEEnnnnnnnnnnnrrrr.xml

En donde:

- aaaammdd** : Fecha de transmisión
- EEE** : Identificador del tipo de entidad que envía el archivo (SNR)
- nnnnnnnnnnnn** : El número de NIT del SN/SR (Con digito de verificación).
Para completar los 12 dígitos se rellena con ceros a la izquierda.
- 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 : 20140202 (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 2 de febrero de 2014.

HH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

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).

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 |

HUH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

| Etiqueta de la variable | Tipo | Longitud Máxima | Validaciones | Observaciones |
|-------------------------|--------|-----------------|--|--|
| 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 |

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 | FWPD | 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

HWY



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: **25 MAYO 2018**

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

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 (.).

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

| VARIABLE | FWPD | OPPD | SWPD | SWPID | FWOM | OPOM | SWOM | SWIOM | FWTI | OPTI | OD | SPOT |
|----------------------------------|------|------|------|-------|------|------|------|-------|------|------|----|------|
| TipoNovedad | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| PuntaVentaTerceros | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| PuntaCompraTerceros | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TipoDPuntaVentaNegodante | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| IDPuntaVentaNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| NombrePuntaVentaNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TipoDPuntaVentaBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| IDPuntaVentaBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| NombrePuntaVentaBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| NumeroRegistro | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| FechaOper | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| NITSNroIMC | L | L | L | L | L | L | L | L | L | L | L | L |
| NITSNroIMCRegAnterior | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| NumRegAnterior | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| FechaOpAnterior | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| FechaVen | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TipoDPuntaCompraNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| IDPuntaCompraNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| NombrePuntaCompraNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TipoDPuntaCompraBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| IDPuntaCompraBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| NombrePuntaCompraBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| SubsectorPuntaVentaNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| SubsectorPuntaCompraNegociente | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| SubsectorPuntaVentaBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| SubsectorPuntaCompraBeneficiario | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| MontoNegociacion | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| Moneda1 | | | | | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TasaContado | X | | X | | X | | X | | | | X | |
| TasaPactada1Predo | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TasaPactada2 | | | X | X | | | X | X | | | X | |
| Moneda2 | | | | | X | 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 | X |
| MontoNDF | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| TasaReferenciaSubyacente | X | 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 | |
| Primicial | | X | | | | X | | | | X | X | |
| Condición | | X | | | | X | | | | X | X | |
| PlazoTasa | | | | | | | | | X | X | X | |
| RegistroPrevio | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| SistemaPrevio | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O | O |
| TasaFIX | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |
| FechaFIX | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X | X |

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

2018



Fecha: 25 MAYO 2018

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 negociación 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 negociación 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). | |
| NumeroRegistro | | Número de registro de la negociación. | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones | |
| Numérico | 15 | Para cada fecha de negociación 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 negociación y para cada uno de los tipos de novedad. | |
| FechaOper | | Corresponde a la fecha de negociación del instrumento cuando la negociación 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 negociación 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 negociación 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 | |
| NITSNRoIMCRegAnterior | | Número de NIT del SN/SR con que se reportó la negociación 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 negociación 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 negociación anterior) y se debe encontrar vigente (El campo es último debe ser "S") | |
| NumRegAnterior | | Número de Registro con que se reportó la negociación sujeta a modificación (en caso que el tipo de negociación 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 negociación 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 negociación anterior) y se debe encontrar vigente (El campo es último debe ser "S") | |

ANEX



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: 25 MAYO 2018

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

| FechaOpAnterior | | Corresponde a la fecha en la cual fue reportada la negociación sujeta a modificación (en caso que el tipo de negociación 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 negociación 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 negociación 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 negociación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial. | Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). |
| PuntaVentaTerceros | | Indica si la negociación de la punta de venta es realizada a nombre de terceros | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Caracter | 1 | Debe ser S o N. | La negociación en la punta de venta es realizada a nombre de un tercero (S), o no (N). |
| PuntaCompraTerceros | | Indica si la negociación de la punta de compra es realizada a nombre de terceros | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Caracter | 1 | Debe ser S o N. | La negociación en la punta de compra es realizada a nombre de un tercero (S), o no (N). |
| TipoIDPuntaVentaNegociante | | Tipo de documento de identificación de la entidad que negoció la punta de venta 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: 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 |
| TipoIDPuntaCompraNegociante | | Tipo de documento de identificación de la entidad que negoció la punta de compra 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: 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 |
| IDPuntaVentaNegociante | | Número del documento de identificación de la entidad que negoció la punta de venta 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 IDPuntaVentaNegociante debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos. |
| IDPuntaCompraNegociante | | Número del documento de identificación de la entidad que negoció la punta de compra 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 IDPuntaCompraNegociante debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos. |
| NombrePuntaVentaNegociante | | Nombre de la entidad que negoció la punta de venta en el contrato. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 40 | | Razón social o nombre de la entidad que negoció la punta de venta en el contrato. |
| NombrePuntaCompraNegociante | | Nombre de la entidad que negoció la punta de compra en el contrato. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 40 | | Razón social o nombre de la entidad que negoció la punta de compra en el contrato. |

H04



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: **25 MAYO 2018**

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

| TipoIDPuntaVentaBeneficiario | | Tipo de documento de identificación del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso que esta se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
|---------------------------------------|----------|--|---|
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 2 | Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones. No debe ser vacío si PuntaVentaTerceros es S. | Tipo de documento: 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 |
| TipoIDPuntaCompraBeneficiario | | Tipo de documento de identificación del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 2 | Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones. No debe ser vacío si PuntaCompraTerceros es S. | Tipo de documento: 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 |
| IDPuntaVentaBeneficiario | | Número del documento de identificación del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 12 | No debe ser vacío si PuntaVentaTerceros es S. | Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. |
| IDPuntaCompraBeneficiario | | Número del documento de identificación del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 12 | No debe ser vacío si PuntaCompraTerceros es S. | Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. |
| NombrePuntaVentaBeneficiario | | Nombre del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 40 | No debe ser vacío si PuntaVentaTerceros es S. | Razón social o nombre del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. |
| NombrePuntaCompraBeneficiario | | Nombre del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 40 | No debe ser vacío si PuntaCompraTerceros es S. | Razón social o nombre del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. |
| SubsectorPuntaVentaNegociante | | Código Sector de la actividad económica de la entidad que negoció la punta de venta en el contrato. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 8 | Debe corresponder al código CHU o en su defecto a una de las descritas en el presente Anexo. | Código CHU/Tabla de Sectores |
| SubSectorPuntaCompraNegociante | | Código Sector de la actividad económica de la entidad que negoció la punta de compra en el contrato. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 8 | Debe corresponder al código CHU o en su defecto a una de las descritas en el presente Anexo. | Código CHU/Tabla de Sectores |

MH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: 25 MAYO 2018

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

| SubSectorPuntaVentaBeneficiario | | Código Sector de la actividad económica del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
|----------------------------------|----------|--|--|
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 8 | Debe corresponder al código CIUO o en su defecto a una de las descritas en el presente Anexo. No debe ser vacío si PuntaVentaTerceros es S. | Código CIUO/Tabla de Sectores |
| SubSectorPuntaCompraBeneficiario | | Código Subsector de la actividad económica del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso que se haya efectuado a nombre de un tercero. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 8 | Debe corresponder al código CIUO o en su defecto a una de las descritas en el presente Anexo. No debe ser vacío si PuntaCompraTerceros es S. | Código CIUO/Tabla de Sectores |
| MontoNegociación | | Valor nominal de la negociación. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Númerico | 24 | 18 enteros y 6 decimales. El monto de la negociación debe venir diligenciado para todos los tipos de instrumentos. Debe ser igual a la suma de MontoDF y MontoNDF. | El monto nominal de la negociación expresado en términos de la Moneda 1. |
| Moneda1 | | 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 negociación. 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 negociación. |
| TasaContado | | Tasa de contado vigente en el momento en que se negoció la negociación 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. |
| TasaPactada2 | | En los instrumentos Swap peso-dólar y swap otras monedas, se refieren a la tasa pactada para la punta spot de la negociación. 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 |
| Númerico | 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 negociación. 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 negociación. 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. |

HHH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: **25 MAYO 2018**

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

| | | | |
|---|-----------------|--|--|
| Tasa Pactada 1 Precio | | | |
| <p>- 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 moneda 1 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).</p> <p>- 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.</p> <p>- En el caso de los forwards de tasa de interés, se debe especificar la tasa de interés pactada en la moneda 1.</p> | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Numérico | 11 | 5 enteros y 6 decimales. | <p>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 moneda 1 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).</p> <p>Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3USD por EUR la tasa se debe reportar como 1.300000.</p> <p>Como Moneda 1 sería Euro (EUR) y como Moneda 2 el Dólar (USD).</p> <p>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).</p> <p>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.</p> <p>En el caso de los forwards de tasa de interés, la tasa de interés pactada.</p> <p>En las opciones sobre índices bursátiles se debe especificar el precio pactado por el subyacente en términos de la moneda 1.</p> |
| Periodicidad Flujo M1 | | | |
| 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 |
| Numérico | 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. |
| Periodicidad Flujo M2 | | | |
| 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 |
| Numérico | 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. |
| Monto DF | | | |
| Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento efectivo (DF). | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Numérico | 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. |
| Monto NDF | | | |
| Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento financiero (NDF). | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Numérico | 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. |
| Tasa Referencia Subyacente | | | |
| Tasa de referencia a la cual se realizará el cumplimiento del contrato o subyacente de referencia. | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Numérico | 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). |

MNH



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 317
ANEXO No. 1

Fecha: 25 MAYO 2018

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

| AceptadoCamara | | Indica si la negociación 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. | Si 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). |
| TipoOpcion | | 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) |
| FechaCRCC | | Fecha en que la negociación 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 negociación. Esta variable debe ser mayor o igual a la fecha de negociación (Fecha de negociación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I). Mientras la negociación 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 negociación 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). |
| PrimaInicial | | 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 negociación 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 la operación fue negociada previamente en otro sistema (S) o si se realizó en el mercado mostrador (N). | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Caracter | 1 | Debe ser S o N. | Negociada previamente en otro sistema (S), o no (N). |
| SistemaPrevio | | Este campo debe indicar el código del sistema en el que fue negociada previamente la operación. | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Caracter | 1 | Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones. No debe ser vacío si SistemaPrevio es S. | Sistema de Negociación: S: SET ICAP FX S.A. T: Tradition Colombia S.A. G: GFI Exchange Colombia S.A. E: ENLACE DIVISAS S.A. O: Otro Sistema de Negociación |

24/11



Fecha: 25 MAYO 2018

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

| TasaFIX | | | |
|--|----------|--|---|
| Cuando la negociación se pacta a una tasa de mercado que no se conoce al momento de la negociación se debe indicar cuál es esta tasa de referencia | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Alfanumérico | 20 | | Debe registrarse la tasa de referencia y si existe algún spread frente a dicha tasa (ej. TRM + 2) |
| FechaFIX | | | |
| Fecha en la cual se forma la tasa de referencia de la negociación | | | |
| Tipo de Dato | Longitud | Validaciones | Observaciones |
| Fecha | 10 | Esta fecha debe ser igual o posterior a la fecha de negociación (Fecha de negociación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I) | Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). |

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 las variables que se está(n) modificando o aclarando, deben diferir de la información reportada inicialmente y deben realizarse antes del vencimiento de la operación. Las operaciones podrán ser modificadas de acuerdo a lo establecido en la CRE DODM-144.

En los fraccionamientos (F) la suma del valor de cada operación que conforma el fraccionamiento debe corresponder al valor del instrumento original.

De acuerdo con 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>
```

MH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

<ConsecutivoArchivo>0001</ConsecutivoArchivo>
<CantidadRegistros>1</CantidadRegistros>
</Encabezado>

<Operaciones>
<FWPD>
<TipoNovedad>I</TipoNovedad>
<PuntaVentaTerceros>N</PuntaVentaTerceros>
<TipoIDPuntaVentaNegociante>NI</TipoIDPuntaVentaNegociante>
<IDPuntaVentaNegociante>123456789</IDPuntaVentaNegociante>

<NombrePuntaVentaNegociante><![CDATA[NombreParte]]></NombrePuntaVentaNegociante>

<NumeroRegistro>123</NumeroRegistro>
<FechaOper>2013-06-05</FechaOper>
<FechaVen>2013-07-24</FechaVen>
<PuntaCompraTerceros>N</PuntaCompraTerceros>

<TipoIDPuntaCompraNegociante>NI</TipoIDPuntaCompraNegociante>
<IDPuntaCompraNegociante>987654321</IDPuntaCompraNegociante>

<NombrePuntaCompraNegociante><![CDATA[Nombre]]></NombrePuntaCompraNegociante>

<SubsectorPuntaVentaNegociante>F</ SubsectorPuntaVentaNegociante >
<SubsectorPuntaCompraNegociante>R</ SubsectorPuntaCompraNegociante >

<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>

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

</FWPD>

</Operaciones>

</Reporte>

14/14



Fecha: 25 MAYO 2018

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

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**
- 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)**

AVH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

- 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, BANCOLEX, 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**

- Q ORGANIZACIONES Y ORGANOS EXTRATERRITORIALES**
- R PERSONA NATURAL**

AUH



Fecha: 25 MAYO 2018

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-GTA.
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 GTA (Gestión de 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.

He H



Fecha: 25 MAYO 2018

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 GTA, el cual es independiente de los demás servicios electrónicos.

El Sistema SEBRA se encuentra contemplado en la Circular Externa Operativa y de Servicios DG-T-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>

GTA 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 del sistema GTA (“Manual de usuario interactivo: gestión de transferencia de archivos del Banco de la República”) se encuentra disponible en la página del Banco en el siguiente enlace: <http://www.banrep.gov.co/es/documentos-formatos-e-informacion-adicional-sebra/gestion-transferencia-archivos-gta-html5>.

Condiciones de Uso

Las condiciones de uso para el sistema informático de transmisión de información GTA 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.
- 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 GTA.

HH 1



Fecha: 25 MAYO 2018

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

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 Externa Operativa y de Servicios DG-T-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.

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.

HH



Fecha: 25 MAYO 2018

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

- 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/o 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.
- 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.

17014