



Banco de la República Colombia

BOLETÍN

No. 017
Fecha 03 de Mayo de 2013
Páginas

CONTENIDO

| | Página |
|--|--------|
| Circular Reglamentaria Externa DODM - 317 del 03 de mayo de 2013 Asunto 19: Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas | 1 |



**MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE
OPERACIONES Y DESARROLLO DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM -317**

Hoja 19-00

Fecha: - 3 MAYO 2013

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; BANCOLODEX; Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas;

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

Mediante la presente se publica el Anexo No. 1 a la Circular Reglamentaria Externa DODM-317 de abril 30 de 2013, correspondiente al Asunto 19: “**SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**”.

Cordialmente,


HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico


PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Reservas



30 ABR. 2013

Fecha:

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) 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.

HUH

DZG



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: 30 ABR. 2013

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

2.3 PLAZO PARA REGISTRAR LAS OPERACIONES

2.3.1 OPERACIONES ENTRE IMC; ENTRE IMC Y AGENTES DEL EXTERIOR; ENTRE IMC Y OTRAS INSTITUCIONES VIGILADAS POR LA SFC; O ENTRE IMC Y LA NACIÓN - MINISTERIO DE HACIENDA Y CRÉDITO PÚBLICO

Los IMC 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, con otras instituciones vigiladas por la SFC, o con la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público, de acuerdo con lo establecido en el presente numeral.

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.
- 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 $t=0$.

WH

DJR



Fecha: 30 ABR. 2013

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**2.3.2 OPERACIONES ENTRE IMC Y RESIDENTES (DISTINTOS DE VIGILADOS POR LA SFC Y LA NACIÓN - MINISTERIO DE HACIENDA Y CRÉDITO PÚBLICO)**

Los IMC deberán registrar las operaciones sobre divisas, de contado y de derivados, que realicen en el mercado mostrador con otros residentes (distintos de los vigilados por la Superintendencia Financiera de Colombia y de la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público) excepto cuando se trate de operaciones de contado 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. El registro deberá realizarse 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, deberán ser registradas por el IMC antes del cierre de operación de estos 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 durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura siguiente de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas.
- iii. Las operaciones cuya tasa, plazo o contraparte 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 $t=0$.

El registro de las operaciones de derivados sobre divisas realizadas en el mercado mostrador cuyo monto sea inferior a doscientos cincuenta mil dólares de los Estados Unidos de América (USD250,000), o su equivalente en otras monedas, será obligatorio a partir del 1 de noviembre del 2013.



Fecha: 30 ABR. 2013

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**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 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 IMC deberán registrar las modificaciones que se realicen a partir del 1 de noviembre de 2013 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.

HCH

Deigo



Fecha: 30 ABR. 2013

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

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 un reporte electrónico al BR a más tardar a las 10:00 a.m. 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 a partir del 1 de noviembre de 2013.

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.

HUH

DODM



Fecha: 30 APR 2013

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

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)

HJH

DJH



- 3 MAYO 2013

Fecha:

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

INSTRUCTIVO PARA DILIGENCIAR LOS FORMATOS DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de divisas deberán reportar las operaciones de derivados negociadas o registradas a través de su conducto, sus modificaciones y los errores de digitación a través del archivo en formato Excel¹, "*Formato de reporte de operaciones con derivados*"² el cual contiene una única hoja para reportar los diferentes tipos de instrumentos y operaciones.

Al diligenciar esta hoja, no altere el formato de las columnas, no borre ni inserte filas o columnas, ni cambie el nombre de las hojas, puesto que serán leídas por una aplicación automatizada, cualquier modificación afectará el procesamiento de la información.

Las columnas contienen instrucciones para diligenciar los datos, de tal forma que sea fácil y rápido completarlas. Adicionalmente, están formateadas y validan los datos de entrada, por lo que los formatos de las celdas no deben ser modificados en ningún caso.

Lea cuidadosamente estas instrucciones antes de diligenciar su archivo. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico DODM-divisas@banrep.gov.co.

1 DESCRIPCIÓN SOBRE LOS CAMPOS PARA EL REGISTRO DE LAS OPERACIONES

A continuación se presenta la relación de la información que debe ser reportada de acuerdo con el tipo de instrumento.

¹ El archivo debe ser diligenciado en Excel 2007 o versiones posteriores

² Ingrese a http://www.reglamentacion/rg_cambia_nego.htm

HUH

PC



Fecha:

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

| Variable | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
|------------------------|------|------|------|-------|------|------|------|-------|------|------|
| | fwpd | oppd | swpd | swipd | fwom | opom | swom | swiom | fwti | opti |
| Tipo_Instrumento | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tipo_Novedad | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tipo_ID_Punta_Venta | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| ID_Punta_Venta | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Nombre_Punta_Venta | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Numero_Registro | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Fecha_Oper | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Num_Reg_Anterior | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Fecha_Op_Anterior | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Fecha_Ven | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tipo_ID_Punta_Compra | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| ID_Punta_Compra | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Nombre_Punta_Compra | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| SubSector_Punta_Venta | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| SubSector_Punta_Compra | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Moneda1 | | | | | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Moneda2 | | | | | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | | |
| Monto_Operacion | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tasa_Contado | ✓ | | ✓ | | ✓ | | ✓ | | | |
| Tasa_Pactada1 | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tasa_Pactada2 | | | ✓ | ✓ | | | ✓ | ✓ | | |
| Periodicidad_Flujo_M1 | | | | ✓ | | | | ✓ | | |
| Periodicidad_Flujo_M2 | | | | ✓ | | | | ✓ | | |
| Monto_DF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Monto_NDF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Tasa_Referencia | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Opcionalidad | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ | |
| Tipo_Opcionalidad | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ | |
| Aceptado_Camara | ✓ | | | | | | | | | |
| Fecha_CRCC | ✓ | | | | | | | | | |
| Tipo_Opcion | | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ |
| Tipo_Ejercicio_Opcion | | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ |
| Prima | | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ |
| Condicion | | ✓ | | | | ✓ | | | | ✓ |
| Plazo_Tasa | | | | | | | | | ✓ | ✓ |
| Registro_Previo | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |

AVH

PC



3 MAYO 2013

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**Descripción de los campos**

Tipo_Instrumento: El tipo de instrumento corresponde a la numeración asignada a la siguiente lista:

| Tipo de Instrumento | Instrumento |
|----------------------------|------------------------------------|
| 1 | Forward peso dólar (fwpd) |
| 2 | Opciones peso dólar (oppd) |
| 3 | Swap peso dólar (swpd) |
| 4 | Swap interés peso dólar (swipd) |
| 5 | Forward otras monedas (fwom) |
| 6 | Opciones otras monedas (opom) |
| 7 | Swap otras monedas (swom) |
| 8 | Swap interés otras monedas (swiom) |
| 9 | Forward tasa de interés (fvti) |
| 10 | Opciones tasa de interés (opti) |

Tipo_Novedad: Corresponde al tipo de novedad que se está reportando con el registro. Este campo puede tener los siguientes valores: **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.

Tipo_ID_Punta_Venta: Tipo de documento de identificación de la parte vendedora en el contrato. Este campo puede tener los siguientes valores: 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. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

ID_Punta_Venta: Número del documento de identificación de la parte que tiene la posición vendedora en el contrato. Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

Nombre_Punta_Venta: Nombre de la parte vendedora en el contrato. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

Numero_Registro: Número de registro de la operación.

H2H

PC



Fecha: - 3 MAYO 2013

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

Fecha_Oper: Corresponde a la fecha de negociación del instrumento cuando la operación corresponde a una novedad de tipo I (Inicial) y en el caso de una novedad tipo M, A o F debe corresponder a la fecha en que se realiza la Modificación, la Aclaración o el Fraccionamiento.

Num_Reg_Anterior: Número de Registro con que se reportó la operación sujeta a modificación (en caso que el tipo de operación sea distinta a inicial).

Fecha_Op_Anterior: 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).

Fecha_Ven: Fecha de vencimiento del instrumento.

Tipo_ID_Punta_Compra: Tipo de documento de identificación de la parte compradora en el contrato. Este campo puede tener los siguientes valores: 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. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

ID_Punta_Compra: Número del documento de identificación de la parte que tiene la posición compradora en el contrato. Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

Nombre_Punta_Compra: Nombre de la parte compradora en el contrato. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

SubSector_Punta_Venta: Código Subsector de la actividad económica de la parte vendedora en el contrato, de acuerdo con la tabla de clasificación de actividades económicas que se encuentra en la siguiente sección.

SubSector_Punta_Compra: Código Subsector de la actividad económica de la parte compradora en el contrato, de acuerdo con la tabla de clasificación de actividades económicas que se encuentra en la siguiente sección.

Moneda1: Se refiere a la moneda base de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar, opciones peso-dólar y swap peso dólar e interés, donde la moneda 1 por defecto es el dólar. Por otra parte, para los instrumentos que solo incluyen una moneda (forward tasa de interés y opciones tasa de

MVA

RC



Fecha:

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

interés), este campo se refiere a la moneda en la cual se realiza la operación. Finalmente, se debe resaltar que el dólar (USD) solo puede ser moneda 1.

Moneda2: Se refiere a la segunda moneda de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar, opciones peso-dólar, swap peso dólar e interés, donde por defecto la moneda 2 es el peso colombiano. Tampoco se debe llenar para los forward de tasa de interés y las opciones de tasa de interés.

Monto_Operación: Valor nominal de la operación (en términos de la moneda 1). Esta casilla debe ser igual a la suma de las casillas Monto_DF y Monto_NDF.

Tasa_Contado: Tasa de contado vigente en el momento en que se negoció la operación de derivados. Debe ser expresada en unidades de la moneda 2 por moneda 1. Esta tasa debe ser reportada para los forward peso dólar, swap peso-dólar, forward otras monedas y swap otras monedas.

Tasa_Pactada1:

- En los instrumentos que involucran tasas de cambio no ligados a una tasa de interés (forward peso-dólar, swap peso-dólar, 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 dólar y moneda 2 es euro y el instrumento es uno de los mencionados anteriormente, la tasa a llenar sería cuantos euros deben ser entregados por cada dólar (por ejemplo 0.7 EUR por USD).

- En los instrumentos swaps peso-dólar e interés y swaps otras monedas e 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 llenar la tasa de interés pactada.

Tasa_Pactada2: 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 denominados en la moneda 2.

Periodicidad_Flujo_M1: 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: 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 nominal de la operación que se liquidará en la modalidad de cumplimiento efectivo (DF).

AH

PC



Fecha:

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

Monto_NDF: Corresponde al valor nominal de la operación que se liquidará en la modalidad de cumplimiento financiero (NDF).

Tasa_Referencia: 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).

Opcionalidad: Especifica si el contrato forward tiene una opción implícita (SI/NO).

Tipo_Opcionalidad: Especifica el tipo de opcionalidad si el campo anterior es afirmativo.

Aceptado_Camara: Indica si la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada (SI/NO).

Fecha_CRCC: Fecha en que la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.

Tipo_Opción: Este campo debe indicar si la opción es call o put (C/P).

Tipo_Ejercicio_Opción: Este campo debe indicar si la opción es americana o europea (A/E).

Prima: La prima para entrar en el contrato (la opción).

Condición: Describe la condición de ejercicio de la opción. En el caso de opciones con strike, este campo se refiere al strike de la opción.

Plazo_Tasa: Para los instrumentos sobre tasa de interés (forward tasa de interés y opciones tasa de interés) se debe reportar el plazo que esta aplicará.

Registro_Previo: Este campo debe indicar si esta operación fue negociada o registrada previamente en otro sistema (S/N).

2 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**

MH

PC



Fecha:

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

- 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)
 - 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**

H.V.H

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – A 1-8

317

ANEXO No. 1

Fecha:

- 3 MAYO 2013

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

P SERVICIOS SOCIALES Y DE SALUD
Q ORGANIZACIONES Y ORGANOS EXTRATERRITORIALES
R PERSONA NATURAL

AWH

PC