



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia (Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

1. CRITERIOS GENERALES

El formato se debe enviar mensualmente al Banco de la República dentro de los 10 días hábiles siguientes al cierre del mes que se reporta a través del enlace dispuesto en la página: <http://www.banrep.gov.co/sec> – opción “Transmisión para intermediarios”, “Otros servicios”, “Transmisión de información de inversión extranjera de portafolio”, o “Transmisión para administradores de portafolio – No intermediarios y/o entidades locales que administran programas sobre certificados de depósitos negociables representativos de valores (ADR’s/GDR’s/GDN’s)”, “Transmisión de información de inversión extranjera de portafolio”, o “Archivos reportados por el depósito centralizado de valores local al Banco de la República”, “Otros servicios”, “Transmisión de información de inversión extranjera de portafolio (MILA)”. La dirección electrónica del formato es DTIE-IPEXT@banrep.gov.co

I. SALDOS DE INVERSIÓN

1. La información solicitada corresponde al valor mensual de los saldos, de las compras y ventas de las inversiones de portafolio de no residentes (extranjeros) en Colombia, de acuerdo con lo establecido en el Decreto 2080 de 2000 y las normas que lo modifiquen o sustituyan.
2. Las definiciones de los componentes del portafolio utilizados en este formato, son las establecidas en el Decreto 2555 de 2010 y las normas que lo modifiquen o sustituyan.
3. La información debe incluir las modalidades de inversión de portafolio: divisas y otras.
4. Los programas sobre certificados representativos de valores ADR’s,/GDR’s/GDN’s deben ser reportados en este formato únicamente en el numeral 8.
5. En el componente I del formato denominado “Saldos de Inversión” se debe excluir: i) El valor de los títulos recibidos en operaciones de repos, simultáneas y transferencia temporal de valores contra valores ii) Las inversiones en valores extranjeros listados en los sistemas de cotización de valores del extranjero y las inversiones en valores extranjeros emitidos en el exterior e inscritos en el registro nacional de valores y emisores.
6. Las inversiones en valores extranjeros listados en los sistemas de cotización de valores del extranjero y las inversiones en valores extranjeros emitidos en el exterior e inscritos en el registro nacional de valores y emisores se deben incluir **únicamente** en la categoría IV del formato: Emisores Extranjeros.
7. La información debe ser suministrada en **millones de pesos colombianos**. De requerirse, se debe utilizar la TRM vigente a la fecha de corte del formato para convertir a pesos colombianos las posiciones en moneda extranjera.
8. El formato debe ser diligenciado por el administrador de los inversionistas de capital del exterior a que se refiere el artículo 26 del Decreto 2080/00, la entidad local que administra el programa sobre certificados de depósitos negociables representativos de valores (ADR’s/GDR’s/GDN’s) o el depósito centralizado de valores local, según lo previsto en el Capítulo 7 de la Circular DCIN-83 y sus modificaciones.
9. El formato debe contener la información mensual consolidada de todos los clientes, discriminada de acuerdo con la clasificación del portafolio considerada en este formato.
10. La columna de saldo debe contener el valor a precios de mercado al cierre del mes que se informa.
11. Las columnas de compras y ventas corresponden al valor mensual acumulado teniendo en cuenta el valor al que fueron realizadas. Las adiciones y liquidaciones de posición se



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

- consideran como compras y ventas, respectivamente. Estas columnas no aplican para liquidez, operaciones de repos, simultáneas y transferencia temporal de valores.
12. Programas DR'S y DN'S (numeral 8): Para los efectos de este formato se deben incluir las transacciones con el administrador del programa DR's en el exterior.
 - a. Las emisiones primarias de acciones de emisores locales que se vinculen a estos programas (empaquetamiento) deben ser reportadas como compras.
 - b. Las redenciones de los DR'S o DN'S en acciones (des-empaquetamiento) deberán registrarse como ventas. Si la redención se realiza por parte de un no residente, las acciones adquiridas deben ser reportadas como compras de Renta Variable (numeral 1).
 - c. La orden de liquidación de una posición en DR'S o DN'S no debe ser reportada como una venta.
 - d. La adición de acciones previamente emitidas por parte de emisores locales que se vinculen a programas DR'S o DN'S (empaquetamiento) deben ser reportadas como compras en el numeral 8. En caso que esta adición se realice por parte de un no residente, las acciones vinculadas deben reportarse como ventas de Renta Variable (numeral 1).
 13. Fondos de inversión colectiva-Fondos Bursátiles (FIC) (carteras colectivas) (numeral 3):
 - a. Los aportes en divisas por parte de un no-residente para adquisición de unidades de participación en FIC deberán reportarse como compras en este formato. La redención de estas unidades se deben reportar como ventas del FIC.
 - b. Los aportes en valores de emisores locales efectuados por un no-residente en el FIC deberán reportarse como compras en el numeral 3 y como ventas de Renta Variable (numeral 1). La redención de estas unidades se deben reportar como ventas del FIC y como compras de Renta variable.
 - c. Los aportes en valores de emisores extranjeros inscritos en el RNVE efectuados por un no-residente al FIC deberán reportarse como compras en el numeral 3 y como ventas de Renta Variable (numeral 1 de la categoría "Emisores Extranjeros"). La redención de estas unidades por un no-residente se deben reportar como ventas del FIC y como compras de Renta Variable del numeral 1 de la categoría "Emisores Extranjeros".
 - d. Los aportes en valores de emisores extranjeros no inscritos en el RNVE efectuados por un no-residente deberán reportarse como compras en el numeral 3. La redención de estas unidades se deben reportar como ventas.
 14. Las inversiones en renta fija y renta variable, deben discriminarse según la clasificación institucional del emisor (sector financiero, sector no financiero público y sector no financiero privado)
 - a. Sector financiero: corresponde a las entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia. El listado se encuentra disponible en el siguiente enlace: [www.superfinanciera.gov.co/Entidades Supervisadas/Lista General de Entidades Vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia](http://www.superfinanciera.gov.co/Entidades_Supervisadas/Lista_General_de_Entidades_Vigiladas_por_la_Superintendencia_Financiera_de_Colombia).
 - b. **Sector no financiero:**
 - i. **Público:** corresponde a las entidades incluidas en la lista definida por la Superintendencia Financiera de Colombia para el diligenciamiento del formato 338. Dicho listado se encuentra disponible en el siguiente enlace: [www.superfinanciera.gov.co/Normativa/Índice de Reportes de Información a la Superintendencia Financiera de Colombia/ Guías para el Reporte de Información / Lista de Entidades – Formato 338](http://www.superfinanciera.gov.co/Normativa/Índice_de_Reportes_de_Información_a_la_Superintendencia_Financiera_de_Colombia/Guías_para_el_Reporte_de_Información/ListadeEntidades-Formato338)



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

- ii. **Privado:** Corresponde a las entidades y empresas no incluidas en los listados anteriormente mencionados.
15. **Fondos de inversión colectiva:** Discriminar entre fondos bursátiles y otros fondos. Se entiende por fondos bursátiles a aquellos fondos de inversión colectiva cuyo portafolio está integrado por valores que intentan replicar un índice nacional o internacional. En el resto de fondos de inversión colectiva se encuentran los otros tipos señalados por la regulación (inmobiliarias, del mercado monetario, entre otros).
16. **Liquidez:** Se refiere al saldo en cuentas corrientes, cuentas de ahorro, y depósitos a la vista en moneda legal colombiana, incluidos en la cuenta 11 del Plan Único de Cuentas (PUC) del administrador.
17. **Operaciones de repos y simultáneas activos y TTV contra dinero:** Se debe registrar la suma de dineros entregados en operaciones de repos activos, simultáneas activas y en operaciones de transferencia temporal de valores contra dinero.
18. **Derivados:**
 - a. **No estandarizados:** registra el valor a precio justo de intercambio de instrumentos financieros derivados no estandarizados.
 - b. **Garantías en derivados liquidados y compensados en una cámara de riesgo central de contraparte:** registra el valor de las garantías depositadas en contratos derivados liquidados y compensados en una cámara de riesgo central de contraparte. La constitución de garantías (liquidación) y los llamados de margen (devoluciones de margen) se deben reportar como una compra (venta) en las columnas correspondientes.
19. **Otras inversiones:** Registra el valor de mercado de las demás inversiones extranjeras de portafolio.
20. **Total:** Registra la suma de los renglones: Renta Variable, Renta Fija, fondos de inversión colectiva (carteras colectivas), Liquidez, **Operaciones de repos y simultáneas activos y TTV contra dinero**, Derivados y Otras Inversiones.

II. FONDEO

1. **Repos y simultáneas pasivos y en operaciones de transferencia temporal de valores (TTV) contra dinero:** Se debe registrar la suma de dineros recibidos en operaciones de repos pasivos, simultáneas pasivas y en TTV contra dinero.
2. **Otros mecanismos:** registra valor de financiamiento obtenido bajo otros mecanismos, por ejemplo créditos.

III. POSICIONES NETAS EN DERIVADOS

1. Se registra la posición neta en derivados discriminada por tipo de subyacente: renta variable, renta fija y monedas. La posición neta corresponde al valor nominal de las posiciones de compra, menos el valor nominal de las posiciones de venta en los diferentes tipos de derivados. En el caso de los derivados de monedas, la posición neta corresponde al valor nominal de las posiciones de compra de pesos colombianos, menos el valor nominal de las posiciones de venta de pesos colombianos, y no se incluyen las operaciones divisa-divisa.

IV. EMISORES EXTRANJEROS



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

1. Corresponde a las inversiones en valores extranjeros listados en los sistemas de cotización de valores del extranjero y las inversiones en valores extranjeros emitidos en el exterior e inscritos en el Registro Nacional de Valores y Emisores de Colombia, discriminados por:
 - a) Renta variable: Por ejemplo, algunas de las acciones que cumplen con esta condición son las siguientes: Pacific Rubiales Energy Corp, Canacol Energy Ltd. y Avianca-Taca Holdings S.A.
 - b) Renta Fija
 - c) Otras inversiones

2. ESPECIFICACIONES TÉCNICAS DEL ARCHIVO

La información del formato de Inversiones Extranjeras de Portafolio en Colombia debe enviarse en formato texto plano con extensión .txt, y con las siguientes especificaciones:

Primer registro (primera fila): El primer carácter debe ser una “E”. Los siguientes nueve caracteres deben contener el nit de la entidad sin dígito de verificación ni puntos o espacios. Si el nit tiene una longitud inferior a nueve caracteres complete la longitud requerida con ceros a la izquierda. Los siguientes seis caracteres deben contener la fecha de la información reportada. El formato requerido es AAAAMM donde AAAA corresponde al año y MM corresponde al número del mes.

Campo	Tipo	Longitud	Contenido
1	Caracter	1	E
2	Numérico	9	Nit de la entidad
3	Numérico	6	Fecha en formato AAAAMM

En los registros 2 a 26 (filas de la 2 a la 26) debe presentarse: En el primer carácter la letra “D”. En los siguientes tres caracteres el código asignado a cada componente de la inversión de portafolio (ver anexo 1). En el quinto carácter debe diligenciarse el signo (“+” ó “-”) para el dato correspondiente al saldo fin de mes del valor de mercado. Los siguientes 14 caracteres deben contener el dato del saldo fin de mes del valor de mercado. El siguiente carácter debe contener el signo (“+”) para el dato correspondiente al valor acumulado mensual para compras. Los siguientes 14 caracteres deben contener el valor acumulado mensual para compras. El siguiente carácter debe contener el signo (“+”) para el dato correspondiente al valor acumulado mensual para ventas. Los siguientes 14 caracteres deben contener el valor acumulado mensual para ventas. En cualquiera de los casos anteriores si el número de caracteres para las cifras es inferior a 14, complete 14 caracteres adicionando ceros a la izquierda de la cifra. Adicionalmente, todos los valores deben ser presentados en millones de pesos (COP\$ 1'000.000 debe reportarse en el formato como 1), sin decimales ni separador de miles y redondeados al número entero más cercano.

Para los siguientes componentes solamente se debe incluir el saldo fin de mes:

040: Liquidez

050: Operaciones de repos, simultáneas y transferencia temporal de valores

110: Repos y simultáneas pasivos y TTV contra dinero

120: Otros mecanismos

210: Derivados sobre renta variable



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

220: Derivados sobre renta fija

230: Derivados sobre monedas

Por favor tenga en cuenta la formulación de cada componente como se presenta en el anexo 2.

Campo	Tipo	Longitud	Contenido
1	Caracter	1	D
2	Caracter	3	Código asignado al componente de la inversión de portafolio
3	Caracter	1	Signo “+” o “-“
4	Numérico	14	Saldo fin de mes del valor de mercado
5	Caracter	1	Signo “+”
6	Numérico	14	Valor acumulado mensual para compras
7	Caracter	1	Signo “+”
8	Numérico	14	Valor acumulado mensual para ventas

El último registro (última fila) del archivo plano debe contener la letra “F” para indicar el fin de archivo.

Campo	Tipo	Longitud	Contenido
1	Caracter	1	F

Ejemplo de un archivo:

```
E99999999201101
D010+00000000017628+00000000003724+00000000003202
D011+00000000006524+00000000000823+00000000000956
D016+00000000011104+00000000002901+00000000002246
D017+00000000001568+00000000000756+00000000000657
D018+00000000009536+00000000002145+00000000001589
D020+00000000022447+00000000006834+00000000008277
D021+00000000011523+00000000004258+00000000005368
D026+00000000010924+00000000002576+00000000002909
D027+00000000008567+00000000002012+00000000001924
D028+00000000002357+00000000000564+00000000000985
D030+00000000007014+00000000001804+00000000002180
D031+00000000005425+00000000000954+00000000001259
D036+00000000001589+00000000000850+00000000000921
D040+000000000036587
D050+000000000011897
D060+00000000016235+00000000003687+00000000009524
D070+00000000014120+00000000005687+00000000006324
D080+00000000012020+00000000004587+00000000003224
D090+00000000137948+00000000026323+00000000032731
D100+00000000014555
D110+00000000003658
D120+00000000010897
```



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

D200+00000000563719
 D210+00000000216235
 D220+00000000336587
 D230+0000000010897
 D300+00000000375976+00000000020920+00000000045200
 D310+00000000214120+00000000005000+00000000006400
 D320+00000000135928+00000000002960+00000000015200
 D330+00000000025928+00000000012960+00000000023600
 F

El nombre del archivo debe tener la siguiente estructura: IPEXT-#####-AAAAMM en donde ##### hace referencia al nit del administrador y AAAAMM es la fecha del mes que se informa. Por ejemplo, si el nit del administrador es 999999999, y los datos corresponden a enero de 2011, el archivo debe grabarse de la siguiente manera: IPEXT-999999999-201101.txt y enviarse a la siguiente dirección electrónica: DTIE-IPEXT@banrep.gov.co.

Cualquier inquietud por favor enviarla a la misma dirección electrónica: DTIE-IPEXT@banrep.gov.co.

Anexo 1: Códigos asignados a los componentes de la inversión de portafolio

Código	Nombre de la variable
010	Renta Variable (011 + 016)
011	Sector Financiero
016	Sector No Financiero (017 + 018)
017	Público
018	Privado
020	Renta Fija (021 + 026)
021	Sector Financiero
026	Sector No Financiero (027 + 028)
027	Público
028	Privado
030	Fondos de inversión Colectiva (031 + 036)
031	Bursátiles
036	Resto
040	Liquidez
050	Operaciones de repos, simultáneas y transferencia temporal de valores
060	Derivados
070	Otras inversiones
080	Programas DR´s (ADR, GDR) y GDN´s
090	Total saldos de inversión(010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070+080)
100	Total fondeo (110+120)
110	Repos y simultáneas pasivos y TTV contra dinero
120	Otros mecanismos



Formato de inversiones extranjeras de portafolio en Colombia
(Información a transmitir a partir de los movimientos de septiembre de 2013)

Circular Reglamentaria Externa DCIN-83 de agosto 29 de 2013

200	Total posiciones netas en derivados (210+220+230)
210	Derivados sobre renta variable
220	Derivados sobre renta fija
230	Derivados sobre monedas
300	Total emisores extranjeros (310+320+330)
310	Renta variable
320	Renta fija
330	Otras inversiones en emisores extranjeros