



Banco de la República Colombia

BOLETÍN

No. **18**
Fecha 24 de marzo de 2021
Páginas 7

CONTENIDO

Página

Circular Reglamentaria Externa DOAM-305 del 24 de marzo de 2021, Asunto 16: Manual Operativo para la Administración del Indicador Bancario de Referencia (IBR) 1



**MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE OPERACIONES
Y ANÁLISIS DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**

Hoja 16 - 00

Fecha: 24 MAR 2021

Destinatario:

Oficina Principal y Sucursales del Banco de la República, Superintendencia Financiera de Colombia, Entidades Vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia, Asobancaria, Ministerio de Hacienda y Crédito Público.

ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)

La presente Circular reemplaza en su totalidad el Asunto 16: **MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)** de la Circular Reglamentaria Externa DODM-305 del 9 de enero de 2015 y del 31 de julio de 2012, del Manual del Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados.

Los cambios se realizan con el objetivo de incluir ajustes respecto a la operatividad relacionada con la presentación de las cotizaciones a través de los medios alternos en situaciones de contingencia y para incorporar las modificaciones efectuadas al Reglamento del IBR respecto a los horarios para la recepción de las cotizaciones y la publicación de la información del indicador en situaciones de contingencia.

Atentamente,

HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico

PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente
Monetario y de Inversiones Internacionales

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**Fecha : **24 MAR 2021****ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)****16.1 ORIGEN Y OBJETIVOS**

Por medio de la presente circular se adopta el manual operativo para la administración del esquema del Indicador Bancario de Referencia (IBR), el cual desarrolla lo señalado en el Reglamento del IBR (el reglamento) y en los contratos de prestación de servicios que los participantes y aspirantes del esquema suscriban con el Banco de la República (BR).

En su condición de administrador del esquema, el BR calculará y publicará el IBR, y realizará la liquidación de las operaciones pertinentes, según lo establecido en el reglamento.

16.2 AGENTES AUTORIZADOS

De acuerdo con lo establecido en el reglamento y en la metodología de selección de los participantes aprobada por el Comité Rector del IBR (CR), los participantes y los dos primeros aspirantes en el esquema (agentes) son los bancos definidos por el mencionado órgano.

Los agentes deben tener un contrato de prestación de servicios debidamente celebrado y vigente con el BR. La condición de agente se mantendrá mientras no sean expulsados del esquema o pierdan la calidad de participante o aspirante, de acuerdo con lo establecido en el reglamento.

Es obligación de los agentes contar con los sistemas necesarios para ingresar a los Servicios Electrónicos del BR (SEBRA) y al Sistema de Subastas del BR, al igual que mantener operativo y sincronizado el «token card» (tarjeta) de ingreso a SEBRA, o el mecanismo que lo sustituya.

16.3 RECEPCIÓN DE LAS COTIZACIONES DEL IBR

Las cotizaciones que deben efectuar los agentes participantes en el esquema se recibirán, para los diferentes plazos, de acuerdo con la periodicidad y el horario establecidos en el reglamento, a través de la plataforma tecnológica del Sistema de Subastas del BR, con sujeción al procedimiento operativo de dicho sistema.

16.4 CRÉDITOS INTERBANCARIOS Y OVERNIGHT INDEX SWAPS (OIS)

El esquema del IBR implica el otorgamiento de créditos interbancarios o la celebración de OIS, según el plazo de cotización.

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**Fecha : **24 MAR 2021****ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)****16.4.1 Créditos interbancarios**

El reglamento y los contratos firmados por los agentes con el BR, lo facultan, en calidad de administrador del esquema, para debitar o acreditar en forma automática las cuentas de depósito de los participantes en el BR, por concepto de la liquidación de los créditos interbancarios.

La información sobre la afectación de las cuentas de depósito de cada participante será reportada a las partes involucradas vía correo electrónico, con un archivo adjunto. El archivo incluirá, para el caso de los créditos interbancarios, la tasa de interés, el monto, la contraparte y el plazo de las operaciones interbancarias.

Adicionalmente, la información sobre las operaciones del esquema de formación del IBR podrá ser consultada en el Sistema de Subastas.

16.4.2 Overnight Index Swaps

En el caso de los OIS, a cada participante le será suministrada, en la fecha de cotización, la siguiente información por cada operación: su posición, su contraparte, la tasa fija (IBR) y la fecha de vencimiento. La información de todos los participantes le será suministrada a la cámara de riesgo central de contraparte (la cámara) que determine el CR. Al vencimiento de las operaciones, el BR le informará a cada participante la fecha de negociación, la tasa fija (IBR), la tasa compuesta y su contraparte. Adicionalmente, los participantes y la cámara podrán consultar la mencionada información en el Sistema de Subastas.

16.5 EFECTOS POR INCUMPLIMIENTOS

El BR, como administrador del esquema, aplicará los efectos por los incumplimientos definidos en el reglamento del mismo. El reglamento establece que los efectos son de aplicación inmediata y automática por parte del administrador. Lo anterior implica que el BR afectará las cuentas de los participantes en el BR cuando sea pertinente.

Los incumplimientos y sus efectos serán informados a los participantes incumplidos, a la Secretaría del CR y a la cámara.

16.6 PUBLICACIÓN

El IBR para cada uno de los plazos se publicará en la página de internet www.banrep.gov.co del BR, en los horarios establecidos en el reglamento. El BR publicará la totalidad de las cotizaciones presentadas por las entidades participantes con sus respectivos nombres para cada plazo.

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**Fecha : **24 MAR 2021****ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)**

Adicionalmente, publicará en su página de internet www.banrep.gov.co cualquier otra información relevante sobre el esquema.

En caso de que se presenten situaciones excepcionales que impidan la publicación del detalle de las cotizaciones por entidades, el BR publicará el indicador en su página de internet www.banrep.gov.co sin el detalle mencionado.

En caso de que se presenten situaciones excepcionales que impidan al BR efectuar la publicación del IBR en la página de internet www.banrep.gov.co, esta se efectuará lo antes posible a través de los medios alternativos que el BR considere pertinentes, los cuales pueden incluir, entre otros, las redes sociales del BR y su publicación por un tercero. En este caso, el IBR se publicará para cada plazo sin el detalle de las cotizaciones por entidades.

En escenarios de contingencia operativa, la publicación se sujetará a los horarios establecidos en el reglamento.

Cuando la página de internet www.banrep.gov.co esté disponible y se hayan superado las situaciones excepcionales que impidieron la publicación del detalle de las cotizaciones por entidades, se publicará este detalle para cada plazo en dicha página.

16.7 CONTINGENCIA

En una situación de contingencia, el agente participante deberá presentar las cotizaciones por los medios alternos en contingencia como se explica a continuación:

Durante el horario establecido para la operación, el agente participante deberá primero notificar esta situación en la página web del BR (www.banrep.gov.co), en la ruta: www.banrep.gov.co => Servicios => Contingencia de subastas del Banco de la República (vínculo: <https://www.banrep.gov.co/es/contenidos/webform/registro-para-presentacion-ofertas-las-operaciones-con-el-banco-republica>). Todos los campos del formato de registro deben ser diligenciados y se debe haber dado clic en “Generar registro” antes de la hora de cierre establecida para la operación. En caso de que se estén llevando a cabo varias subastas u operaciones al mismo tiempo, la solicitud será válida para todas estas.

Inmediatamente después de generar el registro, el agente participante deberá presentar sus cotizaciones al BR a través de los medios alternos en contingencia máximo 10 minutos después de la hora de cierre de la sesión; de lo contrario no serán tenidas en cuenta. En caso de que el mecanismo utilizado sea el teléfono, podrá presentar sus cotizaciones siempre y cuando se haya comunicado máximo 10 minutos después de la hora de cierre de la sesión. El BR hará su mejor esfuerzo para registrar las cotizaciones recibidas a través de los medios alternos en contingencia hasta las

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**Fecha : **24 MAR 2021****ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)**

11:00 (0 segundos) a.m. En caso de que una o varias cotizaciones recibidas por los medios alternos en contingencia no hayan podido ser registradas por el BR antes de las 11:00 (0 segundos) a.m., no serán tenidas en cuenta para el cálculo del IBR y el agente participante deberá asumir la posición de oferente o demandante que se le asigne de acuerdo con lo establecido en el reglamento.

Si hay una falla en la página web del BR que impida el registro de la situación de contingencia, el agente participante podrá presentar sus cotizaciones en los medios indicados sin necesidad de generar el registro, siguiendo las anteriores directrices.

A través de cualquiera de los mecanismos de contingencia, el agente participante deberá enviar una sola cotización por cada plazo, la cual no podrá ser modificada ni revocada. El agente participante es responsable de la exactitud y contenido de sus cotizaciones y de verificar que se presenten en la forma correcta.

Las cotizaciones deben ser presentadas en el formato de contingencia (archivo de Excel), cuya estructura se encuentra en el Anexo 1 de esta circular.

Los mecanismos de contingencia deben ser utilizados en el orden descrito a continuación:

a. GTA del portal de SEBRA

El agente participante deberá enviar a través del mecanismo GTA el formato de contingencia que se encuentra en el Anexo 1 de esta circular y en las Carteleras Electrónicas de SEBRA en la ruta MESA DE DINERO - CONTINGENCIA => FORMATOS DE CONTINGENCIA, debidamente diligenciado. El archivo no debe estar encriptado (el BR sólo tendrá en cuenta archivos que no estén encriptados). Para acceder al mecanismo de GTA, el agente participante deberá ingresar al portal SEBRA y seguir la siguiente ruta: Gestión de Transferencia de Archivos – GTA => SUBASTAS => Entrada. Posteriormente, debe dar clic en la opción «cargar», elegir el formato de contingencia diligenciado y dar clic en la opción «Actualizar».

b. Correo electrónico

En caso de fallas en el mecanismo alternativo de GTA, el agente participante deberá enviar el formato de contingencia a través del correo electrónico al buzón DOAM-Subastascontingencia@banrep.gov.co. El archivo debe estar firmado digitalmente. Para la firma se debe usar un certificado digital emitido por una entidad de certificación digital abierta acreditada por el Organismo Nacional de Acreditación

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 305**Fecha : **24 MAR 2021****ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)**

de Colombia (ONAC). El archivo no debe estar encriptado (el BR sólo tendrá en cuenta archivos con firma digital que no estén encriptados).

c. Teléfono

En caso de no poder presentar las cotizaciones a través de correo electrónico, como última instancia, el agente participante podrá comunicarse al teléfono +571 3430600 para la presentación de las cotizaciones. En este caso, serán indispensables el «login» de usuario de contingencia, la clave del «token» de contingencia y el número que genera el «token» de contingencia.

16.8 TARIFA POR LA PRESTACIÓN DE LOS SERVICIOS DE ADMINISTRACIÓN DEL IBR

La tarifa se cobrará anualmente y será modificada o reajustada cada año, de acuerdo con las decisiones adoptadas por el Consejo de Administración del BR. Cualquier modificación en la remuneración será notificada por el BR mediante el mecanismo establecido en el reglamento, y podrá ser divulgada, además, mediante otro medio que el BR considere pertinente.

La tarifa será distribuida en partes iguales entre todas las entidades participantes del esquema. En caso de empate en la selección de los participantes, el cobro de la tarifa de las entidades empatadas se realizará en forma proporcional al tiempo para el cual cada entidad sea designada para actuar como participante en el esquema de formación del IBR. El valor que corresponda a cada entidad se debitará automáticamente, junto con los impuestos que sean aplicables, de la cuenta de depósito de la respectiva entidad, dentro del plazo previsto en el contrato de prestación de servicios con el BR.

(ESPACIO DISPONIBLE)

H. Vargas PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 305
ANEXO I

Fecha : 24 MAR 2021

ASUNTO 16: MANUAL OPERATIVO PARA LA ADMINISTRACIÓN DEL INDICADOR BANCARIO DE REFERENCIA (IBR)

ANEXO N°1.

FORMATO N°6 FORMULARIO PARA LA PRESENTACIÓN DE LAS COTIZACIONES DEL IBR AL BANCO DE LA REPÚBLICA



FORMATO N°6 PARA PRESENTACIÓN DE COTIZACIONES

Únicamente diligenciar las celdas sombreadas.

OPERACIÓN: COTIZACIÓN IBR (CRE DOAM-305)

FECHA dd/mm/aaaa
NIT ENTIDAD Sin dígito de verificación
NOMBRE ENTIDAD
NOMBRE DEL FUNCIONARIO QUE
DILIGENCIA EL FORMATO
TELÉFONO (con indicativo)
CORREO ELECTRÓNICO

[Redacted area for form fields]

ATENCIÓN: NO ENCRIPTAR. Cuando este formato es enviado por correo electrónico debe estar firmado digitalmente.

| | PLAZO | TASA OFRECIDA (1) |
|---|-----------|----------------------|
| 1 | Overnight | |
| 2 | 1 mes | |
| 3 | 3 meses | |
| 4 | 6 meses | |

(1) No incluir el signo % (Ej: Si su oferta es 3.000% debe incluir solo el número 3.000. Si su oferta es 0.300% debe incluir 0.300). Las tasas cotizadas son en términos nominales con base 360. Tasas expresadas en tres decimales.

RECOMENDACIONES:

No realizar ningún cambio en el formato ni agregar hojas de cálculo.
Verificar los valores incluidos. Las cotizaciones recibidas con su respectivo contenido son en firme.
Guardar el archivo con el nombre: "IBR-Número del NIT" (NIT sin dígito de verificación).
Consultar el Reglamento del IBR.

La presentación de las cotizaciones y/o el cumplimiento de la(s) operación(es) se sujetan a las condiciones, obligaciones y procedimientos establecidos en el contrato de prestación de servicios que suscribe el agente, en el Reglamento del IBR y en la Circular Reglamentaria Externa DOAM 305 Asunto 16: Manual Operativo para la Administración del Indicador Bancario de Referencia (IBR). Los participantes del esquema del IBR aceptan como prueba de la existencia de las cotizaciones presentadas y de las operaciones celebradas por ellos, los registros del sistema informático o de los medios alternos del BR, así como toda prueba que permita acreditar las cotizaciones cursadas y las operaciones celebradas, especialmente registros electrónicos y grabaciones. Asimismo, los participantes del esquema del IBR aceptan las consecuencias de los incumplimientos de las operaciones y los procedimientos previstos para el efecto en dicha reglamentación. Con el envío de las cotizaciones, los participantes del esquema del IBR aceptan los términos, condiciones, obligaciones y procedimientos anteriores.

H. Vargas PC