



Banco de la República | Colombia

Título de boletín

Número: 33

Fecha: 17 de agosto de 2023

Páginas: 47

Contenido

- Circular Reglamentaria Externa DOAM-317 del 17 de agosto de 2023, Asunto 19: Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas: página 1

Este boletín se publica en desarrollo de lo dispuesto en el literal a) del artículo 51 de la Ley 31 de 1992 y del párrafo del artículo 108 de la Ley 510 de 1999.

Secretaría Junta Directiva – Carrera 7 #14-78, piso sexto – Bogotá, D. C. – Teléfonos: +57 (601) 343-1111 y +57 (601) 343-1000

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317

MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE OPERACIONES Y ANÁLISIS DE MERCADOS

Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023



Destinatario: Oficina Principal y Sucursales, Superintendencia Financiera de Colombia, Bolsa de Valores de Colombia; Entidades sometidas a la Inspección y Vigilancia de la Superintendencia Financiera de Colombia; Ministerio de Hacienda y Crédito Público; Autorregulador del Mercado de Valores; Sistemas de Compensación y Liquidación de Divisas; Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas.

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

La presente Circular reemplaza en su totalidad la Circular Reglamentaria Externa DOAM-317 del 30 de octubre de 2020, del 27 de diciembre de 2021 y del 1 de marzo de 2022, correspondiente al Asunto 19: “**SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**” del Manual del Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados.

Las modificaciones se realizan para:

- Incorporar nuevas variables en el envío de la información de las operaciones *spot* y modificar los requerimientos de información de las variables de las operaciones que se liquidan en una Cámara de Riesgo Central de Contraparte. Lo anterior con el objetivo de fortalecer el análisis sobre el comportamiento del mercado cambiario local; y
- Acoger los estándares de usabilidad y accesibilidad en el contenido de las circulares externas definidos por el Banco de la República.

La presente Circular Reglamentaria Externa entra en vigencia a partir del 18 de agosto de 2023.

Cordialmente,

HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico

ANDRÉS MURCIA PABÓN
Subgerente Monetario y de Inversiones
Internacionales

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

1. Origen

Esta circular reglamenta la Resolución Externa número 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 número 4 de 2009, los Intermediarios del Mercado Cambiario (IMC), señalados en los Numerales 1, 2 y 3 del artículo 8 de la Resolución Externa número 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 un 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 o con el Banco de la República (BR), 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.

H. Vargas

[Signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

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.
- Fecha de vencimiento.
- Fecha de liquidación.
- Identificación de los afiliados, operadores participantes de la operación.
- Tipo de instrumento: operaciones de contado, *forwards*, opciones, *swaps*, *swaps* tasa de cambio y de interés, entre otros.
- Monedas involucradas (Moneda 1 y Moneda 2). En operaciones peso colombiano (COP) - divisa la Moneda 1 corresponde a la divisa externa.
- Tipo de operación: compra o venta de la Moneda 1.
- Monto de la operación: se expresa en la Moneda 1.
- Tasa pactada: corresponde a la cantidad de Moneda 2 por Moneda 1.
- Modalidad de cumplimiento: efectivo (DF) o financiero (NDF).
- Opcionalidad: Sí (S) o No (N).
- Descripción de la opcionalidad: se debe registrar en los casos que 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 de 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 la sociedad fiduciaria, NIT y nombre de la 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) 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

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.

- Aceptado Cámara: información sobre si la liquidación se hace a través de una Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC).
- Sistema de negociación previo: 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:

- 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.
- 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 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.
- 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 de 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 COP-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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

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.

1. 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 quince (15) 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 un IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público-, operaciones que deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. También se 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 estas operaciones de manera profesional. Las entidades vigiladas por la SFC distintas de IMC deberán registrar las operaciones de derivados ejecutadas con el Banco de la República antes de la hora de cierre operativo de los sistemas de registro de operaciones.
2. 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 quince (15) minutos posteriores a la apertura de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

3. 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 quince (15) 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 un 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 quince (15) minutos posteriores a la apertura del día hábil siguiente, en caso de que la tasa se conozca después del cierre de dichos sistemas.
4. 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.
5. 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 $t=0$.
6. 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 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.
7. El ejercicio parcial de una opción tipo americana debe ser registrado como una modificación al monto de la operación vigente de tal forma que se muestre el monto que hace falta por ejercer. El ejercicio total de estas opciones debe ser registrado como una modificación de la fecha de vencimiento, de tal forma que esta corresponda a la fecha de ejercicio.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

-
8. Para las operaciones del mercado de contado que hacen parte del cálculo de la Tasa Representativa del Mercado (TRM), según lo establecido en la Circular Reglamentaria Externa (CRE) DOAM-146, su registro y modificaciones podrán efectuarse como máximo a la 1:25 pm.

A continuación, se presentan algunos ejemplos asociados a la identificación de las contrapartes y beneficiarios, 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 COP 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 COP 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 de Pensiones, Fondos de Cesantías) negocie la compra de divisas a cambio de COP 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 COP 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 COP 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

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 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 número 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 de 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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Los administradores de sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán aceptar modificaciones a las condiciones pactadas en las operaciones de contado y de derivados registradas por su conducto durante la vigencia de las mismas. Para las operaciones del mercado de contado que hacen parte del cálculo de la Tasa Representativa del Mercado (TRM), según lo establecido en la CRE DOAM-146, los afiliados podrán efectuar modificaciones únicamente atendiendo errores de digitación y como máximo a la 1:25 pm. Los administradores de los sistemas deberán establecer los controles necesarios para que ninguna modificación pueda surtirse con posterioridad a dicho horario. 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 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 contado y de derivados, siempre y cuando puedan acreditar los cambios ante los organismos de vigilancia y control, y se ajusten a lo establecido en los reglamentos de los sistemas de negociación y de registro de divisas. Cuando las operaciones hayan sido aceptadas por un sistema de compensación y liquidación de divisas o por una cámara de riesgo central de contraparte, las modificaciones deberán atender lo establecido en sus respectivos reglamentos. En el caso de las operaciones de derivados, las modificaciones deben atender la reglamentación establecida en la Circular Reglamentaria Externa DOAM-144. El registro de las modificaciones a las operaciones de contado y de derivados debe realizarse de acuerdo con los siguientes principios:

1. 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.
2. 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 quince (15) minutos posteriores a la apertura siguiente de dichos sistemas.
3. 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

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:

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 contado y 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 quince (15) minutos, y al final de cada sesión de negociación o de registro por lo menos la siguiente información:

1. 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

ejecutada, observados hasta el momento de la publicación. Adicionalmente, la evolución de la tasa de las transacciones ejecutadas a lo largo de la sesión.

2. 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 un 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.

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 número 2 de 2017 de la Junta Directiva del BR en lo relacionado con *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 un 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 de 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)

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Instructivo para el diligenciamiento y transmisión de la información de las operaciones sobre divisas por parte de administradores de los sistemas de negociación 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 contado y 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: <https://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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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 6013431111 extensión 0359. Una vez reportado el inconveniente, el Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados (DOAM) 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 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 en el formato año, mes y día.

EEE: Identificador del tipo de entidad que envía el archivo (SNR).

nnnnnnnnnnnn: El número de NIT del SN/SR (con dígito 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:

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Nombre del archivo: D01_20140202SNR0084204746210001.xml

Donde:

Fecha de transmisión: 20140202 (8 dígitos).

Tipo de entidad: SNR.

NIT del SN/SR: 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.

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, Quinta 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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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. A continuación, 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=5
Consecutivo Archivo	Entero	4	Debe ser un consecutivo para cada archivo enviado.	
Cantidad Registros	Entero		Se envían archivos con máximo 10000 registros, si se requiere enviar más de 10000 registros se fraccionará la información en varios archivos de 10000.	Cantidad de Registros reportados en el contenido.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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
Operaciones de contado	SPOT	SNR
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 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:

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

1. En la información de una variable en particular NO puede existir el carácter (') o (").
2. El separador de los decimales es punto (.).

En la siguiente tabla se muestra una relación de las variables requeridas por tipo de instrumento, de acuerdo con la siguiente convención:

X: Obligatoria.

O: Opcional.

L: Se lee del nombre del archivo.

NA: No aplica.

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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
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
HoraNegociacion	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	X
TipoOrigen	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	X
NITSNRolMC	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L
NITSNRolMCRegAnterior	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
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
TipoDPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaVentaNegociante	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
TipoDPuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaCompraNegociante	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
SubsectorPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaCompraNegociante	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	NA	NA	NA	NA	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaContado	X	NA	X	NA	X	NA	X	NA	NA	NA	X	NA
TasaPactada1Precio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaPactada2	NA	NA	X	X	NA	NA	X	X	NA	NA	X	NA
Moneda2	NA	NA	NA	NA	X	X	X	X	NA	NA	X	X
PeriodicidadFlujoM1	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	X	NA
PeriodicidadFlujoM2	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	X	NA
MontoDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	NA
MontoNDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	NA
TasaReferenciaSubyacente	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	NA
Opcionalidad	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	X	NA
TipoOpcionalidad	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	X	NA
AceptadoCamara	X	X	X	X	O	O	O	O	O	O	X	X
FechaCRCC	X	X	X	X	O	O	O	O	O	O	X	X
TipoOpcion	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	X	NA
TipoEjercicioOpcion	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	X	NA
PrimaInicial	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	X	NA
Condición	NA	X	NA	NA	NA	X	NA	NA	NA	X	X	NA
PlazoTasa	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	X	X	X	NA
PrimaPeriodica	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	O	NA
EmisorSubyacente	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	O	O	O	NA
FechaVenSubyacente	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	O	O	O	NA
ValorFacialCubierto	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	O	NA
FechaEfectivaDC	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	O	NA
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
Comentarios	O	O	O	X	O	O	O	X	O	O	O	O

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Cada una de las variables mencionadas en la tabla anterior debe cumplir con las siguientes características:

TipoNovedad	Corresponde al tipo de novedad que se está reportando con el registro. 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).		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe corresponder a uno de los siguientes registros: I, M, A o F.	<p>Inicial (I): Cuando la negociación se reporta por primera vez;</p> <p>Modificación (M): Cuando durante la vigencia del contrato se modifica alguna de las condiciones;</p> <p>Aclaración (A): Cuando se reporta una corrección a la información reportada y aceptada inicialmente;</p> <p>Fraccionamiento (F): Cuando el reporte corresponde a la división de una negociación ya reportada.</p>
NumeroRegistro	Número de registro de la negociación. Para cada fecha de negociación debe existir una serie de caracteres recomendablemente consecutivos.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	15	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.		

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Para el tipo de novedad I, la fecha de negociación debe ser la del día anterior o igual a la fecha en la que se reportan las operaciones. Esta fecha debe corresponder a un día que exista en el calendario y debe ser un día hábil.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).
HoraNegociacion		Corresponde a la hora de negociación de la operación.	
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	8	No aplica	Debe registrarse en estándar de 24 horas con formato (HH:MM:SS).
TipoOrigen		Corresponde a la clasificación según el origen de la operación.	
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	1	Debe corresponder a uno de los siguientes registros: S, N, W, E.	<p>T+0 (S): Operaciones de contado con liquidación el mismo día.</p> <p>Next day (N): Operaciones de contado con liquidación entre t+1 y t+3.</p> <p>Swap (W): Aquellas que corresponden al flujo spot de una operación swap.</p> <p>Efectivo (E): Aquellas operaciones con entrega de divisas en efectivo, las cuales se omiten del cálculo de la TRM.</p>

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

NITSNRoIMCRegAnterior			
Número de NIT del SN/SR con el que se reportó en la ocasión inmediatamente anterior la negociación sujeta a modificación. Esta variable solo se debe registrar en caso de que el TipoNovedad 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. 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.	Se debe registrar el número de NIT del SN/SR con que se reportó la negociación anterior.
NumRegAnterior			
Número de Registro con que se reportó la negociación sujeta a modificación, esto en caso de que el tipo de novedad sea distinta a inicial.			
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	15	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.	Se debe registrar el número de registro con que se reportó la negociación anterior.

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

FechaOpAnterior	Corresponde a la fecha en la cual fue reportada la negociación sujeta a modificación (en caso de que el tipo de negociación sea distinta a inicial).		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	<p>Únicamente debe diligenciarse cuando se reporta una novedad tipo M, A o F.</p> <p>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.</p>	Se debe registrar la fecha con que se reportó la negociación anterior. El formato de la fecha debe ser AAAA-MM-DD.
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
Carácter	1	Debe ser S o N.	La negociación en la punta de venta es realizada a nombre de un tercero: Sí(S), o no (N).

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

PuntaCompraTerceros	Indica si la negociación de la punta de compra es realizada a nombre de terceros.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe ser S o N.	La negociación en la punta de compra es realizada a nombre de un tercero: sí (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

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

			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	El IDPuntaVentaNegociante no puede venir blanco, vacío o nulo.	Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un NIT, esta debe incluir el dígito de verificación sin separador.
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	El IDPuntaCompraNegociante no puede venir blanco, vacío o nulo.	Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un NIT, esta debe incluir el dígito de verificación sin separador.
NombrePuntaVentaNegociante	Nombre de la entidad que negoció la punta de venta en el contrato.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	40	No aplica.	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	No aplica.	Razón social o nombre de la entidad que negoció la punta de compra en el contrato.

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

TipoIDPuntaVentaBeneficiario	Tipo de documento de identificación del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso de 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 de 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 de que se haya efectuado a nombre de un tercero.		

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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 NIT, 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 de 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 NIT, 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 de 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 de 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 de 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 de que se haya efectuado a nombre de un tercero.

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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 CIU o en su defecto a una de las opciones del dominio de la lista del numeral 7 del presente Anexo.	Código CIU/Tabla de Sectores (Numeral 7 del presente Anexo).
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 CIU o en su defecto a una de las opciones del dominio de la lista del numeral 7 del presente Anexo.	Código CIU/Tabla de Sectores (Numeral 7 del presente Anexo).
SubSectorPuntaVentaBeneficiario	Código Sector de la actividad económica del ordenante o beneficiario de la punta de venta de la negociación en caso de que se haya efectuado a nombre de un tercero.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	8	Debe corresponder al código CIU o en su defecto a una de las opciones del dominio de la lista del numeral 7 del presente Anexo. No debe ser vacío si PuntaVentaTerceros es S.	Código CIU/Tabla de Sectores (Numeral 7 del presente Anexo).

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

SubSectorPuntaCompraBeneficiario		Código Subsector de la actividad económica del ordenante o beneficiario de la punta de compra de la negociación en caso de que se haya efectuado a nombre de un tercero.	
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	8	Debe corresponder al código CIU o en su defecto a una de las opciones del dominio de la lista del numeral 7 del presente Anexo. No debe ser vacío si PuntaCompraTerceros es S.	Código CIU/Tabla de Sectores (Numeral 7 del presente Anexo).
MontoNegociación		Valor nominal de la negociación.	
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	24	No puede exceder 18 enteros y 6 decimales El monto de la negociación no puede venir blanco, vacío o nulo. 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Carácter	3	Debe corresponder con los códigos de moneda manejados por el Sistema SWIFT.	<p>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 otras operaciones COP-divisa la Moneda 1 corresponde a la divisa externa.</p> <p>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.</p>
TasaContado	Tasa de contado vigente en el momento en que se realizó la negociación de derivados.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	11	No puede exceder 5 enteros y 6 decimales.	Debe ser expresada en cantidad 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 refiere 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.		

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	11	No debe exceder 5 enteros y 6 decimales.	<p>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.</p> <p>En los instrumentos swap peso-dólar (FX swap), se refieren a la tasa pactada para la punta spot de la negociación.</p> <p>Ejemplo: para un tipo de cambio de 2164 pesos por dólar, la tasa se debe reportar como 2164.000000.</p>
Moneda2	Código de la Moneda 2.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	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 donde por defecto la Moneda 2 es el peso colombiano (COP), forwards tasa de interés y opciones tasa de interés.
TasaPactada1Precio	<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 otras monedas, swaps otras monedas y opciones otras monedas), se debe llenar la tasa pactada en unidades de la moneda 2 que serán intercambiadas por la moneda 1.</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 moneda1.</p>		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Numérico	11	No debe exceder 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 otras monedas, swaps otras monedas y opciones otras monedas), se debe llenar la tasa pactada en unidades de la moneda 2 que serán intercambiadas por la moneda 1. Por ejemplo: si moneda1 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 1.3 USD por EUR). Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3 USD por EUR la tasa se debe reportar como 1.300000. Ejemplo: para un tipo de cambio de 2164 pesos por dólar, la tasa se debe reportar como 2164.000000.</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. En el caso de los forwards de tasa de interés, la tasa de interés pactada.</p> <p>Para otros derivados se debe especificar el precio pactado por el subyacente en términos de la moneda1.</p>
----------	----	------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

PeriodicidadFlujoM 1	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	No debe exceder 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.
PeriodicidadFlujoM 2	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	No debe exceder 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.
MontoDF	Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento efectivo (DF).		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	24	No debe exceder 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.
MontoNDF	Corresponde al valor que se liquidará en la modalidad de cumplimiento financiero (NDF).		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	24	No debe exceder 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.

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

TasaReferenciaSubyacente	Tasa de referencia a la cual se realizará el cumplimiento del contrato o subyacente de referencia.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	11	No debe exceder 5 enteros y 6 decimales. La tasa de referencia debe venir diligenciada, si 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).
AceptadoCamara	Indica si la negociación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe ser S o N.	Aceptado por una CRCC: Sí (S), o No (N).
Opcionalidad	Indica si el contrato forward tiene una opción implícita.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe ser S o N.	Tiene opción implícita: Sí (S), o no (N).
TipoOpcionalidad	Describe la opción implícita del forward en caso de que el campo anterior sea afirmativo.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	50	No debe ser vacía si el campo opcionalidad es (S).	No aplica.
TipoOpcion	Tipo de opción negociada: <i>Call</i> o <i>Put</i> .		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	1	Debe ser C o P.	<i>Call</i> (C) o <i>Put</i> (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	Esta fecha debe ser anterior a la fecha de vencimiento de la negociación.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). Dado que la negociación puede ser aceptada por la CRCC en cualquier

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

		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). Mientras la negociación no haya sido aceptada por una CRCC, esta variable no se debe incluir.	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 u Otra.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
	3	Debe ser AME, EUR u OTR.	Americana (AME), Europea (EUR) u Otra (OTR).
Condicion	Describe la condición de ejercicio de la opción.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	50	No aplica.	Se describe la condición de ejercicio. En el caso de opciones con <i>strike</i> , este campo se refiere al <i>strike</i> de la opción (en opciones peso-dólar y opciones otras monedas debe ser llenado en términos de unidades de moneda2 por moneda1). Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3 USD por EUR la tasa se debe reportar como 1.300000 (EUR es la moneda1 y USD la moneda2. 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.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

Numérico	14	No debe exceder 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 (<i>forward</i> 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	No aplica.	Esta variable aplica para forwards tasa de interés y opciones tasa de interés.
PrimaPeriodica	Se refiere a los pagos periódicos pactados en el derivado.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	14	No debe exceder 8 enteros y 6 decimales.	La moneda en que está expresado debe definirse en el atributo moneda1.
EmisorSubyacente	Emisor del activo subyacente de la operación.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	32	No aplica.	Para los instrumentos forwards tasa de interés y opciones tasa de interés se debe registrar el emisor del título en el caso en que el subyacente de la operación sea un título de renta fija.
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 FechaVen.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

ValorFacialCubierto	Se refiere al valor nominal del activo de referencia que paga el vendedor del derivado de crédito ante los eventos definidos en el contrato.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	14	No debe exceder de 8 enteros y 6 decimales.	La moneda en que está expresado debe definirse en el atributo moneda1.
FechaEfectivaDC	Fecha efectiva de la operación.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	No aplica.	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
Carácter	1	Debe ser S o N.	Negociada previamente en otro sistema: Sí (S), o no (N).
SistemaPrevio	Este campo debe indicar el código del sistema en el que fue negociada previamente la operación. Para las operaciones negociadas a través de cualquier mecanismo de negociación diferente a los SN/SR autorizados por la SFC señalados a continuación, no se debe diligenciar este campo.		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Carácter	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 FX S.A. I: ICAPCO T: Tradition Colombia S.A. G: GFI Exchange Colombia S.A.
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	No aplica.	Debe registrarse la tasa de referencia y si existe algún spread frente a dicha tasa (ej. TRM + 2).

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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).
Comentario	En este campo se debe enviar la información de los tipos de tasas de interés relacionadas a los instrumentos de swaps interés otras monedas (SWIOM) y swaps interés peso dólar (SWPID) conforme a la siguiente estructura		
Tipo de dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	9999	No aplica.	“Tasa pactada moneda 1 = característica de la tasa de interés usada para los flujos de la moneda 1 / Tasa pactada moneda 2 = característica de la tasa de interés usada para los flujos de la moneda 2” (ej. “IBR / Tasa Fija”).

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**).

El reporte de Modificaciones (M), Aclaraciones (A) o Fraccionamientos (F) deben ser enviados usando la versión del esquema XSD con la cual se reportó la operación inicial (I).

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

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 las 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 con lo establecido en la CRE DOAM-144.

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>5</Version>
    <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>
    </FWPD>
  </Operaciones>
</Reporte>
```

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

```
<TipoIDPuntaCompraNegociante>NI</TipoIDPuntaCompraNegociante>
      <IDPuntaCompraNegociante>987654321</IDPuntaCompraNegociante>
<NombrePuntaCompraNegociante><![CDATA[Nombre]]></NombrePuntaCompraNegocia
nte>
<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>
```

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 con la versión de XSD vigente (proporcionada por el BR).
- Validación 3 de 4 – Datos: De acuerdo con 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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

- 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 J13)**
 - 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: FDN, ICETEX, BANCOLDEX, FINAGRO, FINDETER Y FONADE

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 1

J13 OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS

K ENTIDAD FINANCIERA NO RESIDENTE

L FINANCIACION DE PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS (DIVISIONES L1 A L7)

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)

L6 POSICIÓN PROPIA DE FONDOS DE PENSIONES Y CESANTÍAS O ASEGURADORAS

L7 PATRIMONIOS AUTÓNOMOS ADMINISTRADOS POR FONDOS DE PENSIONES Y CESANTÍAS

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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 2

CARTA DE SOLICITUD Y ACUERDO DE SERVICIO

Señores

BANCO DE LA REPÚBLICA
Dirección General de Tecnología
Carrera 7 # 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 número _____ 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 número _____ del _____ 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 de dar cumplimiento a los deberes de envío de información señalados en la Resolución Externa número 4 de 2009 de la Junta Directiva del Banco de la República y en la Circular Reglamentaria Externa DOAM-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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 2

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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 3

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 número 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:

H. Vargas

[Handwritten signature]

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 3

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.
- 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.

3. 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

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 3

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.

4. 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.
- 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.

H. Vargas

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DOAM-317



Fecha: jueves, 17 de agosto de 2023

Asunto 19: Sistemas de negociación y sistemas de registro de operaciones sobre divisas

Anexo 3

- i. Abstenerse de explotar de cualquier forma los derechos de propiedad intelectual del BR, incluidos sus signos distintivos, patentes de invención, modelos de utilidad, diseños industriales, derechos de autor sobre el software 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.

5. 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.

6. 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.

H. Vargas