



# Banco de la República Colombia

## BOLETÍN

No. 49  
 Fecha 30 de Septiembre de 2015  
 Páginas 11

### Página

### CONTENIDO

Circular Reglamentaria Externa DODM-139 del 30 de septiembre de 2015 "Asunto 1: Posición Propia, Posición Propia de Contado, Posición Bruta de Apalancamiento e Indicadores de Exposición por Moneda de los Intermediarios del Mercado Cambiario".	1
Circular Reglamentaria Externa DODM-146 del 30 de septiembre de 2015 "Asunto 8: Metodología de cálculo de la Tasa de Cambio representativa del mercado".	3
Circular Reglamentaria Externa DODM-317 del 30 de septiembre de 2015 "Asunto 19: Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas".	5

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 7ª. No. 14-78 Piso 6º. - Bogotá D.C. - Teléfonos: 343 11 11 – 343 1000



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

Hoja 19-00

Fecha: 30 SET. 2015


**Destinatario:** Oficina Principal y Sucursales; Superintendencia Financiera de Colombia; Establecimientos Bancarios; Corporaciones Financieras; Compañías de Financiamiento; Cooperativas Financieras; Comisionistas de Bolsa; Financiera de Desarrollo Nacional; BANCOLDEX; Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas.

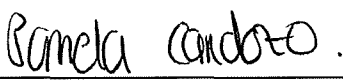
**ASUNTO 19: SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

La presente Circular modifica las Hojas A1-6 y A1-13 a A1-17 del 30 de mayo de 2014, de la Circular Reglamentaria Externa DODM-317 correspondiente al Asunto 19: **“SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS”** del Manual del Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados.

Las modificaciones se realizan con el fin incluir campos al reporte *“Modelo de formatos de reporte de operaciones sobre divisas”* que los Sistemas de Negociación y Registro de Operaciones sobre divisas deben enviar al Banco de la República en relación a las operaciones de divisas que se pactan a una tasa de mercado la cual no se conoce al momento de la negociación.

Cordialmente,

  
HERNANDO VARGAS HERRERA  
Gerente Técnico

  
PAMELA CARDOZO ORTIZ  
Subgerente  
Monetario y de Inversiones Internacionales



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317  
ANEXO No. 1

A1 -6

Fecha: 30 SET. 2015

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

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

VARIABLE	FWPD	OPPD	SWPD	SWPID	FWOM	OPOM	SWOM	SWIOM	FWTI	OPTI	OD	SPOT
TipoNovedad	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaVenta	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
NITSNRoiMC	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L
NITSNRoiMCRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NumRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaOpAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaVen	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaVenta	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaCompra	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
MontoOperacion	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Moneda1					X	X	X	X	X	X	X	X
TasaContado	X		X		X		X				X	
TasaPactada1Precio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaPactada2			X	X			X	X			X	
Moneda2					X	X	X	X			X	X
PeriodicidadFlujoM1				X				X			X	
PeriodicidadFlujoM2				X				X			X	
MontoDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	
MontoNDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	
TasaReferenciaSubyacente	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	
Opcionalidad	X				X				X		X	
TipoOpcionalidad	X				X				X		X	
AceptadoCamara	X		X								X	
FechaCRCC	X		X								X	
TipoOpcion		X				X				X	X	
TipoEjercicioOpcion		X				X				X	X	
PrimalInicial		X				X				X	X	
Condicion		X				X				X	X	
PlazoTasa									X	X	X	
RegistroPrevio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaFIX	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
FechaFIX	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X

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

HCH

PC



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317    A1 -13**  
**ANEXO No. 1**

Fecha: 30 SET. 2015

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

<b>FechaCRCC</b>			
Fecha en que la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Para los instrumentos tipo 1 y 11 esta fecha debe ser anterior a la fecha de vencimiento de la operación. Esta variable debe ser mayor o igual a la fecha de negociación (Fecha de Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I). Mientras la operación no haya sido aceptada por una CRCC, esta variable no se debe incluir.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD). Dado que la operación puede ser aceptada por la CRCC en cualquier momento durante la vigencia del contrato, un cambio en esta condición debe ser reportado como una modificación (M).
<b>TipoEjercicioOpcion</b>			
Tipo de opción negociada: Americana o Europea.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	3	Debe ser AME o EUR	Americana (AME) ó Europea (EUR)
<b>Condicion</b>			
Describe la condición de ejercicio de la opción.			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	50		Se describe la condición de ejercicio. En el caso de opciones con strike, este campo se refiere al strike de la opción (en Opciones peso-dólar y Opciones Otras Monedas debe ser llenado en términos de unidades de moneda dos por moneda 1). Ejemplo: para un tipo de cambio de 1.3 Dólares por Euro la tasa se debe reportar como 1.300000 (euro es la moneda 1 y dólar la moneda 2. Aplica para opciones peso-dólar y opciones otras monedas. Para opciones de índices bursátiles y opciones tasa de interés se da en términos de moneda 1).
<b>PrimalInicial</b>			
Corresponde al pago inicial para entrar en el contrato (aplica para Opciones).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	14	8 enteros y 6 decimales Si no hay pago inicial esta variable no se debe reportar.	La moneda en que está expresado el monto debe definirse en el atributo moneda1.
<b>PlazoTasa</b>			
Para los instrumentos sobre tasa de interés (forward tasa de interés y opciones tasa de interés) se debe reportar el plazo que esta aplicará (en días).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Numérico	4		Esta variable aplica para forwards tasa de interés y Opciones Tasa de Interés
<b>FechaVenSubyacente</b>			
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 Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I) y mayor a la variable Fecha ven.	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).
<b>RegistroPrevio</b>			
Este campo debe indicar si esta operación fue negociada o registrada previamente en otro sistema (S/N).			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser S o N.	Registrada o negociada previamente en otro sistema (S), o no (N).
<b>TasaFIX</b>			
Cuando la operación se pacta a una tasa de mercado que no se conoce al momento de la negociación se debe indicar cuál es esta tasa de referencia			
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	20		Debe registrarse la tasa de referencia y si existe algún spread frente a dicha tasa (ej. TRM + 2)

RC

HHH



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317**  
**ANEXO No. 1**

A1 -14

Fecha: 30 SET. 2015

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

FechaFIX	Fecha en la cual se forma la tasa de referencia de la operación		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Fecha	10	Esta fecha debe ser igual o posterior a la fecha de negociación (Fecha de Operación cuando el instrumento se reportó con el Tipo de Novedad Inicial I)	Debe registrarse como año, mes, día en formato (AAAA-MM-DD).

De acuerdo a la definición anterior de las variables para el reporte de operaciones de derivados, un ejemplo de una operación FWPD en formato XML será:

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Reporte xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xmlns="http://www.banrep.gov.co"
  xsi:schemaLocation="http://www.banrep.gov.co reporte.xsd">
<Encabezado>
  <Nit>000845236987</Nit>
  <TipoEntidad>SNR</TipoEntidad>
  <FechaTransmision>2013-09-10</FechaTransmision>
  <Version>1</Version>
  <ConsecutivoArchivo>0001</ConsecutivoArchivo>
  <CantidadRegistros>1</CantidadRegistros>
</Encabezado>

<Operaciones>
  <FWPD>
    <TipoNovedad>I</TipoNovedad>
    <TipoIDPuntaVenta>NI</TipoIDPuntaVenta>
    <IDPuntaVenta>123456789</IDPuntaVenta>

    <NombrePuntaVenta><![CDATA[NombreParte]]></NombrePuntaVenta>
    <NumeroRegistro>123</NumeroRegistro>
    <FechaOper>2013-06-05</FechaOper>
    <FechaVen>2013-07-24</FechaVen>
    <TipoIDPuntaCompra>NI</TipoIDPuntaCompra>
    <IDPuntaCompra>987654321</IDPuntaCompra>

    <NombrePuntaCompra><![CDATA[Nombre]]></NombrePuntaCompra>
    <SubsectorPuntaVenta>F</SubsectorPuntaVenta>
    <SubsectorPuntaCompra>R</SubsectorPuntaCompra>
    <MontoOperacion>5007500.00</MontoOperacion>
    <TasaContado>2164.000000</TasaContado>
  </FWPD>
</Operaciones>

```

HCH

RC



Fecha: 30 SET. 2015

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

```
<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>
```

### 1.1. VALIDACIONES GENERALES.

La información reportada tendrá el siguiente proceso de validación:

- Validación 1 de 4 - Nombre del archivo: Se valida que el formato de nombre de archivo sea correcto. Cuando se rechaza un archivo por cualquiera de las validaciones de nombre de archivo, no se continúa realizando las demás validaciones.
- Validación 2 de 4 – Estructura: Se valida que el archivo tenga la estructura XML de acuerdo a la versión de XSD vigente (proporcionada por el BR).
- Validación 3 de 4 – Datos: De acuerdo a las validaciones establecidas para cada uno de los campos reportados, y como resultado de dichas validaciones se procederá a aceptar o rechazar las operaciones. El resultado de dicha validación será informado a cada SN/SR y solo se considerará como información recibida aquellos registros que cumplan con todas las validaciones definidas.
- Validación 4 de 4 - Negocio: En esta etapa se evalúa que la información de las operaciones sea coherente con el mercado y las condiciones de los instrumentos.

### 2. 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.

### 3. TABLA DE CLASIFICACIÓN DE ACTIVIDADES ECONÓMICAS.

**A AGRICULTURA, GANADERIA, CAZA, SILVICULTURA, EXTRACCION DE MADERA, PESCA Y ACTIVIDADES DE SERVICIOS CONEXAS**



Fecha: 30 SET. 2015

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

- B EXPLOTACION DE MINAS Y CANTERAS, EXTRACCION PETROLEO  
CRUDO Y GAS NATURAL**
- C INDUSTRIA MANUFACTURERA**
- D SUMINISTRO DE ELECTRICIDAD, GAS, Y AGUA**
- E CONSTRUCCION**
- F COMERCIO**
- G TURISMO, HOTELES Y RESTAURANTES**
- H TRANSPORTE, MANIPULACION DE CARGA, ALMACENAMIENTO Y  
DEPÓSITO**
- I CORREO Y TELECOMUNICACIONES**
- J INTERMEDIACION FINANCIERA - EXCEPTO FINANCIACION PLANES  
DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS (DIVISIONES J1 A J14)**
  
- J1 BANCA CENTRAL
- J2 BANCOS COMERCIALES Y BANCOS ESPECIALIZADOS EN CARTERA  
HIPOTECARIA
- J3 CORPORACIONES FINANCIERAS (INCLUYE IFI)
- J4 COMPAÑÍAS DE FINANCIAMIENTO COMERCIAL (INCLUYE COMPAÑÍAS  
DE LEASING)
- J5 COOPERATIVAS FINANCIERAS Y FONDOS DE EMPLEADOS
- J6 SOCIEDADES FIDUCIARIAS
- J7 SOCIEDADES DE CAPITALIZACION
- J8 ACTIVIDADES DE COMPRA DE CARTERA (FACTORING)
- J9 BOLSA DE VALORES
- J10 SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSA
- J11 CASAS DE CAMBIO
- J12 ENTIDADES FINANCIERAS OFICIALES ESPECIALES: FEN, ICETEX,  
BANCOLDEX, FINAGRO, FINDETER Y FONADE
- J13 OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS
  
- K ENTIDAD FINANCIERA NO RESIDENTE**
- L FINANCIACION DE PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS  
(DIVISIONES L1 A L5)**
  
- L1 PLANES DE SEGUROS GENERALES, SEGUROS DE VIDA Y REASEGUROS
- L2 PLANES DE PENSIONES VOLUNTARIAS
- L3 PLANES DE CESANTIAS
- L4 PLANES DE PENSIONES DE AFILIACION OBLIGATORIA
- L5 PLANES DE PENSIONES DEL REGIMEN DE PRIMA MEDIA (INCLUYE:  
SEGURO SOCIAL, CAJANAL, CAPRECOM, ENTRE OTROS)

HCH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 317 A1-17  
ANEXO No. 1

Fecha: 30 SET. 2015

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

- 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**

PC

HH