

GUÍA DEL USUARIO PARA INCLUIR LAS COTIZACIONES DEL IBR EN EL SISTEMA DE SUBASTAS

Contenido

INI	TRODUCCION	4
Obje	eto	.4
Alca	nce	.4
Aud	iencia	.4
	GRESO DE LAS COTIZACIONES DEL IBR EN EL MÓDULO DEL IBR EN SISTEMA DE SUBASTAS	
1.	Ingresar al Portal de Acceso SEBRA del BR	.5
2.	Seleccionar en el menú la opción de la aplicación de «Subastas»	.5
3.	En el menú del intermediario seleccionar la opción «4. Operaciones IBR».	.6
4.	Seleccionar la opción «1. Cotizaciones de IBR».	.6
5. «AC	Seleccionar la operación en la que va a participar (IBR) y luego seleccionar el comando TIVAR».	.7
6.	Incluir cotizaciones para los plazos que se despliegan	.7
8. IBR	Validaciones del Sistema de Subastas durante el proceso de ingreso de las cotizaciones del : 9	
a. el pl	El Sistema no incluye ni modifica la cotización si no se ha marcado la columna «Activar» par azo	
b.	El Sistema no permite incluir cotizaciones con valor cero (0)	.9
c.	El Sistema no permite ingresar cotizaciones con más de tres decimales	10
	El Sistema genera una advertencia al incluir cotizaciones superiores a 2 veces la Tasa de crencia del BR o Tasa de Política Monetaria. Sin embargo, permite al usuario continuar syendo esa cotización	10
e. inclu	El Sistema genera una alerta cuando el valor absoluto de la variación entre la cotización nida y la del día hábil anterior supera el parámetro de desviación1	11
f.	El Sistema no permite incluir las cotizaciones fuera de horario1	12
9.	El Sistema permite generar listados de las cotizaciones incluidas	13
a.	Seleccione la opción «Listar».	13
c.	Seleccione el archivo «ULOCT06».	13
	El Sistema permite generar consultas de la información de las operaciones que sustentan la nación del IBR overnight (préstamos interbancarios no colateralizados) y de los IBR a plazos priores al overnight (OIS)	14
a.	Seleccionar la opción «2. Consultas»	14

enti	stamos interbancarios no colateralizados que han sido asignados, el estado de los mismos, las dades con que se realizaron –contrapartes-, el monto y el contravalor -capital más intereses-, BR -tasa nominal base 360	y
d.	Una vez realizada la consulta, se puede generar un listado o un archivo:	1
i. sele	Para generar el listado seleccione la opción «LISTAR», y luego en el menú de la izquierda ccione la opción «LISTADOS»	1
e. plaz	Para consultar la información de las operaciones que sustentan la formación de los IBR a cos superiores al overnight, se debe seleccionar la opción «2. Consultas SWAPS»	1
f.	Una vez realizada la consulta, se puede generar un listado o un archivo:	1
g.	Seleccione la opción «3. Consultas de Incumplimientos».	1
CO	RREOS DE RESULTADOS DE LA OPERACIÓN	2
	BLICACIÓN DE LOS RESULTADOS DEL IBR	2



Página 4 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

Introducción

Objeto

Este documento presenta el procedimiento para realizar: i) el ingreso al Módulo del IBR en el Sistema de Subastas a través del Portal de Acceso SEBRA del BR, ii) la modificación de las cotizaciones del IBR para los plazos autorizados, iii) la consulta del estado de las cotizaciones, y iv) la consulta de las cotizaciones presentadas, en el marco del Esquema de Formación del Indicador Bancario de Referencia (IBR).

Alcance

Este documento contiene los procedimientos para ingresar y modificar las cotizaciones del IBR para los plazos autorizados. Asimismo, se presenta el procedimiento para consultar la información tanto de las operaciones que sustentan la formación del IBR overnight (préstamos interbancarios no colateralizados) como de los IBR a plazos superiores (Overnight Index Swaps, en adelante OIS), como de los incumplimientos registrados.

Audiencia

Este documento está dirigido a los usuarios de las entidades autorizadas a participar en el Esquema de Formación del IBR administrado por el Banco de la República (BR).



Página **5** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

Ingreso de las Cotizaciones del IBR en el Módulo del IBR en el Sistema de Subastas.

1. Ingresar al Portal de Acceso SEBRA del BR.

El link de ingreso es https://wsebra.banrep.gov.co. Se debe digitar la siguiente información:

Usuario: Login asignado

Contraseña: 4 dígitos del pin y 6 dígitos que aparecen en el token asignado.



2. Seleccionar en el menú la opción de la aplicación de «Subastas». Este sistema solo permitirá ingresar a los usuarios autorizados por el BR.





Página 6 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

3. En el menú del intermediario seleccionar la opción «4. Operaciones IBR».



4. Seleccionar la opción «1. Cotizaciones de IBR».





Página 7 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

5. Seleccionar la operación en la que va a participar (IBR) y luego seleccionar el comando «ACTIVAR».



6. Incluir cotizaciones para los plazos que se despliegan.



RECOMENDACIÓN:

1. Marcar las cajas de la columna «Activar» para habilitar los plazos en los que ingresará las cotizaciones.



Página 8 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

- 2. Digitar el valor de la cotización para cada uno de los plazos habilitados.
- 3. Seleccionar el botón «Activar».



7. Revisar las cotizaciones incluidas.

En esta instancia se despliegan los valores de las cotizaciones, el estado (Cotizado o No cotizado) y la gráfica actualizada con los valores de las cotizaciones.





Página **9** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

- 8. Validaciones del Sistema de Subastas durante el proceso de ingreso de las cotizaciones del IBR:
- a. El Sistema no incluye ni modifica la cotización si no se ha marcado la columna «Activar» para el plazo.



EL SISTEMA NO INCLUYE O MODIFICA EL VALOR DE LA COTIZACIÓN.

b. El Sistema no permite incluir cotizaciones con valor cero (0).



EL SISTEMA NO PERMITE INCLUIR COTIZACIONES CON VALOR IGUAL A CERO.



Página **10** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

c. El Sistema no permite ingresar cotizaciones con más de tres decimales.



EL SISTEMA NO PERMITE INCLUIR COTIZACIONES CON MÁS DE TRES DECIMALES (Reglamento del IBR).

d. El Sistema genera una advertencia al incluir cotizaciones superiores a 2 veces la Tasa de Referencia del BR o Tasa de Política Monetaria. Sin embargo, permite al usuario continuar incluyendo esa cotización.





Página 11 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2



EL SISTEMA VALIDA E INFORMA: «TASA COTIZADA ES SUPERIOR A DOS VECES LA TASA DE REFERENCIA DEL BR» PERO DE TODAS MANERAS ACEPTA LA COTIZACIÓN.

e. El Sistema genera una alerta cuando el valor absoluto de la variación entre la cotización incluida y la del día hábil anterior supera el parámetro de desviación.



EL SISTEMA VALIDA QUE EL VALOR ABSOLUTO DE LA VARIACIÓN ENTRE LA COTIZACIÓN INCLUIDA Y LA DEL DÍA ANTERIOR ES SUPERIOR AL PARÁMETRO DE DESVIACIÓN, SUGIERE QUE SE REVISE EL EJERCICIO DE GENERACIÓN DE LA COTIZACIÓN Y PREGUNTA SI SE DESEA CONTINUAR INCLUYENDO ESA COTIZACIÓN.



Página **12** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

f. El Sistema no permite incluir las cotizaciones fuera de horario.



EL SISTEMA NO ACEPTA COTIZACIONES FUERA DEL HORARIO LÍMITE

g. El Sistema no permite ingresar valores diferentes a números en los campos de tasas nominales. Si el agente incluye valores no válidos, se genera el mensaje de error «Carácter no Válido en los campos numéricos».



EL SISTEMA NO ACEPTA VALORES NO NUMÉRICOS EN LOS CAMPOS DE TASA NOMINAL



Página 13 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

9. El Sistema permite generar listados de las cotizaciones incluidas.

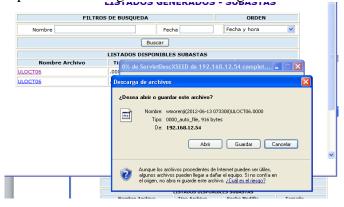


- a. Seleccione la opción «Listar».
- b. Active la opción de «Listados».



c. Seleccione el archivo «ULOCT06».

En esta instancia se permite abrir o guardar el archivo generado.





Página **14** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2



- 10. El Sistema permite generar consultas de la información de las operaciones que sustentan la formación del IBR overnight (préstamos interbancarios no colateralizados) y de los IBR a plazos superiores al overnight (OIS).
- a. Seleccionar la opción «2. Consultas».



b. Se despliega el menú que presenta los dos tipos de consultas de las operaciones que sustentan la formación del IBR (préstamos interbancarios y OIS). Adicionalmente, se presenta una consulta de los incumplimientos contemplados en el Reglamento del IBR. Seleccione la opción «1. Consultas overnight».





Página **15** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

c. Se deben diligenciar los campos «fecha desde», «fecha hasta e «Intermediario» (en este campo se incluye el Nit), y luego seleccionar la opción «MIRAR» para desplegar la información de los préstamos interbancarios no colateralizados que han sido asignados, el estado de los mismos, las entidades con que se realizaron –contrapartes, el monto y el contravalor -capital más intereses-, y el IBR -tasa nominal base 360-.



Estados:

Pendiente: Operación del día sin cumplir. Incumplido: Operación que no se realizó.

Pagado: Operación realizada satisfactoriamente.

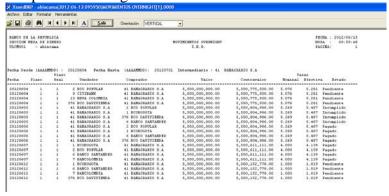
- d. Una vez realizada la consulta, se puede generar un listado o un archivo:
 - i. Para generar el listado seleccione la opción «LISTAR», y luego en el menú de la izquierda seleccione la opción «LISTADOS».





Página **16** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

ii. El listado se genera con el nombre «MOVIMIENTOS OVERNIGHT». Este archivo se puede abrir o guardar.



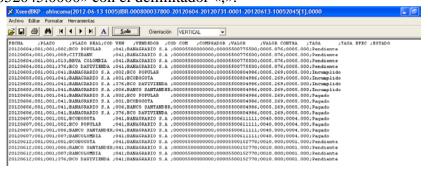
iii. Para generar el archivo seleccione la opción «GENERAR», luego en el menú de la izquierda seleccione la opción «Listados».



LISTADOS GENERADOS - SUBASTAS



iv. El archivo se genera con el nombre del usuario, por ejemplo: «ahincama (2012-06-131005)IBR-000800037800-20120604-20120731-0001-20120613-10052045.0000» con el delimitador «;».





Página 17 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

e. Para consultar la información de las operaciones que sustentan la formación de los IBR a plazos superiores al overnight, se debe seleccionar la opción «2. Consultas SWAPS».

Luego se deben diligenciar los siguientes campos: «fecha desde», «fecha hasta» y «NIT», y escoger la opción «MIRAR». La consulta mostrará la información de los swaps que han sido asignados, el estado de los mismos, las entidades con que se realizaron —contrapartes-, el IBR -la tasa nominal base 360- y la tasa compuesta de los swaps vencidos - composición del IBR overnight durante la vigencia del swap-.



- f. Una vez realizada la consulta, se puede generar un listado o un archivo:
 - i. Para generar el listado seleccione la opción «LISTAR». Luego en el menú de la izquierda seleccione la opción «Listados».





Página **18** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

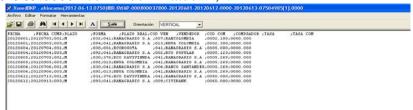
ii. Se genera el listado con el nombre «MOVIMIENTOS SWAPS». Este archivo se puede abrir o guardar.



iii. Para generar el archivo seleccione la opción «GENERAR», luego en el menú de la izquierda seleccione la opción «Listados».



iv. El archivo se genera, por ejemplo, con el nombre «ahincama(2012-06-13 0750)IBR-SWAP-000800037800-20120601-20120612-0000-20120613-07504985.0000» con el delimitador «;».





Página **19** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

g. Seleccione la opción «3. Consultas de Incumplimientos».

Para desplegar la información de los incumplimientos acumulados durante el periodo seleccionado, se debe digitar el período (campo «Periodo Desde» y el NIT (campo «Intermediario», y luego se debe escoger la opción «MIRAR».



h. Una vez realizada la consulta se puede generar un listado de incumplimientos. Para generar dicho listado seleccione la opción «LISTAR«, luego en el menú de la izquierda seleccione la opción «Listados» y escoja el archivo «INCUMPLIMIENTOS».







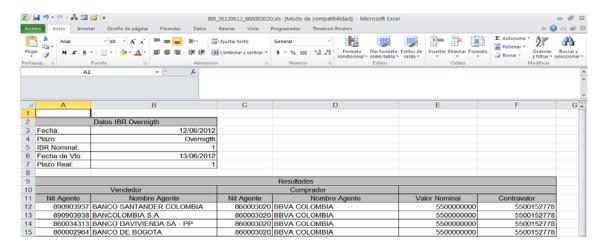
Página **20** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

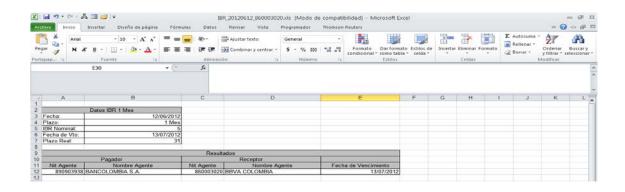
Correos de resultados de la operación.

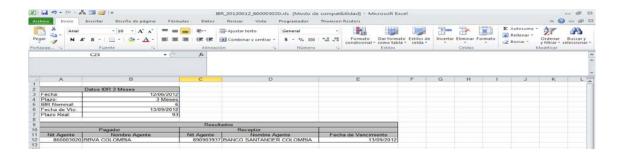
1. Archivo de Excel:

Los resultados de la operación se envían diariamente a los agentes participantes en un Archivo Excel adjunto en un correo electrónico.

Ejemplo del nombre del archivo: IBR_20120612_860003020.xls





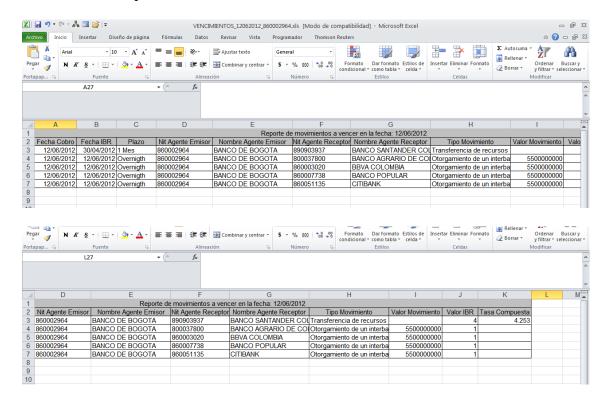




Página **21** de **22** Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

2. Archivo de Movimientos:

Este archivo se envía diariamente e incluye la información de las operaciones cuyo vencimiento está pendiente.



3. Correos de incumplimientos

Este archivo se envía cuando ocurre un incumplimiento por: no cotizar, no realizar el cumplimiento de los préstamos interbancarios no colateralizados que sustentan la formación del IBR overnight o no pagar la tarifa administrativa.





Página 22 de 22 Fecha de aprobación: 18-07-2019 Versión: 2

Publicación de los Resultados del IBR

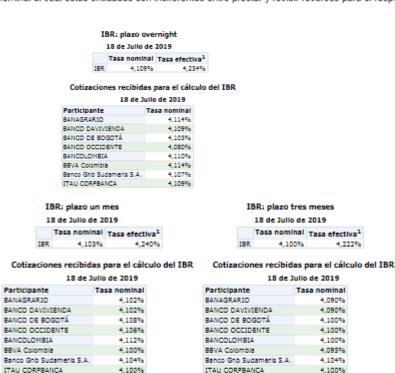
1. Los resultados se publican diariamente en la página del Banco de la República en la ruta: http://www.banrep.gov.co/estadisticas/indicador-bancario-referencia-ibr.

Indicador Bancario de Referencia (IBR)

En enero de 2008 comenzó a funcionar el esquema de formación del IBR. Este indicador fue desarrollado por el sector privado, con el respaldo del Banco de la República y otras entidades, con el objetivo de reflejar la liquidez del mercado monetario colombiano. El IBR es una tasa de interés de referencia de corto plazo denominada en pesos colombianos, que refleja el precio al que los bancos están dispuestos a ofrecer o a captar recursos en el mercado monetario.



El IBR se calcula a partir de las cotizaciones de los participantes del esquema. Las tasas cotizadas corresponden al interés nominal al cual estas entidades son indiferentes entre prestar y recibir recursos para el respectivo plazo.



IBR: plazo seis meses

Cotizaciones recibidas para el cálculo del IBR

18 de Julio de 2019				
Participante	Tasa nominal			
BANAGRARIO	4,090%			
BANCO DAVIVIENDA	4,090%			
BANCO DE BOGOTÁ	4,100%			
BANCO OCCIDENTE	4,100%			
BANCOLOMBIA	4,100%			
BBVA Colombia	4,095%			
Banco Gnb Sudameris S.A.	4,098%			
ITAU CORPBANCA	4,100%			

Fuente: Banco de la República.

¹ Las tasas se calculan de acuerdo con lo establecido en el reglamento del IBR.