



Banco de la República Colombia

BOLETÍN

No.
Fecha
Páginas

017
03 de Mayo de 2013

CONTENIDO

Circular Reglamentaria Externa DODM - 317 del 03 de mayo de 2013 Asunto 19:
Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas

Página

1



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

Hoja 19-00

Fecha: - 3 MAYO 2013

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; BANCOLODEX; Sistemas de Negociación y Sistemas de Registro de Operaciones sobre Divisas;

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

Mediante la presente se publica el Anexo No. 1 a la Circular Reglamentaria Externa DODM-317 de abril 30 de 2013, correspondiente al Asunto 19: “**SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**”.

Cordialmente,


HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico


PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Reservas



- 3 MAYO 2013

Fecha:

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

INSTRUCTIVO PARA DILIGENCIAR LOS FORMATOS DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de divisas deberán reportar las operaciones de derivados negociadas o registradas a través de su conducto, sus modificaciones y los errores de digitación a través del archivo en formato Excel¹, "*Formato de reporte de operaciones con derivados*"² el cual contiene una única hoja para reportar los diferentes tipos de instrumentos y operaciones.

Al diligenciar esta hoja, no altere el formato de las columnas, no borre ni inserte filas o columnas, ni cambie el nombre de las hojas, puesto que serán leídas por una aplicación automatizada, cualquier modificación afectará el procesamiento de la información.

Las columnas contienen instrucciones para diligenciar los datos, de tal forma que sea fácil y rápido completarlas. Adicionalmente, están formateadas y validan los datos de entrada, por lo que los formatos de las celdas no deben ser modificados en ningún caso.

Lea cuidadosamente estas instrucciones antes de diligenciar su archivo. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico DODM-divisas@banrep.gov.co.

1 DESCRIPCIÓN SOBRE LOS CAMPOS PARA EL REGISTRO DE LAS OPERACIONES

A continuación se presenta la relación de la información que debe ser reportada de acuerdo con el tipo de instrumento.

¹ El archivo debe ser diligenciado en Excel 2007 o versiones posteriores

² Ingrese a http://www.reglamentacion/rg_cambia_nego.htm

HUH

PC



Fecha:

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

Variable	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
	fwpd	oppd	swpd	swipd	fwom	opom	swom	swiom	fwti	opti
Tipo_Instrumento	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tipo_Novedad	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tipo_ID_Punta_Venta	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ID_Punta_Venta	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Nombre_Punta_Venta	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Numero_Registro	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Fecha_Oper	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Num_Reg_Anterior	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Fecha_Op_Anterior	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Fecha_Ven	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tipo_ID_Punta_Compra	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ID_Punta_Compra	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Nombre_Punta_Compra	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
SubSector_Punta_Venta	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
SubSector_Punta_Compra	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Moneda1					✓	✓	✓	✓	✓	✓
Moneda2					✓	✓	✓	✓		
Monto_Operacion	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tasa_Contado	✓		✓		✓		✓			
Tasa_Pactada1	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tasa_Pactada2			✓	✓			✓	✓		
Periodicidad_Flujo_M1				✓				✓		
Periodicidad_Flujo_M2				✓				✓		
Monto_DF	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Monto_NDF	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Tasa_Referencia	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
Opcionalidad	✓				✓				✓	
Tipo_Opcionalidad	✓				✓				✓	
Aceptado_Camara	✓									
Fecha_CRCC	✓									
Tipo_Opcion		✓				✓				✓
Tipo_Ejercicio_Opcion		✓				✓				✓
Prima		✓				✓				✓
Condicion		✓				✓				✓
Plazo_Tasa									✓	✓
Registro_Previo	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

AVH

PC



3 MAYO 2013

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**Descripción de los campos**

Tipo_Instrumento: El tipo de instrumento corresponde a la numeración asignada a la siguiente lista:

Tipo de Instrumento	Instrumento
1	Forward peso dólar (fwpd)
2	Opciones peso dólar (oppd)
3	Swap peso dólar (swpd)
4	Swap interés peso dólar (swipd)
5	Forward otras monedas (fwom)
6	Opciones otras monedas (opom)
7	Swap otras monedas (swom)
8	Swap interés otras monedas (swiom)
9	Forward tasa de interés (fvti)
10	Opciones tasa de interés (opti)

Tipo_Novedad: Corresponde al tipo de novedad que se está reportando con el registro. Este campo puede tener los siguientes valores: **Inicial (I):** Cuando la operación se reporta por primera vez; **Modificación (M):** Cuando durante la vigencia del contrato se modifica alguna de las condiciones; **Aclaración (A):** Cuando se reporta una corrección a la información reportada y aceptada inicialmente; **Fraccionamiento (F):** Cuando el reporte corresponde a la división de una operación ya reportada.

Tipo_ID_Punta_Venta: Tipo de documento de identificación de la parte vendedora en el contrato. Este campo puede tener los siguientes valores: 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. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

ID_Punta_Venta: Número del documento de identificación de la parte que tiene la posición vendedora en el contrato. Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

Nombre_Punta_Venta: Nombre de la parte vendedora en el contrato. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte vendedora con respecto a la moneda1.

Numero_Registro: Número de registro de la operación.

H2H

PC



Fecha: - 3 MAYO 2013

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

Fecha_Oper: Corresponde a la fecha de negociación del instrumento cuando la operación corresponde a una novedad de tipo I (Inicial) y en el caso de una novedad tipo M, A o F debe corresponder a la fecha en que se realiza la Modificación, la Aclaración o el Fraccionamiento.

Num_Reg_Anterior: Número de Registro con que se reportó la operación sujeta a modificación (en caso que el tipo de operación sea distinta a inicial).

Fecha_Op_Anterior: Corresponde a la fecha en la cual fue reportada la operación sujeta a modificación (en caso que el tipo de operación sea distinta a inicial).

Fecha_Ven: Fecha de vencimiento del instrumento.

Tipo_ID_Punta_Compra: Tipo de documento de identificación de la parte compradora en el contrato. Este campo puede tener los siguientes valores: 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. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

ID_Punta_Compra: Número del documento de identificación de la parte que tiene la posición compradora en el contrato. Cuando la identificación de la contraparte corresponde a un N.I.T., esta debe incluir el dígito de verificación sin separador. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

Nombre_Punta_Compra: Nombre de la parte compradora en el contrato. En el caso de los instrumentos entre los números 5 y 8, se debe considerar la parte compradora con respecto a la monedal.

SubSector_Punta_Venta: Código Subsector de la actividad económica de la parte vendedora en el contrato, de acuerdo con la tabla de clasificación de actividades económicas que se encuentra en la siguiente sección.

SubSector_Punta_Compra: Código Subsector de la actividad económica de la parte compradora en el contrato, de acuerdo con la tabla de clasificación de actividades económicas que se encuentra en la siguiente sección.

Moneda1: Se refiere a la moneda base de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar, opciones peso-dólar y swap peso dólar e interés, donde la moneda 1 por defecto es el dólar. Por otra parte, para los instrumentos que solo incluyen una moneda (forward tasa de interés y opciones tasa de

MVA

RC



Fecha:

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

interés), este campo se refiere a la moneda en la cual se realiza la operación. Finalmente, se debe resaltar que el dólar (USD) solo puede ser moneda 1.

Moneda2: Se refiere a la segunda moneda de la operación. Este campo no se debe llenar para los instrumentos: forward peso-dólar, swap peso-dólar, opciones peso-dólar, swap peso dólar e interés, donde por defecto la moneda 2 es el peso colombiano. Tampoco se debe llenar para los forward de tasa de interés y las opciones de tasa de interés.

Monto_Operación: Valor nominal de la operación (en términos de la moneda 1). Esta casilla debe ser igual a la suma de las casillas Monto_DF y Monto_NDF.

Tasa_Contado: Tasa de contado vigente en el momento en que se negoció la operación de derivados. Debe ser expresada en unidades de la moneda 2 por moneda1. Esta tasa debe ser reportada para los forward peso dólar, swap peso-dólar, forward otras monedas y swap otras monedas.

Tasa_Pactada1:

- En los instrumentos que involucran tasas de cambio no ligados a una tasa de interés (forward peso-dólar, swap peso-dólar, opciones peso-dólar, forwards otra monedas, swaps otras monedas y opciones otras monedas), en este campo se debe llenar la tasa pactada en unidades de la moneda 2 que serán intercambiadas por la moneda 1. Por ejemplo: si moneda1 es dólar y moneda 2 es euro y el instrumento es uno de los mencionados anteriormente, la tasa a llenar sería cuantos euros deben ser entregados por cada dólar (por ejemplo 0.7 EUR por USD).

- En los instrumentos swaps peso-dólar e interés y swaps otras monedas e interés, se debe llenar la tasa de interés correspondiente a la moneda 1. En el caso de los forwards de tasa de interés, se debe llenar la tasa de interés pactada.

Tasa_Pactada2: En los instrumentos swap peso-dólar y swap otras monedas, se refieren a la tasa pactada para la punta spot de la operación. 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 denominados en la moneda2.

Periodicidad_Flujo_M1: Para los instrumentos swaps peso-dólar e interés y swaps otras monedas e interés, se refiere a la periodicidad de los flujos en la moneda1.

Periodicidad_Flujo_M2: 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.

Monto_DF: Corresponde al valor nominal de la operación que se liquidará en la modalidad de cumplimiento efectivo (DF).

AH

PC



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

Monto_NDF: Corresponde al valor nominal de la operación que se liquidará en la modalidad de cumplimiento financiero (NDF).

Tasa_Referencia: 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).

Opcionalidad: Especifica si el contrato forward tiene una opción implícita (SI/NO).

Tipo_Opcionalidad: Especifica el tipo de opcionalidad si el campo anterior es afirmativo.

Aceptado_Camara: Indica si la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada (SI/NO).

Fecha_CRCC: Fecha en que la operación fue aceptada para compensación y liquidación por una CRCC autorizada.

Tipo_Opción: Este campo debe indicar si la opción es call o put (C/P).

Tipo_Ejercicio_Opción: Este campo debe indicar si la opción es americana o europea (A/E).

Prima: La prima para entrar en el contrato (la opción).

Condición: Describe la condición de ejercicio de la opción. En el caso de opciones con strike, este campo se refiere al strike de la opción.

Plazo_Tasa: Para los instrumentos sobre tasa de interés (forward tasa de interés y opciones tasa de interés) se debe reportar el plazo que esta aplicará.

Registro_Previo: Este campo debe indicar si esta operación fue negociada o registrada previamente en otro sistema (S/N).

2 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

MH

PC



Fecha:

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

- 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, BANCOLEX, 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)
- 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**

H.V.H

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – A 1-8

317

ANEXO No. 1

Fecha:

- 3 MAYO 2013

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

P SERVICIOS SOCIALES Y DE SALUD
Q ORGANIZACIONES Y ORGANOS EXTRATERRITORIALES
R PERSONA NATURAL

AWH

PC