



# **DEPÓSITO CENTRAL DE VALORES DCV**

**PROCEDIMIENTO PARA EL MANEJO DE  
GARANTÍAS SOBRE OPERACIONES A PLAZO**

**DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES**

.....

# AGENDA

1. INTRODUCCIÓN
2. ALCANCE
3. FUNCIONAMIENTO DE LAS GARANTÍAS
4. DESCRIPCIÓN DEL PROCESO
5. CONFIGURACIÓN DEL SISTEMA
6. CICLO DE LA OPERACIÓN
7. MANEJO OPERATIVO
8. CÓDIGOS DE OPERACIONES



# INTRODUCCIÓN

EL DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES, COMO ADMINISTRADOR DEL DCV Y DEL SEN, Y PARA DAR CUMPLIMIENTO A LO SEÑALADO EN EL DECRETO 2555 DE 2010, DESARROLLÓ UN MECANISMO PARA LA PREVENCIÓN DEL RIESGO DERIVADO DE LAS VARIACIONES EN LOS PRECIOS DE MERCADO AL QUE ESTÁN EXPUESTAS LAS OPERACIONES A PLAZO.



# ALCANCE

LA FUNCIONALIDAD ESTÁ DISEÑADA, EN PRINCIPIO, PARA QUE EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS REQUERIDAS Y LOS LLAMADOS A MARGEN SE GENEREN EN:

1. LAS OPERACIONES REPO QUE REALICE EL BANCO DE LA REPÚBLICA COMO AUTORIDAD MONETARIA
2. LAS OPERACIONES SIMULTÁNEAS Y COMPRAVENTAS A PLAZO QUE SE CIERREN EN EL SEN.
3. LAS TRANSFERENCIAS TEMPORALES DE VALORES QUE SE ORIGINEN EN LA FUNCIONALIDAD DE PRÉSTAMO DE VALORES DEL DCV.



# PROCEDIMIENTO PARA EL CALCULO

1. SE CALCULA LA GARANTÍA REQUERIDA TENIENDO EN CUENTA LOS PRECIOS DE MERCADO Y SE COMPARA CONTRA EL SALDO DE LAS GARANTÍAS CONSTITUIDAS.
2. SI LA GARANTÍA REQUERIDA ES MAYOR A LAS CONSTITUIDAS, VERIFICA LA DISPONIBILIDAD EN DINERO Y DE TÍTULOS.
3. SI LA GARANTÍA REQUERIDA ES MENOR A LAS CONSTITUIDAS, EFECTÚA UNA LIBERACIÓN DE GARANTÍAS POR LA DIFERENCIA.



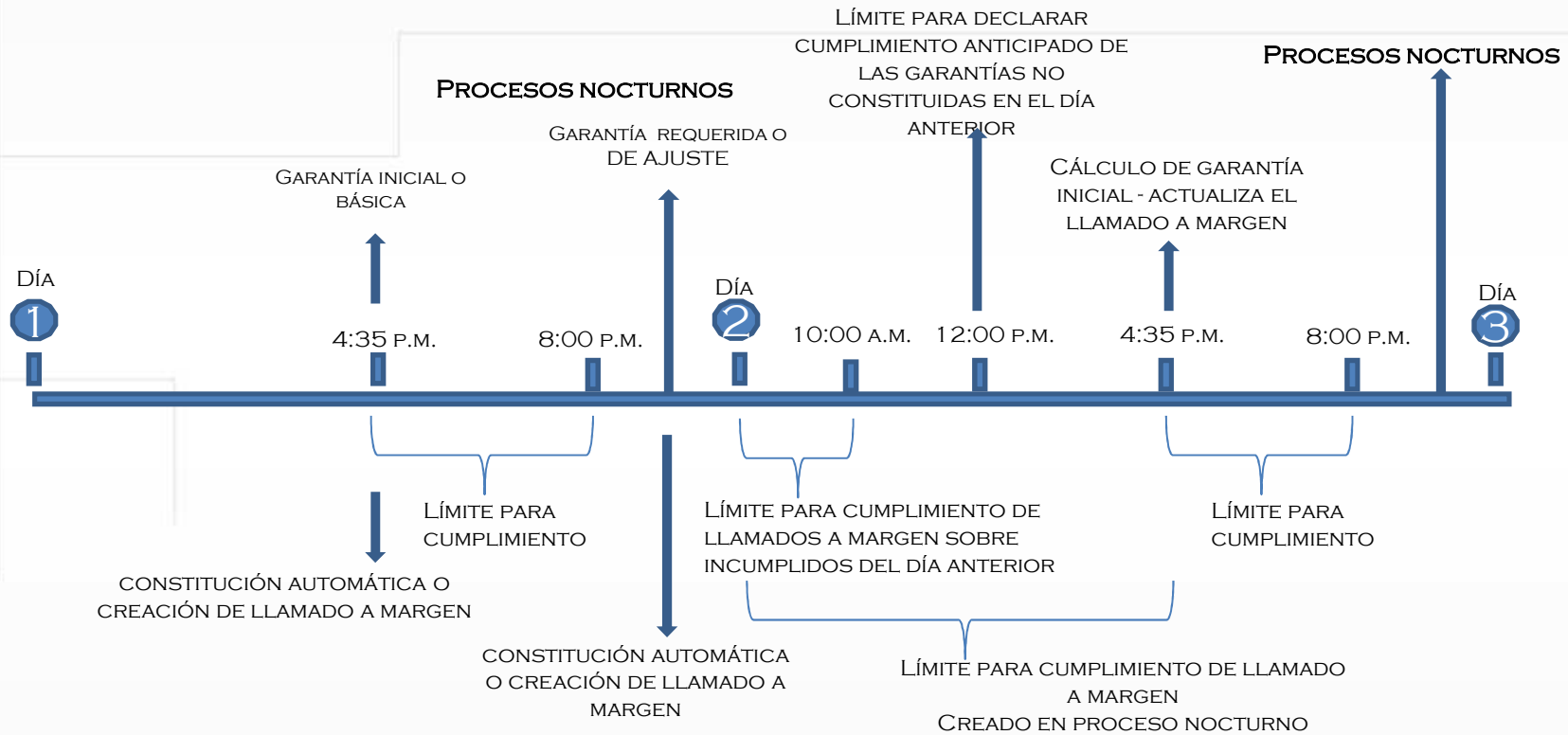
# PROCEDIMIENTO PARA EL CALCULO

A LAS 4:35 P.M. SE REALIZA EL CÁLCULO DE LA GARANTÍA BÁSICA ÚNICAMENTE DE LAS OPERACIONES CERRADAS EN ESE DÍA APLICA A LAS SIMULTANEAS, DEBE SER CUBIERTAS EN EL HORARIO DE 4:30 A 8:00 P.M. DEL MISMO DÍA DE LA OPERACIÓN, DE NO HACERSE TIENE PLAZO HASTA EL DÍA SIGUIENTE ANTES DE LAS 10:00 A.M.

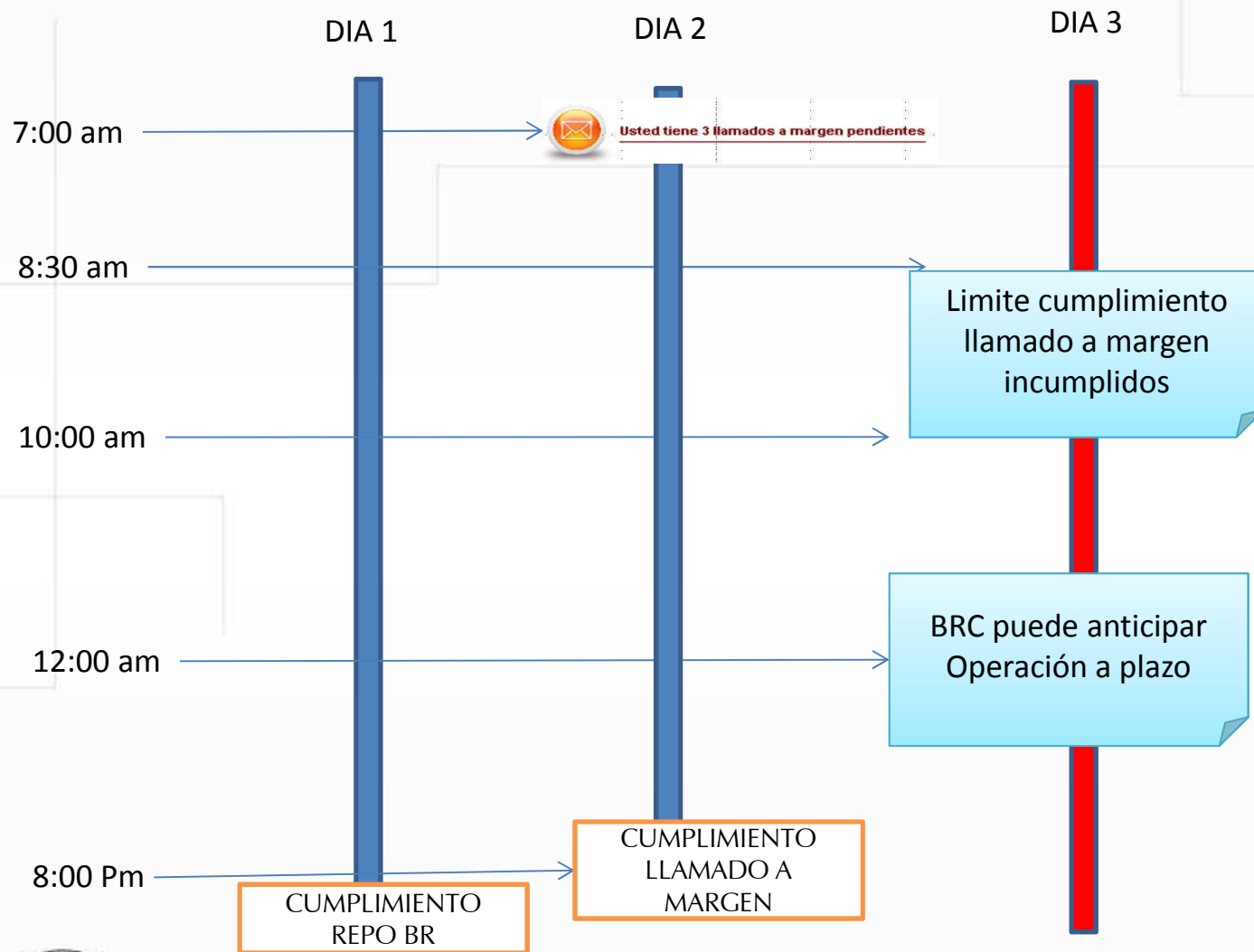
UNA VEZ CERRADO LOS SERVICIOS DEL DCV, SE EJECUTAN LOS PROCESOS NOCTURNOS DONDE SE REALIZA EL CÁLCULO DE LA GARANTÍA CONSTITUIDAS, VERIFICANDO EL SALDO DISPONIBLE, REALIZA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS AUTOMÁTICAS O GENERA UNA OPERACIÓN (LLAMADO A MARGEN) PARA QUE SE ACTIVADA AL DÍA SIGUIENTE ENTRE LAS 8:00 A.M. Y 8:00 P.M. ESTO APLICA PARA LAS OPERACIONES REPO.



# SECUENCIA DEL PROCESO PARA LAS OPERACIONES SIMULTANEAS



# SECUENCIA DEL PROCESO PARA LAS OPERACIONES REPO





# CONFIGURACIÓN PREVIA DEL SISTEMA

LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS EN EL DCV SERÁ AUTOMÁTICA, PARA EL EFECTO, LOS AGENTES DEBERÁN DEFINIR EN EL DCV UN PORTAFOLIO Y UNA CUENTA DE DINERO PARA EL CUMPLIMIENTO DE LAS OPERACIONES.

LA RUTA PARA DEFINIR ESTOS PARÁMETROS ES:

1. DEPOSITO CENTRAL DE VALORES -DCV
3. OPERACIONES SISTEMA ELECTRÓNICO DE NEGOCIACIÓN
9. GARANTÍAS PARA OPERACIONES A PLAZO
1. CONFIGURACIÓN DE INTERMEDIARIOS



# PARÁMETROS – INCLUSIÓN - 1

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación

**Sistema de negociación:** Seleccione

- Seleccione
- SELECCIONAR SISTEMA DE NEGOCIACIÓN
- DEPOSITO CENTRAL DE VALORES

Imedinro02041  
2015/01/26  
15:47:41

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

Terminar

SELECCIONAR SISTEMA DE NEGOCIACIÓN



# PARÁMETROS – INCLUSIÓN – 2

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

[Información de consulta](#)  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación

**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

[Información de configuración](#)

**Estado:** Sin incluir

**Cuenta de depósito:**

**Portafolio de garantías:** Seleccione

**Permitir constitución automática:**

**Porcentaje de cumplimiento en dinero:**

**TRAER REGISTROS EN BLANCO**

Terminar Incluir



# PARÁMETROS – INCLUSIÓN - 3

**DCV** Depósito Central de Valores

INC **Configuración de intermediarios para garantías - DCV**

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Sin incluir  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 0  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 0

**Mensaje de página web**  
Registro incluido correctamente  
Aceptar

**DIGITAR PARÁMETROS Y CLICK EN INCLUIR**

Procesando petición...

Terminar Incluir

Imedinro02041  
2015/01/26  
15:40:18

Principal  
Listados  
Logs Reportes  
Terminar Sesión  
Contáctenos

BANCO DE LA REPUBLICA  
COLOMBIA

# PARÁMETROS – ACTIVACIÓN - 1

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Pendiente por activar  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 0  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 0

[Terminar](#) [Modificar](#) [Activar](#)

**SELECCIONAR SISTEMA DE NEGOCIACIÓN Y TRAER LOS REGISTROS PARA ACTIVAR**



# PARÁMETROS – ACTIVACIÓN - 2

**DCV** Depósito Central de Valores

ACT Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Pendiente por activar  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 0  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 0

**Mensaje de página web**  
Registro activado correctamente  
Aceptar

Principal  
Listados  
Logs Reportes  
Terminar Sesión  
Contáctenos

VERIFICAR PARÁMETROS Y  
CLICK EN ACTIVAR

Procesando petición...

Terminar Modificar Activar



# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 1

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

[Información de consulta](#)  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación

**Sistema de negociación:** Seleccione

- Seleccione
- SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION**
- DEPOSITO CENTRAL DE VALORES

epeneesc01039  
2015/01/26  
14:15:17

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

[Terminar](#)

AL INGRESAR A LA PANTALLA EL USUARIO CON PERFIL DE ACTIVACIÓN, SELECCIONA EL SISTEMA DE NEGOCIACIÓN



# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 2

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Activo  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 4  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 0

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

epenaesc01039  
2015/01/23  
10:30:15

**Terminar** **Modificar**

SELECCIONAR SISTEMA DE NEGOCIACIÓN Y TRAER LOS REGISTROS ACTIVOS EN EL SISTEMA





# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 3

**DCV** Depósito Central de Valores

MOD **Configuración de intermediarios para garantías - DCV**

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Activo  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 4  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 10

Mensaje de página web  
Registro modificado correctamente  
Aceptar

Procesando petición...

Terminar **Modificar**

MODIFICAR PARÁMETROS  
Y CLICK EN MODIFICAR



# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 4

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Pendiente por activar  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 4  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 10

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

epenaesc01039  
2015/01/23  
10:30:15

Terminar Modificar Activar Consultar Registro Activo

PUEDE VERIFICAR EL REGISTRO ACTIVO O ACTIVAR LA MODIFICACIÓN



# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 5

**DCV** Depósito Central de Valores

Configuración de intermediarios para garantías - DCV

**Información de consulta**  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

**Información de configuración**  
**Estado:** Activo  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 4  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 0

**VERIFICAR EL REGISTRO MODIFICADO POR ACTIVAR**

Terminar Modificar Consultar Registro Pendiente Activar

mcruzpin01039  
2015/01/23  
10:34:27

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

BANCO DE LA REPUBLICA  
COLOMBIA

# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 6



## Depósito Central de Valores

**Configuración de intermediarios para garantías - DCV**

[Información de consulta](#)

Para iniciar seleccione un sistema de negociación

**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

mcruzpin01039  
2015/01/23  
10:34:27

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

[Información de configuración](#)

**Estado:** Pendiente por activar

**Cuenta de depósito:** 62015102

**Portafolio de garantías:** 4

**Permitir constitución automática:**

**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 10

[Terminar](#) [Modificar](#) [Activar](#) [Consultar Registro Activo](#)

TRAER LOS NUEVOS  
REGISTROS PARA ACTIVAR  
LA MODIFICACIÓN



# PARÁMETROS – MODIFICACIÓN - 7

**DCV** Depósito Central de Valores

ACT **Configuración de intermediarios para garantías - DCV**

Información de consulta  
Para iniciar seleccione un sistema de negociación  
**Sistema de negociación:** SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

Información de configuración  
**Estado:** Pendiente por activa  
**Cuenta de depósito:** 62015102  
**Portafolio de garantías:** 4  
**Permitir constitución automática:**   
**Porcentaje de cumplimiento en dinero:** 10

**Mensaje de página web**  
Registro activado correctamente  
Aceptar

**ACTIVAR LA MODIFICACIÓN**

Procesando petición...

Terminar Modificar **Activar** Consultar Registro Activo



# MANEJO OPERATIVO - 1



Depósito Central de Valores



DCV  
MME21

## MENU PRINCIPAL D C V

1. [Menu Deposito Central de Valores DCV](#)
2. [Menu Operaciones de Mercado Abierto](#)

- R. [Regresar Menu Anterior](#)  
T. [Terminar Sesión](#)

\* Digite numero de opcion, Regresar, Terminar \*



**Usted tiene 3 llamados a margen pendientes**

LINK PARA ACCEDER A LA INFORMACIÓN DE LAS OPERACIONES PARA LAS QUE NO FUE POSIBLE CONSTITUIR DE FORMA AUTOMÁTICA LAS GARANTÍAS REQUERIDAS.

etalernn01002

2013/08/16

10:49:14

[Principal](#)

[Listados](#)

[Logs Reportes](#)



[Terminar Sesión](#)

[Contactenos](#)



# MANEJO OPERATIVO - 2

EME12 - PANTALLAZO GENERAL MENUS - Windows Internet Explorer



## Depósito Central de Valores

Requiere acción

ID	Sistema Externo	Mensaje	Requiere Acción
1	SEN	Constituido automáticamente por valor de \$ 2.000.000,00	No
2	SEN	Existe un llamado a margen por valor de \$ 4.000.000,00	Si
3	BVC	Constituido automáticamente por valor de \$ 10.000.000,00	No
4	BVC	Existe un llamado a margen por valor de \$ 20.000.000,00	Si
5	SUBA	Constituido automáticamente por valor de \$ 120.000.000,00	No
6	SUBA	Existe un llamado a margen por valor de \$ 30.000.000,00	Si
7	CARI	Se realizó una liberación de garantías por valor de \$ 15.000.000,00	No

Principal  
Listados  
Loqs Reportes  
Terminar Sesion  
Contactenos

jrjcgarc  
2013/07/16  
14:55:51

Detalle de las garantías constituidas (si) y los llamados a margen (no) que debe cumplir el agente.

Listo Intranet local | Modo protegido: desactivado 100%



# MANEJO OPERATIVO - CONSULTA

PARA ACCEDER A LA CONSULTA DE LOS LLAMADOS A MARGEN SE DEBE INGRESAR POR LA SIGUIENTE RUTA:

1. DEPOSITO CENTRAL DE VALORES - DCV
3. OPERACIONES SISTEMA ELECTRÓNICO DE NEGOCIACIÓN
9. GARANTÍAS PARA OPERACIONES A PLAZO
6. CONSULTA LLAMADOS A MARGEN.

ccarrica01007  
2015/01/22  
10:21:39

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

**Depósito Central de Valores**

CONSULTAS LLAMADO A MARGEN - GARANTIAS

Fecha de Consulta: 20150122    Código Intermediario: 7    BANCOLOMBIA S.A.  
Sistema Externo: TODOS    Cod. Operación: TODOS  
Estado: Generado  
Valor de Garantías Otorgadas: 0.00    Valor de Garantías Requeridas: 531,563,786.09  
Valor de Llamado Margen: 531,563,786.09

OPERACIONES DESCUBIERTAS POR LLAMADOS A MARGEN						
Código	No. Operación	Descripción	Fecha Operación	Sistema Externo	Garantías Requeridas	Valor Operación
422	43001	COMPRAVENTA	20150130	SEN	\$31,563,786.09	531,563,786.09

Mirar    Listar    Terminar

DEFINIR CRITERIOS DE CONSULTA





# MANEJO OPERATIVO - 3

LAS GARANTÍAS REQUERIDAS DEBEN SER CUBIERTAS ANTES DEL CIERRE DE OPERACIONES EN EL DCV.

EN CASO DE QUE EL CUBRIMIENTO NO SE PUEDA HACER AUTOMÁTICAMENTE, SE PUEDE REALIZAR MANUALMENTE POR LA SIGUIENTE RUTA:

1. DEPOSITO CENTRAL DE VALORES - DCV
3. OPERACIONES SISTEMA ELECTRÓNICO DE NEGOCIACIÓN
9. GARANTÍAS PARA OPERACIONES A PLAZO
4. CONSTITUCIÓN MANUAL DE GARANTÍAS



# MANEJO OPERATIVO

**Constitución Manual de Garantías - DCV**

OPERACION

Fecha Operación  Número Operación  Estado Operación

Sistema Externo:

Número de Portafolio :  Garantía Marginal Requerida:

Monto efectivo a utilizar como garantía :  de la cuenta CUD :

Emisión	Vr.Nominal Disponible	Vr.Nominal a Utilizar	Monto Valorado
53782	45.000.000		<input type="text" value="Todo"/>
54876	10.000.000		<input type="text" value="Todo"/>
51929	5.000.000.000		<input type="text" value="Todo"/>
53531	5.000.000.000		<input type="text" value="Todo"/>
55081	79.000.000.000		<input type="text" value="Todo"/>

Garantía Marginal Pendiente :

SELECCIONAR EL PORTAFOLIO ORIGEN DE LOS TÍTULOS A ENTREGAR EN GARANTÍA

SELECCIONAR EL SISTEMA DE NEGOCIACIÓN

INGRESAR EL VALOR DE DINERO A TRANSFERIR EN GARANTÍAS

SELECCIONAR TODO EL SALDO O INGRESE EL VALOR NOMINAL A TRANSFERIR EN GARANTÍA.



# MANEJO OPERATIVO

**OPERACION** 771

Fecha Operación: 20140424    Número Operación: 0    Estado Operación:

Sistema Externo: SEN - SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

Número de Portafolio: 10    Garantía Marginal Requerida: 50.000.000

Monto efectivo a utilizar como garantía: 0    de la cuenta CUD: 65880023

Emisión	Vr.Nominal Disponible	Vr.Nominal a Utilizar	Monto Valorado	
53782	45.000.000	10.000.000	12.000.000.00	Todo
54876	10.000.000	5.000.000	8.000.000.00	Todo
51929	5.000.000.000	30.000.000	30.000.000.00	Todo
53531	5.000.000.000			Todo
55081	79.000.000.000			Todo

Garantía Marginal Pendiente: 50.000.000

Mirar    Incluir    Activar    Modificar    Suprimir    Terminar

DAR CRICK EN INCLUIR PARA DESPUÉS SER ACTIVADA CON EL FUNCIONARIO CORRESPONDIENTE



# MANEJO OPERATIVO

**OPERACION** 771

Fecha Operación: 20140424    Número Operación: 0    Estado Operación:

Sistema Externo: SEN - SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

Número de Portafolio: 10    Garantía Marginal Requerida: 50.000.000

Monto efectivo a utilizar como garantía: 0    de la cuenta CUD: 65880023

Emisión	Vr.Nominal Disponible	Vr.Nominal a Utilizar	Monto Valorado	
53782	45.000.000	10.000.000	12.000.000.00	Todo
54876	10.000.000	5.000.000	8.000.000.00	Todo
51929	5.000.000.000	30.000.000	30.000.000.00	Todo
53531	5.000.000.000			Todo
55081	79.000.000.000			Todo

Garantía Marginal Pendiente: 50.000.000

Mirar    Incluir    **Activar**    Modificar    Suprimir    Terminar

DAR CRICK EN ACTIVAR PARA DAR CONFORMIDAD DE LA OPERACIÓN



# MANEJO OPERATIVO - CONSULTA

PARA ACCEDER A LA CONSULTA DE LOS LLAMADOS A MARGEN SE DEBE INGRESAR POR LA SIGUIENTE RUTA:

1. DEPOSITO CENTRAL DE VALORES - DCV
3. OPERACIONES SISTEMA ELECTRÓNICO DE NEGOCIACIÓN
9. GARANTÍAS PARA OPERACIONES A PLAZO
6. CONSULTA LLAMADOS A MARGEN.

ccarrica01007  
2015/01/22  
10:21:39

[Principal](#)  
[Listados](#)  
[Logs Reportes](#)  
[Terminar Sesión](#)  
[Contáctenos](#)

**Depósito Central de Valores**

CONSULTAS LLAMADO A MARGEN - GARANTIAS

Fecha de Consulta: 20150122    Código Intermediario: 7    BANCOLOMBIA S.A.  
Sistema Externo: TODOS    Cod. Operación: TODOS  
Estado: Generado  
Valor de Garantías Otorgadas: 0.00    Valor de Garantías Requeridas: 531,563,786.09  
Valor de Llamado Margen: 531,563,786.09

OPERACIONES DESCUBIERTAS POR LLAMADOS A MARGEN						
Código	No.Operación	Descripción	Fecha Operación	Sistema Externo	Garantías Requeridas	Valor Operación
422	43001	COMPRAVENTA	20150130	SEN	\$31,563,786.09	531,563,786.09

Mirar    Listar    Terminar

DEFINIR CRITERIOS DE CONSULTA



# MANEJO OPERATIVO - CONSULTA

**CONSULTAS LLAMADO A MARGEN - GARANTIAS**

Fecha de Consulta: 20150126      Código Intermediario: TODOS

Sistema Externo: TODOS      Cod. Operación: TODOS

Estado: **TODOS**

Valor de Garantías: **Cumplido Parcial**      Requeridas:

Valor de Llamado Margen:

**OPERACIONES DESCUBIERTAS POR LLAMADOS A MARGEN**

Intermediario	Código	No. Operación	Descripción	Fecha Operación	Sistema Externo	Garantías Requeridas	Valor Operación

**ESTADO DE LAS GARANTÍAS**

Mirar    Listar    Terminar



# MANEJO OPERATIVO - CONSULTA

Intermediario: 23 - BANCO DE OCCIDENTE S.A.

## INFORMACIÓN DE OPERACIONES DESCUBIERTAS

Código Operación	Numero Operación	Descripción	Fecha Operación	Sistema Externo	Garantías Requeridas	Valor Llamado Margen
435	43015	SIMULTANEA	20141111	SEN	621,165,613.44	4,468,817,851.32
435	43016	SIMULTANEA	20141111	SEN	660,604,700.00	4,468,817,851.32
435	43017	SIMULTANEA	20141111	SEN	700,043,786.57	4,468,817,851.32
435	43018	SIMULTANEA	20141111	SEN	739,482,873.14	4,468,817,851.32
435	43019	SIMULTANEA	20141111	SEN	778,921,959.71	4,468,817,851.32
435	43020	SIMULTANEA	20141111	SEN	818,361,046.27	4,468,817,851.32
495	143005	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	15,637,541.34	4,468,817,851.32
495	143006	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	18,357,113.75	4,468,817,851.32
495	143007	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	21,076,686.16	4,468,817,851.32
495	143008	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	23,796,258.56	4,468,817,851.32
495	143009	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	26,515,830.97	4,468,817,851.32
495	143010	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	29,235,403.38	4,468,817,851.32
495	143011	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	31,954,975.79	4,468,817,851.32
495	143012	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	34,674,548.19	4,468,817,851.32
495	143013	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	37,394,120.60	4,468,817,851.32
495	143014	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	40,113,693.01	4,468,817,851.32
495	143015	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	42,833,265.42	4,468,817,851.32
495	143016	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	45,552,837.82	4,468,817,851.32
495	143017	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	48,272,410.23	4,468,817,851.32
495	143018	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	50,991,982.64	4,468,817,851.32
495	143019	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	53,711,555.05	4,468,817,851.32
495	143020	R. SIMULTANEA	20141111	SEN	56,431,127.45	4,468,817,851.32

Total de Operaciones 22

Total Valor Llamado Margen 4,895,129,329.49



# MANEJO OPERATIVO - REPORTES



Depósito Central de Valores



## REPORTES GARANTIAS OPERACIONES A PLAZO

atalerni01002  
2015/01/15  
14:04:37

- [Principal](#)
- [Listados](#)
- [Loqs Reportes](#)
- [Terminar Sesión](#)
- [Contáctenos](#)

Código Intermediario:

2

Sistema Externo:

Seleccione ▼

**Reporte Operaciones en Garantías**

Fecha Operación: Desde 20150115 Hasta 20150115

**Reporte Garantías Otorgadas**

Listar

Terminar





## Diapositiva 32

---

**GVAAS**

Confirmar la ubicación de la pantalla en el menú.

García Vélez Aurelio Abdón, 26/01/2015

# MANEJO OPERATIVO - REPORTES

BANCO DE LA REPUBLICA

DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES

PDFOctorgadas

GARANTIAS OTORGADAS PARA OPERACIONES A PLAZO

Sist. Externo: SEN- SISTEMA ELECTRONICO DE NEGOCIACION

Intermediario: 10- RESEC COLOMBIA S.A.

Fecha	Portafolio	Tipo Garantía	Emission/Cuenta	Valor Costo (COP)	Valor Nominal
20150122	0	T	53531	276,866,270.00	250,472,945.29
20150122	0	D	62011002	92,286,756.70	0.00

Subtotal	738,294,033.56
Total Valor Titulos (hoy)	250,472,945.29
Total Valor Dinero	92,286,756.70



## CODIGO DE OPERACIONES

CONSTITUCIÓN MANUAL	CONSTITUCIÓN AUTOMÁTICA	LIBERACIÓN
771	770	772



# MANEJO DE LOS INCUMPLIMIENTOS

## Garantías no constituidas el día anterior:

EN BRC DEBERÁ CONTACTAR AL DEPOSITANTE DIRECTO PARA INFORMARLE EL HECHO Y SOLICITARLE LA CONSTITUCIÓN DE LA GARANTÍA ANTES DE LAS 10:00 A.M., ADVIRTIÉNDOLE QUE EN CASO DE INCUMPLIR CON LA CONSTITUCIÓN LOS REPOS BR PODRÁ DECLARAR EL CUMPLIMIENTO ANTICIPADO.

EN EL CASO DE LAS OPERACIONES REPO BR, SE DEBE REPORTAR EL EVENTO A LA SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA CONFORME LO ESTABLECIDO EN EL REGLAMENTO DEL DCV ART. 27. ADICIONALMENTE, SE DEBE INFORMAR AL DEPARTAMENTO DE ESTABILIDAD FINANCIERA - DEFI PARA QUE ESTABLEZCA LA PROCEDENCIA DEL COBRO DE LA SANCIÓN PECUNIARIA Y DE LAS DEMÁS CONSECUENCIAS POR CUMPLIMIENTO EXTEMPORÁNEO..



# MANEJO DE LOS INCUMPLIMIENTOS

## Liquidación Anticipada:

SE PROCEDERÁ A ANTICIPAR LA OPERACIÓN TENIÉNDOSE EN CUENTA EL MONTO INICIAL, ADICIONADO LOS RENDIMIENTOS FINANCIEROS HASTA EL MOMENTO DE LA TERMINACIÓN ANTICIPADA, ES RESPONSABILIDAD DE LOS DD EFECTUAR EL PROCEDIMIENTO DE ANTICIPO UTILIZANDO LA FACILIDAD QUE OFRECE EL DCV

CADA PARTE MANTENDRÁ EL DERECHO DE PROPIEDAD SOBRE LAS SUMAS DE DINERO Y LOS VALORES QUE HAYA RECIBIDO DE LA OPERACIÓN Y PODRÁ CONSERVARLOS DEFINITIVAMENTE HASTA SU VENCIMIENTO SI EXISTE ALGUNA DIFERENCIA ENTRE LOS VALORES, ENTRE DE UN LADO, EL MONTO PACTADO EN LA OPERACIÓN Y DE OTRO EL PRECIO DE MERCADO EN LA FECHA DE INCUMPLIMIENTO MAS LAS AMORTIZACIONES Y SE CONSTITUYA UNA DIFERENCIA DE SALDO A FAVOR TENDRÁ DERECHO A QUE SEA PAGADO EN UN PLAZO NO MAYOR A 5 DÍAS HÁBILES



# MANEJO DE LOS INCUMPLIMIENTOS

## Sanciones pecuniarias:

RETRASO O INCUMPLIMIENTO EN LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS REQUERIDAS POR LA FUNCIONALIDAD PARA EL MANEJO DE GARANTÍAS DEL DCV DE LA OPERACIÓN DE REPORTO (REPO). SE ENTIENDE POR RETRASO EN LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS CUANDO LOS ACO CONSTITUYAN LAS MISMAS DESPUÉS DE LA HORA DE CIERRE DEL PORTAL DE ACCESO SEBRA, O EL QUE LO SUSTITUYA, DEL DÍA EN QUE FUERON REQUERIDAS, Y ANTES DE LAS 10:00 A.M. DEL DÍA HÁBIL SIGUIENTE. SE ENTIENDE POR INCUMPLIMIENTO EN LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS CUANDO LOS ACO NO REALICEN LA CONSTITUCIÓN DE LAS MISMAS ANTES DE LAS 10:00 A.M. DEL DÍA HÁBIL SIGUIENTE MENCIONADO.

PRESENTADO EL INCUMPLIMIENTO EN LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS SE DECLARARÁ LA LIQUIDACIÓN  
ANTICIPADA DE LA OPERACIÓN, LA CUAL SE EFECTUARÁ COMENZANDO CON LA OPERACIÓN DE MENOR MONTO Y CONTINUARÁ EN ORDEN ASCENDENTE DE MONTO HASTA QUE SE TENGA UN NIVEL DE GARANTÍAS SUFICIENTE PARA RESPALDAR LAS OPERACIONES ABIE1IAS RESTANTES. DE EXISTIR OPERACIONES POR EL MISMO MONTO, SE TOMARÁ PRIMERO LA DE MENOR PLAZO RESTANTE



# MANEJO DE LOS INCUMPLIMIENTOS

## Sanciones pecuniarias:

Cuadro No.2 Funcionalidad para el manejo de garantías del DCV en las OMAs

Caso	No. de veces 1/ 2 3 ó más	Sanción pecuniaria		
		Tasa de interés	Margen	Días
Retraso o incumplimiento en la constitución de garantías	1		-	3
	2	la de la operación	100 p.b.	5
	3 ó más		100 p.b.	10

p.b. puntos básicos. 1/ Acumuladas en los últimos doce meses

EN AQUELLOS CASOS EN QUE SE DECLARE Y SE CUMPLA LA LIQUIDACIÓN ANTICIPADA DE LA OPERACIÓN, LA SANCIÓN PECUNIARIA APLICABLE SERÁ SOLAMENTE LA PREVISTA PARA EL INCUMPLIMIENTO EN LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS.

EN CONSECUENCIA, NO SE APLICARÁ LA SANCIÓN PECUNIARIA POR RETRASO.





**GRACIAS**