



Depósito **Central**  
de Valores





# REUNIÓN DE PARTICIPANTES

**DEPÓSITO CENTRAL DE VALORES - DCV**

**DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES**

**7 DE SEPTIEMBRE DE 2015**

---

# AGENDA

- 1. ESTADÍSTICAS**
- 2. RESULTADOS ENCUESTA DE SATISFACCIÓN**
- 3. NUEVO ESQUEMA DE CUSTODIOS**
- 4. GARANTÍAS**
- 5. FUTURAS IMPLEMENTACIONES**



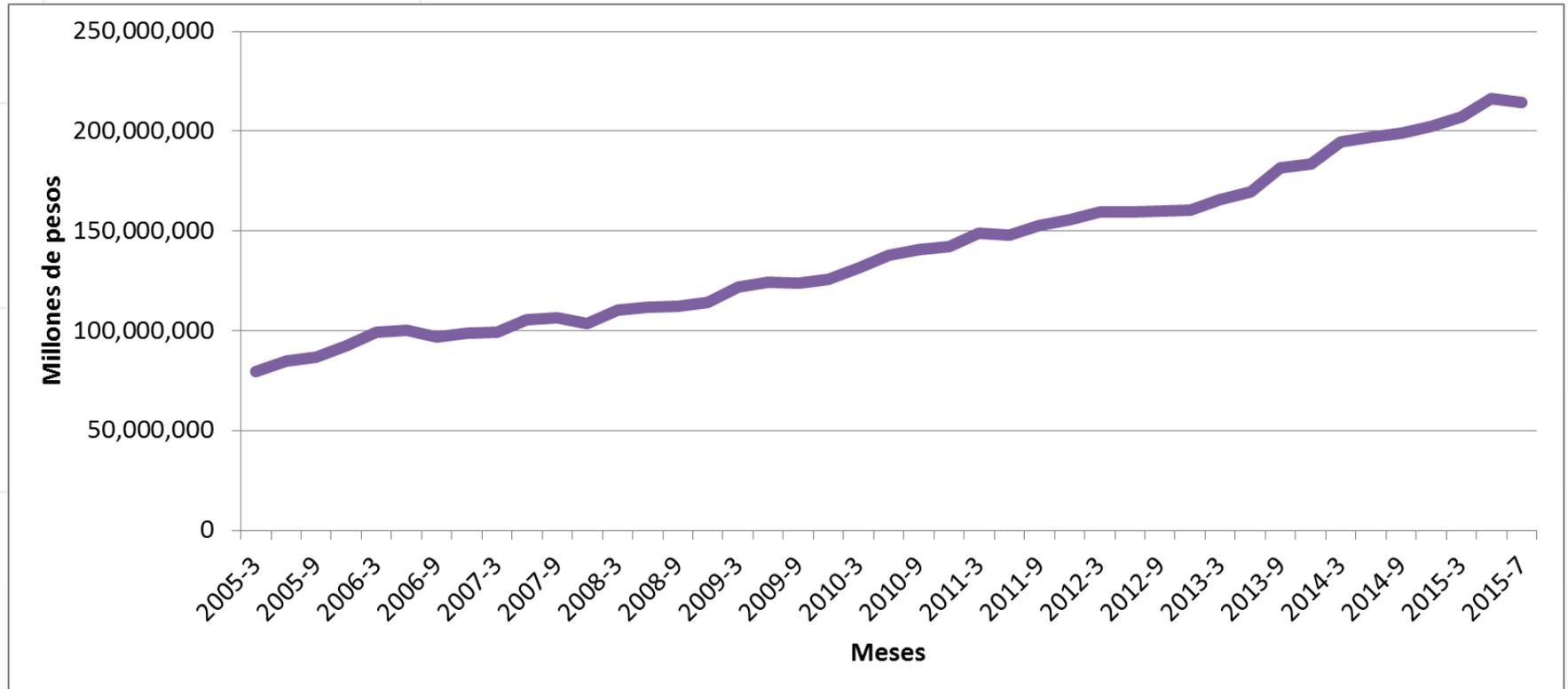
# ALGUNAS ESTADÍSTICAS



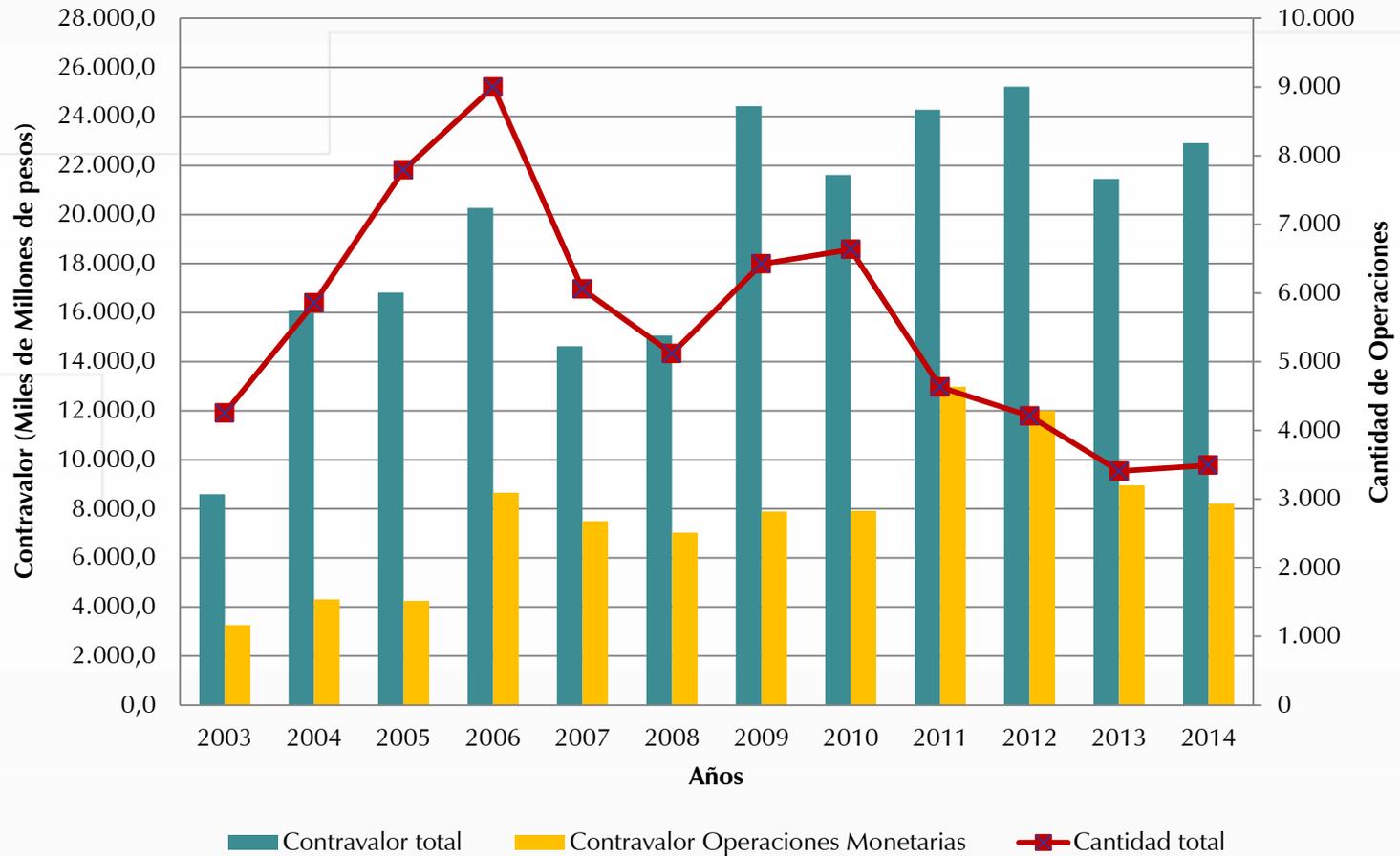
# ALGUNAS ESTADÍSTICAS

## SALDOS DEPOSITADOS

(CIFRAS A JULIO 2015)



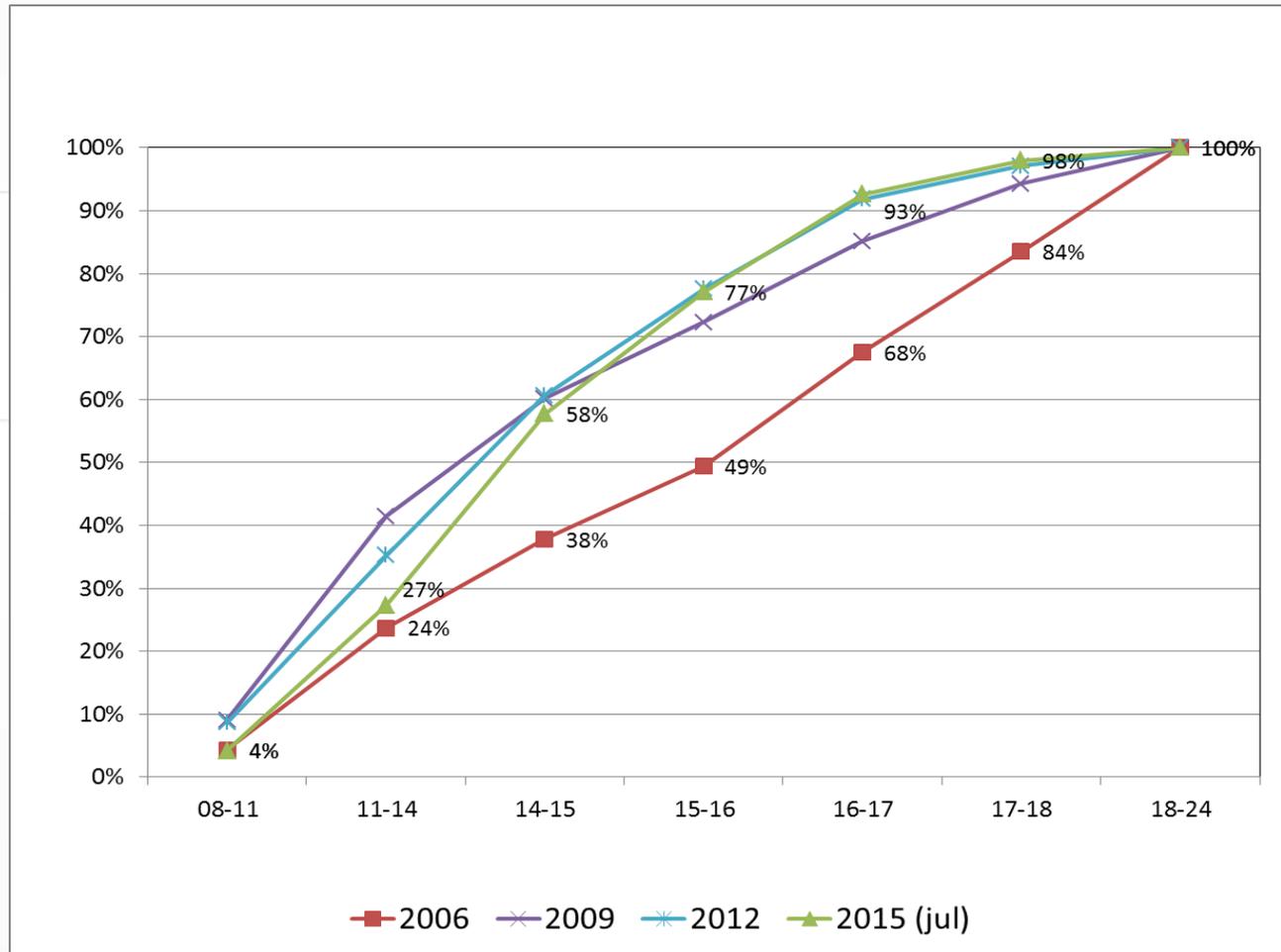
## Promedio diario Operaciones DCV



# ALGUNAS ESTADÍSTICAS

## OPORTUNIDAD EN LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

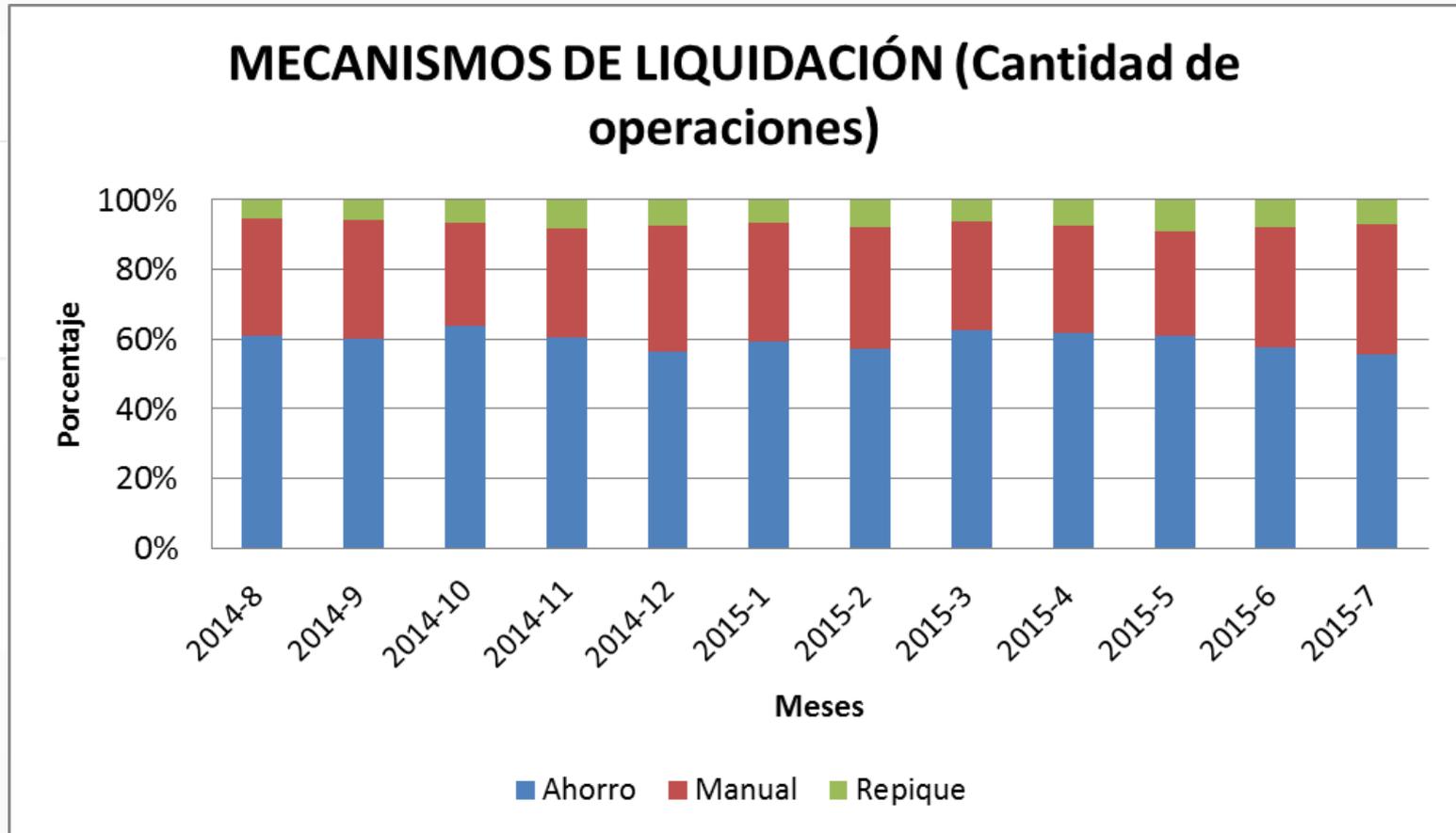
(CIFRAS A JULIO 2015)



# ALGUNAS ESTADÍSTICAS

## OPORTUNIDAD EN LA LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES

(CIFRAS A JULIO 2015)



# ENCUESTA DE SATISFACCIÓN



# RESULTADOS ENCUESTA DE SATISFACCIÓN 2015

Nivel de Satisfacción	Año 2015	Año 2014	AÑO 2013	AÑO 2011	AÑO 2010
ASPECTO TECNOLÓGICO	4,5	4,3	4,6	4,5	4,4
TARIFAS	4,5	4,2	4,4	3,9	4,1
ATENCIÓN AL CLIENTE	4,4	4,1	4,4	4,5	4,1
TRANSPARENCIA	4,6	4,4	4,6		
GESTIÓN DE LA INFORMACIÓN	4,4	4,1	4,4		
GOBIERNO CORPORATIVO	4,8	4,8	4,7		
GESTIÓN DEL RIESGO	4,5	4,4	4,7		
<b>TOTAL GENERAL</b>	<b>4,5</b>	<b>4,3</b>	<b>4,6</b>	<b>4,3</b>	<b>4,2</b>

\*La encuesta de satisfacción fue aplicada en abril de 2015 a una muestra representativa de las entidades afiliadas al DCV.



# CUSTODIOS



# Transferencia en lote



# TRANSFERENCIA EN LOTE

## Descripción

El DCV ofrece a sus DD la posibilidad de realizar transferencias masivas de títulos, mediante el envío de instrucciones en archivos planos, para el procesamiento de operaciones de transferencia (código 423) y de compraventa (código 420).

Si bien es de aplicación inmediata en la migración de portafolios de los FIC, esta facilidad puede emplearse en el trámite de cualquier transferencia o compraventa.

La funcionalidad está descrita en el capítulo **9.16.1.1.12 Operaciones en lote** del Manual de Operación.

## Requisitos

- Herramienta para la firma digital: **SUCED**
- Herramienta para la transferencia del archivo: **GTA**
- La estructura del archivo debe estar de acuerdo a la definida en el Anexo 9 del Manual de Operación.
- Gestionar la transmisión y la recepción de la respuesta (Interactivo o No Interactivo).



# Delegación - Cumplimiento Operaciones Repo



# DELEGACIÓN CUMPLIMIENTO REPOS BR

## Descripción

Con el propósito de facilitar el procedimiento operativo **para el cumplimiento** de los Repos que los administradores de los FIC, en su calidad de ACO, realicen con el BR (Repo BR e Intradía), en el DVC se implementó la facilidad de “**Delegación y Fraccionamiento de Repos BR**”.

Las responsabilidades y el ejercicio de los derechos derivados de la operación recaerán en el **ACO** a quien se le aprobó la operación.

## Consideraciones Generales

- Administrador de un FIC: Para efectos de los Repos BR será un DD autorizado a actuar como Agente Colocador de OMA (ACO).
- El ACO podrá delegar el cumplimiento de una operación a otro DD del DCV. En el esquema de custodios, se entendería como aquel DD que mantiene en custodia los activos del FIC.
- El ACO podrá fraccionar una postura aprobada y delegar el cumplimiento de una o de todas sus partes a uno o varios DD.



# Consulta Extractos



# CONSULTA EXTRACTOS

## Descripción

Un DD (Custodio) podrá autorizar a otro DD (Administrador) a consultar sus portafolios.

Un DD autorizado (Administrador), podrá obtener un reporte en formato .PDF de los saldos, del movimiento (extracto) y de las operaciones a plazo vigentes, correspondientes a los títulos depositados en el portafolio autorizado.

La consulta y estructura del reporte de saldos y del extracto es equivalente a la consulta de los mismos reportes que actualmente utilizan los DD.

## Requisitos

Autorización expresa del Custodio al DFV para que el administrador pueda realizar las consultas.

La autorización será sobre la información que pertenezca a un portafolio específico



# PANTALLA CONSULTA DE EXTRACTOS PORTAFOLIOS AUTORIZADOS

**Depósito Central de Valores**  
EXTRACTO/SALDOS CUENTAS EN OTROS DEPOSITOS

**Codigo Intermediario** 1  
**Portafolio** Todos  
**Fecha Desde** 20141209 **Fecha Hasta** 20141209  
**Codigo del Titulo** Todos **Tipo de Seleccion** Solamente  
**Posicion Intermediario** Ambas **Subcuenta** 0 **Todas**   
**Una emision particular** 0 **Codigo ISIN**  **Todas**   
**Reporte a Ejecutar** Extracto **Seleccione el formato del reporte** Archivo Plano  
Activar Terminar  
Extracto  
Saldos  
Operaciones a plazo vigente

**Seleccionar el código de DD de la entidad que autoriza**

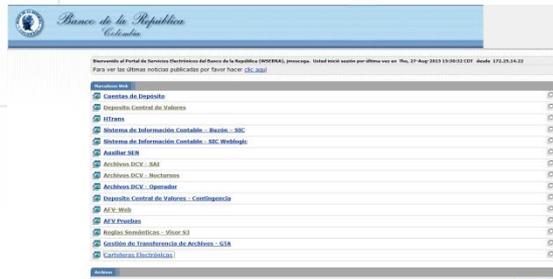
**Seleccionar el portafolio autorizado**

**Seleccionar la consulta a ejecutar**



# AUTORIZACIÓN DEL CUSTODIO AL ADMINISTRADOR

## WSEBRA CARTELERAS ELECTRÓNICAS



DILIGENCIAR FORMULARIO DE SOLICITUD PARA CREAR, RENOMBRAR O INHABILITAR PORTAFOLIOS Y AUTORIZAR CONSULTAS DE CUENTAS

BR-DFV REGISTRA AUTORIZACIÓN EN EL DCV

ENVÍO CORREO CIFRADO A BR  
SERVICIOALCLIENTEDFV@BANREP.GOV.CO



www.shutterstock.com - 94245322



# INCIDENTES

Funcionalidad	Descripción	Estado
Delegación Repos	No se despliega la información para la delegación o admisión para cumplimiento de Repos delegados.	<b>Cerrado</b> – Se divulga la versión de IE para la que está homologada la funcionalidad.
Consulta de extractos	El sistema despliega información que no corresponde a la solicitada.	<b>Cerrado</b> – Se adicionan controles para los eventos de múltiples transmisiones.
Operaciones de la BVC (MEC) “suprimidas”	Algunos cierres son transmitidos al DCV sin haber culminado la complementación.	<b>Abierto</b> – Se está ajustando el SI-DCV para permitir el ingreso de la información del custodio (2 meses)



# DISPOSICIONES

En atención a la solicitud conjunta de ASOFIDUCIARIAS y ASOBOLSA, en el sentido de considerar una ampliación del horario de la primera ventana del sistema de cuentas de depósito CUD, mediante CRE DSP 272, se estableció las 17:59 (5:59 p.m.) como hora límite de la primera ventana, hasta el día 2 de octubre de 2015.



# GARANTÍAS



# INTERPOSICIÓN DE LA CÁMARA

De conformidad con lo dispuesto en la regulación del Programa de Creadores de Mercado para Títulos de Deuda Pública del Ministerio de Hacienda y de Crédito Público, La Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) se interpondrá en el cumplimiento de las operaciones Simultáneas **del Primer Escalón del Sistema Electrónico de Negociación SEN.**

Si bien la interposición de la CRCC conlleva la **novación** de las obligaciones, **no habrá cambio operativo en el cumplimiento** de las citadas simultáneas.

El modelo operativo se encuentra probado y listo para operación. Se espera disposición del MHCP que establezca la fecha para iniciar bajo este nuevo esquema.



# INTERPOSICIÓN DE LA CÁMARA...

En la transmisión de los cierres que el SEN hace al DCV para el cumplimiento de las operaciones, se hará simultáneamente a la CRCC para que ésta las acepte.

Por su parte, el DCV informará a la CRCC el cumplimiento de las mencionadas operaciones mediante un archivo plano generado cada 30 minutos a partir de la apertura del horario SEBRA hasta el cierre del mismo (tanto la ope de ida como la retrocesión).

El manejo de las garantías mínimas y de los llamados a margen estará a cargo de la CRCC y se registrarán por su reglamento.

El MHCP delegó en la CRCC la facultad de bloqueo de agentes en la rueda de simultáneas del primer escalón del SEN que incumplan al Reglamento de la CRCC.



# MÓDULO DE GARANTÍAS DEL DCV

El riesgo de mercado de las simultáneas del segundo escalón y de las compraventas a plazo del SEN, se gestiona a través del módulo de garantías del DCV.

La descripción del mecanismo para el manejo de garantías del DCV se encuentra disponible en el sitio Web del Banco, bajo la ruta: *Sistemas de pago / Depósito Central de Valores (DCV) / Estadísticas, Boletines informativos / Información.*



# **FUTURAS IMPLEMENTACIONES**



# FUTURAS IMPLEMENTACIONES

<b>Garantías Fase II</b>	Sustitución: Nueva funcionalidad que permitirá a los depositantes directos sustituir los títulos transferidos como garantía por otros que mantengan el cubrimiento del riesgo de mercado. <i>(Enero 2016)</i>
<b>Garantías en Operaciones Repos BR</b>	A través de la funcionalidad para la cobertura del riesgo de mercado del DCV, se gestionarán las garantías necesarias en las operaciones Repo con el Banco de la República. <i>(Octubre 2015 – Requiere, además, ajuste reglamentario).</i>



# FUTURAS IMPLEMENTACIONES

<b>Clasificación de inversionistas</b>	<p>En la creación de subcuentas, se deberá indicar el "<b><i>Tipo de Inversionista</i></b>" al que pertenece el titular de la subcuenta. Las opciones disponibles serán:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>• Inversionista Extranjero</li><li>• Fondo Pasivo Pensional</li><li>• Otros.</li></ul> <p>El BR – DCV requerirá a los DD informar el tipo de inversionista de las subcuentas existentes. (<i>Septiembre 2015</i>).</p>
--	---



# PREGUNTAS E INQUIETUDES



**GRACIAS**

