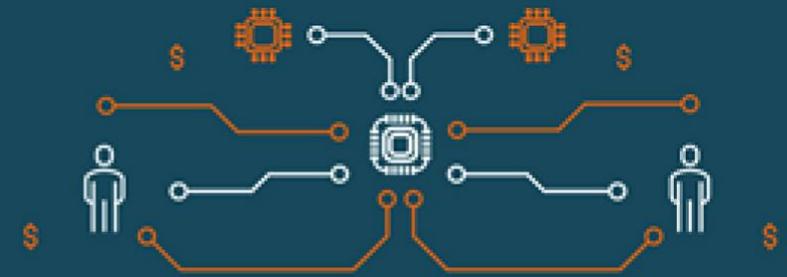




Depósito Central
de Valores - DCV

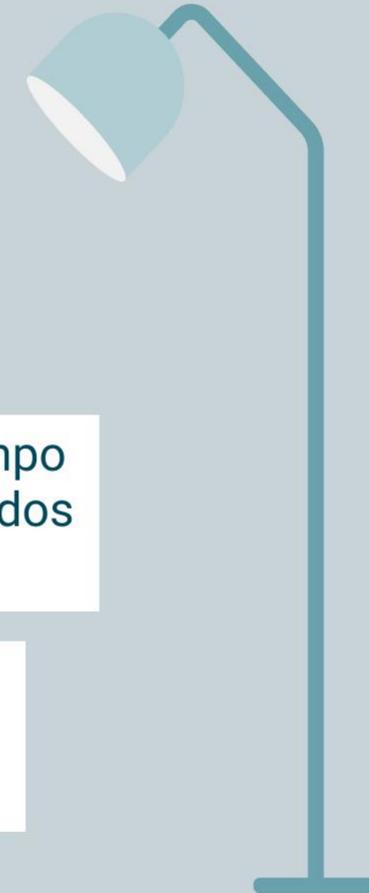


El evento iniciará pronto

Por favor, para interactuar recuerde:

Los mensajes recibidos mediante el campo de Preguntas y Respuestas serán atendidos en orden de llegada

Si tiene problemas para escuchar o visualizar, utilice el chat para dejarnos saber



Agradecemos su retroalimentación diligenciando la encuesta al finalizar



Reunión Depositantes Directos - DCV

SUBGERENCIA SISTEMA DE PAGOS Y OPERACIÓN BANCARIA
Departamento de Fiduciaria y Valores

12 de agosto de 2020



AGENDA

1. Nuevas funcionalidades

2. Operaciones con intervención del BR

3. Proyecto de Modernización



AGENDA

1. Nuevas funcionalidades

2. Operaciones con intervención del BR

3. Proyecto de Modernización

Nuevas Funcionalidades

Reinversión Automática de los TDA

- Los DD podrán determinar el % de reinversión automática por tipo de indicador de referencia (DTF e IBR).
- Adicionalmente, podrán especificar el valor nominal que requieren NO sea reinvertido (3Q 2020).

Anonimato en las operaciones

- Los sistemas de negociación o de registro de operaciones sobre valores, podrán especificar si se debe mantener el anonimato durante el cumplimiento (4Q 2020).



AGENDA

1. Nuevas funcionalidades

2. Operaciones con intervención del BR

3. Proyecto de Modernización

Operaciones con intervención del BR

TIDIS:

- En febrero el BR inició la administración de los títulos.
- Al cierre de julio:
 - Resoluciones tramitadas: 8,571
 - Valor nominal expedido: \$9,8 billones
 - Entidades participantes en las expediciones: 27
- Atender las solicitudes de anulación tan pronto como son notificadas por la DIAN.
- El BR da trámite a las órdenes de expedición de la DIAN, una vez las recibe, en el horario de 8:00 am a 3:00 pm.

Operaciones con intervención del BR

REPOS CON DEUDA PRIVADA:

- Agilizar el envío de los archivos con la relación de los títulos a entregar al BR y dentro del horario establecido (antes de la 1:00 pm).
- Verificar que los títulos tengan el saldo suficiente.
- Validar que los títulos valorados son suficientes (debe aplicarse el *haircut* y deben cubrir el capital más los intereses de la operación).



Photo by [Brandi Redd](#) on [Unsplash](#)

Espacio para resolver dudas e inquietudes



AGENDA

1. Nuevas funcionalidades

2. Operaciones con intervención del BR

3. Proyecto de Modernización



TEMAS

INTRODUCCIÓN

CARACTERÍSTICAS

INSTRUCCIONES, TRANSACCIONES Y PROCESAMIENTO

PRÓXIMOS PASOS

OTROS TEMAS DE INTERÉS

Modernización del DCV

INTRODUCCIÓN

Modernización de la infraestructura tecnológica del DCV

Depósito Central de Valores

Sistema de custodia, compensación y liquidación de operaciones sobre títulos valores

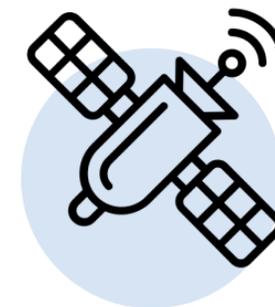
Adquisición de solución
Proveedor: Montran Co.

- +50 Países con sus productos. 21 Depósitos Centrales.
- +40 Clientes Bancos Centrales y Cámaras de Compensación
- +100 Implementaciones en todo el mundo
- Oficinas en 5 países
- +200 Interfaces con diferentes sistemas bancarios desarrolladas

Gestor Operativo Integrado de Valores

Sistema que cubre actividades administrativas y propias de banca central (operaciones con títulos de deuda privada)

Aplicación construida a la medida



Créditos
trust by Justin Blake, from thenounproject.com - modern security by Azam Ishaq , from thenounproject.com - artificial satellite by Azam Ishaq , from thenounproject.com

Objetivos



Modernizar el sistema de información que soporta el portafolio de servicios del DCV



Mantener o incorporar los estándares y principios internacionales para las infraestructuras del mercado financiero



Fortalecer la eficiencia en la prestación de los servicios, bajo los más estrictos estándares de seguridad informática

Beneficios



Optimización de tiempos de implementación de mejoras o ajustes derivados de cambios normativos o requeridos por el mercado



Acceso al procesamiento automático de principio a fin (STP por sus siglas en inglés).
Uso de mensajería ISO 20022



Nuevas funcionalidades y alineación con estándares internacionales y mejores prácticas

Modernización del DCV

CARACTERÍSTICAS

Principios y Estándares



Principios centrales para las Infraestructuras del Mercado Financiero emitidos por el *Bank for International Settlements* (BIS).

Uso de estándar IBAN (*International Bank Account Number*) para nomenclatura de cuentas.

Uso de estándar *Corporate Actions Joint Working Group* (CAJWG) para servicio de la deuda.

Uso del código BIC (*Business Identifier Code*) para identificar a los participantes.

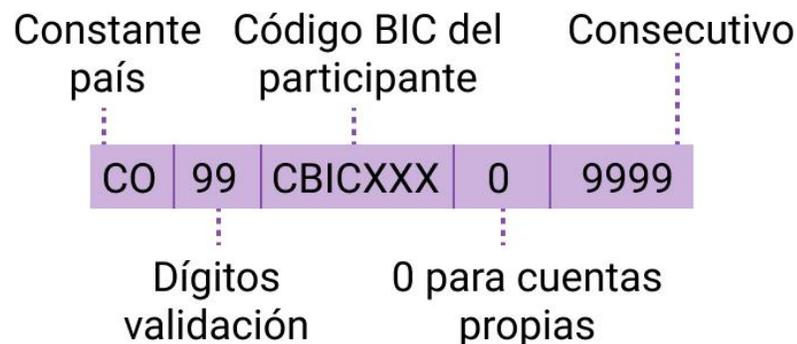
Liquidación bruta en tiempo real bajo los modelos DVP 1 y DVP 3.

ISIN como identificador principal de los títulos.

Entre otros.

Estructura de código IBAN para cuenta propia en el nuevo sistema del DCV

Ejemplo: CO12CBICXXX0010



Se elimina la restricción de 100 cuentas por depositante indirecto



Mecanismos de optimización operativa

Autocolateralización, Instrucciones vinculadas y Reciclaje de transacciones.

Uso de mensajería ISO 20022, que provee comunicación y gestión asíncrona de la recepción y confirmación de las instrucciones.

Mecanismo de Múltiples Roles: los afiliados, exceptuando los clientes, podrán tener múltiples roles en el sistema DCV que definen qué tipo de actividad realizarán en el sistema.



La mensajería ISO 20022 se podrá capturar tanto por interfaz gráfica de usuario (formularios con altos estándares de usabilidad) como utilizando el mecanismo B2B. Los depositantes podrán seleccionar el mecanismo que se adecúe a sus necesidades

optimization by Creative Stall from thenounproject.com



Mecanismos de monitoreo

Alertas impulsadas por eventos y configurado por roles.

Registro de actividad disponible para los administradores, que contiene información de las acciones y eventos realizados por los usuarios.



Los usuarios podrán consultar un resumen del log de acciones en la parte inferior de cada formulario o pantalla

Computer Warning by Chunk Icons from thenounproject.com



Facilidades para consulta de información

Tablero de Monitoreo: seguimiento centralizado y permanente de transacciones pendientes, liquidadas o balances de cuenta, entre otros.

Portal Web del Inversionista: complemento del DCV que le permite a los inversionistas finales y revisores fiscales consultar el estado de cuenta y próximos eventos de pago.

Reorganización y optimización de los reportes e informes que genera el sistema. Mayor flexibilidad en los formatos y firmas digitales en reportes pdf.



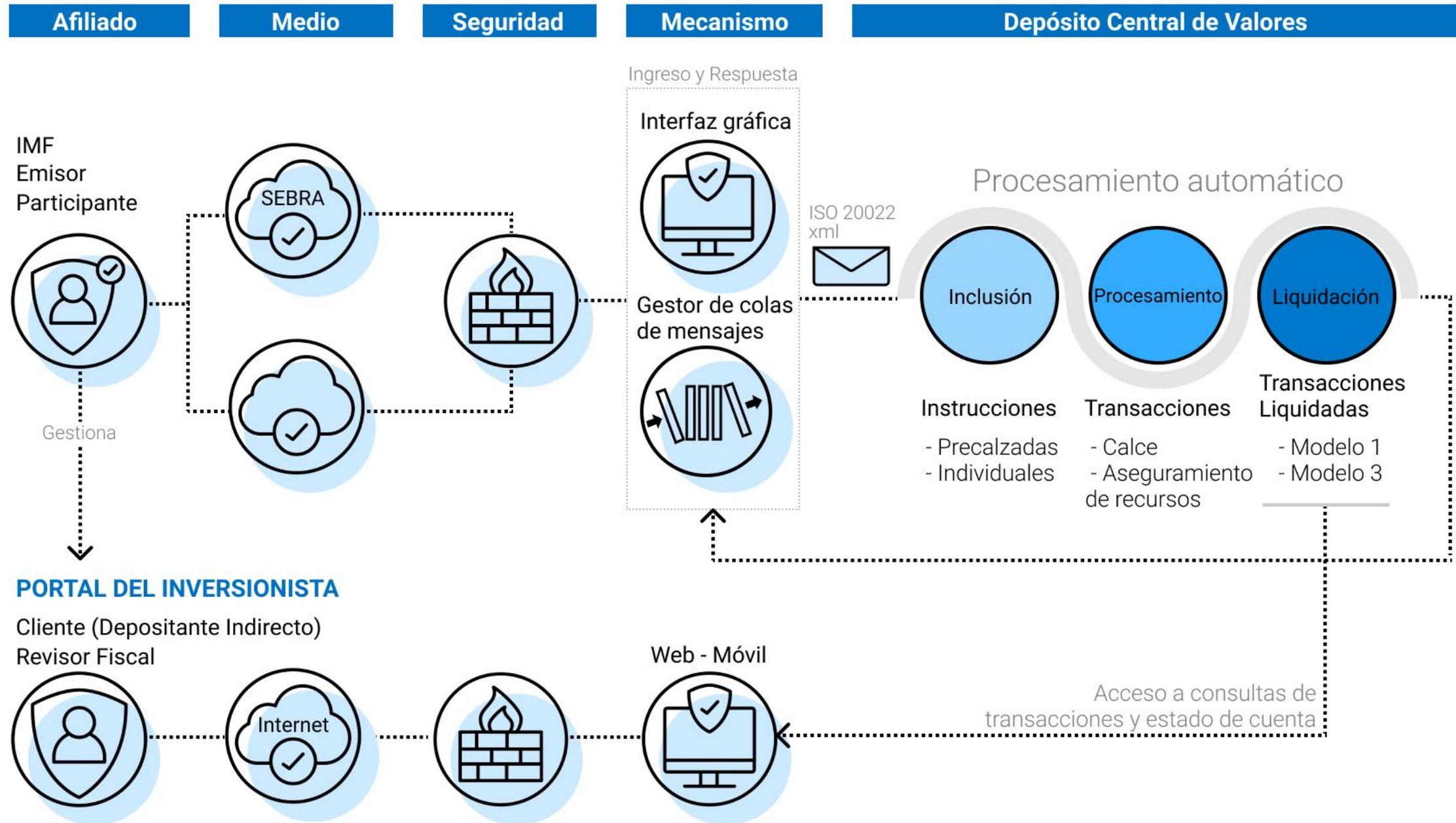
Los reportes se modernizarán para ajustarse a las demandas actuales de los usuarios y para reflejar los estándares del sistema. Todos los reportes tendrán versión CSV y PDF firmado cuando la información sea sensible.

analytics by shashank sing from thenounproject.com

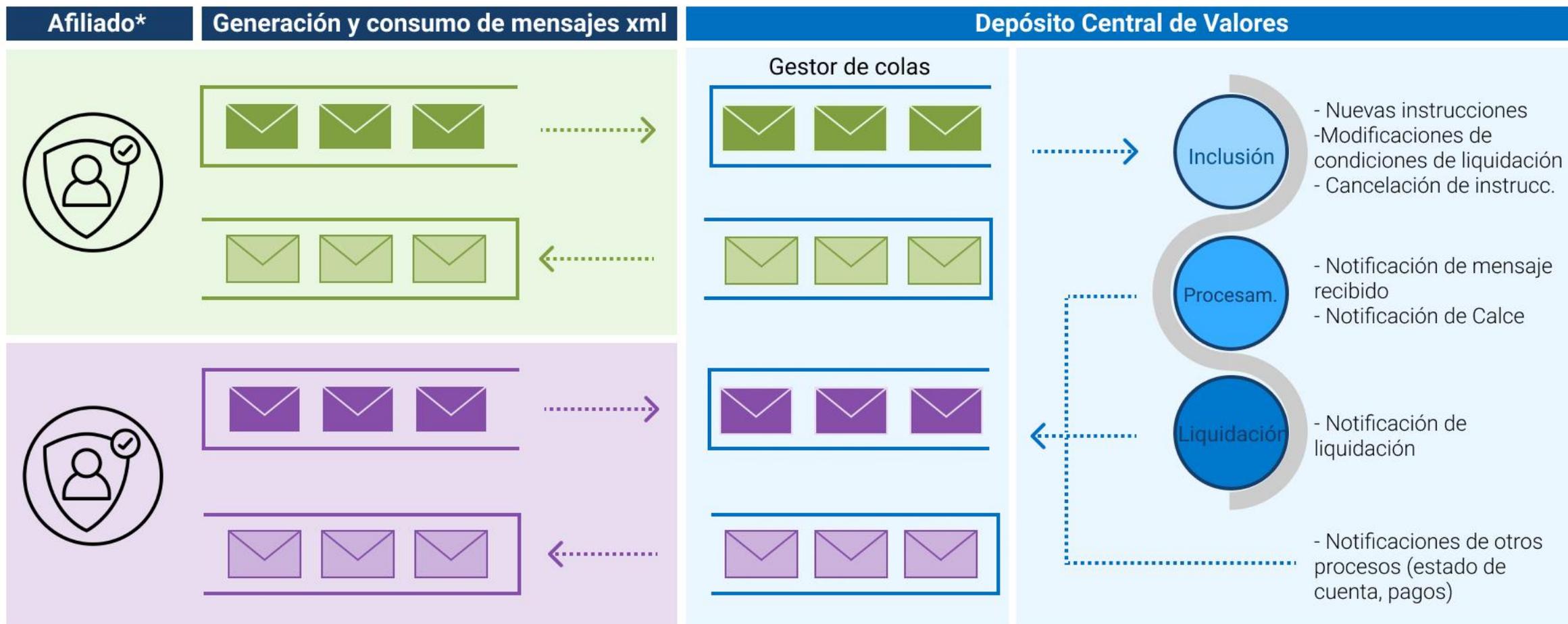
Modernización del DCV

INSTRUCCIONES, TRANSACCIONES Y PROCESAMIENTO

Esquema general de conexión con el DCV



Esquema de conexión con el uso de mensajería ISO 20022



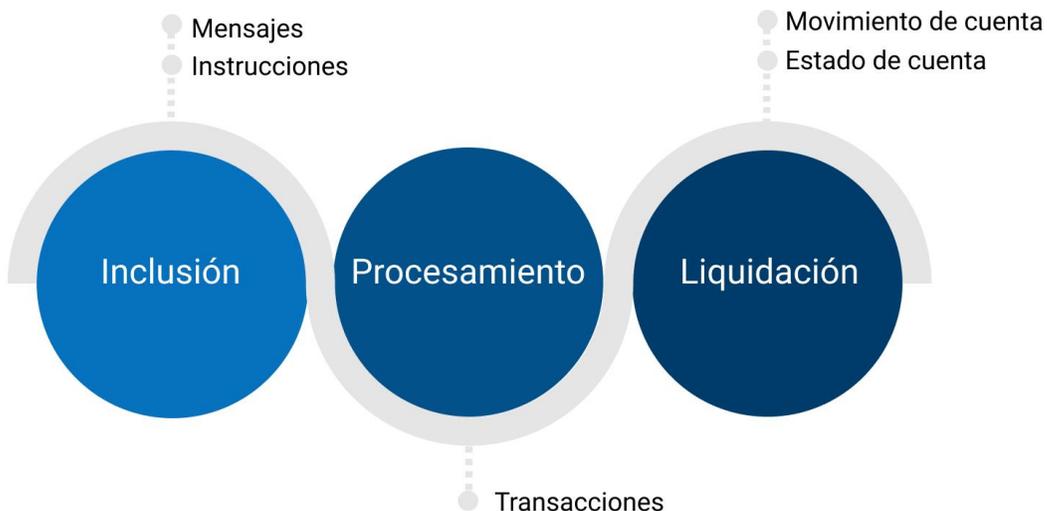
*IMF, Participante

Créditos
secured profile by SBTS from thenounproject.com

Formato de mensajes ISO 20022: XML

Suministro de información

Reportes Generales



Reportes Específicos por operación

Repos	Contratos de Repos. Títulos elegibles para operaciones con el Banco de la República. Cupo de ROC.	Pago de impuestos con títulos valores	Títulos Valores Redimidos en Pago de impuestos. Títulos Valores Expedidos para Pago de Impuestos.
Simultáneas	Contratos de Simultáneas.	Prendas	Extracto de Garantías Constituidas, Liberadas y Ejecutadas.
Operaciones sin títulos	Contratos de Operaciones sin títulos.	Garantías	Títulos elegibles para operaciones con el Banco de la República. Llamados a Margen y Operaciones Descubiertas.
TTV	Transacciones pendientes para TTV entre participantes. Transacciones de TTV.	Delegación	Operaciones delegadas.
Expediciones	Estado de cuenta valores emitidos.	Certificados	Certificado de Inmovilización. Constancias de Depósito.
Acciones corporativas	Estimación de acciones corporativas. Acciones corporativas pagadas. Acciones Corporativas. Días de Tenencia.	Auditorías	Actividad Usuario Auditoría.



Los reportes y estructuras de archivos planos cambiarán



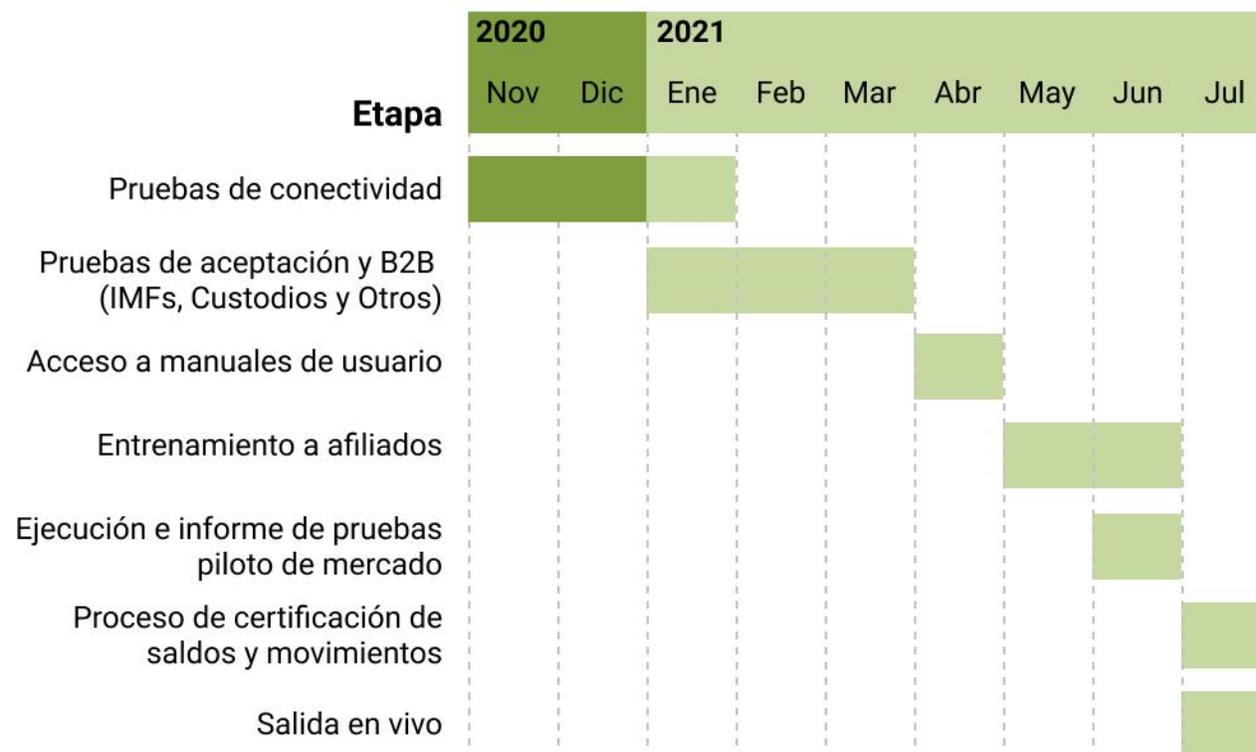
Photo by [Brandi Redd](#) on [Unsplash](#)

Espacio para resolver dudas e inquietudes

Modernización del DCV

PRÓXIMOS PASOS

Cronograma de participación de afiliados



Modernización del DCV

OTROS TEMAS DE INTERÉS

Grupos de enfoque



Se conformarán grupos para gestionar lo relacionado con los desarrollos de software que tienen que ver con interoperabilidad B2B con mensajería ISO 20022:

IMFs
Custodios
Otros afiliados interesados



Los afiliados pueden manifestarnos su interés de realizar desarrollos y participar en los grupos de enfoque a través de comunicación desde el correo de la persona de contacto para el Programa de Modernización de Infraestructura Tecnológica del DFV.
ProgramaMIT-DFV@banrep.gov.co

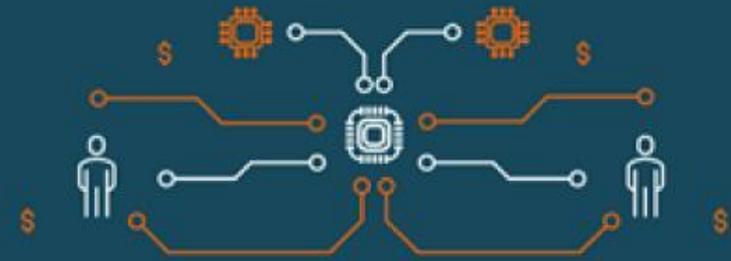


Photo by [Brandi Redd](#) on [Unsplash](#)

Espacio para resolver dudas e inquietudes



Depósito Central
de Valores - DCV



12/08/2020

Contáctenos

ProgramaMIT-DFV@banrep.gov.co
ServicioalClienteDFV@banrep.gov.co