



*Banco de la República
Colombia*

ESTRUCTURA DE ARCHIVOS PARA OPERACIONES CON DEUDA PRIVADA

Departamento de Fiduciaria y Valores

16 de junio de 2015



CONTENIDO

	Pág.
CONTENIDO	I
PÁG.....	I
1 INTRODUCCIÓN	II
1.1 OBJETO.....	II
1.2 ALCANCE.....	II
1.3 AUDIENCIA	II
2 ESTRUCTURAS DE LOS ARCHIVOS DE CUMPLIMIENTO DE OPERACIONES CON DEUDA PRIVADA	3
2.1 TTV FRECH.....	3
2.1.1 INFORMACIÓN DE LA OPERACION TTV <datos principales>	3
2.1.2 INFORMACION DE CUENTAS <datos de cuentas empleadas>.....	4
2.1.3 INFORMACION DE LOS TÍTULOS <datos de los títulos a transferir>.....	5
2.2 REPOS BR CON DEUDA PRIVADA	7
2.2.1 INFORMACION DE LA OPERACION REPO <datos principales>.....	8
2.2.2 INFORMACION DE CUENTAS <datos de cuentas empleadas>.....	9
2.2.3 INFORMACION DE LOS TÍTULOS <datos de los títulos a transferir >.....	9



1 INTRODUCCIÓN

1.1 OBJETO

Poner a disposición de los Agentes Autorizados FRECH y de los Agentes Colocadores de OMAs, un documento que describa los campos que conforman el archivo a enviar en el trámite de operaciones que involucra deuda privada depositada en DECEVAL; específicamente, en la realización de Transferencias Temporales de Valores con portafolio FRECH y de operaciones transitorias de expansión con deuda privada.

1.2 ALCANCE

Las estructuras presentadas corresponden al esquema de diligenciamiento de información asociada a las solicitudes de trámite de Traserencias Temporales de Valores con portafolio FRECH (TTV-FRECH) y a Repos BR con deuda privada.

1.3 AUDIENCIA

Agentes Autorizados FRECH y Agentes Colocadores de OMAs.



2 ESTRUCTURAS DE LOS ARCHIVOS DE CUMPLIMIENTO DE OPERACIONES CON DEUDA PRIVADA

2.1 TTV FRECH

De conformidad con lo establecido en la Circular Reglamentaria Externa – DGPC – 271, del Asunto 33: Transferencia Temporal de Valores del FRECH, el adjudicatario de un cupo FRECH, durante el período de utilización del mismo y hasta por su valor, está autorizado para realizar TTV – FRECH. Para la utilización el cupo FRECH, el Agente Autorizado FRECH deberá enviar un correo electrónico antes de las 3:00 p.m., a las direcciones ServicioalclienteDFV@banrep.gov.co, DGPC_Frech@banrep.gov.co y DFVContingencia@yahoo.com, adjuntando una comunicación cifrada y firmada en forma digital con la herramienta SUCED o la que la sustituya, en la cual informe su intención de utilizar el cupo FRECH adjudicado, el valor del cupo a utilizar y el plazo de la TTV-FRECH. Así mismo, deberá anexar un archivo sobre los títulos a transferir en la operación TTV a favor del FRECH en DECEVAL con los campos y formatos señalados en el numeral 2.1.1 del presente documento.

Adicionalmente, el archivo debe conservar las características del modelo que está publicado en la página Web del Banco de la República, debido a que éste contempla varias hojas que aunque no son diligenciadas por el agente sí se actualizan con la información que se incluye en la hoja con nombre “Cumplimiento” y que son necesarias para procesar la operación. También en la página www.banrep.gov.co / Sistema Financiero / Sistemas de Pago / Depósito Central de Valores / Trámites y Servicios / Trámites, se encuentra el link “Estructura Excel TTV FRECH” donde está publicado el formato Excel que debe ser diligenciado en este tipo de operación.

2.1.1 INFORMACIÓN DE LA OPERACION TTV <datos principales>

2.1.1.1 Descripción

Corresponde a la información básica de la utilización del cupo FRECH. Debe digitarse una sola vez en el archivo.



2.1.1.2 Estructura

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Consecutivo Operación Diario	Número asignado por el Agente FRECH (AF).	9999
NIT Intermediario (1)	Número de Identificación Tributaria del AF que realizará la TTV.	99999999999999
Digito de Chequeo Intermediario	Digito de chequeo del AF que realizará la TTV.	9
Código Depositante Directo Vendedor DECEVAL	Código DECEVAL del AF que realizará la TTV.	999999
Fecha Cumplimiento Operación TTV	Fecha de la operación TTV. Formato:<AAAAMMDD> AAAA= Año cumplimiento de la operación MM= Mes cumplimiento de la operación DD= Día cumplimiento de la operación	20140219
Fecha Vencimiento TTV	Fecha de la operación de devolución de la TTV. Formato:<AAAAMMDD> AAAA= Año vencimiento de la operación MM= Mes vencimiento de la operación DD= Día vencimiento de la operación	20140219
Vr TTV Solicitado	Corresponde al valor en pesos de la operación TTV a realizar. Debe ser menor o igual al cupo asignado.	9999999999000.00

2.1.2 INFORMACION DE CUENTAS <datos de cuentas empleadas>

2.1.2.1 Descripción

Corresponde a los datos básicos del titular y de las cuentas desde donde se transferirán los títulos en DECEVAL. Debe diligenciarse para cada título/ISIN a transferir.



2.1.2.2 Estructura

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Número Cuenta Inversionista DECEVAL	Número de cuenta DECEVAL del AF que solicita el trámite de la TTV.	999999
Tipo Documento Identificación Titular (2)	Tipo de documento asociado al número de documento de identificación del AF titular de la cuenta en DECEVAL CC - CEDULA DE CIUDADANIA CE - CEDULA DE EXTRANJERIA NIP - NUMERO DE IDENTIFICACION PERSONAL NIT - NUMERO DE IDENTIFICACION TRIBUTARIA TI - TARJETA DE IDENTIDAD PAP - PASAPORTE	CC
Numero Documento Identificación Titular (1)	Número de Identificación del AF asociado a la operación a realizar.	999999999999
Digito de Chequeo	Digito de chequeo del Número de Identificación del Titular	9

2.1.3 INFORMACION DE LOS TÍTULOS <datos de los títulos a transferir>

2.1.3.1 Descripción

Corresponde a los datos básicos referentes a los títulos a transferir en la operación. Debe diligenciarse un renglón por cada título de deuda privada a ser transferido en la TTV.



2.1.3.2 Estructura

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Código ISIN	Corresponde al acrónimo del título a transferir en la operación.	AAAAAAAAAAAAAAAA
Indicador de comportamiento de la Tasa (3)	Campo identificador del tipo de tasa presente en el título: 1 : Fija 2 : Variable Simple 3 : Variable Compuesta 8 : Acciones 9 : Sin Rendimientos	1
Valor Nominal (Saldo)	Corresponde al valor nominal del título. (Se debe informar en la moneda original, en caso de ser en UVR se enviará la cantidad de UVRs y no el valor en pesos).	99999999.9999
Base de Liquidación del Título	Corresponde a la base de liquidación; es la forma como se cuentan los días para el cálculo de la rentabilidad financiera del título, el cual puede ser: 1: 360 (Comercial). 2: 365 (Calendario). 3 : Real/Real	999



2.2 REPOS BR CON DEUDA PRIVADA

De conformidad con lo estipulado en la Circular Reglamentaria Externa DODM – 142, Asunto 4: Control de Riesgo para las Operaciones de Expansión y Contracción Monetaria, se podrán realizar operaciones de expansión transitoria con bonos ordinarios, certificados de depósito a término, papeles comerciales y títulos provenientes de titularizaciones de cartera hipotecaria, entre otros, siempre y cuando se encuentren desmaterializados en un depósito centralizado de valores, entre otras condiciones.

Por su parte, la CRE DODM-148, Asunto 10: Procedimientos para las Operaciones de Expansión y Contracción Monetaria, establece que el cumplimiento de las ofertas de las operaciones Repo de contracción monetaria será mediante la transferencia completa de los títulos admisibles antes de las 4:00 p.m.

Adicionalmente, se estableció que el ACO al que se le haya aprobado la realización de un Repo Banco de la República con deuda privada depositada en DECEVAL, deberá iniciar el cumplimiento de la oferta aprobada mediante el envío de un correo electrónico cifrado con las siguientes características:

- Dirigido a la cuenta ServicioalclienteDFV@banrep.gov.co con copia a DFVContingencia@banrep.gov.co.
- Cifrado con la herramienta SUCED, o la que en un futuro la sustituya.
- El asunto del correo deberá indicar “Cumplimiento Oferta NNN-Nombre del ACO” donde NNN será el número de la oferta aprobada.
- Así mismo, deberá anexar un archivo sobre los títulos a transferir en la operación Repo a favor del BR en DECEVAL con los campos y formatos señalados en el numeral 2.2.1 del presente documento.

Adicionalmente, el archivo debe conservar las características del modelo que está publicado en la página Web del Banco de la República, debido a que éste contempla varias hojas que aunque no son diligenciadas por el agente sí se actualizan con la información que se incluye en la hoja con nombre “Cumplimiento” y que son necesarias para procesar la operación. También en la página www.banrep.gov.co / Sistemas de Pago / Depósito Central de Valores / Trámites y Servicios / Trámites, se encuentra el link “Estructura Excel para repos BR con DP” donde está publicado el formato Excel que debe ser diligenciado en este tipo de operación.



2.2.1 INFORMACION DE LA OPERACION REPO <datos principales>

2.2.1.1 Descripción

Corresponde a la información básica de la oferta a cumplir. Debe digitarse una sola vez en el archivo.

2.2.1.2 Estructura

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Número Oferta Cumplir BRC	Corresponde a la oferta aprobada por el BRC-OMAS y que se desea cumplir con este archivo.	9999
NIT Intermediario (1)	Número de identificación del ACO asociado a la operación a realizar. Sin dígito de chequeo	999999999999
Digito de Chequeo Intermediario	Digito de chequeo del NIT del ACO al que se le aprobó la oferta.	9
Código Depositante Directo Vendedor DECEVAL	Código DECEVAL del ACO.	999999
Fecha Cumplimiento Operación Repo	Fecha de la operación Repo. Formato:<AAAAMMDD> : AAAA= Año cumplimiento de la operación MM= Mes cumplimiento de la operación DD= Día cumplimiento de la operación	20140219
Fecha Vencimiento Repo	Fecha de la retrocesión de la operación Repo. Formato:<AAAAMMDD> AAAA= Año vencimiento de la operación MM= Mes vencimiento de la operación DD= Día vencimiento de la operación	200140219
Vr Repo Solicitado	Corresponde al valor en pesos de la operación Repo aprobada por BRC OMAS.	999999999999000.00



2.2.2 **INFORMACION DE CUENTAS** <datos de cuentas empleadas>

2.2.2.1 *Descripción*

Corresponde a los datos básicos del titular y de las cuentas desde donde se transferirán los títulos en DECEVAL. Debe diligenciarse para cada título/ISIN a transferir.

2.2.2.2 *Estructura*

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Número Cuenta Inversionista DECEVAL	Número de la Cuenta DECEVAL del ACO que solicita el trámite del Repo.	999999
Tipo Documento Identificación Titular (2)	Tipo de documento del titular de la cuenta en DECEVAL. Se puede seleccionar entre: CC - Cédula de Ciudadanía CE - Cédula de Extranjería NIP - Número de identificación personal NIT - Número De Identificación Tributaria TI - Tarjeta de Identidad PAP - Pasaporte	NIT
Numero Documento Identificación Titular (1)	Número de Identificación del ACO que realiza la operación.	999999999999
Digito de Chequeo	Digito de chequeo de la Identificación del ACO que realiza la operación.	9

2.2.3 **INFORMACION DE LOS TÍTULOS** <datos de los títulos a transferir >

2.2.3.1 *Descripción*

Corresponde a los datos básicos referentes a los títulos a transferir en la operación. Debe diligenciarse un renglón por cada título de deuda privada a ser transferido en la operación REPO.



2.2.3.2 Estructura

NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCION DEL CAMPO	EJEMPLO
Código ISIN	Corresponde al ISIN (International Securities Identification Numbering system) del título a transferir en la operación.	AAAAAAAAAAAAAAAA
Indicador de comportamiento de la Tasa (3)	Campo identificador del tipo de tasa presente en el título. Se puede seleccionar entre: 1 : Fija 2 : Variable Simple 3 : Variable Compuesta 9 : Sin Rendimientos	Fija
Valor nominal (saldo)	Corresponde al valor nominal del título. (Se debe informar en la moneda original, en caso de ser en UVR se enviará la cantidad de UVRs y no el valor en pesos).	99999999999000,00
Base de Liquidación del Título (4)	Corresponde a la base de liquidación; es la forma como se cuentan los días para el cálculo de la rentabilidad financiera del título; se puede seleccionar entre: 1: 360 (Comercial) 2: 365 (Calendario) 3 : Real/Real	360 (Comercial)