



BOLETÍN

No. **51**
Fecha 29 de Noviembre de 2016
Páginas 15

Página

CONTENIDO

Circular Reglamentaria Externa DODM-141, del 29 de Noviembre de 2016 Asunto 3: Condiciones para la Liquidación de las Operaciones de Mercado Abierto y de las Operaciones de Liquidez para el normal funcionamiento del Sistema de Pagos.	1
Circular Reglamentaria Externa DEFI-354, del 29 de Noviembre de 2016 Asunto 2: Control de Riesgo en las Operaciones de Mercado Abierto y en las Operaciones de Liquidez para el normal funcionamiento del Sistema de Pagos	4



MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE OPERACIONES Y
DESARROLLO DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM -141

Hoja 3-00

Fecha: 29 NOV. 2016


Destinatario: Oficina Principal y Sucursales del Banco de la República, Superintendencia Financiera de Colombia, Ministerio de Hacienda y Crédito Público, Agentes Colocadores OMA, Fogafin, Findeter y Finagro.

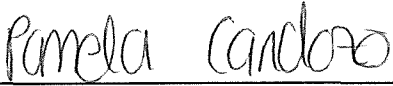
ASUNTO: 3: CONDICIONES PARA LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y DE LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

La presente Circular modifica a partir del 1o. de diciembre de 2016 las Hojas 3-1 del 27 de abril de 2015 y 3-3 del 3 de mayo de 2016, de la Circular Reglamentaria Externa DODM – 141 correspondiente al Asunto 3: “CONDICIONES PARA LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y DE LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS” del Manual Corporativo del Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados.

Las modificaciones se realizan con el fin de ajustar los *haircuts* aplicables a los títulos admisibles para las operaciones de mercado abierto con menos de 30 observaciones de precios (una por día hábil).

Cordialmente,


HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico


PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Inversiones
Internacionales



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO: 3: CONDICIONES PARA LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y DE LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

1. ORIGEN Y OBJETIVOS

El objetivo de esta circular es reglamentar las condiciones en las que se liquidarán las Operaciones de Mercado Abierto –OMA- (expansión y contracción, transitoria y definitiva) y las operaciones de liquidez para el normal funcionamiento del sistema de pagos (repo intradía -RI- y repo overnight por compensación -ROC-) realizadas por el Banco de la República (BR), autorizadas por la Resolución Externa No. 2 de 2015 de la Junta Directiva del Banco de la República y las que la modifiquen, adicionen o complementen. Los parámetros de valoración de títulos a precios de mercado seguidos en esta circular, son en general aquellos estipulados por la Superintendencia Financiera de Colombia contenidos en el Capítulo I de la Circular Básica Contable y Financiera de agosto de 2002 y las que la modifiquen o adicionen.

2. CONDICIONES PARA LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

El BR recibirá los títulos para sus operaciones por el Valor total de los Títulos (VT), que se define en la presente circular. El VT debe ser igual o superior al valor del monto adjudicado más los intereses que se causarán durante el plazo de la operación. No se admitirán títulos que venzan durante el plazo de la respectiva operación.

Tratándose de títulos admisibles depositados en el Depósito Central de Valores (DCV), el orden en que el BR seleccionará los títulos será el siguiente:

1. TES Clase B (tomando primero los completos)
2. Títulos de Desarrollo Agropecuario (TDA) Clase A
3. Títulos de Desarrollo Agropecuario (TDA) Clase B
4. Bonos para la Seguridad

En los casos en que el Agente Colocador de OMAs (ACO) o el custodio dispongan de más de un título valor de una misma clase, el DCV seleccionará primero los más próximos al vencimiento.

El VT del título se establece a partir de su Precio Sucio en Pesos (PSP) y de su *haircut* como se señala a continuación.

HWH

PC



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO: 3: CONDICIONES PARA LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y DE LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

2.2 HAIRCUTS

El *haircut* es un descuento que se le aplica al valor de mercado del título, para proteger a quien reciba dicho título en una operación a plazo, del riesgo de mercado y de liquidez, estimado para la vigencia de la operación. Para el caso en el cual los PPV no publiquen los precios de los títulos a ser utilizados en las OMA, o la información para el cálculo de éstos antes de la hora de cierre de la primera subasta, los *haircuts* de las operaciones se tomarán con un día más de plazo. Para el caso de las operaciones de liquidez para el normal funcionamiento del sistema de pagos, si el PPV no publica los precios de los títulos, estos no podrán utilizarse en estas operaciones.

Los *haircuts* se podrán definir para categorías de títulos de forma general o para cada emisión, de acuerdo a lo establecido en los siguientes numerales. En el Anexo 1 de la presente circular se encuentra la metodología utilizada para el cálculo de los *haircuts* y el valor descontado de los títulos. Los *haircuts* serán calculados mensualmente por el DCV y se publicarán en la página Web del Banco de la República www.banrep.gov.co, en la ruta de acceso, Sistemas de Pago / Depósito Central de Valores / Información. Adicionalmente, los *haircuts* podrán consultarse directamente a través del DCV. El BR podrá modificar los *haircuts* en cualquier momento.

2.2.1 Títulos TES clase B y Títulos emitidos por el Banco de la República:

El *haircut* será calculado para cada emisión en función de la volatilidad reciente del precio en pesos y liquidez del título en cuestión. Los *haircut* para las OMA con los títulos de este numeral se calcularán para un plazo de un día de acuerdo con lo establecido en el Anexo 1 y se aplicará lo contemplado en el numeral 3 de la presente circular. En el caso de los títulos que cuenten con menos de 30 observaciones de precio (una por día hábil), se emplearán *haircuts* determinados para títulos con similares características financieras, incluyendo una prima de 50 puntos básicos.

2.2.2 TES de corto plazo

Estos títulos comprenden los TES clase B con plazo igual o inferior a un año.

En estos casos se debe tomar el *haircut* del TES tasa fija pesos completo, más cercano en días al vencimiento, calculado para un plazo de un día. En el caso de títulos con menos de 30 observaciones de precio (una por día hábil), al *haircut* mencionado se adicionará una prima de 50 puntos básicos. Adicionalmente, se aplicará lo contemplado en el numeral 3 de la presente circular.

2.2.3 Cupones de intereses y Principales de los TES tasa fija en pesos:

Para el *haircut* aplicable a estos cupones y principales, se debe tomar el mismo *haircut* calculado para el título completo a un día y estarán sujetos a lo contemplado en el numeral 3 de la presente circular.

MH

RC



MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE ESTABILIDAD FINANCIERA Hoja 2 - 00

CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DEFI – 354

Fecha: 29 NOV. 2016

Destinatario:

Oficina Principal y Sucursales del Banco de la República, Superintendencia Financiera de Colombia, Bolsa de Valores de Colombia, Establecimientos Bancarios, Corporaciones Financieras, Compañías de Financiamiento, Cooperativas Financieras, Sociedades Comisionistas de Bolsa, Sociedades Fiduciarias, Sociedades Administradoras de Inversión, Sociedades Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Sociedades Aseguradoras, Sociedades de Capitalización, Sociedades de Intermediación Cambiaria y de Servicios Financieros Especiales, Cámaras de Riesgo Central de Contraparte, Financiera de Desarrollo Nacional, Fondo Nacional del Ahorro, FOGAFIN, FINAGRO, FINDETER, ICETEX, FONADE, BANCOLEX.

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

La presente Circular reemplaza, a partir del 1o. de diciembre, las Hojas 2-2 del 29 de julio de 2016, 2-3 del 3 de mayo de 2016, 2-7 del 29 de marzo de 2016, 2-8 del 26 de agosto de 2015, 2-17 del 29 de julio de 2016, 2-23 del 3 de mayo de 2016, 2-A1-1, 2-A1-2 del 29 de julio de 2016, 2-A1-3 del 3 de julio de 2015, 2-A3-7 del 29 de julio de 2016 e incluye la Hoja 2-24 de la Circular Reglamentaria Externa DEFI-354 correspondiente al Asunto 2: **“CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS”** del Manual Corporativo del Departamento de Estabilidad Financiera.

Las modificaciones se realizan con el fin de:

- i) Ajustar las condiciones de los títulos admisibles para las operaciones de mercado abierto cuando tengan menos de 30 días de colocados en el mercado, y
- ii) Realizar cambios de carácter operativo.

HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico

PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente
Monetario y de Inversiones Internacionales



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

Las operaciones de contracción transitoria por depósitos se entienden como las operaciones realizadas por ventanilla y por depósitos de dinero a plazo remunerados.

Las SCB autorizadas como ACO que sean designadas como participantes del Programa de Creadores de Mercado para Títulos de Deuda Pública (creadores o aspirantes) –SCBCM- podrán realizar operaciones de expansión transitoria a partir de dicha designación.

Las SCBCM que dejen de participar en el Programa de Creadores de Mercado para Títulos de Deuda Pública, en forma temporal o definitiva, por cualquiera de las causales señaladas en las normas correspondientes, podrán realizar las operaciones de expansión definitiva, contracción transitoria y definitiva y operaciones RI. Las SCBCM podrán realizar nuevamente operaciones de expansión transitoria cuando acrediten el restablecimiento de su calidad de participante en el mencionado programa.

Los ACO que realicen operaciones RI se registrarán por lo dispuesto en la Circular Reglamentaria Externa DFV-120 correspondiente al Asunto 61: Repo Intradía del Departamento de Fiduciaria y Valores, y los que realicen operaciones ROC se registrarán por lo dispuesto en la Circular Reglamentaria Externa DSP-36 correspondiente al Asunto 3: Repo Overnight por Compensación del Departamento de Sistemas de Pago.

El cumplimiento de las operaciones de expansión transitoria y repo intradía (transferencia de los títulos y del dinero) podrá llevarse a cabo directamente por el ACO autorizado o por su custodio.

En todas las operaciones que realicen los ACO la responsabilidad legal del cumplimiento de las obligaciones y el ejercicio de los derechos corresponde a la entidad autorizada como ACO.

3. TÍTULOS ADMISIBLES PARA OPERACIONES DE EXPANSIÓN Y CONTRACCIÓN Y PARA LA CONSTITUCIÓN DE GARANTÍAS REQUERIDAS POR EL DEPÓSITO CENTRAL DE VALORES (DCV)

Las operaciones de mercado abierto se efectuarán mediante la compra y venta de los títulos valores que el BR considere admisibles, de acuerdo con la Resolución 2/2015.

3.1 OPERACIONES DE EXPANSIÓN Y CONTRACCIÓN TRANSITORIA

3.1.1 Las operaciones de expansión y contracción transitoria se podrán realizar mediante la celebración de contratos de reporto (repo) con Bonos para la Seguridad, Títulos de Desarrollo Agropecuario (TDA), TES Clase B, Títulos de Deuda Externa de la Nación, Títulos emitidos por FOGAFIN y Títulos emitidos por el BR.

Las operaciones de expansión transitoria podrán ser celebradas con estos títulos siempre y cuando hayan transcurrido como mínimo 30 días desde la primera colocación de su emisión. Esta restricción no aplica para las operaciones realizadas con títulos emitidos por el BR y TES Clase B emitidos con plazo igual o inferior a un año.

HCH

PC



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

3.1.2 Adicionalmente se podrán realizar operaciones de expansión transitoria con bonos ordinarios, Certificados de Depósito a Término -CDT-, papeles comerciales, títulos provenientes de titularizaciones de cartera hipotecaria (incluyendo leasing habitacional) y títulos de deuda pública diferentes a los enunciados en el numeral 3.1.1, siempre y cuando haya transcurrido como mínimo un mes desde la primera colocación de su emisión, se encuentren desmaterializados en un depósito centralizado de valores y estén calificados por las sociedades calificadoras de valores conforme se describe a continuación:

Sociedad calificadora de valores	BRC Investor Services (Bankwatch)	Fitch Ratings (Duff and Phelps)	Value Risk Rating
Títulos de corto plazo	BRC1 BRC2	F1 F2	VR1 VR2
Títulos de largo plazo	AAA AA A	AAA AA A	AAA AA A

En ningún caso se considerarán admisibles para la realización de las operaciones, los títulos emitidos con ocasión del otorgamiento de cartera de créditos u operaciones de leasing financiero.

También podrán realizarse operaciones de expansión transitoria con títulos de renta fija en moneda extranjera, provenientes de deuda soberana *senior* emitida por gobiernos y bancos centrales, que cumplan con las siguientes condiciones:

- Estar calificado por al menos dos de las siguientes calificadoras: S&P, Moody's o Fitch Ratings. La calificación mínima asignada debe ser de A-.
- Los títulos deben ser denominados en: dólar americano, euro, yen, corona noruega, corona sueca, dólar australiano, dólar neozelandés, franco suizo, libra esterlina o dólar canadiense.
- Los títulos deben estar depositados, en el momento de la presentación de la oferta, en la cuenta que el Banco de la República designe.

3.1.3 Las garantías que sean requeridas por la funcionalidad para el manejo de garantías del DCV para las operaciones de reporto (repo), podrán constituirse con los títulos depositados en el DCV que sean admisibles para las operaciones de expansión monetaria transitoria y/o en efectivo en moneda legal colombiana.

3.2 OPERACIONES DE EXPANSIÓN Y CONTRACCIÓN DEFINITIVA

Las operaciones de expansión y contracción definitiva se podrán realizar mediante la compra o venta en firme, de contado o a futuro de TDA, TES Clase B, Títulos de Deuda Externa de la Nación y Títulos emitidos por el BR.

Las operaciones de expansión definitiva podrán ser celebradas con estos títulos siempre y cuando hayan transcurrido como mínimo 30 días desde la primera colocación de su emisión. Esta restricción no aplica para las operaciones realizadas con títulos emitidos por el BR.

PC

HJH



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS**5. REQUISITOS DE INGRESO DE LOS ACO**

La entidad que solicite autorización para actuar como ACO deberá cumplir con los requisitos de carácter general y particular, de acuerdo con la clase de entidad que se indica en el presente numeral.

Para acreditar el cumplimiento de tales requisitos, el representante legal de la entidad deberá diligenciar el Formato No. 3 del Anexo No.3 correspondiente a la composición accionaria, disponible en la Web del BR www.banrep.org en la Sección Normatividad, Monetaria, Expansión y Contracción Monetaria, Asunto 2 y conformará un archivo en pdf con los demás requisitos contemplados en el numeral 5.1, cada archivo con su respectiva firma digital de representación de empresa conforme a lo establecido en el Anexo No.1 de esta circular.

De otra parte, el revisor fiscal deberá diligenciar la información que corresponda del numeral 5.1 en un archivo en pdf con su firma digital de profesional titulado. Por último, el representante legal enviará toda la información en un archivo comprimido con extensión **.zip**. Estos documentos deberán remitirse al correo corporativo DODM_ACO@banrep.gov.co conforme a lo establecido en el Anexo No.1 de esta circular.

5.1 REQUISITOS GENERALES

Para actuar como ACO la entidad interesada deberá enviar por correo electrónico una carta suscrita por su representante legal, dirigida a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales, especificando que:

- i. Acepta la afiliación (o está afiliado) al servicio electrónico de transacciones del BR, SEBRA, o al que lo sustituya.
- ii. Está vinculado como depositante directo al Depósito Central de Valores (DCV), acorde con lo dispuesto en la Circular Reglamentaria Externa DFV-56 correspondiente al Asunto 98: Depósito Central de Valores – DCV.
- iii. Se compromete a realizar el trámite de acceso al sistema de información NOVA contenido en el sistema de transferencia de archivos del BR.
- iv. Se compromete a realizar el trámite para obtener el token OMA de contingencia ante el BR. Bajo contingencia, sin el token OMA no podrá participar en las operaciones autorizadas.
- v. Conoce y acepta la grabación telefónica de las operaciones de negociación y de las conversaciones sostenidas con la Sección de Apoyos de Liquidez y Control de Riesgos.
- vi. Autoriza al BR para que solicite y utilice cualquier información sobre la entidad en los siguientes términos: “Autorizo al Banco de la República para que, cuando así lo requiera, en los términos del artículo 18 de la Ley 31 de 1992 pueda solicitar a la Superintendencia Financiera de Colombia cualquier información sobre esta entidad, incluyendo la relacionada con las visitas de inspección que efectúe dicho organismo. Adicionalmente, autorizo al Banco de la República para utilizar dicha información y la demás que le sea suministrada por otras entidades públicas o directamente por esta entidad para efectos de las operaciones de mercado abierto y de las operaciones de liquidez para el normal funcionamiento del sistema de pagos, conforme a la Resolución Externa No.2 de 2015 de la Junta Directiva del Banco de la República, la Circular

HCH

PC



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

Reglamentaria Externa DEFI-354 y demás normatividad relacionada con tales operaciones y, en general, con las operaciones y funciones del Banco de la República, en concordancia con el régimen de protección de datos personales (Ley 1266 de 2008, Ley 1581 de 2012, Decreto 1074 de 2015 y demás normas que los modifiquen, adicionen o complementen).”

- vii. Declara que al solicitar su ingreso como ACO y al realizar las operaciones con el BR conoce y acepta la totalidad de las obligaciones y condiciones de las operaciones a que se refiere la Resolución 2/2015 y sus Circulares Reglamentarias DODM-141 correspondiente al Asunto 3, DEFI-354 correspondiente al Asunto 2, DODM-148 correspondiente al Asunto 10, DFV-120 correspondiente al Asunto 61 y DSP-36 correspondiente al Asunto 3, y sus modificaciones.

A la carta de solicitud deberá anexarse:

- a. Copia del acta de la junta directiva de la entidad en la cual conste la aprobación a la entidad para actuar como ACO, firmada por el (la) Presidente y/o Secretario (a) de la Junta Directiva, según corresponda.
- b. El último reporte de la información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión con periodicidad mensual que ha debido ser transmitido a la SFC. Esta información financiera deberá estar firmada por el revisor fiscal o acompañarse con una certificación del revisor fiscal en la que se acredite que la misma está basada en los libros de contabilidad, que corresponden a la transmitida a la SFC y que la entidad se encuentra desarrollando su objeto social.

Para los casos de procesos de reorganización institucional, en los términos del artículo 23 de la Resolución 6/01, tal obligación se surtirá al presentar la información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión Consolidada con la cual se formalizó el proceso de reorganización institucional, aprobada por la SFC y certificada por el revisor fiscal y el representante legal de la entidad.

Quedan exceptuadas de estos requisitos las entidades del Grupo C, señaladas en el numeral 2 de la presente circular.

- c. Relación actualizada de accionistas o asociados con participación superior al 1% en el capital de la entidad. Esta relación deberá diligenciarse en el formato correspondiente, el cual incluirá nombre completo, identificación y participación de cada accionista o asociado, y estará firmado digitalmente por el representante legal.
- d. Certificado de existencia y representación legal de la SFC, con fecha de expedición inferior a un mes.
- e. Certificado de constitución y gerencia expedido por la Cámara de Comercio, con fecha de expedición inferior a un mes, que incluya la inscripción del nombramiento del revisor fiscal y NIT de la entidad. En aquellos casos en que el revisor fiscal actual no figure aún en el certificado deberá enviar carta de posesión expedida por la SFC y extracto de acta de asamblea donde conste el respectivo nombramiento.
- f. Correos electrónicos, teléfonos y fax de los funcionarios autorizados para transmitir y recibir información relacionada con los ACO.
- g. El cumplimiento de los requisitos señalados en el numeral 5.2.

HWH

R



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

- c) Para el envío de la información, los formatos y anexos deberán estar firmados por el representante legal y el revisor fiscal, atendiendo los pasos descritos en los anexos de esta circular.
- d) La información trimestral debe corresponder al corte de marzo, junio, septiembre y diciembre de la información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión con periodicidad mensual. La información trimestral deberá ser enviada dentro de los 10 días hábiles siguientes al vencimiento del plazo de su transmisión a la SFC, en el horario establecido para el portal de acceso a W-Sebra, o al que lo sustituya. Tratándose del último día del plazo de envío, dicha información deberá ser transmitida al BR hasta las 12 p.m. Si el BR solicita ajustes, éstos deberán enviarse antes de las 3:00 p.m. de ese día.

Los ACO que sean EC, independientemente de que consoliden o no, deberán enviar la certificación de la información trimestral de la relación mínima de solvencia consolidada dentro de los 10 días hábiles siguientes al vencimiento del plazo de transmisión a la SFC de la información financiera consolidada, de acuerdo con los formatos establecidos por el BR para el efecto. Esta certificación deberá ser firmada digitalmente y enviada a través del correo corporativo DODM_ACO@banrep.gov.co. Tratándose del último día del plazo de envío, dicha información deberá ser transmitida al BR hasta las 12 p.m. Si el BR solicita ajustes, éstos deberán enviarse antes de las 3:00 p.m. de ese día.

Cuando el ACO no cumpla con el envío de la información trimestral dentro de los plazos antes indicados, este será suspendido de manera automática para realizar las operaciones autorizadas a partir del día hábil siguiente a dicho incumplimiento. El ACO que se encuentre suspendido podrá enviar la información trimestral en cualquier momento hasta las 12 p.m. Si el BR solicita ajustes, éstos podrán enviarse hasta las 3:00 p.m. de ese día. Una vez recibida la información en debida forma, el ACO será reactivado de manera automática a partir del día hábil siguiente.

El plazo máximo y el procedimiento de envío de la información se publicarán en la web del BR, en la cartelera electrónica ACO en W-Sebra y/o en los medios que el BR considere pertinentes.

- e) Cuando la SFC extienda al ACO el plazo de transmisión de la información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión con periodicidad mensual, éste deberá enviar al BR una comunicación expedida por la SFC hasta la fecha límite de cumplimiento trimestral. En este caso, los 10 días hábiles se contarán a partir del nuevo plazo fijado por la SFC.
- f) Únicamente para los casos en que se presenten fallas que no permitan la correcta funcionalidad del esquema descrito, el ACO, previa autorización del BR, podrá utilizar cualquiera de los mecanismos de contingencia descritos a continuación, dentro de los plazos establecidos en esta circular, en el siguiente orden de preferencia: i) enviar los documentos al correo corporativo DODM_ACO@banrep.gov.co en los formatos y anexos descritos y firmados digitalmente, o ii) radicar la documentación física en el BR.

HV H

PC



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

El pago de las sanciones pecuniarias establecidas en este numeral se debitará de la cuenta de depósito en pesos del ACO en el BR y cuando no cumpla con el pago de las mismas será suspendido para realizar operaciones de mercado abierto y repo intradía. Dicha suspensión se aplicará a más tardar a partir del día hábil siguiente al conocimiento del hecho y hasta el pago de la obligación. Así mismo se adicionará el número de días en mora al cálculo inicial de la sanción pecuniaria. Si después de 30 días calendario en mora no cumple con el pago de esta obligación, la entidad perderá su condición de ACO. La entidad podrá recuperar esta condición cuando presente una nueva solicitud y el BR autorice su ingreso.

9. POLÍTICA DE TRATAMIENTO DE DATOS PERSONALES

En cumplimiento del régimen de protección de datos personales (Ley 1266 de 2008, Ley 1581 de 2012, Decreto 1074 de 2015 y demás normas que los modifiquen, complementen o sustituyan), el BR informa su política sobre el tratamiento de los datos personales suministrados por los ACO en el curso de las operaciones para regular la liquidez de la economía y para facilitar el normal funcionamiento del sistema de pagos, conforme a los procedimientos previstos en la presente Circular.

Datos Generales - Responsable: Banco de la República, NIT No.8600052167, Oficina Principal: Bogotá D.C. Contacto: A través del Sistema de Atención al Ciudadano (SAC): puntos de atención presencial, Centro de atención telefónica (Línea gratuita nacional: 01 8000 911745), atención vía web. Para mayor información, consulte la página Web del BR <http://www.banrep.gov.co/atencion-ciudadano> en la sección "Sistema de Atención al Ciudadano (SAC)".

Finalidad del tratamiento: Los datos así suministrados al BR serán objeto de tratamiento (recolección, almacenamiento, uso, circulación o supresión) con la finalidad de cumplir adecuadamente con las operaciones para regular la liquidez de la economía y para facilitar el normal funcionamiento del sistema de pagos, los procedimientos y servicios previstos en la presente Circular, incluyendo la construcción de indicadores y estadísticas para el seguimiento y control de dichos procesos, servicios y trámites y, en todo caso, para dar cumplimiento a sus demás funciones constitucionales y legales.

El BR está comprometido con la seguridad y protección de los datos personales de que es responsable, y sus sistemas de gestión para manejo de información cuentan con las certificaciones vigentes ISO 9001 e ISO/IEC 27001, ésta última referida a la seguridad de la información. De esta manera, buena parte de las políticas y estándares del sistema de gestión de la información de la entidad están enfocadas a proteger la confidencialidad de la información; por ello, dispositivos de control de acceso y/o autenticación a la red, software para manejar niveles de autorización, monitorear la actividad en los sistemas y registro de estas actividades, son algunos de los mecanismos que soportan estas políticas y estándares. La conservación de los documentos e información se efectúa en cumplimiento y dentro de los términos señalados en el artículo 55 de la Ley 31 de 1992.

HH

R



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

Ejercicio de los derechos de los titulares de los datos personales: El suministro, actualización, modificación o corrección de información, regulados en la presente Circular se seguirán conforme a los procedimientos especiales regulados para el efecto en la misma. Respecto a otro tipo de información personal propia del ejercicio del derecho de Habeas Data, los titulares de los datos personales, podrán acceder, conocer, actualizar y rectificar dichos datos; ser informados sobre el uso dado a los mismos; presentar consultas y reclamos sobre el manejo de dichos datos; revocar la autorización o solicitar la supresión de sus datos, en los casos en que sea procedente, y los demás derechos que le confiere la Ley. Para ejercer tales derechos podrá emplear los mecanismos de contacto antes mencionados. Los procedimientos y términos para la atención de consultas, reclamos y demás peticiones referidas al ejercicio del derecho de Habeas Data seguirán lo dispuesto en la Ley 1266 de 2008 y los principios sobre protección de datos contemplados en la Ley 1581 de 2012.

Políticas o lineamientos generales de tratamiento de los datos personales: Puede consultarse en la página web del BR <http://www.banrep.gov.co/proteccion-datos-personales> en la sección “Protección de Datos Personales – Habeas Data”.

10. ANEXOS

Hacen parte de esta circular la descripción de los formatos y anexos, el instructivo para su diligenciamiento y la nomenclatura de los archivos para reportar electrónicamente al BR los requisitos de mantenimiento a que hace referencia el numeral 6 de esta circular, según se relaciona en los siguientes anexos:

- Anexo No.1 Descripción e instructivo de diligenciamiento de los formatos y anexos.
- Anexo No.2 Nomenclatura para la generación de archivos.
- Anexo No.3 Modelo de formatos.

(ESPACIO DISPONIBLE)

HVH

PC



ANEXO No.1

Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

DESCRIPCION E INSTRUCTIVO DE DILIGENCIAMIENTO DE LOS FORMATOS Y ANEXOS

1 DESCRIPCIÓN

Cada formato de Excel que requiera ser enviado al BR deberá ser firmado con un certificado de firma digital emitido por una entidad autorizada por la Superintendencia de Industria y Comercio, que garantice, entre otros, la autenticidad, integridad y no repudio de la información transmitida, conforme a lo establecido en la Ley 527 de 1999, el Decreto Reglamentario 1747 de 2000 y la Circular Única 10 de la Superintendencia de Industria y Comercio.

La solicitud del certificado de firma digital la deberá tramitar, como requisito indispensable, el representante legal y el revisor fiscal del ACO ante una entidad de certificación digital autorizada. El representante legal deberá solicitar el Certificado de Representación de Empresa, y el revisor fiscal el Certificado de Profesional Titulado.

El ACO enviará por el sistema de transferencia de archivos del BR la información requerida diligenciando los formatos de Excel (versión 97-2003 – extensión .xls) y los anexos en PDF descritos a continuación, dentro de los plazos establecidos en esta circular.

Formato No.1 “Certificación para establecimientos de crédito” con firma digital del representante legal.

Formato No.2 “Certificación para establecimientos de crédito” con firma digital del revisor fiscal;

Formato No.3 “Relación actualizada de accionistas o asociados”, con firma digital del representante legal;

Formato No.4 “Certificación para SCBCM, SCB, SF, SAI y SAPC”, con firma digital del representante legal;

Formato No.5 “Certificación para SCBCM, SCB, SF, SAI y SAPC”, con firma digital del revisor fiscal;

Formato No.6 “Certificación para CRCC”, con firma digital del representante legal;

Formato No.7 “Certificación para CRCC”, con firma digital del revisor fiscal;

Formato No.8 “Certificación de la relación mínima de solvencia consolidada para EC”, con firma digital del representante legal;

Formato No.9 “Certificación de la relación mínima de solvencia consolidada para EC”, con firma digital del revisor fiscal;

Anexo No. 1 “Certificado de constitución y gerencia expedido por la Cámara de Comercio”, o en su defecto, carta de posesión expedida por la SFC y extracto de acta de asamblea donde conste el respectivo nombramiento;

Anexo No.2 “Certificado de existencia y representación legal expedido por la SFC”;

Anexo No.3 “Plan de ajuste con la SFC”, en caso de incumplimiento del numeral 5.2.1.

HHH

R



Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

2. INSTRUCTIVO DE DILIGENCIAMIENTO

Los modelos de los formatos se encuentran disponibles en la web del BR www.banrep.org en la Sección Normatividad, Monetaria, Expansión y Contracción Monetaria, Asunto 2.

- a) **Formatos Nos. 1, 2, 4, 5, 6, 7, 8 y 9.** A continuación se describen las características y especificaciones del contenido de los campos sombreados en las plantillas, que son de obligatorio diligenciamiento:

Entidad y Revisoría Fiscal. Los formatos deben ser diligenciados de manera independiente por el representante legal y el revisor fiscal. En los formatos diligenciados por el representante legal (Formatos Nos. 1, 4, 6 y 8) se debe incluir la razón social de la entidad que actúa como ACO. Los diligenciados por el revisor fiscal (Formatos Nos. 2, 5, 7 y 9) deben incluir la razón social de la entidad que actúa como ACO y la razón social de la firma de auditoría a la que pertenece.

Información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión con periodicidad mensual con corte a, o solvencia consolidada con periodicidad trimestral con corte a, según corresponda: Diligenciar en la celda sombreada la fecha correspondiente al trimestre requerido, en formato general, de la siguiente manera: aaaammdd, sin guiones ni paréntesis.

A la fecha de transmisión de la información: En la celda sombreada digitar la fecha de diligenciamiento, en formato general, como sigue: aaaammdd, sin guiones ni paréntesis. La fecha de diligenciamiento deberá estar dentro del límite establecido en esta circular.

Campos (SI – NO) para marcar con “X”: Solo puede escogerse una opción. En el caso de la pregunta correspondiente a la parte de “información financiera del Catálogo Único de Información Financiera con Fines de Supervisión con periodicidad mensual con corte a” o “solvencia consolidada con periodicidad trimestral con corte a”, según corresponda, es necesario justificar el incumplimiento en el campo “Comentarios”, y adjuntar el Anexo No.3. En la parte correspondiente a “la fecha de transmisión de la información”, se deben incluir las observaciones pertinentes en el campo “Comentarios”, cuando sea necesario.

- b) **Formato No.3.** A continuación se describen las características y especificaciones del contenido de los campos sombreados que son de obligatorio diligenciamiento:

Nit ACO. Corresponde al nit de la entidad que actúa como ACO. Debe diligenciarse en formato de número, sin puntos de separación ni dígito de chequeo.

Nombre Entidad – ACO. Corresponde a la razón social de la entidad que actúa como ACO.

NH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DEFI – 354
ANEXO No.1

Hoja 2-A1-3

Fecha: 29 NOV. 2016

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

Identificación accionistas o asociados. Se refiere al número de identificación de cada uno de los accionistas o asociados (personas naturales y/o jurídicas) con participación superior al 1% en el capital de la entidad. Debe diligenciarse sin puntos de separación ni dígito de chequeo.

Nombre de accionistas y asociados: Corresponde al nombre completo de cada uno de los accionistas o asociados (personas naturales y/o jurídicas).

Participación porcentual: El formato de estas celdas se encuentra predefinido como porcentaje, para diligenciarse con dos decimales.

Fecha de diligenciamiento: Se diligencia en el siguiente orden, **aaaammdd**, sin guiones ni paréntesis. La fecha de diligenciamiento deberá estar dentro del límite establecido en esta circular.

c) **Anexos Nos.1, 2 y 3.** Deben guardarse como archivos con extensión **.pdf**.

En todos los casos, los formatos y anexos que apliquen deben enviarse en un archivo comprimido con extensión **.zip**.

HUH

RC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DEFI - 354
ANEXO No.3

Fecha: **29 NOV. 2016**

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS

Formato No.8 "Certificación de la relación mínima de solvencia consolidada para EC", con firma digital del representante legal.

BR-3-875-7

Formato No. 8

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS REQUISITOS DE MANTENIMIENTO PARA ESTABLECIMIENTOS DE CREDITO	
ENTIDAD:	

Circular Reglamentaria Externa DEFI-354	SI	NO	Comentarios
---	----	----	-------------

Solvencia consolidada con periodicidad trimestral con corte a - aaaammdd:

¿De acuerdo con las instrucciones de la SFC, la entidad se encuentra obligada a presentar la relación de solvencia consolidada (básica y total)?			Marque con X la casilla que corresponda. En caso de marcar la opción "SI", diligenciar la siguiente pregunta.
¿La entidad cumple con las normas vigentes sobre el nivel de patrimonio adecuado y la relación mínima de solvencia consolidada (básica y total)?			Valor de la relación de solvencia consolidada básica (%) y total (%).

TRD-31.02.01.007

DEPARTAMENTO DE ESTABILIDAD FINANCIERA 11-2016

Formato No.9 "Certificación de la relación mínima de solvencia consolidada para EC", con firma digital del revisor fiscal.

BR-3-875-8

Formato No. 9

ASUNTO 2: CONTROL DE RIESGO EN LAS OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y EN LAS OPERACIONES DE LIQUIDEZ PARA EL NORMAL FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA DE PAGOS REQUISITOS DE MANTENIMIENTO PARA ESTABLECIMIENTOS DE CREDITO	
ENTIDAD:	
REVISORIA FISCAL:	

Circular Reglamentaria Externa DEFI-354	SI	NO	Comentarios
---	----	----	-------------

Solvencia consolidada con periodicidad trimestral con corte a - aaaammdd:

¿De acuerdo con las instrucciones de la SFC, la entidad se encuentra obligada a presentar la relación de solvencia consolidada (básica y total)?			Marque con X la casilla que corresponda. En caso de marcar la opción "SI", diligenciar la siguiente pregunta.
¿La entidad cumple con las normas vigentes sobre el nivel de patrimonio adecuado y la relación mínima de solvencia consolidada (básica y total)?			Valor de la relación de solvencia consolidada básica (%) y total (%).

TRD-31.02.01.007

DEPARTAMENTO DE ESTABILIDAD FINANCIERA 11-2016

Handwritten initials: HCH

Handwritten initials: PC