



**MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE
OPERACIONES Y DESARROLLO DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA - DODM - 316**

Hoja 18-00

Fecha: **31 AGO. 2017**

Destinatario: Oficina Principal y Sucursales del Banco de la República; Superintendencia Financiera de Colombia; Establecimientos Bancarios; Corporaciones Financieras; Compañías de Financiamiento; Comisionistas de Bolsa; Financiera de Desarrollo Nacional; BANCOLEX; Cámara de Riesgo Central de Contraparte S.A.

ASUNTO 18 CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

La presente circular modifica las hojas 18-1 a 18-5 del 31 de julio de 2015, se elimina la hoja 18-6 del 31 de julio de 2015, y se modifica la totalidad del Anexo 1 de la Circular Reglamentaria Externa DODM-316 correspondiente al Asunto 18: **“CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS”** del Manual del Departamento de Operaciones y Desarrollo de Mercados.

Las modificaciones se realizan para:

1. Permitir a las entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera (SFC) participar como Miembros No Liquidadores de las Cámaras de Riesgo Central de Contraparte (CRCC).
2. Autorizar a las CRCC la compensación y liquidación como contraparte de contratos cross currency swaps y de opciones de tasa de cambio.
3. Eliminar la autorización individual de las características particulares de los contratos de futuros sobre tasa de cambio que se compensan y liquidan a través de las CRCC por parte del Banco de la República.

Cordialmente,


HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico


PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Inversiones
Internacionales

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 316**Fecha: **31 AGO. 2017**

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

OBJETIVO

Esta circular reglamenta la Resolución Externa 12 de 2008 de la Junta Directiva del Banco de la República y demás normas que la modifiquen o adicionen, por la cual se expidieron regulaciones en relación con las Cámaras de Riesgo Central de Contraparte –CRCC–, sus operadores y las operaciones autorizadas sobre divisas.

1. AUTORIZACIÓN

Las CRCC, constituidas y organizadas conforme a lo dispuesto en la Ley 964 de 2005 y en el Decreto 2555 de 2010, y demás disposiciones que las modifiquen, se encuentran autorizadas para efectuar la compensación y liquidación como contraparte de contratos de: i) futuros sobre tasa de cambio, ii) forward sobre tasa de cambio, iii) opciones sobre tasa de cambio, y iv) cross currency swap. Los contratos a que se refiere este numeral corresponden a aquellos estandarizados y no estandarizados.

La actividad de las CRCC en el mercado de divisas estará sujeta al cumplimiento de lo dispuesto en la Resolución Externa 12 de 2008 y las demás normas que la modifiquen o adicionen.

Lo anterior, sin perjuicio de la autorización que deba impartir la Superintendencia Financiera de Colombia (SFC) para efecto de la compensación y liquidación de derivados a través de las CRCC. De la misma manera, las CRCC no podrán realizar las operaciones autorizadas hasta tanto no introduzcan las modificaciones al reglamento, circulares reglamentarias e instructivos a que haya lugar con el fin de adecuar su actividad a lo establecido en la mencionada resolución y en la presente circular.

2. CARACTERISTICAS DE LOS CONTRATOS

Los derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 que se compensen y liquiden por conducto de una CRCC deberán denominarse en divisas, serán de cumplimiento financiero (*non delivery*) y su liquidación se efectuará en moneda legal colombiana.

HUT

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 316**Fecha: **31 AGO. 2017**

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

3. CONTRAPARTES

Las entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia podrán actuar como contrapartes de las CRCC, por cuenta propia o por cuenta de terceros, en las operaciones de derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 y a las normas que la modifiquen o adicionen, conforme a las condiciones y modalidades de acceso y al cumplimiento de los requisitos establecidos para el efecto en el reglamento de funcionamiento de las CRCC.

Los IMC autorizados para realizar operaciones de derivados, de acuerdo con lo previsto en el artículo 59 de la Resolución Externa 8 de 2000, son las únicas entidades facultadas para operar como miembros liquidadores ante las CRCC en las operaciones de derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008.

Las entidades sujetas a vigilancia por la SFC podrán participar como miembros no liquidadores, en las operaciones de derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 y a las normas que la modifiquen o adicionen.

4. SUMINISTRO DE INFORMACIÓN**4.1 Información sobre modificaciones a los Reglamentos, Circulares e Instructivos**

Sin perjuicio de las autorizaciones que deba expedir la SFC en desarrollo de la Ley 964 de 2005 y el Decreto 2555 de 2010, las CRCC por conducto de sus representantes legales deberán informar previamente a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales del Banco de la República los proyectos de modificación al reglamento, así como los proyectos de modificación de las circulares reglamentarias e instructivos relacionados con las políticas de administración de riesgo de la respectiva cámara.

Las políticas de administración de riesgo comprenden los siguientes aspectos: el modelo de gestión de riesgo, el esquema de garantías, la definición de los llamados al margen, el proceso de compensación y liquidación, la asignación de límites de riesgo, la medición del riesgo de operación diaria y de posición abierta, los requisitos de admisión de contrapartes, la admisión y exclusión de contrapartes, la aprobación de agentes de pago o custodios, la aprobación de las reformas al reglamento y la autorización de productos a ser aceptados por las CRCC.

HUA

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 316

Fecha: 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Los ajustes que se introduzcan al nivel de garantías o a los parámetros del modelo que fundamenten el riesgo de operación diaria y posición abierta de los derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008, no requerirán informarse previamente al Banco de la República, siempre y cuando los mismos se efectúen de acuerdo con el modelo de gestión de riesgo presentado al Banco por las CRCC para efectos de la autorización de los mencionados derivados. No obstante, tales ajustes deberán ser informados a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales a más tardar el día hábil siguiente a su adopción. Una vez adoptadas las modificaciones a los reglamentos, circulares e instructivos se deberá informar de tal hecho a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales.

El Banco de la República podrá en cualquier tiempo solicitar las modificaciones que estime pertinentes al reglamento, circulares e instructivos cuando advierta que con su aplicación se afecta el normal funcionamiento del mercado cambiario.

4.2 Información sobre operaciones

Las CRCC deberán transmitir, vía electrónica, al Banco de la República dentro del plazo y de acuerdo con el procedimiento señalado en el Anexo 1 de la presente circular, la información correspondiente a las operaciones realizadas en futuros, opciones sobre tasa de cambio y cross currency swap estandarizados, las posiciones abiertas en los derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 a nivel de cuenta, indicadores de gestión de riesgo y los llamados al margen e incumplimientos presentados.

La información deberá ser reportada al Banco en la forma que se detalla a continuación:

a. Operaciones realizadas

Las operaciones de futuros sobre tasa de cambio, opciones sobre tasa de cambio y cross currency swap estandarizadas, aceptadas por una CRCC, deberán ser reportadas por esta última al Banco de la República. Lo anterior exime a los IMC de la obligación de reportar estas operaciones cuando sean compensadas y liquidadas a través de una CRCC, prevista en la Circular Reglamentaria Externa DODM- 144, Asunto 6 “Operaciones de Derivados”.

Las CRCC deberán informar diariamente las operaciones realizadas el día hábil anterior.

Las operaciones de forward sobre tasa de cambio, así como las opciones sobre tasa de cambio y los contratos de cross currency swap no estandarizados deberán ser reportadas por los IMC conforme a lo dispuesto en la Circular Reglamentaria Externa DODM-144, Asunto 6.

MH

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 316**

Fecha: 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

b. Posiciones abiertas a nivel de contraparte liquidadora, contraparte no liquidadora y terceros

Las CRCC deberán reportar diariamente al Banco de la República las posiciones abiertas en los derivados de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 a nivel de cuentas de terceros, contraparte liquidadora y contraparte no liquidadora.

Dicha información deberá corresponder a las posiciones registradas al cierre de cámara (7:00 pm) y enviarse a más tardar el día hábil siguiente.

c. Indicadores de gestión de riesgo de la contraparte liquidadora

Las CRCC deberán reportar diariamente al Banco de la República información de los límites utilizados para administrar el riesgo de operación diaria y de posiciones abiertas de las contrapartes liquidadoras, considerando las operaciones realizadas por cuenta propia y de la estructura de cuentas que respalda, y su consumo. La estructura de cuentas que respalda comprende las cuentas de sus terceros, así como la de sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros.

Las CRCC deberán suministrar diariamente información del monto y composición de las garantías que respaldan las posiciones propias y de la estructura de cuentas de las contrapartes liquidadoras. Dicha información deberá corresponder a las posiciones registradas al cierre de cámara (7:00 pm) y enviarse a más tardar el día hábil siguiente.

d. Incumplimientos y llamados al margen

Los eventos de llamados al margen a nivel de contraparte liquidadora e incumplimientos a nivel de las cuentas de terceros, contrapartes liquidadoras y contrapartes no liquidadoras, deberán ser informados a más tardar una hora después de que la CRCC tenga conocimiento de la situación.

4.3 Reporte de información por parte de los IMC que actúan por cuenta de agentes del exterior

Los IMC que actúen como contraparte de una CRCC por cuenta de agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados, deben enviar mensualmente la información de los cupos de crédito y el saldo vigente al final de mes con dichos agentes al correo derivados@banrep.gov.co. El Anexo 2 de esta circular contiene el formato que los IMC deben utilizar para reportar electrónicamente la información solicitada. Este formato deberá ser enviado mensualmente a más tardar el día 10 del siguiente mes y en caso que dicha fecha sea no hábil el reporte se podrá hacer el día hábil siguiente.

HVVH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM - 316

Fecha: **31 AGO. 2017**

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

4.4 Autorizaciones y extemporaneidad

La información de que trata el presente numeral 4 de esta circular, deberá ser enviada al Banco de la República por el representante legal o el funcionario autorizado de la entidad.

Los reportes enviados al Banco de la República con posterioridad a los plazos y hora establecidos, serán aceptados por el Banco. No obstante, dicha situación se pondrá en conocimiento de la Superintendencia Financiera de Colombia para efectos del control y vigilancia correspondiente.

Las CRCC y el Banco de la República podrán establecer mecanismos que permitan el acceso, conservación y consulta histórica de la información indicada en el numeral 4.2 de la presente circular, incluyendo el uso de pantallas pasivas de observación. A juicio del Subgerente Monetario y de Inversiones Internacionales del Banco de la República, estos mecanismos podrán sustituir el envío de la información solicitada.

5. VIGENCIA

Esta circular rige a partir de la fecha de su publicación.

(ESPACIO DISPONIBLE)

AVH

pc



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Instructivo para transmisión y firma digital de archivos requeridos a las Cámaras de Riesgo Central de Contraparte

I. Generalidades

Las cámaras de riesgo central de contraparte (CRCC) transmitirán, vía electrónica, al Banco de la República dentro del plazo y de acuerdo con el procedimiento señalado la información correspondiente a: i) las operaciones de futuros y opciones sobre tasa de cambio estandarizados y cross currency swaps estandarizados que son aceptadas por estas entidades para su compensación y liquidación, ii) las posiciones abiertas en los títulos del literal i de las contrapartes liquidadoras, no liquidadoras y terceros, iii) los indicadores de gestión riesgo de la contraparte liquidadora y su consumo, así como el monto y la composición de las garantías constituidas, y iv) información de los llamados al margen e incumplimientos.

Los reportes se deberán enviar en los horarios y frecuencia indicados. En caso de no existir información a reportar, se debe enviar el reporte vacío.

II. Mecanismos de transmisión electrónica de archivos

Para efectos de la transmisión electrónica de los archivos con destino al Banco de la República, las CRCC utilizarán el sistema de transferencia de archivos GTA. La documentación para el uso del sistema GTA (“Manual de usuario interactivo: gestión de transferencia de archivos del Banco de la República”) se encuentra disponible en la página del Banco en el siguiente enlace: <http://www.banrep.gov.co/es/documentos-formatos-e-informacion-adicional-sebra/gestion-transferencia-archivos-gta-html5>

En caso de presentarse alguna falla que no permita la correcta funcionalidad del esquema descrito, la entidad autorizada deberá enviar la información al correo corporativo: derivados@banrep.gov.co, aplicando la firma de seguridad PKI, como se describe en la siguiente sección.

III. Aspectos de seguridad

La certificación del envío de la información desde las CRCC hacia el Banco de la República se hará firmando el(los) archivo(s) enviado(s) usando certificados emitidos por la PKI (*Public Key Infrastructure*) del Banco de la República. Dado que el software a usar para firmar permite la combinación de cualquier combinación de operaciones de encriptación y firma, es importante anotar que los archivos a enviar deben ser solo firmados. El anterior mecanismo se establece como de obligatorio cumplimiento por parte de la CRCC para el envío de la información. La descripción del mecanismo definido por el Banco de la República para el uso del esquema seguro con PKI se encuentra en el documento “*Esquema de firma digital y encriptación end to end con la CA Banrep*” del Departamento de Seguridad Informática, el cual se entregará a todas las entidades autorizadas. El manual de usuario del software de firma y encriptación (“*Manual del Usuario PKI, USI-PN-18*”) se encuentra disponible en el siguiente enlace: http://www.banrep.gov.co/sites/default/files/paginas/mu_pki.pdf.

HUT

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : **31 AGO. 2017**

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

IV. Estructura de los archivos

Los archivos deben ser transmitidos en formato tipo texto con las características y especificaciones definidas a continuación.

A. Formato de los campos

- El primer registro del archivo debe contener los nombres de los campos separados por punto y coma (;)
- Los campos de cada registro deben ser separados por punto y coma (;)
- Los campos alfanuméricos deben justificarse a la izquierda y sin espacios en blanco. Si en este campo requiere enviar el carácter punto y coma (;), el campo debe ir entre comillas. Los campos alfanuméricos en que no se requiera reportar información se deben reportar en blanco.
- En la información de un campo en particular no puede existir comillas
- Los campos numéricos deben ser justificados a la derecha y no tener espacios en blanco. Los campos numéricos en que no se requiera reportar información se deben reportar en ceros.
- Los campos numéricos que se definan con posiciones decimales deben ser diligenciados con un punto y dos posiciones decimales. Los campos de fechas (tipo alfanumérico) ocupan 10 posiciones y deben registrarse como día, mes, año en formato (dd/mm/aaaa)
- El NIT de las entidades se reportará incluyendo el dígito de verificación, sin que éste último esté separado por algún tipo de carácter.
- El separador de los decimales es punto (.).

B. Estructura de los Archivos

Las CRCC transmitirán la información solicitada utilizando los siguientes cuatro tipos de archivos.

1) Archivo de operaciones realizadas – formato tipo 01

Las operaciones a las que hace referencia el literal i) del numeral 1 del presente anexo deberán ser reportadas por esta última al Banco de la República. La información deberá ser enviada a más tardar el día hábil siguiente a la realización de las operaciones.

a. Nombre del archivo

El archivo debe iniciar con C01_ y seguido con el NIT de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (11 dígitos) y de la fecha del día de la transmisión en formato DDMMAAAA. Ejemplo: C01_999999999901012009.

WHH

RC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316**
ANEXO No. 1Fecha : **31 AGO. 2017****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS****b. Descripción del formato**

Cada registro de archivo corresponde a una nueva operación o a la modificación de una operación reportada anteriormente. La estructura es la siguiente:

Campo	Tipo	Longitud	Contenido	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha de reporte. Formato dd/mm/aaaa	FECHA_REPORTE
2	Alfanumérico	2	Formato Tipo	ID_FORMATO
3	Alfanumérico	15	NIT de la CRCC que reporta la información	NIT_CRCC
4	Numérico	16	Número de folio	NUM_FOLIO
5	Numérico	16	Número de registro original de la operación	NUM_REG_ORI
6	Alfanumérico	3	Identificador en CRCC – titular de la cuenta que realiza la operación de venta	ID_CRCC_OV
7	Alfanumérico	100	Nombre titular de la cuenta – operación de venta	NOM_TIT_OV
8	Alfanumérico	15	Documento titular cuenta – operación de venta	DCTO_TIT_OV
9	Alfanumérico	3	Tipo de documento del titular cuenta – operación de venta (NIT, CED, TID, CEE)	TIPO_DCTO_V
10	Alfanumérico	4	Identificador contraparte no liquidadora – operación de venta	ID_CONT_NL_OV
11	Alfanumérico	100	Nombre contraparte no liquidadora – operación de venta	NOM_CONT_NL_OV
12	Alfanumérico	15	NIT contraparte no liquidadora – operación de venta	NIT_CONT_NL_OV
13	Alfanumérico	4	Identificador contraparte liquidadora – operación de venta	ID_CONT_LQ_OV
14	Alfanumérico	100	Nombre contraparte liquidadora – operación de venta	NOM_CONT_LQ_OV
15	Alfanumérico	15	NIT contraparte liquidadora – operación de venta	NIT_CONT_LQ_OV
16	Alfanumérico	3	Identificador en CRCC – titular de la cuenta que realiza operación de compra	ID_CRCC_OC
17	Alfanumérico	100	Nombre titular de la cuenta – operación de compra	NOM_TIT_OC
18	Alfanumérico	15	Documento titular cuenta – operación de compra	DCTO_TIT_OC

MWH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

19	Alfanumérico	3	Tipo de documento del titular cuenta – operación de compra (NIT, CED, TID, CEE)	TIPO_DCTO_C
20	Alfanumérico	4	Identificador contraparte no liquidadora – operación de compra	ID_CONT_NL_OC
21	Alfanumérico	100	Nombre contraparte no liquidadora – operación de compra	NOM_CONT_NL_OC
22	Alfanumérico	15	NIT contraparte no liquidadora – operación de compra	NIT_CONT_NL_OC
23	Alfanumérico	4	Identificador contraparte liquidadora – operación de compra	ID_CONT_LQ_OC
24	Alfanumérico	100	Nombre contraparte liquidadora – operación de compra	NOM_CONT_LQ_OC
25	Alfanumérico	15	NIT contraparte liquidadora – operación de compra	NIT_CONT_LQ_OC
26	Alfanumérico	10	Fecha de negociación. Formato dd/mm/aaaa	FECHA_NEGOCIA
27	Alfanumérico	8	Hora de negociación. Formato hh:mm:ss	HORA_NEGOCIA
28	Alfanumérico	16	Nemotécnico	NEMOTECNICO
29	Númerico	6	Cantidad de contratos	CANT_CONTRA
30	Númerico	10	Valor nominal de la operación	VALNOM_OPERA
31	Númerico	20	Valor total. Formato con dos decimales.	VALTOT_OPERA
32	Númerico	10	Precio de la negociación (\$/USD). Formato con dos decimales	PRECIO_NEGOCIA
33	Alfanumérico	1	Origen de la operación (M, R,G)	ORIGEN_OPERA
34	Alfanumérico	1	Tipo de novedad. Aplica para operaciones de gestión (D, G, T, V, X, Y, Z)	TIPO_NOVEDAD

- **Descripción de los campos**

Fecha de reporte

Corresponde a la fecha en la cual se envía la información. Formato dd/mm/aaaa

Formato Tipo

Tipo de formato de archivo que se está remitiendo. Para este caso el valor es 01

NIT de la CRCC que reporta la información

Registre el NIT de la CRCC que reporta la información.

NH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Número de folio

Corresponde al número de registro de la operación en la CRCC. En el caso que en el campo novedad no se reporte una gestión de operaciones, el valor de este campo corresponde al número original de registro de la operación.

Número de registro original de la operación

Corresponde al número inicial de registro de la operación en la CRCC.

Identificador en CRCC – titular de la cuenta que realiza operación de venta

Corresponde al identificador asignado por la CRCC al titular de la cuenta al que se le asigna la operación de venta. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el identificador de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Nombre titular de la cuenta – operación de venta

Corresponde al nombre del titular de la cuenta al que se le asigna la operación de venta. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el nombre de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Documento titular cuenta – operación de venta

Corresponde al NIT o la Cédula de Ciudadanía del titular de la cuenta al que se le asigna la operación de venta. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el NIT de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Tipo de documento del titular de la cuenta – operación de venta

Los tipos de documentos son:

NIT: NIT que identifica a la persona jurídica titular de la cuenta – operación de venta

CED: Cédula de Ciudadanía que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operación de venta

TID: Tarjeta de identidad que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operación de venta

CEE: Cédula de extranjería que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operaciones de venta.

Identificador contraparte no liquidadora – operación de venta

Corresponde al identificador asignado por la CRCC a la contraparte no liquidadora que respalda la operación de venta, en caso de que aplique.

Nombre contraparte no liquidadora – operación de venta

Corresponde al nombre de la contraparte no liquidadora que respalda la operación de venta, en caso de que aplique.

NIT contraparte no liquidadora – operación de venta

Corresponde al NIT de la contraparte no liquidadora que respalda la operación de venta, en caso de que aplique.

HH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Identificador contraparte liquidadora – operación de venta

Corresponde al identificador asignado por la CRCC a la contraparte liquidadora que respalda la operación de venta.

Nombre de la contraparte liquidadora – operación de venta

Corresponde al nombre de la contraparte liquidadora que respalda la operación de venta.

NIT contraparte liquidadora – operación de venta

Corresponde al NIT de la contraparte liquidadora que respalda la operación de venta.

Identificador en CRCC – titular de la cuenta que realiza operación de compra

Corresponde al identificador asignado por la CRCC al titular de la cuenta al que se le asigna la operación de compra. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el identificador de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Nombre titular de la cuenta – operación de compra

Corresponde al nombre del titular de la cuenta al que se le asigna la operación de compra. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el nombre de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Documento titular cuenta – operación de compra

Corresponde al NIT o la Cédula de Ciudadanía del titular de la cuenta al que se le asigna la operación de compra. En el caso que sea una operación de la cuenta diaria se reportará el NIT de la contraparte (liquidadora o no liquidadora) que respalda la operación.

Tipo de documento del titular de la cuenta – operación de compra

Los tipos de documentos son:

NIT: NIT que identifica a la persona jurídica titular de la cuenta – operación de compra

CED: Cédula de Ciudadanía que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operación de compra

TID: Tarjeta de identidad que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operación de compra

CEE: Cédula de extranjería que identifica a la persona natural titular de la cuenta – operaciones de compra.

Identificador contraparte no liquidadora – operación de compra

Corresponde al identificador asignado por la CRCC a la contraparte no liquidadora que respalda la operación de compra, en caso de que aplique.

Nombre contraparte no liquidadora – operación de compra

Corresponde al nombre de la contraparte no liquidadora que respalda la operación de compra, en caso de que aplique.

NH

RC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

NIT contraparte no liquidadora – operación de compra

Corresponde al NIT de la contraparte no liquidadora que respalda la operación de compra, en caso de que aplique.

Identificador contraparte liquidadora – operación de compra

Corresponde al identificador asignado por la CRCC a la contraparte liquidadora que respalda la operación de compra.

Nombre contraparte liquidadora – operación de compra

Corresponde al nombre de la contraparte liquidadora que respalda la operación de compra.

NIT contraparte liquidadora – operación de compra

Corresponde al NIT de la contraparte liquidadora que respalda la operación de compra.

Fecha de negociación

Corresponde a la fecha en la que se realizó la aceptación de la operación por parte de la CRCC; formato dd/mm/aaaa

Hora de negociación

Corresponde a la hora de aceptación de la operación en el sistema de CRCC hh:mm:ss

Nemotécnico

Corresponde al identificador del contrato negociado.

Cantidad de contratos

Corresponde al número de contratos transados en cada operación.

Valor nominal de la operación

Corresponde al valor nominal del contrato multiplicado por el número de contratos de cada operación.

Valor total

Corresponde al valor de la operación, el cual resulta de multiplicar la cantidad de contratos por el valor nominal y por el precio de negociación.

Precio de la negociación (\$/USD)

Corresponde al precio al cual se transó la operación.

Origen de la operación

El origen de la operación puede corresponder a:

R: operación de registro: transacción acordada entre las partes en el mercado mostrador, la cual es aceptada por una CRCC para su compensación y liquidación.

M: operación de mercado: transacción acordada entre las partes en un sistema de negociación administrado por las bolsas de valores.

HHH

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

G: operación de gestión: movimientos de las posiciones posteriores a la negociación inicial.

Tipo de novedad

Corresponde al tipo de novedad asociado a una operación de gestión. Las posibles novedades son:

D: asignación de la operación desde la cuenta diaria.

G: Give Up: traspaso de una operación aceptada por la CRCC entre dos cuentas de diferente contraparte

T: traspaso de la operación aceptada por la CRCC entre dos cuentas de la misma contraparte.

V: vencimiento de la operación.

X: cancelación de la operación.

Y: anulación de la cancelación.

Z: traspaso de la posición.

2) Archivo de posiciones abiertas a nivel de cuenta – Formato tipo 2

Las CRCC deberán reportar diariamente al Banco de la República las posiciones abiertas en los contratos de que trata el literal i) del numeral 1 del presente anexo a nivel de cuentas de terceros, contraparte liquidadora y contraparte no liquidadora. Dicha información deberá corresponder a las posiciones registradas al cierre de cámara (7:00 pm) y enviarse a más tardar el día hábil siguiente.

a. Nombre del archivo

El archivo debe iniciar con C02_ y seguido con el NIT de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (11 dígitos) y de la fecha del día de la transmisión en formato DDMMAAAA. Ejemplo: C02_9999999999901012009.

b. Descripción del formato

Cada registro corresponde a la posición abierta en futuros sobre tasa de cambio a nivel de cuenta. La estructura del reporte es la siguiente:

Campo	Tipo	Longitud	Contenido	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha de reporte. Formato dd/mm/aaaa	FECHA_REPORTE
2	Alfanumérico	2	Formato Tipo	ID_FORMATO
3	Alfanumérico	15	NIT de la CRCC que reporta la información	NIT_CRCC
4	Alfanumérico	10	Fecha de reporte de la posición abierta; formato dd/mm/aaaa	FECHA_POSICION
5	Alfanumérico	3	Identificador en la CRCC de la cuenta	ID_CRCC

MH

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1**

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

6	Alfanumérico	100	Nombre del titular de la cuenta	NOM_TIT
7	Alfanumérico	15	Documento titular cuenta	DCTO_TIT
8	Alfanumérico	3	Tipo de documento del titular cuenta (NIT, CED, TID, CEE)	TIPO_DCTO
9	Alfanumérico	16	Nemotécnico	NEMOTECNICO
10	Numérico	8	Posición abierta vendedora	POS_AB_VE_CTO
11	Numérico	8	Posición abierta compradora	POS_AB_CO_CTO
12	Alfanumérico	15	NIT contraparte liquidadora que respalda la posición	NIT_CONT_LQ
13	Alfanumérico	15	NIT contraparte no liquidadora que respalda la posición	NIT_CONT_NL

• Descripción de los campos**Fecha de reporte**

Corresponde a la fecha en la cual se envía la información. Formato dd/mm/aaaa

Formato Tipo

Tipo de formato de archivo que se está remitiendo. Para este caso el valor es 02

NIT de la CRCC que reporta la información

Registre el NIT de la CRCC que reporta la información.

Fecha del reporte de la posición abierta

Fecha a la que corresponde la información de la posición abierta de la cuenta. Formato dd/mm/aaaa.

Identificador en la CRCC de la cuenta

Identificador asignado por la CRCC al titular de la cuenta.

Nombre titular de la cuenta

Nombre del titular de la cuenta.

Documento titular cuenta

Corresponde al NIT o la Cédula de Ciudadanía del titular de la cuenta.

Tipo de documento del titular de la cuenta

Los tipos de documentos son:

NIT: NIT que identifica a la persona jurídica titular de la cuenta**CED:** Cédula de Ciudadanía que identifica a la persona natural titular de la cuenta**TID:** Tarjeta de identidad que identifica a la persona natural titular de la cuenta**CEE:** Cédula de extranjería que identifica a la persona natural titular de la cuenta.**Nemotécnico**

Identificador del contrato.

HUT

PC



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1**

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Posición abierta vendedora

Posición abierta vendedora en número de contratos para futuros, opciones y *cross currency swaps* y en valor nominal en USD para forwards.

Posición abierta compradora

Posición abierta compradora en número de contratos para futuros, opciones y *cross currency swaps* y en valor nominal en USD para forwards.

NIT contraparte liquidadora que respalda la operación

Corresponde al NIT de la contraparte liquidadora que respalda la operación.

NIT contraparte no liquidadora que respalda la operación

Corresponde al NIT de la contraparte no liquidadora que respalda la operación, en caso de que aplique.

3) Archivo gestión de riesgo de la contraparte liquidadora – Formato tipo 3

Las CRCC deberán reportar diariamente al Banco de la República información de los límites utilizados para administrar el riesgo de operación diaria y de posiciones abiertas de las contrapartes liquidadoras, considerando las operaciones realizadas a nivel de cuenta propia o de la estructura de cuentas que respalda, y su consumo. La estructura de cuentas que respalda comprende las cuentas de sus terceros, así como las de sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros. Así mismo, las CRCC deberán suministrar diariamente información del monto y composición de las garantías que respaldan las posiciones por cuenta propia y de terceros de las contrapartes liquidadoras.

Dicha información deberá corresponder a las posiciones registradas al cierre de cámara (7:00 pm) y enviarse a más tardar el día hábil siguiente.

a. Nombre del archivo

El archivo debe iniciar con C03_ y seguido con el NIT de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (11 dígitos) y de la fecha del día de la transmisión en formato DDMMAAAA. Ejemplo: C03_999999999901012009.

b. Descripción del formato

Cada registro contiene información de una contraparte liquidadora. La estructura del reporte es la siguiente:

Campo	Tipo	Longitud	Definición	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha de reporte. Formato dd/mm/aaaa	FECHA_REPORTES
2	Alfanumérico	2	Formato Tipo	ID_FORMATO

H2H

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1**Fecha : **31 AGO. 2017****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS**

3	Alfanumérico	15	NIT de la CRCC que reporta la información	NIT_CRCC
4	Alfanumérico	4	Identificador en CRCC de la contraparte liquidadora	ID_CRCC_LQ
5	Alfanumérico	100	Nombre de la contraparte liquidadora	NOM_CONT_LQ
6	Alfanumérico	15	NIT de la contraparte liquidadora	NIT_CONT_LQ
7	Numérico	15	Límite Operativo Diario	LIM_OPE_DIARIO
8	Numérico	15	Riesgo Operativo Diario	RIE_OPE_DIARIO
9	Numérico	15	Límite de Posición Abierta	LIM_POS_AB
10	Numérico	15	Riesgo de Posición Abierta	RIE_POS_AB
11	Numérico	20	Monto total garantías	MONTO_TOTAL
12	Numérico	20	Garantía inicial	GARAN_INI
13	Numérico	20	Garantías diarias- Cuenta Propia	GARAN_DIA_CP
14	Numérico	20	Garantías diarias- Demás cuentas de la contraparte liquidadora	GARAN_DIA_OC
15	Numérico	20	Garantía extraordinarias	GARAN_EXT
16	Numérico	20	Garantías generales	GARAN_GEN
17	Alfanumérico	10	Fecha de operación dd/mm/aaa	FECHA_OPER

• Descripción de los campos**Fecha de reporte**

Corresponde a la fecha en la cual se envía la información. Formato dd/mm/aaaa

Formato Tipo

Tipo de formato de archivo que se está remitiendo. Para este caso el valor es 03

NIT de la CRCC que reporta la información

Registre el NIT de la CRCC que reporta la información.

Identificador en la CRCC de la contraparte liquidadora

Corresponde al identificador asignado por la CRCC a la contraparte liquidadora.

Nombre de la contraparte liquidadora

Corresponde al nombre de la contraparte liquidadora.

NIT de la contraparte liquidadora

Corresponde al NIT de la contraparte liquidadora.

Límite operativo Diario

Máximo riesgo operativo diario que puede generar una contraparte liquidadora por operaciones realizadas tanto por cuenta propia y de sus terceros como por las realizadas por sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros, desde el momento en que se realizan las operaciones hasta el momento en que depositan las garantías diarias.

MVH

PC



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1**

Fecha : **31 AGO. 2017**

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

Riesgo Operativo Diario

El riesgo operativo diario de la contraparte liquidadora se determina mediante la suma del riesgo calculado para cada Cliente/Titular, sin compensar entre distintos clientes, y el riesgo operativo de la Cuenta Diaria. El cálculo del Riesgo Operativo Diario se realizará de acuerdo con el procedimiento establecido en el reglamento y/o en las circulares reglamentarias de las CRCC.

Límite de Posición Abierta

Máxima exposición de una contraparte liquidadora considerando tanto la posición abierta de la cuenta propia y de sus terceros, como las posiciones abiertas de sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros, en el evento simulado de una variación extrema de los precios.

Riesgo de Posición Abierta

El riesgo de posición abierta de la contraparte liquidadora se determina mediante la suma del riesgo calculado para cada Cliente/Titular, sin compensar entre distintos clientes. El cálculo del Riesgo de Posición Abierta se realizará de acuerdo con el procedimiento establecido en el reglamento y/o en las circulares reglamentarias de la CRCC.

Monto total de garantías

Corresponde a la suma del monto de la garantía inicial, las garantías diarias, tanto de la cuenta propia como de las demás cuentas de la contraparte liquidadora, las garantías extraordinarias y las garantías generales.

Monto garantía inicial

Garantía constituida por las contrapartes liquidadoras para poder operar.

Monto garantías diarias – cuenta propia

Monto de las garantías diarias constituidas a nivel de la cuenta propia de la contraparte liquidadora.

Monto garantías diarias – demás cuentas de la contraparte liquidadora

Monto de las garantías diarias constituidas a nivel de las cuentas de terceros, así como de sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros.

Monto garantías extraordinarias

Monto de las garantías extraordinarias depositadas por la contraparte liquidadora.

Monto garantías generales

Monto de las garantías generales depositadas por la contraparte liquidadora así como por sus contrapartes no liquidadoras.

Fecha de operación

Corresponde a la fecha para la cual se reporta la información. Formato dd/mm/aaaa

HWH

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1**

Fecha : 31 AGO. 2017

**ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS
OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL
MERCADO DE DIVISAS****4) Archivo de incumplimientos y llamados al margen – Formato tipo 4**

Los eventos de llamados al margen a nivel de contraparte liquidadora e incumplimientos a nivel de las cuentas de terceros, contrapartes liquidadoras y contrapartes no liquidadoras, deberán ser informados a más tardar una hora después de que la CRCC tenga conocimiento de la situación. Adicionalmente, se debe enviar un reporte diario que agregue los eventos del día a más tardar el día hábil siguiente.

a. Nombre del archivo

El archivo debe iniciar con C04_ y seguido con el NIT de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (11 dígitos) y de la fecha del día de la transmisión en formato DDMMAAAA. Ejemplo: C04_9999999999901012009.

b. Descripción del formato

Cada registro debe contener información del llamado al margen que se haga a nivel de la contraparte liquidadora o del incumplimiento declarado a nivel de cuenta. La estructura del reporte es la siguiente.

Campo	Tipo	Longitud	Descripción	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha del reporte dd/mm/aaaa	FECHA REPORTE
2	Alfanumérico	2	Formato Tipo	ID_FORMATO
3	Alfanumérico	15	NIT CRCC que reporta la información	NIT_CRCC
4	String	1	Novedad: I: incumplimiento M: llamado al margen	NOVEDAD
5	Alfanumérico	10	Fecha de reporte del incumplimiento o llamado al margen dd/mm/aaaa	FEC_REP_INC
6	Alfanumérico	15	NIT de la contraparte liquidadora a la que se le hace el llamado al margen o declara el incumplimiento	NIT_CONT_LQ
7	Numérico	20	Importe llamado al margen	IMP_MARG
8	Alfanumérico	3	Identificador en la CRCC de la cuenta que registra un incumplimiento	ID_CRCC
9	Alfanumérico	100	Nombre del titular de la cuenta que registra un incumplimiento	NOM_TIT
10	Alfanumérico	15	Documento titular cuenta que registra un incumplimiento	DCTO_TIT
11	Alfanumérico	3	Tipo de documento del titular cuenta (NIT, CED, TID, CEE)	TIPO_DCTO

Hv H

PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No. 1

Fecha : 31 AGO. 2017

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

- **Descripción de los campos**
Fecha de reporte

Corresponde a la fecha en la cual se envía la información. Formato dd/mm/aaaa

Formato Tipo

Tipo de formato de archivo que se está remitiendo. Para este caso el valor es 04

NIT de la CRCC que reporta la información

Registre el NIT de la CRCC que reporta la información.

Tipo de novedad reportada:

I: incumplimiento

M: llamado al margen.

Fecha del incumplimiento o del llamado al margen.

Formato dd/mm/aaaa

NIT de la contraparte liquidadora al que se le hace un llamado al margen o declara el incumplimiento

NIT de la contraparte liquidadora a la cual se le hace un llamado al margen o la cual reporta un incumplimiento ya sea a nivel de cuenta propia o de la estructura de cuentas que respalda. La estructura de cuentas que respalda comprende las cuentas de sus terceros, así como las de sus contrapartes no liquidadoras y respectivos terceros.

Importe llamado al margen

Monto de garantías exigidas a la contraparte liquidadora por un llamado al margen sobre las posiciones tanto por cuenta propia y de sus terceros como las de sus contrapartes no liquidadoras y sus respectivos terceros.

Identificador en la CRCC de la cuenta que presenta un incumplimiento

Corresponde al identificador asignado por la CRCC al titular de la cuenta que presenta un incumplimiento.

Nombre del titular de la cuenta que presenta un incumplimiento

Corresponde al nombre del titular de la cuenta que presenta un incumplimiento.

Documento titular cuenta que presenta un incumplimiento

Corresponde al NIT o la Cédula de Ciudadanía del titular de la cuenta.

Tipo de documento del titular de la cuenta que presenta un incumplimiento

Los tipos de documentos son:

NIT: NIT que identifica a la persona jurídica titular de la cuenta

CED: Cédula de Ciudadanía que identifica a la persona natural titular de la cuenta

TID: Tarjeta de identidad que identifica a la persona natural titular de la cuenta

CEE: Cédula de extranjería que identifica a la persona natural titular de la cuenta.

HH

PC



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DODM – 316
ANEXO No 2**

Fecha:

ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS

ANEXO 2: INSTRUCTIVO PARA DILIGENCIAR EL FORMATO DE REPORTE POR PARTE DE LOS IMC QUE ACTÚAN POR CUENTA DE AGENTES DEL EXTERIOR

Los IMC que actúen como contraparte de una CRCC por cuenta de agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados deben reportar un archivo en formato Excel¹, *“Modelo de formatos de reporte por parte de los IMC que actúan por cuenta de los agentes del exterior”*².

Al diligenciar el formato, no altere las columnas, no borre ni inserte filas o columnas, ni cambie el nombre de la hoja. Lea cuidadosamente estas instrucciones antes de diligenciar el formato. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico derivados@banrep.gov.co.

1 DESCRIPCIÓN DE LOS CAMPOS

Entidad y NIT

En la hoja de cálculo, la celda sombreada en amarillo bajo el título “Entidad” contiene la lista desplegable de IMC, con el fin de identificar la entidad reportante. Al seleccionar el nombre de la entidad, aparecerá automáticamente (en la casilla inferior) el NIT.

Nombre y país del agente del exterior por cuenta del cual actúa

Se debe escribir el nombre del agente del exterior por cuenta del cual actúa seguido del país de origen. Se debe diligenciar una fila por cada agente del exterior.

Cupo de crédito con el agente del exterior por cuenta del cual actúa

Se debe escribir el cupo de crédito vigente al último día hábil del mes anterior (en pesos) asignado al agente del exterior por cuenta del cual actúa.

Cuentas por cobrar vigentes

Se debe escribir el valor de la obligación vigente al último día hábil del mes anterior (en pesos) del agente del exterior por cuenta del cual actúa, a favor del IMC. En caso de existir una cuenta por pagar, el valor reportado debe ser negativo.

¹ El archivo debe ser diligenciado en Excel 97 o versiones posteriores

² Ingrese a <http://www.banrep.gov.co/sites/default/files/reglamentacion/archivos/dodm-316-anexo2.xlsx>

HVH

PC

