



Hoja 18 – 00

**MANUAL DEL DEPARTAMENTO DE
OPERACIONES Y ANÁLISIS DE MERCADOS
CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA-DOAM-316**

Fecha: 28 MAY 2021

Destinatario Oficina Principal y Sucursales; Superintendencia Financiera de Colombia; Intermediarios del Mercado Cambiario; y Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A.

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

La presente Circular reemplaza las hojas 18-2, 18-5, 18-6, 18-A1-1 y 18-A1-10 de la Circular Reglamentaria Externa DOAM-316 del 25 de septiembre de 2020, correspondiente al Asunto 18: **“CÁMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS”** del Manual del Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados.

La modificación se realiza en desarrollo de lo establecido en la Resolución Externa 5 de 2021, que modifica la Resolución Externa 12 de 2008 de la Junta Directiva del Banco de la República, para autorizar a las cámaras de riesgo central de contraparte para efectuar la compensación y liquidación como contraparte de operaciones de FX – swaps, así como para realizar la liquidación con cumplimiento efectivo de los contratos de derivados cambiarios autorizados a dicha entidad, con el intercambio de moneda legal colombiana por dólar.

Cordialmente,

HERNANDO VARGAS HERRERA
Gerente Técnico

PAMELA CARDOZO ORTIZ
Subgerente Monetario y de Inversiones Internacionales

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316**Fecha: **25 SEP 2020**

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

1. OBJETIVO

Esta circular reglamenta la Resolución Externa 12 de 2008 de la Junta Directiva del Banco de la República (JDBR) 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.

2. SUMINISTRO DE INFORMACIÓN**2.1. Información sobre modificaciones a los Reglamentos, Circulares e Instructivos**

Sin perjuicio de las autorizaciones que deba expedir la Superintendencia Financiera de Colombia (SFC) en desarrollo de la Ley 964 de 2005 y el Decreto 2555 de 2010, las modificaciones al reglamento de las CRCC, así como las circulares e instructivos que se expidan relacionados directa o indirectamente con las operaciones autorizadas en la Resolución Externa 12 de 2008 de la JDBR, o que incidan en su ejecución, incluyendo modificaciones a los mecanismos de mitigación de riesgo, deberán ser informadas previamente a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales del Banco de la República.

Los mecanismos 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 a los reglamentos y la autorización de productos a ser aceptados por las CRCC.

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 y de las operaciones de compra y venta de contado 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. 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.

*H. Vargas***PC**

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316**Fecha: **28 MAY 2021****ASUNTO 18: CÁMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS****2.2. Información sobre operaciones**

Las CRCC deberán transmitir vía electrónica 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, cross currency swap estandarizados y FX swap estandarizados; las posiciones abiertas en los derivados y los contratos de compra y venta de contado de que trata el artículo primero de la Resolución Externa 12 de 2008 de la JDBR a nivel de cuenta; los indicadores de gestión de riesgo; y los llamados al margen e incumplimientos presentados.

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 presente numeral, incluyendo el uso de pantallas pasivas de observación. Estos mecanismos podrán sustituir el envío de la información solicitada mediante del Anexo 1.

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

a. Operaciones realizadas

Las operaciones estandarizadas de futuros sobre tasa de cambio, opciones sobre tasa de cambio, cross currency swap y FX swap, 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 DOAM- 144, Asunto 6 “Operaciones de Derivados”.

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

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

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

Dicha información deberá corresponder a las posiciones registradas al cierre de las CRCC y deberá enviarse a más tardar el día hábil siguiente.

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316**Fecha: **25 SEP 2020**

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

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 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.

2.3. Reporte de información por parte de los IMC facultados para operar como miembros liquidadores ante las CRCC y que liquiden operaciones a nombre de agentes del exterior

Los IMC facultados para operar como miembros liquidadores ante las CRCC y que liquiden operaciones a nombre de un agente del exterior autorizado para realizar operaciones de derivados financieros, 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 instructivo que los IMC deben utilizar para diligenciar el formato del Anexo 3 de esta circular: “*Formato de reporte por parte de los IMC que liquiden operaciones a nombre de agentes del exterior*”. 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.

2.4. Autorizaciones y extemporaneidad

La información de que trata el presente numeral 2 esta circular deberá ser enviada al Banco de la República por el representante legal o el funcionario autorizado de la entidad.

H. Vargas
PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316**Fecha: **25 SEP 2020**

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

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 SFC para efectos del control y vigilancia correspondiente.

3. AGENTES PROVEEDORES DE LIQUIDEZ

Las CRCC deben contar con agentes proveedores de liquidez en moneda legal colombiana y moneda extranjera para garantizar el normal desarrollo en los pagos de los contratos de compra y venta de contado peso-dólar.

Debido a la importancia que representan los agentes proveedores de liquidez para el adecuado cumplimiento de estas operaciones, las CRCC deben asegurar que, en todo momento, los agentes proveedores de liquidez sean entidades patrimonialmente sólidas, cuenten con suficiente liquidez y acrediten la capacidad técnica y operativa para asegurar el cumplimiento de las operaciones de contado compensadas a través de tales cámaras. Adicionalmente, para el desarrollo de las operaciones, dichos agentes deberán acreditar y mantener, como mínimo, los requisitos establecidos en la presente circular.

No se puede interpretar como garantía de solvencia y cumplimiento que un agente proveedor de liquidez acredite las condiciones previstas en esta circular. Continuará siendo responsabilidad de las CRCC la adecuada evaluación del riesgo de sus contrapartes y el cumplimiento y mantenimiento de las condiciones establecidas en esta circular.

3.1. AGENTES PROVEEDORES DE LIQUIDEZ EN MONEDA LEGAL COLOMBIANA

Los agentes proveedores de liquidez en moneda legal deben cumplir, como mínimo, los siguientes requisitos:

- a) Ser un intermediario del mercado cambiario (IMC) del numeral 1 del Artículo 8 de la Resolución Externa 1 de 2018 de la JDBR.
- b) Acreditar una calificación de riesgo crediticio de corto plazo por parte de una de las calificadoras de riesgo autorizadas en Colombia por la SFC, igual a “DP1+” si se utiliza la escala de DCR o, de BRC1+ si se utiliza la escala de BRC.

*H. Vargas**PC*



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316

Fecha: **28 MAY 2021**

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

3.2. AGENTES PROVEEDORES DE LIQUIDEZ EN MONEDA EXTRANJERA

Las CRCC no podrán concentrar más del 35% de la liquidez en divisas en un solo agente proveedor de liquidez.

Los agentes proveedores de liquidez en moneda extranjera deberán cumplir como mínimo con los requisitos que se indican a continuación, según se trate de: a) agentes del exterior que realicen de manera profesional operaciones de derivados, b) entidades financieras del exterior o, c) IMC.

a) Agentes del exterior que realicen de manera profesional operaciones de derivados:

- i) Ser agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados de manera profesional, según lo dispuesto en la Resolución Externa 1 de 2018 de la JDDBR y en la Circular Reglamentaria Externa DOAM-144; y
- ii) Acreditar una calificación de riesgo crediticio de corto plazo mínima de “A1” de acuerdo con Standard & Poor’s o “F1” de acuerdo con Fitch o su equivalente de “P1” en la escala de Moody’s, de por lo menos dos (2) de estas calificadoras de riesgo.

b) Entidades financieras del exterior:

- i) Ser una entidad financiera del exterior que acredite dicha condición con el certificado de la entidad especializada de supervisión financiera equivalente a la SFC; y
- ii) Acreditar una calificación de riesgo crediticio de corto plazo mínima de “A1” de acuerdo con Standard & Poor’s o “F1” de acuerdo con Fitch o su equivalente de “P1” en la escala de Moody’s, de por lo menos dos (2) de estas calificadoras de riesgo.

c) IMC:

- i) Ser un IMC del numeral 1 del Artículo 8 de la Resolución Externa 1 de 2018 de la JDDBR;
- ii) Acreditar una calificación de riesgo crediticio de corto plazo por parte de una de las calificadoras de riesgo autorizadas en Colombia por la SFC, igual a “DP1+” si se utiliza la escala de CDR o, de BRC1+ si se utiliza la escala de BRC; y
- iii) Contar con una línea de crédito preaprobada por una entidad financiera del exterior con una calificación de riesgo crediticio de corto plazo mínima de “A1” de acuerdo con Standard & Poor’s o “F1” de acuerdo con Fitch Ratings o su equivalente de “P1” en la escala de Moody’s, de por lo menos dos (2) de estas calificadoras de riesgo.

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM - 316**Fecha: **28 MAY 2021****ASUNTO 18: CÁMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS****4. REPORTE DE EVENTOS**

Las CRCC deberán informar mediante comunicación escrita a la Subgerencia Monetaria y de Inversiones Internacionales del Banco de la República y a la SFC, los eventos que impidan la prestación temporal de los servicios de compensación y liquidación de divisas, incluyendo las medidas implementadas para subsanar y prevenir su ocurrencia. Dicha comunicación deberá enviarse a más tardar el quinto (5°) día hábil siguiente a la ocurrencia del mencionado evento.

Cuando las CRCC no remitan la comunicación dentro del plazo señalado, el Banco de la República informará sobre tal situación a la SFC, a efecto de que dicha entidad pueda imponer las sanciones conforme a sus competencias, en particular las previstas en el Estatuto Orgánico del Sistema Financiero.

5. LIQUIDACIÓN DE LOS CONTRATOS

Los contratos de derivados con cumplimiento financiero que se compensen y liquiden por conducto de una CRCC, deberán liquidarse en moneda legal colombiana. Los que se celebren entre los agentes del exterior y los intermediarios del mercado cambiario que actúen por cuenta de tales agentes ante una CRCC se hará conforme lo establecido en el artículo 64 de la Resolución Externa 1 de 2018.

Los contratos de compra y venta de peso-dólar y de derivados con cumplimiento efectivo, que se compensen y liquiden por conducto de una CRCC deberán liquidarse mediante la transferencia de: i) moneda legal a través de las cuentas de depósito que mantienen los participantes y la CRCC en el Banco de la República, y ii) moneda extranjera a través de las cuentas de depósito que posean los participantes y la CRCC en entidades financieras del exterior.

(ESPACIO DISPONIBLE)*H. Vargas* PC



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

Fecha: **28 MAY 2021**

**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 realizadas de futuros y opciones sobre tasa de cambio estandarizados, cross currency swaps estandarizados y FX swap estandarizados que son aceptadas por estas entidades para su compensación y liquidación, ii) las posiciones abiertas en los derivados y los contratos de compra y venta de contado 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, 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.

H. Vargas PC



CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1

Fecha: **25 SEP 2020**

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_9999999999901012009.

H. Vargas
PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1**Fecha: **25 SEP 2020****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

H. Vargas

PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1**Fecha: **25 SEP 2020****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS**

Campo	Tipo	Longitud	Contenido	Nombre Campo
18	Alfanumérico	15	Documento titular cuenta – operación de compra	DCTO_TIT_OC
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	Numérico	6	Cantidad de contratos	CANT_CONTRA
30	Numérico	10	Valor nominal de la operación	VALNOM_OPERA
31	Numérico	20	Valor total. Formato con dos decimales.	VALTOT_OPERA
32	Numérico	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

H. Vargas
PC



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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

NIT de la CRCC que reporta la información

Registre el NIT de la CRCC que reporta la información.

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.

H. Vargas
PC



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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 venta

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

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.

H. Vargas
PC



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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

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.

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.

H. Vargas

PC



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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

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.

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 derivados y los contratos de compra y venta de contado 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 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_999999999901012009.

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:

H. Vargas
PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1**Fecha: **25 SEP 2020****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL MERCADO DE DIVISAS**

Campo	Tipo	Longitud	Contenido	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha de reporte. Formato dd/mm/aaaa	FECHA_REPORTES
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
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 o Identificador	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.

H. Vargas
PC



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

Fecha: **28 MAY 2021**

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

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 o Identificador

Nemotécnico del contrato para el caso de los derivados estandarizados. Para derivados no estandarizados: “FWD” para contratos forward de tasa de cambio, “OPC” para el caso de opciones, “CCS” para cross currency swap y “FXS” para FX swap. Para los contratos de contado peso-dólar: “CONTADO”.

Posición abierta vendedora

Posición abierta vendedora en número de contratos para los derivados estandarizados y en valor nominal en USD para los derivados no estandarizados y los contratos de contado peso-dólar.

Posición abierta compradora

Posición abierta compradora en número de contratos para los derivados estandarizados y en valor nominal en USD para los derivados no estandarizados y los contratos de contado peso-dólar.

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.

H. Vargas PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1**Fecha: **25 SEP 2020****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS
OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL
MERCADO DE DIVISAS**

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_REPORTE
2	Alfanumérico	2	Formato Tipo	ID_FORMATO
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

H. Vargas
PC



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

Fecha: 25 SEP 2020

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

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.

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.

H. Vargas
PC



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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

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

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.

H. Vargas
PC

**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 1**Fecha: **25 SEP 2020****ASUNTO: 18: CAMARAS DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE, SUS
OPERADORES Y LAS OPERACIONES AUTORIZADAS EN EL
MERCADO DE DIVISAS**

Campo	Tipo	Longitud	Descripción	Nombre Campo
1	Alfanumérico	10	Fecha del reporte dd/mm/aaaa	FECHA_REPORTER
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

• 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.



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

Fecha: **25 SEP 2020**

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

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.

H. Vargas
PC



**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA – DOAM – 316
ANEXO No. 2**

Fecha: **25 SEP 2020**

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

**INSTRUCTIVO PARA DILIGENCIAR EL FORMATO DE REPORTE POR PARTE
DE LOS IMC QUE LIQUIDEN OPERACIONES A NOMBRE DE UN AGENTE DEL
EXTERIOR**

Los IMC facultados para operar como miembros liquidadores ante las CRCC y que liquiden operaciones a nombre de un agente del exterior autorizado para realizar operaciones de derivados, deben reportar el archivo en formato Excel¹ del Anexo 3 de esta circular: “*Formato de reporte por parte de los IMC que liquiden operaciones a nombre de agentes del exterior*”².

Al diligenciamiento 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 contraparte

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

País contraparte

Se debe escribir el país de origen del agente del exterior por cuenta del cual actúa.

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 <https://www.banrep.gov.co/es/reglamentacion-temas/2159>

H. Vargas
PC

