



Depósito **Central**
de Valores





REUNIÓN DE PARTICIPANTES

DEPÓSITO CENTRAL DE VALORES - DCV

DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES

2 DE NOVIEMBRE DE 2016

AGENDA

- 1. ESTADÍSTICAS**
- 2. RESULTADOS ENCUESTA DE SATISFACCIÓN**
- 3. COMPROMISOS REUNIÓN ANTERIOR**
- 4. NUEVAS IMPLEMENTACIONES**
- 5. FUTURAS IMPLEMENTACIONES - AVANCES**
- 6. OTROS TEMAS DE INTERÉS**
- 7. ALGUNAS RECOMENDACIONES**



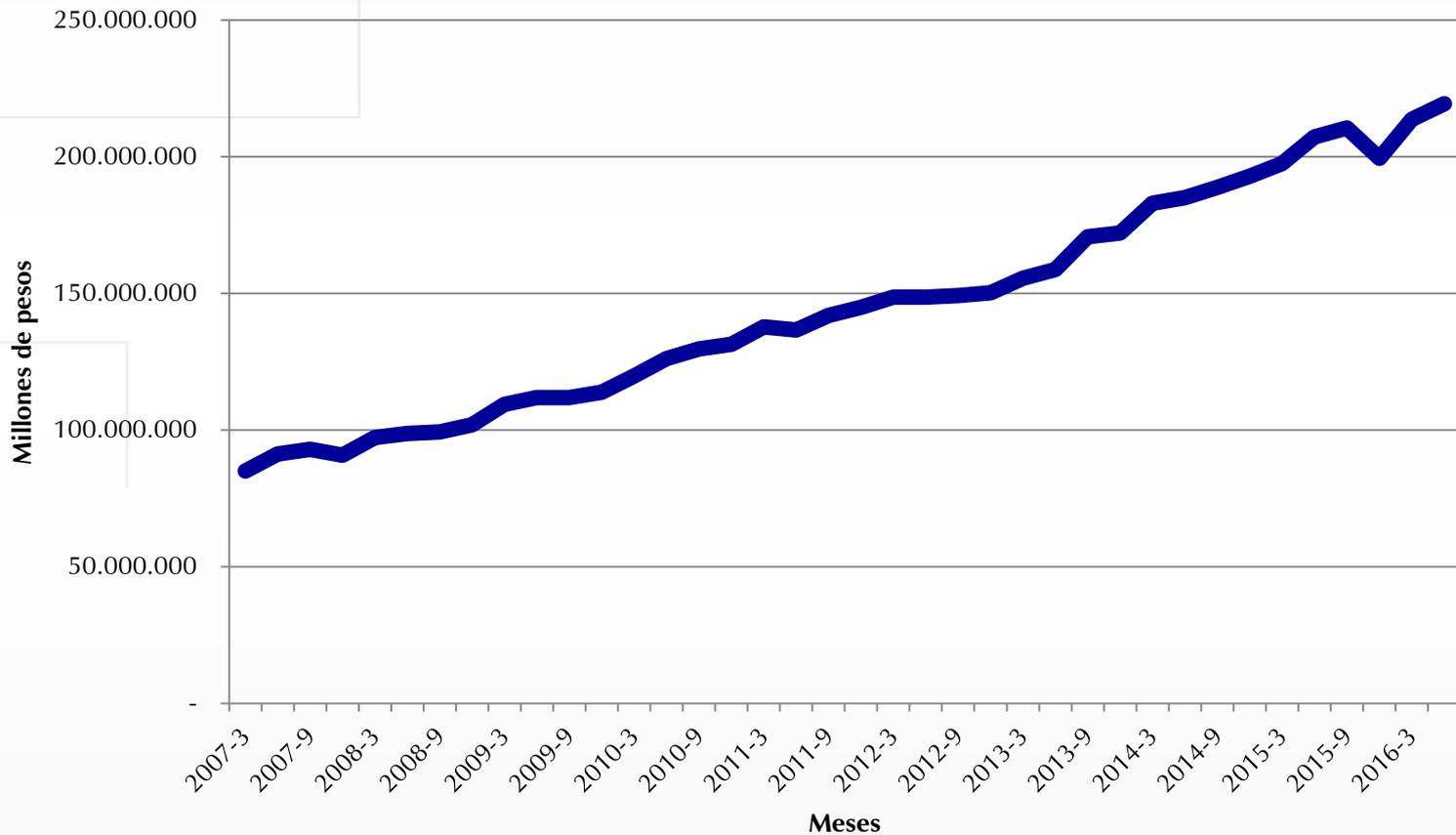
ESTADÍSTICAS



ESTADÍSTICAS

SALDOS DEPOSITADOS

(CIFRAS A SEPTIEMBRE 2016)

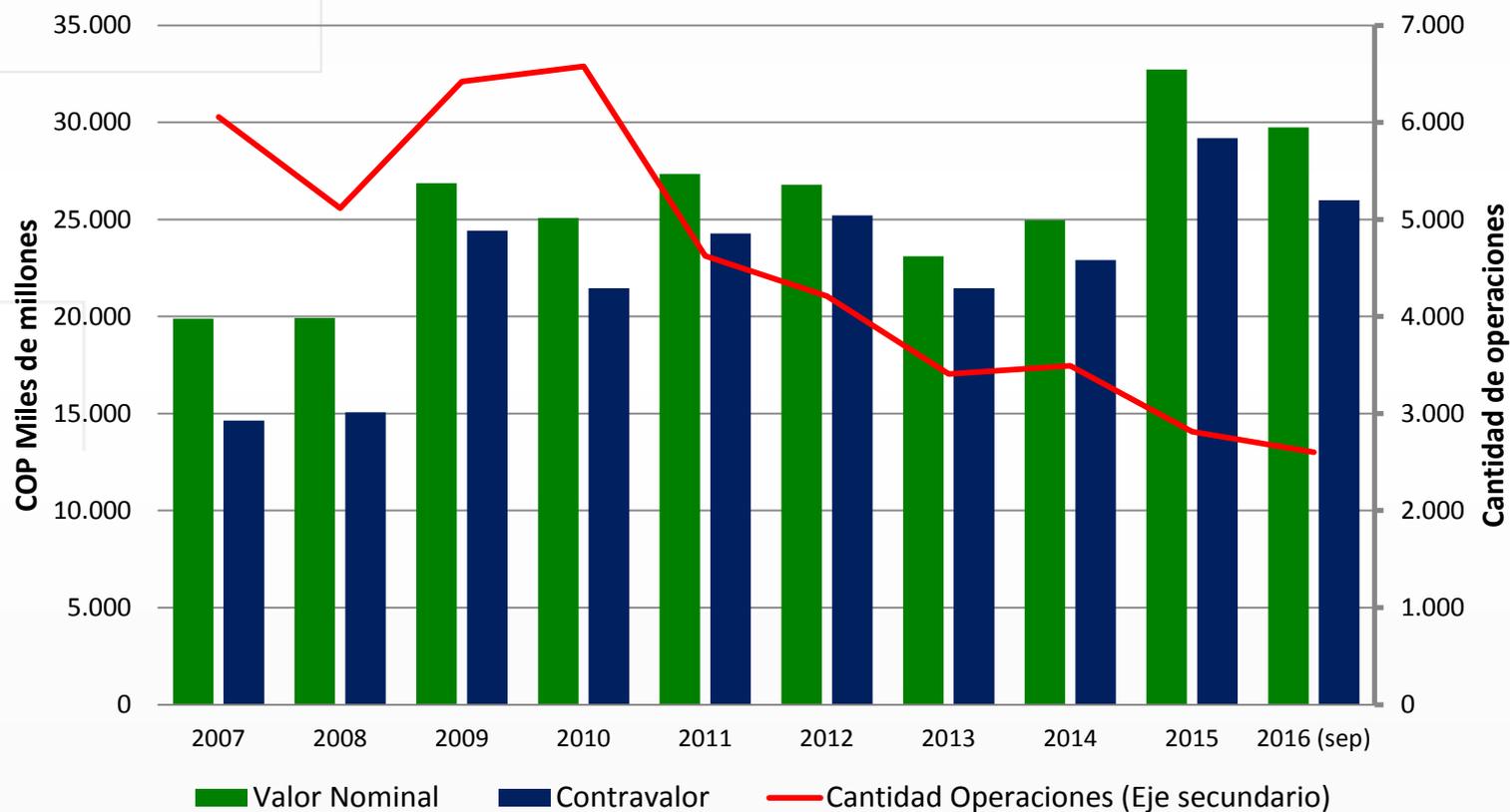


ESTADÍSTICAS

PROMEDIO DIARIO OPERACIONES DCV

Depósito Central de Valores

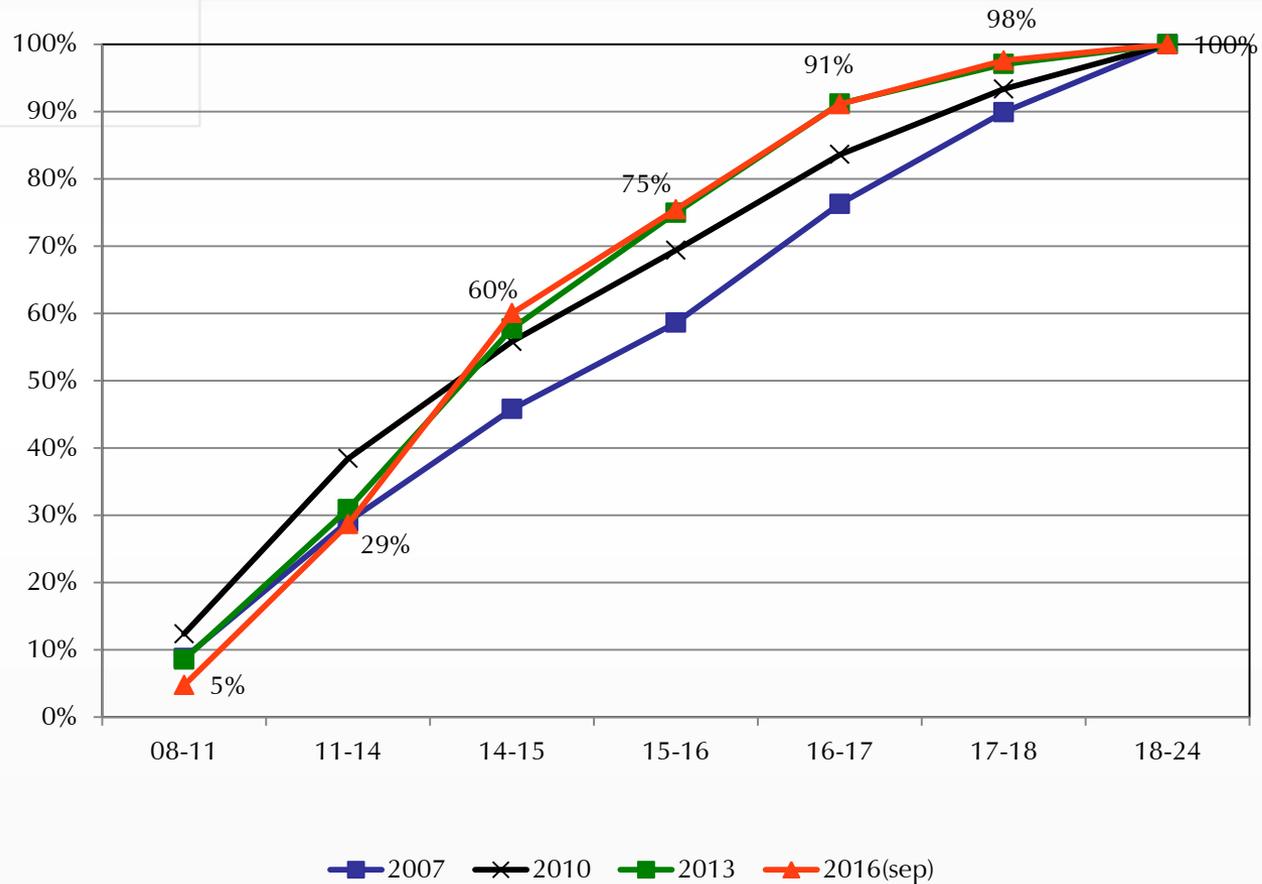
Operaciones cursadas - Promedios diarios



ESTADÍSTICAS

OPORTUNIDAD EN LA LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

(CIFRAS A SEPTIEMBRE 2016)

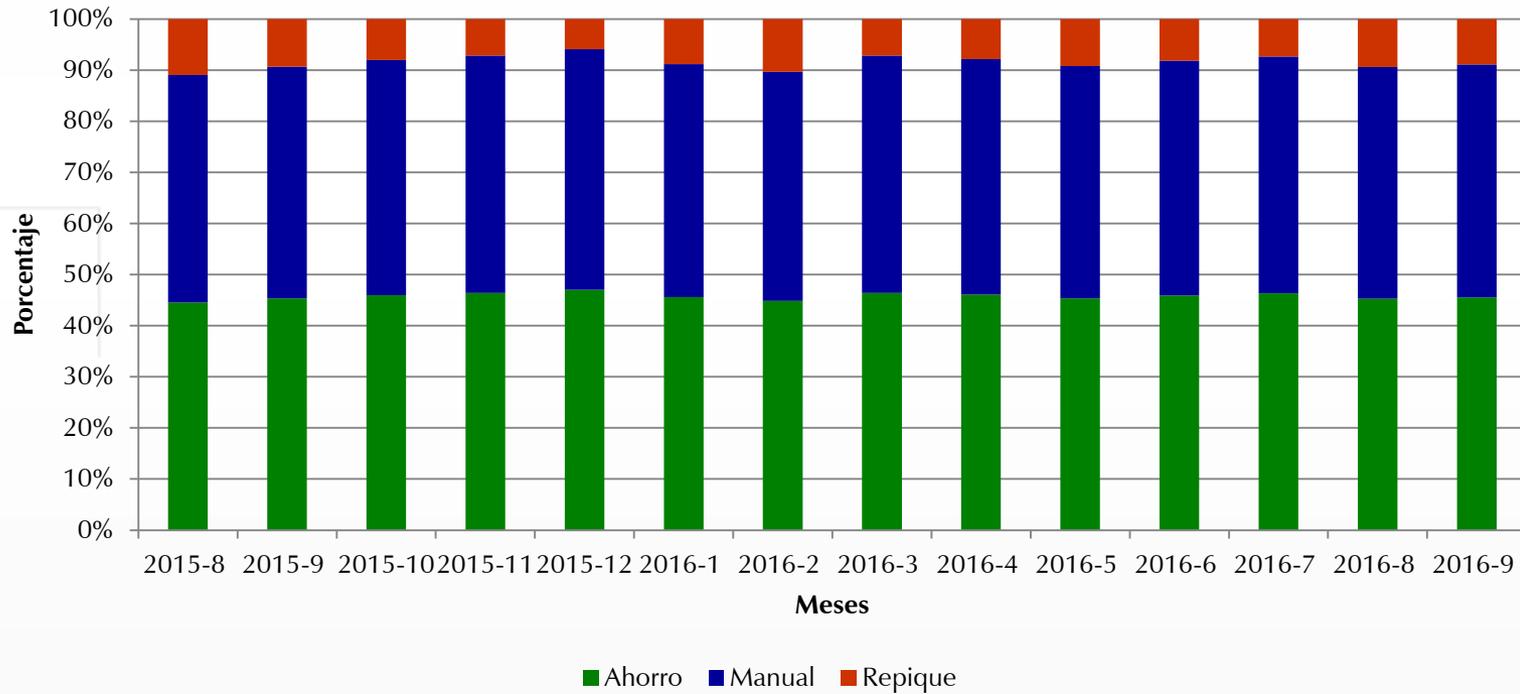


ESTADÍSTICAS

OPORTUNIDAD EN LA LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES

(CIFRAS A SEPTIEMBRE 2016)

MECANISMOS DE LIQUIDACIÓN (Cantidad de operaciones)



ENCUESTA DE SATISFACCIÓN



RESULTADOS ENCUESTA DE SATISFACCIÓN 2016

FACTOR DE SATISFACCIÓN	AÑO 2016	AÑO 2015	AÑO 2014	AÑO 2013	AÑO 2011
ASPECTO TECNOLÓGICO	4,4	4,5	4,3	4,6	4,5
TARIFAS	4,4	4,5	4,2	4,4	3,9
ATENCIÓN AL CLIENTE	4,2	4,4	4,1	4,4	4,5
TRANSPARENCIA	4,3	4,6	4,4	4,6	N/A
GESTIÓN DE LA INFORMACIÓN	4,2	4,4	4,1	4,4	N/A
GOBIERNO CORPORATIVO	4,7	4,8	4,8	4,7	N/A
GESTIÓN DEL RIESGO	4,4	4,5	4,4	4,7	N/A
TOTAL GENERAL	4,4	4,5	4,3	4,5	4,3

*Durante el segundo trimestre de 2016 se aplicó la encuesta de satisfacción a una muestra representativa de las entidades afiliadas al DCV.



COMPROMISOS REUNIÓN ANTERIOR



COMPROMISOS REUNIÓN ANTERIOR

- Evaluar la viabilidad de poner a disposición de los Administradores de los FIC una consulta por pantalla y la información de los vencimientos de los títulos: su viabilidad será evaluada en el primer trimestre de 2017.
- Revisar la viabilidad de incluir un ahorro de liquidez adicional, hacia las 6:30 p.m.

Se puede solicitar en casos excepcionales (neteo) un ahorro por demanda hasta las 6:15 p.m.; esto se hace mediante un correo enviado a la cuenta servicioalclienteDFV@banrep.gov.co.



INCIDENTES (AVANCES)

Funcionalidad	Descripción del Cambio	Estado
<p>Sistemas de negociación y de registro: el DCV no permitía modificar comprador o vendedor en los cierres recibidos, lo que obligaba a suprimir el cierre y crear uno nuevo con las modificaciones</p>	<p>Se modificaron algunas validaciones sobre los archivos provenientes de sistemas de negociación para permitir cambiar comprador y vendedor</p>	<p>Cerrado – instalado en producción el 18 de abril de 2016</p>



NUEVAS IMPLEMENTACIONES



GARANTÍAS EN OPERACIONES

REPO BR

Descripción	<p>Gestión de las garantías necesarias en las operaciones Repo con el Banco de la República.</p> <p>A partir de esta implementación se aplica al Repo BR el <i>haircut</i> a 1 día, independiente de su plazo.</p> <p>Permite dar un uso más eficiente a los recursos, al tener <i>haircuts</i> más bajos, requiriendo y liberando garantías por cambios en los precios de los títulos.</p>
Avances	<p>Puesto en producción en mayo de 2016 – boletín informativo 300.</p>



CLASIFICACIÓN DE INVERSIONISTAS

Descripción	<p>En la creación de subcuentas, se debe indicar el "Tipo de Inversionista" al que pertenece el titular de la subcuenta. Las opciones disponibles son:</p> <ul style="list-style-type: none">• Inversionista Extranjero• Portafolio de Pasivo Pensional• Otro <p>Si se requiere alguna modificación sobre el tipo de inversionista incluido, debe solicitarse al Banco de la República.</p> <p>Le permite al Banco llevar estadísticas más precisas sobre el tipo de tenedor de los títulos.</p>
Avances	<p>Puesto en producción el 19 de septiembre de 2015 - boletín informativo 297.</p>



REINVERSIONES DE FINAGRO

Descripción	<p>En procesos de reestructuración como fusiones o adquisiciones, los títulos que pertenecían al Depositante Directo absorbido pueden ser reinvertidos por el Depositante Directo absorbente.</p> <p>Permite hacer la reinversión de títulos que hayan sido trasladados por procesos de fusión, dado que anteriormente solo se podían reinvertir títulos que habían permanecido con el inversor primario.</p>
Avances	Puesto en producción el 18 de abril de 2016.



AJUSTES AL REPO INTRADÍA Y A REPORTES DE OPERACIONES A PLAZO

Descripción	<ul style="list-style-type: none">• En la conversión automática del Repo Intradía en <i>Overnight</i>, los intereses se cobran al vencimiento de la operación.• Se podrán encadenar los recursos de un repo intradía con TES provenientes de una TTV del FRECH, con la retrocesión de un Intradía de la misma naturaleza.• Se incluye la información de la operación inicial o a contado, en los reportes (“polígrafos”) de solicitudes de retrocesión de operaciones a plazo.
Avances	Puestos en producción el 16 de mayo de 2016 - boletín informativo 299.



DCV –HOMOLOGACIÓN IE 11 CON MODO DE COMPATIBILIDAD

De: Notificaciones Tecnológicas BanRep

Enviado el: miércoles, 26 de octubre de 2016 02:27 p.m.

Asunto: Homologación Internet Explorer 11 portal SEBRA y servicios asociados



Nos permitimos informar que a partir de la fecha todos los sistemas de información disponibles a través del Portal SEBRA funcionan con Internet Explorer 11, teniendo en cuenta la siguiente precisión:

	Con vista de compatibilidad *	Sin vista de compatibilidad
Servicios	DCV CUD HTRANS SUBASTAS	STA HTRANS GTA ANTARES CEDEC CENIT

*Nota: CEDEC y CENIT adicionalmente requieren de un software cliente (Gateway).
SEN es cliente-servidor.*

*Para mayor detalle de activación de la vista de compatibilidad ver documento anexo.



FUTURAS IMPLEMENTACIONES



FUTURAS IMPLEMENTACIONES

Sustitución de garantías	Funcionalidad que permitirá a los depositantes directos reemplazar los títulos transferidos como garantía, por otros que mantengan la cobertura del riesgo de mercado. La solución está compuesta por tres (3) pantallas. Mes esperado de puesta en producción: diciembre de 2016.
Aceptación de términos y obligaciones para operaciones del BRC	Al momento de activar las operaciones Repo Intradía y Repo <i>Overnight</i> por Compensación, el sistema del DCV solicitará aceptar los términos y obligaciones establecidos para las mismas. Mes esperado de puesta en producción: noviembre de 2016 – boletín informativo 302.



FUTURAS IMPLEMENTACIONES

<p>Sistemas de negociación y de registro: solicitudes de custodios para operaciones provenientes de sistemas externos</p>	<p>Se validará el numero de identificación del tenedor asociado a la subcuenta reportada por los sistemas de negociación o de registro. Actualmente el sistema solo admite el número de subcuenta.</p> <p>Los sistemas de negociación o de registro pueden tomar la decisión de no hacer ningún cambio, el DCV seguirá recibiendo la información en el formato actual.</p> <p>Mes esperado de puesta en producción: noviembre de 2016</p>



FUTURAS IMPLEMENTACIONES

Algunas modificaciones a las condiciones de los repos BR - *Haircuts* con prima de riesgo de liquidez

Se asignarán *haircuts* determinados para títulos con similares características financieras, incluyendo una prima por riesgo de liquidez de 50 pb, para títulos TES B a corto plazo y los títulos del BR que se reciben en las OMA, con menos de 30 observaciones de precio.

Esta condición no aplicará para otros títulos de deuda pública o títulos de deuda privada que ya que tienen establecido un *haircut* fijo que cubre todos los riesgos.

Los TES a corto plazo se recibirán en repo BR desde su creación.

Mes esperado de puesta en producción: noviembre de 2016. Las circulares reglamentarias se modificarán previo al ingreso en producción.



OTROS TEMAS DE INTERÉS



OTROS TEMAS DE INTERÉS

Registro de Interbancarios: ventajas para el back office

El SEN permite a las entidades autorizadas, además de la negociación, el registro de Interbancarios. Mediante este mecanismo, se puede ejercer un control eficiente y seguro al ciclo de la operación, desde la correcta validación de los términos financieros (monto, plazo y tasa), hasta la verificación del cumplimiento al vencimiento (control del plazo y del monto de la liquidación de los intereses).



OTROS TEMAS DE INTERÉS

Registro de Interbancarios: ventajas para el back office

Los controles son totalmente automatizados y posibles gracias a la interfaz entre los sistemas SEN, DCV y CUD. En esta operación los Agentes, a través de sus Administradores de Límites, por el Módulo de Administración del SEN, pueden establecer los límites mediante la fijación de cupos máximos de operación.

Las características funcionales y para el manejo de riesgo, se encuentran disponibles en la página Web del Banco de la República, www.banrep.gov.co, siguiendo la ruta Sistema Financiero/Sistemas de Pago/SEN/Reglamentación y Manuales/Manuales, en el archivo Manual de Operación



OTROS TEMAS DE INTERÉS

Transferencia de archivos no interactiva: ventajas (1/2)

- Permite enviar al DCV de forma masiva, la información de las operaciones de Transferencia libre de pago (código 423) y Compraventa entrega contra pago (código 420) para su compensación y liquidación, evitando digitar operación por operación por pantalla; reduce la operatividad asociada a la complementación de las constancias de enajenación.
- Utiliza la seguridad de mecanismo GTA.
- Se minimizan los errores humanos al no tener que digitar.
- El proceso y creación de las operaciones es ágil y seguro.



OTROS TEMAS DE INTERÉS

Transferencia de archivos no interactiva: ventajas (2/2)

- Se identifica que el usuario tenga los permisos para realizar este tipo de operaciones.
- Para mayor información, consultar el Manual de operación del DCV – “Mercado Secundario” y en el Anexo “Transferencia en lote”.



ALGUNAS RECOMENDACIONES



ALGUNAS RECOMENDACIONES

- La programación de capacitaciones del DCV, se puede consultar en la página www.banrep.gov.co siguiendo la ruta: Sistema Financiero/Sistemas de Pago/DCV/Trámites y Servicios/Servicios archivo Programa de capacitación año 2016. Adicionalmente se pueden solicitar capacitaciones por demanda.
- Cuando se presente lentitud en el sistema DCV, revisar su configuración y conexiones. En caso de no poder solucionarlo, favor reportarlo al Centro de Soporte 3431000 o al Centro de Atención telefónica del DFV 3430444.



PREGUNTAS E INQUIETUDES



GRACIAS

