Estructura de archivo de emisiones vigentes y de haircuts

Última modificación Martes, 20 de octubre de 2026
Versión 1.03 publicada el 15 de enero de 2024

Esta información está sujeta a cambios sin previo aviso por parte del Banco de la República. Su actualización será informada por las vías que el Banco de la República considere pertinentes. Para referencia de los lectores, se incluirá una descripción de los principales cambios en la sección Historial de versiones.

Historial de versiones

FechaVersiónCambios2024-01-091.03 APROBADOAjuste a los nombres de los archivos para cumplimiento de lineamientos del departamento de Comunicaciones2022-05-231.02 APROBADOAjuste en el reporte de emisiones vigentes para incluir la fecha de emisión del ISIN2022-05-031.01 APROBADOAjuste en el reporte de emisiones vigentes sobre el campo Tasa de Interés y el Valor Tasa de interés2021-06-011.00 APROBADODocumento aprobado1. Introducción
La estructura y contenido de los archivos con que se publican en la página web del Banco de la República las "Emisiones vigentes" y los "*Haircuts* deuda externa" y "*Haircuts* Repos BR" sufrirán modificaciones debido a actualizaciones tecnológicas. La fecha esperada de liberación del nuevo formato es el 1 de abril de 2024.

A continuación, se especifican los cambios a introducir en los mencionados archivos.

2. Emisiones vigentes
En la actualidad se publican en forma separada la información de las emisiones vigentes (archivo "Emisiones vigentes en el DEpósito Central de Valores, DCV") de la información de los títulos transferidos en operaciones a plazo (archivo "Emisiones comprometidas operaciones a plazo vigentes").

Con la nueva estructura se fusionará en un único archivo Excel la información de las emisiones con la de los títulos transferidos en operaciones a plazo, el que tendrá las siguientes especificaciones:

Información
Códigos ISIN (*International Securities Identification Number* o Número Internacional de Identificación de Valores) vigentes

Nombre del archivo
caracteristicas-financieras-titulos-vigentes.xlsx

Descripción
Presenta los códigos ISIN vigentes en el DCV a la fecha de corte de la información, junto con las características financieras y el valor nominal comprometido en operaciones a plazo (Repos, simultáneas y préstamos de valores).

Disponibilidad
Público en general

Frecuencia de publicación

Diaria (días hábiles)

Rangos de consulta
No aplica

Corte de información
Fecha en que se obtuvo la información

DatosCabecera
Fecha de corte de la información.

Detalle
Categoría del título: Nombre interno de la categoría del instrumento financiero.

ISIN: Código ISIN del instrumento financiero.

Mnemotécnico: Código inteligente que se le asigna al título para su identificación.

Denominación: Moneda o unidad (en denominación original) en que está expresado el valor facial o nominal de un título.

Plazo: Plazo del ISIN

Fecha de emisión: Fecha de inicio de conteo del plazo

Fecha de vencimiento: Fecha fin del plazo

Tipo de tasa: Tasa de interés del título (variable, fija o indexada).

Tasa de interés: Estará compuesto de la siguiente forma para títulos con rentabilidad atada a una tasa variable: (factor + índice) + signo + spread, donde:

- “factor”: Porcentaje por el que se afecta el indicador para determinar la rentabilidad del título. Si no está incluido, significa que el “factor” = 1, es decir, se toma el 100% del índice. El “factor” será incluido cuando el porcentaje a tomar del índice sea diferente al 100%, en cuyo caso se mostraría en porcentaje y con 4 decimales. A modo de ejemplo, como sigue:
  ? Si factor es igual a 1 y el índice es IPC se vería "IPC"
  ? Si factor es el 80% del IPC se vería "80,0000% IPC"
- “spread”: Puntos que se adicionan o restan a la tasa de rentabilidad del título. Si no se adicionan ni restan puntos, es decir, si el spread = 0, no será incluido. Cuando a la tasa se le deban adicionar o restar puntos, se mostrará el signo + o - y el valor con 4 decimales A modo de ejemplo, como sigue:
  ? Si el índice es DTF y no se le suman ni restan puntos; se vería "DTF"
  ? Si el índice es DTF y se le restan dos (2) puntos; se vería "DTF - 2,0000"
- Entre cada parte de la composición existirá un espacio

En caso de representar la rentabilidad del título una tasa fija, se incluirá el valor correspondiente con 6 decimales.

Valor tasa de interés: contendrá el valor calculado de la tasa variable a la fecha del día hábil inmediatamente anterior. Tratándose de títulos con tasa fija, el valor corresponderá al mismo indicado en "Tasa de interés".

Periodicidad rendimientos: Periodicidad de pago de rendimientos del ISIN

Saldo: Monto en circulación del ISIN (en denominación original).

Valores por ISIN en operaciones a plazo - Valores nominales

Repos: Valor nominal del ISIN en operaciones repo.

Simultáneas: Valor nominal del ISIN en operaciones simultáneas

Transferencia temporal de valores / objeto de la operación: Valor nominal del ISIN dado en préstamo de valores.

Transferencia temporal de valores / transferencia a cambio: Valor nominal del ISIN recibido como colateral en operaciones TTV.

Ejemplo
caracteristicas-financieras-titulos-vigentes.xlsx

3. *Haircuts* deuda externa y *Haircuts* Repos BR

La información de los *haircuts* de Repos BR se publica en un archivo Excel mientras que la información de los *haircuts* de deuda externa en un archivo de formato PDF.

Con el cambio de formato, aunque se mantendrán dos archivos, se unificará el formato y la estructura, advirtiendo que los archivos históricos mantendrán la estructura en que fueron publicados.

Especificaciones de la nueva estructura (aplica tanto para "*Haircuts* Repos BR" como para "*Haircuts* deuda pública"):

Información
Haircuts

Nombre del archivo
<mes>-<año>-haircut-<tipo-deuda>.xlsx

Donde:
<mes> corresponde al nombre del mes completo en letras
<año> corresponde al año seleccionado
<tipo-deuda> corresponde al tipo de deuda: interna o externa

Ejemplo: **enero-2024-haircut-externa**.xlsx

Descripción
Presenta el *haircut* calculado para cada uno de los ISIN vigentes en el sistema, de deuda externa o interna, asociado a cada uno de los plazos permitidos en operaciones a plazo.

Cada archivo contiene la información por año y mes, para los últimos 24 meses.

Disponibilidad
Público en general

Frecuencia de publicación
Mensual (primer día hábil del mes)

Rangos de consulta
El reporte incluye información desde el primer día calendario del mes hasta el último día calendario del mes correspondiente a la fecha de consulta del reporte.

Corte de información
No aplica

DatosCabecera
Periodo: Rango de rechas al que corresponde la información.
Tipo de deuda: Indica si el archivo consultado corresponde a deuda externa o deuda interna.

Detalle
ISIN: Identificador ISIN del instrumento financiero.
Plazo: Duración de la operación repo.
***Haircut*:** Porcentaje en que se descuenta el valor de mercado del ISIN para proteger a quien lo reciba, en operaciones a plazo, del riesgo de mercado y de liquidez

Ejemplos
- septiembre-2020-haircut-externa.xlsx
- septiembre-2020-haircut-interna.xlsx

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/sistemas-pago/dcv/estructura-archivo-emisiones-vigentes-haircuts