



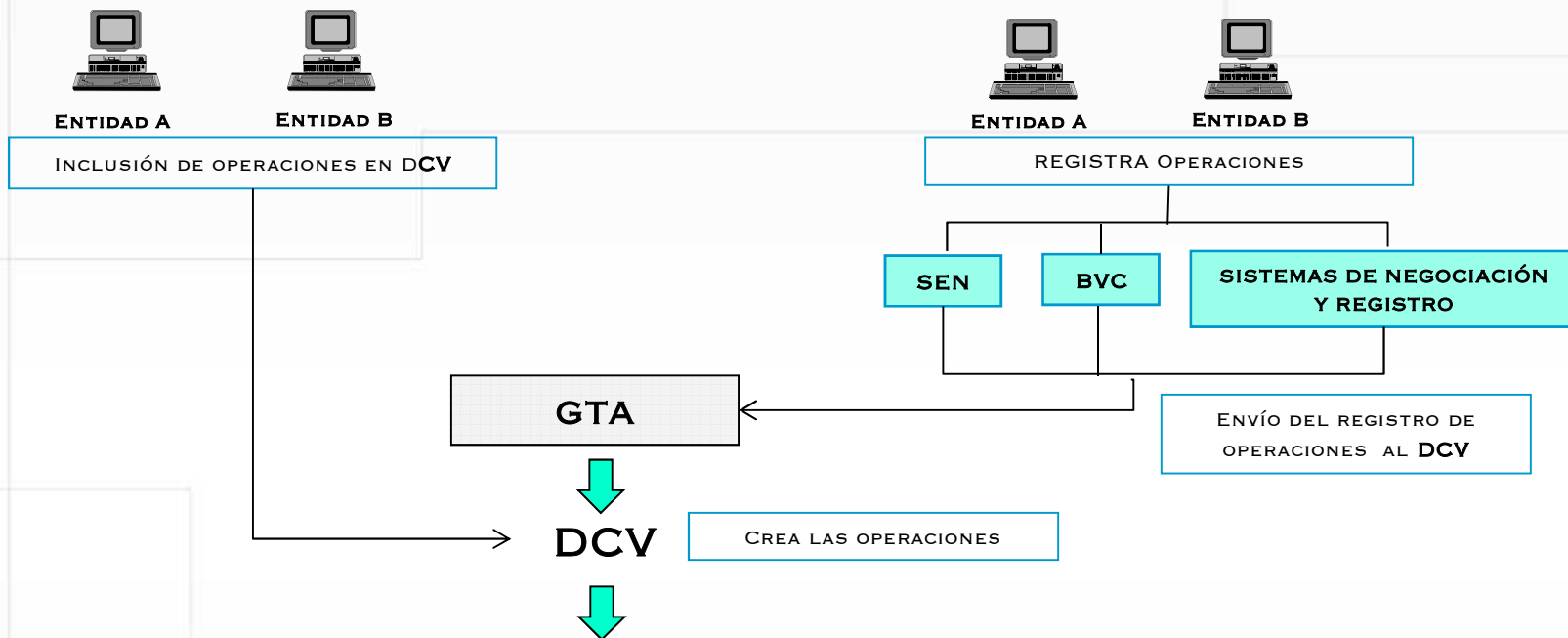
# DEPÓSITO CENTRAL DE VALORES

DEPARTAMENTO DE FIDUCIARIA Y VALORES  
(CUMPLIMIENTO Y LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES EN EL DCV)

---

Subgerencia de Operación Bancaria  
Departamento de Fiduciaria y Valores

# PROCESO DE CUMPLIMIENTO

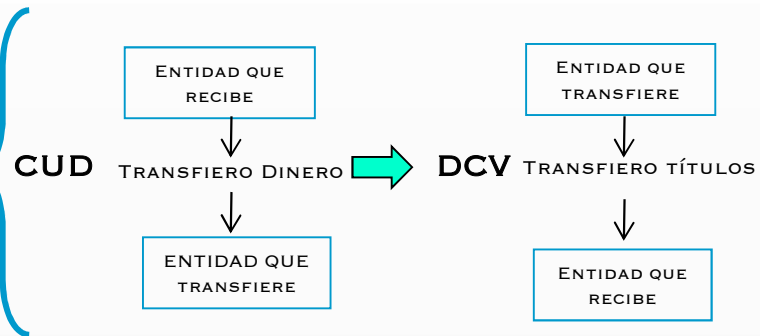


## LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES EN FORMA INTERACTIVA Y NO INTERACTIVA

**INTERACTIVA:** (LIQUIDACIÓN ORDENADA POR EL OPERADOR)

**NO INTERACTIVA:** REPIQUE Y FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ

HAY SALDOS DE DINERO ? HAY TÍTULOS ?



# **MECANISMOS AUTOMÁTICOS (NO INTERACTIVOS) DE COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES**



# FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ (FAL)



# OBJETIVOS DE LA FAL

- EL PROPÓSITO ES OPTIMIZAR LA LIQUIDEZ EXISTENTE EN UN MOMENTO DADO DEL DÍA.
- CON LOS SALDOS EXISTENTES PRETENDE LIQUIDAR EL MAYOR NÚMERO POSIBLE DE OPERACIONES.
- AL FINALIZAR EL CICLO DE LIQUIDACIÓN, LOS SALDOS RESULTANTES EN LAS CUENTAS DEBEN SER CERO Ó POSITIVOS, TANTO EN LAS DE TÍTULOS COMO EN LAS DE EFECTIVO.
- LA FACILIDAD CONSERVA EL PRINCIPIO DE LIQUIDACIÓN BRUTA Y EN TIEMPO REAL, ESTO ES, OPERACIÓN POR OPERACIÓN Y DE FORMA CONTINUA.



# FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ (FUNCIONAMIENTO)

EL PROCESO TOMA LAS OPERACIONES DE SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y REGISTRO (COMPRAVENTA 422, TRANSFERENCIAS 423, SIMULTANEAS 435 Y RETROSIMULTÁNEAS 495) Y LAS TRANSFERENCIAS EN LÍNEA, QUE SE ENCUENTREN EN ESTADO POR ACTIVAR “V”. NO TOMA LA COMPRAVENTA EN LÍNEA (420)

ESTABLECE EL SALDO EN TÍTULOS, TENIENDO EN CUENTA EL CÓDIGO DE INTERMEDIARIO, EL PORTAFOLIO, EL NÚMERO DE CONTRATO (SUBCUENTA) Y EL NÚMERO DE EMISIÓN AFECTADO EN LA OPERACIÓN Y EL SALDO EN DINERO DE LA ENTIDAD A LA HORA EN QUE SE INICIA EL PROCESO.

DURANTE EL PROCESO, LAS CUENTAS DE DINERO Y DE TÍTULOS INVOLUCRADAS SE BLOQUEAN PARA PODER ESTABLECER LAS POSICIONES DE CADA UNO DE ELLOS.

CON LAS OPERACIONES SELECCIONADAS INICIA EL PROCESO DE OPTIMIZACIÓN.

INICIA EL PROCESO DE ACTIVACIÓN OPERACIÓN POR OPERACIÓN ORDENANDO LAS OPERACIONES EN FORMA ASCENDENTE (POR NUMERO DE OPERACIÓN).

## HORARIOS DE EJECUCIÓN

➤ 11:50 14:20 15:30 16:15 16:50 17:45 POR DEMANDA



# FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ (FUNCIONAMIENTO)

SI LA POSICIÓN EN TÍTULOS ES NEGATIVA: EL PROCESO EXCLUYE OPERACIONES TOMANDO LA DE MENOR VALOR NOMINAL Y SUCESIVAMENTE HASTA QUE LA POSICIÓN SEA CERO O POSITIVA.

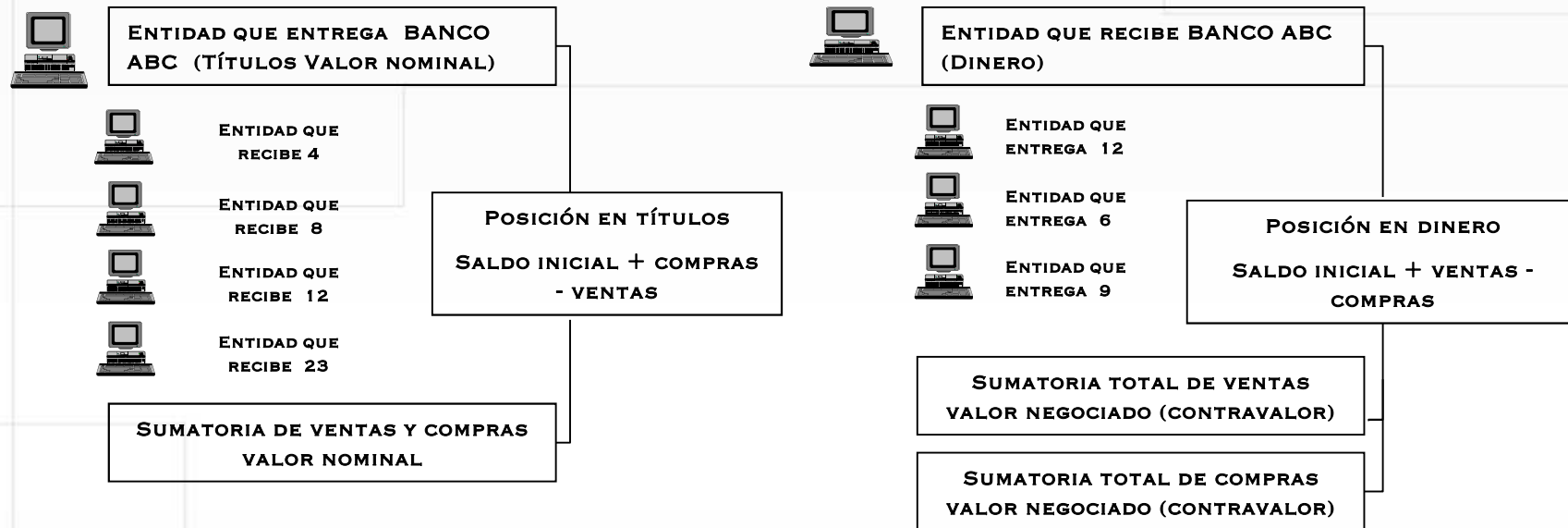
SI LA POSICIÓN EN DINERO ES NEGATIVA: EL PROCESO EXCLUYE OPERACIONES TOMANDO LA DE MENOR VALOR COMPENSADO EN DINERO Y SUCESIVAMENTE HASTA QUE LA POSICIÓN SEA CERO O POSITIVA.

EL PROCESO EXCLUYE LAS OPERACIONES QUE NO CUMPLEN CON LOS MÚLTIPLOS DEFINIDOS PARA CADA TÍTULO Y AQUELLAS QUE REQUIEREN COMPLEMENTAR CONSTANCIAS, AFECTANDO TANTO A LA ENTIDAD QUE VENDE COMO A LA QUE COMPRA.



# FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ

## POSICIONES EN TÍTULOS Y DINERO



LAS POSICIONES NETAS PUEDEN SER CONSULTADAS DESDE LAS 10:50 A.M., Y A PARTIR DE ALLÍ CADA 20 MINUTOS APROXIMADAMENTE EL SISTEMA HACE UNA ACTUALIZACIÓN DEL REPORTE DE POSICIONES, HASTA LAS 19:30 P.M.

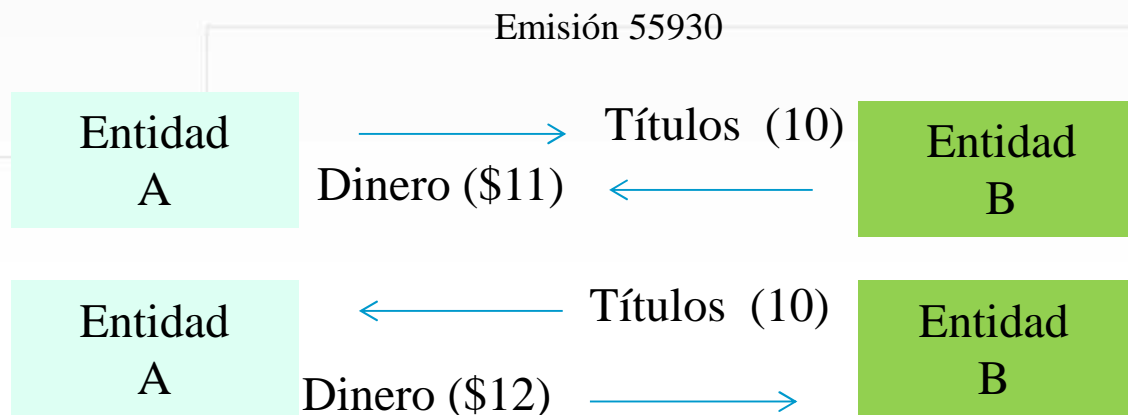
EL INTERMEDIARIO PUEDE INGRESAR A UNA PANTALLA PARA CONSULTAR SUS POSICIONES, CON EL FIN DE CONOCER COMO ESTÁN EN ESE MOMENTO TANTO EN DCV COMO EN CUD.





# FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ

OPERACIONES CON LAS MISMAS CONDICIONES (EMISIÓN - VALOR NOMINAL) ENTRE DOS ENTIDADES



LA ENTIDAD “A” ENTREGA A LA ENTIDAD “B” UN VALOR NOMINAL DE 10, A SU VEZ LA ENTIDAD “B” ENTREGA EL MISMO VALOR NOMINAL; LA DIFERENCIA SE PRESENTA EN EL DINERO; EN ESTE CASO, DICHO VALOR DEBE ESTAR DISPONIBLE EN LA CUENTA DE DEPÓSITO PARA LOGRAR LA OPTIMIZACIÓN. (DEBEN CUMPLIR CON LAS CONDICIONES DE IGUAL EMISIÓN, PORTAFOLIO Y SUBCUENTA)



# REPORTE DE POSICIONES

- 1. MENÚ DEPOSITO CENTRAL DE VALORES
  - 6. FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ
    - 1. LISTADO DE POSICIONES

LISTA POSICIONES NETAS AHO-LIQ - Internet Explorer



## Depósito Central de Valores

### AHORRO DE LIQUIDEZ LISTADO DE POSICIONES

ogalmpa  
2017/05/18  
11:17:34

Codigo Intermediario:

Fecha	Hora	Observaciones
20170518		

[Principal](#)  
[\\_listados](#)  
[\\_logs Reportes](#)  
[Terminar Sesion](#)  
[Contactenos](#)



# REPORTE DE POSICIONES

BANCO DE LA REPUBLICA  
 FIDUCIARIA Y VALORES  
 AHOLIQ\_POS - ogalinpa

DEPOSITO CENTRAL DE VALORES - DCV

FECHA : 2017/05/19  
 HORA : 12:32:03  
 PAGINA: 1

AHORRO DE LIQUIDEZ - ESTADO DE POSICIONES  
 DE 20170519 A LAS 11:30

012	BANCO						
PORT.	SUBCTA	EMISION	MNEMONICO	ISIN	SALDO A LA HORA DE EJECUCION	POSICION	FALTANTE
00	000000-0	051927	TFIT15240720	COL17CT02302	437,004,400,000.00	140,000,000,000.00-	0.00
00	000000-0	053059	TFIT16240724	COL17CT02385	212,100,000.00	0.00	0.00
00	000000-0	054542	TFIT15260826	COL17CT02625	55,800,000.00	0.00	0.00
00	000000-0	054816	TFIT10040522	COL17CT02864	240,106,100,000.00	0.00	0.00
00	000000-0	054876	TUVT10100321	COL17CT02872	100,161,000.00	0.00	0.00
00	000000-0	055197	TUVT20250333	COL17CT02963	140,000.00	10,000,000.00-	9,860,000.00
00	000000-0	055408	TUVT06170419	COL17CT03003	0.00	0.00	0.00
00	000000-0	055420	TFIT06110919	COL17CT03011	520,197,100,000.00	85,000,000,000.00-	0.00
00	000000-0	055738	TUVT11070525	COL17CT03359	10,000,000.00	10,000,000.00-	0.00
00	000000-0	055930	TUVT20040435	COL17CT03441	10,000,000.00	10,000,000.00-	0.00
00	000000-0	056059	TFIT16300632	COL17CT03490	6,000,000,000.00	500,000,000.00-	0.00

CUENTA: 62011200  
 SALDO A LA HORA DE EJECUCION: 1,346,550,048,904.45  
 POSICION: 272,905,212,639.00  
 FALTANTE: 0.00



# EXCLUSIÓN MANUAL DE OPERACIONES PARA QUE NO LAS TOME LA FAL

MEDIANTE ESTA FUNCIONALIDAD SE PUEDEN MARCAR LAS OPERACIONES QUE NO QUIEREN QUE PARTICIPEN EN EL PROCESO.

- 1 - MENÚ DEPOSITO CENTRAL DE VALORES
- 6 - FACILIDAD DE AHORRO DE LIQUIDEZ
- 2 - EXCLUSIÓN DE OPERACIONES

EXCLUSION OPERACION AHORRO LIQ. - Microsoft Internet Explorer

**Depósito Central de Valores**

**EXCLUSIÓN OPERACIONES AHORRO LIQUIDEZ**

MIR  
Intermediario 227 Portafolio Todos Sistem Neg SEN Operacion 422-CPRVTA SIST. EXTER.

EXC.	Numero Estado Portafolio	Valor Nominal	Valor Contrapago	Emision	Fecha Neg.	No. Cierre
<input checked="" type="checkbox"/>	43913 Por Activar 00	5,000,000,000.00	6,079,180,000.00	48289	2006/06/07	99
<input checked="" type="checkbox"/>	43975 Por Activar 00	4,000,000,000.00	4,883,984,000.00	48289	2006/06/07	160
<input type="checkbox"/>	44031 Por Activar 00	4,000,000,000.00	4,887,344,000.00	48289	2006/06/07	181
<input type="checkbox"/>	44212 Por Activar 00	1,000,000,000.00	1,084,482,000.00	44822	2006/06/07	271
<input type="checkbox"/>	83855 Por Activar 00	1,000,000,000.00	1,213,626,000.00	48289	2006/06/07	91
<input type="checkbox"/>	83955 Por Activar 00	2,500,000,000.00	3,054,340,000.00	48289	2006/06/07	162
<input type="checkbox"/>	83958 Por Activar 00	1,000,000,000.00	1,221,826,000.00	48289	2006/06/07	165
<input type="checkbox"/>	83959 Por Activar 00	1,000,000,000.00	1,221,736,000.00	48289	2006/06/07	166
<input type="checkbox"/>	83965 Por Activar 00	1,000,000,000.00	1,221,836,000.00	48289	2006/06/07	172
<input type="checkbox"/>	84019 Por Activar 00	2,000,000,000.00	2,402,998,000.00	47428	2006/06/07	190
<input type="checkbox"/>	84020 Por Activar 00	2,000,000,000.00	2,403,318,000.00	47428	2006/06/07	191
<input type="checkbox"/>	84133 Por Activar 00	2,000,000,000.00	2,441,652,000.00	48289	2006/06/07	233
<input type="checkbox"/>	84157 Por Activar 00	2,000,000,000.00	2,443,272,000.00	48289	2006/06/07	255
<b>Total Operaciones</b>				13	de	18

Mirar Siguiete Anterior Activar Terminar



# REPIQUE



# REPIQUE

PROCESO AUTOMÁTICO DE ACTIVACIÓN DE OPERACIONES QUE SE EJECUTA DENTRO DE LOS SIGUIENTES HORARIOS:

EL PRIMER PROCESO DE ACTIVACIÓN POR REPIQUE ES A LAS 7:03 Y ACTIVA LAS RETROCESIONES DE LOS DEPÓSITOS REMUNERADOS Y LAS RETROCESIONES DE LOS REPOS DE TERCEROS.

LOS SIGUIENTES PROCESOS DE REPIQUE SE EJECUTAN EN HORARIOS ESTABLECIDOS A LAS 2:50 P.M. - 4:25 P.M. - 5:55 P.M. Y ACTIVAN TODAS LAS OPERACIONES QUE CUMPLAN CON LA DISPONIBILIDAD DE SALDOS EN TÍTULOS Y DINERO PARA SU LIQUIDACIÓN.

A PARTIR DE LAS 6:30 P.M., SE EJECUTA EL PROCESO DE REPIQUE CADA 30 MINUTOS (6:30 - 7:00 - 7:30 - 8:00)

EL PROCESO ACTIVA, UNA A UNA, TODAS LAS OPERACIONES QUE ESTÉN EN ESTADO “V” “POR ACTIVAR” VERIFICANDO LA PARTE Y LA CONTRAPARTE, SIEMPRE Y CUANDO TENGAN SALDO SUFICIENTE EN TÍTULOS Y DINERO



# CONSULTA DE OPERACIONES

TODAS LAS OPERACIONES QUE FUERON ACTIVADAS POR LOS MECANISMOS DE COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN SE MUESTRAN EN EL EXTRACTO TANTO DEL CUD COMO DEL DCV.

LAS OPERACIONES EN SUS DIFERENTES ESTADOS SE PUEDEN CONSULTAR POR LA PANTALLA DE “CONSULTA DE OPERACIONES” EN EL SISTEMA DCV.



# PANTALLA DE CONSULTA OPERACIONES

1. MENÚ DEPOSITO CENTRAL DE VALORES
  5. CONSULTA/INFORMES
    4. CONSULTA DE OPERACIONES
      1. POR INTERMEDIARIO Y SISTEMA DE NEGOCIACIÓN

IOP13 - CONSULTA DE OPERACIONES - Internet Explorer



## Depósito Central de Valores



**\*CONSULTA DE OPERACIONES**

MIR

Fecha de Operacion  Cod. Int.  Ent.  Ciudad

Estado  Operacion DCV  Sist.Negociacion

Operac.	C.Ope	Int/Ent.	Emision / Cod. ISIN	Valor Nominal	Fec.Negociac....	Sis.Ext.	Usuario
Ope.	C.Ope	Int/Ent.	Valor Compensado	Hora Act.	No. Cierre	Contraparte	
<input type="checkbox"/>	43003	Activada	376 - 00	10,000,000,000.00	2017/05/12	BVC	
RTRSI	495		51927 COL17CT02302	12,376,683,258.00	11:50:24	577	BCO SANTANDER N
<input type="checkbox"/>	43004	Activada	376 - 00	10,000,000,000.00	2017/05/12	BVC	
RTRSI	495		51927 COL17CT02302	12,376,683,258.00	11:50:24	590	BCO SANTANDER N
<input type="checkbox"/>	43015	Activada	376 - 00	4,000,000.00	2017/05/16	BVC	
RTRSI	495		55408 COL17CT03003	1,024,682,276.00	11:50:24	519	ALIANZA VALORES
<input type="checkbox"/>	43030	Por Activar	376 - 00	5,000,000.00	2017/05/16	BVC	
RTRSI	495		55408 COL17CT03003	1,280,342,515.00	20:50:44	673	ADCAP COLOMBIA
<input type="checkbox"/>	43031	Por Activar	376 - 00	10,000,000.00	2017/05/16	RVC	
RTRSI	495		54876 COL17CT02872	2,588,586,486.00	20:50:44	2006	FIDUC.CORFICOLO
<input type="checkbox"/>	43050	Activada	376 - 00	10,000,000,000.00	2017/05/17	SEN	
RTRSI	495		56059 COL17CT03490	10,764,633,883.00	11:50:24	1300	JPMORGAN CORP.F
<input type="checkbox"/> Resumen				Total Operaciones Consultadas		6 de 196	







**GRACIAS**