



Banco de la República
Bogotá D. C., Colombia

Departamento de Fiduciaria y Valores

**CESIÓN DE OBLIGACIONES/DERECHOS EN
OPERACIONES SIMULTÁNEAS Y REPOS**

(Versión preliminar para comentarios)

03 de octubre de 2014



CONTENIDO

	Pág.
CONTENIDO	3
1 INTRODUCCIÓN	4
1.1 OBJETO	4
1.2 ALCANCE	4
1.3 AUDIENCIA	4
2 CESIÓN DE OBLIGACIONES/DERECHOS EN OPERACIONES A PLAZO VIGENTES.....	5
2.1 OBJETO	5
2.2 ALCANCE	5
2.2.1 Datos	5
2.3 PROCEDIMIENTO	5
2.4 CONSIDERACIONES ADICIONALES	7
2.5 RIESGOS	8



1 INTRODUCCIÓN

1.1 OBJETO

El presente documento define la operatividad que ofrece el Banco de la República a los Depositantes Directos que en el marco de lo establecido por los Decretos 1242 y 1243 de 2013 deben ceder, en su calidad de administradores de Fondos de Inversión Colectiva, las obligaciones o derechos de las operaciones Simultáneas y Repos en las que participen los fondos administrados, vigentes al momento de transferir los activos del Fondo a los Depositantes Directos que acturan como Custodios.

1.2 ALCANCE

El presente documento hace referencia exclusivamente a la operatividad que se debe seguir para realizar en el Depósito Central de Valores, la cesión de las obligaciones o derechos de las señaladas operaciones, cuya fecha de vencimiento sea posterior a la fecha de la cesión, con el fin de que sean cumplidas al vencimiento por parte de los Depositantes Directos que desarrollaran la actividad de Custodios.

1.3 AUDIENCIA

Este documento está dirigido a los funcionarios del Banco de la República y a los empleados de las entidades que participan en el nuevo esquema de custodios.



2 CESIÓN DE OBLIGACIONES/DERECHOS EN OPERACIONES A PLAZO VIGENTES

2.1 OBJETO

El propósito de este proceso es el de definir las actividades a seguir por los Depositantes Directos (DD) que deseen modificar las operaciones Simultáneas y Repos vigentes en el Depósito Central de Valores, de manera que al llegar a su vencimiento éstas sean cumplidas o liquidadas por el DD que se indique en el cambio.

2.2 ALCANCE

El proceso de cesión de obligaciones o derechos en operaciones a plazo vigentes afecta o requiere las siguientes aplicaciones del Banco de la República:

- Depósito Central de Valores: DCV
- Sistema de Cuentas de Depósito: CUD
- Infraestructura de Gestión de Solicitudes: GENS
- Infraestructura de Llave Pública: SUCED

2.2.1 Datos

Los datos para este proceso deben afectar la información registrada en las bases de datos del ambiente de producción del DCV.

2.3 PROCEDIMIENTO

El DD que cederá las obligaciones o derechos de las operaciones deberá enviar un correo debidamente cifrado con la herramienta SUCED, o la que en un futuro la reemplace, a más tardar a las 9:00 a.m., a la cuenta de correo ServicioalClienteDFV@banrep.gov.co, con el asunto: “Solicitud Cesión de Derechos y obligaciones <Nombre del Depositante Directo>”. En el correo el DD debe solicitar el envío de un archivo Excel con la información de las operaciones Repos y Simultáneas vigentes a la fecha, en las que participe tanto como comprador como vendedor; especificando la cuenta y el portafolio (cuando actúe por cuenta propia) o la cuenta, portafolio y subcuenta (cuando sea por cuenta de terceros).

El DCV generará un archivo Excel con la información solicitada por el DD con los campos que se detallan a continuación y lo remitirá a la entidad cifrado con la



herramienta SUCED, o la que en un futuro la sustituya, máximo una hora después de haber recibido la solicitud por parte de la entidad:

- Ciudad: numérico de dos posiciones:
- Fecha Operación: numérico de 8 posiciones en formato AAAAMMDD, donde AAAA es el año MM el mes y DD el día en que se cumplió la operación.
- Número de operación en el DCV: Número de 6 posiciones.
- Tipo de operación: Numérico de tres posiciones.
- NIT Sistema de Negociación: Numérico de 9 posiciones.
- Número de operación externa: Texto de 8 posiciones.
- Código Depositante Directo Original: Numérico de 3 posiciones.
- Portafolio Original: Numérico de 2 posiciones:
- Subcuenta Original: Numérico de 6 posiciones, sin ceros a la izquierda.
- Dígito subcuenta Original: Numérico de una posición.
- Valor (pesos de la operación inicial): Numérico de 16 posiciones enteras y 2 decimales.

Es absoluta responsabilidad del DD que cederá las obligaciones o derechos notificar a la Bolsa de Valores de Colombia (BVC) y a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC), sobre los ajustes que está ordenando realizar en el Depósito Central de Valores DCV.

El DD que cederá las obligaciones o derechos una vez reciba el archivo remitido por el BR, deberá enviar antes de las 12:00 M las instrucciones de cesión de obligaciones o derechos de las operaciones en un archivo Excel, mediante correo electrónico dirigido a la cuenta ServicioalClienteDFV@banrep.gov.co y a la cuenta de correo corporativa o de los usuarios designados por el DD que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones, cifrado con la herramienta SUCED o la que en un futuro la sustituya, con las siguientes características:

En el asunto se deberá incluir: "Orden de cesión de obligaciones y derechos de operaciones del Intermediario DD", donde DD es el nombre del depositante directo que realizará la cesión.

Contenido: El correo deberá contener el archivo Excel generado y enviado inicialmente por el BR agregando la siguiente información al final de cada registro:

- Código Depositante Directo que recibe: numérico de 3 posiciones
- Portafolio que recibe: numérico de 2 posiciones
- Subcuenta que recibe: numérico de 6 posiciones, los ceros a la izquierda no deben informarse.



- Dígito subcuenta que recibe: numérico de una posición

- Instrucciones de diligenciamiento:
 - Código Depositante Directo que recibe: Código de depositante directo que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones.
 - Portafolio que recibe: Código del portafolio del depositante directo que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones.
 - Subcuenta que recibe: Identificación de la subcuenta del depositante directo que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones.
 - Dígito subcuenta que recibe: Corresponde al dígito de chequeo de la subcuenta del depositante directo que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones.

El DD que asumirá las obligaciones o derechos de las operaciones deberá haber efectuado previamente la creación de las subcuentas en las que se van a registrar las operaciones. Para el efecto, deberá seguir el procedimiento establecido en el “Manual Creación de subcuentas”, disponible en la página Web del BRC www.banrep.gov.co, siguiendo la ruta: Sistema financiero / Sistemas de pago / Depósito Central de Valores / Reglamentación y manuales / Manuales de usuario y estructuras.

Se deberá, a más tardar el día anterior al establecido para efectuar la operación, haber creado las subcuentas en las que se registrarán las obligaciones o derechos de las operaciones.

Una vez recibida y validada la información y de haberse recibido un correo de aceptación por parte del DD que va a asumir las obligaciones o derechos de las operaciones, el BR hará la solicitud de modificación de base de datos de acuerdo a lo descrito en los procedimientos internos para tal fin, para que se haga la actualización de las estructuras de operaciones de acuerdo a las instrucciones recibidas por parte del DD que está efectuando la cesión.

Finalmente, una vez efectuada la actualización de las bases de datos del DCV y antes de que finalice la jornada laboral del BR, se enviará un correo al DD solicitante, informando la correcta finalización de la actualización solicitada.

2.4 CONSIDERACIONES ADICIONALES

Dado que se trata de una modificación a la base de datos, no va a quedar registro de movimiento por este procedimiento.



Las operaciones Repos y Simultáneas que realice el DD que cederá las obligaciones o derechos durante el día, no se incluirán en este procedimiento.

También se excluirán de este proceso las operaciones Simultáneas o Repos cuya retrocesión tenga como fecha de cumplimiento (fecha al vencimiento) el día en que se hace la solicitud para tramitar la cesión de derechos y obligaciones.

2.5 RIESGOS

En caso de que el Depositante Directo que cederá las obligaciones o derechos llega a realizar una operación de cancelación anticipada de alguna de las operaciones involucradas en la cesión, al intentar realizar la modificación a la base de datos se va a generar un error en la ejecución que va a impedir que se realice la actualización y se presentará una demora o la no ejecución de la modificación.