



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

De acuerdo con en el numeral 8. del artículo 8o. del Código de Procedimiento Administrativo y de lo Contencioso Administrativo, se publica para comentarios el Proyecto de Regulación **MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA**, por un término de diez (10) días calendario contados a partir del día siguiente a la fecha de su publicación.

Fecha de publicación: 14 de octubre de 2020

Fecha y hora límite: 24 de octubre de 2020, 5:00 p.m.

*En cumplimiento de lo establecido en la Ley 1581 de 2012, por medio de la cual se dictan las disposiciones generales para la protección de datos personales, y el Decreto 1377 de 2013 que la reglamenta parcialmente, incorporado en el Decreto Único Reglamentario 1074 de 2015, la información que sea proporcionada al Banco de la República estará protegida por la política de tratamiento de datos personales disponible en <http://www.banrep.gov.co/proteccion-datos-personales> en la sección “Protección de Datos Personales – Habeas Data”.*

#### **OBJETIVO Y JUSTIFICACIÓN DEL PROYECTO DE REGULACIÓN**

Modificar el envío de información al Banco de la República por parte de los Intermediarios del Mercado Cambiario y de otras entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia de las operaciones de derivados que realicen en el mercado mostrador que tengan como subyacente divisas o tasas de interés externas y que se encuentren registrados en los Sistemas de Registro de operaciones sobre Divisas, con el fin de reducir la carga operativa de las entidades. Los cambios entrarán en vigencia a partir del 3 de noviembre de 2020.

#### **FUNDAMENTO LEGAL**

Artículos 371 y 372 de la Constitución Política, el artículo 18 de la Ley 31 de 1992, y los artículos 61 y siguientes de la Resolución Externa No. 1 de 2018.

[Pulse aquí, para ingresar sus comentarios](#)



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

**MODIFICACIÓN DE LA CRE DOAM 317**

(...)

**2.1.1. INFORMACIÓN GENERAL A TODAS LAS OPERACIONES**

- Fecha y hora de ejecución.
- Fecha y hora de registro.
- Fecha de vencimiento.
- Fecha de liquidación.
- Identificación de los afiliados, operadores participantes de la operación.
- | - Tipo de instrumento: operaciones de contado, forwards, opciones, swaps, swaps tasa de cambio y de interés, entre otros.
- Monedas involucradas (Moneda 1 y Moneda 2). En operaciones peso-divisa la Moneda 1 corresponde a la divisa.
- Tipo de operación: compra o venta de Moneda 1.
- Monto de la operación (expresado en Moneda 1).
- Tasa pactada (cantidad de Moneda 2 por Moneda 1).
- Modalidad de cumplimiento (efectivo (*DF*) o financiero (*NDF*)).
- Opcionalidad (S/N).
- Descripción de la opcionalidad (si aplica).
- Modalidad de participación de la contraparte (por cuenta propia o por cuenta de terceros).
- Identificación de las contrapartes que negocien la compra o venta de las divisas, ya sea actuando por cuenta propia o por cuenta de terceros cuando están autorizados para este fin (En Colombia: sociedades fiduciarias, sociedades comisionistas de bolsa de valores, sociedades administradoras de inversión, sociedades administradoras de fondos de pensiones y cesantías y aseguradoras). En el caso de los fondos administrados (ejemplo: Fondos de Inversión Colectiva (FIC), Administración de Portafolios de Terceros (APT), Fondos Pensiones, Fondos de Cesantías) se debe identificar siempre a la entidad que negocie la compra o venta de las divisas (ejemplo: NIT y nombre de sociedad fiduciaria, NIT y nombre sociedad comisionista de bolsa). Cuando un IMC negocie la compra o venta de divisas directamente con otro residente o con un no residente se debe incluir la identificación respectiva.
- Identificación del tercero. Para este efecto se deberá identificar como tercero a alguno de los siguientes agentes: i) beneficiario de la operación, o ii) al ordenante de la misma. Adicionalmente, se debe señalar su calidad de residente o no residente. En el caso de las operaciones negociadas por las sociedades administradoras a nombre de terceros se debe identificar el tercero (ejemplo: NIT y nombre del FIC, NIT y nombre del APT, NIT y nombre del fondo de pensiones, NIT y nombre del fondo de cesantías). Cuando una contraparte del exterior actúe a nombre de terceros y no se conozca el beneficiario de la operación, la entidad del exterior deberá aparecer como



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

contraparte y como ordenante y no deberá tener un NIT correspondiente a una entidad o fondo vigilado por la SFC.

- Información sobre si la liquidación se hace a través de una Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
- Si la operación registrada proviene de otro sistema de negociación indicar el nombre de dicho sistema o si la operación se efectuó en el mercado mostrador.

Para efectos de la información requerida se entiende por,

- a. **Contraparte:** la persona natural o jurídica que negocia los términos y condiciones de la compra o venta a través de cualquier medio verificable, como por ejemplo un sistema transaccional, teléfono, mensajes electrónicos, entre otros.
- b. **Ordenante:** la persona no residente natural o jurídica que por un mandato imparte órdenes de negociación o negocia la compra o la venta. Solo aplica para operaciones a nombre de terceros. Cuando una contraparte del exterior actúe a nombre de terceros y no se conozca el beneficiario de la operación, la entidad del exterior deberá aparecer como contraparte y como ordenante.

(...)

## **2.2. PLAZO Y REQUISITOS PARA REGISTRAR LAS OPERACIONES**

Los IMC y las demás entidades vigiladas por la SFC que realicen operaciones sobre divisas en sistemas de negociación y las registren en un sistema de registro deben hacerlo de acuerdo con lo establecido en el presente numeral.

- i. Las operaciones que se ejecuten dentro del horario de operación establecido por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, se deberán registrar dentro de los cuarenta y cinco (45) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento, con excepción de las operaciones de derivados ejecutadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público-, que deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. También se exceptúan las operaciones sobre divisas con cruces de monedas que no incluyan al peso colombiano ejecutadas en el mercado mostrador por cualquier entidad vigilada por la SFC, que deberán ser registradas con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. Este registro deberá ser realizado por los IMC, cuando estos sean contraparte de la operación, o por las entidades vigiladas por la SFC, distintas de IMC, cuando se trate de sus operaciones de contado de divisas con agentes del exterior o de derivados sobre divisas con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados de manera profesional.



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

- ii.** Las operaciones que se ejecuten con posterioridad a la hora de cierre operativo de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán como si hubieran sido ejecutadas al primer instante de la apertura siguiente, es decir, el registro deberá efectuarse durante los primeros cuarenta y cinco (45) minutos posteriores a la apertura de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas.
- iii.** Las operaciones que se pacten a una tasa de mercado que no se conoce al momento de la negociación (ejemplo: tasa FIX del día de la negociación, tasa FIX del día del vencimiento, TRM, etc.) deberán ser registradas dentro de los cuarenta y cinco (45) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento, con excepción de las operaciones de derivados ejecutadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público- que deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro. En cualquier caso, una vez se conozca la tasa, esta deberá ser ingresada en los sistemas de registro de operaciones sobre divisas antes del cierre de operación de dichos sistemas, o durante los primeros cuarenta y cinco (45) minutos posteriores a la apertura del día hábil siguiente, en caso que la tasa se conozca después del cierre de dichos sistemas.
- iv.** En las operaciones de contado en las cuales no se negocie explícitamente la tasa de cambio de compra o venta para un plazo de cumplimiento específico, sino que la negociación involucre un diferencial de precios con otras operaciones de contado, como por ejemplo un margen de la tasa de una operación frente al de otra con un plazo de cumplimiento superior, deberán registrarse de acuerdo con lo establecido en el presente numeral pero no como operaciones de contado independientes.
- v.** El administrador del sistema de registro de operaciones sobre divisas podrá establecer los términos para recibir operaciones con cumplimiento en  $t=0$  por fuera de su horario de operación. Cuando el administrador del sistema de registro de operaciones sobre divisas no haya establecido tales términos, dichas operaciones no podrán registrarse ese mismo día y por lo tanto su cumplimiento tampoco podrá realizarse en  $t=0$ .
- vi.** Cuando un IMC efectúe la compra o venta de divisas en el mercado de contado y de derivados con otra entidad vigilada por la SFC (que sea o no IMC) que actúe por cuenta de un tercero, el registro deberá indicar: (i) que la operación es por cuenta de terceros, (ii) la entidad vigilada que participó como contraparte en la negociación, (iii) el tercero beneficiario u ordenante de la operación, y (iv) la calidad de residente o no residente del tercero beneficiario u ordenante. En el caso de operaciones negociadas por una entidad vigilada por la SFC a nombre de un



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

tercero residente, el registro siempre debe identificar al tercero beneficiario de la operación.

- vii. El ejercicio parcial de una opción tipo americana debe ser registrado como una modificación al monto de la operación vigente de tal forma que se muestre el monto que hace falta por ejercer. El ejercicio total de estas opciones debe ser registrado como una modificación de la fecha de vencimiento, de tal forma que esta corresponda a la fecha del ejercicio.

A continuación, se presentan ejemplos, sin que las operaciones se limiten únicamente a estos casos:

- Cuando una entidad del exterior ordena a una entidad fiduciaria local que venda divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la fiduciaria y al IMC. Se debe señalar que la fiduciaria actuó a nombre de un tercero e identificar a la entidad del exterior como ordenante. El ordenante puede o no ser beneficiario de la operación.
- Cuando una entidad del exterior negocie directamente la venta de las divisas a cambio de moneda legal con el IMC, el registro deberá incluir a la entidad del exterior y al IMC como contrapartes y se deberá identificar al primero como entidad del exterior (su identificación debe corresponder a la de una entidad del exterior).
- Cuando una sociedad administradora actuando a nombre de un fondo administrado (ejemplo: FIC, APT, Fondos Pensiones, Fondos de Cesantías) negocie la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la sociedad administradora y al IMC. Se debe señalar que la sociedad administradora actuó a nombre de un tercero e identificar al fondo administrado como beneficiario.
- Cuando una entidad del exterior actuando a nombre de un fondo con inversión de portafolio en Colombia negocie la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la entidad del exterior y al IMC. Se debe señalar que la entidad del exterior actuó a nombre de un tercero e identificar al fondo como beneficiario. Se debe identificar a la entidad del exterior como tal, por tanto, no puede tener la identificación que lo asocie a una entidad vigilada o a un negocio administrado por una entidad vigilada. Si la entidad del exterior no suministra información sobre el fondo, se debe registrar a la entidad del exterior como contraparte y ordenante.
- Cuando una entidad del exterior actuando a nombre de un fondo con inversión de portafolio en Colombia ordene a una fiduciaria local la compra de divisas a cambio de moneda legal con un IMC, el registro debe incluir como contrapartes a la fiduciaria y al IMC. Se debe señalar que la fiduciaria actuó a nombre de un tercero e identificar a la entidad del exterior como ordenante o beneficiario.

(...)



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

### 3.1. INFORMACIÓN AL BR

Los administradores de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán enviar diariamente el reporte al BR de las operaciones de contado y de derivados sobre divisas negociadas, registradas o modificadas el día hábil inmediatamente anterior. La información deberá ser enviada a través del sistema de transmisión de información GTA que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR, en los formatos del Anexo 1 de esta circular.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido serán aceptados por el Banco. Sin embargo, si un sistema envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la Superintendencia Financiera de Colombia, a efectos de que dicha autoridad pueda imponer las sanciones conforme a sus competencias, en particular las previstas en el Estatuto Orgánico del Sistema Financiero.

### MODIFICACIÓN DE LA CRE DOAM 317 – ANEXO 1

#### **INSTRUCTIVO PARA EL DILIGENCIAMIENTO Y TRANSMISIÓN DE LA INFORMACIÓN DE LAS OPERACIONES SOBRE DIVISAS POR PARTE DE ADMINISTRADORES DE LOS SISTEMAS DE NEGOCIACION Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS**

### 1. GENERALIDADES

Los administradores de los Sistemas de Negociación y de los Sistemas de Registro de Divisas (SN/SR) deberán informar al Banco de la República (BR) las operaciones de contado y de derivados negociadas o registradas a través de su conducto, sus modificaciones y fraccionamientos, y las aclaraciones por errores de digitación. Esta transmisión se realizará vía electrónica usando el archivo “*Modelo de formatos de reporte de operaciones sobre divisas*”, cuyo contenido debe cumplir con el estándar XML, de acuerdo con el procedimiento señalado en este anexo. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico [derivados@banrep.gov.co](mailto:derivados@banrep.gov.co).

El informe de operaciones sobre divisas deberá ser presentado por los SN/SR al BR utilizando el sistema de transmisión de información GTA que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR.

(...)

### 5.1. PRÓLOGO

El prólogo del documento debe incluir los siguientes elementos:



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

1. La especificación de XML empleada, la cual debe ser la establecida en la versión 1.0, Cuarta edición.
2. El conjunto de caracteres utilizado en el documento XML, que debe ser el alfabeto latino No. 1: "UTF-8" (el archivo no debe contener caracteres acentuados).

(...)

### 5.3. FORMATO DEL ENCABEZADO

La sección de encabezado cuya etiqueta inicial es <Encabezado> y su etiqueta final es </Encabezado> contiene en su estructura los siguientes elementos: Nit (del SN/SR), tipo de Entidad (SNR), fecha de transmisión, versión del formato, consecutivo del archivo y cantidad de registros. En la siguiente tabla, se encuentra la descripción de cada uno de los elementos mencionados.

<b>Etiqueta de la variable</b>	<b>Tipo</b>	<b>Longitud Máxima</b>	<b>Validaciones</b>	<b>Observaciones</b>
Nit	Entero	12		Nit del SN/SR incluyendo el dígito de verificación
Tipo de entidad	Entero	3	Debe ser SNR	
Fecha Transmisión	Fecha	10	Debe ser una fecha calendario	Debe corresponder a la fecha de envío.
Versión	Entero	2		Versión=4
Consecutivo Archivo	Entero	4	Debe ser un consecutivo para cada archivo enviado	
Cantidad Registros	Entero		Se envían archivos con máximo 10000 registros, si se requiere enviar más de 10000 registros se fraccionará la información en varios archivos de 10000.	Cantidad de Registros reportados en el contenido



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

#### 5.4. FORMATO DEL CONTENIDO

La sección de contenido será la que incluye la información de las operaciones reportadas. Esta sección iniciará con la etiqueta <Operaciones> y finalizará con la etiqueta </Operaciones>.

##### 5.4.1. Estructura de los instrumentos y sus atributos

Cada elemento registrado en la sección de contenido corresponde a una operación reportada, así, para identificar el tipo de instrumento deben utilizarse las siguientes etiquetas:

<b>Instrumento</b>	<b>Etiqueta</b>	<b>Entidad</b>
Operaciones de contado	SPOT	SNR
Forward peso dólar	FWPD	SNR
Opciones peso dólar	OPPD	SNR
Swap peso dólar	SWPD	SNR
Swap interés peso dólar	SWPID	SNR
Forward otras monedas	FWOM	SNR
Opciones otras monedas	OPOM	SNR
Swap otras monedas	SWOM	SNR
Swap interés otras monedas	SWIOM	SNR
Forward tasa de interés	FWTI	SNR
Opciones tasa de interés	OPTI	SNR
Otros derivados	OD	SNR

##### 5.4.2. Variables de los instrumentos negociados

A continuación, se describen las variables que deben incluirse en los registros de cada uno de los instrumentos reportados, teniendo en cuenta que algunas aplican para el reporte de todos los instrumentos, y otras solamente para un conjunto específico de estos. También se establecen las reglas de validación y la estructura que debe cumplir cada una de las variables reportadas.

Las siguientes consideraciones adicionales deben tenerse en cuenta para la formación del documento en todas las variables:





**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

1. En la información de una variable en particular NO puede existir el carácter (‘) o (‘‘)
  2. El separador de los decimales es punto (.).
- A continuación, se muestra una relación de las variables requeridas por tipo de instrumento:

VARIABLE	FWPD	OPPD	SWPD	SWPID	FWOM	OPOM	SWOM	SWIOM	FWTI	OPTI	OD	SPOT
TipoNovedad	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
PuntaVentaTerceros	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
PuntaCompraTerceros	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaVentaBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
IDPuntaVentaBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NombrePuntaVentaBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NumeroRegistro	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
FechaOper	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NITSNRoiMC	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L	L
NITSNRoiMCRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NumRegAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaOpAnterior	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
FechaVen	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
IDPuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
NombrePuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TipoDPuntaCompraBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
IDPuntaCompraBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
NombrePuntaCompraBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
SubsectorPuntaVentaNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaCompraNegociante	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SubsectorPuntaVentaBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
SubsectorPuntaCompraBeneficiario	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
MontoNegociacion	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Moneda1					X	X	X	X	X	X	X	X
TasaContado	X		X		X		X				X	
TasaPactada1Precio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaPactada2			X	X			X	X			X	
Moneda2					X	X	X	X			X	X
PeriodicidadFlujoM1				X				X			X	
PeriodicidadFlujoM2				X				X			X	
MontoDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
MontoNDF	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
TasaReferenciaSubyacente	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Opcionalidad	X				X				X		X	
TipoOpcionalidad	X				X				X		X	
AceptadoCamara	X		X								X	
FechaCRCC	X		X								X	
TipoOpcion		X				X				X	X	
TipoEjercicioOpcion		X				X				X	X	
PrimaInicial		X				X				X	X	
Condicion		X				X				X	X	
PlazoTasa									X	X	X	
PrimaPeriodica											X	
EmisorSubyacente											X	
FechaVenSubyacente											X	
ValorFacialCubierto											X	
FechaEfectivaCDS											X	
RegistroPrevio	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
SistemaPrevio	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O	O
TasaFIX	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
FechaFIX	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
Comentarios	O	O	O	X	O	O	O	X	O	O	O	O

X = Obligatorio, O = Opcional, L = Se lee del Nombre del Archivo

(...)

Se modifica la descripción de las variables SistemaPrevio y Comentarios que deben incluirse en los registros a ser reportados al BR, de acuerdo con la siguiente instrucción:



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

SistemaPrevio	Este campo debe indicar el código del sistema en el que fue negociada previamente la operación. Para las operaciones negociadas a través de cualquier mecanismo de negociación diferente a los SN/SR autorizados por la SFC señalados a continuación, no se debe diligenciar este campo.		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Caracter	1	Debe ser una de las opciones del dominio de valores descrito en las observaciones.  No debe ser vacío si SistemaPrevio es S.	Sistema de Negociación: S: SET FX S.A. I: ICAPCO T: Tradition Colombia S.A. G: GFI Exchange Colombia S.A.
Comentario	En este campo se debe enviar la información de los tipos de tasas de interés relacionadas a los instrumentos de swaps interés otras monedas (SWIOM) y Swaps Interés Peso Dólar (SWPID) conforme a la siguiente estructura		
Tipo de Dato	Longitud	Validaciones	Observaciones
Alfanumérico	9999		"Tasa pactada moneda 1 = característica de la tasa de interés usada para los flujos de la moneda 1 / Tasa pactada moneda 2 = característica de la tasa de interés usada para los flujos de la moneda 2" (ej. "IBR / Tasa Fija").

(...)

El reporte de Modificaciones (M), Aclaraciones (A) o Fraccionamientos (F) sólo aplica para registros que ya han sido recibidos y aceptados por el BR. Como regla, cuando se reporte alguna de estas novedades, la operación se debe identificar de la siguiente forma: el NIT del SN/SR, el número de registro de la operación (variable **NumeroRegistro**) y la fecha de Operación (**FechaOper** que corresponde a la fecha en que se realizó la modificación (M), la aclaración (A), o el fraccionamiento (F)). Adicionalmente, se debe reportar el número de consecutivo de la operación anterior (a través de la variable: **NumRegAnterior**), el número de NIT del sistema de registro de la operación anterior (A través de la variable: **NITSNRoIMCRegAnterior**) y la fecha en que se realizó la operación anterior (a través de la variable: **FechaOpAnterior**).

El reporte de Modificaciones (M), Aclaraciones (A) o Fraccionamientos (F) deben ser enviados usando la versión del esquema XSD con la cual se reportó la operación inicial (I).

Internamente, el BR guardará la fecha y número de registro del reporte con que se informó la operación por primera vez. Igualmente, cuando un SN/SR reporta un tipo de novedad de modificación (M), aclaración (A), o fraccionamiento (F), el BR verifica que la operación anterior se encuentre activa y procederá a desactivarla y dejará activa la última operación reportada.

Las modificaciones (M) o aclaraciones (A) deben diligenciarse todas las variables de la operación; y únicamente las variables que se está(n) modificando o aclarando, deben diferir de la información reportada inicialmente y deben realizarse antes del vencimiento de la operación. Las operaciones podrán ser modificadas de acuerdo a lo establecido en la CRE DOAM-144.



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

De acuerdo con la definición anterior de las variables para el reporte de operaciones de derivados, un ejemplo de una operación FWPD en formato XML será:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Reporte xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  xmlns="http://www.banrep.gov.co"
  xsi:schemaLocation="http://www.banrep.gov.co reporte.xsd">
<Encabezado>
  <Nit>000845236987</Nit>
  <TipoEntidad>SNR</TipoEntidad>
  <FechaTransmision>2013-09-10</FechaTransmision>
  <Version>4</Version>
  <ConsecutivoArchivo>0001</ConsecutivoArchivo>
  <CantidadRegistros>1</CantidadRegistros>
</Encabezado>

<Operaciones>
  <FWPD>
    <TipoNovedad>I</TipoNovedad>
    <PuntaVentaTerceros>N</PuntaVentaTerceros>
    <TipoIDPuntaVentaNegociante>NI</TipoIDPuntaVentaNegociante>
    <IDPuntaVentaNegociante>123456789</IDPuntaVentaNegociante>

    <NombrePuntaVentaNegociante><![CDATA[NombreParte]]></NombrePuntaVent
aNegociante>
    <NumeroRegistro>123</NumeroRegistro>
    <FechaOper>2013-06-05</FechaOper>
    <FechaVen>2013-07-24</FechaVen>
    <PuntaCompraTerceros>N</PuntaCompraTerceros>

    <TipoIDPuntaCompraNegociante>NI</TipoIDPuntaCompraNegociante>

    <IDPuntaCompraNegociante>987654321</IDPuntaCompraNegociante>

    <NombrePuntaCompraNegociante><![CDATA[Nombre]]></NombrePuntaCompra
Negociante>

    <SubsectorPuntaVentaNegociante>F</ SubsectorPuntaVentaNegociante >
    <SubsectorPuntaCompraNegociante>R</ SubsectorPuntaCompraNegociante >
    <MontoOperacion>5007500.00</MontoOperacion>
    <TasaContado>2164.000000</TasaContado>
    <TasaPactada1Precio>2.10</TasaPactada1Precio>
    <MontoDF>2500000</MontoDF>
    <MontoNDF>2507500</MontoNDF>
```



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

<TasaReferenciaSubyacente>2.20</TasaReferenciaSubyacente>  
<Opcionalidad>S</Opcionalidad>  
<TipoOpcionalidad><![CDATA[Describe la  
opcion]]></TipoOpcionalidad>  
<AceptadoCamara>S</AceptadoCamara>

<FechaCRCC>2013-06-02</FechaCRCC>  
<RegistroPrevio>N</RegistroPrevio>

</FWPD>

</Operaciones>  
</Reporte>

(...)

## 7. TABLA DE CLASIFICACIÓN DE ACTIVIDADES ECONÓMICAS

- A AGRICULTURA, GANADERIA, CAZA, SILVICULTURA, EXTRACCION DE MADERA, PESCA Y ACTIVIDADES DE SERVICIOS CONEXAS**
- B EXPLOTACION DE MINAS Y CANTERAS, EXTRACCION PETROLEO CRUDO Y GAS NATURAL**
- C INDUSTRIA MANUFACTURERA**
- D SUMINISTRO DE ELECTRICIDAD, GAS, Y AGUA**
- E CONSTRUCCION**
- F COMERCIO**
- G TURISMO, HOTELES Y RESTAURANTES**
- H TRANSPORTE, MANIPULACION DE CARGA, ALMACENAMIENTO Y DEPÓSITO**
- I CORREO Y TELECOMUNICACIONES**
- J INTERMEDIACION FINANCIERA - EXCEPTO FINANCIACION PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS (DIVISIONES J1 A J14)**
  
- J1 BANCA CENTRAL
- J2 BANCOS COMERCIALES Y BANCOS ESPECIALIZADOS EN CARTERA HIPOTECARIA
- J3 CORPORACIONES FINANCIERAS (INCLUYE IFI)
- J4 COMPAÑÍAS DE FINANCIAMIENTO COMERCIAL (INCLUYE COMPAÑÍAS DE LEASING)
- J5 COOPERATIVAS FINANCIERAS Y FONDOS DE EMPLEADOS
- J6 SOCIEDADES FIDUCIARIAS
- J7 SOCIEDADES DE CAPITALIZACION
- J8 ACTIVIDADES DE COMPRA DE CARTERA (FACTORING)



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

- J9 BOLSA DE VALORES
- J10 SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSA
- J11 CASAS DE CAMBIO
- J12 ENTIDADES FINANCIERAS OFICIALES ESPECIALES: FEN, ICETEX,  
BANCOLDEX, FINAGRO, FINDETER Y FONADE
- J13 OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS
  
- K ENTIDAD FINANCIERA NO RESIDENTE**
- L FINANCIACION DE PLANES DE SEGUROS, PENSIONES Y CESANTIAS  
(DIVISIONES L1 A L5)**
  - L1 PLANES DE SEGUROS GENERALES, SEGUROS DE VIDA Y REASEGUROS
  - L2 PLANES DE PENSIONES VOLUNTARIAS
  - L3 PLANES DE CESANTIAS
  - L4 PLANES DE PENSIONES DE AFILIACION OBLIGATORIA
  - L5 PLANES DE PENSIONES DEL REGIMEN DE PRIMA MEDIA (INCLUYE:  
SEGURO SOCIAL, CAJANAL, CAPRECOM, ENTRE OTROS)
  - L6 POSICIÓN PROPIA DE FONDOS DE PENSIONES Y CESANTÍAS O  
ASEGURADORAS
  - L7 PATRIMONIOS AUTÓNOMOS ADMINISTRADOS POR FONDOS DE  
PENSIONES Y CESANTÍAS
  
- M ACTIVIDADES EMPRESARIALES: ACTIVIDADES INMOBILIARIAS,  
ALQUILER DE MAQUINARIA Y EQUIPO, INFORMATICA Y  
ACTIVIDADES CONEXAS, INVESTIGACION Y DESARROLLO, OTRAS  
ACTIVIDADES EMPRESARIALES**
- N ADMINISTRACION PUBLICA Y DEFENSA**
- O EDUCACION, ACTIVIDADES CULTURALES Y DEPORTIVAS, ACTIVIDAD  
DE ASOCIACIONES**
- P SERVICIOS SOCIALES Y DE SALUD**
  
- Q ORGANIZACIONES Y ORGANOS EXTRATERRITORIALES**
- R PERSONA NATURAL**



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

**MODIFICACIÓN DE LA CRE DOAM 144**

(...)

**7. REPORTES DE DERIVADOS AL BR**

**7.1 REPORTE DE OPERACIONES POR LOS IMC SEÑALADOS EN EL NUMERAL 1 DEL ARTÍCULO 8 DE LA RESOLUCIÓN 1/18**

Los IMC señalados en el Numeral 1 del Artículo 8 de la Resolución 1/18 deberán informar diariamente al BR las operaciones de derivados celebradas el día hábil anterior, distintas a aquellas realizadas en el mercado mostrador que tengan como subyacente divisas o tasas de interés externas, y que sean negociadas con:

- Agentes del exterior autorizados, incluyendo las operaciones realizadas en el mercado mostrador que tengan como subyacente títulos de renta fija.
- Residentes, incluyendo IMC y otras entidades vigiladas por la SFC, que sean denominadas en divisas y aquellas realizadas en el mercado mostrador que tengan como subyacente títulos de renta fija.

Adicionalmente, deberán reportar las operaciones de derivados estandarizados que celebren y que sean compensadas y liquidadas en cámaras de compensación y liquidación del exterior.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido serán aceptados por el BR. Sin embargo, si el IMC envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la SFC.

**7.2 REPORTE DE OPERACIONES POR LAS SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSA DE VALORES QUE SON IMC DEL NUMERAL 3 DEL ARTÍCULO 8 DE LA RESOLUCIÓN 1/18**

Las sociedades comisionistas de bolsa de valores señaladas en el Numeral 3 del Artículo 8 de la Resolución 1/18 deberán informar diariamente al BR las operaciones de derivados estandarizados que celebren y que sean compensadas y liquidadas en cámaras de compensación y liquidación del exterior realizadas el día hábil anterior.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido serán aceptados por el BR. Sin embargo, si el IMC envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la SFC.

**7.3 REPORTE DE OPERACIONES POR ENTIDADES VIGILADAS POR LA SFC, DISTINTAS DE LOS IMC SEÑALADOS EN EL NUMERAL 7.1 Y 7.2 DE ESTA CIRCULAR**



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

Las entidades vigiladas por la SFC, distintas de las señaladas en los numerales 7.1 y 7.2 de esta circular, deberán informar diariamente al BR las siguientes operaciones realizadas el día hábil anterior.

- Los derivados celebrados con agentes del exterior autorizados, distintos a aquellos realizados en el mercado mostrador que tengan como subyacente divisas o tasas de interés externas.
- Los derivados celebrados con agentes del exterior autorizados en el mercado mostrador que tengan como subyacente títulos de renta fija.
- Los derivados estandarizados que celebren y que sean compensados y liquidados en cámaras de compensación y liquidación del exterior.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido serán aceptados por el BR. Sin embargo, si la entidad vigilada envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la SFC.

**7.4 REPORTE DE OPERACIONES POR RESIDENTES, DISTINTOS DE ENTIDADES VIGILADAS POR LA SFC**

Los residentes, distintos de entidades vigiladas por la SFC:

- Deberán informar las operaciones de derivados estandarizados realizados el día hábil anterior que celebren y sean compensadas y liquidadas en cámaras de compensación y liquidación del exterior, cuando en el año calendario inmediatamente anterior el residente haya compensado y liquidado en cámaras de compensación y liquidación del exterior operaciones de derivados estandarizados por un valor nominal acumulado igual o superior a USD500.000, o su equivalente en otras monedas.

Las operaciones de derivados estandarizados que celebre la casa matriz o controlante del exterior para el residente (distinto de IMC y de entidades vigiladas por la SFC), de tal forma que este último sea responsable de las ganancias o pérdidas de dichas operaciones, deberán informarse cuando en el año calendario inmediatamente anterior el residente haya sido responsable de operaciones de derivados estandarizados por un valor nominal acumulado igual o superior a USD500.000, o su equivalente en otras monedas.

- A efectos de lo dispuesto en la Ley 1328 de 2009 y en el decreto reglamentario y sus modificaciones, con el fin de que las operaciones de derivados no estandarizados realizadas con agentes del exterior autorizados puedan ser sujetas de terminación anticipada y de compensación y liquidación en caso de que alguna de las contrapartes incurra en un proceso de insolvencia o de naturaleza concursal, toma de posesión para liquidación o acuerdos globales de reestructuración de deudas (*close-out netting*), los



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

- residentes (distintos de entidades vigiladas por la SFC) informarán diariamente al BR las operaciones de derivados no estandarizados realizadas con agentes del exterior autorizados el día hábil anterior, incluyendo el ejercicio de opciones americanas.
- Deberán informar las operaciones de derivados no estandarizados que celebren el día hábil anterior sus matrices o entidades controlantes del exterior por ellos, de tal forma que el residente sea responsable de las ganancias o pérdidas de dichas operaciones. Para el efecto, el residente deberá reportar las características de los mencionados contratos, especificando como contraparte a su casa matriz o entidad controlante. Este reporte deberá ser enviado el día siguiente al cual se conozcan las características de los contratos, y en todo caso antes de realizar las liquidaciones con la casa matriz.

Los reportes enviados al BR con posterioridad al plazo establecido serán aceptados por el BR. Sin embargo, si el residente envía la información con posterioridad al plazo establecido en tres o más ocasiones dentro del mes calendario, esta situación se pondrá en conocimiento de la autoridad de control y vigilancia.

## **7.5 HORARIO Y ENVÍO DE INFORMACIÓN**

El Anexo 3 de esta circular contiene el formato que los IMC señalados en los numerales 7.1 y 7.2 de esta circular y las entidades vigiladas por la SFC señalados en el numeral 7.3 deben utilizar para reportar electrónicamente las operaciones de derivados realizadas el día hábil anterior. El Anexo 4 de esta circular contiene el formato que los residentes señalados en el numeral 7.4 deben utilizar para reportar electrónicamente las operaciones de derivados realizadas el día hábil anterior. En los anexos 1 y 2 se encuentran el instructivo para tramitar los formatos y la tabla de clasificación de actividades económicas. Lo anterior está disponible también en la siguiente dirección: <http://www.banrep.gov.co/es/reglamentacion-temas/2165>

La información deberá ser enviada al correo electrónico: [derivados@banrep.gov.co](mailto:derivados@banrep.gov.co) en los formatos del Anexo 3 y 4 de esta circular. Se recomienda leer cuidadosamente el instructivo (Anexo 2 de esta circular) antes de llenar los formatos.

En caso de encontrar dificultades para el envío de la información a través de la dirección electrónica indicada anteriormente, los formatos deberán ser remitidos por fax al 2840228 o 3431171 del Departamento de Operaciones y Análisis de Mercados.

De acuerdo con lo dispuesto en literal a) del artículo 4 de la Ley 1266 de 2008, los IMC y residentes deberán tener en cuenta el “*Principio de veracidad o calidad de los registros de datos*”, según el cual deben garantizar que la información que se suministra al BR sea veraz, completa, exacta, actualizada, comprobable y comprensible.

## **7.6 MODIFICACIONES Y ERRORES DE DIGITACIÓN**

Las modificaciones a las condiciones pactadas en las operaciones de derivados durante la vigencia del contrato se deben reportar al BR por el IMC o el residente, según corresponda,





**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

el día hábil siguiente de acuerdo con lo previsto en el numeral 7.5 de esta circular. No podrán hacerse modificaciones después del vencimiento del contrato.

El ejercicio parcial de una opción tipo americana debe ser registrado como una modificación al monto de la operación vigente de tal forma que se muestre el monto que hace falta por ejercer. El ejercicio total de estas opciones debe ser registrado como una modificación de la fecha de vencimiento, de tal forma que esta corresponda a la fecha del ejercicio.

Los errores de digitación en la información enviada por el IMC o por el residente al BR, se pueden reportar en cualquier momento, de acuerdo con lo previsto en el numeral 7.5 de esta circular.

(...)

## **10. ANEXOS**

Hacen parte de esta circular la tabla de clasificación de actividades económicas, el instructivo para diligenciar los formatos de las operaciones de derivados y los formatos de reporte de derivados que los IMC y los residentes deben utilizar para reportar electrónicamente las operaciones de derivados al BR, según se relaciona en los siguientes Anexos:

Anexo No. 1 Tabla de clasificación de actividades económicas.

Anexo No. 2 Instructivo para diligenciar los formatos de las operaciones de derivados.

Anexo No. 3 Formatos de reporte de derivados por parte de los IMC y demás entidades vigiladas por la SFC.

Anexo No. 4 Formatos de reporte de derivados por parte de los residentes.

(...)

## **MODIFICACIÓN DE LA CRE DOAM 144 – ANEXO 2**

### **INSTRUCTIVO PARA DILIGENCIAR LOS FORMATOS DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS**

Las operaciones de derivados, sus modificaciones y los errores de digitación se deben reportar a través de los archivos en formato Excel, “Modelo de formatos de reporte de derivados – IMC y vigilados por la SFC” y “Modelo de formatos de reporte de derivados - residentes”<sup>1</sup> el cual contiene varias hojas con formatos específicos para reportar los diferentes tipos de instrumentos.

<sup>1</sup> Ingrese a <http://www.banrep.gov.co/es/normatividad/operaciones-de-derivados>



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

El Anexo 3 (“*Modelo de formatos de reporte de derivados – IMC y vigilados por la SFC*”) de esta circular contiene el formato que los IMC señalados en los numerales 7.1 y 7.2 de esta circular y las entidades vigiladas por la SFC señalados en el numeral 7.3 deben utilizar para reportar electrónicamente las operaciones de derivados realizadas el día hábil anterior. El Anexo 4 de esta circular (“*Modelo de formatos de reporte de derivados - residentes*”) contiene el formato que los residentes señalados en el numeral 7.4 deben utilizar para reportar electrónicamente las operaciones de derivados realizadas el día hábil anterior.

Al diligenciar estas hojas, no altere el formato de las columnas, no borre ni inserte filas o columnas, ni cambie el nombre de las hojas, puesto que serán leídas por una aplicación y cualquier modificación afectará el procesamiento de la información.

Las columnas sombreadas contienen listas desplegadas. Para seleccionar una opción haga clic al lado derecho de la celda. Su utilización agilizará el registro de información y minimizará el riesgo de errores de digitación.

Las columnas contienen instrucciones para diligenciar los datos, de tal forma que sea fácil y rápido completarlas. Adicionalmente, están formateadas y validan los datos de entrada, por lo que los formatos de las celdas no deben ser modificados en ningún caso.

Lea cuidadosamente estas instrucciones antes de diligenciar su archivo. Para resolver cualquier duda comuníquese al correo electrónico [derivados@banrep.gov.co](mailto:derivados@banrep.gov.co).

## **1 DESCRIPCIÓN SOBRE LOS CAMPOS COMUNES A TODAS LAS OPERACIONES**

### **Entidad, NIT y Código**

En el Anexo 3 en la hoja: “*Credit Default Swaps*”, la celda sombreada en amarillo bajo el título “Entidad” contiene la lista desplegable de intermediarios del mercado cambiario (IMC) y algunas entidades vigiladas por la SFC, con el fin de identificar la entidad que está reportando las operaciones de derivados. Al seleccionar el nombre de la entidad, aparecerá automáticamente (en las casillas inferiores) el NIT y el código de IMC asociado, en ésta y en las demás hojas del archivo. Es importante seleccionar correctamente la entidad, puesto que la aplicación toma estas tres referencias como claves para la clasificación de los datos. Si el nombre de la entidad no se encuentra en la lista desplegable debe diligenciar en el campo “Entidad” el nombre y el NIT, separado por “-” (ejemplo: “CompañíaABC – 860XXXXXX”). En el Anexo 4 en la hoja “*forward peso-dólar*” los residentes deben diligenciar el nombre de la entidad en la celda sombreada en amarillo bajo el título “Entidad” y diligenciar el NIT en la celda sombreada en amarillo bajo el título “NIT” sin caracteres especiales ni dígito de verificación.



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

### **Número Consecutivo**

En la columna “Número Consecutivo” debe poner el número consecutivo correspondiente a la operación que está registrando. Los cambios en las condiciones de la operación, el ejercicio de opciones americanas y los errores de digitación se deben reportar bajo el número consecutivo con que inicialmente reportó la operación. Para cada tipo de operación (forwards peso dólar, opciones peso dólar, swaps peso dólar, swaps interés peso dólar, forwards otras monedas, opciones otras monedas, swaps otras monedas, swaps interés otras monedas, etc.) debe existir una serie de números consecutivos diferente. El número consecutivo será asignado por el obligado a reportar la operación.

### **Tipo de Transacción**

En esta columna se debe seleccionar la posición en el contrato, que está asumiendo quien reporta el contrato de derivados. Ya sea Comprador (C) o Vendedor (V) de divisas. En el caso de derivados en otras monedas se debe seleccionar la posición respecto a la moneda 1 (ver numeral 2.1 de este Anexo). En el caso de los *cross currency swaps* la posición se debe seleccionar respecto a la tasa de interés en la moneda 1; una compra indica que se recibirá esta tasa de interés y se pagará la tasa de la moneda 2.

### **Monto**

En esta columna se debe ingresar el monto de la operación, expresado en dólares de los Estados Unidos (USD). Para el caso de derivados en otras monedas, se debe ingresar el monto de la operación expresado en la moneda 1 (ver numeral 2.2 de este Anexo).

### **Nombre y NIT de la contraparte**

Esta columna despliega una lista con establecimientos de crédito, sociedades comisionistas de bolsa, fondos de pensiones obligatorias y fondos de cesantías. Si va a usar alguna de estas entidades despliegue la lista; o de lo contrario escriba el nombre de la contraparte seguido del NIT ó del número de cédula, sin comas ni puntos.

### **Código del Sector**

En esta columna se despliega una lista de actividades económicas con sus respectivos códigos, con el fin de catalogar la contraparte con la cual se realizó el negocio. Esta lista se encuentra en el Anexo 1 de esta circular.

### **Opcionalidad y Tipo de opcionalidad**

En la columna “Opcionalidad” debe registrar si la operación tiene o no algún tipo de opción implícita en el contrato. Sólo en el caso en que la operación tenga alguna opción implícita en el contrato, se debe especificar el tipo de opción en la columna “Tipo de opcionalidad”.



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

**Modalidad de cumplimiento**

En esta columna se debe seleccionar de la lista desplegable la forma como se realizará la liquidación del contrato (cumplimiento financiero -DF- o cumplimiento efectivo -NDF-).

**Tipo de Novedad**

En esta columna, debe seleccionar la novedad sobre la operación que se está reportando, clasificándolas en *Inicial (I)*, *Modificación (M)* o *Errores de Digitación (E)*. Es obligatorio diligenciar este campo.

**Operación Realizada por Matriz o Controlante**

Esta columna debe ser diligenciada por las entidades cuyas operaciones hayan sido realizadas por su casa matriz o controlante, pero cuyas pérdidas o ganancias se encuentren a su cargo. De esta manera la opción “NO” se encuentra seleccionada por defecto.

**2 OBSERVACIONES ESPECÍFICAS DE ACUERDO A LA OPERACIÓN REPORTADA****2.1 Forwards peso-dólar**

Para estas operaciones existen las columnas “Aceptado por CRCC” y “Fecha de Aceptación por CRCC”.

Cuando la operación no ha sido aceptada para su compensación y liquidación por una Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) autorizada, debe diligenciarse “No” en la columna “Aceptado por CRCC” y la columna “Fecha de Aceptación por CRCC” debe quedar en blanco. Cuando la operación ha sido aceptada para su compensación y liquidación por una CRCC autorizada en una fecha posterior a la negociación, se debe enviar una modificación de la operación cambiando “No” por “Sí” en la columna “Aceptado por CRCC” e incluyendo en la columna “Fecha de Aceptación por CRCC” la fecha en que la CRCC aceptó la operación.

**2.2 Forwards otras monedas, Opciones otras monedas, Swaps otras monedas y Swaps interés otras monedas**

Para estas operaciones existe la columna monedas involucradas que permite registrar los negocios pactados en monedas diferentes al par peso/dólar. Los tipos de monedas involucradas se seleccionan, al desplegar las columnas moneda1 y moneda2, de acuerdo con los códigos SWIFT de las monedas. El valor del monto pactado debe registrarse en unidades de la moneda 1, y la tasa pactada como cantidad de moneda 2 por moneda 1 (moneda2/moneda1). Para el caso de los swaps interés otras monedas debe reportarse un solo registro de la operación, sin desagregar los flujos futuros del contrato y en la columna monto debe registrarse el nominal total del contrato, en unidades de moneda 1.



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**

(...)

**2.6 Derivados sobre precios de productos básicos**

- Tipo de producto: hace referencia al tipo de derivado negociado, dentro de estos se encuentran opciones, forward, swaps, etc.
- Moneda de referencia: corresponde a la moneda en la cual se encuentra denominado el contrato.
- Producto subyacente: corresponde al producto básico subyacente del contrato derivado negociado.
- Nombre de la contraparte: corresponde al agente del exterior autorizado para realizar derivados, o a la cámara de compensación y liquidación del exterior.
- País de la contraparte: corresponde al país en donde se encuentra establecida la contraparte con la cual se negoció el derivado.
- Tipo contraparte: seleccione de la lista desplegable el sector económico al cual pertenece la contraparte con la cual se realizó el negocio.
- Precio contado: corresponde al precio al cual se estaba negociando el subyacente al momento de cerrar el contrato.
- Precio pactado: corresponde al precio del contrato negociado
- Opciones - Tipo de opción: indica si se trata de una opción americana o europea.
- Precio ejercicio: corresponde al precio de ejercicio de las opciones en la moneda de referencia del contrato.
- Swap - Tasa de referencia: indica si existe algún tipo de tasa de referencia en el contrato.
- Swap - Periodicidad: corresponde a la periodicidad con la que se intercambian los flujos expresado en número de veces al año.
- Comentarios: incorpora cualquier información adicional relevante sobre la operación que no haya sido consignada en los campos anteriores.

(...)

**2.8 Fraccionamiento de una operación**

Cuando se realiza el fraccionamiento de una operación debe reportarse: i) la modificación de la operación inicialmente reportada al BR incluyendo los cambios en las condiciones pactadas, con su respectivo número de consecutivo y ii) el remanente del contrato debe reportarse en una o varias operaciones con tipo de novedad inicial (I) con nuevos números de consecutivo.

**3 MODIFICACIONES Y ERRORES DE DIGITACIÓN**

Tanto los reportes de las modificaciones como los de los errores de digitación, deben incluir el número consecutivo (código único), que los identifica como únicos en la fecha en que





PROYECTO DE REGULACIÓN – PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - IMC Y VIGILADOS POR LA SFC FORWARDS ÍNDICES BURSÁTILES

Form fields for Entity, NIT, and Código IMC.

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Índice Bursátil Subyacente, Precio Pactado, Modalidad de Cumplimiento, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - IMC Y VIGILADOS POR LA SFC OPCIONES ÍNDICES BURSÁTILES

Form fields for Entity, NIT, and Código IMC.

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Índice Bursátil Subyacente, Precio Pactado, Prima, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - IMC Y VIGILADOS POR LA SFC PRODUCTOS BÁSICOS

Form fields for Entity and NIT.

Table with 18 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Tipo Producto, Moneda Referencia, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Moneda de Referencia, Producto Subyacente, Nombre de la Contraparte, País de la Contraparte, Tipo Contraparte, Tasa de Cotización Moneda de Referencia, Tasa Pactada (Precio), Modalidad de Cumplimiento, Opciones Call/Put, Opciones Tipo Opc., Opciones Precio Ejecución Moneda de Referencia, Swap Tasa de Referencia, Swap Periodicidad, Tipo de Novedad, Comentarios, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - IMC Y VIGILADOS POR LA SFC FUTUROS ESTANDARIZADOS SOBRE TASAS DE CAMBIO, TASAS DE INTERÉS O ÍNDICES ACCIONARIOS

Form fields for Entity, NIT, and Código IMC.

Table with 18 columns: Número Consecutivo, Moneda Intermediaria, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Moneda, Nombre de la Cámara de Compensación y Liquidación del Exterior, Tasa Pactada, Modalidad de Cumplimiento, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tasa de Interés o Tasa de Bruto (Índice Subyacente), Índice del Título, Tipo de Tasa (solo para títulos), Plazo (tasa de interés) o fecha de vencimiento (títulos), Denominación del título o de la tasa, Índice Bursátil Subyacente, Tipo de Sociedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.







PROYECTO DE REGULACIÓN – PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020

MODIFICACIÓN DE LA CRE DOAM 144 – ANEXO 4



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES FORWARDS PESO-DÓLAR

Entidad NIT

Yellow rectangular box for entity information

Table with 16 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto en US\$, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa de Contado (\$/US\$), Tasa Pactada (\$/US\$), Modalidad de Cumplimiento, Tasa de Referencia, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Aceptado por CRC, Fecha de Aceptación por CRC, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES OPCIONES PESO-DÓLAR

Entidad NIT

Yellow rectangular box for entity information

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Fecha de Ejercicio, Monto en US\$, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tipo de Opción, Prima Inicial (\$/US\$), Tasa Pactada (\$/US\$), Condición de Ejercicio, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES SWAPS PESO-DÓLAR

Entidad NIT

Yellow rectangular box for entity information

Table with 12 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto en US\$, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa Pactada (\$/US\$), Modalidad de Cumplimiento, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES SWAPS INTERÉS PESO-DÓLAR

Entidad NIT

Yellow rectangular box for entity information

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto en US\$, Tasa interés dólares, Tasa interés pesos, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa pactada (\$/US\$), Modalidad de Cumplimiento, Periodicidad Dólar, Periodicidad Peso, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



PROYECTO DE REGULACIÓN – PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES FORWARDS OTRAS MONEDAS

Entidad NIT [Yellow box]

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Monedas involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda 1, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa Pactada, Modalidad de Cumplimiento, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES OPCIONES OTRAS MONEDAS

Entidad NIT [Yellow box]

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Monedas involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Fecha de Ejercicio, Monto Moneda 1, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tipo de Opción, Prima, Tasa Pactada, Condición de Ejercicio, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES SWAPS OTRAS MONEDAS

Entidad NIT [Yellow box]

Table with 13 columns: Número Consecutivo, Monedas involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda 1, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa Pactada, Modalidad de Cumplimiento, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES SWAPS INTERÉS OTRAS MONEDAS

Entidad NIT [Yellow box]

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Monedas involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda 1, Tasa interés Moneda 1, Tasa interés Moneda 2, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Tasa Pactada, Modalidad de Cumplimiento, Periodicidad Moneda 1, Periodicidad Moneda 2, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante.



PROYECTO DE REGULACIÓN – PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES CREDIT DEFAULT SWAPS

Entidad NIT 0

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Moneda, Fecha de Terminación del CDS, Emisor del Activo de Referencia, Fecha de vencimiento del activo de referencia, Valor facial a cubrir en %, Nombre de la Contraparte del CDS, Valor nominal del CDS, Prima Inicial, Prima Periódica, Periodicidad Prima, Modalidad de Cumplimiento, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES FORWARDS DE TASA DE INTERÉS

Entidad NIT 0

Table with 18 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector (Según Tabla 1), Tasa de Interés o Título de Bono Fija Subyacente, Emisor del Título (solo para títulos), Tipo de Tasa Capita (solo para títulos), Plazo (tasa de interés) o fecha de vencimiento (títulos), Denominación del título o de la tasa, Precio o Tasa Pactada, Modalidad de Cumplimiento, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES OPCIONES DE TASA DE INTERÉS

Entidad NIT 0

Table with 18 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector (Según Tabla 1), Tasa de Interés o Título de Bono Fija Subyacente, Emisor del Título (solo para títulos), Tipo de Tasa Capita (solo para títulos), Plazo (tasa de interés) o fecha de vencimiento (títulos), Denominación del título o de la tasa, Precio o Tasa Pactada, Prima, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES FORWARDS ÍNDICES BURSÁTILES

Entidad NIT 0

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector (Según Tabla 1), Índice Bursátil Subyacente, Precio Pactado, Modalidad de Cumplimiento, Opcionalidad, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



PROYECTO DE REGULACIÓN – PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES OPCIONES ÍNDICES BURSÁTILES

Entidad: 0
NTI: [ ]

Table with 14 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto, Moneda, Nombre de la Contraparte, Código Sector, Índice Bursátil Subyacente, Precio Pactado, Prima, Tipo de Opción, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES PRODUCTOS BÁSICOS

Entidad: [ ]
NTI: [ ]

Table with 20 columns: Número Consecutivo, Tipo de Transacción, Tipo Producto, Moneda Referencia, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda de Referencia, Producto Subyacente, Nombre de la Contraparte, País de la Contraparte, Tipo Contraparte, Tasa de Cambio en Moneda de Referencia, Tasa Pactado/Precio, Movilidad de Cumplimiento, Opciones Call/Put, Opciones Tipo Opc., Opciones Precio Ejercicio en Moneda de Referencia, Swap Tasa de Referencia, Swap Periodicidad, Tipo de Novedad, Comentarios, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES FUTUROS ESTANDARIZADOS SOBRE TASAS DE CAMBIO, TASAS DE INTERÉS O ÍNDICES ACCIONARIOS

Entidad: [ ]
NTI: [ ]

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Moneda involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda 1, Nombre de la Cámara de Compensación y Liquidación del Exterior, Tasa Pactada (Moneda 2/Moneda 1), Movilidad de Cumplimiento, Oportunidad, Tipo de Opción, Tasa de Interés o Tasa de Rentas Fijas Subyacente, Índice del Título (solo para títulos), Tipo de Tasa Capita (solo para títulos), Plazo (tasa de interés o fecha de vencimiento (títulos)), Desempeño del Índice de la tasa, Índice Bursátil Subyacente, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES OPCIONES ESTANDARIZADAS SOBRE TASAS DE CAMBIO, TASAS DE INTERÉS O ÍNDICES ACCIONARIOS

Entidad: [ ]
NTI: [ ]

Table with 17 columns: Número Consecutivo, Moneda involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Fecha de Ejecución, Monto Moneda 1, Nombre de la Cámara de Compensación y Liquidación del Exterior, Tipo de Opción, Prima (Moneda 2/Moneda 1), Tasa Pactada (Spot) (Moneda 2/Moneda 1), Precio del Ejercicio (títulos) (Moneda 2/Moneda 1), Condiciones de Ejecución, Tasa de Interés o Tasa de Rentas Fijas Subyacente, Índice del Título (solo para títulos), Tipo de Tasa Capita (solo para títulos), Plazo (tasa de interés o fecha de vencimiento (títulos)), Desempeño del Índice de la tasa, Índice Bursátil Subyacente, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES SWAPS ESTANDARIZADOS SOBRE TASAS DE CAMBIO, TASA DE INTERÉS O ÍNDICES ACCIONARIOS

Entidad: 0
NTI: [ ]

Table with 15 columns: Número Consecutivo, Moneda involucradas (Moneda 1, Moneda 2), Tipo de Transacción, Fecha de Negociación, Fecha de Vencimiento, Monto Moneda 1, Tasa Interés Moneda 1, Tasa Interés Moneda 2, Nombre de la Cámara de Compensación y Liquidación del Exterior, Tasa Pactada (Moneda 2/Moneda 1), Movilidad de Cumplimiento, Periodicidad Moneda 1, Periodicidad Moneda 2, Tipo de Novedad, Operación realizada por Matriz/ Controlante



**PROYECTO DE REGULACIÓN –  
PUBLICACIÓN PARA COMENTARIOS  
MODIFICACIÓN AL ESQUEMA DE REPORTES DE LAS OPERACIONES DE  
DERIVADOS AL BANCO DE LA REPÚBLICA  
PR-DOAM- 024 del 14 de octubre de 2020**



MODELO DE FORMATOS DE REPORTE DE DERIVADOS - RESIDENTES  
OTROS SUBYACENTES E INSTRUMENTOS

Entidad  
NIT

--

Número de consecutivo	Tipo de transacción	Tipo de producto	¿Cual?	Fecha de negociación	Fecha de vencimiento	Subyacente 1	Subyacente 2 (En caso de Swaps)	Monto nominal en USD	Nombre de la contraparte	Código Sector (Según Tabla 1)	País de la contraparte	(Forward) Tasa de contado en USD	(Forward) Tasa pactada	(Forward) Modalidad de cumplimiento	Prima de la opción

Opción Call/Put	Tipo de opción	(Opciones) Precio Ejercicio en Moneda de Referencia	(Swaps) Periodicidad del pago	(Swap) Tasa de referencia	Tipo de novedad	Comentarios	Operación realizada por Matriz/ Controlante