

1. Proyecto de Circular para el Registro Extemporáneo de las Operaciones de Derivados en Divisas

En cumplimiento de lo previsto en los artículos 1.1.3.6, 1.1.7.3, 1.1.7.4 y 1.1.7.5, del Reglamento del Sistema de Negociación de Divisas y Registro de Operaciones sobre Divisas administrado por Tradition Colombia S.A., se publica para comentarios el proyecto de Circular que permite efectuar el registro extemporáneo de las operaciones de Derivados en Divisas celebradas por los Afiliados distintos de los IMC en el mercado mostrador con Agentes del Exterior autorizados para realizar operaciones de derivados de manera profesional:

Para el efecto, se recibirán comentarios a la propuesta de Circular vía correo electrónico en la siguiente dirección:

traditioncolombia@tradition.com.co

Plazo para comentarios: Tres (3) días hábiles contados a partir de la publicación del presente Boletín, hasta las 5:00 pm del 22 de febrero de 2017.

Cualquier inquietud, también será recibida en la Carrera 14 No. 85 – 68 oficina 602, Bogotá D.C., o en el teléfono (1) 219 9000.

Cordial saludo,

(Original Firmado)

ARIEL ROZMARYN BARURZADEK

Representante Legal
Tradition Colombia S.A.

Registro Extemporáneo de Operaciones de Derivados en Divisas

El numeral 2 de la Circular Reglamentaria Externa DODM 317 expedida por el Banco de la República, establece que las entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia (SFC), distintas de los IMC, podrán registrar en un sistema de registro de operaciones sobre divisas debidamente autorizado, las operaciones de derivados sobre divisas que realicen en el mercado mostrador con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados de manera profesional.

Para el efecto, la misma circular en el numeral 2.3 señala que el registro de las operaciones se deberá efectuar dentro los 15 minutos siguientes a su ejecución. 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.

No obstante la obligatoriedad de los registros en los tiempos señalados, los Afiliados a los sistemas de registro de operaciones sobre divisas podrán hacer el registro de las operaciones de forma extemporánea para efectos de realizar el “close out netting” y satisfacer su necesidad de normalizar este proceso, bajo los siguientes parámetros:

- El registro deberá permitir identificar claramente estas operaciones en el Sistema de Registro y en la trazabilidad de la información que deberá remitirse a la Superintendencia Financiera de Colombia, el Banco de la República y al AMV.
- Se deberán coordinar conjuntamente entre el administrador del sistema y el afiliado las actividades necesarias para adelantar el cargue de las operaciones objeto de registro dentro de un mismo espacio de tiempo y poder asignar los consecutivos en el sistema de registro que permitan identificar claramente estas operaciones, sin mezclarlas con las operaciones que correspondan al mismo día, siguiendo el mismo protocolo que se viene aplicando para el registro normal de las operaciones.
- Las operaciones se recibirán y quedaran registradas con la fecha del día en que el sistema las reciba, las cuales deberán ser ingresadas con el detalle de la operación original, incluyendo como mínimo el suministro de la siguiente información por parte del Afiliado, de acuerdo con lo previsto en la Circular Reglamentaria Externa - DODM – 317 de 2009 del Banco de la República:

- Será responsabilidad del Afiliado que solicita el registro la veracidad y precisión de la información que se registra, quien declara, asegura y garantiza que todas las Operaciones registradas a través del Sistema de Registro, corresponden en todo a la realidad.

Fecha y Hora de ejecución
Fecha y hora de registro
Fecha de vencimiento
Fecha de liquidación
Tipo de instrumento (NDF, opciones, swap tasa de cambio o swap tasa de interés)
Moneda 1
Moneda 2
Tipo de Operación (compra o venta)
Monto (en moneda 1)
Tasa
Spot base (en caso de ser un fx swap)
Modalidad de cumplimiento
Contrapartes
Operador del fondo
Cuenta propia o cuenta terceros
Opcionalidad (s/n)

Adicional para opciones:

Tipo de operación (call o put)
Tipo de opción
Prima opción
Condición de ejercicio

Adicional para swaps de tasa:

Tasa de interés moneda 1
Periodicidad de los flujos moneda 1
Periodicidad de los flujos moneda 2

- Una vez entregada e ingresada la totalidad de la información requerida en la plataforma de registro, el Administrador enviará la confirmación de las respectivas Operaciones al Afiliado a través de correo electrónico u otro servicio de mensajería electrónico.
- La anulación de las Operaciones extemporáneas registradas por los Afiliados en el Sistema de Registro atendiendo razones como error sustancial, fallas técnicas u otras establecidas de conformidad con la

normatividad vigente, se registrarán por lo contemplado en el Reglamento del Administrador.

- El Administrador enviará a la Superintendencia Financiera de Colombia, al Banco de la República y al AMV toda la información respecto de la extemporaneidad de los registros recibidos; así mismo, divulgará al público en general la información respecto a las Operaciones registradas de acuerdo a las Operaciones registradas en el Sistema de Registro de acuerdo a lo establecido en la Resolución Externa No. 4 de 2009 de la Junta Directiva del Banco de la República y las demás normas que la desarrollen, modifiquen, complementen o sustituyan. en particular la Circular Reglamentaria Externa - DODM – 317 de 2009 del Banco de la República y el Reglamento del sistema.