

Asunto:**CIRCULAR REGLAMENTARIA EXTERNA DEL BANCO DE LA REPÚBLICA –
DODM- 317**

SET ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas “SET-FX” se permite informar a todos sus afiliados que el Banco de la República mediante su Circular Reglamentaria Externa – DODM – 317 del 26 de junio de 2015 (la cual se adjunta con el presente boletín), estableció los principios bajo los cuales los IMC deben realizar los registros de las operaciones que se pacten a una tasa de mercado que no se conoce al momento de la negociación (FIX del día de la negociación, FIX del día del vencimiento, TRM, etc.).

Teniendo en cuenta que las disposiciones contenidas en la circular mencionada entran en vigencia a partir del 1º de octubre de 2015, enviamos a continuación los datos de contacto para obtener información sobre la implementación de las interfaces respectivas para el reconocimiento de las operaciones FIX registradas a través del Sistema SET-FX:

Hernando Ángel Sánchez
Gerente de Proyectos
hangel@set-icap.co
Tel. 7427777 Opción 1, Extensión 217

Estaremos atentos para resolver cualquier inquietud sobre este particular.

(Original firmado)
ANDRES MACAYA DÁVILA
Presidente
SET-ICAP FX S.A.



Fecha: 26 JUN. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

2.3 PLAZO PARA REGISTRAR LAS OPERACIONES

Los IMC señalados en los Numerales 1 y 2 del Artículo 59 de la Resolución Externa 8 de 2000, deberán registrar las operaciones sobre divisas que realicen en el mercado mostrador con otros IMC, con agentes del exterior autorizados para realizar operaciones de derivados o con otros residentes distintos de IMC, de acuerdo con lo establecido en el presente numeral.

Se exceptúan de la obligación de registro las operaciones de contado sobre divisas, celebradas entre IMC y los demás residentes, distintos de vigilados por la SFC y la Nación - Ministerio de Hacienda y Crédito Público, cuyo monto nominal sea inferior a doscientos cincuenta mil dólares de los Estados Unidos de América (USD \$250.000), o su equivalente en otras monedas.

De igual forma, los IMC que registren en un sistema de registro las operaciones sobre divisas que realicen en sistemas de negociación deberán hacerlo de acuerdo con los siguientes principios:

- i. Las operaciones que se realicen dentro del horario de operación establecido por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, se deberán registrar dentro de los quince (15) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento. Para el caso de las operaciones de derivados realizadas en el mercado mostrador por IMC con residentes distintos de entidades vigiladas por la SFC y la Nación – Ministerio de Hacienda y Crédito Público- esta disposición entra en vigencia a partir del 1 de marzo de 2016. Hasta esta fecha, dichas operaciones deberán ser registradas por el IMC con anterioridad al cierre de operación de los sistemas de registro.
- ii. Las operaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán como si hubieran sido realizadas al primer instante de la apertura siguiente, es decir, el registro deberá efectuarse durante los primeros quince (15) 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 quince (15) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva operación, independientemente del momento de su cumplimiento. 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 quince (15) minutos posteriores a la apertura del día hábil siguiente, en caso que la tasa se conozca después del cierre de dichos sistemas.
- iv. 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 $t=0$.



Fecha: 26 JUN. 2015

ASUNTO: 19 SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN Y SISTEMAS DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE DIVISAS

Circular una vez los sistemas de negociación y/o de registro hayan incorporado los ajustes a sus reglamentos.

Los IMC deberán registrar las modificaciones que se realicen sobre las condiciones de las operaciones de derivados, atendiendo la reglamentación establecida en la *Circular Reglamentaria Externa DODM-144 - Operaciones de Derivados* y siempre y cuando puedan acreditar los cambios ante los organismos de vigilancia y control. Este registro deberá realizarse de acuerdo con los siguientes principios:

- i. Las modificaciones que se realicen dentro del horario de operación establecido por los sistemas de negociación y por los sistemas de registro de operaciones sobre divisas, deberán ser registradas por el IMC antes del cierre de operación de estos sistemas.
- ii. Las operaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura siguiente de dichos sistemas.
- ii. Las operaciones que se realicen con posterioridad a la hora de cierre de los sistemas de negociación y de los sistemas de registro de operaciones y antes de la hora de apertura del día hábil siguiente, se registrarán durante los primeros quince (15) minutos posteriores a la apertura siguiente de dichos sistemas.
- iii. Cuando se trate de modificaciones sobre operaciones entre IMC afiliados al mismo sistema, uno de los IMC deberá realizar la modificación al registro y su contraparte deberá verificar dicha modificación. Cuando uno solo de los IMC sea el afiliado al sistema, será responsabilidad de éste la modificación del registro.

3. DIVULGACIÓN DE INFORMACIÓN

Los administradores de sistemas de negociación y de sistemas de registro de operaciones sobre divisas deberán divulgar la información de las operaciones negociadas o registradas de acuerdo con los siguientes parámetros:

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 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 HTRANS que hace parte de la plataforma electrónica SEBRA del BR, en los formatos del Anexo 1 de esta circular a partir del 6 de julio de 2015.

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.