

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 1 de 15

Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV de Renta Variable a través de la CRCC

Impactos Tecnológicos al Mercado

Marzo de 2018

La información aquí contenida es preliminar a la implementación del proyecto, por lo cual puede ser actualizada, eliminada o modificada de cualquier manera por posteriores publicaciones realizadas por la **bvc, CRCC y/o deceval**.

<http://www.bvc.com.co>
<http://www.camaraderiesgo.com>

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 2 de 15

Contenido

1. INTRODUCCIÓN.....	4
2. OBJETIVO	5
3. IMPACTOS CRCC	6
3.1. Portal	6
3.1.1. Funcionalidades modificadas	6
3.1.1.1. Cuentas	6
3.1.1.1.1. Ampliación del Campo Código de Cuenta.....	6
3.1.1.1.2. Creación masiva de Cuentas en la CRCC	6
3.1.2. Funcionalidades nuevas.....	12
3.1.2.1. Mantenimiento de Operaciones Contado	12
3.1.2.2. Consulta de Instrucciones de Liquidación	13
3.1.2.3. Informe de Cumplimiento IL Contado.....	14
3.1.2.4. Volcamiento de Operaciones.....	15

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 3 de 15

Historial de Versiones

Versión	Fecha	Estado	Autor:	Descripción
1.0	05/03/2018	Versión inicial	Oscar Forero	Versión inicial.

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 4 de 15

1. INTRODUCCIÓN

Este documento explica los impactos tecnológicos que tiene el proyecto para la Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV en los aplicativos de la CRCC.

Se detallan cada una de las funcionalidades modificadas las cuales tienen interacción con los miembros.

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 5 de 15

2. OBJETIVO

Permitir a los Miembros identificar los impactos y posibles modificaciones funcionales y/o tecnológicas de modo que puedan implementar los cambios pertinentes dentro de sus procesos y aplicativos tecnológicos, de manera oportuna para el paso a producción.

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 6 de 15

3. IMPACTOS CRCC

3.1. Portal

3.1.1. Funcionalidades modificadas

3.1.1.1. Cuentas

3.1.1.1.1. Ampliación del Campo Código de Cuenta.

Se ampliará los caracteres del campo código de cuenta de terceros o cuentas propias a cinco (5) caracteres.

3.1.1.1.2. Creación masiva de Cuentas en la CRCC

Al archivo de cargue masivo de cuentas en formato Excel tendrá modificaciones. A continuación, se muestra una tabla con el listado de los campos que deben venir en el formato Excel. Los campos que se eliminan se muestran en color rojo y los campos nuevos en color azul:

Nombre del campo	Tipo campo	Campo obligatorio
Número de identificación	Numérico	SI
Tipo de identificación	Numérico	SI
Primer Nombre	Alfanumérico	SI
Segundo Nombre	Alfanumérico	NO
Primer Apellido	Alfanumérico	SI

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 7 de 15

Segundo Apellido	Alfanumérico	NO
Dígito	Numérico	SI
Razón Social	Alfanumérico	SI
País	Numérico	SI
CIIU	Numérico	SI
Calidad tributaria	Numérico	SI
Tipo titular	Numérico	SI
Tipo persona	Numérico	SI
Tipo tercero	Numérico	SI
Clase	Numérico	SI
Categoría	Numérico	SI
Tipo Anotación	Numérico	SI
Referencia Cuenta	Numérico	SI
No. Inversionista DVL	Numérico	SI
No. Contrato DCV	Numérico	SI
Dígito DCV	Numérico	SI
Entidad Portafolio DCV	Numérico	SI
Exclusividad Acciones	Numérico	SI
Volcamiento (Nuevo)	Alfanumérico (SI O NO)	SI
Cuenta Volcamiento (Nuevo)	Alfanumérico (Se debe poner el número de la cuenta ya creada)	SI (para cuentas de Derivados y Exclusivas de acciones)
Forward	Numérico	SI
Referencia Sistema registro	Numérico	SI
Depositante directo Entrega	Numérico	SI
Depositante directo DCV	Numérico	SI
No. Contrato DCV	Numérico	SI
Dig.Contr.DCV	Numérico	SI

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 8 de 15

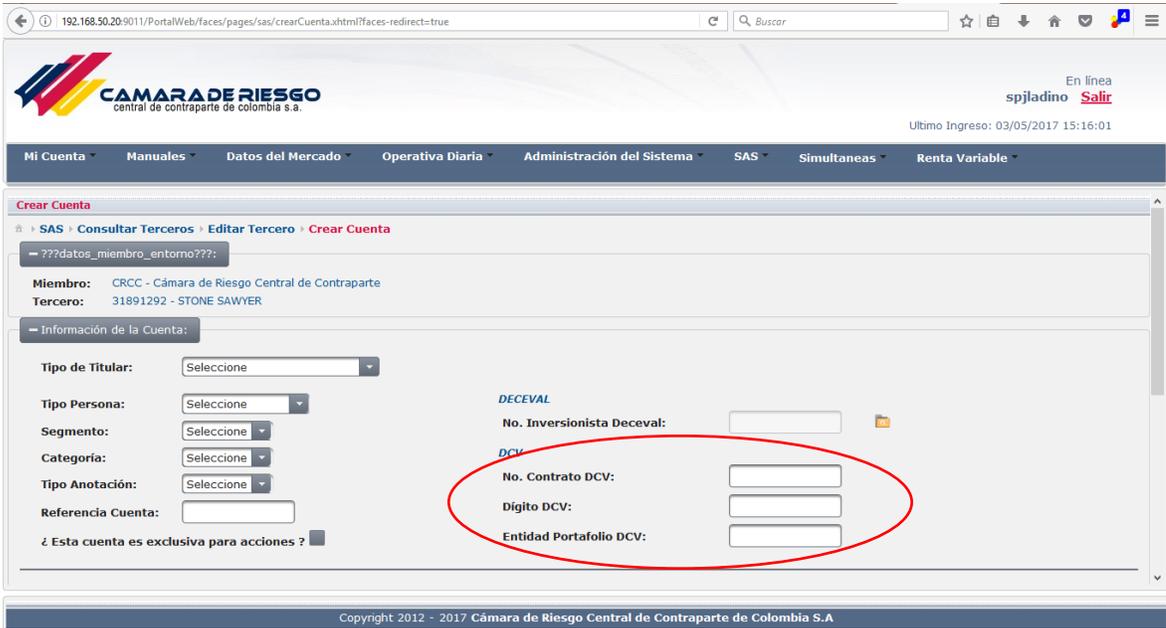
Portafolio DCV	Numérico	SI
Código DCV	Numérico	SI
Depositante directo DVL	Numérico	SI
Código Deceval	Numérico	SI
Num. Inversionista Deceval	Numérico	SI
Renta Variable	Alfanumérico (SI) y (NO)	SI
Derivados	Alfanumérico (SI) y (NO)	SI
Renta Fija	Alfanumérico (SI) y (NO)	SI
Cuenta ya existe (Se elimina)	Numérico 0 y 1	SI
Cuenta anteriormente creada (Se elimina)	Numérico 0 y 1	SI
Custodio (Nuevo)	Alfanumérico (SI) o (NO)	SI
No. ID Custodio (Nuevo).	Numérico.	SI
Cuenta CUD (Nuevo).	Numérico.	SI
Portafolio CUD (Nuevo).	Numérico.	SI
No. Contrato DCV custodio (Nuevo).	Numérico	SI
Digito DCV custodio (Nuevo).	Numérico	SI
Entidad Portafolio DCV custodio (Nuevo).	Numérico	SI
Marcación MILA (Nuevo)	Alfanumérico (SI) o (NO)	SI
Código depositante directo (Nuevo)	Numérico	SI

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 9 de 15

3.1.1.1.3. Creación de Cuentas por pantalla del Portal

A la creación por pantalla se adicionarán los mismos campos mencionados en la creación masiva.

- Cuenta CUD
- Portafolio CUD
- No. Contrato DCV custodio
- Digito DCV custodio
- Entidad Portafolio DCV custodio



192.168.50.20:9011/PortalWeb/faces/pages/sas/crearCuenta.xhtml?faces-redirect=true

En línea
spjladino [Salir](#)
Ultimo Ingreso: 03/05/2017 15:16:01

Mi Cuenta ▾ Manuales ▾ Datos del Mercado ▾ Operativa Diaria ▾ Administración del Sistema ▾ SAS ▾ Simultaneas ▾ Renta Variable ▾

Crear Cuenta

→ SAS → Consultar Terceros → Editar Tercero → **Crear Cuenta**

--- ???datos_miembro_entorno???:

Miembro: CRCC - Cámara de Riesgo Central de Contraparte
Tercero: 31891292 - STONE SAWYER

--- Información de la Cuenta:

Tipo de Titular: Seleccione ▾

Tipo Persona: Seleccione ▾

Segmento: Seleccione ▾

Categoría: Seleccione ▾

Tipo Anotación: Seleccione ▾

Referencia Cuenta:

¿ Esta cuenta es exclusiva para acciones ?

DECEVAL

No. Inversionista Deceval:

DCV

No. Contrato DCV:

Digito DCV:

Entidad Portafolio DCV:

Copyright 2012 - 2017 Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A.

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 10 de 15

3.1.1.1.4. Creación de cuentas de garantía y colaterales

La nueva versión de SMART 2018 incluye un ajuste en la Gestión de Cuentas. En 20 de los 46 archivos que actualmente se generan a través de las herramientas de Cámara (Station, Server y Gatefix) se realizarán cambios. El detalle de estos cambios se presentará en el Documento Impactos Tecnológicos Versión 2018 de SMART.

Como parte de la actualización del manejo de cuentas, se realizará la creación de dos nuevos tipos de cuentas, con esto se tendrá una estructura de cuentas, donde se tendrán cuentas con funciones específicas.

Cuentas de posición.

Cuentas de garantía.

Cuenta de colaterales.

3.1.1.1.5. Cambios en las tablas del server.

Se han identificado cambios en las estructuras de los archivos exportados por el server asociados al nuevo tamaño del campo de cuenta y la nueva estructura de cuentas.

Campo IdCta aumenta a 12 posiciones

Tablas Nuevas:

- CmarginAccounts
- CCollateralAccounts
- CMarginOpenPosition

Tablas modificadas:

- CHolders
- Caccounts
- CGiveIn
- CGiveOut
- Ctrades
- COpenPosition
- CSpotTradeSBRK
- Cpremiums
- CVarMargin

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3 Página 11 de 15

- CIniMarginCalc
- CAccountSettl
- CCpPledges

3.1.1.2. Mantenimiento de Operaciones

En esta pantalla se adicionarán los registros de las operaciones TTVs.



Esta pantalla mantendrá los filtros y ordenamientos que se tienen actualmente con las operaciones REPO.

3.1.1.3. Anticipos de Operaciones

A esta funcionalidad se incluirán las operaciones TTV y Contado



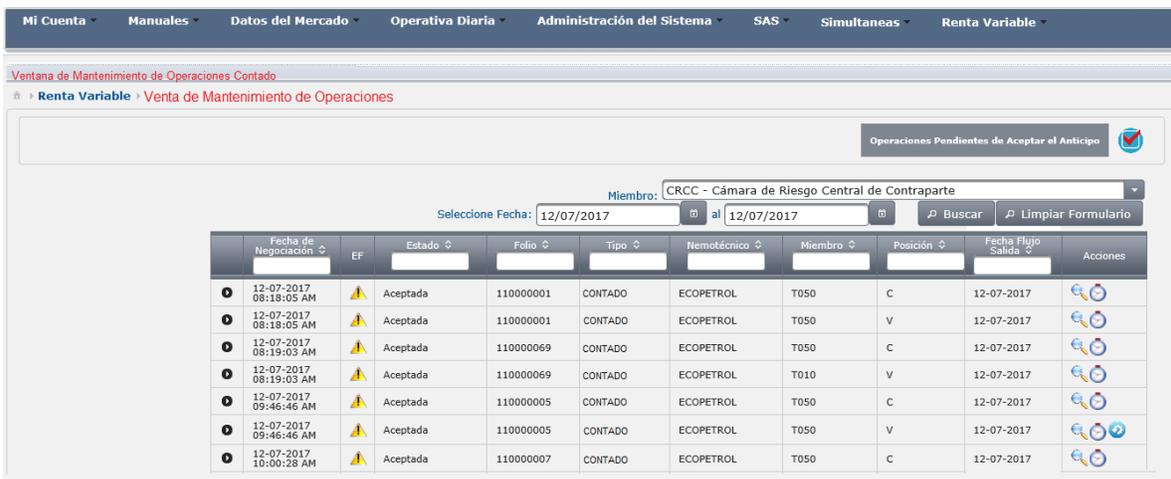
Fracción	Nuevo Valor Prima
0	\$33.684.000

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 12 de 15

3.1.2. Funcionalidades nuevas

3.1.2.1. Mantenimiento de Operaciones Contado

Se creará un nuevo mantenedor de operaciones para las operaciones de contado



Operaciones Pendientes de Aceptar el Anticipo

Miembro: CRCC - Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Selección Fecha: 12/07/2017 al 12/07/2017

Fecha de Negociación	EF	Estado	Folio	Tipo	Nemotécnico	Miembro	Posición	Fecha Flujo Salida	Acciones
12-07-2017 08:18:05 AM		Aceptada	110000001	CONTADO	ECOPETROL	T050	C	12-07-2017	
12-07-2017 08:18:05 AM		Aceptada	110000001	CONTADO	ECOPETROL	T050	V	12-07-2017	
12-07-2017 08:19:03 AM		Aceptada	110000069	CONTADO	ECOPETROL	T050	C	12-07-2017	
12-07-2017 08:19:03 AM		Aceptada	110000069	CONTADO	ECOPETROL	T010	V	12-07-2017	
12-07-2017 09:46:46 AM		Aceptada	110000005	CONTADO	ECOPETROL	T050	C	12-07-2017	
12-07-2017 09:46:46 AM		Aceptada	110000005	CONTADO	ECOPETROL	T050	V	12-07-2017	
12-07-2017 10:00:28 AM		Aceptada	110000007	CONTADO	ECOPETROL	T050	C	12-07-2017	

La pantalla tendrá los siguientes campos, los cuales permitirán realizar filtros y ordenamientos:

- Fecha de cumplimiento
- Fecha de negociación
- Estado
- Folio
- Especie
- Posición

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3 Página 13 de 15

Desde esta pantalla se permitirá realizar el anticipo de operaciones.

3.1.2.2. Consulta de Instrucciones de Liquidación

Se creará una nueva pantalla en donde se incluirán las instrucciones de liquidación correspondientes al neto en valores a nivel de cuenta aplicado a las operaciones de Contado. A través de esta pantalla los Miembros podrán visualizar en línea el cumplimiento de sus instrucciones.



La pantalla tendrá los siguientes campos, los cuales permitirán realizar filtros y ordenamientos:

- Fecha de la instrucción de liquidación
- Estado
- Número
- Origen (C1-> Contado primer ciclo. C2 -> Contado segundo ciclo.
P-> Prima
D-> Dividendos

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 14 de 15

A -> Anticipo)

- Especie
- Miembro
- Custodio
- Cuenta CRCC
- Tipo (Neto
Bruto)
- Efectivo
- Títulos

3.1.2.3. Informe de Cumplimiento IL Contado

Los campos del informe generado son los que se muestran a continuación:

Nombre Del Campo	Descripción
Miembro	Código identificador del Miembro o Custodio.
Cuenta.	Número de cuenta del Tercero.
Instrucción de Liquidación (IL).	Identificador único de la IL.
Folio CRCC.	Folio de cada una de las operaciones que componen dicha IL.
Punta.	Punta del Tercero participante. Este campo aparece de forma proporcional a la cantidad de operaciones que conformen dicha IL. Los posible valores para este campo: - C: Compra. - V: Venta.
Fracción.	Número de la fracción a la que pertenece el Tercero, asociado a un determinado folio; este campo aparece de forma proporcional a la cantidad de operaciones que conformen dicha IL. Para el caso de una punta entera, este campo toma el valor cero.
Tercero.	Identificador del Tercero.

	Proyecto Compensación y Liquidación operaciones Contado y TTV	Código: SBRC0009
	IMPACTOS TECNOLÓGICOS AL MERCADO	Versión: 1.3
		Página 15 de 15

Nominal	Valor nominal por cada folio/fracción que compone dicha IL.
Especie	Especie en criterio de dicha IL.
Precio	Precio.
Volumen Compra.	(P * Q) Los valores de este campo llevan signo positivo.
Volumen Venta.	(P * Q) Los valores de este campo llevan signo negativo.
Neto Total.	Diferencia entre Compras y Ventas.
Neto a recibir Miembro.	Diferencia entre Compras y Ventas de las IL a liquidar por el Miembro.
Neto a girar Miembro.	Diferencia entre Compras y Ventas de las IL a liquidar por el Miembro.
Neto a recibir Custodio	Diferencia entre Compras y Ventas de las IL a liquidar por el Custodio.
Neto a girar Custodio	Diferencia entre Compras y Ventas de las IL a liquidar por el Custodio.

Este informe podrá ser generado desde la pantalla de consulta de instrucciones de liquidación y descargado al equipo de la persona que realiza la consulta o vía servicio web, en este caso el informe será generado y ubicado en una ruta para ser descargado vía FTP.

3.1.2.4. Volcamiento de Operaciones

Las operaciones correspondientes a futuros sobre acciones se volcarán al segmento de renta variable el día de su fin de negociación para que sean liquidadas en la fecha de vencimiento bajo las condiciones del segmento de renta variable. Por lo anterior, al crear las cuentas de terceros para futuros sobre acciones, los Miembros deberán relacionar la cuenta de renta variable en la que han de volcar las operaciones.