

Con base en la información, la Cámara procederá a la preparación de las Instrucciones de Liquidación de tipo Pago sin Entrega y Cobro sin Entrega en la cuenta CUD del Miembro y/o Agente en el Banco de la República.

Etapa 2: Al finalizar el quinto día de la Sesión de Liquidación por Diferencias por Retardo, la Cámara transmite las Instrucciones de Liquidación de tipo Pago sin Entrega y Cobro sin Entrega en la cuenta CUD de los Miembros y/o Agentes, según corresponda, hacia el Deceval.

Etapa 3: Al finalizar la Sesión de Liquidación por Diferencias por Retardo, una vez el Deceval haya recibido las Instrucciones de Liquidación mencionadas en la Etapa anterior, los Miembros y/o Agentes, deben efectuar el proceso de entrega y cobro de efectivo a los Terceros Identificados. Los Miembros No liquidadores y/o Agentes deberán procesar la información ofrecida por el Portal Web de la Cámara, con el fin de realizar la gestión de liquidación de la misma manera frente a sus Terceros Identificados.

Para el caso de los terceros del exterior no conocidos al momento de la Liquidación, la entrega y cobro del efectivo la realizará el Miembro que haya actuado por su cuenta, hasta tanto se realice la identificación del tercero.

CAPÍTULO CUARTO

COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA 4

Artículo 4.4.4.1. Procedimiento para la Compensación y Liquidación Anticipada por solicitud de un Miembro para Operaciones Repo.

(Este artículo fue modificado mediante Circular 23 del 2 de junio de 2020, publicada en el Boletín Normativo No. 028 del 2 de junio de 2020, modificación que rige a partir del 2 de junio de 2020.)

De acuerdo con lo establecido en el artículo 1.5.3.2. de la presente Circular, el procedimiento para la Compensación y Liquidación Anticipada de Operaciones Repo será el siguiente:

1. El Miembro ingresa al Portal WEB de la Cámara por el módulo de renta variable y en la opción mantenimiento de operaciones, debe indicar la nueva fecha de liquidación del flujo de regreso de la Operación Repo.
2. La Cámara validará que la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada se realice dentro del horario establecido para la Sesión de Aceptación de Operaciones. Adicionalmente, la Cámara no permitirá solicitudes de Compensación y Liquidación Anticipada para el mismo día del cumplimiento del flujo de salida de la Operación Repo.
3. El Miembro deberá indicar si la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada corresponde a un anticipo con reliquidación o sin reliquidación del Monto Final de la Operación Repo.
4. La Cámara previo a la aprobación de la solicitud de la Compensación y Liquidación Anticipada, notifica al Miembro que corresponda a la misma pareja de la Operación Repo enviada por la Bolsa, con la información de la nueva fecha de Liquidación y el nuevo valor del Monto Final de la operación para su aprobación.
5. Si el Miembro notificado con la información de la nueva fecha de Liquidación y el nuevo valor del Monto Final de la operación, aprueba la solicitud, la Cámara procede a informar la aprobación de la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada al Miembro que la realizó. Adicionalmente, si la operación debe ser cumplida por un Agente, la Cámara notifica a través del Portal WEB y/o Correo electrónico la nueva fecha y nuevo Monto Final de la Operación al Agente.

Así mismo, la Cámara notifica al Deceval y a la Bolsa, la aceptación de una solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada y enviará la información de la nueva fecha de Liquidación y el nuevo Monto Final de la Operación.
6. Si el Miembro notificado con la información de la nueva fecha de liquidación y el nuevo valor del Monto Final de la Operación, rechaza la solicitud, la Cámara procede a informar el rechazo de la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada al Miembro que la realizó. Por lo tanto, la fecha de Liquidación y el Monto Final de la Operación se mantendrán de acuerdo con lo estipulado en la Operación original.

7. Si la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada corresponde a un anticipo sin reliquidación y es realizado por el Miembro del Enajenante de la Operación Repo, la Cámara aprueba la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada y notifica al Miembro de la cuenta que corresponda a la misma pareja de la Operación Repo enviada por la Bolsa, con la información de la nueva fecha de liquidación.

Si la Operación debe ser cumplida por un Agente, la Cámara notificará a través del Portal WEB y/o correo electrónico la nueva fecha de liquidación de la Operación al Agente.

Así mismo, la Cámara notificará al Deceval y a la Bolsa, la aceptación de una solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada y enviará la información de la nueva fecha de Liquidación al Vencimiento de la Operación y el nuevo valor del Monto Final de la Operación.

8. Si el Enajenante y Adquirente corresponden al mismo Miembro en la pareja de la Operación Repo enviada por la Bolsa, la Cámara aprueba la solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada y notifica al Miembro la información de la nueva fecha de liquidación o, en caso que así lo solicite el Miembro, del monto final de la Operación.

Si la Operación debe ser cumplida por un Agente, la Cámara notificará a través del Portal WEB y/o correo electrónico la nueva fecha de liquidación de la Operación al Agente.

Así mismo, la Cámara notificará al Deceval y a la Bolsa, la aceptación de una solicitud de Compensación y Liquidación Anticipada y enviará la información de la nueva fecha de Liquidación al vencimiento de la Operación y el nuevo valor del Monto Final de la Operación.

9. En el Sistema de la Cámara la Compensación y Liquidación Anticipada se registrará como una operación tipo "F", que permite la generación automática de todos los procesos necesarios para registrar la nueva fecha de Liquidación por Entrega en el flujo de regreso de la Operación Repo y, de ser el caso, el nuevo Monto Final de la Operación asociados al número inicial de la Operación Repo aceptada por la Cámara.