

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4., 1.4.5. y 1.4.10. del Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., se publica:

TABLA DE CONTENIDO

No.	Circular	Páginas
15	ASUNTO: MODIFICACIÓN DEL ARTÍCULO 4.2.2. Y 4.2.3. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A. RELACIONADOS CON LA ASIGNACIÓN DE OPERACIONES Y EL TRASPASO DE OPERACIONES ACEPTADAS.	7

ASUNTO: MODIFICACIÓN DEL ARTÍCULO 4.2.2. Y 4.2.3. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A. RELACIONADOS CON LA ASIGNACIÓN DE OPERACIONES Y EL TRASPASO DE OPERACIONES ACEPTADAS.

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4., 1.4.5. y 1.4.10. del Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., se publica la modificación de los artículos 4.2.2. y 4.2.3. de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A. relacionados con la asignación de Operaciones y el Traspaso de Operaciones Aceptadas.

Artículo Primero. Modifíquese el artículo 4.2.2. y 4.2.3. de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., que quedarán así:

ARTÍCULO ANTERIOR	ARTÍCULO ACTUAL
<p data-bbox="170 235 705 264"><u>Artículo 4.2.2. Asignación de operaciones.</u></p> <p data-bbox="170 306 1045 410">Consiste en la asignación que deben realizar los Miembros, de las Operaciones Aceptadas de la Cuenta Diaria a las Cuentas Definitivas de acuerdo con el titular al cual correspondan.</p> <p data-bbox="170 453 1045 521">La Asignación de Operaciones se regirá por las siguientes reglas y presupuestos:</p> <ol data-bbox="170 563 1045 1177" style="list-style-type: none"> <li data-bbox="170 563 1045 703">1. Las Operaciones catalogadas como de Posición Propia estarán asignadas directamente a las Cuentas de Registro de la Cuenta Propia por lo tanto, para dichas Operaciones no estará disponible la Asignación de Operaciones. <li data-bbox="170 816 1045 959">2. En el caso de Operaciones de Terceros Identificados, el sistema de negociación y/o registro donde se realiza o registra la Operación permitirá la Asignación de la Operación a la Cuenta Definitiva desde el ingreso de la orden <li data-bbox="170 1002 1045 1177">3. Las Operaciones Aceptadas que no sean asignadas, desde el ingreso de la orden o registro de la Operación en los sistemas de negociación y/o registro, serán registradas preliminar y automáticamente por la Cámara en la Cuenta Diaria, para que posteriormente el Miembro las asigne a la Cuenta Definitiva correspondiente. 	<p data-bbox="1068 235 1608 264"><u>Artículo 4.2.2. Asignación de operaciones.</u></p> <p data-bbox="1068 306 1944 410">Consiste en la asignación que deben realizar los Miembros, de las Operaciones Aceptadas de la Cuenta Diaria a las Cuentas Definitivas de acuerdo con el titular al cual correspondan.</p> <p data-bbox="1068 453 1944 521">La Asignación de Operaciones se regirá por las siguientes reglas y presupuestos:</p> <ol data-bbox="1068 563 1944 1390" style="list-style-type: none"> <li data-bbox="1068 563 1944 777">1. Las Operaciones catalogadas como de Posición Propia estarán asignadas directamente a las Cuentas de Registro de la Cuenta Propia <u>desde el ingreso de la orden en el sistema de negociación y/o registro donde se realiza o registra la Operación por lo tanto, para dichas Operaciones no estará disponible la Asignación de Operaciones.</u> <li data-bbox="1068 816 1944 959">2. En el caso de Operaciones de Terceros Identificados, el sistema de negociación y/o registro donde se realiza o registra la Operación permitirá la Asignación de la Operación a la Cuenta Definitiva desde el ingreso de la orden. <li data-bbox="1068 1002 1944 1390">3. Las Operaciones Aceptadas que no sean asignadas, desde el ingreso de la orden o registro de la Operación en los sistemas de negociación y/o registro, serán registradas preliminar y automáticamente por la Cámara en la Cuenta Diaria, para que posteriormente el Miembro las asigne a la Cuenta Definitiva correspondiente. <u>Excepcionalmente, en el evento en que el Miembro no pueda realizar la asignación de la Operación a la Cuenta Definitiva de Tercero Identificado, podrá realizar dicha asignación a la Cuenta de Registro de la Cuenta Propia, teniendo en cuenta su responsabilidad por las Operaciones Aceptadas y registradas en su estructura de Cuentas.</u>

4. La Asignación de Operaciones puede tener lugar desde la Hora de Inicio hasta la Hora de Cierre de la sesión de Administración de Operaciones.
5. El Operador del Miembro con el perfil autorizado, debe seleccionar cada una de las Operaciones registradas en la Cuenta Diaria y trasladar el monto no neteado de la Operación o una fracción de éste, seleccionando el número de contratos y la Cuenta Definitiva (Código Cuenta + Código Subcuenta), a la cual debe realizarse el registro de la posición seleccionada.
6. Si al cierre del horario de Administración de Operaciones existen Operaciones Aceptadas que no hayan sido asignadas de la Cuenta Diaria a una Cuenta Definitiva, el Sistema de la Cámara automáticamente asignará aquellas Operaciones pendientes a la correspondiente Cuenta Residual del Miembro Liquidador o Miembro no Liquidador.
7. La Cámara trata la Operación de Asignación como un registro de operación tipo "D".

Parágrafo. Cuando se trate de Operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados, dichas Operaciones serán registradas por los Miembros directamente en Cuentas Definitivas a través de los sistemas de negociación y/o registro autorizados por la Cámara, por lo que para dichas Operaciones no estará disponible la Asignación de Operaciones. Para Operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados provenientes de un Mecanismo de Contratación no estará disponible la Asignación de Operaciones

4. La Asignación de Operaciones puede tener lugar desde la Hora de Inicio hasta la Hora de Cierre de la sesión de Administración de Operaciones.
5. El Operador del Miembro con el perfil autorizado, debe seleccionar cada una de las Operaciones registradas en la Cuenta Diaria y trasladar el monto no neteado de la Operación o una fracción de éste, seleccionando el número de contratos y la Cuenta Definitiva (Código Cuenta + Código Subcuenta), a la cual debe realizarse el registro de la posición seleccionada.
6. Si al cierre del horario de Administración de Operaciones existen Operaciones Aceptadas que no hayan sido asignadas de la Cuenta Diaria a una Cuenta Definitiva, el Sistema de la Cámara automáticamente asignará aquellas Operaciones pendientes a la correspondiente Cuenta Residual del Miembro Liquidador o Miembro no Liquidador.
7. La Cámara trata la Operación de Asignación como un registro de operación tipo "D".

Parágrafo Primero. Cuando se trate de Operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados, dichas Operaciones serán registradas por los Miembros directamente en Cuentas Definitivas a través de los sistemas de negociación y/o registro autorizados por la Cámara, por lo que para dichas Operaciones no estará disponible la Asignación de Operaciones. Para Operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados provenientes de un Mecanismo de Contratación no estará disponible la Asignación de Operaciones.

	<p>Parágrafo Segundo: <u>La Cámara dentro de su plan de capacitación a los Miembros explicará los eventos en que procede la Asignación de Operaciones.</u></p>
<p>Artículo 4.2.3. Traspaso de Operaciones Aceptadas.</p> <p>La Operación de Traspaso consiste en la reasignación de una Operación registrada en una Cuenta Definitiva de Tercero Identificado a otra Cuenta o Cuentas Definitivas de Tercero(s) Identificado(s) diferentes, o de una Operación registrada en una Cuenta Definitiva de Registro de la Cuenta Propia a otra Cuenta o Cuentas Definitivas de Registro de la Cuenta Propia de un mismo Miembro Liquidador o Miembro no Liquidador, dentro de la estructura de Cuentas del mismo Miembro. Este tipo de Operación no supone modificación en el Precio de Negociación de la Operación Aceptada ni en su volumen y su Traspaso puede ser por volumen total o parcial.</p> <p>En caso que lo requiera la Cámara, el Miembro por su operativa de traspasos, deberá enviar una carta explicativa de la causa del Traspaso, con confirmación del titular de la cuenta de origen y destino. Los Miembros podrán traspasar una Operación Aceptada de una Cuenta Definitiva o de la Cuenta Residual a otra u otras Cuentas Definitivas diferentes, siempre que las mismas se encuentren bajo su misma estructura de Cuentas, para tal efecto se cumplirá el siguiente procedimiento:</p>	<p>Artículo 4.2.3. Traspaso de Operaciones Aceptadas.</p> <p>La Operación de Traspaso consiste en la reasignación de una Operación registrada en una Cuenta Definitiva de Tercero Identificado a otra Cuenta o Cuentas Definitivas de <u>l mismo</u> Tercero(s) Identificado(s) diferentes, o de una Operación registrada en una Cuenta Definitiva de Registro de la Cuenta Propia a otra Cuenta o Cuentas Definitivas de Registro de la Cuenta Propia de un mismo Miembro Liquidador o Miembro no Liquidador, <u>o de una Operación registrada en una Cuenta Definitiva de Tercero Identificado a otra Cuenta o Cuentas Definitivas de Tercero(s) Identificado(s) diferentes, siempre que sea haya presentado un error operativo en el registro inicial de la Operación,</u> dentro de la estructura de Cuentas del mismo Miembro. Este tipo de Operación no supone modificación en el Precio de Negociación de la Operación Aceptada ni en su volumen y su Traspaso puede ser por volumen total o parcial.</p> <p>En caso que lo requiera la Cámara, el Miembro por su operativa de traspasos, deberá enviar una carta explicativa de la causa del Traspaso, con confirmación del titular de la cuenta de origen y destino. Los Miembros podrán traspasar una Operación Aceptada de una Cuenta Definitiva o de la Cuenta Residual a otra u otras Cuentas Definitivas diferentes, siempre que las mismas se encuentren bajo su misma estructura de Cuentas. <u>Excepcionalmente, el Miembro podrá traspasar la Operación Aceptada de la Cuenta Residual a la Cuenta Definitiva de Registro de la Cuenta Propia cuando no pueda realizar el Traspaso a la Cuenta Definitiva de Tercero Identificado teniendo en cuenta su responsabilidad por las Operaciones Aceptadas y registradas en su estructura de Cuentas.</u> ¶ Para tal efecto se cumplirá el siguiente procedimiento:</p>

1. El Operador del Miembro con el perfil autorizado, debe seleccionar la Operación que desea traspasar. El traspaso puede ser por el total del volumen de la Operación o por una fracción de la misma, para lo cual debe indicar el número de contratos y la Cuenta (Código Cuenta + Código Subcuenta) a la cual debe realizarse el Traspaso de la Operación.
2. El Sistema identifica la Operación de Traspaso con tipo de operación "T". Por lo tanto, para efectos del Registro de la Operación, el Traspaso es una nueva Operación que tiene por objeto la correcta Asignación de la Operación original y que la Compensación de los derechos y obligaciones corresponda con las instrucciones del Titular de la cuenta, sin eliminar el registro de la Operación original, lo que permite su identificación de manera completa desde el origen.
3. El Traspaso de Operaciones se podrá realizar en cada sesión en los horarios establecidos para la Administración de Operaciones en la presente Circular.

1. El Operador del Miembro con el perfil autorizado, debe seleccionar la Operación que desea traspasar. El traspaso puede ser por el total del volumen de la Operación o por una fracción de la misma, para lo cual debe indicar el número de contratos y la Cuenta (Código Cuenta + Código Subcuenta) a la cual debe realizarse el Traspaso de la Operación.
2. El Sistema identifica la Operación de Traspaso con tipo de operación "T". Por lo tanto, para efectos del Registro de la Operación, el Traspaso es una nueva Operación que tiene por objeto la correcta Asignación de la Operación original y que la Compensación de los derechos y obligaciones corresponda con las instrucciones del Titular de la cuenta, sin eliminar el registro de la Operación original, lo que permite su identificación de manera completa desde el origen.
3. El Traspaso de Operaciones se podrá realizar en cada sesión en los horarios establecidos para la Administración de Operaciones en la presente Circular.

Parágrafo. La Cámara dentro de su plan de capacitación a los Miembros explicará los eventos en que procede el Traspaso de Operaciones.

Artículo Segundo. Vigencia. La presente modificación a la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A., rige a partir del día dos (2) de diciembre de 2016.

(Original Firmado)
OSCAR JOYA LIZARAZO
Suplente del Gerente