

**INSTRUCTIVO OPERATIVO NO. 001**

**PARA EL CÁLCULO DEL IMPORTE DEL VALOR DE GIRO DEL EFECTIVO QUE DEBE REALIZAR EL TITULAR DE LA CUENTA CON POSICIÓN NETA COMPRADORA EN LA LIQUIDACIÓN POR ENTREGA FÍSICA DE LOS VENCIMIENTOS DE DICIEMBRE DE 2008 DEL CONTRATO DE FUTURO TES MEDIANO PLAZO LISTADO POR LA BVC.**

---

Con ocasión de los vencimientos de diciembre de 2008 del Contrato de Futuro TES mediano plazo listado por la BVC, la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A., en adelante la Cámara, ha elaborado el presente instructivo operativo para el cálculo del importe del valor de giro del efectivo que debe realizar el titular de la cuenta con posición neta compradora en la liquidación por entrega física.

**1. CANASTA DE ENTREGABLES Y FACTOR DE CONVERSIÓN PARA LOS CONTRATO DE FUTURO TES MEDIANO PLAZO LISTADO POR LA BVC CON VENCIMIENTOS DE DICIEMBRE DE 2008.**

De conformidad con lo establecido por la BVC los vencimientos de Diciembre de 2008 del Futuro TES Mediano Plazo tendrán la siguiente canasta de entregables con sus respectivos factores de conversión.

TEMZ08F	
TITULOS	FACTOR DE CONVERSION
TFIT06141113	0.972034
TFIT10120914	1.101439
TFIT10281015	0.859436

**2. CÁLCULO DEL VALOR DE GIRO DEL EFECTIVO QUE DEBE REALIZAR EL TITULAR DE LA CUENTA CON POSICIÓN NETA COMPRADORA.**

De acuerdo con el artículo 5.3.14. de la Circular Única de la Cámara el valor de giro en efectivo se calculará así:

*Importe efectivo Operación = N° Contratos \*(Factor de conversión \* Precio Liquidación \* Valor Nominal del Contrato de Futuro + Cupón Corrido)*

El cupón corrido se calcula sobre la base del valor nominal del Contrato de Futuro pero sobre las condiciones particulares del título a entregar.

Para efectos del cálculo se tendrán en cuenta lo siguiente:

- El factor de conversión incluirá seis (6) decimales.
- El precio de liquidación incluirá tres (3) decimales.
- El cupón corrido incluirá cuatro (4) decimales.
- El valor de giro del efectivo de la operación incluirá dos (2) decimales.

### **3. INFORMACIÓN DEL VALOR DE GIRO DEL EFECTIVO DE LA OPERACIÓN EN LA LIQUIDACIÓN POR ENTREGA FÍSICA DE LOS VENCIMIENTOS DE DICIEMBRE DE 2008 DEL FUTURO TES MEDIANO PLAZO**

Para efectos de conocer el valor del giro del efectivo de la operación en la liquidación por entrega física de los vencimientos de diciembre de 2008 del Futuro TES Mediano Plazo, el Miembro recibirá de la Cámara la siguiente información:

- a. A través del terminal de Cámara, el Miembro podrá visualizar únicamente para fines informativos el valor del giro de efectivo de la operación calculado utilizando un factor de conversión de cuatro (4) decimales.
- b. Al finalizar la sesión de Cámara del último día de negociación del Contrato de Futuro y, para efectos del cumplimiento, la Cámara remitirá al Miembro un formato FO SRO LIQVTO 0002 (Anexo 1) con la información de las operaciones de contado desglosadas por titular junto con el valor de giro en efectivo, calculado utilizando un factor de conversión de seis (6) decimales.
- c. La información contenida en el formato FO SRO LIQVTO 0002 (Anexo 1) es la que se tendrá en cuenta para las operaciones de transferencia de valores y efectivo ante los Depósitos Centralizados de Valores y el sistema de pagos del Banco de República, respectivamente, las cuales se cumplirán el día de vencimiento de acuerdo con las características del Contrato de Futuro TES Mediano Plazo.


### **4. POLÍTICA DE SEGURIDAD DE LA INFORMACIÓN EN EL REPORTE DEL FORMATO FO SRO LIQVTO 0002 (Anexo 1)**

De acuerdo con las políticas de seguridad de la información de la Cámara, el envío del Formato FO SRO LIQVTO 0002 (Anexo 1) se realizará mediante el manejo del software Winzip para empaquetar y encriptar la información y se remitirá exclusivamente al correo registrado en el Formato de solicitud de creación y modificación del usuario administrador (según anexo 11 de la Circular Única de la Cámara) correspondiente al Administrador del Miembro a través del correo electrónico [gestionentrega@camaraderiesgo.com.co](mailto:gestionentrega@camaraderiesgo.com.co).

## **5. MESA DE AYUDA**

En caso de cualquier duda por favor comunicarse con la Mesa de Ayuda de la Cámara en los teléfonos PBX 595 34 34 Extensiones 204, y de la 209 a la 214 o al correo electrónico [gestionentrega@camaraderiesgo.com.co](mailto:gestionentrega@camaraderiesgo.com.co).

## **6. ANEXO 1.**

	<b>ANEXO 1</b>	Código:
	<b>OPERACIONES DE CONTADO DESGLOSADAS POR TITULAR</b>	FO SRO LIQVTO 0002
	<b>(TABLA CSPOTTRADEBRKD)</b>	Archivo:
		Versión: 1
		Página 1 de 1

**1. DATOS GENERALES DEL MIEMBRO**

**Razón social:**  
**Número de Identificación (NIT):**  
**Código Miembro en CRCC:**

**2. DATOS DEL CONTACTO A QUIEN SE REMITE LA INFORMACIÓN**

**Nombre del Administrador del Miembro:**  
**Cargo:**  
**Teléfono Oficina:** **Teléfono celular:**  
**Dirección de correo electrónico:**


El Miembro deberá mantener actualizada la información del funcionario con el rol Administrador , así como el nombre y teléfonos de contacto de la persona responsable del proceso de liquidación.

**3. OPERACIONES DE CONTADO DESGLOSADAS POR TITULAR**

Fecha	Cámara	Miembro	Titular	Contrato	TipoVto	Volumen	Signo	PrecioRef	FechaRegNegli	MiemLiq	Código CSD	ImpEfectivo	NumOperacion

**4. RESPONSABLES.**

**Cargo:** SUBGERENTE DE OPERACIONES Y RIESGOS  
**Nombre :** MOISES MAHECHA PARRA

	<b>ESPECIFICACIONES DE LA TABLA</b>
---	-------------------------------------

**Nombre de la tabla:** CSPOTTRADESBRKD

**Descripción:** Detalle a nivel de titular de las operaciones sobre futuros con entrega física realizada en la sesión.

Variable	Campo	Tipo	Valores definidos	Descripción
1	Fecha	LocalDate		Fecha de sesión
2	Cámara	String(2)		Código de cámara
3	Miembro	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
4	Titular	String(3)		Titular
5	Contrato	String(16)		Código del título
6	TipoVto	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
7	Volumen	Qty		Número de títulos
8	Signo	char	"Tomo"=Compra "Doy"=Venta	Signo de la operación de contado
9	PrecioRef	Price		Precio de referencia
10	FechaRegNegIni	LocalDate		Fecha de registro de las operaciones de contado
11	MiemLiq	String(4)		Miembro liquidador
12	Código CSD	VarChar (1)		Código del Depósito
13	ImpEfectivo	Number (19,4)		Valor del Impute Efectivo
14	NumOperacion	Number(10)		Número de la operación

## 7. VIGENCIA.

El presente Instructivo Operativo, rige a partir del día primero (1) de diciembre de 2008.