



BOLETÍN INFORMATIVO

Proyecto Renta Variable por Cámara de Riesgo Central de Contraparte – Pruebas en el Ambiente PRUM de la Cámara

PRUEBAS – COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES DE CONTADO

No. 111

Bogotá D.C., 12 de septiembre de 2019

La Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia (CRCC) informa a los participantes del Mercado de Renta Variable que el **lunes 16 de septiembre de 2019** se dará inicio a una fase de Marcha Blanca exclusivamente en el ambiente de Pruebas del Mercado PRUM de la Cámara, correspondiente a la visualización de los procesos de Compensación y Liquidación de Operaciones de Contado y validación del Modelo de Riesgo.

Es importante informar que la Bolsa de Valores de Colombia y el Depósito Centralizado de Valores no participarán en este periodo de pruebas, razón por la cual, las pruebas no contemplan interacción con el X-Stream, Back Office o SIIDJ de las respectivas entidades. Por lo anterior, se simularán las operaciones y los cumplimientos de acuerdo la solicitud que realicen los participantes.

CRONOGRAMA DE ACTIVIDADES ALISTAMIENTO:

FECHA	ASUNTO	RESPONSABLE
Lunes 16 de septiembre al lunes 30 de noviembre de 2019	Pruebas Cámara Horario: 9 a.m. a 4 p.m.	- Cámara - Sociedades Comisionistas de Bolsa Miembros de la Cámara o en proceso de vinculación a la Cámara - Agentes Custodios/Pagos

Para el desarrollo de la Marcha Blanca por favor tener en cuenta lo siguiente:

1. Generalidades de la Marcha Blanca

1.1 Solicitud de Operaciones de Contado

La solicitud de operaciones por parte de las Sociedades Comisionistas de Bolsa y/o Custodios se debe realizar un (1) día antes del ingreso de dichas operaciones en el sistema de la Cámara. El cumplimiento de estas operaciones se realizará dos días posteriores a su ingreso en el sistema de la Cámara.

La información que debe remitir la Sociedad Comisionista de Bolsa y/o Custodio para el ingreso de las Operaciones será:

- Miembro
- Código del Tercero (ISA u OSA) asignado en la marcha blanca de cuentas.
- Tipo de Documento
- Número de Documento
- Número de Cuenta Inversorista
- Especie (Las especies que se podrán utilizar son: Ecopetrol, Éxito, ISA, Terpel y Coltejer)
- Posición (Compra o Venta)
- Nominal
- Precio
- Custodio S/N
- Si tiene Custodio, en que proceso se debe ingresar (Empaquetada, Admitida)

Se procesará un máximo de 10 Operaciones por Sociedad Comisionista de Bolsa y/o Custodio por día. Las solicitudes de Operaciones realizadas por los Custodios deben estar previamente acordadas con la Sociedad Comisionista de Bolsa a través de la cual se realizará el ingreso de la Operación.

En el evento que la Sociedad Comisionista de Bolsa requiera que las operaciones ingresen y se mantengan en la cuenta diaria para solicitar posteriormente la complementación, es decir, que no sean complementadas desde su ingreso al sistema de la Cámara, identificará la cuenta 00D en el campo *Código del Tercero*.

1.2 Solicitud de Complementación de Operaciones de Contado

La solicitud de Complementación de Operaciones por parte de las Sociedades Comisionistas de Bolsa podrá realizarse hasta las 11 am de la Fecha Teórica de Liquidación. Las operaciones no se fraccionarán en esta fase de pruebas.

1.3 Solicitud de Recomplementación de Operaciones de Contado

La solicitud de Recomplementación de Operaciones por parte de las Sociedades Comisionistas de Bolsa se podrá realizar hasta las 11.00 am de la Fecha Teórica de Liquidación de las Operaciones. En estas solicitudes se deberá adjuntar el folio reportado por Cámara en el ingreso de las operaciones al sistema.

1.4 Solicitud de Admisión de Operaciones de Contado por parte del Custodio

La solicitud de Admisión de Operaciones de Contado por parte del Custodio podrá ser solicitada por las Sociedades Comisionistas de Bolsa y/o Custodios hasta las 11.00 am de la Fecha Teórica de Liquidación de las Operaciones.

La liquidación de operaciones para las cuales no se reciba solicitud de admisión de Custodio se realizará en la cuenta de la Sociedad Comisionista de Bolsa.

1.5 Solicitud de Anticipos de Operaciones de Contado

La solicitud de Anticipos de Operaciones debe ser solicitada por las Sociedades Comisionistas de Bolsa un (1) día antes de que se requiera el anticipo efectivo de la operación.

1.6 Solicitud de Fraccionamiento de ILOs (Compra y Venta) e ILs de Venta

La solicitud de fraccionamiento de ILOs de compra y venta e ILs de Venta debe ser solicitada por las Sociedades Comisionistas de Bolsa hasta la 1.00 pm de la Fecha Teórica de Liquidación de las Operaciones.

1.7 Solicitud de Constitución de Garantías para cuentas ISA y estructura OSA

La solicitud de constitución de garantías para cuentas ISA y estructura OSA (Constituidas en nombre de la Sociedad Comisionista de Bolsa) debe ser solicitada por las Sociedades Comisionistas de Bolsa un (1) día antes del ingreso de dichas garantías en el sistema de la Cámara.

1.8 Solicitud de Reporte de Cumplimiento

La solicitud del reporte de cumplimiento se podrá realizar durante la sesión de pruebas.

1.9 Solicitud de Liquidación por Diferencias

La solicitud de Liquidación por Diferencias debe ser solicitada por las Sociedades Comisionistas de Bolsa y/o Custodios un (1) día antes de su realización efectiva en el sistema de la Cámara y sólo para las instrucciones de liquidación que se encuentren en estado "Retardo".

1.10 Horarios de Liquidación

Los horarios de los procesos asociados a la liquidación serán los siguientes:

- Inicio de Repique de Valores de ILOs de Venta 1.00 pm
- Inicio de Repique de Valore de ILs de Venta 1.30 pm
- Eficiencia de Efectivo 2.00 pm

- Cumplimiento de ILs e ILOs 2.10 pm hasta las 4.00 pm
- Cumplimiento Parcial de IL e ILOs a las 3.45 pm

1.11 Funcionalidades que no serán incluidas en el Periodo de Pruebas

Dentro del periodo de pruebas no se incluirán las siguientes funcionalidades:

- Corrección de Operaciones
- Compensación y Liquidación de Operaciones TTV
- Proceso de Volcamiento de Operaciones provenientes del Segmento de Derivados
- Constitución y Liberación de Garantías de Terceros bajo una cuenta OSA
- Anulaciones
- Dividendos de Ventas en Corto

Para mayor información sobre el proyecto o aclarar dudas sobre la marcha blanca por favor comuníquese a través de los medios:

- rhenao@camaraderiesgo.com.co o rdiaz@camaraderiesgo.com.co
- camaratech@camaraderiesgo.com.co
- (1) 3277000 ext.220 o ext. 245