

CIRCULAR No. 003 de 2009

Señores

AFILIADOS AL SISTEMA DE NEGOCIACION DE VALORES Y DE REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE VALORES ICAP HYBRID SYSTEM (IHS)

Referencia: **Disposiciones varias**

Fecha: **Mayo 20 de 2009**

De acuerdo con lo establecido en el artículo 15.1.2 del Reglamento del IHS, aprobado por la Superintendencia Financiera mediante la Resolución 0538 del 24 de abril de 2009, a continuación se aclaran y desarrollan algunos aspectos del Reglamento, con el objeto de dar más claridad y transparencia a las operaciones que se celebren y/o registren en el IHS.

1. Boleta de cierre de operaciones para la negociación de valores y registro de operaciones sobre valores a través del sistema IHS

Las boletas de cierre de las operaciones generadas por el sistema IHS contendrán la siguiente información:

Información de ICAP Securities Colombia S.A.

Nombre del Administrador del Sistema: ICAP Securities Colombia S.A.
Nombre del Sistema: ICAP HYBRID SISTEM (IHS)
NIT: 830.045.351-5
Logo

Datos de la operación

Fecha de Operación: día, mes y año en que se realiza la operación.
Fecha de Cumplimiento: día, mes y año en que se liquida y cumple la operación.
Clase Operación: Compra o Venta.
Modalidad Operativa: Posición Propia, Por Cuenta de Terceros o para Fondos o Carteras Colectivas.
Consecutivo: número que el sistema IHS asigna para cada operación de negociación o registro que se realiza.

Datos del Afiliado

Razón social del Afiliado
NIT del Afiliado
Nombre del operador autorizado del Afiliado

Datos Generales del Título que se Negocia

Nemotécnico: Código asignado para identificar cada uno de los valores susceptibles de ser negociados en Deuda Pública y Deuda Privada.
Clase de Título: TES clase B, CDT's, bonos, TIDIS, títulos de participación u otros admisibles según el Reglamento del IHS.
Emisor: nombre de la entidad que emite el título.

Características de la Operación

Tipo Operación: de acuerdo al reglamento del Sistema IHS solo se podrán celebrar en el Sistema operaciones de compraventa de contado.
Contraparte: Afiliado al Sistema IHS contraparte en la operación.
Tipo de Cumplimiento: de acuerdo con el Reglamento del IHS, las operaciones se cumplen en la modalidad de contado, mediante el mecanismo de entrega contra pago (DVP). Por excepción, las operaciones se podrán compensar y liquidar mediante el mecanismo de entrega libre de pago, de conformidad con el artículo 6.2.2.4 de Reglamento del sistema.
Tipo de Mercado: el módulo del IHS donde se realizó la operación.
Depósito: medio por el que se compensa y liquida la operación.
Tasa de Negociación: tasa a la cual se negocia el título.
Precio Limpio: precio del bono que excluye la causación de intereses.
Precio Sucio: precio del bono cuando se incluye el interés causado desde el pago del último cupón hasta la fecha de negociación.
Valor Nominal: monto de negociación.
Desembolso Total: valor de giro.

Características del Título que se Negocia

Plazo Total: días desde la emisión hasta el vencimiento del título.
Interés Nominal: tasa cupón.
Periodo de Interés: base del título (365/360)
Fecha de Emisión: fecha en la cual es creado el título.
Fecha de Vencimiento: fecha en la cual se vence el título.
Plazo por Vencer: días restantes al vencimiento del título.
Moneda: moneda a la cual se liquida el título.
Valor Moneda: pesos: 1, UVR: UVR del día de liquidación, TRM: TRM del día de liquidación.

Datos de la Operación Simultánea

Tasa Simultánea: tasa de negociación de la simultánea.
Valor a pagar recompra: giro de la recompra.
Tasa Recompra: tasa a la cual se realiza la recompra.
Fecha Plazo: plazo de la simultánea.
Días Plazo: días al vencimiento de la simultánea.

Datos de las Operaciones por Cuenta de Terceros y para Fondos y Carteras Colectivas

Comitente o fondo o cartera colectiva para el cual se celebra o registra la operación: nombre del tercero que se incluye en la complementación o descripción del fondo o cartera colectiva de que se trate.
Tipo de Identificación: tipo de documento.
Número de Identificación: número de documento.

Liquidación de las Operaciones por Cuenta de Terceros y para Fondos y Carteras Colectivas

Valor Nominal: monto de negociación.
Precio Sucio: precio de un bono cuando se incluye el interés causado desde el pago del último cupón hasta la fecha de negociación.
Desembolso Total: valor de giro.
Comisión: valor a pagar por parte de los Afiliados.
Retención en la Fuente.
Traslado de Retención en la Fuente.
Valor neto.
I.V.A. comisión.
Valor neto incluido I.V.A.

Observaciones

2. Tipo y clase de información disponible en el Sistema IHS, según el tipo de usuario del sistema y los horarios en los que estará disponible

A solicitud del Usuario Operador, el Administrador del Sistema podrá suministrar vía voz la siguiente información:

Condiciones del mercado a nivel mundial
Noticias financieras relevantes
Color del mercado en cuanto a cierres, tendencias, subastas
Divulgación de precios por especies
Información de ofertas y demandas: profundidades
Agresiones en las posturas
Cierres de operaciones del día
Confirmación de registros

Por su parte, el Usuario Administrador tendrá acceso a la siguiente información a través del sistema IHS:

Información del mercado
Cupos de contraparte
Limites por operador

El Usuario Observador dispondrá de la siguiente información a través del sistema IHS:

Información de mercado
Seguimiento del mercado en cuanto a precios y cierres
Informes estadísticos de las negociaciones del día

La información antes descrita estará disponible para los Usuarios Operadores, Usuarios Administradores y Usuarios Observadores durante el horario de funcionamiento del sistema (7:00 a.m. a 5:00 p.m.).

La presente circular rige a partir del día siguiente a su publicación.

Cordialmente,

RICARDO LEAL VILLAREAL
Gerente General