

MEMORANDO INTERNO

PARA: Daniel Quevedo
Gerente de Informática y tecnología.

DE: Fredy Alonso Ruiz Molano
Director de Cumplimiento

ASUNTO: Proyectos – Matriz Cuellos de Botella-Dirección de Cumplimiento

FECHA: Abril 22 de 2015

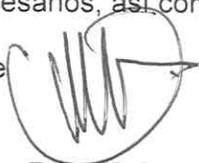
Apreciado Doctor:

De acuerdo a lo establecido en el comité de seguimiento a la vicepresidencia de operaciones del pasado 8 de Abril, y con el fin de poner en marcha la implementación de los siguientes proyectos, para la gestión de las oportunidades de mejora, de manera atenta nos permitimos remitir los documentos de requerimiento V1 elaborados por esta Dirección así:

AREA QUE GENERA	AREA INVOLUCRADA	DESCRIPCION	FECHA INICIAL	FECHA FINAL	SOLUCION	RESPON.	DOCUMENTO
VOP	GIT - GR - GC	6. B. Optimización de los arqueos de caja en PAV. C. Transmisión de información a la Superfinanciera.	B. 02/2015 C. 05/2015	B. 02/2016 C. 02/2016	B. Implementar fuente de datos adicional en el proceso de arqueo C. Implementar funcionalidad para validación del formato 351 y 468	Dirección Cumplimiento	B. Documento de Requerimiento Arqueo Faciales. C. Documento de Requerimiento Validación Formatos de Transmisión Superfinanciera F351,397,468,469,470,471 Y 472

Quedamos atentos a los comentarios, con el fin de iniciar con el proceso definición de los recursos necesarios, así como del cronograma para la puesta en marcha del proyecto.

Cordialmente



Fredy Alonso Ruiz Molano
Director de Cumplimiento.

c.c. Dra. Amparo Reyes Sierra –Vicepresidente de Operaciones
Dr. Jaime Alberto Rueda – Gerente de Planeación Estratégica.

V.O. → Euf.1
22 Abril 2015

Sistemas → [Handwritten signature]
22/04/15
Planeación → [Handwritten signature]
22/04/15



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Fiducoldex S.A.

Documento de Requerimiento – Arqueo faciales

Proceso Conciliación Faciales

Dirección de Cumplimiento
20/04/2015

Contenido

Objetivo	3
Glosario	4
Antecedentes	5
Justificación	6
Conclusiones	9

Objetivo

El presente documento de requerimiento, busca documentar las causas que generan las partidas conciliatorias, en el proceso de arqueo de inversiones, específicamente en la conciliación de datos faciales y proponer soluciones que permitan que dichas partidas se reduzcan.

Glosario

DECEVAL: “El Depósito Centralizado de Valores de Colombia DECEVAL S.A., es una entidad que recibe en depósito valores inscritos en el Registro Nacional de Valores e Intermediarios, para mediante un sistema computarizado administrarlos mitigando el riesgo de su manejo físico en transferencias, registros, ejercicio de derechos patrimoniales etc.) Deuda Privada y Pública del Orden No Nacional”

DCV: “El Depósito Central de Valores del Banco de la República – DCV, es un sistema diseñado para el depósito, custodia y administración de títulos valores en forma de registros electrónicos (desmaterializados) –Deuda Pública Nacional”.

CITITRUST FOR SECURITIES: Custodio de valores a través el cual se custodian los títulos en Moneda Extranjera emitidos en el Exterior-Deuda Pública Emitida en el Exterior.

Fecha de Emisión: Fecha a partir de la cual se crean los títulos y se inicia su colocación en el mercado.¹

Fecha de Vencimiento: Fecha en la que termina la obligación del emisor y reintegra el capital al tenedor del título.¹

Valor Nominal actual: Cantidad de dinero representada en el título en el momento de su emisión o posterior a la amortización de capital.¹

Tasa de Intereses: Es la expresión porcentual del interés aplicado sobre un capital. Las tasas de interés pueden estar expresadas en términos nominales o efectivos. Las nominales son aquellas en que el pago de intereses no se capitaliza, pueden tener periodicidad mensual, trimestral, semestral o cualquier otra que se establezca¹. Las tasas pueden ser Fijas o Variables – Indexadas.

Periodicidad: Frecuencia en el tiempo en la cual se liquidan y pagan los intereses. Puede ser Mensual, Trimestral, Semestral, Anual o periodo vencido.

Vigencia: Es el periodo o Vigencia que se debe utilizar para el cálculo de Interés sobre una tasa Variable. (Ejemplo, Primera Semana de pago (I) o Semana de Pago (F).

Modalidad: Puede ser Anticipada o Vencida (Pago de Interés), en la actualidad no existen títulos como modalidad anticipada.

ISIN: Código de Identificación Internacional que recoge *CONDICIONES GENERALES DE LA EMISION Y FINANCIERAS*²

EMISION: Código de Identificación ante el Banco de la República para Deuda Publica

1. Conceptos Tomados de la Web WWW.BVC.COM.CO
2. Conceptos Tomados de Presentación DECEVAL ISIN ANNA

Antecedentes

En la actualidad Fiducoldex cuenta con la herramienta PAV, la cual permite bajo el concepto de conciliación realizar los procesos de; arqueo de valores nominales y arqueo de faciales de los títulos de los portafolios de Inversión tanto de la posición propia de Fiducoldex como los de los terceros administrados.

La herramienta permite para el proceso de arqueo de valores nominales cruzar información como: **Portafolio, depósito, ISIN, Moneda y valor nominal**, garantizando con estos realizar una conciliación en donde se determine que cada uno de los portafolios mantiene la totalidad de sus títulos en subcuentas independientes, en cada uno de los depósitos y que su valores nominales son exactos a los que se encuentran en el aplicativo de administración de inversiones denominado Porfin.

Para el caso de la conciliación de faciales la herramienta permite cruzar información como: **ISIN, fecha de emisión, fecha de vencimiento, periodicidad, modalidad, tasa, base, indicador y moneda**, con esto se garantiza el cruce de información necesaria para los cálculos financieros de cada uno de los títulos.

La conciliación tanto de Nominales como de Faciales se realiza utilizando las siguientes fuentes de información:

Fuente 1

Sistema Porfin

Archivo PFTIT597 Valor títulos por Serie, bajo extensión .csv.

Archivo PFICO310 Archivo Plano Formato351, bajo extensión .txt.

Fuente 2

Sistema SIID Deceval

REPORTE DE PORTAFOLIOS X DEPOSITANTE PARA EXCEL. - ruta CUENTA INVERSIONISTA - REPORTE DE CUENTA INVERSIONISTA

Banco de la República

ARCHIVO DE SALDOS - ruta MENU DEPOSITO CENTRAL DE VALORES DCV – CONSULTA/INFORMES – GENERACION DE ARCHIVOS PLANOS

Cititrust

EXTRACTO CONSOLIDADO - ruta CUSTODY REPORTING- CONSULTA / REPORTES – MIS REPORTES - POSITION VALUATIONS

Otros archivos

Monedas, en el cual se incluyen los indicadores TRM, ICOLCAP, UVR para reexpresión a pesos de los valores nominales.

Emisiones, el cual trae información complementaria para el cruce de información del extracto del DCV del Banco de la República.



FIDUCOLDEX
Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Justificación

En el proceso de conciliación de faciales, la herramienta PAV deja más del 85% de los títulos pendientes de conciliar, debido a que las fuentes 2 (Depósitos) no contienen dentro de su información toda la data de faciales necesaria para su cruce.

Como ejemplo para el 31 de Marzo de 2015 quedan pendientes de cruce 950 títulos de un total de 1098:

Validación Faciales-Resumen	
31/03/2015	
Deposito	Total Títulos por conciliar Faciales
CITITRUST	46
DCV	2
DECEVAL	898
FISICO	4
Total	950
Val	-

Fuente Acta_OPNCF20150331.txt

Se ha evidenciado, que datos como Base y Vigencia no se reflejan en los extractos de los depósitos, lo cual genera que la herramienta al momento de la conciliación no encuentre información y refleje estas partidas como conciliatorias.

De acuerdo a lo evidenciado se hace necesario crear nuevos cargues que permitan, que las fuentes dos, complemente la información necesaria para el cruce de la totalidad de condiciones faciales (**ISIN, fecha de emisión, fecha de vencimiento, periodicidad, modalidad, tasa, base, indicador, moneda, clase y emisor**).

A continuación se relacionan los archivos que actualmente se cargan para la fuente 2, con la descripción de cada uno de ellos:

Archivos Depósitos Cargados Actualmente en PAV				
Fuente	Archivo generado	Ruta Generación	Acceso información	Descripción del Informe
Aplicativo Deceval SIIDJ	Extracto Deceval	a) deceval.csv: Se genera el reporte en el aplicativo SIID de Deceval a través de la ruta CUENTA INVERSIONISTA - REPORTE DE CUENTA INVERSIONISTA - REPORTE DE PORTAFOLIOS X DEPOSITANTE PARA EXCEL.	Directamente en la Pantalla de la Dirección de Cumplimiento	Archivo en TXT con la siguiente información: DEPOSITANTE NIT RAZON SOCIAL DEPOSITANTE ADMINISTRADOR EMISOR ISIN DEPOSITO FEC.EXPEDICION FEC.VENCIMIENTO TASA MODALIDAD PERIODICIDAD SPREAD EXPRESADO CUENTADOC IDENTIFICACION NOMBRE INVERSIONISTA SALDO TOTAL SALDO DISPONIBLE SALDO TRANSITO SALDO PRENDA BLOQUEOS X EMBARGO SALDO GARANTIA SALDO RETIRO SALDO REPO PASIVO SALDO REPO ACTIVO OTROS BLOQUEOS DESCRIP. OTROS BLOQUEOS SALDO NETO CON REPOS SALDO REBLOQUEOS
Aplicativo S.E.B.R.A. - DCV	Extracto DCV	b) dcv_salDOS.txt: Se genera el reporte en el aplicativo DCV del Sistema S.E.B.R.A. a través de la ruta MENU DEPOSITO CENTRAL DE VALORES DCV - CONSULTA/INFORMES - GENERACION DE ARCHIVOS PLANOS - ARCHIVO DE SALDOS	Directamente en la Pantalla de la Dirección de Cumplimiento	Archivo en TXT con la siguiente información: Código entidad Código Emisor Nemetécnico Emisión # Subcuenta Tipo de Documento # Documento Nombre Vr. Nominal Vr. Nominal Fecha Reporte ISIN
Aplicativo CDS	Extracto Cititrust	c) cititrust.csv: Se genera el reporte en el aplicativo CDS del Sistema del Cititrust. a través de la ruta CUSTODY REPORTING-CONSULTA / REPORTES - MIS REPORTES - POSITION VALUATIONS - EXTRACTO CONSOLIDADO.	A través de la WEB: https://securities.citi-direct.com/sminfoagent/forms/login.fcc	Archivo en CSV con la siguiente información: Account ID Account Name Security ID - ISIN Issue Name Issue Description Settled Quantity Traded Quantity Maturity Date Interest Rate Market Value Issue Price Issue Name Issue Type Name
Banco de la República	Archivo de Emisiones Vigentes	d) Se genera a través de la WEB del Banco de la República	A través de la WEB: http://www.banrep.gov.co/es/contenidos/page/emisiones-vigentes-xls	Archivo en XLS con la siguiente información: Título PlazoTipo Plazo Moneda Emisión Mnemetécnico SEN Fecha Inicio Vigencia Fecha Vencim. Tasa de Interés Tasa Spread Signo Periodo Interés TipoCódigo ISIN Código CFI

A continuación se relacionan los archivos que se pueden usar como complemento de la Fuente 2:



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

OTROS POSIBLES ARCHIVOS A UTILIZAR				
Fuente	Archivo generado	Ruta Generación	Acceso información	Descripción del Informe
Aplicativo Deceval SIIDJ	Archivo plano DECEVAL con información ISINES a un corte	SE GENERA POR - CUENTA INVERSIONISTA- GENERACION ARCHIVO PLANO- REPORTE DE ARCHIVO PLANO DE ISINES	Directamente en la Pantalla de la Dirección de Cumplimiento	Archivo en TXT con la siguiente información: ISIN ANNA CODIGO DEPOSITO FECHA EXPEDICION FECHA VTO TPTIPO DE TASA PPERIODICIDAD MMODALIDAD V1VIGENCIA 1 V2VIGENCIA 2 FORMA DE PAGO INDICADOR MANEJO TASA TASA FIJA EFECTIVA TASA FIJA NOMINAL SPREAD ESTADO ISIN BASE LIQUIDACION NEMOTECNICO CODIGO CFI CODIGO DEL EMISOR CLASE DE TITULO AÑO EMISION SERIE EMISION DESCRIPCION SERIE ADMINISTRADOR FORMA EMISION COD MONEDA COD UNIDAD FORMA CIRCULACIÓN PLAZO EXTENDIDO MATERIALIZABLE MONTO INVERSION MIN IMAULTIPLO INVERSION FRACCIONAMIENTO MONTO FRACCIONAMIENTO MULTIPLO FRACCIONAMIENTO PLAZO MESES TIPO AMORTIZACION ESTADO FECHA INICIO FECHA FINAL
INFOVALMER	Archivo Excel Nemos e ISINES	SE GENERA POR INFOVALMER- RENTA FIJA-BASE DE DATOS ESPECIALIZADA- ARCHIVO DE NEMOS E ISINES LOCAL	Directamente en la WEB https://www.infovalmer.com.co/portal/faces/secure/fixedincome/specializedDB.xhtml?FM=1	Archivo en XLS con la siguiente información: CÓDIGO MEC PLUS NEMO NUEVO NEMO ANTIGUO EMI EMISOR NIT TIT TITULO ISIN 1 ISIN 2 ISIN 3 SERIE ADMINISTRADOR PLAZO MINIMO PLAZO MAX MONEDA CUPON TASA REFERENCIA USO TASA ACTUAL TASA BASE PERIODICIDAD REINVERSION ESTADO Curva Referencia Amortizable Fecha de Emisión Fecha de Vto Método de Valoración Clase y Tipo de Tasa
BCV	Maestro Títulos	Pendiente Validar		
BLOOMBERG		Pendiente Validar		

Es importante que la fuente dos que construye Pav a partir de los extractos relacionados contengan la totalidad de datos fáciles susceptible de conciliación en el proceso de arquezos de Inversiones.



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Conclusiones

- Se evidencia que la Fuente 2 no contiene toda la información necesaria para el proceso de arqueo de faciales.
- Al cierre del 31 de Marzo se presentan 950 partidas conciliatorias.
- Se hace necesario crear nuevos cargues en la herramienta PAV que le permitan a la fuente 2 contener toda la información facial a cruzar.
- Existen dos archivos actualmente que se pueden utilizar como apoyo a la fuente 2 para la conciliación de faciales.
- El Mantis 8622 hace el requerimiento sobre las partidas conciliatorias generadas en el proceso de faciales.



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Fiducoldex S.A.

Documento de Requerimiento
–Validación Formatos de
Transmisión Superfinanciera

F351,397,468,469,470,471 Y 472

Dirección de Cumplimiento
20/04/2015

Contenido

Objetivo	3
Glosario	4
Antecedentes	5
Justificación	6
Conclusiones	11



FIDUCOLDEX
Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Objetivo

El presente documento de requerimiento, busca describir de manera general el proceso de consolidación, validación y envío de los formatos 351, 397 y 468,469,470,471,472 a la superfinanciera y la necesidad de poder contar con un método o herramienta de validación de la totalidad de datos que se transmiten en dichos formatos.

Glosario

Formato 351: Formato en el cual se transmite la composición de los portafolios de inversión.

Formato 397: Formato en el cual se transmite la información relacionada con operaciones, repos, simultaneas y transferencia temporal de valores.

Formato 468: Formato en el cual se transmite la información relacionada con los instrumentos financieros derivados. Forward sobre Divisas (incluye FX - Swap).

Formato 469: Formato en el cual se transmite la información relacionada con los instrumentos financieros derivados. Forward sobre títulos o valores.

Formato 470: Formato en el cual se transmite la información relacionada con los instrumentos financieros derivados. Forward sobre una tasa de interés a plazo ('Forward Rate Agreement' o 'FRA')

Formato 471: Formato en el cual se transmite la información relacionada con los instrumentos financieros derivados. Opciones Europeas en el mercado mostrador (OTC).

Formato 472: Formato en el cual se transmite la información relacionada con los instrumentos financieros derivados. Swaps ('Interest Rate Swap – IRS y 'Cross Currency Swap' – CCS).

Porfin: Sistema e través del cual se administran los portafolios de inversión en títulos de Renta Fija, operaciones Derivadas, Divisas y emisiones.

JAC: Plataforma a través de la cual se realiza el proceso de consolidación del formato 351 para transmisión a la superfinanciera.

Antecedentes

En la actualidad la Dirección de Cumplimiento es el área responsable de la transmisión de los formatos 351, 397, 468, 469, 470, 471 y 472, los cuales tiene una periodicidad de envío diaria, con plazo para transmisión (fecha de reporte) el segundo día hábil siguiente a la fecha de corte hasta las 12 de la noche, esta transmisión se realiza bajo archivos planos a través de la pagina WEB de la superfinanciera así:

Formatos	Informe	Fuente de Información	Consolidación
351 y 397	00-Portafolio de Inversión	Porfin, Encargos FICs(SIFI), Disponible(Excel), Acciones(Excel), ICOLCAP	JAC
468, 469, 470, 471 y 472	02-Derivados	Porfin.	N/A

Los formatos 468, 469, 470, 471 y 472 se generan desde Porfin bajo archivo plano denominado PFICO331 – Nuevo archivo reporte información derivados, sobre este no se genera ningún procedimiento adicional y solo se debe nombrar y transmitir al superfinanciera.

Los formatos 351 y 397 se generan desde Porfin bajo archivo plano denominado PFICO310 – Archivo plano formato 351 y requieren ser consolidados con 4 archivos adicionales denominados Encargos (fuente SIFI), Disponible (fuente Excel), Acciones (fuente Excel) e Icolcap (fuente Excel). La consolidación de los formatos 351 y 397 se realiza a través de la herramienta JAC.

En la actualidad la información proveniente de la fuente Porfin requiere parametrización previa con el fin que los formatos contengan la información de acuerdo a los códigos que se deben reportar dentro de la información a transmitir.

Para los informe de cierre de cada mes se realiza validación de los saldos transmitidos en las cuentas 713- 711 -715- 723 -761 -712 de los formatos 468, 351 y 3947, frente a los saldos contables en SIFI.

Justificación

Se requiere realizar la validación de la totalidad de columnas que se reportan en los formatos, con el fin de garantizar ante la Superintendencia Financiera de Colombia la data que conforma la composición de los portafolios de inversión. Para el caso de los formatos 351 y 397 las validaciones a realizar corresponden a la siguiente información transmitida:

Tipo de Registro	Longitud /Caracteres	Clase	Datos a Validar
1	49	Control y Encabezado	Secuencia, Tipo de Registro, Entidad, Código, Fecha de Corte, Número de Registros, Nombre, Area de Información, Tipo de Informe.
3	44	Datos de la Entidad o el Fideicomiso	Secuencia, Tipo de Registro, Tipo de Evaluación, Tipo de Fideicomiso, Código del Fideicomiso, Tipo de Entidad, Código de Entidad, Tipo de Entidad RL, Código de Entidad RL, Tipo de Fideicomiso, Código del Fideicomiso.
4	85	Identifica el encabezado de los formatos, tanto para el reporte por emisor como para el reporte total de la entidad.	Secuencia, Tipo de Registro, Tipo de Identificación, Numero de Identificación, Dígito de chequeo, Nombre o Razón social, Código CIIU, Código naturaleza jurídica, Campo variable 1, 2, 3, Código reportado.
5	73	Información del formato	Secuencia, Tipo de Registro, Código de formato, Código de la columna, Código de la Unidad de Captura, Código de la subcuenta, Signo, Valor.
6	9	Registro Fin archivo	Secuencia, Tipo de Registro.

Para el registro tipo 5 se requiere realizar validación sobre las columnas allí transmitidas, las cuales son:



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

Columna	Datos a Validar
1	Número asignado por la entidad[1]
2	Código PUC
3	Aval
4	Tipo de identificación del avalista
5	No. identificación avalista
6	Razón social del avalista
7	No. Identificación administrador
8	Razón social del administrador
9	Clase de inversión
10	Nemotécnico
11	Cupón, principal o total
12	Fecha emisión
13	Fecha vencimiento título o valor
14	Fecha vencimiento cupón
15	Fecha compra
16	Código de moneda
17	Valor nominal
18	Amortizaciones de capital – Intereses especiales
19	Valor nominal residual o capitalizado
20	Número de acciones, unidades o participaciones
21	Clase de acciones
22	Valor de compra moneda o unidad original
23	Valor de compra en pesos
24	Código tasa facial del título o valor
25	Valor tasa o spread
26	Base cálculo intereses
27	Periodicidad pago de rendimientos
28	Modalidad pago de intereses
29	Indicador tasa variable de referencia
30	Valor de mercado o valor presente en pesos
31	Valor presente en pesos
32	Valor de mercado o valor presente moneda diferente al peso
33	Tasa de negociación
34	Días al vencimiento o vencidos



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A

37	Valor de la tasa variable 1er flujo
39	Tasa de descuento
40	Precio
41	Método de valoración
42	Fecha último reprecio o fecha último cambio de bursatilidad
43	Valor presente al último reprecio
44	Índice de bursatilidad
45	Intereses y capital vencidos y no cobrados
46	Código PUC provisión
47	Base de provisión
48	Valor de provisión
49	Calificación del título o valor del emisor
50	Entidad calificadora
51	Calificación de riesgo crediticio o de incumplimiento en el pago nominal o flujo.
52	Calificación del avalista
53	Calificación deuda soberana país del emisor o administrador del exterior
54	Entidad calificadora deuda soberana país del emisor o administrador del exterior
55	Depósito de valores
56	No. Identificación asignado por el Depósito de Valores
58	Monto de la emisión
59	Porcentaje (%) de participación en el monto de la emisión
60	Ramo de seguros
61	Relación matriz, filial o subsidiaria
62	Concentración de propiedad accionaria
63	Relación de vinculación entre emisores
64	Código PUC causación en cuenta de resultados
65	Causación valoración en cuentas de resultados
66	Código PUC causación en cuentas de patrimonio
67	Causación valoración en cuentas de patrimonio
68	Restricciones
69	Valorización
70	Desvalorización
71	Fecha de captura de la tasa variable de referencia
72	Número asignado por la entidad a la operación
73	Valor de mercado inversiones para mantener hasta el vencimiento
74	Código país de origen del emisor

Para el caso de los formatos 468, 469, 470, 471 y 472 las validaciones a realizar corresponden a la siguiente información transmitida:

Tipo de Registro	Longitud /Caracteres	Clase	Datos a Validar
1	49	Control y Encabezado	Secuencia, Tipo de Registro, Entidad, Código, Fecha de Corte, Número de Registros, Nombre, Area de Información, Tipo de Informe.
3	44	Datos de la Entidad o el Fideicomiso	Secuencia, Tipo de Registro, Tipo de Evaluación, Tipo de Fideicomiso, Código del Fideicomiso, Tipo de Entidad, Código de Entidad, Tipo de Entidad RL, Código de Entidad RL, Tipo de Fideicomiso, Código del Fideicomiso.
4	85	Identifica el encabezado de los formatos, tanto para el reporte por emisor como para el reporte total de la entidad.	Secuencia, Tipo de Registro, Tipo de Identificación, Numero de Identificación, Dígito de chequeo, Nombre o Razón social, Código CIU, Código naturaleza jurídica, Campo variable 1, 2, 3, Código reportado.
5	73	Información del formato	Secuencia, Tipo de Registro, Código de formato, Código de la columna, Código de la Unidad de Captura, Código de la subcuenta, Signo, Valor.
6	9	Registro Fin archivo	Secuencia, Tipo de Registro.

Para el registro tipo 5 se requiere realizar validación sobre las columnas allí transmitidas, las cuales son:

Columna	Datos a Validar
1	Tipo de forward
2	Número de contrato
3	Finalidad de la operación
4	Forma de Liquidación
5	Metodología de valoración
6	Fecha celebración contrato
7	Fecha vencimiento contrato



FIDUCOLDEX

Fiduciaria Colombiana de Comercio Exterior S. A.

8	Código moneda comprada (divisa X o COP, según el caso)
9	Nominal moneda comprada (divisa X o COP, según el caso)
10	Código moneda vendida (divisa Y o COP, según el caso)
11	Nominal moneda vendida (divisa Y o COP, según el caso)
12	Tipo identificación contraparte
13	No. Identificación contraparte
14	Nombre de la contraparte
15	Tipo de contraparte
16	Tasa de cambio pactada
17	Tasa de cambio fecha de valoración
18	Puntos 'forward' (PIPS) para el plazo remanente
19	Tasa interés bajo riesgo Divisa X para plazo remanente
20	Tasa interés bajo riesgo Divisa Y para plazo remanente
21	Tasa de descuento
22	Días al vencimiento
23	Código PUC derecho
24	Valor del derecho (COP)
25	Código PUC obligación
26	Valor de la obligación (COP)
27	Precio justo de intercambio (COP)

Los formatos 469, 470, 471 y 472 en la actualidad se transmiten en ceros, sin embargo se debe crear la validación para el momento en el cual se cuente con productos que se deben reportar en dichos formatos.

Conclusiones

- Se evidencia que la totalidad de datos reportados en los formatos, no cuentan con una validación.
- Se hace necesario contar con una validación de la información reportada que permita garantizar la data de la información remitida a la Superintendencia Financiera de Colombia.
- En la actualidad a través de la herramienta JAC se realiza la consolidación del formato 351 y 397, se puede explorar la posibilidad a través de esta misma herramienta, a través del concepto de parametrizaciones realizar el proceso de validación de la totalidad de formatos a transmitir a la Superfinanciera.
- En la actualidad a través de la herramienta PAV se realiza cargue del formato 351 para el proceso de arqueo de faciales, se puede explorar la posibilidad a través de esta misma herramienta, a través del concepto de parametrizaciones realizar el proceso de validación de la totalidad de formatos a transmitir a la Superfinanciera.

