

**GFI SECURITIES COLOMBIA S.A.**

**CIRCULAR NORMATIVA No. 019**

De acuerdo con el Artículo 7.1. y siguientes del Capítulo VII – “Negociación – Módulos y Reglas para el Funcionamiento y Operación” del Reglamento de Funcionamiento y Operación del Sistema de Negociación de Valores y Registro de Operaciones de GFI Securities Colombia S.A. aprobado por la Superintendencia Financiera de Colombia mediante la Resolución número 2260 de noviembre veintidós (22) del 2010, modificado y adicionado mediante Resoluciones 0363 del 27 de marzo de 2015, Resolución 1072 de diciembre de 2020 y Resolución 0061 del 27 de enero de 2021, se expide la siguiente Circular Normativa por el Representa Legal Suplente de GFI Securities Colombia S.A., la cual reemplaza la circular normativa No 009 del año 2013.

**Señores:**

AFILIADOS AL SISTEMA DE NEGOCIACIÓN DE LOS VALORES Y REGISTRO DE OPERACIONES SOBRE VALORES ADMINISTRADO POR GFI SECURITIES COLOMBIA S.A.

**Fecha:** Agosto de 2021

**Asunto:** Expedición de Instructivo Operativo Para el Proceso de Registro de Transacciones.

De conformidad con lo previsto en el artículo 9.1 y siguientes del Capítulo IX – “Registro de Transacciones de Valores e Instrumentos Financieros Derivados y/o Productos Estructurados que Tengan o No Calidad de Valor”, del Reglamento de Funcionamiento y Operación del Sistema de Negociación de Valores y Registro de Operaciones de GFI Securities Colombia S.A. (en adelante Reglamento de Funcionamiento de GFI Securities Colombia), se expide el siguiente instructivo operativo para el proceso de registro de las transacciones, el cual se rige por los siguientes artículos:

**Artículo Primero - Reporte de las Transacciones:** Los Afiliados deberán reportar al Administrador mediante un medio verificable (E-mail, Bloomberg y voz) toda la información relacionada con la Transacción que se encuentra prevista en el artículo 9.3. – “Suministro de Información” del Reglamento de Funcionamiento de GFI Securities Colombia, la cual deberá ser reportada dentro de los treinta (30) minutos siguientes a la ejecución de la respectiva Transacción, según lo estipulado en las cartas circulares 039, 041, 049 y 055 de 2020, expedidas por la Superintendencia Financiera de Colombia, las cuales son de aplicación transitoria mientras exista el estado de emergencia declarado por el Ministerio de Salud. Una vez terminado el estado de emergencia se aplicarán los plazos máximos determinados por la Superintendencia Financiera de Colombia. Para el caso de las Transacciones que se ejecuten con posterioridad a la hora del cierre del Sistema de Registro, la información deberá ser enviada durante los treinta diez (30) minutos posteriores a la apertura del día siguiente según lo estipulado en las cartas circulares 039, 041, 049 y 055 de 2020, expedidas por la Superintendencia Financiera de Colombia, las cuales son de aplicación transitoria mientras exista el estado de emergencia declarado por el Ministerio de Salud. Una vez terminado el estado de emergencia se aplicarán los plazos máximos determinados por la Superintendencia Financiera de Colombia.

**Artículo Segundo - Recepción de la información de Transacciones para Registro:** Se entenderá que el Administrador ha recibido la información de las transacciones para su correspondiente registro, siempre que el Afiliado cumpla con el siguiente procedimiento:

- a) El Afiliado enviará al Administrador, en el plazo establecido en el artículo anterior, toda la información necesaria para la realización del registro, un medio verificable (E-mail, Bloomberg y voz), especificando las condiciones del valor a registrar, con la información mínima requerida.
- b) Posterior al envío mediante un medio verificable (E-mail, Bloomberg y voz), el Administrador, confirmará la recepción de sobre la Transacción que se registrará.

**Artículo Tercero - Suministro de Información:** El Afiliado deberá enviar como mínimo al Administrador del Sistema de Registro la siguiente información sobre las Transacciones objeto de registro;

**En el caso de valores de renta fija:**

1. La identificación del valor negociado mediante Nemo-técnico, Isin;
2. La moneda o unidad en la cual está expresado el valor nominal del respectivo valor;
3. El valor nominal de la operación expresado en la moneda o unidad en que se encuentre emitido el valor;
4. El valor en pesos de la operación;
5. El precio o tasa de la operación;
6. La fecha cuando ejecutó la operación para el caso de operaciones realizadas fuera del horario de registro;
7. Identificación de la contraparte;
8. Nombre e identificación del beneficiario de la operación;
9. Hora en la cual se ejecutó la operación;
10. La comisión en términos porcentuales cuando se trate de una operación por cuenta de un tercero;
11. Tipo de operación de que se trata, tales como compra, venta, operación de contado, a plazo, repo, simultánea, transferencia temporal de valores, operaciones de crédito público y de manejo de deuda realizadas con la Nación;
12. Modalidad en la cual se actuó, tales como cuenta propia, cuenta de terceros, administración de portafolios;
13. Fecha de liquidación de la operación.

**En el caso de operaciones con instrumentos financieros derivados que tengan la calidad de valor:**

1. La identificación del instrumento financiero derivado negociado, mediante Nemo-técnico, Isin;
2. La cantidad del instrumento financiero derivado a registrar;
3. El precio total de la operación;
4. Identificación de la contraparte en los términos que establezca el sistema de registro de operaciones;
5. Nombre del beneficiario de la operación o número de cuenta del titular en la respectiva cámara de riesgo central de contraparte donde los afiliados administran las cuentas.

**En el caso de operaciones con instrumentos financieros derivados que no tengan la calidad de valor:**

1. Información general de la operación:
  - 1.1. Tipo de instrumento financiero derivado. Para estos efectos se debe tener en cuenta la clasificación establecida en el Capítulo XVIII de la CBCF, y cualquier detalle adicional que complemente el nombre genérico;
  - 1.2. Tipo de liquidación, diferenciando entre financiera o sin entrega ('Non Delivery') y con entrega ('Delivery');
  - 1.3. Fecha de registro;
  - 1.4. Fecha de celebración;
  - 1.5. Fecha vencimiento;

- 1.6. Fecha de liquidación;
  - 1.7. Posición, diferenciando entre compra y venta;
  - 1.8. Información de la entidad o persona a nombre de quien se está registrando la operación tanto para ésta como para su respectiva contraparte. Se debe incluir nombre, tipo y número de identificación, diferenciando entre: entidades vigiladas y controladas por la SFC; entidades no vigiladas ni controladas por la SFC; persona natural y, sociedad extranjera sin NIT en Colombia;
  - 1.9. Tasa(s) (de cambio y/o de interés) pactada(s) o precio pactado en la moneda original. Para el caso de las opciones se debe reportar el precio de ejercicio;
  - 1.10. Valor nominal del contrato, con su respectiva denominación de la(s) moneda(s) pactada(s);
  - 1.11. Información del(los) subyacente(s), incluyendo como mínimo el tipo.
2. Información específica de la operación, para los casos en los que aplique, además de la información anterior se debe incluir la siguiente:
- 2.1. Tipo de opción, diferenciando entre 'call' o 'put';
  - 2.2. Valor de la prima pactada en pesos.

**Productos estructurados que tengan o no la calidad de valor:**

1. La identificación de la operación mediante Nemotécnico, Isin;
2. Fecha de registro;
3. Fecha de celebración;
4. Fecha vencimiento;
5. Fecha de liquidación;
6. Posición, diferenciando entre emisión o venta y compra;
7. Precio (venta/compra);
8. Existencia de opcionalidad sobre la operación;
9. Información de la entidad o persona a nombre de quien se está registrando la operación tanto para ésta como para su respectiva contraparte. Se debe incluir nombre, tipo y número de identificación, diferenciando entre: entidades vigiladas y controladas por la SFC; entidades no vigiladas ni controladas por la SFC; persona natural y, sociedad extranjera sin NIT en Colombia;
10. Valor nominal del producto, con su respectiva denominación de la(s) moneda(s) pactada(s);
11. Información del(los) subyacente(s), incluyendo como mínimo el tipo.

No obstante, lo anterior, para efectos del registro de los instrumentos y productos a los que se refieren los numerales anteriores se deben atender las siguientes convenciones;

Formato de fechas: AAAA-MM-DD:hh:mm:ss

Tasas de interés: Expresadas en términos efectivos anuales con cuatro cifras decimales

Montos: Expresados con dos cifras decimales.

**COMPLEMENTACIÓN**

Una vez recibida la orden de registro el Administrador del Sistema procederá a incluir en el Sistema la información de Complementación necesaria para el cumplimiento de las Transacciones correspondientes, de conformidad con las órdenes proferidas por los Afiliados correspondientes.

Si como consecuencia de la Confirmación de la Transacción, o por cualquier otra causa, se encuentra información errónea o inexacta, el Administrador del Sistema podrá corregir dicha información dentro del proceso de complementación, con el fin de garantizar el cumplimiento de la Transacción. La complementación deberá hacerse máximo hasta la hora siguiente de la Ratificación de la Transacción.

## MODIFICACIÓN

1. De acuerdo con el numeral 7.6.2 del Reglamento de Funcionamiento de GFI Securities Colombia, un registro se podrá modificar durante el proceso de complementación y más tardar antes del envío de la confirmación del Administrador. Luego de cumplidos los plazos anteriores se debe proceder a la anulación del registro;
2. Datos susceptibles de modificar: Serán susceptibles de modificar todos los datos del registro a excepción de los siguientes:
  - 2.1. Tipo de operación: compra o venta;
  - 2.2. Identificación de las contrapartes.

## ANULACIÓN

El proceso de anulación se regirá por los artículos 7.6.1 y subsiguientes del Reglamento de Funcionamiento de GFI Securities Colombia y teniendo en cuenta los siguientes aspectos adicionales:

1. La solicitud de anulación debe ser solicitada por el afiliado por un medio verificable (E-mail, Bloomberg y voz);
2. Si el afiliado desea registrar de nuevo la operación anulada debe realizar de nuevo la solicitud al administrador del sistema de acuerdo con lo establecido en el reglamento y esta circular.

**Artículo Cuarto. Registro de las Transacciones.** Una vez recibida y confirmada las condiciones de la Transacción se procederá, máximo dentro de veinte (20) minutos siguientes al recibo de confirmación del envío de la información, a su inclusión en los sistemas internos del Administrador.

El registro se publicará en la página Web [www.qfigroup.com.co](http://www.qfigroup.com.co) en el módulo GFI Securities Colombia S.A. en el link Sistema de Registro, donde se pueden consultar durante el día de su vigencia, todas las transacciones registradas.

**Artículo Quinto. Vigencia.** El presente instructivo operativo para el proceso de registro de transacciones rige a partir de su publicación.

La anterior información se actualiza de acuerdo con la aprobación de reunión ordinaria de la Junta Directiva de GFI Securities Colombia S.A., bajo el ACTA 141 y a su vez esta Circular Normativa hace parte integral del Reglamento de Funcionamiento de GFI Securities Colombia.

Cordialmente,

(Original Firmado)

---

**Oscar Luis Pedroza Jiménez**  
**Representante Legal Suplente**  
GFI Securities Colombia S.A  
Nit. 900.369.524-7  
Tel: 7463600