

 MINHACIENDA	NEGOCIACIÓN Y CUMPLIMIENTO DE OPERACIONES ACTIVAS DE TESORERÍA EN COP	Código:	Mis.3.4.3.Pro.1
		Fecha:	30-01-2017
		Versión:	2
		Página:	1 de 7

1. OBJETIVO

Describir la negociación de operaciones activas como son, las compras de TES a Entidades Públicas, la compra y venta de TES y las operaciones Simultáneas a través del Sistema Electrónico de Negociación – SEN y del Mercado Electrónico Colombiano –MEC, Otorgamiento de Créditos, Redenciones Anticipadas y Operaciones de Manejo.

2. ALCANCE

Desde la recepción de ofrecimiento de venta de TES por parte de Entidades Públicas, la decisión de compra de TES a través de los Sistemas Transaccionales, de las operaciones simultaneas, Otorgamiento de Créditos, Redenciones Anticipadas y Operaciones de Manejo hasta la compensación de la operación.

3. NORMAS RELACIONADAS Y POLÍTICAS DE OPERACIÓN

3.1. Normas Relacionadas

- Decreto 4712 del 15 de Diciembre de 2008, por el cual se modifica la estructura del Ministerio de Hacienda y Crédito Público.
- Artículo 37. Se establecen las funciones de la Subdirección de Tesorería.
- Resolución 416 de 11 de febrero 2014 Por el cual se modifica la resolución 1081 del 30 de abril dl 2009 y 2543 de septiembre 8 de 2011 del Ministerio de Hacienda y Crédito Público.
- Artículo 6. Se crea el grupo de Gestión de liquidez de la Subdirección de Tesorería y establece las funciones del grupo.

3.2. Políticas de Operación

Ver documento de políticas de operación

4. TÉRMINOS Y DEFINICIONES

- **SEN:** Sistema Electrónico de Negociación para negociación de títulos TES
- **MEC:** Mercado Electrónico Colombiano
- **CCRC:** Cámara de Riesgo Central de Contraparte
- **SET-FX:** Sistema Electrónico para negociación de dólares americanos vs pesos colombianos
- **MMF:** Money Market Funds
- **CT:** Comité de Tesoreria



5. DESCRIPCIÓN

No.	PROVEEDOR: ENTRADAS	ACTIVIDAD	RESPONSABLE	EXPLICACIÓN	REGISTRO
1.		Definir políticas y estrategias de compra	Subdirector de Tesorería	<p>De acuerdo con los lineamientos de Gestión liquidez y de flujo de caja, se definen las políticas y estrategias de compra de títulos, dependiendo de la operación.</p> <p>Si es una operación Simultanea o REPO, Ir a actividad siguiente</p> <p>Si es un ofrecimiento de una entidad, Ir a actividad 4.</p> <p>Si es una operación a través de SEN o MEC ir a actividad 14</p> <p>Si es una operación de otorgamiento de crédito ir a actividad 19</p> <p>Si es una operación de manejo de crédito ir a actividad 22</p>	
2.		Realizar negociación de operaciones Simultaneas Activas	Profesional de Gestión Institucional, Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	Se debe realizar la negociación de operaciones activas Simultáneas según descrito en el " <i>Instructivo Realización de Operaciones.</i> "	
3.		Copiar archivos planos de las operaciones y subirlos al aplicativo de administración de portafolios	Profesional Especializado y /o Universitario	Copia los archivos planos de SEN y de MEC, de las operaciones simultaneas y los sube al aplicativo de administración de portafolios y lo asigna al portafolio correspondiente según el <i>Manual de Registro del Sistema de Administración de Portafolios</i> Fin del procedimiento.	



No.	PROVEEDOR: ENTRADAS	ACTIVIDAD	RESPONSABLE	EXPLICACIÓN	REGISTRO
4.		Recibir ofrecimiento de Venta de TES de Entidades Publicas	Profesional de Gestión Institucional, Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	Recibe de la Entidad Pública vía fax o correo electrónico la oferta de Venta de TES	
5.		Valorar la operación	Profesional de Gestión Institucional, Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	Valora la operación de acuerdo con la cobertura y rentabilidad mínimas fijadas en el Decreto 1525 de 2008.	
6.		Elaborar oficio de cotización	Profesional Universitario Mesa de Dinero	Verifica los datos de la valoración y elabora el oficio de cotización.	
7.		Aprobar la operación	Profesional de Gestión Institucional Mesa de Dinero	Revisa y aprueba la operación.	
8.		Enviar ofrecimiento aprobado a Entidad	Profesional Universitario Mesa de Dinero	Envía ofrecimiento aprobado por el Profesional de Gestión Institucional de Dinero a la Entidad confirmando las condiciones para la compra.	
9.		¿La Entidad acepta el ofrecimiento?		Si la Entidad no acepta el ofrecimiento continuar con la actividad siguiente , Si la Entidad acepta el ofrecimiento ir a actividad 11	
10.		Cancelar la operación	Profesional de Gestión Institucional Mesa de Dinero	En caso de no aceptación del ofrecimiento por parte de la Entidad ordena la cancelación de la operación Fin del procedimiento.	
11.		Recibir confirmación	Profesional de Gestión	Recibe vía fax o correo electrónico la confirmación de la	



No.	PROVEEDOR: ENTRADAS	ACTIVIDAD	RESPONSABLE	EXPLICACIÓN	REGISTRO
		de Entidad	Institucional, Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	aceptación por parte de la Entidad, revisa que esté de acuerdo a lo cotizado y entrega la documentación para que se registre la operación el Sistema de Administración de Portafolios.	
12.		Incluir Operación en sistema de Administración de Portafolios	Profesional Especializado o Universitario	Incluye los datos la operación en el Sistema de Administración de Portafolios de acuerdo al oficio remitido y aprobado, de acuerdo al <i>Manual de Registro del Sistema de Administración de Portafolios</i> .	
13.		Confirmar los datos de la operación ingresada en el Sistema de Administración de Portafolios.	Profesional de Gestión Institucional o Profesional Especializado	Verifica la operación registrada en el Sistema de Administración de Portafolios contra el oficio de confirmación y valida que las condiciones se hayan ingresado correctamente y confirma la operación en el sistema Fin del procedimiento	
14.		Realizar compra a través del sistema SEN o MEC	Profesional de Gestión Institucional, Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	Realiza compra a través del sistema SEN o MEC, de acuerdo con <i>"Instructivo Realización de Operaciones."</i>	
15.		Generar reporte de movimientos para verificar la posición propia	Profesional Especializado, Profesional Universitario Mesa de Dinero,	Genera el reporte de SEN o MEC de operaciones para verificar la posición actual durante la rueda, según <i>Instructivo Realización de Operaciones."</i>	
16.		Generar reporte de Compras y Ventas de	Profesional Universitario Mesa de Dinero	Al final de la rueda de negociación genera el reporte de SEN o MEC de Operaciones propias, identifica a que fondo	




No.	PROVEEDOR: ENTRADAS	ACTIVIDAD	RESPONSABLE	EXPLICACIÓN	REGISTRO
		SEN o MEC		pertenece y lo envía al Grupo Flujo de Caja, Grupo de Liquidez y Subdirección de Riesgo.	
17.		Elaborar cuadro resumen de operaciones	Profesional Universitario Mesa de Dinero	Incluye los datos de las operaciones por SEN o MEC del día en el Cuadro "Formato Traslado de Derechos" y envía por correo electrónico Grupo de Pagos y Cumplimiento, para su cumplimiento a través del DCV o de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte	
18.		Subir archivo plano al aplicativo de administración de portafolios	Profesional Universitario o Especializado Mesa de Dinero	Sube el archivo plano generado por el Sistema SEN o MEC al aplicativo de administración de portafolios y le asigna al portafolio correspondiente según el <i>Manual de Registro del Sistema de Administración de Portafolios</i> Fin del procedimiento	
19.		Realizar Otorgamiento de Créditos	Grupo de Liquidez	Envía instrucciones para constitución de pagarés activos en el archivo BASE PAGARES previamente actualizado con los datos del crédito.	
20.		Registrar los créditos en el aplicativo de administración de portafolios	Profesional Universitario o Especializado Mesa de Dinero	Incluye los datos la operación en al Sistema de Administración de Portafolios de acuerdo al archivo remitido e informa al Grupo de Liquidez para su confirmación de acuerdo al <i>Manual de Registro del Sistema de Administración de Portafolios</i> . Fin del procedimiento	
21.		Realizar Operaciones de Manejo	Grupo Gestión de Liquidez	Envía las papeletas con las condiciones de la operación de manejo	



No.	PROVEEDOR: ENTRADAS	ACTIVIDAD	RESPONSABLE	EXPLICACIÓN	REGISTRO
22.		Realizar Operaciones de Manejo	Profesional Universitario o Especializado Mesa de Dinero	Se recibe de Gestión de liquidez las papeletas con las condiciones de la operación de manejo y se registran en el aplicativo de administración de portafolios de acuerdo al <i>Manual de Registro del Sistema de Administración de Portafolios</i> .	
23.		Confirmar los datos de la operación ingresada en el Sistema de Administración de Portafolios.	Profesional de Gestión Institucional o Profesional Especializado	Verifica la operación registrada en el Sistema de Administración de Portafolios contra las papeletas de la operación y valida que las condiciones se hayan ingresado correctamente y confirma la operación en el sistema	
FIN DEL PROCEDIMIENTO					

6. HISTORIAL DE CAMBIOS

FECHA	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CAMBIO	ASESOR SUG
27-11-2014	1	Primera Versión del Documento Documentado a partir de la transversalidad del proceso y con base en los lineamientos metodológicos vigentes de la OAP.	Sandra Calderón
30-01-2017	2	Con la contratación de los servicios de Mercado Electrónico Colombiano - MEC y la Cámara de Riesgo Central de Contraparte, sistemas requeridos para efectuar las operaciones de simultáneas, se hace necesario modificar el procedimiento, el instructivo y los formatos relacionados.	Tatiana Santos Yate

 MINHACIENDA	NEGOCIACIÓN Y CUMPLIMIENTO DE OPERACIONES ACTIVAS DE TESORERÍA EN COP	Código:	Mis.3.4.3.Pro.1
		Fecha:	30-01-2017
		Versión:	2
		Página:	7 de 7

7. APROBACIÓN

ELABORADO POR:	REVISADO POR:	APROBADO POR:
Nombre: Karen Alfonso / Maria Olinda López Cargo: Profesional Especializado Dependencia: Grupo Mesa de Dinero / Subdirección de Tesoreria Fecha: 16-01-2017	Nombre: Andres Celis Castañeda Cargo: Profesional de gestión Institucional Dependencia: Grupo Mesa de Dinero / Subdirección de Tesoreria Fecha: 30-01-2017	Nombre: Francisco Manuel Lucero Campaña Cargo: Subdirector Dependencia: Subdirección de Tesoreria Fecha: 30-01-2017