

Disposiciones Generales sobre la remisión de Reportes Diarios de Transacciones de los Intermediarios de Valores.

Título I Disposiciones Generales

Artículo 1. Objeto.

El presente documento tiene por objeto establecer determinadas disposiciones con el fin de dar cumplimiento a las remisiones diarias ordenadas por el artículo 298 del *Decreto de Aplicación de la Ley 19-00*, el artículo 27 de la *Norma para los Intermediarios de Valores que establece disposiciones para su funcionamiento* y el artículo 59 de la *Norma que establece disposiciones generales sobre la información que deben remitir periódicamente, los emisores y participantes del mercado de valores*.

Artículo 2. Alcance.

Quedan sometidos a las formalidades previstas en el presente documento, los Intermediarios de Valores (en lo adelante: “Intermediarios”) inscritos en el Registro del Mercado de Valores y Productos (en lo adelante, el “Registro”).

Artículo 3. Definiciones. Para los fines del presente documento, se establecen las definiciones de los conceptos siguientes:

- a) **Valor.** Es un derecho o conjunto de derechos de contenido esencialmente económico, que incorpora un derecho literal y autónomo que se ejercita por su titular legitimado.
- b) **Valores de renta variable.** Son valores que otorgan a sus titulares, derechos o partes alícuotas de participación sobre el patrimonio del emisor a prorrata de la inversión, siendo el rendimiento variable en forma de ganancias de capital o distribuciones periódicas de dividendos, según la política de dividendos establecida.
- c) **Valores de renta fija.** Son valores representativos de deuda, cuyo rendimiento no depende de sus resultados financieros, por lo que, le representan una obligación de restituir el capital invertido más un rendimiento predeterminado, en los términos y condiciones señalados en el respectivo valor.
- d) **Canal de comunicación.** Se refiere al medio de comunicación en que se remiten los archivos solicitados.
- e) **Formato del archivo.** Se refiere al tipo de archivo a ser remitido.

f) **Estructura del archivo.** Se refiere al formato y orden de los archivos electrónicos a ser remitidos.

Artículo 4. Obligaciones generales para el envío de información. Los Intermediarios deberán remitir las informaciones exigidas por el presente documento, de forma que la Superintendencia pueda cumplir con su rol de supervisar y fiscalizar el mercado de valores.

Artículo 5. Responsabilidad de la documentación. Es responsabilidad exclusiva de los Intermediarios, la remisión de la información requerida en el presente documento de manera exacta, correcta, veraz y oportuna.

Artículo 6. Medios de remisión. Las informaciones exigidas en el presente documento deberán ser remitidas oportunamente a la Superintendencia en el formato establecido, a través de los mecanismos electrónicos que la Superintendencia disponga.

Artículo 7. Horario de remisión. Para los fines de esta Norma, la remisión de informaciones por vía electrónica, se entenderá como final del día las once y cincuenta y nueve de la noche (11:59 PM).

Título II

Reportes diarios de Transacciones de los Intermediarios de Valores.

Artículo 8. Reportes diarios de Transacciones de los Intermediarios de Valores (en lo adelante: los “Reportes”). Declaraciones generadas por los Intermediarios en base diaria, a ser presentadas ante la Superintendencia de Valores (en lo adelante, la “Superintendencia”), en cual dan a conocer sobre las adquisiciones y enajenaciones que realicen de cualquier valor inscrito en el Registro o no, y que deberán ser remitido mediante el canal de comunicación, formato y estructura del archivo dispuesto por esta Institución.

Párrafo I. La Superintendencia solicitará a los Intermediarios Reportes dispuestos conforme a los diferentes tipos de contratos y actividades contempladas en el marco legal del mercado de valores dominicano, pudiendo un (1) solo Reporte considerar uno (1) o más modalidades de contratos en un mismo archivo o envío.

Párrafo II. Los Reportes que esta Superintendencia requiera mediante el canal de comunicación SERI (en lo adelante: “SERI”), contarán con un Instructivo que realizará una explicación de manera detallada de las transacciones a ser reportadas, en cada uno de los Reportes y de cómo deberán ser completadas las Plantillas dispuestas por esta Institución para generar un archivo único de envío.

Párrafo III. Esta Superintendencia podrá requerir uno (1) o más archivo único mediante el SERI, para agrupar distintos Reportes.

Párrafo IV. Para todas las transacciones que no sean consideradas en un Reporte que genere un archivo único de transacciones a ser remitido mediante el SERI, y no

contenidas en las excepciones indicadas en el artículo 10 del presente documento, el Intermediario deberá de notificarlas ante la Superintendencia mediante el envío de un correo electrónico, previo a la Hora de Remisión prevista por el artículo 7 previo.

El correo dispuesto para este tipo de Reporte será divisiondeIntermediariosdevalores@siv.gov.do, cual está dirigido a la División de Intermediarios de Valores de la Dirección de Participantes.

Artículo 9. Transacciones Simultáneas o Vinculadas. Se refiere a transacciones pactadas que se relacionan a una aceptación de múltiples transacciones o mandatos entre el Intermediario y el cliente, indistintamente, de las fechas de transacción o pacto entre ellas, y que se vinculan a una propuesta de rendimiento única o integral, resultante del conjunto de estas transacciones. Estas transacciones se relacionaran de manera directa, mediante de un manual de producto único o, de manera implícita mediante un acuerdo de negocios de distintas transacciones soportadas por distintos pactos o manuales de productos.

Párrafo I. Transacciones Simples. Se conocerán de esta manera, las transacciones que generan un contrato o mandato que solo genera una sola transacción bilateral, y la cual no se vincula a otras transacciones u otras propuestas de rendimiento único o integral.

Artículo 10. Transacciones excluidas de los Reportes diarios de Transacciones de los Intermediarios de Valores. De manera limitativa, quedan excluida las declaraciones de las siguientes transacciones de los Reportes:

1. Transacciones de Efectivo, de Depósitos a la vista en bancos y asociaciones de ahorro y préstamo (AAyP) del país y de Depósitos a la vista en bancos y otras instituciones financieras del exterior (Bancos del Exterior).
2. Transacciones sobre adquisiciones y enajenaciones directas de cuotas de fondos mutuos o abiertos administrados por una Administradora de Fondos de Inversión autorizada y registrada ante esta Superintendencia.
3. Transacciones sobre adquisiciones y enajenaciones de terrenos, edificaciones e instalaciones, mobiliario y equipos, equipos de transporte, bienes adquiridos en arrendamiento financiero y obras en ejecución.
4. Transacciones sobre adquisiciones y enajenaciones Bienes Asignados para uso del Personal, Otros Activos relacionados a las Oficinas y Sucursales, Depósitos por requerimientos Judiciales o Administrativos, Gastos Pagados por Anticipado.
5. Los servicios prestados por los Intermediarios, en calidad de agente colocador, distribuidor o estructurador, los cuales otorgan al Puesto el rol de gestor en la venta del valor en la oferta primaria del emisor.
6. Cualquier otra que disponga esta Superintendencia, en respuesta a la solicitud del Intermediario, y que esté ligado a gestiones administrativas de la Entidad.

Artículo 12. Divulgación del Corredor de Valores a cargo de las negociaciones. Para cada transacción a ser reportada se solicitará que se indique el código del Corredor de Valores que realizó la negociación directamente, con la contraparte o que realizó las gestiones en los sistemas de negociación centralizados en que esté inscrito el Intermediario.

Párrafo I: En cada uno de los Reportes de remisión vía SERI, se establecerá un campo en cual se especifique esta información de cada transacción pactada. En el caso de, las transacciones a ser declaradas mediante correo electrónico a la dirección dispuesta por este documento, también deberá declararse esta información para cada transacción.

Título III

Reporte Diario de Transacciones de los Intermediarios de Valores, Plantilla “A”.

Artículo 11. Transacciones a ser reportadas en la Plantilla “A”. Se reportarán diariamente (de manera limitativa) las siguientes transacciones en el Reporte Diario de Transacciones de los Intermediarios de Valores, Plantilla “A” (en lo adelante: Plantilla “A”):

1. Compraventa de valores de renta fija al contado (Spot).
2. Compraventa de valores de renta fija a plazos (Forward).
3. Préstamos de valores (Mutuos).
4. Compraventa de valores de renta variable al contado o cuotas /valores (Spot).
5. Traspasos de valores.

Párrafo I. El instructivo correspondiente al reporte citado, se encontrará en los documentos anexos a este documento.

Párrafo II. La plantilla de generación del archivo único de este Reporte se encontrará disponible en la página de esta Superintendencia.

Artículo 12. Definición de las transacciones a ser reportar en la Plantilla “A”.

1. Compraventa de valores de renta fija al contado (Spot).

Código del reporte en archivo XML: (SPT)

Reporte correspondiente a transacciones derivadas de acuerdos contractuales en los que se pactan vender o comprar valores de renta fija, contra una contraprestación en efectivo, a un precio establecido, para ser liquidados en la misma fecha de transacción o hasta tres (3) días hábiles, contados a partir del día siguiente a la fecha de transacción o pacto.

2. Compraventa de valores de renta fija a plazos (Forward).

Código del reporte en archivo XML: (FRW)

Reporte correspondiente a transacciones derivadas de acuerdos contractuales en los que se pactan vender o comprar valores de renta fija, contra una contraprestación en efectivo, a un precio establecido, para ser liquidados a una fecha superior a los tres (3) días hábiles contados a partir del día siguiente a la fecha de transacción o pacto.

3. Préstamos de valores (Mutuos).

Código del reporte en archivo XML: (PVM)

Reporte correspondiente a transacciones derivadas de acuerdos contractuales, mediante los cuales el intermediario de valores o la contraparte entrega o recibe en préstamo cierta cantidad de valores con la obligación de recibir o entregar, al vencimiento del contrato, otros valores de la misma especie y calidad, más un premio según las condiciones acordadas por las partes.

4. Compraventa de valores de renta variable al contado o cuotas / valores (Spot).

Código del reporte en archivo XML: (COV)

Reporte correspondiente a transacciones derivadas de acuerdos contractuales en los que se pactan vender o comprar valores de renta variable, contra una contraprestación en efectivo, a un precio establecido, para ser liquidados en el plazo permitido por el marco legal y máximo de hasta tres (3) días hábiles contados a partir del día siguiente a la fecha de transacción o pacto.

5. Traspasos de Valores.

Código del reporte en archivo XML: (TRV)

Reportes correspondientes a los traspasos de valores anotados en cuenta como consecuencia de la ocurrencia de cualquiera de los siguientes casos:

- Herencia (HEREN).
- División y partición de la masa hereditaria (DIVHE).
- División y partición del patrimonio perteneciente a una sociedad conyugal (SPSCC).
- Donación (DONAC).
- División y partición de la copropiedad (DIVPP).
- Fusión o escisión (FUSES).
- Fusión de fondos mutuos y fondos de inversión (FUNFM).
- Efecto de una dación en pago (EFCDP).
- Ejecución de garantías, mandato legal u orden judicial (MNDLJ).
- Traspaso de una cuenta a otra del mismo titular (TRCOP).
- Otros casos que resuelva favorablemente la Superintendencia.

Artículo 13. Productos Estructurados. En cuanto a las transacciones citadas en los numerales previos, los Intermediarios estarán obligados a declarar en los casos de transacciones **Spot**, **Forward** y **Mutuos**, cuando estas transacciones se encasillen dentro de las definiciones de **Transacciones Simples** o **Transacciones Estructuradas (Simultaneas o Vinculadas)**.

Este tipo de contratos o mandatos de negocios son declarados en la **Plantilla “A”**, en el campo 2.2 **“Tipo de Producto o Transacciones Simultaneas”** y complementados con la información respecto a estos, con los requerimientos de los campos 2.3 y 2.21 del Instructivo de este Reporte.

Artículo 14. Canal de comunicación, formato y estructura del archivo. Las transacciones de la Plantilla “A” deberán ser declaradas en un archivo único de formato XML vía el SERI y generado según la estructura del archivo dispuesta en la plantilla de este Reporte.

Párrafo I. Esta plantilla deberá ser completada automáticamente, por el sistema de registro y contabilidad del Intermediario, o en su defecto, el citado sistema deberá generar un archivo idéntico a la estructura del archivo único que genera la plantilla, tipo XML.

Párrafo II. En el caso de que un Intermediario pretenda generar de manera independiente, el archivo tipo XML, deberá contactar a esta Superintendencia para conocer el esquema de generación de este archivo.

Artículo 15. Procedimiento para declaración de transacciones liquidadas por error a una cuenta distinta a la dispuesta por la contraparte. De existir errores en transacciones liquidadas, y el Intermediario verse precisado a tomar acciones correctivas posteriores, estas medidas no eximen al participante de la declaración de las transacciones liquidadas erróneamente, y que las mismas estén declaradas tal como han sido liquidadas.

Párrafo I. Del mismo modo, cualquier operación resultante de las medidas correctivas, deberá ser declarada por el Intermediario en la fecha de ejecución y/o registro de la citada transacción.

Título IV Disposiciones Finales

Artículo 16. Obligatoriedad de la norma. Las disposiciones establecidas en el presente documento, son de cumplimiento obligatorio en todas sus partes y en caso de incumplimiento se aplicarán las sanciones previstas en la Ley.

Anexos

Anexo I: Instructivo Reporte Diario de Transacciones de los Intermediarios de Valores, Plantilla “A”, (versión 2.2).

En el presente instructivo se explica de manera detallada las transacciones a ser reportadas y las características de cada uno de los campos de información requeridos para estas transacciones, con el fin de lograr la correcta remisión de la información requerida a los Intermediarios respecto a las transacciones diarias ordenadas en este Título.

Es importante resaltar, que todas las casillas deben estar completadas conforme las especificaciones definidas en este instructivo, en orden para que el archivo a remitir ante esta Institución, sea recibido satisfactoriamente, tras la Superintendencia ejecutar los validadores de la estructura del archivo enviado por los Intermediarios.

En caso contrario, precisamos señalar, que los Intermediarios serán responsables de la condición de incumplimiento en la remisión oportuna del citado reporte. La cual solo será considerada una remisión efectiva, al momento en que esta Superintendencia reciba satisfactoriamente, el archivo requerido y lo notifique de esta manera al Intermediario.

Del mismo modo, después de esta Superintendencia recibir satisfactoriamente, la información requerida en atención a la estructura del archivo solicitado, procederá a verificar la calidad de la información recibida. Y podrá requerir en cualquier caso, al Intermediario *la corrección, precisión o exigir que se abunde sobre información observada, cuando estime que la misma es incompleta o inexacta*. No obstante, la corrección y/o posterior remisión de estas informaciones, no exime al participante de las posibles sanciones de las que pueda ser susceptible, conforme las facultades y disposiciones contenidas en el Artículo 111 de la Ley 19-00.

Contenido de la plantilla “A” de Reporte Diario de Transacciones de los Intermediarios de Valores.

La citada plantilla “A” está compuesta por 5 secciones, que a su vez, son completadas por los siguientes campos:

1. Información del valor transado:

En esta sección se conocerá la información que define el valor a reportar como transado. Dicha sección, será completada en cada uno de los siguientes campos:

1.1. Valor Registrado SIV: Indica si el Valor Transado se encuentra inscrito en el Registro del Mercado de Valores y Productos de la SIV (en lo adelante: “El Registro”).

-Este campo será completado exclusivamente, con un “si” o “no” según un listado desplegable en la plantilla.

-En caso de que el Valor Transado se encuentre inscrito en El Registro (disponible en la página web de esta Superintendencia), se deberá especificar “sí”, y los campos: 1.3, 1.4, 1.5 y 1.6, no deberán ser completados.

-En caso de no cumplirse la condición previa, se deberá especificar que “no”, y se deberán completar los campos: 1.3, 1.4, 1.5 y 1.6.

1.2. Código ISIN: Es el código de identificación de cada valor autorizado, y que será completado con el código asignado en atención al International Security Identification Number (ISIN).

-Este campo debe ser completado con doce (12) caracteres alfanuméricos.

-En caso de no tener código ISIN completar con **“na”**

1.3. Nombre del Emisor: Nombre del emisor del valor transado.

-Este campo debe ser completado solo en los casos en que el campo 1.1, se indique “no”.

-Se deberá completar con el Nombre del Emisor.

-Este campo estará habilitado para caracteres alfanuméricos.

1.4. RNC Emisor: Registro Nacional de Contribuyente del emisor.

-Este campo debe ser completado solo en los casos en que el campo 1.1, se indique “no”.

-Este campo debe ser completado con el RNC o identificación homologa del emisor en su jurisdicción.

-Este campo estará habilitado para caracteres alfanuméricos.

1.5. Moneda de Denominación: Corresponde a la moneda de denominación del valor transado, de acuerdo a su acrónimo contable. Siendo la definición de acrónimo contable, el signo monetario del monto de una partida registrada en una cuenta.

-Este campo debe ser completado solo en los casos en que el campo 1.1, se indique “no”.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (DOP / USD / EUR / etc...)

-La selección del acrónimo contable debe ser en atención a la Moneda de Denominación que se defina para el valor autorizado y que se encuentra publicada en el Registro del Mercado de Valores y Productos, en la página web de esta Superintendencia.

1.6. Tasa de Interés Facial: Corresponde al cupón que paga el emisor al titular del valor negociable según las condiciones contratadas en el prospecto de la emisión de oferta pública.

-Este campo debe ser completado solo en los casos en que el campo 1.1, se indique “no”.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Se completaría con “11.375000” para una tasa de interés facial de un 11.375% anual.

-Para el reporte de transacciones de compraventa de valores de renta variable al contado (Spot), este campo no debe ser completado.

1.7. Valor de Cotización de Cuota/Valores: Corresponde al valor cotizado para la cuota de participación de un fondo cerrado o el valor de fideicomiso en el día reportado, según las condiciones contratadas en el prospecto de la emisión de oferta pública.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales. Ejemplo: 1,037.154893.

-Este campo debe ser completado con el valor cuota o, el valor de fideicomiso del día de pacto, según la cuota publicada en la página de la administradora del fondo de inversión o, el valor de fideicomiso cotizado en la fiduciaria, a la fecha del pacto.

-Para reporte de transacciones SPO, FRW y PVM, este campo no debe ser completado.

2. Información de la operación:

En esta sección se conoce la información que indica las características de cada transacción que se deriva del pacto o contrato de operación entre el intermediario y el cliente.

Dicha sección, será completada en cada uno de los siguientes campos:

2.1 Tipo de Mercado: Indica en el mercado donde se realiza la operación.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Primario / Secundario)

Mercado Primario: Son las transacciones que envuelven la colocación inicial de emisiones de valores, mediante las cuales los emisores obtienen financiamiento para sus actividades.

Mercado Secundario: Son las transacciones que envuelven la transferencia de valores que previamente fueron colocados a través del mercado primario, con el objetivo de propiciar liquidez a los tenedores de valores.

2.2 Tipo de Producto o Transacciones Simultaneas: Para fines de este instructivo, este campo indica si la transacción se refiere a una Transacciones Simultanea o Vinculada (Estructurada) o a una Transacción Simple.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Simple / Estructurado)

Simple: Transacciones que representan intercambios de un contrato o mandato que sólo genera una transacción bilateral, la cual no se vincula a otras transacciones.

Estructurado: Indica si cada transacción pactada y declarada, se relaciona a una aceptación de múltiples transacciones o mandatos entre el Intermediario y el cliente, indistintamente, de las fechas de transacción o pacto entre ellas, y que se vinculan a una propuesta de rendimiento única o integral, resultante del conjunto de estas transacciones, las cuales se conocen como **Transacciones Simultaneas o Vinculadas**. Estas transacciones, se relacionaran de manera directa mediante un manual de producto único o de manera implícita, mediante un acuerdo de negocios de distintas transacciones soportadas por distintos pactos o manuales de productos.

2.3 Número Asignado a Operación del Producto Estructurado: Corresponde a un número que el Intermediario debe generar para dicha operación, en caso de ser una operación que sea categorizada como “Estructurada”, en el campo “Tipo de Producto”.

-Este campo solo puede y debe ser completado por un número único asignado al contrato del Producto Estructurado por el Intermediario.

-Esta numeración deberá ser en atención a los contratos de este tipo, que celebre el Intermediario con sus contrapartes, y para lo cual deberá asignarle a estos, una numeración única, y con orden ascendente.

-En caso de que el Intermediario pretenda realizar una secuencia lógica distinta a la descrita previamente, deberá de notificar a la Dirección de Participantes mediante una comunicación formal, notificando bajo que secuencia lógica que llevará el control de los Contratos de Transacciones Estructuradas que pacten.

-No aplica a Tipo de Producto Simple y se completaría con **“na”**.

2.4 Tipo de Operación: Indica que tipología define la operación en atención al móvil u orden, que genera la negociación y liquidación en el Mercado.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Cuenta Propia / Cuenta de Tercero).

-En atención a este campo, se deberá de dar registro a los campos subsiguientes.

Cuenta Propia – Se refiere a las transacciones en que se realiza una negociación a “cuenta propia” por parte del Intermediario de valores, siendo el cliente o Entidad con quien el Puesto realiza la transacción de valores la

contraparte del Intermediario (campos 3.1, 3.2 y 3.3). Estas transacciones serán todas aquellas en que el Intermediario pacte negociaciones en atención a inversiones en cartera propia y por consecuencia afecte sus inventarios de inversiones.

Cuenta de Tercero – Se refiere a las transacciones realizadas por los Intermediarios a nombre de sus clientes, en atención a un servicio de corretaje prestado, y el objetivo de la transacción será afectar el inventario de inversiones del cliente en las cuentas de encargo de confianza.

2.5 Mecanismo de la Negociación.: Señala bajo qué mecanismo de calce de transacciones se registra y se ordena la liquidación de la negociación.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo (Bursátil / Extrabursátil/ Programa Creadores de Mercado)

2.6 Comisión por servicio de corretaje (Monto): Indica el monto por comisión que el Intermediario cobra al cliente en la operación registrada.

-Este campo solo puede y debe ser completado con el monto cobrado por el Intermediario al cliente, por servicios prestados para realizar la operación en el mecanismo de la negociación, inclusive, si este servicio no es cargado al cliente.

-De no aplicarse comisión al cliente por dicho servicio, se deberá indicar que la comisión por servicio fue de 0.00.

-Este campo siempre será completado en atención a la moneda del Peso Dominicano (DOP), dado que esta constituye la moneda funcional del Manual de Contabilidad y Plan de Cuentas, y es en base a ella, que el Intermediario deberá expresar sus estados financieros.

-Este campo debe ser completado con un número de dos (2) dígitos decimales.

2.7 Tipo de transacción: Indica la postura en que se reporta la operación, en atención al “Tipo de Operación” indicado.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Compra / Venta) o (Mutante / Mutuario), según el Reporte a completar.

Compra - Es la adquisición u obtención de instrumentos financieros.

Venta – Es la enajenación de instrumentos financieros.

Mutuante - Es cuando se actúa como prestamista de un valor de deuda.

Mutuario - Es cuando se actúa como prestatario de un valor de deuda.

Sus posibles selecciones según los distintos Reportes son:

Compra o Venta para los reportes de:

- 1) Compraventa de valores de renta fija al contado (Spot).
- 2) Compraventa de valores de renta fija a plazos (Forward).
- 3) Compraventa de valores de renta variable al contado o cuotas / valores (Spot).

Mutuante o Mutuario para los reportes de:

- 1) Préstamos de valores (Mutuos).

Instrucciones:

El llenado de esta casilla se debe hacer desde el **punto de vista del Intermediario**. Para lo cual se detalla lo siguiente:

A) En los casos que el intermediario actúa por cuenta propia, el intermediario no deberá completar los campos de “RNC Intermediario Contraparte” y “Nombre Intermediario Contraparte” (solo aplican en cuenta de terceros), en la sección de “Información de la contraparte (s)” (Sección 3 del presente instructivo), y se deberán dejar estos campos vacíos o completa con “na”.

A.1) Se debe completar la información del cliente o Entidad que actuó como contraparte de la operación, los campos de “Nombre Inversionista”, “Tipo de Documento” y “Número Documento”.

A.2) Cuando la transacción (compra y venta) se efectuó entre dos intermediarios, cada intermediario reportará por separado cada operación, es decir, un intermediario reportará la compra, y el otro intermediario reportará la venta.

B) En los casos que el intermediario actúa por cuenta de tercero, se deben completar todos los campos de la sección de “Información de la contraparte (s)”.

B.1) Completar la información del cliente o Entidad que desea vender o comprar un valor, en los campos de “Nombre Inversionista”, “Tipo de Documento” y “Número Documento”.

B.2) Completar la información del intermediario contraparte que le vende o compra un valor al cliente o Entidad, en los campos de “RNC Intermediario Contraparte” y “Nombre Intermediario Contraparte” (solo aplica en cuenta de terceros).

B.3) Cuando ambas puntas de las transacciones (compra y venta) se efectúen en el mismo intermediario (transacciones cruzadas), este debe reportar las dos puntas y completar los campos de “RNC Intermediario Contraparte” y

“Nombre Intermediario Contraparte” con el RNC y Nombre del mismo intermediario que reporta.

B.4) Cuando la transacción (compra y venta) se efectuó entre dos intermediarios, cada intermediario reportará por separado la operación de su cliente, es decir, un intermediario reportará la compra y el otro intermediario reportará la venta.

2.8 Número de Registro de la Operación: Indica el número de registro oficial de la operación. (Actualmente, se utiliza el No. otorgado por el Depósito Centralizado de Valores)

-Este campo solo puede y debe ser completado por un código único asignado al contrato de la operación. (Actualmente, se utiliza el No. otorgado por el Depósito Centralizado de Valores)

2.9 Código SIV Corredor: Indica el código de registro SIVCV del corredor que realizó la negociación directamente, con la contraparte o quien realizó las gestiones en los sistemas de negociación centralizados, en la cual esté inscrito el Intermediario.

-Este campo debe ser completado con el código del corredor que se encuentra publicado en el Registro del Mercado de Valores y Productos, en la página web de esta Superintendencia.

2.10 Fecha: se completa con la fecha requerida en el campo, según el reporte a completar, la cuál puede ser:

2.10.1 Fecha Valor o de Liquidación: Es la fecha efectiva de la compra o venta de los valores, en la que toma lugar la liquidación del Contrato de Compraventa. La Fecha Valor coincide con la Fecha de Transacción para aquellos Contratos de Compraventa Spot “Same day value” (Contratos Valor Mismo Día).

2.10.2 Fecha de Traspaso de Valores: Esta fecha sólo será requerida para los casos de reportes de Traspasos de valores y Préstamos de Valores (Mutuos), representa la fecha efectiva en que se traspasan los valores objeto del contrato.

2.10.3 Fecha vencimiento contrato: Campo requerido en reportes de contratos de Préstamos de Valores (Mutuos), indica la fecha de vencimiento del contrato. **De no tener una fecha específica de vencimiento, este campo debe dejarse vacío.**

-Este campo debe ser completado bajo el formato (día/mes/año) / (dd/mm/yyyy) y con un juego de diez (10) caracteres, inclusive las barras oblicuas, según el siguiente ejemplo: 15/04/2016

2.11 Cantidad de Valor Nominal: Es el monto en términos monetarios en el cual se expresan las transacciones y/o la posición de un título valor de deuda.

-La Cantidad de Valor Nominal se calcula multiplicando la Cantidad de Títulos por el Valor Nominal que conforma la transacción o la posición.

-Corresponde al valor facial que un emisor debe pagar a los titulares en la fecha de vencimiento.

-Este campo deberá ser completado con caracteres numérico sin dígitos decimales.

2.12 Cantidad de cuotas/valores: Es la cantidad de cuotas de participación de fondos cerrados o valores de fideicomisos según la participación adquirida.

-Este campo solo puede y debe ser completado por números enteros.

2.13 Tasa de Rendimiento al vencimiento: Es la tasa de rendimiento esperada de una inversión, expresada en términos porcentuales.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Se completaría con “11.375000” para una tasa de interés facial de un 11.375% anual.

2.14 Premio o contraprestación por mutuo: Es el premio, rendimiento o ganancia que se obtiene de un contrato en que se otorga a manera de préstamo un valor.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Se completaría con “2.370000” para una tasa de interés de un 2.370000% anual.

2.15 Periodicidad de Pagos por Premio o contraprestación Mutuo: señala si los pagos de premios por mutuos tienen una periodicidad establecida o, se cancelarán al vencimiento del contrato.

-En caso de no tener una periodicidad establecida se completa con **“na”**.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (diaria, semanal, quincenal, mensual, bimensual, trimestral, cuatrimestral, semestral, anual, na)

2.16 Precio sin intereses (limpio), pactado: En este campo se indica el precio del valor pactado a fecha valor o de liquidación del contrato. (No incluye cupón corrido).

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Completar con 109.456376, para un precio limpio de 109.456376%.

2.17 Precio sin intereses (limpio), de mercado (como referencia): En este campo se indica el precio limpio (sin cupón corrido) a la fecha del acuerdo, para obtener la referencia utilizada con la cual se realizó el cálculo o valoración (pricing) de los contratos. Se requiere en reportes de Compraventa RF a Plazo (Forward) y Préstamos de Valores (Mutuo).

-El precio limpio (sin cupón corrido) a la fecha del acuerdo, se define como el valor de mercado del activo transado al día hábil anterior.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Completar con 109.456376 para un precio limpio de 109.456376%

2.18 Componente de tasa de interés implícita: Se deberá presentar la tasa de interés que representa el costo de capital o valor del dinero en el tiempo, para obtener las valoraciones de los precios en los contratos a plazo.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales, expresado sin el símbolo de porcentaje.

Ejemplo: Se completaría con “6.370000” para una tasa de interés de un 6.370000% anual.

-La tasa de interés implícita señalada deberá estar anualizada.

2.19 Intereses Corridos a la Fecha Liquidación (En monto): Se completa con el monto total de intereses acumulados a fecha de liquidación de la operación (Monto Cupón Corrido).

-Este campo siempre será completado en atención a la moneda del valor transado.

-De no contener intereses corridos a la fecha de liquidación el valor transado, se deberá indicar en el campo el monto de 0.00.

-Este campo debe ser completado con un número de dos (2) dígitos decimales.

2.20 Valor Liquidación (Monto): Campo que requiere ser completado con el valor de liquidación del pacto, incluye tanto precio limpio como intereses acumulados.

-Este campo siempre será completado en atención a la moneda del valor transado, según el campo 1.5.

-Este campo debe ser completado con un número de dos (2) dígitos decimales.

2.21 Plazo Total del Producto Estructurado: Se requiere presentar cual es el plazo total entre todas las transacciones estructuradas o vinculadas.

-Este campo siempre será completado en atención a los días calendarios totales de duración del contrato.

-Este campo deberá de completarse solo con números enteros, en atención al punto anterior.

-El cálculo de los días transcurridos o plazo total del producto estructurado, será contado desde la primera fecha de liquidación del Producto Estructurado, y la fecha de liquidación final del último Forward de la estructura.

2.22 Tipo de mandato del Traspaso de Valores: Se debe completar con el tipo de mandato de traspaso de valores que fue realizado acorde a las opciones establecidas por la SIV:

- Herencia (HEREN).
- División y partición de la masa hereditaria (DIVHE).
- División y partición del patrimonio perteneciente a una sociedad conyugal (SPSCC)
- Donación (DONAC).
- División y partición de la copropiedad (DIVPP).
- Fusión o escisión (FUSES).
- Fusión fondos mutuos y fondos de inversión (FUNFM)
- Efecto de una dación en pago. (EFCDP)
- Ejecución de garantías, mandato legal u orden judicial. (MNDLJ).
- Traspaso de una cuenta a otra del mismo titular (TRCOP)
- Otros casos que resuelva favorablemente la Superintendencia.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo, (HEREN / DIVHE / SPSCC / DONAC / DIVPP / FUSES / FUNFM / EFCDP / MNDLJ / TRCOP).

2.23 Valor negociado de cuotas/valores: En este campo se indica el valor pactado, a fecha valor o de liquidación del contrato, de las cuotas del fondo cerrado o de los valores de fideicomisos negociados.

-Este campo debe ser completado con un número de seis (6) dígitos decimales. Ejemplo: 1,037.154893

2.24 Moneda de Liquidación del contrato (Contratos con liquidación en monedas distintas): Corresponde a la moneda de Liquidación del contrato reportado, de acuerdo a su acrónimo contable. Siendo la definición de acrónimo contable, el signo monetario del monto de una partida registrada en una cuenta.

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (DOP / USD / EUR / etc...)

-La selección del acrónimo contable debe ser en atención a la Moneda de Denominación que se defina para el valor autorizado, y que se encuentra publicada en el Registro del Mercado de Valores y Productos en la página web de esta Superintendencia.

3. Información de la contraparte (s):

En esta sección se completará la información de la contraparte de las negociaciones reportadas.

Dicha sección, será completada en cada uno de los siguientes campos:

3.1 Nombre del Inversionista: Se refiere al inversionista que realiza el intercambio.

-Este campo debe ser completado con el Nombre del Inversionista en atención al que este contiene en su documento de identificación.

3.2 Tipo de documento de identificación del Inversionista: Cual puede ser, según el tipo de persona:

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Cédula / RNC / Pasaporte / Otros).

3.3 Número de documento de identificación: en atención al documento indicado en el punto anterior.

-Este campo debe ser completado con el Número que contiene su documento de identificación.

3.4 RNC Intermediario Contraparte (solo aplica en transacciones de tipo cuenta de terceros): En estos casos, se deberá especificar el R.N.C del Intermediario contraparte del cliente. En transacciones cruzadas se completa con el mismo RNC del intermediario que reporta.

-No aplica cuando el Intermediario actúa por cuenta propia, y se deberá dejar este campo vacío o completar con “na”.

-Este campo debe ser completado con el RNC del Intermediario que se encuentra publicado en el Registro del Mercado de Valores y Productos, en la página web de esta Superintendencia (En casos de que la transacción por cuenta de terceros sea directa con bancos, asociaciones u otro depositante no registrado en la SIV, pero registrado en el Depósito Centralizado de Valores, completar con el RNC registrado en el Depósito).

3.5 Nombre Intermediario Contraparte (solo aplica en transacciones de tipo cuenta de terceros): En estos casos, se especifica nombre del intermediario contraparte del cliente. En transacciones cruzadas se completa con el mismo nombre del intermediario que reporta.

-No aplica cuando el Intermediario actúa por cuenta propia y se deberá dejar este campo vacío o completar con “na”.

-Este campo debe ser completado con el nombre del Intermediario que se encuentra publicado en el Registro del Mercado de Valores y Productos, en la página web de esta Superintendencia (En casos de que la transacción por cuenta de terceros sea directa con bancos, asociaciones u otro depositante no registrado en la SIV, pero registrado en el Depósito Centralizado de Valores, completar con el nombre registrado en el Depósito).

-En el caso de Traspasos de Valores, esta sección será conformada por dos sub-secciones llamadas: (4) Información del Titular Origen y (5) Información del Titular Destino.

4. Información del Titular Origen en Traspasos de Valores.

En esta sección se completará la información del Titular que se acredita en un Traspaso de valores, en orden a ser recibidos dichos valores por un destinatario.

Dicha sección, será completada en cada uno de los siguientes campos:

4.1 Nombre del Inversionista: Se refiere al cliente que realiza el intercambio y transfiere los valores.

-Este campo debe ser completado con el Nombre del Inversionista en atención al que este contiene en su documento de identificación.

4.2 Tipo de documento de identificación del Inversionista: Cual puede ser, según el tipo de persona:

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Cédula / RNC / Pasaporte / Otros).

4.3 Número de documento de identificación: en atención al documento indicado en el punto anterior.

-Este campo debe ser completado con el número que contiene su documento de identificación.

4.4 RNC Depositante Profesional cuenta origen: Se deberá especificar el R.N.C del Intermediario, en cual reposa la cuenta del cliente que se acredita, para realizar la transferencia de Valores.

4.5 Nombre Depositante Profesional cuenta origen: Se deberá especificar el Nombre del Intermediario en cual reposa la cuenta del cliente que se acredita para realizar la transferencia de Valores.

5. Información del Titular Destino en Traspasos de Valores

5.1. Nombre del Inversionista: Se refiere al cliente que realiza el intercambio y recibe los valores.

-Este campo debe ser completado con el Nombre del Inversionista que contiene su documento de identificación.

5.2. Tipo de documento de identificación del Inversionista: Cual puede ser, según el tipo de persona:

-Este campo contiene un listado desplegable, y sus posibles selecciones son los únicos juegos de caracteres permitidos en el mismo. (Cédula / RNC / Pasaporte / Otros).

5.3. Número de documento de identificación: en atención al documento indicado en el punto previo.

-Este campo debe ser completado con el número que contiene su documento de identificación.

5.4. RNC Depositante Profesional cuenta destino: Se deberá especificar el R.N.C del Intermediario, en cual reposa la cuenta del cliente que se debita, tras recibir la transferencia de Valores.

5.5. Nombre Depositante Profesional cuenta destino: Se deberá especificar el Nombre del Intermediario en cual reposa la cuenta del cliente que se debita tras recibir la transferencia de Valores.

Anexo II: Posibles selecciones Plantilla “A”.

Significado de campos:

Debe ser completado
No aplica (N/A)

Sección I		SPT	FRW	PVM	COV	TRV
1.1 Valor Registrado SIV						
1.2 Código ISIN						
1.3 Nombre del Emisor						
1.4 R.N.C. Emisor						
1.5 Moneda de Denominación						
1.6 Tasa de Interés Facial					N/A	
1.7 Valor de Cotización de Cuota/Valores		N/A	N/A	N/A		

Sección II
2.1 Tipo de Mercado
2.2 Tipo de Producto
2.3 Número Asignado a Operación del Producto Estructurado
2.4 Tipo de Operación
2.5 Mecanismo de la Negociación
2.6 Comisión por servicio de corretaje (monto)
2.7 Tipo de Transacción
2.8 Número de Registro de la Operación
2.9 Código SIV Corredor
2.10.1 Fecha Valor o de Liquidación
2.10.2 Fecha de Traspaso de valores
2.10.3 Fecha Vencimiento Contrato
2.11 Cantidad de Valor Nominal
2.12 Cantidad de Cuotas/Valores
2.13 Tasa de Rendimiento (%)
2.14 Premio por Mutuo (%)
2.15 Periodicidad de Pagos por Premio Mutuo
2.16 Precio sin Intereses (limpio) Pactado (%)
2.17 Precio sin Intereses (limpio), de mercado (como referencia)
2.18 Componente Tasa de Interés Implícita (%)
2.19 Intereses Corridos a la Fecha Liquidación (En monto)
2.20 Valor Liquidación (Monto)
2.21 Plazo Total del Producto Estructurado
2.22 Tipo de mandato del Traspaso de valores
2.23 Valor Negociado de Cuotas/Valores
2.24 Moneda de Liquidación del contrato (Contratos con liquidación en monedas distintas)
Sección III
3.1 Nombre Inversionista
3.2 Tipo de Documento
3.3 Número Documento
3.4 RNC Intermediario Contraparte (solo aplica en cta. tercero)
3.5 Nombre Intermediario Contraparte (solo aplica en cta. tercero)
Sección IV
4.1 Nombre Inversionista
4.2 Tipo de Documento
4.3 Número Documento
4.4 RNC Intermediario, Cta. Origen
4.5 Nombre Intermediario, Cta. Origen
Sección V
5.1 Nombre Inversionista
5.2 Tipo de Documento
5.3 Número Documento
5.4 RNC Intermediario, Cta. Destino
5.5 Nombre Intermediario, Cta. Destino

			N/A	N/A
		N/A		
		N/A		N/A
				N/A
		N/A		N/A
N/A	N/A		N/A	
N/A	N/A		N/A	N/A
			N/A	
N/A	N/A	N/A		
		N/A	N/A	N/A
N/A	N/A		N/A	N/A
N/A	N/A		N/A	N/A
		N/A	N/A	N/A
N/A			N/A	N/A
N/A		N/A	N/A	N/A
		N/A	N/A	N/A
		N/A		N/A
		N/A	N/A	N/A
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A		N/A

				N/A
				N/A
				N/A
		N/A		N/A
		N/A		N/A

N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	

N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	
N/A	N/A	N/A	N/A	