**SISTEMA PARA LA ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS FINANCIEROS DE MERCADO, CRÉDITO Y LIQUIDEZ**

**ANEXO 1**

**LAYOUTS DE INFORMACIÓN PARA EL SISTEMA**

1. **Información de mercado**
2. **Factores de riesgo**

**Factor de riesgo 1. Curva Bancaria B1, B2 y B3.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Nominal\_Interbancaria\_Pagares”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 | Columna  8 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Nombre de la curva** | **Nodos de la curva** | **Tasa** | **Nombre de la curva** | **Tasa** | **Nombre de la curva** | **Tasa** |
| “**GEI**”  Alfabético en mayúsculas | “**B1**”  Alfanumérico | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. | “**B2**”  Alfanumérico | Numérico. | “**B3**”  Alfanumérico | Numérico. |

**Factor de riesgo 2. Curva Bonos M.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“BonosM\_Yield”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de la curva** | **Tasa de los nodos utilizados para construcción de la curva** | **Tasa** |
| “**BMI**”  Alfabético en mayúsculas | “**BONOS**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. | Numérico. |

**Factor de riesgo 3. Curva Cetes con Impuesto.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: “***Cetes\_Zero***”.

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de la curva** | **Tasas de mercado utilizadas para la construcción de la curva** | **Tasa** | **Precios de mercado utilizados para la construcción de la curva** | **Precio** |
| “**BI**”  Alfabético en mayúsculas | “**CETES**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. | Numérico. | Numérico. | Numérico. |

**Factor de riesgo 4. Curva Descuento IRS.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“irs”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Campo vacío** | **Tasa** | **Forward** |
| “\***F**”  Alfabético en mayúsculas | “**TIIE28-IRS**”  Alfanumérico | En el formato **aammdd** | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva |  | Numérico. | Numérico. |

**Factor de riesgo 5. Curva Papel Corporativo D1 a D6.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Papel\_Corporativo”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 | Columna  8 | Columna  9 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de la curva** | **Tasa**  **D1** | **Tasa**  **D2** | **Tasa**  **D3** | **Tasa**  **D4** | **Tasa**  **D5** | **Tasa**  **D6** |
| “**PC**”  Alfabético en mayúsculas | “**D**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. | | | | | |

**Factor de riesgo 6. Curva Real.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Real\_Neta\_Zero\_SEMI”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 7. Curva Real con Impuesto.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Real\_Bruta\_Zero\_SEMI”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 8. Curva Reporto Bancario B1, B2 y B3.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Repo\_Interbancarias”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 | Columna  8 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de la curva** | **Tasa**  **B1** | **Tipo de instrumento** | **Tasa**  **B2** | **Tipo de instrumento** | **Tasa**  **B3** |
| “**R**”  Alfabético en mayúsculas | “**REPOB1**”  Alfanumérico | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico | “**REPOB2**”  Alfanumérico | Numérico | “**REPOUB**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico |

**Factor de riesgo 9. Curva IRMXP-TIIE-P30.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: “***IRMXP-TIIE-P30***”.

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 10. Curva IRMXP-TIIE1D.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: “***IRMXP-TIIE1D***”.

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 11. Curva Yield Real.** Archivo electrónico con separador de campo “coma”

( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Real\_Neta\_Yield”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 12. Curva Sobretasa BondesD.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa LD”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 13. Curva Sobretasas BPIS.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa IS”***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 14. Curva Sobretasa IM.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa IM”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 15. Curva Sobretasa IQ.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa IQ”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 16. Curva Treasury.** Archivo electrónico con separador de campo “coma”

( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Treasury”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de**  **la curva** | **Fecha** | **Tasa** |
| “\***T**”  Alfabético en mayúsculas | “**TREASURY Simple**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | En el formato **aammdd** | Numérico. |

**Factor de riesgo 17. Curva IRUDSD UMS.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRUDSD UMS”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Nodos de la curva** | **Fecha** | **Tasa de los nodos utilizados para construcción de la curva** | **Tasa** |
| “\***\*D1**”  Alfabético en mayúsculas | “**UMS**”  Alfabético en mayúsculas | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | En el formato **aammdd** | Numérico. | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 18. Curva Basis Swap.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Basis Swap”.***

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Tipo de instrumento** | **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa de los nodos utilizados para construcción de la curva** | **Tasa** |
| “\*\***D**”  Alfabético en mayúsculas | “**BSWAP**”  Alfabético en mayúsculas | En el formato **aammdd** | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 19. Curva Sobretasa BondesF.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa LF”.***

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| En el formato dd/mm/aaaa | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 20. Curva IRMXP-TIIE-P28.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRMXP-TIIE-P28”.***

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 21. Curva IRMXP-Cetes-P182.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRMXP-TIIE-P28”.***

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 22. Curva Sobretasa BondesG.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Sobretasa LG”.***

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| En el formato dd/mm/aaaa | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 23. Curva Reportos de bonos gubernamentales de Estados Unidos (USD).** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“Reportos de bonos gubernamentales de Estados Unidos (USD)”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |
| --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 |
| **Nodos de**  **la curva** | **Tasa** |
| Numérico.  Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico. |

**Factor de riesgo 24. Curva IRMXP-FGub-28.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRMXP-FGub-28”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta 1 nodo tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 25. Curva IRMXP-FGub-91.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRMXP-FGub-91”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta 1 nodo tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 26. Curva IRMXP-TPFB.** Archivo electrónico con separador de campo “coma”

( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRMXP-TPFB”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta 1 nodo tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 27. Curva IRUSD\_SOFR1D\_OIS.** Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“IRUSD\_SOFR1D\_OIS”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 |
| **Fecha** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| En el formato **dd/mm/yyyy** | Comienza en 1 y hasta *n* nodos tenga la curva | Numérico, al menos 6 decimales. |

**Factor de riesgo 28. Curva IRSDU\_SOFR.** Archivo electrónico con separador de campo “coma”

( , ), en formato csv y nombrado específicamente de la siguiente forma*: “****IRSDU\_SOFR****”.*

El contenido del archivo debe presentarse en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 |
| **Nombre de Identificación del archivo** | **Nombre de la curva** | **Nodos de la curva** | **Tasa** |
| “**SOFR**”  Alfabético en mayúsculas | “**SOFR**”  Alfanumérico | Numérico.  Comienza en 1 y hasta *360* nodos tenga la curva | Numérico. |

1. **Vector de precios (personalizado)**

Archivo con separador de campo “coma” ( , ) en ficheros planos, nombrado específicamente de la siguiente forma: “***NNNNN\_VectorAnaliticoaaammddMD***”

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente, ningún campo excede una longitud máxima de 120 caracteres.

| Descripción | No. De columna |
| --- | --- |
| Fecha del Vector | 1 |
| Tipo de Valor | 2 |
| Emisora | 3 |
| Serie | 4 |
| Precio Limpio | 5 |
| Precio Sucio | 6 |
| Tasa | 7 |
| Tasa del cupón | 8 |
| Intereses | 9 |
| Duración del cupón | 10 |
| Sector económico | 11 |
| Sub sector económico | 12 |
| Características del cupón | 13 |
| Fecha de la Emisión | 14 |
| Plazo de la emisión | 15 |
| Fecha de vencimiento | 16 |
| Valor nominal actualizado | 17 |
| Calificación crediticia Fitch | 18 |
| Calificación crediticia S&P | 19 |
| Calificación crediticia Moody’s | 20 |
| Días transcurridos del cupón | 21 |
| Monto emitido actualizado | 22 |
| ISIN | 23 |
| Sobretasa | 24 |
| Volatilidad | 25 |
| Fecha Inicio Cupón | 26 |
| Fecha Fin Cupón | 27 |
| Emisor Nombre Corto | 28 |
| Emisor Nombre Largo | 29 |
| Calificación HR | 30 |
| Duración Macaulay | 31 |
| Curva de descuento | 32 |
| Tipo de Emisión | 33 |
| Monto emitido | 34 |
| Títulos en circulación | 35 |
| Títulos emitidos | 36 |
| Ramo económico | 37 |
| Subramo económico | 38 |
| Moneda | 39 |
| Valor nominal original | 40 |
| Sobretasa de colocación | 41 |
| Duración | 42 |
| Convexidad | 43 |
| Frecuencia del cupón | 44 |
| Bursatilidad | 45 |

1. **Matrices por tipo de instrumento**

Archivos electrónicos en formato xlsx, nombrados específicamente de la siguiente forma, de acuerdo al tipo de instrumento: ***Transpuesta\_ACC\_aaaammdd.xls*** para acciones, ***Transpuesta\_INDICES\_aaaammdd.xls*** para índices y ETFs y ***Transpuesta\_REPOS\_aaaammdd.xls*** para operaciones en Reporto.

El contenido de los archivos se debe presentar con encabezados en el primer registro y 1,000 días de historia.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | . | . | Columna  500 | Columna  1,000 | Columna  1,001 | Columna  1,002 |
| **Nombre de**  **identificación**  **del instrumento** | **ISIN** | **Fecha**  **T** | **Fecha**  **T-1** | **.** | **.** | **Fecha**  **T-500** | **Fecha**  **T-1,000** | **Precio**  **Vector** | **Precio**  **Teórico** |
| INSTRUMENTO | ISIN | Fecha  T | Fecha  T-1 | **.** | **.** | Fecha  T-500 | Fecha  T-249 | Precio  Teórico | Precio  Vector |
| Instrumento1 | Isin1 | P&L1,T | P&L1,T-1 |  |  | P&L1,T-500 | P&L1,T-1,000 | PTi,T | PVi,T |
| **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** |
| **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** |
| InstrumentoK | IsinK | P&LKT | P&LK,T-1 |  |  | P&LK,T-500 | P&LK,T-1,00 | PTK,T | PVK,T |
| **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** |
| **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** | **.** |
| Instrumenton | Isinn | P&Ln,T | P&Ln,T-1 |  |  | P&Ln,T-500 | P&Ln,T-1,000 | PTn,T | PVn,T |

1. **Calendarios de amortización**

Archivo con separador de campo “coma” ( , ) en ficheros planos, nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“CALC\_Flujos\_CGE\_aaaammdd”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 | Columna  6 | Columna  7 | Columna 8 |
| **Instrumento** | **Fecha** | **Días por vencer del cupón** | **Periodo del cupón** | **Interés** | **Valor nominal** | **Amortización** | **Flujo** |
| **Tipo de valor\_instrumento\_serie** | Fecha inicial de cada cupón, en formato **dd/mm/aaaa** | Número de días por vencer que le quedan a cada cupón. | Periodicidad de pago del cupón, considerada en el prospecto. | **Numéricos.** Los decimales del valor no se deberán truncar, ni redondear. | | | |

1. **Base Calificaciones de emisores**

Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: *“****aaaammdd\_Calificaciones Emisores****”*

El contenido del archivo se presenta en forma vertical con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **TITULO** | **DESCRIPCIÓN** |
| --- | --- | --- |
| 1 | RAZON SOCIAL | Razón Social del emisor |
| 2 | CLAVE | Clave interna del proveedor de precios |
| 3 | PAIS | País de origen del emisor |
| 4 | FITCH NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora Fitch |
| 5 | FITCH NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora Fitch |
| 6 | FITCH GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora Fitch |
| 7 | FITCH GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora Fitch |
| 8 | FECHA REVISION FITCH | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Fitch |
| 9 | S&P NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora S&P |
| 10 | S&P NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora S&P |
| 11 | S&P GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora S&P |
| 12 | S&P GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora S&P |
| 13 | FECHA REVISION S&P | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora S&P |
| 14 | MOODYS NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora Moody's |
| 15 | MOODYS NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora Moody's |
| 16 | MOODYS GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora Moody's |
| 17 | MOODYS GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora Moody's |
| 18 | FECHA REVISION MOODYS | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Moody's |
| 19 | HR NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora HR |
| 20 | HR NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora HR |
| 21 | HR GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora HR |
| 22 | HR GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora HR |
| 23 | FECHA REVISION HR | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora HR |
| 24 | VERUM NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora Verum |
| 25 | VERUM NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora Verum |
| 26 | VERUM GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora Verum |
| 27 | VERUM GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora Verum |
| 28 | FECHA REVISION VERUM | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Verum |
| 29 | BEST NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora Best |
| 30 | BEST NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora Best |
| 31 | BEST GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora Best |
| 32 | BEST GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora Best |
| 33 | FECHA REVISION BEST | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Best |
| 34 | DBRS NACIONAL LP | Calificación Nacional de largo plazo asignada por la calificadora DBRS |
| 35 | DBRS NACIONAL CP | Calificación Nacional de corto plazo asignada por la calificadora DBRS |
| 36 | DBRS GLOBAL LP | Calificación Internacional de largo plazo asignada por la calificadora DBRS |
| 37 | DBRS GLOBAL CP | Calificación Internacional de corto plazo asignada por la calificadora DBRS |
| 38 | FECHA REVISION DBRS | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora DBRS |

1. **Bases de datos gubernamental, corporativa, bancaria eurobonos (incluye UMS) y accionaria**

Archivos electrónicos con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma***: “aaaa-mm-dd\_Base\_gubernamental”*** (nombre cambia según la base que corresponda).

El contenido del archivo de las bases gubernamental, bancaria y corporativa se presenta en forma vertical con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **CAMPO** |
| --- | --- |
| 1 | Fecha |
| 2 | Emision |
| 3 | TV |
| 4 | Emisora |
| 5 | Serie |
| 6 | Tipo Instrumento |
| 7 | Sobretasa de mercado |
| 8 | Sobretasa de colocación |
| 9 | ISR |
| 10 | Sobretasa Total |
| 11 | Rendimiento |
| 12 | Tasa Cupon |
| 13 | Dias plazo |
| 14 | Fecha de Colocación |
| 15 | Fecha de Vencimiento |
| 16 | Dias por vencer |
| 17 | Curva de Descuento |
| 18 | Periodo de Cupon |
| 19 | FITCH |
| 20 | S&P |
| 21 | Moodys |
| 22 | HR |
| 23 | Cve. |
| 24 | Inicio de Cupon |
| 25 | Fin de Cupon |
| 26 | Precio Sucio MD |
| 27 | Precio Limpio MD |
| 28 | Intereses |
| 29 | Duracion Ajustada. |
| 30 | Convexidad |
| 31 | Valor Nominal Actualizado |
| 32 | Valores Inscritos |
| 33 | Monto en Circulacion |
| 34 | Representante Comun |
| 35 | Agente Colocador |
| 36 | Cupones por vencer |
| 37 | Cupones vencidos |
| 38 | Días por vencer al Corte Cupon |
| 39 | Sector |
| 40 | Isin |
| 41 | Verum |
| 42 | Moneda |
| 43 | Descripción |
| 44 | Moneda2 |

Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“aaaa-mm-dd\_Base\_eurobonos\_umsl”****.* El contenido del archivo de la base de eurobonos (y UMS) se presenta en forma vertical con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **CAMPO** |
| --- | --- |
| 1 | Instrumento |
| 2 | Emisor |
| 3 | Tipo Valor |
| 4 | Emisora |
| 5 | Serie |
| 6 | VTO |
| 7 | Tasa |
| 8 | Precio Hoy |
| 9 | Precio Ayer |
| 10 | Variación |
| 11 | Isin |
| 12 | Moneda |
| 13 | VN |
| 14 | Fecha\_Val |
| 15 | Descripción |

Archivos electrónicos con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma ***“aaaa-mm-dd\_Base\_Accionaria”.*** El contenido del archivo de la base de acciones (y ETFs) se presenta en forma vertical con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **CAMPO** |
| --- | --- |
| 1 | FECHA |
| 2 | TV |
| 3 | EMISORA |
| 4 | SERIE |
| 5 | INSTR |
| 6 | ISIN |
| 7 | RAZON\_SOCIAL |
| 8 | PAIS\_EMISOR |
| 9 | FOCO\_GEOGRAFICO |
| 10 | MERCADO |
| 11 | NOMBRE\_MERCADO |
| 12 | FECHA\_EMISION |
| 13 | PAIS\_MERCADO |
| 14 | TIPO\_DE\_INSTRUMENTO |
| 15 | CATEGORIA\_INSTRUMENTO |
| 16 | TIPO\_DE\_FONDO |
| 17 | ADMINISTRADOR\_DE\_FONDO |
| 18 | SECTOR |
| 19 | SUBSECTOR |
| 20 | RAMO |
| 21 | SUBRAMO |
| 22 | ACTIVIDAD |
| 23 | ACCIONES\_INSCRITAS |
| 24 | VOLUMEN |
| 25 | MOVIMIENTOS |
| 26 | VOLUMEN\_BID |
| 27 | VOLUMEN\_ASK |
| 28 | UH |
| 29 | PRECIO\_BID |
| 30 | PRECIO\_ASK |
| 31 | FECHA\_UH |
| 32 | CAMBIO\_PORCENTUAL\_1D |
| 33 | CAMBIO\_PUNTOS\_1D |
| 34 | CAMBIO\_PORCENTUAL\_1A |
| 35 | CAMBIO\_PUNTOS\_1A |
| 36 | CIERRE |
| 37 | FECHA\_CIERRE |
| 38 | MONEDA |
| 39 | VALOR\_EN\_LIBROS |
| 40 | DIVIDENDO |
| 41 | MONEDA\_DIVIDENDO |
| 42 | FECHA\_ANUNCIO |
| 43 | FECHA\_APLICACION |
| 44 | FECHA\_DE\_PAGO |
| 45 | TIPO\_DE\_DIVIDENDO |
| 46 | TIPO\_DE\_PAGO |
| 47 | FRECUENCIA\_DE\_DIVIDENDO |
| 48 | TIPO\_DE\_CAMBIO\_DE\_CAPITAL |
| 49 | FECHA\_DE\_ANUNCIO |
| 50 | FECHA\_DE\_APLICACION |
| 51 | FECHA\_DE\_LIQUIDACION |
| 52 | FACTOR\_DE\_AJUSTE |
| 53 | ACCIONES\_ANTERIORES |
| 54 | ACCIONES\_NUEVAS |
| 55 | PROPORCION |
| 56 | INDICE\_PRINCIPAL |
| 57 | ACCIONES\_CIRCULACION |

1. **Base Calificaciones de emisores**

Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“aaaammdd\_Calificaciones Emisores”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **CAMPO** |
| --- | --- |
| 1 | RAZON SOCIAL |
| 2 | CLAVE |
| 3 | PAIS |
| 4 | FITCH NACIONAL LP |
| 5 | FITCH NACIONAL CP |
| 6 | FITCH GLOBAL LP |
| 7 | FITCH GLOBAL CP |
| 8 | FECHA REVISION FITCH |
| 9 | S&P NACIONAL LP |
| 10 | S&P NACIONAL CP |
| 11 | S&P GLOBAL LP |
| 12 | S&P GLOBAL CP |
| 13 | FECHA REVISION S&P |
| 14 | MOODYS NACIONAL LP |
| 15 | MOODYS NACIONAL CP |
| 16 | MOODYS GLOBAL LP |
| 17 | MOODYS GLOBAL CP |
| 18 | FECHA REVISION MOODYS |
| 19 | HR NACIONAL LP |
| 20 | HR NACIONAL CP |
| 21 | HR GLOBAL LP |
| 22 | HR GLOBAL CP |
| 23 | FECHA REVISION HR |
| 24 | VERUM NACIONAL LP |
| 25 | VERUM NACIONAL CP |
| 26 | VERUM GLOBAL LP |
| 27 | VERUM GLOBAL CP |
| 28 | FECHA REVISION VERUM |
| 29 | BEST NACIONAL LP |
| 30 | BEST NACIONAL CP |
| 31 | BEST GLOBAL LP |
| 32 | BEST GLOBAL CP |
| 33 | FECHA REVISION BEST |
| 34 | DBRS NACIONAL LP |
| 35 | DBRS NACIONAL CP |
| 36 | DBRS GLOBAL LP |
| 37 | DBRS GLOBAL CP |
| 38 | FECHA REVISION DBRS |

1. **Base Calificaciones de instrumentos**

Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“aaaammdd\_Calificaciones Instrumentos”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

| **COLUMNA** | **TITULO** | **DESCRIPCIÓN** |
| --- | --- | --- |
| 1 | fecha\_vector | La fecha del vector del día |
| 2 | tv | Tipo de Valor del Instrumento |
| 3 | emisora | Clave de Pizarra del instrumento |
| 4 | serie | Serie del instrumento |
| 5 | isin | ISIN del instrumento |
| 6 | cusip | Cusip del instrumento |
| 7 | pais\_origen | País de origen del instrumento |
| 8 | moneda\_origen | Moneda de origen del instrumento |
| 9 | emisor | Razón Social del emisor |
| 10 | comision\_valores | Autoridad que regula |
| 11 | fecha\_inscripcion | Fecha de inscripción |
| 12 | bolsa\_emision | Bolsa en la que se emitió el instrumento |
| 13 | fecha\_emision | Fecha de emisión del instrumento |
| 14 | fecha\_vencimiento | Fecha de vencimiento del instrumento |
| 15 | tipo\_papel | Tipo de papel por sector |
| 16 | calificacion nac fitch | Calificación Nacional asignada por la calificadora Fitch |
| 17 | calificacion global fitch | Calificación Internacional asignada por la calificadora Fitch |
| 18 | fecha revision fitch | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Fitch |
| 19 | calificacion nac sp | Calificación Nacional asignada por la calificadora S&P |
| 20 | calificacion global sp | Calificación Internacional asignada por la calificadora S&P |
| 21 | fecha revision sp | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora S&P |
| 22 | calificacion nac moody | Calificación Nacional asignada por la calificadora Moody's |
| 23 | calificacion global moody | Calificación Internacional asignada por la calificadora Moody's |
| 24 | fecha revision moody | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Moody's |
| 25 | calificacion nac hr | Calificación Nacional asignada por la calificadora HR |
| 26 | calificacion global hr | Calificación Internacional asignada por la calificadora HR |
| 27 | fecha revision hr | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora HR |
| 28 | calificacion nac verum | Calificación Nacional asignada por la calificadora Verum |
| 29 | calificacion global verum | Calificación Internacional asignada por la calificadora Verum |
| 30 | fecha revision verum | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Verum |
| 31 | calificacion nac best | Calificación Nacional asignada por la calificadora Best |
| 32 | calificacion global best | Calificación Internacional asignada por la calificadora Best |
| 33 | fecha revision best | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora Best |
| 34 | calificacion nac dbrs | Calificación Nacional asignada por la calificadora DBRS |
| 35 | calificacion global dbrs | Calificación Internacional asignada por la calificadora DBRS |
| 36 | fecha revision dbrs | Ultima fecha de revisión de la calificación asignada por la calificadora DBRS |

1. **Base de Movimientos de Calificaciones de emisores e instrumentos**

Archivo electrónico con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“aaaammdd\_Movimientos Calificaciones”.***

El contenido del archivo se presenta en forma vertical con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **COLUMNA** | **TITULO** | **SUBTITULO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | RESUMEN DE CALIFICACIONES POR INSTRUMENTO | Instrumento | Identificador del instrumento |
| 2 |  | Calificadora | Calificadora que tuvo ajuste en calificación |
| 3 |  | Nacional | Calificación Nacional |
| 4 |  | Calif. Anterior | Calificación anterior a la modificación |
| 5 |  | Calif. Nueva | Nueva calificación |
| 6 |  | Evento | Descripción de la acción de calificación aplicada al instrumento |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **COLUMNA** | **TITULO** | **SUBTITULO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | RESUMEN DE CALIFICACIONES POR EMISOR | Razon Social | Razón Social del emisor |
| 2 |  | Clave | Clave Interna proveedor de precios |
| 3 |  | Calificadora | Calificadora que tuvo ajuste en calificación |
| 4 |  | Nacional | Calificación Nacional |
| 5 |  | Corto/Largo | Largo o corto plazo |
| 6 |  | Calif. Anterior | Calificación anterior a la modificación |
| 7 |  | Calif. Nueva | Nueva calificación |
| 8 |  | Evento | Descripción de la acción de calificación aplicada al emisor |

1. **Matrices de equivalencias de calificaciones en escala global y en escala nacional**
2. Las matrices de equivalencias corresponden a las tablas descritas que se incluyen en el apartado V Tablas de equivalencia de calificaciones del Anexo 3.2 Metodología de riesgo de crédito. **Interfaz de posición de portafolios Institucionales e inversiones tercerizadas.**
3. **Portafolios institucionales**

Archivo de carga de los portafolios institucionales con separador de campo “coma”

( , ), en formato de ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: **“*aa-mm-dd INTERFASE\_RIESGOS”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente, cuenta con 39 columnas y aproximadamente 2,500 filas, ningún campo excede una longitud máxima de 40 caracteres.

| **Campo** | **No. De columna** |
| --- | --- |
| Clave de operación | 1 |
| Fecha de la cartera | 2 |
| Subportafolio | 3 |
| Emisora | 4 |
| Serie | 5 |
| Tipo de valor | 6 |
| Precio sucio | 7 |
| Títulos | 8 |
| Plazo del cupón | 9 |
| Días por vencer | 10 |
| Tipo de operación | 11 |
| Plazo de la operación | 12 |
| Fecha de Liquidación | 13 |
| Clave Intermediario | 14 |
| Subportafolio | 15 |
| Monto invertido | 16 |
| Proveedor de precios | 17 |
| Clase de activo | 18 |
| Tasa pactada | 19 |
| Sobretasa | 20 |
| Volatilidad Implícita | 21 |
| Retenido / Disponible | 22 |
| Monto Emitido | 23 |
| Títulos Circulación | 24 |
| Títulos Emitidos | 25 |
| Valor Nominal | 26 |
| % Bancario | 27 |
| % Corporativo | 28 |
| % Gubernamental | 29 |
| % Acciones | 30 |
| Rendimiento Mínimo | 31 |
| Clave Mandato Operación Financiera | 32 |
| Monto Invertido Operación en Transito | 33 |
| Títulos Operación en Tránsito | 34 |
| Monto Liquidado 72 HRS | 35 |
| Monto Liquidado 48 HRS | 36 |
| Monto Liquidado 24 HRS | 37 |
| Precio de cierre Operación en tránsito/Monto liquidado | 38 |
| Fecha de operación | 39 |

1. **Portafolios de inversiones tercerizadas**

Archivo de carga de las inversiones tercerizadas con separador de campo “coma” ( , ), en ficheros planos y nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“aaaammdd\_CARTERA\_MANDATOS”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal sin encabezados en la columna correspondiente, cuenta con 37 columnas y aproximadamente 500 filas, ningún campo excede una longitud máxima de 40 caracteres.

|  |  |
| --- | --- |
| **Campo** | **No. de columna** |
| Clave de operación | 1 |
| Fecha de la cartera | 2 |
| Subportafolio | 3 |
| Emisora | 4 |
| Serie | 5 |
| Tipo de valor | 6 |
| Precio | 7 |
| Títulos | 8 |
| Plazo del cupón | 9 |
| Días por vencer | 10 |
| Tipo de operación | 11 |
| Plazo de la operación | 12 |
| Fecha de operación | 13 |
| Clave Intermediario | 14 |
| Subportafolio | 15 |
| Valor de Mercado | 16 |
| Proveedor de precios | 17 |
| Clase de activo | 18 |
| Tasa pactada | 19 |
| Columna en valor cero | 20 |
| Columna en valor cero | 21 |
| Columna en valor cero | 22 |
| Columna en valor cero | 23 |
| Columna en valor cero | 24 |
| Columna en valor cero | 25 |
| Columna en valor cero | 26 |
| Columna en valor cero | 27 |
| Columna en valor cero | 28 |
| Columna en valor cero | 29 |
| Columna en valor cero | 30 |
| Columna en valor cero | 31 |
| Columna en valor cero | 32 |
| Clave de MANDATO | 33 |
| Clave (EFECTIVO24, EFECTIVO48, EFECTIVO72) | 34 |
| Clave de la Operación (DVP,RVP) | 35 |
| Columna en valor cero | 36 |
| Columna en valor cero | 37 |

1. **Archivos personalizados**
2. **Comisiones cobradas por los intermediarios que administran las inversiones tercerizadas**

La especificación de montos de comisiones se utiliza para ajustar el valor de mercado de los portafolios de inversiones tercerizadas, antes de calcular rendimientos para determinar el Tracking Error.

Archivo con separador de campo “coma” ( , ) en formato xlsx, nombrado específicamente de la siguiente forma: ***“COMISIONES\_aaaammdd”.***

El contenido del archivo se presenta en forma horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Columna | Tipo | Descripción | Obligatorio/Opcional (Default) |
| Comisiones | Texto | Campo de formato estático | Obligatorio |
| Encabezado | Texto | Campo de formato estático | Obligatorio |
| IDENTIFICADOR | Texto | ID único del Mandatario | Obligatorio |
| NOMBRE | Texto | Nombre del Mandatario | Obligatorio |
| Fecha | Fecha | Fecha de la comisión (yyyy/mm/dd) | Obligatorio |
| UNIDAD MONETARIA | MONEDA | Moneda de la comisión | Obligatorio |
| Monto | Numérico | Monto de la comisión | Obligatorio |

1. **Benchmarks con composición de varios índices**

Archivo en formato xlsx, nombrado específicamente de la siguiente forma: “***Benchmark\_aaaammdd***”.

El contenido del archivo se presenta en horizontal con encabezados en la columna correspondiente:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Columna  1 | Columna  2 | Columna  3 | Columna  4 | Columna  5 |
| **Fecha** | **Índice 1** | **Índice 2** | **Índice 3** | **Índice 4** |
| Fecha inicial de cada cupón, en formato **aaaammdddd** | Valor de mercado del proveedor del proveedor de instrumentos | Valor de mercado del proveedor del proveedor de instrumentos | Valor de mercado del proveedor del proveedor de instrumentos | Valor de mercado del proveedor del proveedor de instrumentos |

|  |
| --- |
| Área Técnica, Área Requirente  y Administrador del Contrato  **Act. Rubén Rodríguez Arellano**  Titular de la Coordinación de Administración de Riesgos Financieros |