



SUPERINTENDENCIA DE VALORES DIRECCION DE PARTICIPANTES

INSTRUCCIONES PARA EL REGISTRO DE INFORMACION EN EL REPORTE DIARIO DE ACTIVIDADES DE LOS INTERMEDIARIOS DE VALORES

En el presente instructivo se explica de manera detallada las características de cada una de secciones que componen el formulario para el **Reporte Diario de Actividades de los Intermediarios de Valores**, describiendo el tipo de información que debe ser colocada en cada una de las columnas que conforman el formulario, con las características y especificaciones requeridas en cada caso.

A los fines de lograr la correcta remisión de la información requerida a los intermediarios de valores en el formulario que se anexa a este documento, todas las casillas deben estar completadas correctamente conforme a las especificaciones definidas en este instructivo, para que todos los datos suministrados tenga la misma estructura ya que en el formulario o plantilla existen variables que serán utilizadas como validadores internos en el sistema general de base de datos, que generan errores automáticos cuando la data no sea introducida correctamente, o cuando el sistema no reconocer la información se está reportando, lo cual impiden que la transmisión de la información sea satisfactoria.

(1) Nombre del Emisor: Nombre del emisor.

(2) R.N.C. Emisor: Registro Nacional de Contribuyente del emisor.

(3) Código SIVEM Emisión: Corresponde al número asignado por la Superintendencia de Valores a una emisión.

Instrucciones: Para los títulos valores del Banco Central que no posean código ISIN colocar ND (No Disponible)

Nota: El RNC y el Código SIVEM Emisión a utilizar es el que se encuentra publicado en la página web de la Superintendencia de Valores (www.siv.gov.do).

Ruta del listado: pulse mercado de valores, luego pulse registros y por ultimo pulse emisores de valores. (<https://seri.siv.gov.do/consulta/Emisores.php>).

(4) Código del Título (ISIN): Corresponde al International Security Identification Number, si lo posee, en caso contrario el número asignado por el mecanismo centralizado de negociación.

Instrucciones: Para los títulos valores del Banco Central que no posean Código ISIN colocar ND (No Disponible)

(5) Serie: Conjunto de valores homogéneos plenamente sustituibles entre si, que forman parte de una misma emisión.

Instrucciones: Para los títulos valores del Banco Central que no posean Código ISIN colocar en esta casilla ND (No Disponible)

Nota: El Código del Título (ISIN) a utilizar es el que se encuentra publicado en la página web de la Depósito Centralizado de Valores (www.cevaldom.com).

Ruta del listado: en la parte de consulta pulse Códigos ISIN.
<https://www.cevaldom.com/app/do/isin.aspx>).

(6) Moneda de Denominación: Corresponde a la moneda de denominación del título valor de deuda, de acuerdo a su acrónimo contable (Ver Capítulo I, Págs. I-49-51 Manual y Plan de Cuentas de los Intermediarios de Valores).

Acrónimo Contable: Es el signo monetario del monto de una partida registrada en una cuenta.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(7) Tipo de Operación:

Cuenta Propia - Se refiere a las transacciones propias del intermediario de valores.

Cuenta Tercero – Se refiere a las transacciones efectuadas de sus clientes.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(8) Clasificación de las Operaciones:

Transacciones propuestas - Son todas las transacciones pactadas que son propuesta por el intermediario de valores a los clientes (o transacciones no solicitadas por el cliente).

Transacciones requeridas – Son todas las transacciones pactadas que son requeridas por los clientes a los intermediarios de valores (o transacciones solicitadas por el cliente).

ND – Cuando el intermediario de valores en la casilla (7) especifique cuenta propia, en esta casilla debe colocar NA.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(9) Tipo de Transacción: Indica el tipo de transacción realizado, según la operación efectuada de compra o venta, Mutuante o Mutuario y Otros.

Compra es la adquisición u obtención de instrumentos financieros.

Venta es la transferencia de instrumentos financieros.

Mutuante es cuando se actúa como prestamista de un título valor de deuda.

Mutuario es cuando se actúa como prestatario de un título valor de deuda.

Otros es cualquier otra operación que no se encuentre estipulado en el listado.

Instrucciones:

- a) El llenado de esta casilla se debe hacer desde el punto de vista del cliente. Es importante destacar, que cuando el intermediario de valores actúa por cuenta propia en la compraventa de TVD actuará como cliente.
- b) Cuando ambas transacciones (compra y venta) se efectúe en el mismo intermediario valores, este debe reportar las dos puntas la de compra y la de venta.
- c) Cuando la transacción (compra o venta) se efectúe entre dos intermediarios de valores, cada intermediario reportará por separado cada operación, es decir, un intermediario reportará la compra y el otro intermediario reportará la venta.
- d) Cuando la transacción sea Mutuante o Mutuario el procedimiento a utilizar es el mismo de los literales b) y c).
- e) Cuando la transacción sea Otros el procedimiento a utilizar es el mismo de los literales b) y c)

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(10) Tipos de Contratos: Se refiere a los distintos contratos que establecen los términos y condiciones específicos de contratación por tipología de transacción o producto, entre la Entidad y un Cliente donde, la Entidad siempre actúa como contraparte directa del Cliente.

Spot (contado) - son contratos de compraventa de títulos valores de deuda donde los contratantes convienen (pactan) vender o comprar un título valor de deuda a un precio establecido, para ser liquidados en la misma fecha (same day value) o en una fecha posterior a la fecha de transacción o pacto. (De acuerdo a prácticas internacionales, el plazo entre la fecha de transacción o pacto y la fecha valor o liquidación de un contrato de compraventa spot no podrá exceder los 7 (siete) días hábiles).

Forward (Plazo) - son contratos de compraventa de títulos valores de deuda donde los contratantes convienen (pactan) vender o comprar un título valor de deuda a un precio establecido, para ser liquidados en una fecha posterior a la fecha de transacción o pacto. (De acuerdo a prácticas internacionales, el plazo entre la fecha de transacción o pacto y la fecha valor o liquidación de un contrato de compraventa a plazo debe exceder los 7 (siete) días hábiles).

Mutuo - es un contrato, por el cual una de las partes entrega a otra cierta cantidad de títulos valores que se consumen por el uso, quedando obligada esta última a devolver otro tanto de la misma especie y calidad.

ND - es cualquier otro contrato que no se encuentre estipulado en el listado.

Instrucciones:

- a) Cuando la casilla 9 indique una compra o una venta, en esta casilla se debe referir a un contrato Spot (contado) o un contrato forward (plazo).
- b) Cuando la casilla 9 indique Mutuante o Mutuario, en esta casilla se debe referir a un contrato Mutuo.
- c) Cuando la casilla 9 indique Otros, en esta casilla se debe indicar ND.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(11) Tipo de Mercado: Indica en el mercado donde realiza la colocación inicial o las negociaciones de operaciones ya colocadas.

Mercado Primario: son las operaciones que envuelven la colocación inicial de emisiones de valores, mediante las cuales los emisores obtienen financiamiento para sus actividades. Dicha colocación puede ser directamente por los que emiten los instrumentos financieros o por un intermediario de valores.

Mercado Secundario: son las operaciones 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.

Instrucciones:

- a) Cuando la colocación primaria de una emisión de títulos valores de deuda (TVD) es colocada directamente por el emisor y el intermediario de valores (actuando por cuenta propia o por cuenta de tercero) adquiere TVD de esa emisión, solamente debe reportar la operación de compra. Es importante destacar, que cuando el intermediario de valores actúe por cuenta propia en la compraventa de TVD, este comportará como cliente.
- b) Cuando la colocación primaria de una emisión de títulos valores de deuda (TVD) es realizada a través de un intermediario (por la bolsa) actuando como agente colocador, este no reportará ninguna operación.

Sin embargo, si un intermediario de valores (actuando por cuenta propia o por cuenta de tercero) adquiere TVD de esa emisión colocados a través de un agente colocador, este debe reportar la punta de la compra. Es importante destacar, que cuando el intermediario de valores actúe por cuenta propia en la compraventa de TVD, este comportará como cliente.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(12) Tipo de Negociación: Indica en el mercado donde realiza la negociación.

Bursátil: Es el mercado donde compradores y vendedores concretan negocios, a través de los Puestos de Bolsa autorizados, por una institución autorreguladora que ofrece un mecanismo centralizado de negociación de valores.

Extrabursátil: son aquellos mercados no organizados donde la negociación bilateral de instrumentos financieros se hace directamente entre las partes.

Nota: En la plantilla esta casilla contiene un listado desplegable.

(13) No. Operación Depositario Centralizado de Valores: Corresponde al número de operación generado y asignado por el Depositario Centralizado de Valores.

Instrucciones: Para las operaciones con títulos valores del Banco Central que no posean código ISIN, colocar en esta casilla el número 0. Sin embargo, para los títulos que posean código ISIN, colocar el número asignado por Depositario Centralizado de Valores.

(14) Corredor: Es la persona responsable que efectúa la operación.

Código SIVCV: Corresponde al código asignado por la superintendencia de Valores a un corredor.

Nota: El Código SIV del Corredor a utilizar es el que se encuentra publicado en la página web de la Superintendencia de Valores (www.siv.gov.do).

Ruta del listado: pulse mercado de valores, luego pulse registros y por ultimo pulse corredores de valores. (<http://www.siv.gov.do/mercado/Participantes/Corredores.html>).

(15) Solicitud del Inversionista:

I. Tasa de interés Facial del TVD: es la tasa nominal de la compra o venta de los títulos valores de deuda establecida conforme los lineamientos del Prospecto de Emisión de Oferta Pública aprobado por la Superintendencia de Valores. Dicha tasa para los inversionistas es percibida sobre una inversión, expresada como un porcentaje anual. En el caso de un Emisor con Tratamiento Diferenciado, deberá cumplir con los requisitos en la Ley y el Reglamento del Mercado de Valores.

II. Tasa de Rendimiento del TVD: es el aumento de anualizado porcentaje en el valor de la inversión. Ganancia que se obtiene por alguna inversión expresada en forma decimal o porcentual.

III. Fecha Valor: es la fecha efectiva de la compra o venta de contado de los títulos valores de deuda donde toma lugar la liquidación del Contrato de Compraventa Spot de TVD. La Fecha Valor coincide con la Fecha de Transacción para aquellos Contratos de Compraventa Spot de TVD “Same day value” (Contratos Valor Mismo Día).

Nota: Para los contratos de mutuos valores la fecha valor es la fecha de inicio del Contrato de Mutuo de Valores y la fecha de transacción es la fecha que se pacta con el cliente y confirma por escrito un Contrato de Mutuo.

IV. Fecha de Vencimiento: es la fecha de terminación del Contrato de Mutuo de Valores.

(16) Información del Instrumento Financiero

(I) Unidad de Valor Nominal: constituye la cantidad unitaria de Valor Nominal mínima o denominación mínima de un título valor de deuda.

(II) Valor Nominal: es el monto a ser pagado por el emisor del título valor de deuda o Título de Renta Fija, al vencimiento de la obligación; y es el monto que se toma como base para el cálculo de los intereses o cupones de intereses.

El Valor Nominal se expresa como una cantidad en términos monetarios, y siempre como el 100% en términos porcentuales.

(III) 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 Unidad de Valor Nominal **(I)** por el Valor Nominal **(II)** que conforman la transacción o la posición.

(IV) Precio Negociado de los Títulos Valores de Deuda (TVD) (%): Es el valor que se expresa porcentualmente, el cual representa la intención de compra o de venta del título valor de deuda.

Es el valor pecuniario de una **Unidad de Valor Nominal** expresado como un porcentaje de una **Unidad de Valor Nominal**, para transacciones pactadas en el mercado *spot* profesional de títulos valores de deuda, a una fecha dada.

(V) Valor Negociado de un Título Valor de Deuda: Es el valor económico, expresado en términos monetarios, de una Cantidad de Valor Nominal al Precio Negociado de los TVD. Se calcula multiplicando la Cantidad de Valor Nominal de la transacción y/o posición de un título valor de deuda **(III)** por el Precio Negociado de los TVD (porcentaje) **(IV)**.

(17) Información del Inversionista: Corresponde a la información personal identificable de un cliente.

(I) Inversionista: Se refiere a persona física o Jurídica.

Instrucciones:

Cuando el intermediario de Valores en la casilla (7) indique:

- a) **Cuenta Propia** esta casilla debe presentarse en blanco.
- b) **Cuenta Tercero** esta casilla debe colocarse el nombre del inversionista.

(II) Tipo de documento: Se refiere a los documentos que son expedidos por la autoridad competente, con que identifica o hace identificable cualquier persona física o jurídica.

R.N.C., Cédula de Identidad y Electoral o Pasaporte: Registro Nacional de Contribuyente o el número equivalente de su jurisdicción nacional y/o Documento de Identidad del cliente.

Instrucciones:

Cuando el intermediario de Valores en la casilla (7) indique:

- a) **Cuenta Propia esta casilla debe presentarse en blanco.**
- b) **Cuenta Tercero esta casilla debe colocarse el tipo de documento del inversionista.**

Nota: Esta casilla contiene un listado desplegable.

(III) Número del Documento: Se refiere al número de identificación asignado al documento de cualquier persona física o jurídica.

R.N.C. cuando se refiera a persona jurídica del país o del exterior.

Cédula de Identidad y Electoral Se refiere a personas físicas del país (República Dominicana).

Pasaporte Se refiere a personas físicas del exterior.

Instrucciones:

Cuando el intermediario de Valores en la casilla (7) indique:

- a) **Cuenta Propia esta casilla debe presentarse en blanco.**
- b) **Cuenta Tercero esta casilla debe colocar el número del documento del inversionista.**