

# ANEXO

## Especificaciones Técnicas

### Formato de los archivos para transferir datos valores

#### Valores

El archivo deberá contener un registro de Cabezal, a continuación los registros de datos, no importa el orden, y al final del archivo un registro de Fin. A continuación se detallan los formatos de los registros:

registro cabezal		
1-2	constante VA	alfanumérico
3-9	constante CABEZAL	alfanumérico
10-13	código institución	numérico
14-21	fecha del informe	AAAAMMDD

registro de identificación de valores		
1-2	constante VA	alfanumérico
3-6	código institución	numérico
7-14	fecha del informe	AAAAMMDD
15-17	tipo de código	alfanumérico
18-47	Código del valor	alfanumérico
48-87	Descripción	alfanumérico
88-92	tipo de valor	alfanumérico
93-94	país del documento emisor	alfanumérico
95-97	tipo de documento emisor	alfanumérico
98-115	numero de documento emisor	alfanumérico
116-119	código moneda	numérico
120-127	fecha emisión	AAAAMMDD
128-135	fecha de vencimiento	AAAAMMDD
136-138	Tasa fija (TFI) o flotante (TFL)	alfanumérico
139-147	Cupón	numérico, 4 decimales
148-155	Fecha de recálculo	AAAAMMDD
156-157	Frecuencia del cupón	numérico
158-158	Cupón incremental (S/N)	alfanumérico
159-159	Opciones incorporadas (S/N)	alfanumérico
160-160	Amortizaciones parciales (S/N)	alfanumérico
161-163	Calificadora	alfanumérico
164-166	rating crediticio - calificación	alfanumérico
167-167	rating crediticio - posición relativa	alfanumérico
168-173	fecha de calificación	AAAAMM
174-174	Es parte relacionada(S/N)	alfanumérico

<b>Registro de detalles</b>		
1-2	constante VD	alfanumérico
3-6	código institución	numérico
7-14	fecha del informe	AAAAMMDD
15-17	tipo de código	alfanumérico
18-47	Código del valor	alfanumérico
48-48	Tipo de posición	numérico
49-65	valor nominal moneda origen	numérico, 2 decimales
66-82	valor razonable moneda origen	numérico, 2 decimales
83-90	Fecha en que el subyacente es activado	AAAAMMDD
91-91	Libre disponibilidad (S/N)	alfanumérico
92-92	Con cargo de capital por riesgo de tasa de interés (S/N)	alfanumérico
93-93	Otras características (S/N)	alfanumérico
94-110	impacto gamma	numérico, 2 decimales
111-127	impacto vega	numérico, 2 decimales
128-129	país del documento contraparte	alfanumérico
130-132	tipo de documento contraparte	alfanumérico
133-150	numero de documento contraparte	alfanumérico
151-175	Concepto	alfanumérico
176-176	Afectado a Operación Repo (S/N)	alfanumérico
177-193	Riesgo Específico	numérico, 2 decimales
194-197	Categoría (Ratio de Cobertura de Liquidez)	alfanumérico

<b>Registro final</b>		
1-2	constante VA	alfanumérico
3-8	constante ULTIMO	alfanumérico
9-15	cantidad de registros recibidos (excluyendo cabecal y fin)	numérico

Nota: Los datos de emisores y contrapartes se ingresaran por el sistema de información patronómica.

Nota: Los valores numéricos deberán venir con ceros a la izquierda y sin punto decimal; en caso de valores negativos, el signo deberá estar en la primera posición. Los valores alfanuméricos deben estar alineados a la izquierda y se debe completar el largo del campo con espacios en blanco.

## ***Códigos de instrumentos del sistema AGATA***

La institución podrá descargar los códigos del sistema AGATA y tipo de instrumentos desde la aplicación a efectos de generar los archivos de información a enviar.

Códigos AGATA de valores

<b>Registro cabezal</b>		
1-2	constante CO	alfanumérico
3-9	constante CABEZAL	alfanumérico
10-17	fecha actualización	AAAAMMDD

<b>Registro detalle</b>		
1-2	constante CO	alfanumérico
3-32	código AGATA	alfanumérico
33-82	Descripción	alfanumérico

<b>Registro final</b>		
1-2	constante CO	alfanumérico
3-8	constante ULTIMO	alfanumérico
9-15	cantidad de registros enviados	Numérico

### Tipos de valores

<b>registro cabezal</b>		
1-2	constante CT	alfanumérico
3-9	constante CABEZAL	alfanumérico
10-17	fecha actualización	AAAAMMDD

<b>registro detalle</b>		
1-2	constante CT	alfanumérico
3-7	código tipo de activo	alfanumérico
8-57	Descripción	Numérico

<b>registro final</b>		
1-2	constante CT	alfanumérico
3-8	constante ULTIMO	alfanumérico
9-15	cantidad de registros enviados	Numérico