



**CIRCULAR EXTERNA  
SUGEF 029-2008**

**11 de agosto del 2008**

**A LOS GERENTES DE LAS ENTIDADES SUPERVISADAS POR LA SUPERINTENDENCIA  
GENERAL DE ENTIDADES FINANCIERAS**

**Asunto:** Procedimiento para la inclusión de instrumentos financieros en el Padrón de Emisores, Emisiones e Instrumentos de la SUGEF, y requerimientos adicionales producto del cambio en el proveedor de precios.

**Considerando que:**

1. La normativa 3-06, Reglamento sobre la Suficiencia Patrimonial de Entidades Financieras, pondera los títulos valores según su calificación e incluye el cálculo del Valor en Riesgo de la cartera de inversiones, por lo cual la SUGEF requiere el detalle de los títulos valores que conforman las carteras de inversión de las entidades supervisadas.
2. La Bolsa Nacional de Valores informó en comunicado de hechos relevantes BNV/03/06/2008 del 29 de julio del 2008, su decisión de no proveer a terceros el servicio de metodología para la valoración de instrumentos financieros (Vector de Precios) a partir del 31 de agosto del 2008.
3. El XML de Inversiones del Sistema de Captura, Verificación y Carga de Datos (SICVECA), está sujeto a validaciones contra los padrones de “Emisores, Emisiones e Instrumentos” que mantiene la SUGEF, para asegurar la correcta identificación de los títulos valores que las entidades supervisadas reportan como parte de su cartera de inversiones.
4. Es necesario definir el procedimiento de solicitud de inclusión de nuevos títulos valores en los tres padrones para asegurar la correcta identificación de los títulos valores reportados por las entidades supervisadas.
5. La identificación del emisor, emisión y del instrumento debe contar con un formato estándar para su correcta inclusión en el padrón respectivo.
6. Existe posibilidad de que haya más de un proveedor de precios de instrumentos financieros en el mercado costarricense.

**Dispone:**

**A. Aprobar el procedimiento para la inclusión de instrumentos financieros en el Padrón de “Emisores, Instrumentos y Emisiones” de la SUGEF, según el siguiente texto:**

**Procedimiento para la inclusión de instrumentos financieros en el Padrón de “Emisores, Instrumentos y Emisiones” de la SUGEF**

1. La inclusión de un título valor en los padrones de “Emisores, Instrumentos y Emisiones” se realizará únicamente si se cumple con el requerimiento de información indicado en el Anexo 1, y debe ser remitido con el formato indicado en el Anexo 2 mediante solicitud escrita a esta Superintendencia, y además a las direcciones electrónicas [ghernandez@sugef.fi.cr](mailto:ghernandez@sugef.fi.cr) y [ejimenezc@sugef.fi.cr](mailto:ejimenezc@sugef.fi.cr).
2. Adicionalmente la entidad solicitante debe enviar para cada título que se solicita incluir en los padrones de la SUGEF la fotocopia del título valor, un comprobante del custodio, un archivo con la imagen de una pantalla electrónica o cualquier otro documento que permita a la SUGEF verificar la información remitida en el punto 1. Los comprobantes deben ser numerados según la numeración asignada a cada título valor en el formato indicado en el Anexo 2.
3. Las entidades supervisadas deben solicitar la inclusión de cada título valor que no esté incluido en los padrones de la SUGEF a más tardar el tercer día hábil de cada mes, con el objeto de actualizar los padrones y así poder realizar la carga de la clase de datos “Inversiones y Depósitos” de SICVECA correspondiente al mes anterior.
4. Toda entidad, antes de solicitar la inclusión de un título valor en los padrones de la SUGEF según el punto 3 anterior, debe consultar estos padrones para asegurarse que el título valor no está ya incluido. La consulta a los padrones se puede hacer en la página WEB de la SUGEF, mediante la siguiente ruta: “Otros Servicios”, “SICVECA”, “Descarga de XMLs”.

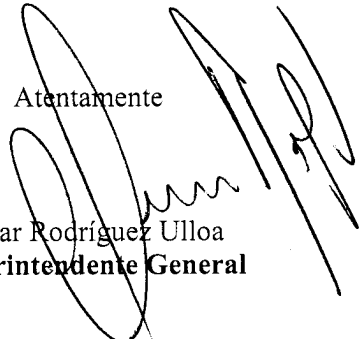
**B. Comunicar sobre los nuevos requerimientos producto de la salida oficial de la Bolsa Nacional de Valores, S.A., como proveedor de precios.**

1. El XML de inversiones se ajustará para incorporar un campo adicional en el cual se deberá indicar el proveedor de precios utilizado en la valoración de cada instrumento financiero. Esta modificación estará vigente a partir del primero de octubre del 2008, con fecha de corte al 30 de septiembre del 2008. Para consultas puede dirigirse a las direcciones electrónicas [ghernandez@sugef.fi.cr](mailto:ghernandez@sugef.fi.cr) y [ejimenezc@sugef.fi.cr](mailto:ejimenezc@sugef.fi.cr).
2. Las emisiones de instrumentos con tasa ajustable tales como los TPTBA y TP\$A del Gobierno de Costa Rica, y CDPA, CPHA y CIIA de Coovivienda, así como cualquier otro instrumento con características similares que hasta la fecha son agrupados por premio en el Padrón de Emisiones de la SUGEF, deberán reportarse en forma independiente para cada emisión, según lo establecido en el punto 3 del “Procedimiento para la inclusión de instrumentos financieros en el Padrón de “Emisores, Instrumentos y Emisiones” de la SUGEF”. Para estos efectos, una emisión individual se define como aquella con igual emisor, instrumento, serie, fecha de vencimiento y premio.



3. A más tardar el 22 de agosto del 2008, deberá informarse a la SUGEF el nombre del proveedor de precios que la entidad utilizará a partir del primero de octubre del 2008.
4. Instar a las entidades supervisadas para que valoren el impacto que podría generar el cambio de proveedor del vector de precios y de metodología.
5. Esta Circular deroga la Circular 04-2006 Procedimiento para la solicitud de inclusión de títulos valores en los padrones de Emisores, Emisiones e Instrumentos de la SUGEF.

Atentamente



Oscar Rodríguez Ulloa  
**Superintendente General**

GSC/KVS/GOC/EJCH



**ANEXO 1**

**DATOS REQUERIDOS DE LOS TÍTULOS VALORES**

Nemotécnico	texto	1 a 30	Sí, cuando existe.	Código que asignan las bolsas de valores, los reguladores de valores o las empresas dedicadas al suministro de precios de instrumentos internacionales a los emisores. En caso de no existir la entidad puede sugerir algún nombre abreviado para el emisor.
Nombre	texto	1 a 150	Sí	Nombre completo del emisor registrado en las bolsas de valores, reguladores de valores, empresas dedicadas al suministro de precios de instrumentos internacionales o registro de personas jurídicas.
País de registro	texto	1 a 4	Sí	País de registro de los emisores. Se debe utilizar el código ISO 3166-2
Sector	texto	1 a 7	Sí	Sector del emisor: público o privado
Nemotécnico	texto	1 a 25	Sí	Código que asignan las bolsas de valores, los reguladores de valores o las empresas dedicadas al suministro de precios de títulos valores internacionales a los instrumentos. En algunas ocasiones es igual al nemotécnico del emisor.
Nombre	texto	1 a 150	Sí	Nombre completo del instrumento registrado en las bolsas de valores, los reguladores de valores o las empresas dedicadas al suministro de precios de instrumentos internacionales.
Moneda de denominación	numérico	1 a 6	Sí	Código del tipo de moneda del instrumento. Se debe utilizar la tabla Tipo_Moneda de SICVECA.
Moneda de liquidación	numérico	1 a 6	Sí, cuando existe.	Código del tipo de moneda de liquidación del instrumento. Se debe utilizar la tabla Tipo_Moneda de SICVECA.
Tipo	texto	1	Sí	Código del tipo de instrumento: A=acción, B=bono, C=certificado de inversión o P=título de participación.
Serie	texto	1 a 20	Sí, cuando existe.	Serie de la emisión. Nota: algunos títulos de emisores costarricenses tienen serie, los títulos extranjeros no tienen serie.
Código ISIN	texto	1 a 25	Sí, cuando existe.	Código ISIN (International Standard Identification Number). Nota: todos los títulos de emisores extranjeros tienen código ISIN.
Fecha de vencimiento	fecha	dd/mm/yyyy	Sí, cuando existe.	Fecha de vencimiento de la emisión.
Premio	numérico	1 a 3 números	Sí, cuando	Corresponde a la prima (positiva o negativa) que el



Dato	Formato	Formato en la solicitud	Obligatorio	Descripción
		enteros con 2 decimales	existe.	título valor devenga por encima o por debajo de la tasa de interés que sirve de referencia para el cálculo de los intereses del mismo, por ejemplo, la tasa básica, la tasa LIBOR, etc. Debe expresarse en puntos porcentuales.
Fecha de emisión	fecha	dd/mm/yyyy	Sí, cuando existe.	Fecha en que la emisión fue emitida.
Periodicidad de pago	numérico	1 a 2	Sí, cuando existe.	Periodicidad de pago de la emisión. Se debe utilizar la tabla Tipo_Periodicidad de SICVECA.

## ANEXO 2

### FORMATO PARA LA SOLICITUD DE INCLUSIÓN DE LOS TÍTULOS VALORES

Nombre de la entidad financiera:

Fecha solicitud de inclusión:

Título a incluir		1	2	3	4	5
Padrón de Emisores	Nemotécnico					
	Nombre					
	País de registro					
	Sector					
Padrón de Instrumentos	Nemotécnico					
	Nombre					
	Moneda de denominación					
	Moneda de liquidación					
	Tipo					
Padrón de Emisiones	Serie					
	Código ISIN					
	Fecha de vencimiento					
	Premio					
	Fecha de emisión					
	Periodicidad de pago					
	Proveedor de Precios <sup>1/</sup>					

1/ Se refiere al Proveedor de Precios seleccionado para su valoración.