



**SUPERINTENDENCIA DEL MERCADO DE
VALORES — SMV**

**MODIFICACIÓN DEL MANUAL DE
ESPECIFICACIONES SOBRE LA NEGOCIACIÓN DE
VALORES DE DEUDA PÚBLICA**

Noviembre de 2014

**ANEXO I**

Incorporar la columna denominada “Etiqueta XML” a los campos de las estructuras de los archivos 2.6.1 a 2.6.15, agregar un carácter de signo a los campos de rendimiento y de variación de precio y rendimiento de los archivos 2.6.1 al 2.6.7, 2.6.9 y 2.6.10, agregar los campos denominados “Fecha Instrucción Tercero” y “Hora Instrucción Tercero” a la estructura del archivo 2.6.6, agregar los campos denominados “Rendimiento Apertura” y “Precio Apertura” a la estructura del archivo 2.10.3 y 2.10.5, así como modificar los formatos de los numerales 3 y 5 del Anexo 02 del “Manual de Especificaciones sobre la Negociación de Valores de Deuda Pública” y actualizar su respectiva numeración.

2.6.1. DS_DESCRIPCIÓN_SUBASTA:

Nº	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Subasta	9(6)	Identificador único de la subasta.	IID_SUBASTA
2	Número Subasta	9(6)	Número de subasta asignado por el Sistema.	INUM_SUBASTA
3	Fecha Subasta	X(8)	Fecha de la subasta. Formato ddmmaaaa.	DFEC_SUBASTA
4	Código	X(12)	Código ISIN del valor subastado.	VCODIGO
5	Valor	X(20)	Código nemónico del valor subastado.	VVALOR
6	Denominación	X(120)	Denominación del valor subastado.	VDENOMINACION
7	Plazo	9(5)	Plazo en días del valor a subastar.	IPLAZO
8	Modalidad de subasta	X(2)	EV-Emisión de Valores. RC-Recompra de Valores. RV-Reventa de Valores.	VMODAL_SUBASTA
9	Tipo de subasta	X(1)	O-Subasta Ordinaria. E-Subasta Especial.	VTIPO_SUBASTA
10	Hora de inicio	X(6)	Hora de inicio de ingreso de Posturas. Formato hhmmss.	VHOR_INICIO
11	Hora de cierre	X(6)	Hora de fin de ingreso de Posturas. Formato hhmmss.	VHOR_CIERRE
12	Hora resultados	X(6)	Hora de publicación de resultados. Formato hhmmss.	VHOR_RESULTADOS
13	Monto referencial	9(15)	Monto referencial a ser colocado en esta emisión.	IMONT_REFERENCIAL
14	Fecha de subasta	X(8)	Fecha en que se realizará la subasta. Formato ddmmaaaa.	DFEC_DSUBASTA
15	Fecha de liquidación	X(8)	Fecha para liquidar las operaciones.	DFEC_LIQUIDACION
16	Procedimiento de adjudicación	X(1)	U-Precios únicos M-Precios múltiples X-Precios mixtos	VPROC_ADJUDICACION
17	Porcentaje del Monto máximo	9(3)	% de los Creadores de Mercado.	IPORC_CREA_MERCADO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
	adjudicación creadores de mercado			
18	Porcentaje del Monto máximo adjudicación entidades elegibles	9(3)	% de las entidades elegibles.	IPORC_ENT_ELEGIBLE
19	Dispositivo legal	X(100)	Indica el dispositivo legal que autoriza la emisión de los valores.	VDISPO_LEGAL
20	Unidades en circulación inicial	9(12)	Cantidad de valores en circulación antes de la subasta.	IUNID_CIRC_INICIAL
21	Total de valores posturas	9(12)	Cantidad total de valores acumulado de todas las Posturas de la subasta.	ITOT_VALOR_POSTURA
22	Monto nominal total postura	9(12)	Monto nominal total acumulado de todas las Posturas de la subasta.	ITOT_NOMINAL_POSTURA
23	Rendimiento Marginal Máximo	9(3)V9(4)	Rendimiento marginal máximo asignado en la subasta. En porcentaje.	NREND_MARG_MAXIMO
24	Rendimiento Promedio Ponderado	S9(3)V9(4)	Rendimiento promedio ponderado asignado en la subasta. En porcentaje.	NREND_PROM_PONDERADO
25	Precio Marginal Mínimo	9(3)V9(4)	Precio marginal mínimo adjudicado. En porcentaje.	NPREC_MARG_MINIMO
26	Precio Promedio Ponderado	9(3)V9(4)	Precio promedio ponderado adjudicado. En porcentaje.	NPREC_PROM_PONDERADO
27	Total de valores colocados	9(12)	Cantidad total de valores colocados.	ITOT_VALORES_COLOCADO
28	Monto total colocado	9(15)	Monto nominal total colocado.	ITOT_MONTO_COLOCADO
29	Unidades en circulación final	9(12)	Cantidad de valores en circulación al final de la subasta.	IUNID_CIRC_FINAL

2.6.2. PS_PROPUESTAS_SUBASTA:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Propuesta	X(18)	Identificador único de la propuesta.	VID_PROPUESTA
2	ID Subasta	9(6)	Identificador único de la subasta.	IID_SUBASTA
3	Número Propuesta	9(6)	Número de la propuesta asignado por el Sistema.	INUM_PROPUESTA
4	Fecha propuesta	X(8)	Fecha de ingreso de la propuesta. Formato fecha ddmmaaaa.	DFEC_PROPUESTA



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
5	Hora propuesta	X(6)	Hora de ingreso de la propuesta. Formato hora hhmmss.	VHOR_PROPUESTA
6	Tipo Propuesta	X(1)	C- Propuesta Competitiva. N- Propuesta No Competitiva.	VTIPO_PROPUESTA
7	Tipo Operación	X(1)	P-Por cuenta Propia. T-Por cuenta de Terceros.	VTIPO_OPERACION
8	Rendimiento Postura	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la propuesta. En porcentaje.	NREND_POSTURA
9	Precio Propuesta	9(3)V9(4)	Precio al rendimiento de la Postura. En porcentaje.	NPREC_PROPUESTA
10	Cantidad Propuesta	9(12)	Cantidad de valores de la propuesta.	ICANT_PROPUESTA
11	Monto Nominal Postura	9(15)	Monto nominal total de la propuesta.	ITOT_NOM_POSTURA
12	Estado Propuesta	X(1)	V- Propuesta Vigente R- Propuesta Retirada por el participante. A- Propuesta Anulada por el Administrador del MCN o Emisor.	VESTADO_PROPUESTA
13	Código Operador	X(12)	Código del operador que ingresó la Propuesta.	VCOD_OPERADOR
14	Código Participante	X(12)	Código del participante.	VCOD_PARTICIPANTE
15	Código Liquidador	X(12)	Código del participante directo liquidador en caso sea distinto al participante del MCN.	VCOD_LIQUIDADOR
16	Denominación Liquidador	X(100)	Denominación del participante directo liquidador en caso sea distinta al participante del MCN.	VDENOM_LIQUIDADOR

2.6.3. OS_OPERACIONES_SUBASTA:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Operación	X(18)	Identificador único de la operación.	VID_OPERACION
2	ID Propuesta	X(18)	Identificador único de la propuesta.	VID_PROPUESTA
3	ID Subasta	9(6)	Identificador único de la subasta.	IID_SUBASTA
4	Numero Operación	9(4)	Número de la operación asignado por el Sistema.	INUM_OPERACION
5	Fecha Operación	X(8)	Fecha operación asignada por el Sistema. Formato fecha ddmmaaaa.	DFEC_OPERACION
6	Hora Operación	X(6)	Hora operación asignada por el Sistema. Formato hora hhmmss.	VHOR_OPERACION
7	Tipo	X(1)	P-Rendimiento Promedio	VTIPO_REND_ADJUDICADO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
	Rendimiento Adjudicado		Ponderado. S-Rendimiento solicitado. U-Rendimiento único.	
8	Rendimiento Adjudicado	S9(3)V9(4)	Rendimiento adjudicado de la operación. En porcentaje	NREND_ADJUDICADO
9	Precio Adjudicado	9(3)V9(4)	Precio adjudicado de la operación. En porcentaje.	NPREC_ADJUDICADO
10	Cantidad Adjudicada	9(12)	Cantidad de valores adjudicados de la operación.	ICANT_ADJUDICADO
11	Monto Nominal Adjudicado	9(15)	Monto nominal adjudicado de la operación.	IMONT_NOM_ADJUDICADO

2.6.4. CV_COTIZACIONES_VALORES:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Fecha Sesión	X(8)	Fecha de la sesión de negociación. Formato fecha ddmmaaaa.	DFEC_SESION
2	Código	X(12)	Código ISIN del instrumento de deuda pública.	VCODIGO
3	Valor	X(12)	Código nemónico del instrumento de deuda pública.	VVALOR
4	ID Operación	X(18)	Identificador único de la última operación válida (no anulada) de la sesión.	VID_OPERACION
5	Último Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la última operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	NULT_RENDIMIENTO
6	Compra Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la mejor demanda. En porcentaje.	NCOMPRA_RENDIMIENTO
7	Venta Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la mejor oferta. En porcentaje.	NVENTA_RENDIMIENTO
8	Último Precio	9(3)V9(4)	Precio de la última operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	NULT_PRECIO
9	Compra Precio	9(3)V9(4)	Precio de la mejor demanda. En porcentaje.	NCOMPRA_PRECIO
10	Venta Precio	9(3)V9(4)	Precio de la mejor oferta. En porcentaje.	NVENTA_PRECIO
11	Fecha Último	X(8)	Fecha de realización de la última operación válida (no anulada). Formato fecha ddmmaaaa.	DFEC_ULTIMO
12	Hora Último	X(6)	Hora de realización de la última operación válida (no anulada). Formato hora hhmss.	VHOR_ULTIMO
13	Penúltimo Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la penúltima operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	NPENU_RENDIMIENTO
14	Penúltimo Precio	9(3)V9(4)	Precio de la penúltima	NPENU_PRECIO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	
15	Fecha Penúltimo	X(8)	Fecha de realización de la penúltima operación válida (no anulada). Formato fecha ddmmaaaa.	DFEC_PENULTIMO
16	Hora Penúltimo	X(6)	Hora de realización de la penúltima operación válida (no anulada). Formato hora hhmmss.	VHOR_PENULTIMO
17	Variación Rendimiento	S9(3)V9(4)	Variación Rendimientos (Último Rendimiento menos Penúltimo Rendimiento). En porcentaje.	NVAR_RENDIMIENTO_P
18	Variación Precio Penúltimo	S9(3)V9(4)	Variación de Precios (Ultimo Precio menos Penúltimo Precio). En porcentaje.	NVAR_PRECIO_PENULT
19	Rendimiento Anterior	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la última operación válida (no anulada) que ha sido registrada en el Sistema al final de la sesión anterior. En porcentaje.	NREND_ANTERIOR
20	Precio Anterior	9(3)V9(4)	Precio de la última operación válida (no anulada) que ha sido registrada en el Sistema al final de la sesión anterior. En porcentaje.	NPRECIO_ANTERIOR
21	Fecha Anterior	X(8)	Fecha de la última operación válida (no anulada) que ha sido registrada en el Sistema al final de la sesión anterior. Formato fecha ddmmaaaa..	DFEC_ANTERIOR
22	Hora Anterior	X(6)	Hora de la última operación válida (no anulada) que ha sido registrada en el Sistema al final de la sesión anterior. Formato hora hhmmss.	VHOR_ANTERIOR
23	Variación Precio Anterior	S9(3)V9(4)	Variación de Precios (Ultimo Precio menos Precio Anterior). En porcentaje.	NVAR_PRECIO_ANT
24	Variación Rendimiento	S9(3)V9(4)	Variación Rendimientos (Último Rendimiento menos Rendimiento Anterior). En porcentaje.	NVAR_RENDIMIENTO_A
25	Total Monto Compra	9(15)	Monto nominal total correspondientes a las demandas ingresadas al mejor rendimiento o precio.	ITOT_MONTO_COMPRA
26	Total Monto Venta	9(15)	Monto nominal total correspondientes a las ofertas ingresadas al mejor rendimiento o precio.	ITOT_MONTO_VENTA
27	Rendimiento Apertura	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	NREND_APERTURA



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
28	Rendimiento Promedio	S9(3)V9(4)	Rendimiento promedio ponderado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NREND_PROMEDIO
29	Rendimiento Máximo	S9(3)V9(4)	Rendimiento más alto registrado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NREND_MAXIMO
30	Rendimiento Mínimo	S9(3)V9(4)	Rendimiento más bajo registrado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NREND_MINIMO
31	Precio Apertura	9(3)V9(4)	Precio de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.	NPRECIO_APERTURA
32	Precio Promedio	9(3)V9(4)	Precio Promedio Ponderado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NPRECIO_PROMEDIO
33	Precio Máximo	9(3)V9(4)	Precio más alto registrado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NPRECIO_MAXIMO
34	Precio Mínimo	9(3)V9(4)	Precio más bajo registrado de todas las operaciones válidas (no anuladas) de la sesión. En porcentaje.	NPRECIO_MINIMO
35	Intervalo máximo de rendimientos	9(3)V9(4)	Diferencial máximo de rendimientos permitido para el ingreso de propuestas de compra o de venta. En porcentaje.	NINT_MAX_RENDIMIENTOS
36	Interés Corrido	9(3)V9(4)	Interés corrido o devengado de la última operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje del valor nominal (Precio Sucio menos Precio Limpio).	NINTERES_CORRIDO
37	Monto Nominal Negociado	9(15)	Monto nominal total negociado durante la sesión del día para el instrumento de deuda pública del Campo N° 2 de esta tabla.	IMONT_NOM_NEGOCIADO
38	Número Operaciones Válidas	9(6)	Número total de operaciones válidas durante la sesión para el instrumento de deuda pública del Campo N° 2 de esta tabla.	INUM_OPERAC_VALIDA
39	Número Operaciones Anuladas	9(6)	Número total de las operaciones anuladas de la sesión para el instrumento de deuda pública del Campo N° 2 de esta tabla.	INUM_OPERAC_ANULADA

**2.6.5. OV_OPERACIONES_VALORES:**

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Operación	X(18)	Identificador único de la operación.	VID_OPERACION
2	Módulo	X(4)	NCNG-Negociación Continua Nivel General. NCNE-Negociación Continua Nivel Especial. REGI-Módulo de Registro.	VMODULO
3	Fecha Operación	X(8)	Muestra la fecha en que se ejecutó la operación en el Sistema. Para las operaciones en el Módulo de Registro será la fecha de confirmación de la operación. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_OPERACION
4	Hora Operación	X(6)	Muestra la hora en que se ejecutó la operación en el Sistema. Para las operaciones en el Módulo de Registro será hora de confirmación de la operación. Formato hora hhmmss.	VHOR_OPERACION
5	Número Operación	9(4)	Muestra el número de la operación asignada por el Sistema (Código DVP).	INUM_OPERACION
6	Código	X(12)	Código ISIN del instrumento de deuda pública.	VCODIGO
7	Valor	X(12)	Código mnemónico del instrumento de deuda pública.	VVALOR
8	Fecha Valor	X(8)	Fecha que se realizará la liquidación de la operación. Formato ddmmaaaa.	DFEC_VALOR
9	Días Valor	9(2)	Número de días hábiles posteriores hasta la liquidación de la operación.	IDIAS_VALOR
10	Tipo	X(1)	Indica si la postura que ha generado la operación es tipo: T-Postura Tomada u Oferta Agredida. P-Postura Pegada u Demanda Agredida. R-Operación de Registro.	V_TIPO
11	Estado	X(2)	OV-Operación válida. A1-Operación anulada por los participantes. A2-Operación con solicitud de anulación sin confirmar. A3-Operación anulada por el Sistema.	VESTADO
12	Monto Nominal	9(15)	Muestra el monto nominal	IMONT_NOM_OPERACION



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
	Operación		total de la operación.	
13	Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la operación.	NRENDIMIENTO
14	Precio	9(3)V9(4)	Precio de la operación. En porcentaje.	NPRECIO
15	Interés Corrido	9(3)V9(4)	Interés corrido o devengado de la operación. En porcentaje del valor nominal (Precio Sucio menos Precio Limpio).	NINT_CORRIDO
16	Tipo calce	X(3)	Tipo de calce de la operación: CTO-Calce Total. CPA-Calce Parcial. REG-Operación de Registro	VTIPO_CALCE
17	Comprador	X(3)	Código del Participante Comprador.	VCOMPRADOR
18	RUT Comprador	9(12)	RUT CAVALI del Participante Comprador.	IRUT_COMPRADOR
19	Vendedor	X(3)	Código del Participante Vendedor.	VVENDEDOR
20	RUT Vendedor	9(12)	RUT CAVALI del Participante Vendedor.	IRUT_VENDEDOR
21	Agresor	X(3)	Código del Participante Agresor. En caso sea operación del Módulo de Registro queda en blanco.	VAGRESOR
22	ID Postura Agredida	X(18)	ID de la postura agredida. Para las operaciones en el Módulo de Registro quedará en blanco.	VID_POST_AGREDIDA
23	Fecha Preingreso	X(8)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la fecha del preingreso de la operación. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_PREINGRESO
24	Hora Preingreso	X(6)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la hora del preingreso de la operación. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato hora hhmmss.	VHOR_PREINGRESO
25	Fecha Confirmación	X(8)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la fecha de la confirmación de la operación. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_CONFIRMACION
26	Hora Confirmación	X(6)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la hora de la confirmación de la operación. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato hora hhmmss.	VHOR_CONFIRMACION



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
27	Fecha Ejecución	X(8)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la fecha de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_EJECUCION
28	Hora Ejecución	X(6)	Si es una operación del Módulo de Registro se coloca la hora de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Caso contrario el campo queda en blanco. Formato hora hhmms.	VHOR_EJECUCION
29	Tipo Cuenta Compra	X(1)	Tipo de operación que involucra el participante comprador: P-Por cuenta Propia T-Por cuenta de Terceros	VTIPO_CTA_COMPRA
30	Tipo Cuenta Venta	X(1)	Tipo de operación que involucra el participante vendedor: P-Por cuenta Propia T-Por cuenta de Terceros	VTIPO_CTA_VENTA
31	Tipo Liquidador compra	X(1)	Indica quien será el participante directo liquidador en CAVALI del comprador: P-El mismo participante es el participante directo liquidador. O-Otra entidad es el participante directo liquidador.	V_TIPO_LIQ_COMPRA
32	Código Liquidador Compra	X(3)	Código del participante directo liquidador en CAVALI del comprador. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	ICODIGO_LIQ_COMPRA
33	Nombre Liquidador Compra	X(100)	Nombre completo del participante directo liquidador en CAVALI del comprador. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VNOMBRE_LIQ_COMPRA
34	Tipo Liquidador venta	X(1)	Indica quien será el participante directo liquidador en CAVALI del vendedor: P-El mismo participante es el participante directo liquidador. O-Otra entidad es el participante directo liquidador.	V_TIPO_LIQ_VENTA
35	Código Liquidador Venta	X(3)	Código del participante directo liquidador en CAVALI del vendedor. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	ICODIGO_LIQ_VENTA



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
36	Nombre Liquidador Venta	X(100)	Nombre completo o denominación del participante directo liquidador en CAVALI del vendedor. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VNOMBRE_LIQ_VENTA
37	Intereses devengados totales	9(12)	Monto total de los intereses devengados de la operación.	IINTERES_DEV_TOTALES
38	Valor efectivo total	9(15)	Monto total efectivo de la operación (Precio limpio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	IVALOR_EFECT_TOTAL
39	Desembolso total	9(15)	Monto total a desembolsar (Intereses devengados totales sumado al Valor efectivo total o Precio sucio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	ITOT_DESEMBOLSO

2.6.6. OP_OPERACIONES_PREINGRESADAS:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Preingreso	X(18)	Identificador único del preingreso.	VID_PREINGRESO
2	Fecha Preingreso	X(8)	Fecha del preingreso de la operación. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_PREINGRESO
3	Hora Preingreso	X(6)	Hora del preingreso de la operación. Formato hora hhmmss.	VHOR_PREINGRESO
4 ¹	Fecha Instrucción Tercero	X(8)	Fecha en que el participante recibió la instrucción de registrar la operación, en el caso de operaciones por cuenta de terceros. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_INSTRUCCION_TER
5 ¹	Hora Instrucción Tercero	X(6)	Hora en que el participante recibió la instrucción de registrar la operación, en el caso de operaciones por cuenta de terceros. Formato hora hhmmss.	VHOR_INSTRUCCION_TER
6	Código	X(12)	Código ISIN del instrumento de deuda pública.	VCODIGO

¹ Con respecto a esta información resulta de aplicación la Tercera Disposición Complementaria Transitoria de la Resolución SMV N° 026-2014-SMV/01 que establece lo siguiente: "La obligación de los participantes establecida en el artículo 24, numeral 24.6, referida a que el pre ingreso incluya fecha y hora de recibida la instrucción de registrar una operación, será exigible a partir del 01 de abril de 2015."



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
7	Valor	X(12)	Código mnemónico del instrumento de deuda pública.	VVALOR
8	Fecha Valor	X(8)	Fecha que se realizará la liquidación de la operación. Formato ddmmaaaa.	DFEC_VALOR
9	Días Valor	9(2)	Número de días hábiles posteriores hasta la liquidación de la operación.	IDIAS_VALOR
10	Estado	X(1)	C-Confirmada. P-Pendiente de Confirmación. R-Rechazada por la Contraparte. E-Expirada.	VESTADO
11	Monto Nominal Operación	9(15)	Monto nominal total de la operación.	IMONT_NOM_OPERACION
12	Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la operación.	NRENDIMIENTO
13	Precio	9(3)V9(4)	Precio de la operación. En porcentaje.	NPRECIO
14	Interés Corrido	9(3)V9(4)	Interés corrido o devengado de la operación. En porcentaje del valor nominal (Precio Sucio menos Precio Limpio).	NINTERES_CORRIDO
15	Participante	X(3)	Código del Participante que preingresa la operación.	VPARTICIPANTE
16	RUT Participante	9(12)	RUT CAVALI del Participante que preingresa la operación.	VRUT_PARTICIPANTE
17	Fecha Ejecución	X(8)	Fecha de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_EJECUCION
18	Hora Ejecución	X(6)	Hora de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Formato hora hhmmss.	VHOR_EJECUCION
19	Tipo Cuenta	X(1)	Tipo de operación que involucra el participante que hizo el preingreso: P-Por cuenta Propia T-Por cuenta de Terceros	VTIPO_CUENTA
20	Tipo Liquidador	X(1)	Indica quien será el participante directo liquidador en CAVALI del participante que realizó el preingreso. P-El mismo participante es el participante directo liquidador. O-Otra entidad es el	VTIPO_LIQUIDADOR



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			participante directo liquidador.	
21	Código Liquidador	X(3)	Código del participante directo liquidador en CAVALI del participante que realiza el preingreso de la operación. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VCOD_LIQUIDADOR
22	Nombre Liquidador	X(100)	Nombre completo del participante directo liquidador en CAVALI del participante que realiza el preingreso de la operación. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VNOM_LIQUIDADOR
23	Intereses devengados totales	9(12)	Monto total de los intereses devengados de la operación.	ITOT_INTERES_DEVENG
24	Valor efectivo total	9(15)	Monto total efectivo de la operación (Precio limpio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	ITOT_VALOR_EFECTIVO
25	Desembolso total	9(15)	Monto total a desembolsar (Intereses devengados totales sumado al Valor efectivo total o Precio sucio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	ITOT_DESEMBOLSO

2.6.7. OC_OPERACIONES_CONFIRMADAS:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Operación Confirmada	X(18)	Identificador único de la operación confirmada.	VID_OPER_CONFIRMADA
2	ID Preingreso	X(18)	Identificador único del preingreso que originó la operación.	VID_PREINGRESO
3	Fecha Confirmación	X(8)	Fecha de confirmación de la operación en caso haya sido confirmada la operación. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_CONFIRMACION
4	Hora Confirmación	X(6)	Hora de confirmación de la operación en caso haya sido confirmada la operación. Formato hora hhmss.	VHOR_CONFIRMACION
5	Fecha Preingreso	X(8)	Fecha del preingreso de la operación. Formato día ddmmaaaa. Formato hora	DFEC_PREINGRESO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			hhmmss.	
6	Hora Preingreso	X(6)	Hora del preingreso de la operación. Formato hora hhmmss.	VHOR_PREINGRESO
7	Número Operación	9(4)	Número de la operación asignada por el Sistema (Código DVP).	INUM_OPERACION
8	Código	X(12)	Código ISIN del instrumento de deuda pública.	VCODIGO
9	Valor	X(12)	Código mnemónico del instrumento de deuda pública.	VVALOR
10	Fecha Valor	X(8)	Fecha que se realizará la liquidación de la operación. Formato ddmmaaaa.	DFEC_VALOR
11	Días Valor	9(4)	Número de días hábiles posteriores hasta la liquidación de la operación.	IDIAS_VALOR
12	Monto Nominal Operación	9(15)	Monto nominal total de la operación.	IMONT_NOM_OPERACION
13	Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la operación.	NRENDIMIENTO
14	Precio	9(3)V9(4)	Precio de la operación. En porcentaje.	NPRECIO
15	Interés Corrido	9(3)V9(4)	Interés corrido o devengado de la operación. En porcentaje del valor nominal (Precio Sucio menos Precio Limpio).	NINTERES_CORRIDO
16	Participante	X(3)	Código interno del Participante que confirma la operación.	VPARTICIPANTE
17	RUT Participante	9(12)	RUT CAVALI del Participante que confirma la operación.	VRUT_PARTICIPANTE
18	Fecha Ejecución	X(8)	Fecha de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_EJECUCION
19	Hora Ejecución	X(6)	Hora de la ejecución de la operación fuera del MCN que se indicó en el preingreso. Formato hora hhmmss.	VHOR_EJECUCION
20	Tipo Cuenta	X(1)	Tipo de operación que involucra el participante que hizo la confirmación: P-Por cuenta Propia T-Por cuenta de Terceros	VTIPO_CUENTA
21	Tipo Liquidador	X(1)	Indica quien será el participante directo liquidador en CAVALI del participante que confirmó la	VTIPO_LIQUIDADOR



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			operación. P-El mismo participante es el participante directo liquidador. O-Otra entidad es el participante directo liquidador.	
22	Código Liquidador	X(3)	Código del participante directo liquidador en CAVALI del participante que confirma la operación. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VCOD_LIQUID_COMPRA
23	Nombre Liquidador	X(100)	Nombre completo del participante directo liquidador en CAVALI del participante que confirma la operación. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VNOM_LIQUID_COMPRA
24	Intereses devengados totales	9(12)	Monto total de los intereses devengados de la operación.	ITOT_INTERES_DEVENG
25	Valor efectivo total	9(15)	Monto total efectivo de la operación (Precio limpio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	ITOT_VALOR_EFECTIVO
26	Desembolso total	9(15)	Monto total a desembolsar (Intereses devengados totales sumado al Valor efectivo total o Precio sucio multiplicado por el Monto nominal de la operación)	ITOT_DESEMBOLSO

2.6.8. OA_OPERACIONES_ANULADAS:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Operación	X(18)	Identificador único de la operación.	VID_OPERACION
2	ID Anulación	X(18)	Identificador único de la anulación.	VID_ANULACION
3	Número Operación	9(6)	Muestra el número de la operación asignada por el Sistema. (Código DVP).	INUM_OPERACION
4	Módulo	X(4)	NCNG-Negociación Continua Nivel General NCNE-Negociación Continua Nivel Especial REGI-Módulo de Registro	VMODULO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
5	Fecha Anulación	X(8)	Fecha de la eliminación realizada por el Sistema. Formato día ddmmaaaa. En caso sea una operación anulada por los participantes el campo queda en blanco.	DFEC_ANULACION
6	Hora Anulación	X(6)	Hora de la eliminación realizada por el Sistema. Formato hora hhmmss. En caso sea una operación anulada por los participantes el campo queda en blanco.	VHOR_ANULACION
7	Fecha Solicitud	X(8)	Fecha del ingreso de la solicitud de anulación. F Si es una operación eliminada por el sistema queda en blanco. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_SOLICITUD
8	Hora Solicitud	X(6)	Hora del ingreso de la solicitud de anulación. Si es una operación eliminada por el sistema queda en blanco. Formato hora hhmmss.	VHOR_SOLICITUD
9	Fecha Aceptación	X(8)	Fecha del ingreso de la aceptación de anulación. Si es una operación eliminada por el sistema queda en blanco. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_ACEPTACION
10	Hora Aceptación	X(6)	Hora del ingreso de la aceptación de anulación. Si es una operación eliminada por el sistema queda en blanco. Formato hora hhmmss.	VHOR_ACEPTACION
11	Código	X(12)	Código ISIN del valor representativo de deuda.	VCODIGO
12	Valor	X(12)	Código nemónico del instrumento del tesoro.	VVALOR
13	Tipo Anulación	X(2)	A1-Solicitada por los participantes. A2-Eliminada por el Sistema.	VTIPO_ANULACION
14	Estado	X(2)	AS-Solicitud de anulación ingresada a la espera de confirmación. AC-Solicitud de anulación confirmada. AR-Solicitud de anulación rechazada. A2- Operación anulada por el Sistema.	VESTADO
15	Participante solicita anulación.	X(3)	Si el valor para el campo "Tipo Anulacion" es "A1" indica el Código del participante que solicita la cancelación de la operación. Caso contrario queda en blanco.	VPARTIC_SOLIC_ANULA



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
16	Participante confirma anulación.	X(3)	Si el valor para el campo "Tipo Anulacion" es "A1" indica el Código del participante que acepta la cancelación de la operación. Caso contrario queda en blanco.	VPARTIC_CONF_ANULA
17	Operador solicita anulación.	X(12)	Si el valor para el campo "Tipo Anulacion" es "A1" indica el Código del operador que solicita la cancelación de la operación. Caso contrario queda en blanco. Caso contrario queda en blanco.	VOPERA_SOLIC_ANULA
18	Operador confirma anulación.	X(12)	Si el valor para el campo "Tipo Anulacion" es "A1" indica el Código del operador que acepta la cancelación de la operación. Caso contrario queda en blanco.	VOPERA_CONF_ANULA

2.6.9. PI_POSTURAS_INGRESADAS:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Postura	X(18)	Identificador único de la Postura.	VID_POSTURA
2	Fecha Postura	X(8)	Fecha en que se ingresó la Postura al Sistema.	DFEC_POSTURA
3	Hora Postura	X(6)	Hora en que se ingresó la Postura al Sistema.	VHOR_POSTURA
4	Módulo	X(4)	NCNG-Negociación Continua Nivel General. NCNE-Negociación Continua Nivel Especial.	VMODULO
5	Código	X(12)	Código ISIN del valor representativo de deuda.	VCODIGO
6	Valor	X(20)	Código Mnemónico del valor representativo de deuda.	VVALOR
7	Clase Postura	X(1)	D-Demanda. O-Oferta.	VCLASE_POSTURA
8	Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la postura.	NRENDIMIENTO
9	Precio	9(3)V9(4)	Precio de la Postura.	NPRECIO
10	Cantidad Valores	9(12)	Cantidad de valores de la postura.	ICANT_VALORES
11	Monto Postura	9(15)	Monto nominal total de la postura.	IMONT_POSTURA
12	Fecha Valor	X(8)	Fecha que se realizará la liquidación de la operación. Formato ddmmaaaa.	DFEC_VALOR



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
13	Días Valor	9(3)	Número de días hábiles posteriores hasta la liquidación de la operación.	IDIAS_VALOR
14	Interés Corrido	9(3)V9(4)	Interés corrido o devengado de la postura. En porcentaje del valor nominal (Precio Sucio menos Precio Limpio).	NINTERES_CORRIDO
15	Estado1	X(2)	VV-Vigente. ET-Ejecutada Total. EP-Ejecutada Parcial. RP-Retirada por el participante. RM-Retirada por modificación. MM-Modificada por el participante. (Si la postura es retirada al final de la sesión de manera automática por el Sistema queda con su último estado)	VESTADO
16	Intereses devengados totales	9(12)	Monto total de los intereses devengados de la postura.	ITOT_INTERES_DEVENG
17	Valor efectivo total	9(15)	Monto total efectivo de la postura (Precio limpio multiplicado por el Monto Postura)	ITOT_VALOR_EFECTIVO
18	Desembolso total	9(15)	Monto total a desembolsar (Intereses devengados totales sumado al Valor efectivo total o Precio sucio multiplicado por el Monto Postura)	ITOT_DESEMBOLSO
19	Plazo real por vencer	9(5)	Número exacto de días entre la fecha de vencimiento del valor y la fecha de liquidación de la operación (fecha valor).	IPLAZO_REAL_VENCER
20	Días transcurridos	9(5)	Total de días transcurridos entre la fecha de pago del último cupón del valor y la fecha de liquidación de la operación.	IDIAS_TRANSCURRIDOS
21	Participante	X(3)	Código del participante que ingreso la postura.	VPARTICIPANTE
22	RUT Participante	9(12)	RUT CAVALI del participante que ingresó la postura.	VRUT_PARTICIPANTE
23	Operador	X(12)	Código del operador que ingresó la postura.	VOPERADOR
24	Hora Retiro	X(6)	En caso sea una postura retirada, valor del campo "Estado1" igual a "RP" o "RM" se indica la Hora en que se retiró la postura del	VHOR_RETIRO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			libro de oferta y demanda. Formato hora hhmmss. Caso contrario queda en blanco.	
25	Operador Retira	X(12)	En caso sea una postura retirada, valor del campo "Estado1" igual a "RP" o "RM" se indica el Código del operador que retiró la postura. Caso contrario queda en blanco.	VOPERAD_RETIRA
26	Tipo Operación	X(1)	Tipo de operación que involucra la postura: P-Por cuenta Propia T-Por cuenta de Terceros	VTIPO_OPERADOR
27	Tipo Liquidador	X(1)	Indica quien será el agente liquidador en CAVALI del participante: P-El mismo participante es el participante directo liquidador. O-Otra entidad es el participante directo liquidador.	VTIPO_LIQUIDADOR
28	Código Liquidador	X(3)	Código del participante directo liquidador en CAVALI. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VCOD_LIQUIDADOR
29	Nombre Liquidador	X(100)	Nombre del participante directo liquidador en CAVALI. En caso sea el mismo participante queda en blanco.	VNOM_LIQUIDADOR

2.6.10. PV_POSTURAS_VIGENTES:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	ID Postura	X(18)	Identificador único de la Postura.	VID_POSTURA
2	Fecha Postura	X(8)	Fecha en que se ingresó la Postura al Sistema. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_POSTURA
3	Hora Postura	X(6)	Hora en que se ingresó la Postura al Sistema. Formato hora hhmmss.	VHOR_POSTURA
4	Módulo	X(4)	NCNG-Negociación Continua Nivel General. NCNE-Negociación Continua Nivel Especial.	VMODULO
5	Clase Postura	X(1)	D-Demanda. O-Oferta.	VCLAS_POSTURA



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
6	Código	X(12)	Código ISIN del valor representativo de deuda.	VCODIGO
7	Valor	X(12)	Código nemónico del valor representativo de deuda.	VVALOR
8	Monto Postura	9(15)	Monto nominal total ingresado originalmente en la postura.	VMONT_POSTURA
9	Monto Aplicado	9(15)	Monto nominal aplicado si es que la postura tuvo una operación de calce parcial.	VMONT_APLICADO
10	Monto Vigente	9(15)	Monto nominal vigente (Monto Postura menos Monto Aplicado).	VMONT_VIGENTE
11	Agresión	X(2)	Tipo de postura: AG-Postura agredida en caso haya tenido un calce parcial. NA-Postura no agredida.	VAGRESION
12	Precio	9(3)V9(4)	Precio de la postura.	NPRECIO
13	Rendimiento	S9(3)V9(4)	Rendimiento de la postura	NRENDIMIENTO
14	Participante	X(3)	Código del participante que ingresó la postura al mercado	VPARTICIPANTE
15	Operador	X(12)	Código del operador que ingresó la postura.	VOPERADOR

2.6.11. PM_PARTICIPANTES_MCN:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Código Participante	X(3)	Código del participante asignado por el Sistema.	VCOD_PARTICIPANTE
2	Fecha Inscripción	X(8)	Fecha de inscripción del participante. En formato ddmmaaaa.	DFEC_INSCRIPCION
3	RUT	9(12)	Registro Único de Titulares de CAVALI del participante.	VRUT
4	Nombre Participante	X(100)	Nombre completo del participante en caso sea una persona natural. Denominación o Razón Social en caso sea persona jurídica. Si es un Patrimonio Autónomo se consignará la Denominación o Razón Social de la persona jurídica que lo administra, seguido de la denominación del patrimonio o beneficiario y de las iniciales "PA".	VNOM_PARTICIPANTE



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
5	Creador de Mercado	X(1)	S-Si es creador de mercado. N-No es creador de mercado.	VCREADOR_MERCADO
6	Residencia	X(1)	R-Residente N-No Residente	VRESIDENCIA
7	Domicilio	X(100)	Domicilio completo del Participante.	VDOMICILIO
8	País	X(3)	Los códigos de los países se encuentran publicados en el Portal de la SMV: www.smv.gob.pe en la opción "Envío de Información".	VPAIS
9	Tipo de Persona	X(1)	N-Persona Natural J-Persona Jurídica	VTIPO_PERSONA
10	Clase de Entidad	X(2)	ES-Entidad de Seguros. EI-Entidad de Inversión. EV-Entidad de Valores. EC-Entidad de Crédito. OT-Otra Entidad.	VCLAS_ENTIDAD
11	Liquidador	X(1)	S-Si es participante directo liquidador en CAVALI. N-No es participante directo liquidador en CAVALI.	VLIQUIDADADOR
12	Teléfono	X(10)	Número telefónico	VTELEFONO
13	Tipo Postura	X(1)	Tipo de postura que puede ingresar el participante en las subastas: C-Propuesta competitiva. N-Propuesta no competitiva.	VTIPO_POSTURA
14	Tipo Operación	X(1)	Tipo de operación que puede realizar el participante en las sesiones de negociación: P-Por cuenta propia. T-Por cuenta propia y de Terceros.	VTIPO_OPERACION
15	Fecha Actualización	X(8)	Fecha de la última actualización del Registro del Participante. En formato ddmmaaaa.	DFEC_ACTUALIZACION
16	Representante Legal	X(100)	Nombre completo del Representante Legal del participante en caso sea una persona natural. Denominación o Razón Social del Representante Legal en caso sea persona jurídica.	VREPRES_LEGAL
17	Estado	X(1)	Estado del participante en el Sistema: A-Participante Activo. I-Participante Inactivo.	VESTADO

**2.6.12. OM_OPERADORES_MCN:**

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Código Participante	X(3)	Código del participante asignado por el Sistema.	VCOD_PARTICIPANTE
2	Código Operador	X(12)	Código de Usuario asignado por el Sistema.	VCOD_OPERADOR
3	Nombre	X(100)	Nombre completo del operador.	VNOMBRE
4	Identificador Unico de Persona	X(14)	Identificador del cliente para lo que se utilizará el identificador único de persona (Ver Anexo 3).	VID_UNICO_PERSONA
5	Transacciones	X(1)	S-Si puede realizar transacciones. N-No puede realizar transacciones.	VTRANSACCIONES
6	Consultas	X(1)	S-Si puede hacer consultas sobre el mercado o las estadísticas. N- No puede hacer consultas sobre el mercado o las estadísticas.	VCONSULTA
7	Registro	X(1)	S-Si puede registra operaciones celebradas fuera del MCN. N- Si puede registra operaciones celebradas fuera del MCN.	VREGISTRO
8	Nivel Operador	X(1)	Describe el tipo de actividad que realizara el operador: P-Operador participante O-Operador observador	VNIVEL_OPERADOR
9	Estado Operador	X(1)	I-Operador Activo. R-Operador Retirado.	VEST_OPERADOR
10	Fecha Actualización	X(8)	Fecha de la última actualización del Registro del Operador. En formato ddmmaaaa.	DFEC_ACTUALIZACION

2.6.13. LV_LISTA_VALORES:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Código	X(12)	Código ISIN del valor.	VCODIGO
2	Valor	X(20)	Código nemónico del valor.	VVALOR
3	Estado	X(1)	Privilegio de negociación de los valores: A- Activo: Es permitida	VESTADO



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
			<p>la negociación del valor según la fase de negociación.</p> <p>S- Suspendido: No es permitido el ingreso de posturas. De existir posturas ingresadas éstas mantendrán pendientes el Sistema.</p> <p>I- Inactivo: No es permitido el ingreso de posturas. De ingresar posturas, éstas serán retiradas automáticamente por el Sistema.</p>	
4	Emisor	X(3)	MEF - República del Perú. OTR – Otro.	VEMISOR
5	Tasa de interés	9(3)V9(4)	Tasa anual de interés del valor. En porcentaje.	NTASA_INTERES
6	Tipo Tasa	X(1)	E-Efectiva. N-Nominal.	VTIPO_TASA
7	Tipo Interés	X(1)	F-Fijo V-Variable	VTIPO_INTERES
8	Periodo Pago	X(2)	1-Un cupón (anual) 2-Dos cupones por año (semestral) 4-Cuatro cupones por año (trimestral) 12-Doce cupones por año (mensual)	VPERIODO_PAGO
9	Moneda	X(4)	Monedas en que ha sido emitido el valor: PEN-Nuevos Soles USD-Dólares Americanos. EUR-Euros. OTR-Otro.	VMONEDA
10	Valor Nominal	9(9)	Valor nominal unitario del instrumento.	IVAL_NOMINAL
11	Cantidad Circulación	9(12)	Cantidad de valores en circulación.	ICANT_CIRCULACION
12	Valor Nominal Total	9(15)	Monto nominal total colocado.	ITOT_VAL_NOMINAL
13	VAC	X(3)	VAC-Valor Adquisitivo Constante. NNN-No reajutable.	VVAC
14	Base numerador	X(3)	-360 -365 -ACT (Actual)	VBASE_NUMERADOR
15	Base denominador	X(3)	-360 -365 -ACT (Actual)	VBASE_DENOMINADOR



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
16	Fecha de Vencimiento	X(8)	Fecha de vencimiento del valor. Formato ddmmaaaa	DFEC_VENCIMIENTO
17	Fecha Emisión	X(8)	Fecha de emisión del valor. Formato ddmmaaaa	DFEC_EMISION
18	Último Cupón Pagado	X(8)	Fecha del último cupón pagado. Formato ddmmaaaa.	DULT_CUP_PAGADO
19	Próximo Cupón a Pagar	X(8)	Fecha del próximo cupón a pagar. Formato ddmmaaaa	DPROX_CUP_PAGAR
20	Plazo Total	9(5)	Número de días totales de vigencia del valor desde su fecha de emisión.	ITOT_PLAZO
21	Opción de Segregabilidad	X(1)	S-Si N-No	VOPC_SEGREGABILIDAD
22	Opción Rescate	X(1)	S-Si N-No	VOPC_RESCATE
23	Intervalo máximo de rendimientos	9(3)V9(4)	Diferencial máximo de rendimientos permitido para el ingreso de propuestas de compra o de venta en el Nivel General del Módulo de Negociación Continua. En porcentaje.	NINT_MAX_RENDIMIENTOS
24	Fecha Actualización	X(8)	Fecha de la última actualización del Registro del Valor. En formato ddmmaaaa	DFEC_ACTUALIZACION

2.6.14. CP_CRONOGRAMA_PAGOS:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Código	X(12)	Código ISIN del valor.	VCODIGO
2	Valor	X(20)	Código nemónico del valor.	VVALOR
3	Vencimiento	X(8)	Fecha de vencimiento del valor. Formato ddmmaaaa.	DVENCIMIENTO
4	Num Cupón	9(6)	Número del cupón	INUM_CUPON
5	Fecha Vencimiento	X(8)	Fecha de vencimiento del cupón. Formato ddmmaaaa.	DFEC_VENCIMIENTO
6	Día Vencimiento	X(10)	Día de la semana de vencimiento del cupón (Ejemplo: Lunes)	VDIA_VENCIMIENTO
7	Fecha de Pago	X(8)	Fecha de pago del cupón. Formato ddmmaaaa.	DFEC_PAGO
8	Día Pago	X(10)	Día de la semana de pago del cupón (Ejemplo: Lunes)	VDIA_PAGO
9	Interés	9(3)V9(4)	Interés. En porcentaje.	IMONT_INTERES
10	Amortización	9(3)V9(4)	Amortización en caso se establezca en las características del valor. En porcentaje.	IMONT_AMORTIZACION



N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
11	Redención del principal	9(3)V9(4)	Redención del principal. En porcentaje.	IMONT_REDENCION

2.6.15. MM_MENSAJES_MCN:

N°	Descripción del Campo	Tipo / Long Máx	Detalle / Validación	Etiqueta XML
0	Tipo de registro	X(1)	Debe ser 'D'	VTIPO_REGISTRO
1	Número Mensaje	X(12)	Número del mensaje asignado por el Sistema.	VNUM_MENSAJE
2	Fecha Mensaje	X(8)	Fecha en que se envió el mensaje en el Sistema. Formato día ddmmaaaa.	DFEC_MENSAJE
3	Hora Mensaje	X(6)	Hora en que se envió el mensaje en el Sistema. Formato hora hhmmss.	VHOR_MENSAJE
4	Remitente Participante	X(12)	Código del participante que remitió el mensaje.	VREMIT_PARTICIPANTE
5	Remitente Operador	X(12)	Código del operador que remitió el mensaje.	VREMIT_OPERADOR
6	Destinatario Participante	X(12)	Código del participante que recibió el mensaje.	VDEST_PARTICIPANTE
7	Destinatario Operador	X(12)	Código del operador que recibió el mensaje.	VDEST_OPERADOR
8	Detalle Mensaje	X(500)	Texto del mensaje.	VDET_MENSAJE

2.10.3. COTIZACIONES DEL DÍA:

N°	Nombre de la Columna	Descripción
1	Módulo	Módulo de Negociación: - Nivel General. - Nivel Especial. - Registro.
2	Valor	Nemónico del Valor
3	Rendimiento compra	Rendimiento de la mejor propuesta de compra. En formato de porcentaje con cuatro decimales. No aplica para el Módulo de Registro.
4	Rendimiento venta	Rendimiento de la mejor propuesta de venta. En formato de porcentaje con cuatro decimales. No aplica para el Módulo de Registro.
5	Rendimiento mínimo	Rendimiento mínimo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
6	Rendimiento máximo	Rendimiento máximo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
7	Rendimiento promedio	Rendimiento promedio ponderado de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
8	Rendimiento último	Rendimiento de la última operación de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
9	Precio compra	Precio de la mejor propuesta de compra. En formato de porcentaje con cuatro decimales. No aplica para el Módulo de Registro.



Nº	Nombre de la Columna	Descripción
10	Precio venta	Precio de la mejor propuesta de venta. En formato de porcentaje con cuatro decimales. No aplica para el Módulo de Registro.
11	Precio mínimo	Precio mínimo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
12	Precio máximo	Precio máximo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
13	Precio promedio	Precio promedio ponderado de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
14	Precio último	Precio de la última operación de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
15	Rendimiento Apertura	Rendimiento de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.
16	Precio Apertura	Precio de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.

2.10.5. COTIZACIONES HISTÓRICAS:

Nº	Nombre de la Columna	Descripción
1	Módulo	Módulo de Negociación: - Nivel General. - Nivel Especial. - Registro.
2	Valor	Nemónico del Valor
4	Fecha	Fecha de la sesión. Formato dd/mm/aaaa.
5	Monto nominal	Monto nominal total negociado. En Nuevos Soles.
6	Monto efectivo	Monto total efectivo negociado. En Nuevos Soles.
7	Operaciones	Número total de operaciones.
8	Rendimiento mínimo	Rendimiento mínimo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
9	Rendimiento máximo	Rendimiento máximo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
10	Rendimiento promedio	Rendimiento promedio ponderado de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
11	Rendimiento último	Rendimiento de la última operación de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
12	Precio mínimo	Precio mínimo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
13	Precio máximo	Precio máximo de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
14	Precio promedio	Precio promedio ponderado de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
15	Precio último	Precio de la última operación de la sesión. En formato de porcentaje con cuatro decimales.
16	Rendimiento Apertura	Rendimiento de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.
17	Precio Apertura	Precio de la primera operación válida (no anulada) de la sesión. En porcentaje.



Anexo 02: FORMATOS

3. COTIZACIONES_DÍA

DETALLE DE LAS COTIZACIONES DEL DÍA

Módulo de Negociación Continua Nivel General

Table with columns for Valor, Rendimiento Efectivo Anual (Posturas, Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último), and Precio Limpio (Posturas, Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último).

Módulo de Negociación Continua Nivel Especial

Table with columns for Valor, Rendimiento Efectivo Anual (Posturas, Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último), and Precio Limpio (Posturas, Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último).

Módulo de Registro

Table with columns for Valor, Rendimiento Efectivo Anual (Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último), and Precio Limpio (Apertura, Mínimo, Máximo, Promedio, Último).

5. COTIZACIONES_HISTÓRICAS

INFORMACIÓN HISTÓRICA DE LAS COTIZACIONES

Módulo de Negociación Continua Nivel General

Table with columns for Valor, Fecha, Monto nominal, Monto efectivo, Oper, Rendimiento Efectivo Anual, and Precio Limpio.

Módulo de Negociación Continua Nivel Especial

Table with columns for Valor, Fecha, Monto nominal, Monto efectivo, Oper, Rendimiento Efectivo Anual, and Precio Limpio.

Módulo de Registro

Table with columns for Valor, Fecha, Monto nominal, Monto efectivo, Oper, Rendimiento Efectivo Anual, and Precio Limpio.

ANEXO II

Eliminar los siguientes campos de las tablas del “Manual de Especificaciones sobre la Negociación de Valores de Deuda Pública”

Tabla	Campo	Descripción
2.6.2. PS_PROPUESTAS_SUBASTA	Campo 15	Código Tercero
	Campo 16	Denominación Tercero
2.6.5. OV_OPERACIONES_VALORES	Campo 28	Código Tercero Compra
	Campo 29	Nombre Tercero Compra
	Campo 31	Código Tercero Venta
	Campo 32	Nombre Tercero Venta
2.6.6. OP_OPERACIONES_PREINGRESADAS	Campo 18	Código Tercero
	Campo 19	Nombre Tercero
2.6.7. OC_OPERACIONES_CONFIRMADAS	Campo 19	Código Tercero
	Campo 20	Nombre Tercero
2.6.9. PI_POSTURAS_INGRESADAS	Campo 29	Código Tercero
	Campo 30	Nombre Tercero

Firmado por: SUAREZ AVELINO Olga Dina (FAU20131016)
Razón:
Fecha: 28/11/2014 10:43:36 a.m.

Firma requerida:
Ingrese el nombre de la persona

Firmado por: DOMINGUEZ PRADO Antonio Percy (FAU20
Razón: