

PARTE 3  
INFORMACIÓN FINANCIERA Y ESQUEMAS DE REPORTE

CAPÍTULO 5  
INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS Y PRODUCTOS ESTRUCTURADOS

ANEXO 4  
FICHA TÉCNICA DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS DE CRÉDITO Y PRODUCTOS ESTRUCTURADOS QUE INVOLUCREN DERIVADOS DE CRÉDITO

A. Datos básicos de la entidad

1. Fecha diligenciamiento de la Ficha Técnica en formato DD/MM/AAAA

2. Tipo Entidad

3. Código Entidad

4. Tipo Patrimonio

5. Código Patrimonio

6. Nombre de la entidad o patrimonio

7. Nombre del responsable del diligenciamiento

8. Cargo

9. Teléfono de contacto

B. Descripción del instrumento financiero derivado de crédito o del producto estructurado

10. Nombre

11. Diligenciar con X:

Instrumento financiero derivado de crédito

Producto estructurado que involucre derivados de crédito

12. Subyacente(s)

Nominal del subyacente

Divisa del subyacente

13. Contraparte del instrumento financiero derivado de crédito o clientes potenciales del producto estructurado

14. Eventos de crédito asociados al instrumento financiero derivado o al producto estructurado

15. Monto cubierto en caso de ocurrencia del evento de crédito asociado al instrumento financiero.

16. Forma de pago en el caso de ocurrencia del evento de crédito.

17. Otras características relevantes del instrumento financiero derivado de crédito o del producto estructurado

C. Finalidad de la operación con instrumentos financieros derivados

18. Finalidad de la operación para la entidad (Diligenciar con X)\*

Negociación o inversión

Cobertura

Cobertura de valor razonable

Cobertura de flujos de efectivo

Cobertura de una inversión neta de un negocio en el extranjero

\* Si respuesta a este numeral fue "Negociación o inversión", favor seguir con el numeral 21 del presente anexo.

19. Partida(s) cubierta(s) con instrumentos financieros derivados

20. Riesgo(s) específico(s) a cubrir con la operación con instrumentos financieros derivados

D. Características de valoración

21. Identificación de los componentes en los cuales se pueda desagregar el producto estructurado (cuándo éste sea separable)

a.

b.

c.

22. Diligenciar el código asignado al proveedor de precios, según el instructivo del Formato 351 "Composición del portafolio de inversiones", designado como oficial para valoración por la entidad vigilada.

Fin de la Ficha Técnica.

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

A. Datos básicos de la entidad

1. Fecha diligenciamiento de la Ficha Técnica en formato DD/MM/AAAA

2. Tipo Entidad

3. Código Entidad

4. Tipo Patrimonio

5. Código Patrimonio

6. Nombre de la entidad o patrimonio

7. Nombre del responsable del diligenciamiento

8. Cargo

9. Teléfono de contacto

B. Descripción del instrumento financiero derivado de crédito o del producto estructurado

10. Nombre

11. Diligenciar con X:

Instrumento financiero derivado de crédito

Producto estructurado que involucre derivados de crédito

12. Subyacente(s)

Nominal del subyacente

Divisa del subyacente

13. Contraparte del instrumento financiero derivado de crédito o clientes potenciales del producto estructurado

14. Eventos de crédito asociados al instrumento financiero derivado o al producto estructurado

15. Monto cubierto en caso de ocurrencia del evento de crédito asociado al instrumento financiero.

16. Forma de pago en el caso de ocurrencia del evento de crédito.

17. Otras características relevantes del instrumento financiero derivado de crédito o del producto estructurado

C. Finalidad de la operación con instrumentos financieros derivados

18. Finalidad de la operación para la entidad (Diligenciar con X)\*

Negociación o inversión

Cobertura

Cobertura de valor razonable

Cobertura de flujos de efectivo

Cobertura de una inversión neta de un negocio en el extranjero

\* Si respuesta a este numeral fue "Negociación o inversión", favor seguir con el numeral 21 del presente anexo.

19. Partida(s) cubierta(s) con instrumentos financieros derivados

20. Riesgo(s) específico(s) a cubrir con la operación con instrumentos financieros derivados

D. Características de valoración

21. Identificación de los componentes en los cuales se pueda desagregar el producto estructurado (cuándo éste sea separable)

a.

b.

c.

22. Diligenciar el código asignado al proveedor de precios, según el instructivo del Formato 351 "Composición del portafolio de inversiones", designado como oficial para valoración por la entidad vigilada.