



# **Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas “Set-FX”**

Instructivo – Módulo Posición y  
Ganancia

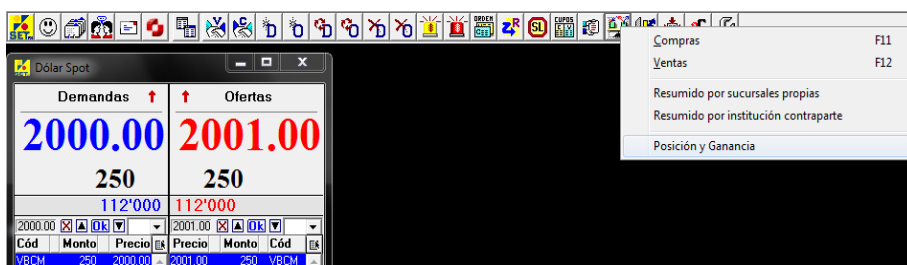
Mayo de 2014

## Introducción


El presente instructivo tiene como objetivo explicar en detalle a los usuarios del sistema SET-FX el funcionamiento del modulo Posición y Ganancia, el cual permite calcular en línea la posición tanto de cada operador así como de la sucursal y de la entidad (según el perfil que se determine).









### 1. Acceso al módulo Posición y Ganancia

El módulo de Posición y Ganancia está activo para el mercado Spot USD/COP. Para tener acceso a este se debe ingresar al mercado Spot y en el botón "Transacciones y Posición" se debe ingresar a la opción: "Posición y Ganancia" como lo muestra la siguiente gráfica:



Una vez se ingresa a esta opción, aparece la siguiente ventana con el Módulo de Posición y Ganancia.

 **Dólar Spot - Posición y Ganancia**

Usuario	Posición (USD)		Utilidad (COP)			Total
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	
SANTIAGO	-500,000	1908.04	1908.56		-260,000	-260,000

### 2. Descripción ventana posición y ganancia

The screenshot shows a window titled 'Dólar Spot - Posición y Ganancia'. It contains a table with the following data:

	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
JIMMY	-250,000	2000.15	2003.10	-5'225,000	-737,500	-5'962,500
CALI	-250,000	2000.15	2003.10	-5'225,000	-737,500	-5'962,500

Arrows point from the following labels to the corresponding columns in the table:

- Posición (points to Largo/Corto)
- Precio Promedio Posición (points to Promedio)
- Ultimo Precio Spot (points to Ult. Precio)
- Utilidad por Intermediación (points to Intermediación)
- Utilidad por Posición (points to Posición)
- Utilidad Total (points to Total)

A continuación se detallan cada una de las partes que componen el módulo de Posición y Ganancia así como su funcionalidad:

### **Posición**

**Largo/Corto:** Es la diferencia en dólares, entre la suma de las compras y la suma de las ventas. Si la suma de las compras es mayor, se muestra en azul '**largo**', y si la suma de las ventas es mayor, se muestra en rojo '**corto**'.

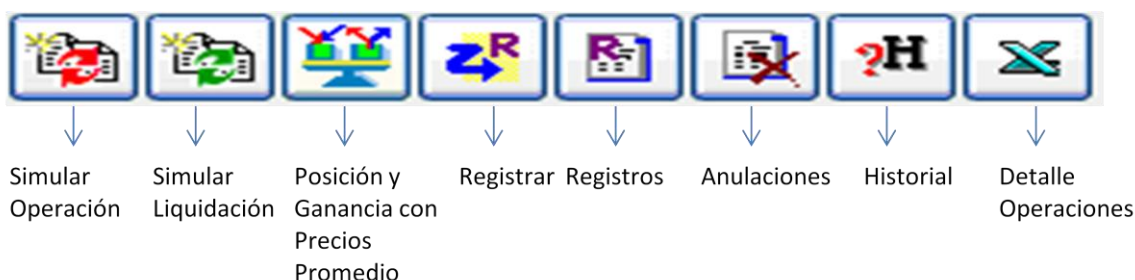
**Promedio:** El precio ponderado de las compras y ventas de la entidad.

### **Utilidad**

**Ult. Precio:** Se muestra el precio de la última transacción en el mercado Spot (realizado por cualquier participante). Este precio es utilizado para calcular la Utilidad Posición.

**Utilidad Intermediación:** cuando el tamaño de la posición disminuye (se venden Dólares que se habían comprado, o se compran Dólares que se habían vendido), se calcula la utilidad en pesos, la cual resulta de multiplicar la diferencia entre el precio de compra/venta y el precio promedio anterior por el monto.

**Utilidad Posición:** Cada vez que haya una transacción en el mercado Spot, se compara el último precio del mercado con el precio promedio de la posición y se multiplica por la posición Largo/Corto, para calcular Utilidad Posición en Pesos.



**Simular Operación:** Al oprimir el botón 'Simul. Operación', se abre la siguiente ventana:

Captura de pantalla de la ventana 'Dólar Spot - Simulación de Transacción'.

C/V	Monto (u)	Precio	Utilidad	Intermediación	Posición	Total
C	2'500,000	950.00	954'020,000	954'020,000		954'020,000

Botones: Simular, Cerrar

En esta ventana el operador puede digitar Monto, Precio y C o V (Compra o Venta) de una transacción futura, para así calcular la utilidad de Intermediación y Posición.

**Simular Liquidación:** Al oprimir el botón 'Liquidación', se abre la siguiente ventana:

C/V	Monto (u)	Precio	Utilidad	Intermediación	Total
C	500,000	1900.00	4'020,000	4'020,000	4'020,000

Esta permite calcular la utilidad de una posible transacción para llevar su posición a cero.

Posición y Ganancia con Precios Promedio: Al oprimir este botón, se desplegará otra ventana en la cual se refleja la valoración con la tasa FIX o la tasa TRM. Esto dependerá de la hora en la cual se invoque esta ventana. Si se abre cuando cierra el mercado spot, se valora sobre la tasa FIX y si se abre una vez se publique la tasa TRM, se valora con dicha tasa. Las operaciones que aparecen antes de la apertura del mercado spot, se valoran a la TRM.

Usuario	Posición (USD)		TRM	Intermediación	Posición	Total
	Largo/Corto	Promedio				
JPBARNEY	-9'750,000	1953.07	1905.80	16'535,000	460'882,500	477'417,500

**Registrar:** Al hacer clic en este botón, se abre una ventana para crear manualmente una transacción (por fuera del mercado transaccional SPOT USD/COP) que se ha realizado y que es tenida en cuenta para el cálculo la posición de la respectiva entidad.

Este tipo de registros pueden estar asociadas a operaciones con:

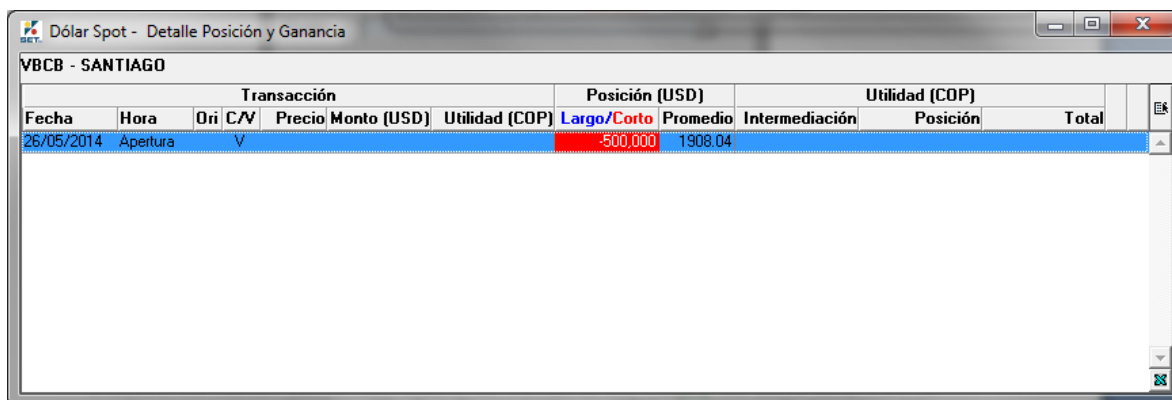
- Contraparte en la misma entidad
- Empleado de la misma entidad
- Contraparte tipo Cliente
- Consolidado

**Anulaciones:** permite consultar la lista de transacciones anuladas de la entidad.

**Historial:** este botón permite tener acceso al detalle histórico de operaciones del Módulo Posición y Ganancia, permitiendo navegar por fechas para conocer el detalle intradía de las operaciones.

**Detalle de operaciones:** este botón permite exportar a Excel el listado de Compras, Ventas, y posición final en el momento de ser oprimido. (incluye posiciones de apertura, cierre y transacciones manuales).

**Detalle:** Al hacer doble clic sobre la ventana principal del módulo de Posición y Ganancia, se abre una nueva ventana que muestra los cálculos de posición y utilidad para cada transacción en orden cronológico, tal como aparece a continuación



Transacción							Posición (USD)		Utilidad (COP)			Total	EX
Fecha	Hora	Ori	C/V	Precio	Monto (USD)	Utilidad (COP)	Largo/Corto	Promedio	Intermediación	Posición			
26/05/2014	Apertura		V				-500,000	1908.04					