



NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX

Versión 6.39

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

DESCRIPCIÓN GENERAL

OBJETIVO

Informar a los interesados los cambios incluidos en la versión 6.39.

ALCANCE:

- Fraccionamiento para mercados Forward y Swap en el Registro de Derivados IMC-Clientes.
- Envío de operaciones Next Day (T+1, T+2 y T+3) a la Cámara de Compensación de Divisas (CCD)
- Cambio en la barra principal del sistema.

FRACCIONAMIENTO PARA MERCADOS FORWARD Y SWAP EN EL REGISTRO DE DERIVADOS IMC-CLIENTES

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

Con esta nueva opción es posible fraccionar las operaciones que han sido registradas en la plataforma transaccional SET-FX por medio del módulo de registros de divisas con clientes en los mercados Forward y Swap.

1. Una vez se realice un registro, en el blotter de transacciones se debe oprimir clic derecho sobre la transacción que se desea fraccionar, con lo cual se desplegará un submenú con la opción “Fraccionar”. Elegida esta opción, aparecerá la ventana “Fracciones de transacción”.

The screenshot shows the 'Registros de Divisas Clientes' window with the 'Transacciones' tab active. The 'Forward' and 'Swap' sub-tabs are highlighted. A table of transactions is displayed, with the third row selected. A right-click context menu is open over the selected row, showing options like 'Detalle', 'Información complementaria', 'Modificar', 'Fraccionar' (highlighted with a blue box), 'Historia', 'Anular transacción', and 'Imprimir Papeleta'.

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instal.															
Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	T E C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	FR	SA	SP	Est	Ncp	NCh
11:50:16	FREDY		NOMURA INTERNATIONAL PLC	E	Compra	USD / COP	5'000.000.00	3103.2500	3104.0000	3W	06/11/2015	B		O						
09:20:00	FREDY	Acc	MORGAN STANLEY AND CO	E	Venta	USD / COP	25'000.000.00	2.0000	3100.0000	5M	17/03/2016	B		F						
11:01:00	FREDY		JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	R	Compra	CAD / GBP	10.000.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016			S						

- Detalle
- Información complementaria
- Modificar
- Fraccionar**
- Historia
- Anular transacción
- Imprimir Papeleta

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

2. La ventana de fraccionamiento contiene información sobre la transacción original en la parte superior. En la parte inferior de la se encuentra la opción “Aumentar” con la cual se podrá fraccionar la operación inicial. Se podrán realizar cambios de plazo, fecha de pago, monto, tasas, origen y cumplimiento.

Contraparte: JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GARAY

Par de monedas: CAD / GBP

Plazo: 3 Meses 15-Ene-2016

Fecha de pago: 18-Ene-2016 Origen: Swap

Monto CAD: 10,000.00 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa forward: 5.2130000 Opcionalidad: NO

Tasa spot: 5.2400000 Negociado en:

Hora: 11:01:00 (Negociación)

Hora	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B	E	Ori	Ex
------	-------	---------	-----------	-------	---------	---	-----	----

Aumentar Aceptar Cancelar

Clase: COMPRÁ Hecho por: Usuario SET-FX BCLB Mi usuario: FREDY

Clase Id: Cédula Id: 00.115.515 JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GARAY

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario:

Par de monedas: CAD GBP

Plazo: 3 Meses ☐ Libre Viernes 15-Ene-2016

Fecha de pago: 18-Ene-2016

Monto CAD: 10,000.00 (Unidades)

Tasa forward: 5.2130000

Tasa spot: 5.2400000

Origen: Swap

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: NO

Negociado en:

Hora: 11:01:00 (Negociación)

Aceptar Cancelar

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

3. Al aceptar la primera fracción, el usuario podrá seguir ingresando operaciones hasta que el monto inicial sea el mismo de la suma de los montos de todas las fracciones. En este momento se habilitará la opción “Aceptar”.

NOTA: La opción “Aceptar” no será habilitada si la suma de las fracciones no es exacta al monto de la operación inicial.

Fracciones de transacción

Contraparte: JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GARAY

Par de monedas: CAD / GBP

Plazo: 3 Meses 15-Ene-2016

Fecha de pago: 18-Ene-2016

Monto CAD: 10,000.00

Tasa forward: 5.2130000

Tasa spot: 5.2400000

Origen: Swap

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: NO

Negociado en:

Hora: 11:01:00 (Negociación)

Hora	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B E	Ori
11:01:00	2,500.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	
11:01:00	3,750.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	
11:01:00	2,222.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	
11:01:00	1,528.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	

Aumentar Aceptar Cancelar

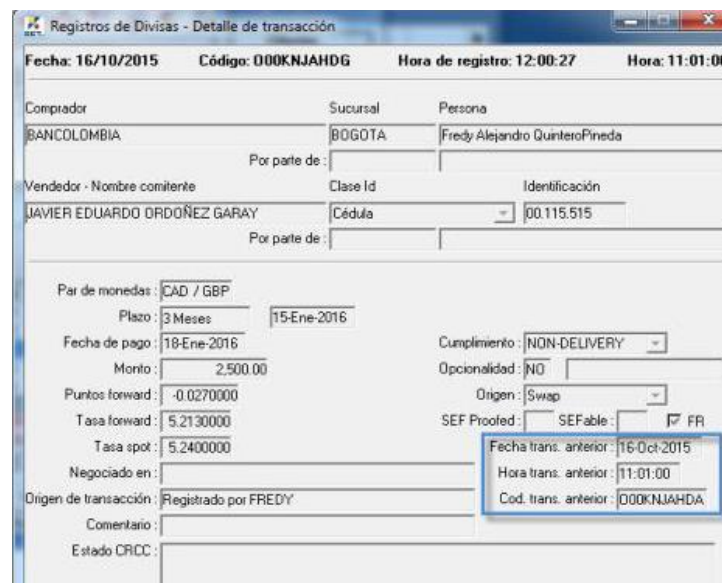
NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

4. Realizado el proceso anterior, automáticamente será eliminada la operación inicial y aparecerán las fracciones en el blotter del día del fraccionamiento. Adicionalmente el blotter cuenta con el campo “FR”, el cual indica si la operación proviene de fraccionamiento.

Registros de Divisas Clientes - Transacciones																			
Spot		Next Day		Fix		Forward		Swap		Opciones		IRS/CCS		Otros derivados					
Todas		Compras		Ventas		Usuario		Sucursal		Insti.									
Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B	E	Oni	FR	SA	SPE	Est	Ncp	NCh
11:50:16	FREDY		NOMURA INTERNATIONAL PLC	E	Compra	USD / COP	5000.000.00	3103.2500	3104.0000	3w	06/11/2015	B	0						
09:20:00	FREDY	Acc	MORGAN STANLEY AND CO	E	Venta	USD / COP	25000.000.00	2.0000	3100.0000	5M	17/03/2016	B	F						
11:01:00	FREDY		JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	R	Compra	CAD / GBP	2,500.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	FR						
11:01:00	FREDY		JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	R	Compra	CAD / GBP	3,750.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	FR						
11:01:00	FREDY		JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	R	Compra	CAD / GBP	2,222.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	FR						
11:01:00	FREDY		JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	R	Compra	CAD / GBP	1,528.00	5.2130000	5.2400000	3 Meses	15/01/2016	S	FR						

5. Haciendo clic derecho en alguna de las fracciones y eligiendo la opción “Detalle”, se puede validar la fecha, hora y código de la operación original.



Registros de Divisas - Detalle de transacción

Fecha: 16/10/2015 Código: 000KNJAHDG Hora de registro: 12:00:27 Hora: 11:01:00

Comprador: BANCOLOMBIA Sucursal: BOGOTA Persona: Fredy Alejandro Quintero Pineda

Por parte de: _____

Vendedor - Nombre comitente: JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GARAY Clase Id: Cédula Identificación: 00.115.515

Por parte de: _____

Par de monedas: CAD / GBP

Plazo: 3 Meses 15-Ene-2016

Fecha de pago: 18-Ene-2016

Monto: 2,500.00

Puntos forward: -0.0270000

Tasa forward: 5.2130000

Tasa spot: 5.2400000

Negociado en: _____

Origen de transacción: Registrado por FREDY

Comentario: _____

Estado CRCC: _____

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: NO

Origen: Swap

SEF Proofed: _____ SEFable: ☒ FR

Fecha trans. anterior: 16-Oct-2015

Hora trans. anterior: 11:01:00

Cod. trans. anterior: 000KNJAHDA

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

6. En la ventana de anulaciones se muestra la operación inicial con un “FR” que representa que fue anulada hoy por fraccionamiento. Asimismo, en la ventana “Historia de la Postura”, en el campo de “Comentario”, se especifica que la operación fue eliminada por fraccionamiento.

Registros de Divisas - Anulaciones y Solicitudes de anulación

Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Regidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes	Rechazadas	
Fecha	Hora	E/R	Mercado	Tipo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo Vence	FR Estado
16/10/15	11:01:00	Enviada	Forward	Cientes	Compra	CAD / GBP	JAVIER EDUARDO ORDOÑEZ GA	10,000.00	5.2130000	3 Meses 15/01/2016	FR Confirmada

Registros de Divisas - Historia de postura

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Plazo Vence	Comentario
16/10/15	11:01:00	BCLB FREDY	Registro	D	CAD / GBP	10,000	5.2130000	3 Meses 15/01/2016	
16/10/15	12:00:27	BCLB FREDY	Anulación	D	CAD / GBP	10,000	5.2130000	3 Meses 15/01/2016	Por fraccionamiento

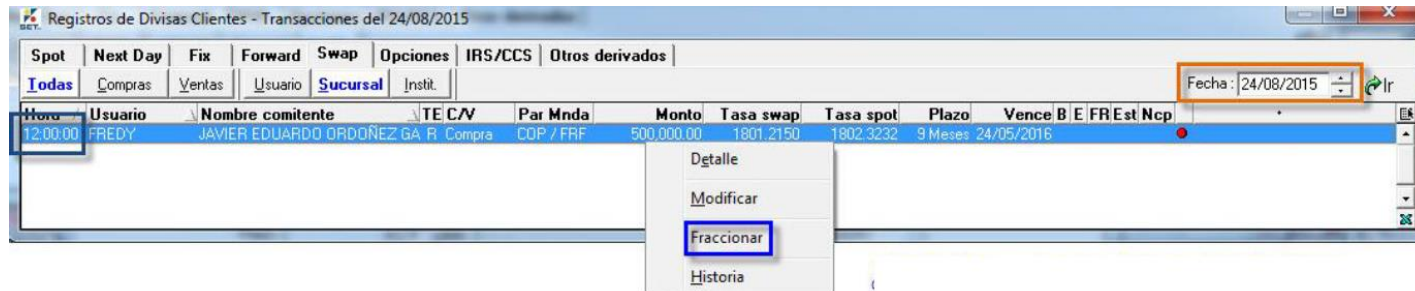
Registro original

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

FRACCIONAMIENTO

CONSIDERACIONES:

- Se podrán fraccionar operaciones realizadas hoy o en días anteriores sólo si no han sido enviadas a compensar.



- Se podrán fraccionar una operación desde el mismo día que se registro hasta la fecha de vencimiento (hasta la hora de cierre de mercado).
- Las operaciones fraccionadas se comportarán como transacciones independientes para efectos de envío a compensar, anulaciones y modificaciones.
- La anulación de fracciones deben cumplir los parámetros ya establecidos.

CONSIDERACIONES:


- En vista de que la operación original que fue fraccionada es anulada, también se modifican las estadísticas del día que se registró originalmente para reflejar el hecho de que la transacción no existe. Las transacciones nuevas – las fracciones – también serán reflejadas en las estadísticas del día en que se hace el fraccionamiento.
- Las fracciones también podrán ser fraccionadas, y en el detalle de las mismas se mostrará la fecha, hora y código único de transacción de la fracción inmediatamente anterior.
- Las transacciones fraccionadas podrán tener fecha de cumplimiento posterior a la inicialmente pactada.
- El cálculo de las fechas de vencimiento de las transacciones fraccionadas tienen como base la fecha del fraccionamiento.

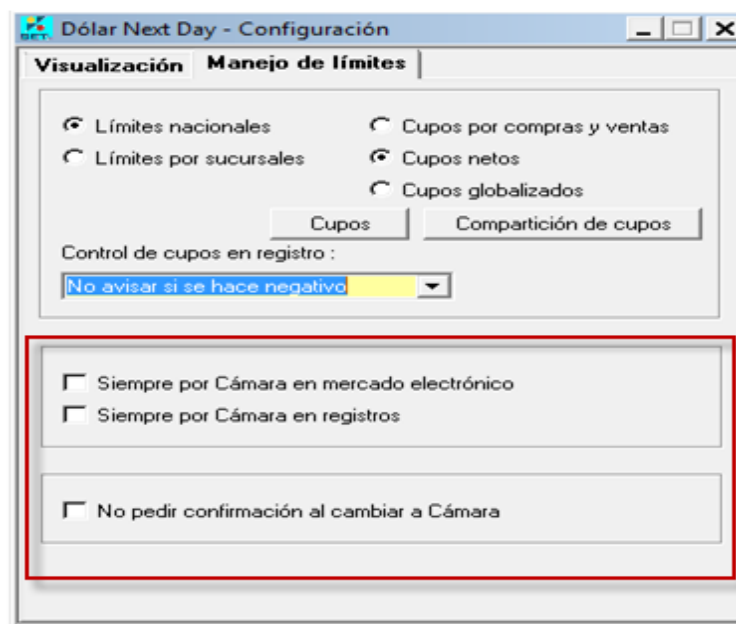
ENVÍO DE OPERACIONES NEXT DAY (T+1, T+2 Y T+3) A LA CÁMARA DE COMPENSACIÓN DE DIVISAS (CCD)

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

Con esta nueva opción, es posible tener funcionalidades en el mercado Next Day interbancario similares a las existentes en el mercado spot, en lo referente a la compensación de operaciones a través de la CCD.

1. Sobre la opción de configuración  los usuarios podrán encontrar en la pestaña “Manejo de Límites” las opciones con sus funcionalidades que se tienen actualmente para el mercado spot como puede apreciarse en la siguiente imagen:



NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

2. En la ventana de control de cupos, los usuarios podrán ver el cupo que se tiene hasta ese momento en CCD. Adicional, la ventana tendrá habilitada la opción “SpC” de *Sólo compensar por Cámara* haciendo clic derecho sobre la entidad para “Poner SpC” o “Quitar SpC”.

Dólar Next Day - B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA - Límites/Cupos

Configuración : Límites nacionales
Por neteo.

Cód.	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
ACC	ACCIONES DE COLOMBIA		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AEV	ASESORES EN VALORES S.A.		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AFN	AFIN S.A. COMISIONISTA DE BOLSA		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AGR	BANCO AGRARIO	S	2'130,000	2'130,000	2'130,000	2'130,000
ALN	ALIANZA VALORES S.A.		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AVV	AV-VILLAS		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AYV	ACCIONES Y VALORES		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
BCL	BANCOLOMBIA		1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
BCX	BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA		10'500,000	10'500,000	10'500,000	10'500,000
BGT	BANCO DE BOGOTA		10'500,000	10'500,000	10'500,000	10'500,000
BYB	STANFORD S.A. COMISIONISTA		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
CFC	CORP FINANCIERA COLOMBIANA		500,000	500,000	500,000	500,000

Cupos en Cámara

Dólar Next Day - Cupos con CCD

Por neteo.

	Compra	Venta
Límite :	50,000'000,000	50,000'000,000
Transacciones :	1'000,000	1'750,000
Cupo :	50,000'750,000	49,999'250,000

Dólar Next Day - B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA

Configuración : Límites nacionales
Por neteo.

Cód.	Institución	SpC
ACC	ACCIONES DE COLOMBIA	
AEV	ASESORES EN VALORES S.A.	
AFN	AFIN S.A. COMISIONISTA DE BOLSA	
AGR	BANCO AGRARIO	S
ALN	ALIANZA VALORES S.A.	
AVV	AV-VILLAS	
AYV	ACCIONES Y VALORES	

Dólar Next Day - B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA - Límites/Cupos

Configuración : Límites nacionales
Por neteo.

Cód.	Institución	Límite de compra	Cu
ACC	ACCIONES DE COLOMBIA	5'000,000	5'000,000
AEV	ASESORES EN VALORES S.A.	5'000,000	5'000,000
AFN	AFIN S.A. COMISIONISTA DE BOLSA	5'000,000	5'000,000
AGR	BANCO AGRARIO	2'130,000	2'130,000
ALN	ALIANZA VALORES S.A.	5'000,000	5'000,000
AVV	AV-VILLAS	5'000,000	5'000,000
AYV	ACCIONES Y VALORES	5'000,000	5'000,000
BCL	BANCOLOMBIA	1,000'000,000	1,000'000,000
BCX	BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA	10'500,000	10'500,000
BGT	BANCO DE BOGOTA	10'500,000	10'500,000

Dólar Next Day - B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA - Límites/Cupos

Configuración : Límites nacionales
Por neteo.

Cód.	Institución	Límite de compra	Cu
ACC	ACCIONES DE COLOMBIA	5'000,000	5'000,000
AEV	ASESORES EN VALORES S.A.	5'000,000	5'000,000
AFN	AFIN S.A. COMISIONISTA DE BOLSA	5'000,000	5'000,000
AGR	BANCO AGRARIO	2'130,000	2'130,000
ALN	ALIANZA VALORES S.A.	5'000,000	5'000,000
AVV	AV-VILLAS	5'000,000	5'000,000
AYV	ACCIONES Y VALORES	5'000,000	5'000,000
BCL	BANCOLOMBIA	1,000'000,000	1,000'000,000
BCX	BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA	10'500,000	10'500,000

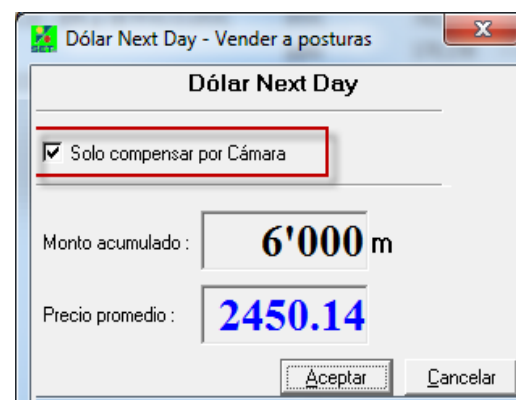
NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

3. En la ventana del mercado Next Day se mostrará los cupos resaltados en miles y sin decimales.



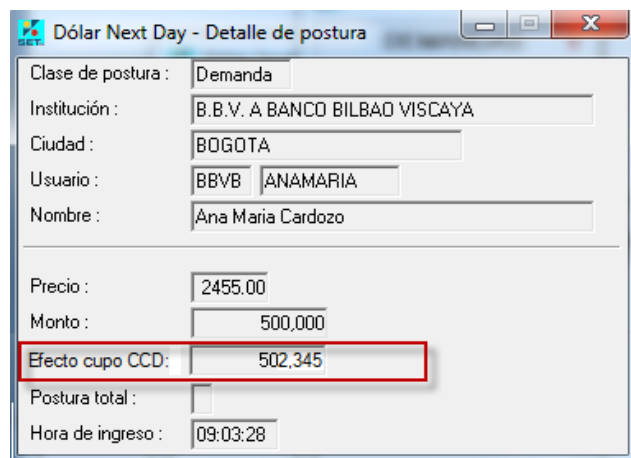
4. Al poner una postura y hacer clic derecho en la misma, el usuario podrá *vender o comprar el acumulado* y hacer la compensación de estas operaciones por cámara por medio de la selección de un check box en la parte superior de la ventana, como se puede observar en la siguiente imagen:



NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

5. Se podrá ver el efecto en cupos (el monto que se va a descontar en los cupos cámara de la entidad) haciendo clic derecho sobre la postura y eligiendo la opción “Detalle”.



The screenshot shows a window titled "Dólar Next Day - Detalle de postura". It contains the following fields:

Clase de postura :	Demanda
Institución :	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA
Ciudad :	BOGOTA
Usuario :	BBVB ANAMARIA
Nombre :	Ana Maria Cardozo
Precio :	2455.00
Monto :	500,000
Efecto cupo CCD:	502,345
Postura total :	
Hora de ingreso :	09:03:28

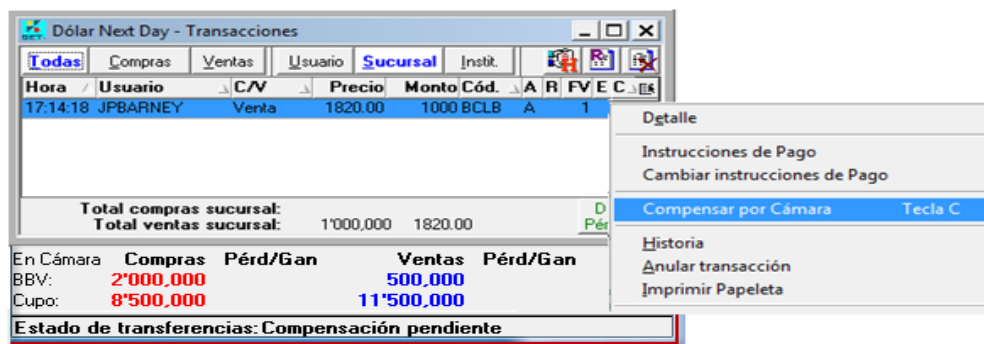
The field "Efecto cupo CCD:" is highlighted with a red rectangle.

6. En el blotter aparecerá la columna “C” que facilitará la identificación de las operaciones enviadas a compensar a la CCD y la columna “Ori” se mostrará de dónde proviene la operación Next Day de días anteriores (N3, N2).

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

Sí una operación no ha sido compensada, se podrá enviar a la CCD haciendo clic derecho sobre la operación y seleccionando la opción “Compensar por Cámara”.






De igual manera al hacer clic derecho sobre la operación se puede elegir la opción “Historia” para ver la cronología de una transacción Next Day.

Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To	T	Comentario
13:00:00	BBVB ANAMARIA	Solicita registro	D	2449.00	500	500		
13:00:00	BBVB ANAMARIA	Registro	D	2449.00	500	500		
16:09:52	BCLB ARTURO	Confirmación	O	2449.00	500			
16:10:03	BBVB ANAMARIA	Solicita cambio a Cámara	D	2449.00	500			
16:10:09	BCLB ARTURO	Confirma cambio	D	2449.00	500			

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

En la parte inferior del blotter también se podrá apreciar la información de cupos como se presenta en el blotter del mercado spot.

Dólar Next Day - Transacciones												
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.						  						
Hora /	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	Orí	A	R	FV	E	C	
09:03:35	ANAMARIA	Compra	2455.00	500	BCLB					1		
11:50:00	ANAMARIA	Compra	2452.00	250	BCLB	N3		R		2		
11:51:00	ANAMARIA	Compra	2452.25	1250	BCLB			R		3		
11:54:04	ANAMARIA	Venta	2453.50	500	BCLB					3		
Total compras sucursal:				2'000.000	2452.91							
Total ventas sucursal:				500.000	2453.50							
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos							
BBV:	2'000.000		500.000		1'500.000							
Cupo:	8'500.000		11'500.000		Detalle Pérd/Gan							
Estado de transferencias: Compensación pendiente												

7. Al presionar el botón "Detalle Pérd/Gan" ubicado en el blotter, el usuario verá las pérdidas y ganancias por plazos *Realizadas*, *Proyectadas*, ó *Realizadas & Proyectadas* con sus cálculos respectivos.

Dólar Next Day - Transacciones BBV B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA																								
T+1 :			T+2 :			T+3 :			Pérdidas & Ganancias USD : Realizada & Proyectada															
COMPRAS									VENTAS															
Hora	Usuario	Contraparte	Precio	Monto	FV	Orí	Pérd/Gan	C/V	Hora	Usuario	Contraparte	Precio	Monto	FV	Orí	Pérd/Gan	C/V							
11:17:43	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3000.00	1'000,000	1			C	17:58:00	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3000.00	500,000	1			C							
11:28:31	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3001.00	500,000	1			C	17:58:00	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3010.00	1'000,000	1			C							
11:46:00	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3001.00	1'000,000	1			C																
17:57:21	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3010.00	1'500,000	1			C																
17:57:21	BBVB JPBARNEY	BCXB LORENA	3000.00	1'500,000	1			C																
Total compras :				5'500,000													Total ventas :				1'500,000			
Efecto en Cupos :				5'500,000													Efecto en Cupos :				1'500,000			
T+1	5'500,000		5'500,000		T+2				T+3				T+1		1'500,000		1'500,000		T+2				T+3	

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

8. En el detalle de las operaciones realizadas en el mercado o registros, el usuario puede validar si la operación tiene la bandera de compensación por cámara.

Dólar Next Day - Detalle de transacción

Fecha: 15/04/2015 Código: 00B3HD7SF0 Hora: 09:03:41

Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	BOGOTA	Ana Maria Cardozo	
Vendedor	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA	BOGOTA	Arturo Felipe Monsave Yepes	

Precio: 2450.02 Monto US\$: 250,000.00 IVA: 97960,800.00

Origen de transacción: Demanda aceptada por ARTURO Monto Pesos: 710'465,800.00

Comentario: Fecha valor: 1

Dólar Next Day - Detalle de transacción

Fecha: 15/04/2015 Código: 026YHEIX67 Hora de registro: 09:17:36 Hora: 09:17:00

Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	BOGOTA	Ana Maria Cardozo	
Broker	Por parte de:		
ICAP CO	BOGOTA	Broker1	
Vendedor	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA	BOGOTA	Arturo Felipe Monsave Yepes	
Broker	Por parte de:		
ICAP CO	BOGOTA	Broker1	

Precio: 2451.85 Monto US\$: 750,000.00 IVA: 294'102,000.00

Negociado en: Origen de transacción: Registrado por BROKER1 Monto Pesos: 2,132'989,500.00

Comentario: Fecha valor: 3

9. En el registro de una operación, si no esta configurado/predeterminado, el usuario podrá seleccionar y habilitar la opción “Compensar por Cámara”.

Dólar Next Day - Registrar transacción

Hecho por: Yo Empleados

BBVB Mi usuario: JPBARNEY

☒ Compensar por Cámara

Clase: ☒ Compra ☐ Venta ☒ A dos días ☐ A tres días

Contraparte: BCLB

Usuario: CAMILO

Comentario:

Precio: 1890.00

Monto: 500 m (Miles)

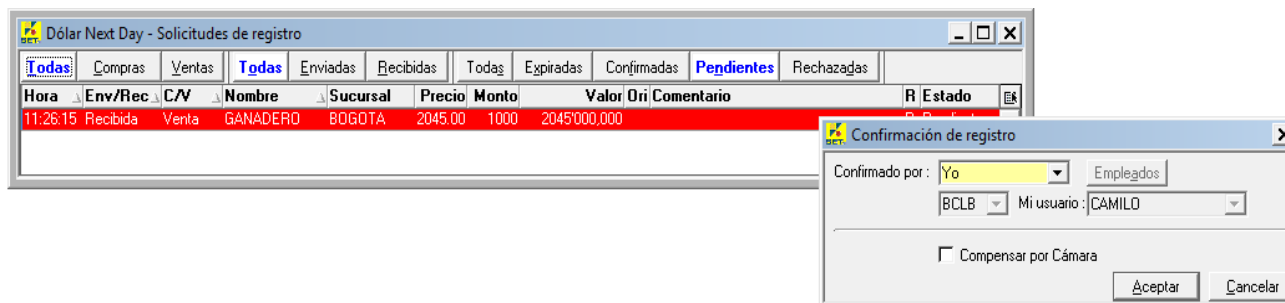
Hora: 17:19:00 (Negociación)

Aceptar Cancelar

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

10. Al solicitar confirmación a la contraparte sobre un registro, si no esta configurado/predeterminado, el usuario podrá ver un check box que podrá seleccionar si quiere que la operación sea compensada en CCD, ó en caso de ocurrir lo contrario, desmarcar esta opción.



11. Sí el usuario quiere enviar a compensar una operación registrada a través del módulo de Stop Loss, éste podrá habilitar el check box “Compensar por Cámara” en la parte superior de la ventana. Cuando la contraparte reciba la solicitud de confirmación de esta operación, tendrá deshabilitada esta opción como puede apreciarse a continuación:

The screenshot shows the 'Dólar Spot / Next Day - Ingresar Stop Loss' window. The 'Mercado' is set to 'Next Day', 'Clase' is 'Venta', 'Código' is 'BBVB', 'Usuario' is 'JPBARNEY', 'Precio' is '2015.00', and 'Monto' is '500 m (Miles)'. The 'Compensar por Cámara' checkbox is unchecked.

The screenshot shows the 'Dólar Spot / Next Day - Ingresar Stop Loss' window. The 'Mercado' is set to 'Next Day', 'Clase' is 'Venta', 'Código' is 'BCXB', 'Usuario' is 'LORENA', 'Precio' is '2479.00', 'Strike' is '2479.00', and 'Monto' is '500 m (Miles)'. The 'Compensar por Cámara' checkbox is checked.

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

12. Al ingresar órdenes de compra o venta, los usuarios también podrán elegir si quieren enviar la operación a compensar a través de la selección de la opción en el check box de la parte superior de la ventana:



Dólar Next Day - Orden de Com...

☐ Solo compensar por Cámara

Precio : 2469.00

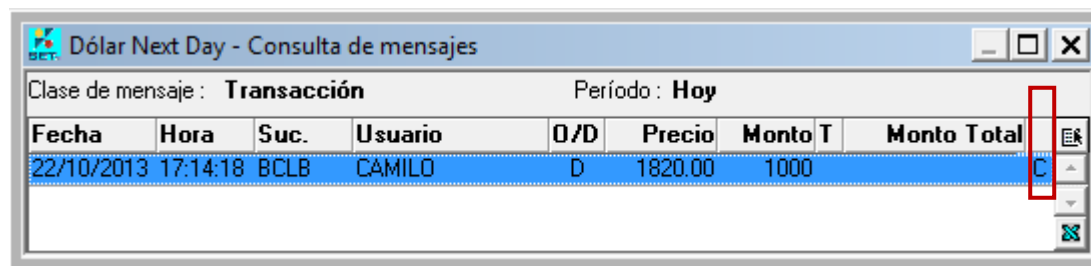
Monto US\$: 500 m

Aceptar propias : No

Tiempo de vida : min.

Aceptar Cancelar

13. En la consulta de mensajes el usuario podrá identificar las operaciones que se compensaron por la CCD.



Dólar Next Day - Consulta de mensajes

Clase de mensaje : Transacción Período : Hoy

Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Precio	Monto T	Monto Total
22/10/2013	17:14:18	BCLB	CAMILO	D	1820.00	1000	C

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

14. En la ventana de barridos netos se podrá seleccionar el check box para activar la opción de “Sólo compensar por Cámara”.

The screenshot shows a software window titled "Dólar Next Day - Barridos Netos". At the top, there is a checkbox labeled "Solo compensar por Cámara" which is checked and highlighted with a red rectangle. To the right of the checkbox is a "Cancelar" button. Below the checkbox, the window is divided into two main columns: "VENTA" (left) and "COMPRA" (right). Under "VENTA", there is a "Monto Pedido" field with the value "10'000" and a unit "m". Below this is a "Calcular" button. Further down are fields for "Monto Disponible", "Precio Máximo", "Precio Promedio", and "Precio Mínimo". At the bottom of the "VENTA" column is a "VENDER" button. Under "COMPRA", there are empty fields for "Monto", "Precio Máximo", "Precio Promedio", and "Precio Mínimo". At the bottom of the "COMPRA" column is a "COMPRAR" button. At the very bottom of the window, there is a section labeled "Variaciones permitidas" with fields for "Precio" (0.00) and "Monto" (0 m).

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

COMPENSACIÓN OPERACIONES NEXT DAY

CONSIDERACIONES:

- Todas las operaciones que se realicen en el mercado interbancario Next Day (ND) podrán ser enviadas a la CCD desde el día en que son realizadas hasta el día en que se trasladan al mercado Spot con el consumo de cupos correspondientes.
- Las operaciones compensadas no se pueden anular sin que la CCD la desmarque (dentro del horario reglamentado).
- Por omisión las operaciones ND que se realicen por tabla quedarán compensadas por la CCD siempre que tenga cupo.
- Los cupos para el mercado Next day serán independientes del mercado Spot.
- El proceso actual de compensación Next Day a la fecha de cumplimiento seguirá operando de la misma forma. Si la operación ND ha sido aceptada por la CCD previamente, en la fecha de cumplimiento debe aparecer aceptada por CCD en el mercado spot.

CAMBIO EN LA BARRA PRINCIPAL DEL SISTEMA

NUEVAS FUNCIONALIDADES SISTEMA SET-FX – VERSIÓN 6.39

BARRA PRINCIPAL DEL SISTEMA

Se ha incluido el nombre del mercado en la barra principal del sistema como se aprecia a continuación:

