

ASUNTO:

PROCEDIMIENTO DE MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

SET-ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "SET-FX", se permite informar a todos sus afiliados el nuevo procedimiento de modificación de operaciones conforme a las obligaciones propias del artículo 1.1.3.10 del reglamento del Sistema "SET-FX".

Este procedimiento reemplaza en su totalidad los procedimientos informados en los Boletines Informativos No. 161 y 250 de 2014 y 2017 respectivamente.

En todo caso, la modificación de operaciones de contado y/o derivados deberá realizarse en cumplimiento de lo establecido en las Circulares DODM-317 y DODM-144 expedidas por el Banco de la República, así como sus posteriores actualizaciones y aquellas normas que las desarrollen, complementen o deroguen y en concordancia con los siguientes procedimientos:

1. Modificación Manual de Operaciones (desde la terminal del usuario)

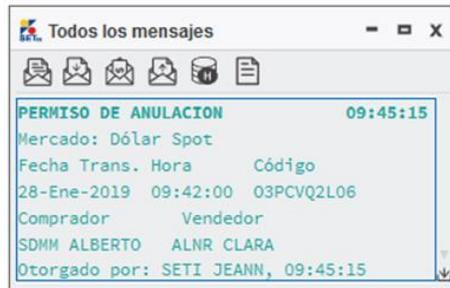
1.1. Operaciones de Contado

Para la modificación manual de las operaciones de contado en el sistema SET-FX se deberán seguir los siguientes pasos:

- a. El afiliado interesado en realizar la modificación de una operación deberá informar dicha situación al administrador del Sistema a través de un medio verificable, bien sea mediante el "chat" del Sistema SET-FX, correo electrónico o vía voz (llamada telefónica). En el caso de operaciones realizadas entre dos IMC afiliados, ambos deben informar al administrador la intención de modificación.

Si la operación a modificar se encuentra Compensada por la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC), las contrapartes deberán solicitar directamente a la CCDC que desmarque dicha operación en el Sistema SET-FX para poder realizar la modificación.

- b. El administrador habilitará el Sistema para iniciar el proceso de modificación, permitiendo en primera instancia la anulación de la operación a modificar, tal cómo se muestra a continuación:



Posteriormente aparecerá una "X" sobre la operación a modificar, en el respectivo Blotter de operaciones:



- c. El afiliado debe "anular" la operación marcada con una "X". Posteriormente, debe ingresar la nueva operación corregida incluyendo en el campo "Comentario" el código de la operación anulada (seguido de un espacio) y la fecha en la que se registró la operación anulada, tal como se muestra a continuación:

Nota:

- Primero se debe indicar el código y luego la fecha de la operación anulada.
- El código y la fecha de la operación anulada deben ser separados por un espacio.
- La fecha no debe contener ningún tipo de separadores y debe ingresarse en el siguiente formato: **DDMMAAAA**

Es indispensable realizar los pasos en el orden que se indica en este Boletín, para garantizar la trazabilidad de las operaciones en el sistema.

1.2. Operaciones de Derivados

Únicamente podrán ser modificadas las operaciones que no hayan sido enviadas a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) para su Compensación y Liquidación. En caso de que la operación haya sido enviada a la CRCC, el afiliado deberá realizar el proceso respectivo de “desmarque” de la operación ante CRCC.

Para la modificación manual de las operaciones de derivados los afiliados podrán elegir cualquiera de las dos siguientes alternativas:

1.2.1. Modificación directa desde el Blotter de operaciones

El afiliado deberá ingresar al Blotter de operaciones, ubicarse sobre la operación que desea modificar, hacer clic derecho y seleccionar la opción “Modificar” como se muestra en la siguiente gráfica:



Posteriormente aparecerá una ventana con los detalles de la operación para que el afiliado realice la modificación requerida.

Los campos que se pueden modificar desde el Blotter de operaciones para cada uno de los mercados son los siguientes:

Forward IMC-IMC (USD/COP)
Origen
Tasa de referencia
Plazo
Fecha de pago
Precio Spot
Puntos Forward
Precio Forward
Monto
Modalidad cumplimiento
Opcionalidad
Tipo de opcionalidad
Negociado en

SWAP IMC-IMC USDCOP
Plazo
Fecha de pago
SWAP points
Monto
Modalidad cumplimiento
Tasa de referencia
Opcionalidad
Negociado en

Forward IMC-IMC (Otras monedas) / IMC - Clientes
Origen
Plazo
Vencimiento
Fecha de Asignación
Fecha de Pago
Monto
Puntos Forward
Tasa Spot
Tasa Forward
Cumplimiento
Opcionalidad
Negociado en
Tasa pool (Solo IMC - Clientes)

Swap IMC-IMC (Otras monedas) / IMC - Clientes
Plazo
Vencimiento
Fecha de Pago
Monto
Puntos swap
Tasa Spot
Tasa Swap
Tasa Referencia
Cumplimiento
Opcionalidad
Negociado en
Tasa pool (Solo IMC - Clientes)

IRS IMC-IMC / IMC - Clientes
Plazo
Vencimiento
Fecha de Pago
Monto
Segundo monto
Modify Following business
Tasa interés 1
Tasa interés 2
Cumplimiento
Opcionalidad
Tipo
Negociado en
Pagos Adicionales (Solo IMC - IMC)
Fecha primera amortización (Solo IMC - Clientes)
Valor amortización (Solo IMC - Clientes)

CCS IMC-IMC / IMC - Clientes
Plazo
Vencimiento
Fecha de Pago
Fecha primera amortización
Monto
Valor amortización
Tasa interés 1
Tasa interés 2
Tasa Cambio
Cumplimiento
Opcionalidad
Tipo
Negociado en
Tasa pool (Solo IMC - Clientes)

Opciones IMC-IMC / IMC - Clientes
Plazo
Vencimiento
Fecha de Pago
Monto
Tasa pactada Spot
Prima COP/USD
Condición del ejercicio
Tipo de opción
Cumplimiento
Tasa Strike
Porcentaje de volatilidad
Negociado en
Tasa pool Strike (Solo IMC – Clientes)

Para operaciones entre dos IMC, la modificación siempre debe ser confirmada por la contraparte. Las operaciones entre IMC-Cliente no requieren una confirmación adicional.

1.2.2. Modificación mediante el proceso de anulación e ingreso de un nuevo registro

Para la modificación manual de las operaciones de derivados en el sistema SET-FX se deberán seguir los siguientes pasos:

- El afiliado interesado en realizar la modificación de una operación deberá informar dicha situación al administrador del Sistema a través de un medio verificable, bien sea mediante el "chat" del Sistema SET-FX, correo electrónico o vía voz (llamada telefónica). En el caso de operaciones realizadas entre dos IMC afiliados, ambos deben informar al administrador la intención de modificación.
- El administrador habilitará el Sistema para iniciar el proceso de modificación, permitiendo en primera instancia la anulación de la operación a modificar, tal cómo se muestra a continuación:



Posteriormente aparecerá una "X" sobre la operación a modificar, en el respectivo Blotter de operaciones:

Fecha	Hora	Usuario	st. C/V	Precio FW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	st Ori	F. Asig	T	A	R	E	SA	Est	Ncp	sM	pA		
28/01/19	13:44:00	ALBERTO	Compra	3101.00	1'000,000	1 Mes	26/02/2019	NDF	ALNR	O	28/01/2019										X	
28/01/19	13:51:00	ALBERTO	Compra	3101.00	1'000,000	1 Mes	26/02/2019	NDF	ALNR	O	28/01/2019											

Total compras sucursal: 2'000,000 3101.00
Total ventas sucursal:

- c. El afiliado debe "anular" la operación marcada con una "X". Posteriormente, debe ingresar la nueva operación corregida incluyendo en el campo "Comentario" el código de la operación anulada (seguido de un espacio) y la fecha en la que se registró la operación anulada, tal como se muestra a continuación:

Ejemplo: modificación de una operación Forward IMC-IMC USD/COP

Dólar Forward

Hecho por: Yo Empleados
SOMM Mi usuario: ALBERTO

Fecha negociación: 28/01/2019
Tipo de transacción: Venta
Contraparte:
Código: ALNR
Nombre: ALIANZA VALORES S.A
Usuario: CLARA

Comentario: O3PCVQ2L1S 28012019

Origen: Outright
Precio Spot: Del sistema / Asignada por usuario 3100.00
Puntos Forward: 1.00
Precio Forward: 3101.00
Monto en dólares: 1'000,000 (Unidades)
Plazo: Libre 1 Mes
Vencimiento: Mar 26-Feb-2019
Fecha asignación precio: 28-Ene-2019
Fecha de pago: 27-Feb-2019
Modalidad cumplimiento: NON-DELIVERY
Tasa de referencia:
Opcionalidad: No
Tipo de opcionalidad:
Negociado en: DIRECTO
Fecha anterior:
Hora: 13:59:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

NOTA

- Primero se debe indicar el código y luego la fecha de la operación anulada
- El código y la fecha de la operación anulada deben ser separados por un espacio.
- La fecha no debe contener ningún tipo de separadores y debe ingresarse en el siguiente formato: DDMMAAAA.

2. Modificación automática vía XML.

La modificación automática de operaciones vía XML únicamente aplica para operaciones IMC-Cliente.

Únicamente podrán ser modificadas las operaciones que no hayan sido enviadas a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) para su Compensación y Liquidación. En caso de que la operación haya sido enviada a la CRCC, el afiliado deberá realizar el proceso respectivo de "desmarque" de la operación ante CRCC.

Para la modificación de operaciones de contado y derivados a través la interfaz automática XML podrán elegir cualquiera de las dos siguientes alternativas:

2.1. Modificación directa de la operación desde la interfaz XML

Para efectuar el proceso de modificación vía XML, en el mensaje de la interfaz el TAG <Tipo de operación> debe contener la letra "M", el cual indica que se trata de una modificación. Adicionalmente, el TAG <id> debe contener el código propio asignado por la entidad para la operación a modificar y debe completar el resto de campos que se van a modificar.

Bajo este procedimiento de Modificación, no se pueden modificar los siguientes campos:

- a. Mercado
- b. Clase (compra/venta)
- c. Id de Usuario
- d. Hora de la transacción
- e. Fecha de la Operación
- f. Tipo de Identificación de Contraparte
- g. Número de Identificación de Contraparte
- h. Tipo Identificación Beneficiario
- i. Número de Identificación Beneficiario

2.2. Modificación mediante el proceso de anulación e ingreso de un nuevo registro

En el caso en que un afiliado al sistema desee modificar cualquier campo de la operación debe seguir los siguientes pasos:

- a. El afiliado interesado deberá enviar la anulación de la operación a corregir vía XML, en la cual el TAG <Tipo de operación> debe contener la letra "A", para indicar que se trata de una anulación. Así mismo el TAG <id> debe contener el código con el que se importó la operación original.
- b. Posteriormente la entidad debe enviar un mensaje XML con la operación modificada, ingresando en el TAG <Comentario> el código de la operación

anulada, seguido de un espacio y luego la fecha de la operación anulada en el formato DDMMAAAA.

En este punto es importante tener en cuenta que si la operación a modificar es de días anteriores, no se puede utilizar la interfaz automática XML. En este caso se debe proceder a modificar la operación mediante el procedimiento descrito en el numeral 1.2. del presente boletín.

Los detalles técnicos y de desarrollos requeridos para realizar una modificación, anulación o ingreso de una nueva operación se encuentran explicados en el Manual técnico del XML que se adjunta.

Nota: En cada caso el Afiliado debe conservar los registros y evidencias que sustenten la razón de dicha modificación que permitan la trazabilidad entre la operación anulada y la nueva operación corregida.

SET-ICAP FX estará en disposición para resolver cualquier inquietud que se pueda presentar sobre este particular.

Conmutador: 7427777.

Teléfono: 7427778 Extensiones: 220, 221, 222, 223

Correo: soportesetfx@set-icap.co

Sin otro particular,

(Original Firmado)

ANDRES MACAYA DÁVILA