

Asunto:

NUEVAS FUNCIONALIDADES: Administración de posturas y envío de operaciones Cross Currency Swaps (CCS) a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC)

SET-ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "SET-FX", informa a todos sus afiliados que a partir del martes 12 de noviembre de 2019 se activará para todos sus afiliados el acceso a la nueva herramienta de administración de posturas.

Esta herramienta permite que los usuarios transaccionales pueden visualizar y administrar las posturas propias en los mercados Spot/Next Day, facilitando el ingreso, modificación y retiro de posturas. Este módulo estará disponible para todos los usuarios transaccionales de cada entidad.

El uso de esta nueva funcionalidad tendrá un costo mensual fijo de COP\$700.000 por entidad, el cual entrará a regir a partir del 1 de enero de 2020. Aquellas entidades que no estén interesadas en continuar con esta herramienta después de la fecha antes indicada, deberán enviar una comunicación en este sentido a SET-ICAP FX S.A. a más tardar el 27 de diciembre de 2019.

Así mismo, se informa que a partir del 18 de noviembre de 2019 se habilitará el envío de operaciones Cross Currency Swaps (CCS) (entre Intermediarios del Mercado Cambiario - IMC) a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte para su compensación y liquidación.

Los respectivos instructivos para el manejo de estas dos funcionalidades (herramienta de administración de posturas y envío de CCS a la CRCC), se adjuntan al presente boletín.

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

Sin otro particular,

(Original Firmado)

ALEJANDRO ARIAS PERALTA

Gerente Comercial