

**ASUNTO:**

**NUEVAS TASAS DE REGISTRO DE OPERACIONES IRS/CCS**

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 18 de agosto del año en curso, se incluirán las siguientes tasas en la ventana de registro de operaciones IRS/CCS del sistema SET-FX:

- Secured Overnight Financing Rate – SFRON, SFR1M, SFR3M y SFR6M.
- Euro Short Term Rate – ETRON.
- Fed Funds Overnight – FFON.

Registros Derivados - Registrar transacción

Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones **IRS/CCS** Otros derivados

Clase: Hecho por: Yo SDMM Mi usuario: ALBERTO Empleados

IMC's Contraparte: ID: Nuevo ID

Cientes Beneficiario: ID:

Comentario: Tercero Offshore

IRS Par de monedas: COP COP Peso Dolar Cumplimiento: NON-DELIVERY

CCS Inicio primer flujo: T+2 Calendario: CO-NY Lun 06-Jul-2020 Opcionalidad: NO

Plazo: Libre Fecha 1era. amortización:

Fecha de pago: Modify following business: SI Valor amortización: COP

Monto COP: (Unidades) Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F ACT/360 Negociado en:

Tasa de interés COP: SFR1M ACT/360

Fecha anterior Enviar

Hora: (Negociación) Nuevo

Limpiar

DTF90  
ETRON  
EUR3M  
EUR6M  
FBIL  
FED  
FFON  
IBR1M  
IBR3M  
IBR6M  
IBRON  
IPC  
LBR1M  
LBR1Y  
LBR3M  
LBR6M  
SFR1M  
SFR3M  
SFR6M  
SFRON  
VAC

Los anteriores ajustes se incorporan al documento "Manual de Usuario para Registro de Divisas", el cual se encuentra disponible en la página de SET-ICAP en el enlace:

<https://set-icap.com/set-icap-fx/todos-los-productos-y-servicios-de-set-icap-fx-de-negociacion-registro-y-post-trade-para-el-analisis-de-informacion-sobre-divisas-somos-la-principal-fuente-de-informacion-de-divisas-en-colombia/manuales/>

El próximo martes 14 de julio a las 3:00PM se dictará una capacitación virtual dirigida tanto a los usuarios del Sistema como a los funcionarios relacionados con Middle Office, Back Office y encargados de realizar ajustes en los desarrollos de las entidades afiliadas con el ánimo de aclarar estas nuevas funcionalidades en el sistema e informar los posibles impactos en las interfaces del Sistema SET-FX (XML, API, Protocolo FIX y Archivo Plano).

La capacitación se dictará de manera online a través de la aplicación Teams.

Las personas interesadas en asistir a esta capacitación deberán solicitar su inscripción al correo electrónico: [jbenavides@set-icap.co](mailto:jbenavides@set-icap.co) y a través de este mismo medio recibirán el enlace para acceder a la reunión virtual.

Estaremos atentos a resolver cualquier inquietud respecto a este particular.

Cordialmente,

(Original Firmado)

**ANDRÉS MACAYA DÁVILA**