

ASUNTO:

IMPLEMENTACIÓN DE MEJORAS – SISTEMA SET-FX

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, que a partir del 6 de junio de 2025 se implementará una actualización en el Sistema que contiene las siguientes mejoras:

- **Nuevo Calendario en IRS/CCS:** En el registro de operaciones IRS/CCS, se aumentará un nuevo calendario denominado "Libre". Este calendario no contará ningún festivo para facilitar el registro de operaciones CCS en monedas distintas a COP, USD y EUR.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes IRS CCS

Clase: COMPRA Hecho por: Yo CTBB Mi usuario: DANIELP Empleados

Contraparte: Nit - Real o Vigilado ID: 800.021.308-5 DRUMMOND Nuevo ID

Beneficiario: ID: Tercero Offshore

Comentario: Cumplimiento: NON-DELIVERY

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Opcionalidad: NO

Inicio primer flujo: T+2 Calendario: Libre /ie 16-May-2025 Vencimiento sin ajustar:

Plazo: - - Segundo monto: COP

Fecha de pago: Mo business: SI Tipo: BULLET

Monto COP: Conteo de días Periodicidad Negociado en:

Tasa de interés COP: F ACT/360 Periodicidad

Tasa de interés COP: V IBRON + ACT/360

P. Rotos/Amortizaciones Editar

Fecha anterior Enviar

Hora: :: (Negociación) Nuevo Limpiar

10:07:00 Venta a OTR 1'000,000.00 a 1.0000 a 0/9, Par de monedas USD/COP

- **Mejora en API para Registros en Derivados:** La información de amortizaciones y periodos rotos de las operaciones IRS/CCS será incluida en la mensajería de la interfaz API, con el fin de que las entidades cuenten con esta información en sus sistemas internos.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Usuario SET-FX ALNB Mi usuario: FELPEI

Contraparte: Nt - Vigilado TRM ID: 800.142.383-7 FIDUCIARIA BOGOTA S.A.

Beneficiario: ID: Tercero Offshore

Comentario: Cumplimiento: NON-DELIVERY

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Opcionalidad: NO

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO-NY Mié 22-Ene-2025

Plazo: 6 Meses Libre Mar 22-Jul-2025 Vencimiento sin ajustar: 22-Jul-2025

Fecha de pago: 22-Jul-2025 Modify following business: SI Segundo monto: 500'000,000.00 COP

Monto COP: 500'000,000.00 (Unidades) Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa Tasa

IRS - Fechas Periodos Rotos y tabla de Amortizaciones

Par de monedas: COP COP

Inicio primer flujo: T + 2 22-Ene-2025

Plazo: 6 Meses 22-Jul-2025

Vencimiento sin ajustar: 22-Jul-2025

Día de corte: 24

Amortizaciones: No

Paga Tasa Fija (Mensual)

Inicio Segundo cupón: 22-Feb-2025

Periodo roto inicial: No días

Inicio último cupón: 22-Jun-2025

Periodo roto final: No días

Recibe IBR1M + (Mensual)

Inicio Segundo cupón: 22-Feb-2025

Periodo roto inicial: No días

Inicio último cupón: 22-Jun-2025

Periodo roto final: No días

Mostrar todos los cupones

Fecha inicio	Nominal	Paga Tasa Fija	Recibe IBR1M +
22/01/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000
22/02/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000
22/03/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000
22/04/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000
22/05/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000
22/06/2025	500'000,000.00	0.320000	0.0000

Enviar Nuevo Limpiar

Aceptar Cancelar

- Ventana de transacciones por fecha de vencimiento y asignación de tasa:** Esta nueva ventana, ya disponible en producción, permite a los usuarios visualizar las operaciones con vencimiento o asignación de tasa en un periodo específico. Con la actualización del sistema, se incorporarán también las operaciones del mercado FIX. Adicionalmente, la ventana presentará las operaciones de todos los mercados de forma agregada, en lugar de individualmente por cada mercado, lo que optimiza la revisión y análisis de las operaciones.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Yo CTBB Mi usuario: DANELP

Contraparte: Nt - Real o Viglado ID: 890.100.251-0 CEMENTOS ARGOS S.A.

Beneficiario: ID: Tercero Offshore

Comentario: Cumplimiento: NON-DELIVERY

Par de monedas: USD COP Peso Dolar Opcionalidad: NO

Origen / Producto: Plazo: 1 Semana Libre Miércoles 21-May-2025

Fecha asignación tasa: 14-May-2025 Tasa referencial: MANUAL

Fecha de pago: 22-May-2025

Monto USD: 5'000,000.00 (Unidades) Cumplimiento: NON-DELIVERY

Puntos forward: 1.3500 Opcionalidad: Negociado en: DIRECTO

Tasa forward: 4104.3500

Tasa spot: 4103.0000 Tasa pool: Hora: 10:07:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

10:16:55 Compra modificada: Forward, Clientes Trd: O4HMK31T8N del 14-05-25

Registros Derivados - Clientes - Transacciones por fecha vencimiento

Lunes 28-Jul-2025 a Miércoles 30-Jul-2025

Fecha vencimiento / asignación : 28/07/2025 Dias : 2 Me 30-Jul-2025

Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Mercado	Usuario	St	Nombre comitante	St	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B E Ori	F. Asig. T	R Est. Ncp	I X pA nC M B	
28/05/25	16:54:00	17:01:57	O4HM17G9F8	Fix	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	2'000.000,00			0d1	29/07/2025	X01	28/07/2025	M		
28/05/25	16:54:00	17:05:17	O4HM17G9F4	Fix	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	2'000.000,00			0d1	29/07/2025	X01	28/07/2025	P		
28/05/25	16:54:00	16:57:20	O4HM17G9F3	Forward	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	1'000.000,00	4100.0000	4050.0000	2 Meses	29/07/2025	O	28/06/2025	M		
28/05/25	16:54:00	16:57:30	O4HM17G9F6	Forward	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	1'000.000,00	4103.0000	4050.0000	2 Meses	29/07/2025	O	28/06/2025	M		
28/05/25	16:54:00	16:57:48	O4HM17G9F7	Forward	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	1'000.000,00	4103.0000	4053.0000	2 Meses	29/07/2025	O	28/06/2025	M		
28/05/25	16:54:00	16:58:48	O4HM17G9F9	Forward	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	1'000.000,00			0d2	29/07/2025	X0	28/05/2025	M		
28/05/25	16:54:00	16:59:03	O4HM17G9F8	Forward	DANIELP		DRUMMOND	R	Venta	USD / COP	1'000.000,00			0d2	29/07/2025	X0	28/05/2025	M		

Consulta desde Jul-2014

Esta herramienta "Ventana de transacciones por fecha de vencimiento y asignación de tasa" estará disponible sin costo para todos los usuarios hasta el día 30 de junio de 2025. Una vez concluido este período, tendrá un costo asociado publicado a través de la actualización del Boletín Informativo No. 437.

Es importante aclarar que la instalación de estas mejoras será completamente transparente para el usuario, por lo cual no será necesario que las entidades afiliadas realicen ajustes en sus interfaces de conexión.

Estaremos en disposición de resolver cualquier inquietud.

Cordialmente,

(Original Firmado)
JUAN DAVID BENAVIDES MONTEALEGRE
 Director Comercial