

MERCADO REGISTRO DE DIVISAS

MANUAL DE USUARIO



	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

Tabla de contenido

INTRODUCCIÓN	4
OBJETIVO	5
1. INGRESO AL MODULO REGISTRO DE DIVISAS	6
1.1. Estructura de la Ventana “Registro de Derivados – Registrar Transacciones”	6
1.2. Creación y Asociación de Comitentes o Clientes	9
2. BOTONES DE HERRAMIENTAS	11
2.1. Importación por XML	11
2.2. Precios/Montos Transacciones Propias	12
2.2.1. Registro Derivados IMCs – Transacciones (Blotter de Operaciones)	12
2.2.2. Registro Derivados Clientes – Transacciones (Blotter de Operaciones)	19
2.2.3. Opciones del Blotter de Transacciones	27
3. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES	39
3.1. Estados del Proceso de Compensación – CRCC	39
3.2. Consulta de Rechazos de Compensación	41
3.3. Compensación registro IRS	42
3.4. Retiro de Estado de Compensación	46
4. MODIFICAR	48
4.1. Modificaciones con Contraparte IMC	49
4.2. Modificaciones con Clientes o Comitentes	50
5. FRACCIONAR	51
6. BOTONES ENVIAR, NUEVO, LIMPIAR	53
7. REGISTRO DE OPERACIONES	54
7.1. Registro Spot IMC – IMC	57
7.2. Registro Spot con origen Spot Efectivo IMC - IMC	58

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

7.3.	Registro Next Day IMC – IMC.....	59
7.4.	Registro Forward IMC – IMC.....	60
7.5.	Registro Swap IMC – IMC.....	61
7.6.	Registro Opciones IMC – IMC	63
7.7.	Registro IRS IMC - IMC	64
7.8.	Registro CCS IMC – IMC.....	67
7.9.	Registro Otros Derivados IMC – IMC.....	70
7.10.	Registro Spot IMC – Clientes.....	71
7.11.	Registro Next Day IMC – Cliente.....	72
7.12.	Registro FIX IMC – Clientes	74
7.13.	Registro Forward IMC – Cliente	78
7.14.	Registro Swap IMC – Cliente	80
7.15.	Registro Opciones	82
7.16.	Registro IRS IMC - Clientes.....	83
7.17.	Registro CCS IMC – Clientes	87
7.18.	Registro Otros Derivados IMCs – clientes	90
8.	ASIGNACIÓN DE TASA REFERENCIAL EN OPERACIONES FIX	92
9.	INFORMACIÓN ADICIONAL	92

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

INTRODUCCIÓN

Este instructivo describe el funcionamiento del Módulo de Registro de Divisas del sistema SET-FX. Este módulo permite a los afiliados registrar operaciones entre IMCs en pares de monedas, así como operaciones entre IMC y Cliente, en cumplimiento de lo establecido en la Resolución No. 4 de enero de 2009 del Banco de la República y la Circular Reglamentaria Externa DODM317.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

OBJETIVO

El objetivo de este instructivo es explicar de manera detallada las funcionalidades, opciones y herramientas disponibles para el registro de operaciones a través del Módulo de Registro de Divisas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

1. INGRESO AL MODULO REGISTRO DE DIVISAS

Para ingresar al módulo, diríjase al ícono Mercado y seleccione la opción Registro de Divisas. Al hacerlo, se desplegará una ventana que contiene los mercados disponibles en este módulo: Spot, Next Day, Fix, Forward, Swap, IRS/CCS, Opciones y Otros Derivados.



Ilustración 1 Mercado Registros de Divisas

1.1. Estructura de la Ventana “Registro de Derivados – Registrar Transacciones”

La ventana está compuesta por los siguientes elementos:

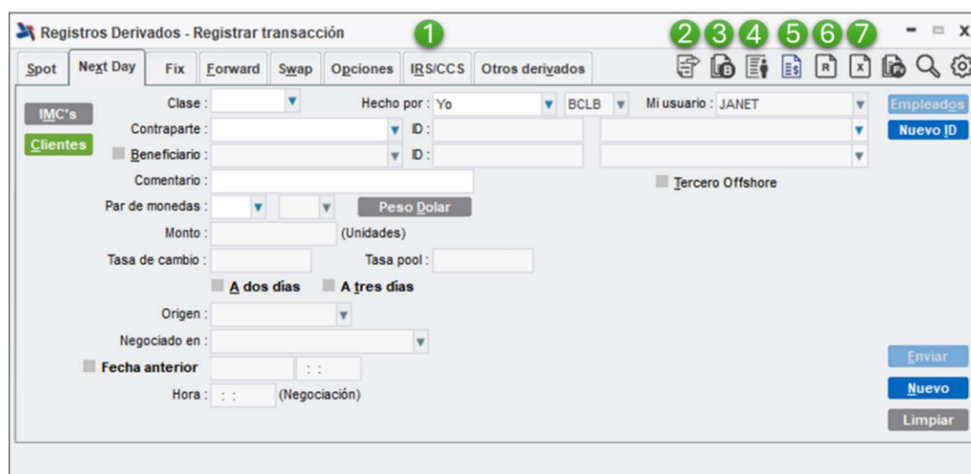

 The image shows a window titled 'Registros Derivados - Registrar transacción'. It has a tabbed interface with tabs for 'Spot', 'Next Day', 'Fix', 'Forward', 'Swap', 'Opciones', 'IRS/CCS', and 'Otros derivados'. The 'Spot' tab is active. The window contains various input fields and buttons. On the left, there are tabs for 'IMC's' and 'Clientes'. The main area has fields for 'Clase', 'Hecho por' (set to 'Yo'), 'BCLB', 'Mi usuario' (set to 'JANET'), 'Contraparte', 'Beneficiario', 'Comentario', 'Par de monedas' (set to 'Peso Dolar'), 'Monto', 'Tasa de cambio', 'Tasa pool', 'A dos días', 'A tres días', 'Origen', 'Negociado en', 'Fecha anterior', and 'Hora'. There are also buttons for 'Enviar', 'Nuevo', and 'Limpiar'. A green circle with the number '1' is placed over the 'Spot' tab, and a series of green circles with numbers '2' through '7' are placed over the top right corner of the window.

Ilustración 2 Ventana Registro Derivados

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

Ítem	Nombre	Descripción
1	Pestañas de submercados	El módulo está organizado en pestañas que representan los distintos submercados. Al seleccionar una pestaña, se mostrarán los campos específicos correspondientes a ese submercado.
2	Importación XML	Permite gestionar la importación de operaciones mediante archivos XML.
3	Precios/Montos transacciones propias	Esta opción permite visualizar las operaciones registradas en el módulo. El usuario puede filtrar y listar las transacciones según su tipo: entre IMCs o entre IMCs y Clientes.
4	Comitentes	Muestra los clientes o comitentes creados por la entidad. El usuario puede ingresar o eliminar clientes. Para modificaciones como cambios en la razón social, corrección de nombres o actualización del NIT, la entidad debe realizar la solicitud al administrador del sistema SET-FX.
5	Resumen de precios/montos transados hoy	Presenta un resumen general de las transacciones registradas entre IMCs, operaciones con otros pares de monedas y transacciones entre IMCs y Clientes.
6	Solicitudes de registro	Muestra el detalle de las solicitudes de registro enviadas y su estado. Aplica únicamente para registros entre IMCs y otros pares de monedas.
7	Anulaciones y solicitudes de anulación	Presenta el detalle de las solicitudes de anulación para registros entre IMCs y otros pares de monedas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

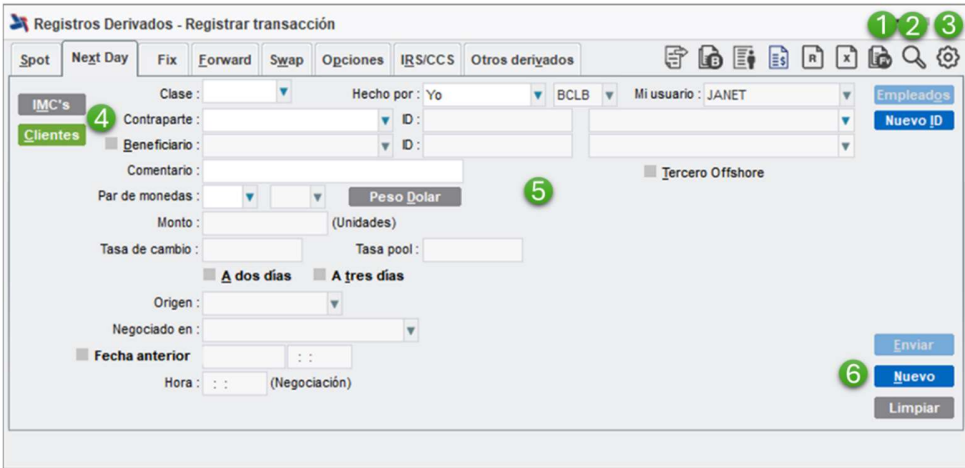


Ilustración 3 Ventana Registro Derivados

Ítem	Nombre	Descripción
1	Transacciones por fecha de vencimiento	Muestra las operaciones entre IMCs y Clientes en mercados derivados, organizadas por fecha de vencimiento.
2	Consultas	Permite validar todas las transacciones y anulaciones realizadas en el módulo de Registro de Divisas.
3	Configuración mercado	Facilita la configuración para la importación de operaciones mediante archivos XML.
4	Tipo de registro	El usuario puede seleccionar el tipo de registro a realizar: entre IMCs y otros pares de monedas, o entre IMCs y Clientes.
5	Diligenciamiento de campos	Según el tipo de operación seleccionada, se habilitarán los campos correspondientes.
6	Botones de Enviar, Nuevo, Limpiar	Botones de Acción Enviar: Se activa cuando los datos de la operación han sido ingresados correctamente. Permite registrar la operación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Nuevo: Permite iniciar un nuevo registro utilizando los datos del registro anterior.
- Limpiar: Borra todos los campos para iniciar un nuevo registro desde cero.

1.2. Creación y Asociación de Comitentes o Clientes

Para gestionar clientes en el sistema SET-FX, el usuario debe tener habilitada la opción "Nuevo ID". En caso de que esta opción no esté disponible, deberá solicitar su activación al administrador de usuarios de su entidad, el cual enviara un correo electrónico dirigido a soportesetfx@set-icap.co.

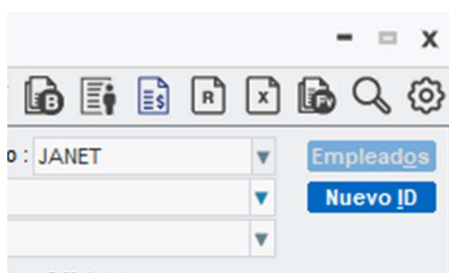


Ilustración 4 Botón Nuevo ID

1.2.1. Creación de un nuevo cliente

Para registrar un cliente y asociarlo a su entidad, diligencie los campos solicitados siguiendo este orden:

- Tipo de Identificación: Seleccione una de las opciones disponibles (*Cédula, Cédula nueva, NIT, Pasaporte, Tarjeta de Identidad, Tarjeta de Identidad nueva, Cédula de Extranjería, Registro Civil, Empresa del exterior, Código SWIFT*).
- Identificación: Ingrese el número o código correspondiente según el tipo de documento seleccionado.
- Nombre del Comitente: Registre la razón social o nombre completo.
- Tipo de Inversionista: Defina si es Persona Natural o Persona Jurídica.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- e) Indicadores Tributarios: Seleccione "Sí" o "No" para los estados de Exento de IVA, Autorretenedor y Sujeto.
- f) País de Residencia: Seleccione el país correspondiente.
- g) Sector Económico: Ingrese el código CIU asignado al cliente.

Al completar los datos, se habilitará el botón "Aceptar". Haga clic para confirmar la creación y asociación del cliente a su entidad.

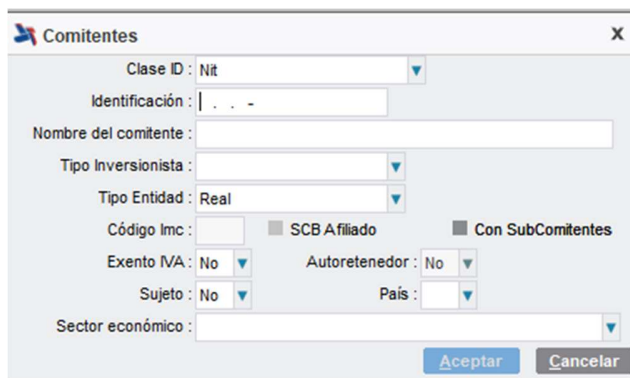


Ilustración 5 Ventana Comitentes

1.2.2. Asociación de un cliente existente

Si el cliente ya existe en el sistema, puede asociarlo directamente:

- Haga clic en el botón "Nuevo ID".
- Seleccione el Tipo de Identificación e ingrese el número o valor correspondiente.
- El sistema cargará automáticamente la información preexistente.
- Haga clic en "Aceptar" para finalizar la asociación.

1.2.3. Registro de Agentes del Exterior

Antes de crear un agente del exterior, es obligatorio verificar si ya se encuentra registrado en el sistema:

- a) Ingrese a www.set-icap.com.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- b) Diríjase a la sección "SET ICAP FX".
- c) Acceda a Productos y Servicios > Información Sistema SET-FX > Descargar.
- d) Consulte el archivo "Listado de Agentes del Exterior" o acceda directamente a través de este [enlace](#).

Si el agente no se encuentra en el listado: El usuario deberá enviar una solicitud formal al correo soportesetfx@set-icap.co, adjuntando la siguiente información:

- Nombre completo o razón social.
- Tipo de Inversionista (Natural o Jurídico).
- Indicadores Tributarios (Exento de IVA, Autorretenedor y Sujeto - Sí/No).
- País de origen.
- Sector Económico (código CIIU).

2. BOTONES DE HERRAMIENTAS

2.1. Importación por XML

El sistema permite la importación de operaciones entre un IMC y un cliente mediante un archivo estructurado en formato XML.



Ilustración 6 Botón Importar XML

Para validar el correcto funcionamiento de este mecanismo, se recomienda consultar el instructivo de importación XML, disponible en nuestro portal web.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

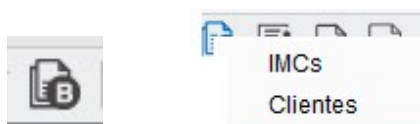
2.2. Precios/Montos Transacciones Propias

El usuario puede listar las operaciones registradas según el tipo de registro realizado, ya sea entre IMCs o con Clientes.

En el blotter de operaciones, se visualizan las características generales de los registros efectuados.



Ilustración 7 Opción Precios/Montos Transacciones Propias



2.2.1. Registro Derivados IMCs – Transacciones (Blotter de Operaciones)

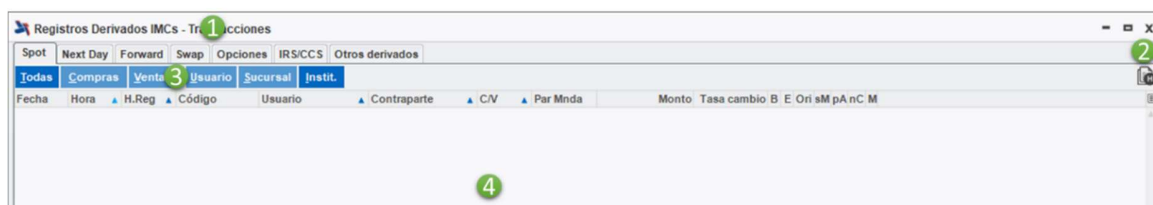


Ilustración 8 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Pestañas de submercados	El blotter está dividido en pestañas según el submercado. Al seleccionar una, se mostrarán únicamente las operaciones correspondientes.
2	Días anteriores	Permite consultar operaciones registradas en fechas anteriores.
3	Filtros de visualización	El usuario puede aplicar filtros para facilitar la búsqueda de operaciones específicas.
4	Operaciones registradas	Muestra el detalle de las operaciones registradas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Registros Derivados IMCs - Transacciones													
Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados							
1	2	3	4	5	6	7	8	9					
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori sM pA nC M	
15/02/22	07:12:36	08:29:16	O2C3FZSZA0	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	ECV / CAD	2'000,000.00	3235.6000		F		
15/02/22	07:12:36	08:28:19	O2C3FZSZ9Y	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	KRW / USD	2'000,000.00	3.2356000		S		
15/02/22	08:05:02	08:29:37	O2C3FZSZA2	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	ZAR / COP	2'000,000.00	3235.6000		O		
15/02/22	08:05:06	08:26:35	O2C3FZSZ9W	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	642'000,000.00	4023.3200		E		M
15/02/22	08:06:05	08:30:24	O2C3FZSZA4	JANET	DVNB HENRY	Venta	ARS / COP	2'000,000.00	425.36366		E	S	
15/02/22	08:33:00	08:33:21	O2RVH7J18M	JANET	DVNB HENRY	Venta	GBP / USD	5'600,000.00	3.2555400	B	O		

Ilustración 9 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Fecha	Fecha de registro.
2	Hora	Hora de negociación del registro
3	H. Reg	Hora de realizado el registro
4	Código	Código que identifica a cada operación en el Sistema SET-FX.
5	Usuario	Nombre del usuario quien realizo la negociación.
6	Contraparte	Nemotécnico y nombre del usuario contraparte
7	C/V	Tipo de operación compra/venta
8	Par Mnda	Nemotécnico del par de monedas correspondientes a la negociación.
9	Monto	Monto correspondiente a la operación. Se visualiza en función de la primera moneda.

Algunas definiciones de las columnas informativas podrán variar de acuerdo con el submercado seleccionado:

- Submercado Spot

Registros Derivados IMCs - Transacciones

SpotNext DayForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

1234567

Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori sM pA nC M
26/01/26	08:05:06	09:22:48	O06B5NG5L3	JANET	DVNB HENRY	Compra	GBP / JPY	56'000,000.00	456.33300		E	
26/01/26	08:05:06	09:30:27	O2RV7XYOOD	JANET	DVNB HENRY	Compra	KRW / USD	540,000.00	3.8560000	B	S	
26/01/26	08:05:06	09:30:15	O2RV7XYO0B	JANET	DVNB HENRY	Compra	FRF / BRL	540,000.00	3856.0000	B	E	U M
26/01/26	08:05:06	09:22:21	O06B5NG5KZ	JANET	DVNB HENRY	Compra	PEN / USD	56'000,000.00	456.33300		O	M
26/01/26	08:05:06	09:22:35	O06B5NG5L1	JANET	DVNB HENRY	Compra	CLP / CAD	56'000,000.00	4563.3300		F	M
26/01/26	08:05:06	09:21:38	O06B5NG5KX	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	56'000,000.00	4563.3300		E	✖

Ilustración 10 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Tasa cambio	Precio pactado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2	B	Registro realizado mediante el bróker
3	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
4	Ori	Identifica el origen del registro: • S – Spot • F – Swap Forward • O – Swap O/N • U – Swap Futuro • E – Spot Efectivo
5	sM	Bandera de solicitud de modificación. • Estado en color azul; se solicitó una modificación. • Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
6	pA	Permiso de anulación X- permitido
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercado Next Day

Registros Derivados IMCs - Transacciones

Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados										
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.											
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	FV B	E	Ori	sM pA nC M			
26/01/26	08:05:06	09:53:05	O06B5NG5L5	JANET	DVNB HENRY	Compra	SGD / USD	56'000,000.00	39.335500	3	E	F	M			
26/01/26	08:05:06	09:53:25	O06B5NG5L7	JANET	DVNB HENRY	Compra	ZAR / USD	56'000,000.00	3933.5500	1	O*					
26/01/26	08:05:06	09:52:07	O2RV7XYOOJ	JANET	DVNB HENRY	Compra	AUD / CAD	12'000,000.00	3.4563300	2	B	U				
26/01/26	08:05:06	10:00:10	O06B5NG5L9	JANET	DVNB HENRY	Compra	ZAR / USD	56'000,000.00	3933.5500	1	O*					

Ilustración 11 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	FV	Fecha valor, aplica solo para operaciones del mercado Next Day. Indica la cantidad de días pactado el registro.
2	B	Registro realizado mediante el bróker
3	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
4	Ori	Identifica el origen del registro: • N –NextDay • F – Swap Forward

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- O – Swap O/N, Al realizar operaciones con este origen, el sistema permite agilizar el proceso de registro mediante el copiado de información entre submercados. Para utilizar esta función, siga estos pasos:
 - Haga clic derecho sobre la operación correspondiente.
 - Seleccione la opción "Cargar datos Registro Spot".

Efecto de la acción: Esta función permite copiar automáticamente los datos del registro Next Day al submercado Spot, evitando el ingreso manual de la información.



- U – Swap Futuro

5	sM	Solicitud de modificación. • Estado en color azul; se solicitó modificación. • Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
6	pA	Permiso de anulación X- permitido
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercados Forward



Ilustración 12 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	Ori	Identifica el origen del registro:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- S – Swap
- F – Forward-Forward
- O – Outright
- XO – FIX

4	T	Tipo de asignación de tasa. Para los registros entre IMCs en otros pares de monedas, la asignación de tasa será: M - Manual
5	Est.	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia el proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.



Ilustración 13 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Ncp	No compensado: Esta columna mostrará el estado cuando una operación previamente compensada inicia el proceso de retiro de compensación
2	sM	Solicitud de modificación. • Estado en color azul; se solicitó modificación. • Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
3	pA	Permiso de anulación X- permitido
4	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercado Swap y Opciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

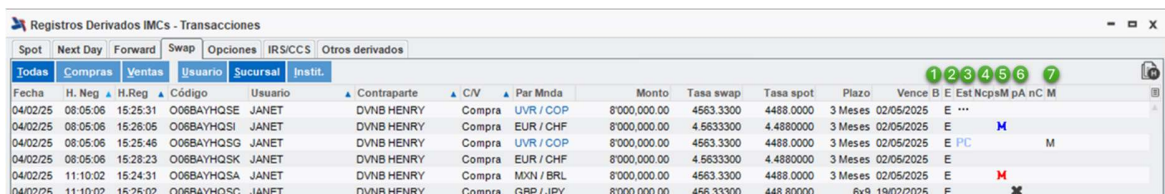


Ilustración 14 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX.
3	Est.	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia su proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.
4	Ncp	No compensado: Esta columna mostrará el estado cuando una operación previamente compensada inicia el proceso de retiro de compensación.
5	sM	Solicitud de modificación. - Estado en color azul; se solicitó modificación. - Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
6	pA	Permiso de anulación X- permitido
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Otros derivados



Ilustración 15 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Indica que el registro fue realizado por medio del bróker

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	sM	Solicitud de modificación. - Estado en color azul; solicita modificación. - Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
4	pA	Permiso de anulación X- permitido
5	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- IRS/CCS



Ilustración 16 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Indica que el registro fue realizado por medio del bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	Est	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia el proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.
4	Ncp	No compensado. Esta columna mostrara los estados cuando una operación compensada inicia el proceso de retiro de compensación.
5	sM	Solicitud de modificación. - Estado en color azul; solicita modificación. - Estado en color rojo; pendiente de confirmación o rechazo de la modificación.
6	Pr/Am	Indica que el registro fue ingresado con la opción de periodos rotos y/o amortizaciones. Con los siguientes valores:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

		• A – Solo amortizaciones • R – Solo periodos rotos • S – Periodos rotos y amortizaciones • D – Solo día de corte
7	PA	Indicador que la operación fue registrada con pagos adicionales.
8	pA	Permiso de anulación X- permitido
9	M	Identifica los registros que han sido modificados.

2.2.2. Registro Derivados Clientes – Transacciones (Blotter de Operaciones)

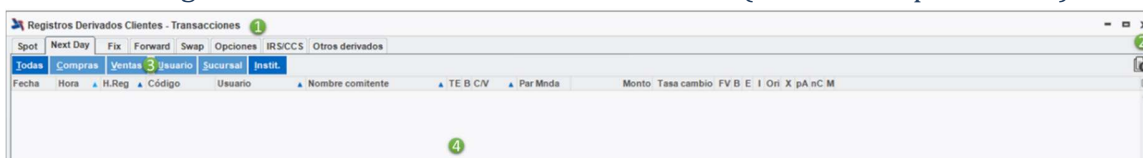


Ilustración 17 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Pestañas de submercados	El blotter de operaciones de registros se encuentra dividido por pestañas y dependiendo de la selección del submercado, se visualizarán las operaciones registradas.
2	Días anteriores	Permite la consulta de operaciones registradas en fechas anteriores.
3	Filtros de visualización	El usuario podrá aplicar filtros de visualización de operaciones.
4	Operaciones registradas	Visualiza las operaciones registradas.



Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio B	E	Ori	I	X	pA	nC	M
26/01/26	08:05:06	11:51:04	O06B5NG5LB	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Venta	FRF / CAD	56'000,000.00	4235.0052	E	S					M
26/01/26	08:05:06	11:51:30	O06B5NG5LD	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Venta	USD / COP	12,000.00	4235.0052	F	S					
26/01/26	08:05:06	11:52:14	O06B5NG5LH	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Compra	CNH / USD	30'000,000.00	4.2350052	U	S					
26/01/26	08:05:06	14:57:03	O2RV7XYOOO	JANET	BANCOMER TRANSFER SERV...	E Compra	USD / COP	12'000,000.00	3562.0000	B	S					
26/01/26	08:30:00	14:16:18	O06B5NG5LJ	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500	O	S					X

Ilustración 18 Ventana Transacciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

		- F – Swap Forward - O – Swap O/N - U – Swap Futuro - E – Spot Efectivo
4	I	Información Complementaria/Información adicional del registro.
5	X	Indica que la operación fue importada mediante el mecanismo de XML.
6	pA	Permiso para anulación X - Permitido
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercado Next Day:

Registros Derivados Clientes - Transacciones

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.															
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE	B	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	FV	B	E	I	Ori	X	pA	nC	M
26/01/26	08:05:06	15:17:32	O06B5NG5M5	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R	Compra	USD / MXN		30'000,000.00	32.222000	1	E	•	O*					
26/01/26	08:05:06	15:16:53	O06B5NG5M3	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R	Compra	USD / MXN		30'000,000.00	32.222000	1	E	•	O*					
26/01/26	08:05:06	15:15:42	O2RV7XYOOR	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T	Compra	USD / COP		12'000,000.00	3856.0000	1	B	•	N					M
26/01/26	08:30:00	14:53:45	O06B5NG5LL	JANET	Administradora de Fondos de ...	T	S Compra	USD / COP		500,000.00	4012.5600	3		•	N					X

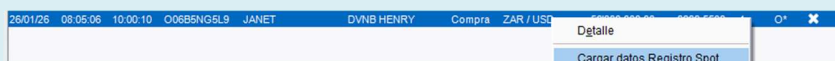
Ilustración 20 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	FV	Fecha valor, aplica solo para operaciones del mercado Next Day. Indica la cantidad de días pactado el registro.
2	B	Registro realizado mediante el bróker B - Bróker
3	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
4	I	Información Complementaria/ Información adicional del registro.
5	Ori	Identifica el origen del registro: - N – NextDay - F – Swap Forward - O – Swap O/N, Al realizar operaciones con este origen, el sistema permite agilizar el proceso de registro mediante el copiado de información entre submercados. Para utilizar esta función, siga estos pasos: - Haga clic derecho sobre la operación correspondiente. - Seleccione la opción "Cargar datos Registro Spot".

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Efecto de la acción: Esta función permite copiar automáticamente los datos del registro Next Day al submercado Spot, evitando el ingreso manual de la información.



- U – Swap Futuro

6	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.
7	pA	Permiso para anulación X - Permitido
8	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercado FIX

Registros Derivados Clientes - Transacciones																
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados									
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.											
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B CV	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	Ort	I	X pa nC
26/01/26	08:05:06	15:42:25	O0685NGEM7	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R	Compra	USD / COP	30000.000.00 USD	0.0000	6	03/02/2026	03/02/2026	P	X	X
26/01/26	08:30:00	14:53:45	O0685NGSLP	JANET	Administradora de Fondos de	T	S Compra	USD / COP	5000.000.00 USD	-2.0000	296	20/11/2026	18/02/2026	T	X296	X
26/01/26	10:22:55	11:21:28	O0685CUUV	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T	Compra	CNH / USD	5600.000.00 CNH	0.0000	Hoy	28/01/2026	28/01/2026	M	X0	X

Ilustración 21 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Vence	Fecha de vencimiento del registro.
2	F. Asig	Fecha asignación de la tasa. El sistema SET-FX mostrará en color rojo los registros cuyas asignaciones de tasa manual aún no han sido establecidas por el usuario.
3	T	Tipo de asignación de tasa al vencimiento: • T – TRM • P – Promedio FIX SET-FX • M - Manual
4	Ori	Cantidad de días pactado
5	I	Información Complementaria/ Información adicional del registro.
6	X	Indica que la operación fue importada mediante el mecanismo de XML.
7	pA	Permiso de anulación X - Permitido
8	M	Identifica los registros que han sido modificados.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Submercado Forward



Ilustración 22 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	Ori	Identifica el origen del registro: • X0 – FIX • S – Swap • F – Forward-Forward • O – Outright
4	T	Tipo de asignación de tasa: • T – TRM • P – Promedio FIX SET-FX • M - Manual
5	FR	Operaciones que han sido fraccionadas



Ilustración 23 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Ncp	No compensado. Esta columna mostrara los estados cuando una operación compensada inicia el proceso de retiro de compensación.
2	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
3	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

4	pA	Permiso de anulación X - Permitido
5	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Swap

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 04/02/2025

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.															
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence B	E	FR	Est	Ncp	I	X	pAnC	M
04/02/25	08:30:00	19:23:54	O06BAYHQVG	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Venta	USD / COP	500.000.00	3245.3200	3123.9400	0x168	22/07/2025	E					X		M
04/02/25	13:00:00	20:34:42	O06BAYHQWB	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000.000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025				NC				
04/02/25	13:00:00	20:34:55	O06BAYHQWD	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000.000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025				...				
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWK	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	3'000.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWM	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'000.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQW1	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'600.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						X

Ilustración 24 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	FR	Operaciones que han sido fraccionadas
4	Est	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia el proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.
5	Ncp	No compensado. Esta columna mostrara los estados cuando una operación compensada inicia el proceso de retiro de compensación.

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 04/02/2025																				
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.															
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B CV	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence B	E	FR	Est	Ncp	I	X	pAnC	M
04/02/25	08:30:00	19:23:54	O06BAYHQVG	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Venta	USD / COP	500.000.00	3245.3200	3123.9400	0x168	22/07/2025	E					X		M
04/02/25	13:00:00	20:34:42	O06BAYHQWB	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000.000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025				NC				
04/02/25	13:00:00	20:34:55	O06BAYHQWD	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000.000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025				...				
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWK	JANET	BANK OF AMERICA N.A. SAN F...	E Venta	USD / COP	3'000.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWM	JANET	BANK OF AMERICA N.A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'000.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQW1	JANET	BANK OF AMERICA N.A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'600.000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR						X

Ilustración 25 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
2	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

3	pA	Permiso de anulación X - Permitido
4	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Opciones

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados							
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Opt	Par Mnda	Monto	Tasa pactada	Plazo	Vence	%V B E Est Ncp	I X pAnC M
05/02/25	08:30:00	11:40:26	O06BGLA4XL	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	Call	NZD / COP	500.000.000	3000.3200	0/201	25/08/2025	1.20	• X
05/02/25	10:02:41	11:53:59	O2RVVZNUUS	JANET	STANDARD CHARTERED BAN...	E Compra	Put	USD / COP	5600.000.000	4123.6600	1 Mes	05/03/2025	0.36 B	• X
05/02/25	11:07:08	11:41:34	O06BGLA4XN	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000.000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33	•
05/02/25	11:07:08	11:41:51	O06BGLA4XP	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000.000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33	•
05/02/25	11:07:08	11:42:06	O06BGLA4XR	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000.000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33 E	•

Ilustración 26 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Indica que el registro fue realizado por medio del bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	Est.	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia el proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.
4	Ncp	No compensado: Esta columna mostrará el estado cuando una operación previamente compensada inicia el proceso de retiro de compensación
5	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
6	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.
7	pA	Permiso de anulación X - Permitido
8	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercado IRS/CCS

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 30/12/2025																	
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados										
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.												
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B E Est	Ncp	Pri/Am	I X	pAnC M	
30/12/25	09:26:00	09:28:14	O3WT85IFY0	JUANCJ	FONDO PARA FINANCIAMIENT...	R	Venta	COP / COP	147,000'000.000.00		18 Meses	02/07/2027	NC		•	X	M
30/12/25	09:26:00	09:28:14	O3WT85IFY2	JUANCJ	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T	Compra	COP / COP	106,000'000.000.00		2 Años	05/01/2028			•	X	M
30/12/25	10:35:42	11:42:26	O4D74COE6X	JUANCJ	EDILANDINA S.A.S	R	Compra	USD / COP	1'532.677.55	3755.0000	0/920	07/07/2028			•		M

Ilustración 27 Ventana Transacciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Ítem	Nombre	Descripción
1	Est	Estado; identifica las diferentes etapas por los cuales un registro inicia el proceso de compensación. Cuando el registro contiene “...” indica que la operación podrá ser compensada.
2	Ncp	No compensado. Esta columna mostrara los estados cuando una operación compensada inicia el proceso de retiro de compensación.
3	Pr/Am	Indica que el registro fue ingresado con la opción de periodos rotos y/o amortizaciones. Con los siguientes valores: • A – Solo amortizaciones • R – Solo periodos rotos • S – Periodos rotos y amortizaciones • D – Solo día de corte
4	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
5	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.
6	pA	Permiso de anulación
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Otros derivados

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados							
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B E I X pAnC M			
05/02/25	08:30:00	12:36:03	O06BGLA4XZ	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	750,000.00	4920.1500	0x1783	24/12/2029	● X		
05/02/25	10:02:41	12:37:11	O2RVIVZNUV	JANET	STANDARD CHARTERED BAN...	E Compra	USD / COP	5'600,000.00	4552.0200	0x56	02/04/2025	B ● ✕		
05/02/25	11:07:08	12:38:47	O06BGLA4Y1	JANET	FABIAN RODRIGO TORRES B...	R Venta	USD / COP	850'000,000.00	4122.0000	0x23	28/02/2025	E ● M		
05/02/25	11:07:08	12:44:56	O06BGLA4Y3	JANET	FABIAN RODRIGO TORRES B...	R Venta	USD / COP	850'000,000.00	4122.0000	0x23	28/02/2025	F ●		

Ilustración 28 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
4	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo de XML.
5	pA	Permiso de anulación
6	M	Identifica los registros que han sido modificados.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2.2.3. Opciones del Blotter de Transacciones

Desde la ventana de “Registros Derivados Clientes/IMCs – Transacciones”, el usuario podrá acceder distintas opciones, las cuales variarán según el tipo de operación seleccionada:

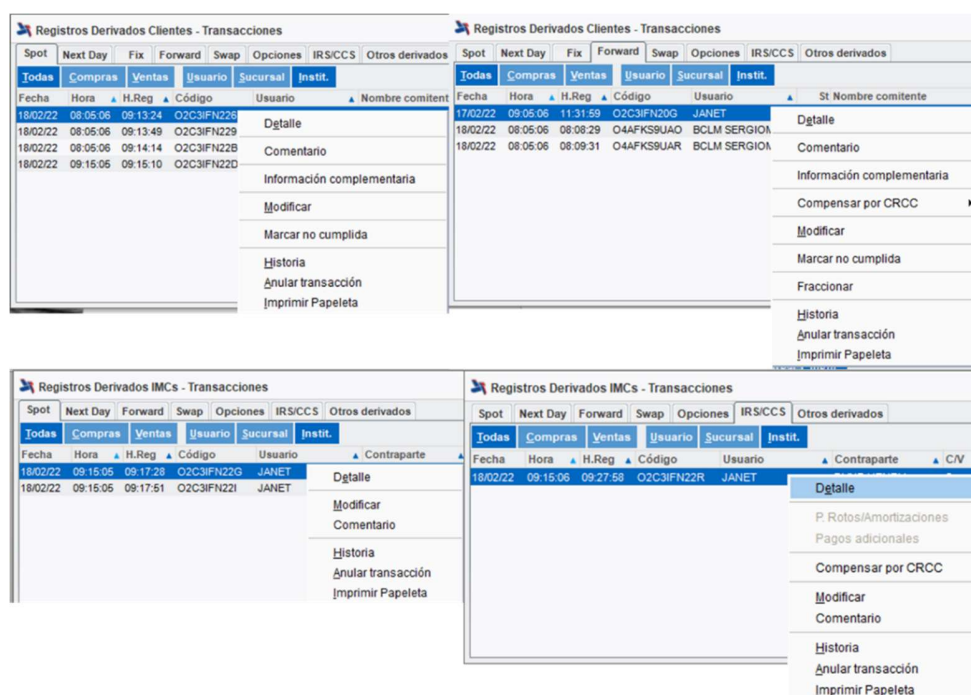


Ilustración 29 Opciones Ventana Transacciones

2.2.3.1. Detalle

La opción permite visualizar el detalle del registro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 17/02/2022 Código: 02C3FN20G Hora de registro: 11:31:59 Hora: 09:05:06

Comprador: BANCOLOMBIA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Janet Patricia Aguilera Roldan

Por parte de:

Vendedor - Nombre comitente: FIDEICOMISOS SOCIEDAD FIDUCIARIA DE OC Nit: 830.054.076-2 Identificación: Real

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Plazo: 18 Meses 17-Ago-2023

Fecha asignación tasa: Viernes 18-Feb-2022 Tasa referencial: TRM

Fecha de pago: 18-Ago-2023 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 560,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 23.6300 SEFable:

Tasa forward: 4025.6300

Tasa spot: 4002.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECCION TESORO NACIONAL

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario:

Estado CRCC:

Fecha anterior:

Ilustración 30 Detalle de Operación

2.2.3.2. Comentario

Permite ingresar un comentario al registro realizado

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Comentarios para transacción

Comentario: Reemplaza Operación

Aceptar Cancelar

Ilustración 31 Ingreso Comentario

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

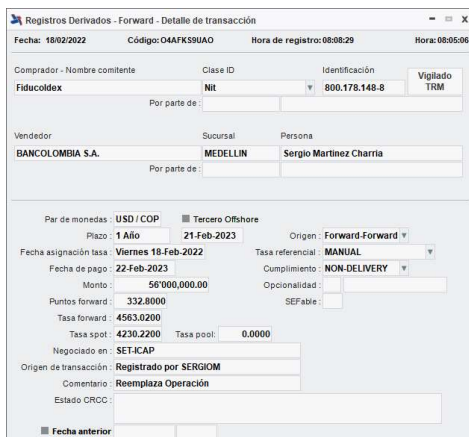


Ilustración 32 Ejemplo Comentario

2.2.3.3. Información Complementaria

Permite ingresar información adicional al registro realizado.

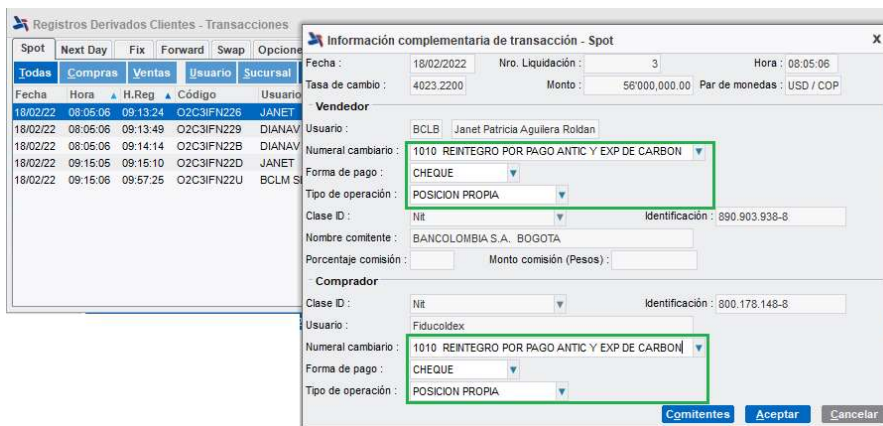


Ilustración 33 Ejemplo Información Complementaria

2.2.3.4. Compensar por CRCC

Existe la posibilidad de enviar los registros a compensación a través de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC).

Para validar el proceso correspondiente, por favor diríjase al apartado "Compensación de Operaciones" dentro de este manual.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

2.2.3.5. Modificar

Se permite la modificación de operaciones de registro.

Para validar el proceso correspondiente, por favor diríjase al apartado "Modificaciones de operaciones" dentro de este manual.

2.2.3.6. Fraccionamiento

Se encuentra disponible la opción para fraccionar operaciones.

Para validar el proceso, por favor diríjase al apartado "Fraccionamiento de operaciones" de este manual.

2.2.3.7. Historia

Muestra las diferentes acciones realizadas sobre la operación, como:

- Registro
- Modificación
- Anulación
- Asignación de precio
- Entre otros



Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Plazo Vence	Info adicional
17/02/22	11:31:59	SETB SRVPPL	Asignación de precio	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
17/02/22	09:05:06	BCLB JANET	Registro	D	USD / COP	560,000.00		18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	09:25:09	BCLB JANET	Modificación de transacción	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	10:32:46	BCLB JANET	Solicita cambio a CRCC	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	10:51:06	SETI JEANN	Expira cambio a CRCC	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	11:53:04	BCLB JANET	Anulación	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	Por fraccionamiento
18/02/22	11:02:03	BCLB JANET	Registro x FR	D	USD / COP	250,000.00	4025.6300	01/45 17/08/2023	

Ilustración 34 Ejemplo Historia

2.2.3.8. Anulación

Permite la anulación de operaciones según la normatividad vigente establecida por el Banco de la República.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

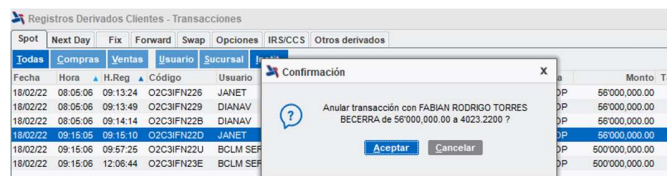


Ilustración 35 Anulación Registro

2.2.3.9. Imprimir papeleta

Permite generar la papeleta de la operación en formato físico o digital, exclusivamente para operaciones registradas el mismo día.

Fecha: 18/02/2022
Hora: 13:39:40

Sistema Electrónico de transacción y registro de moneda extranjera SET-FX

PAPELETA DE NEGOCIACION PARA REGISTROS DE DIVISAS

CLIENTES

Fecha :	18/02/2022
Código :	O2C3IFN22D
Hora :	09:15:05
No Liquidación :	6
Mercado :	Spot
Compra/Venta :	VENTA
Comprador :	Otro
Nombre :	FABIAN RODRIGO TORRES BECERRA
Identificación :	5.547.744.544 Cédula nueva - Real
Por parte de :	
Vendedor :	BANCOLOMBIA S.A.
Ciudad :	BOGOTA
Nombre :	JANET - Janet Patricia Aguilera Roldan
Identificación :	890.903.938-8 Nit
Por parte de :	JOSE NICOLAS PEREZ
Comentario :	
Negociado en :	BANCO DE LA REPUBLICA Tercero Offshore : NO
Tasa de cambio :	4023.2200
Monto :	56,000,000.00 HKD
Par Monedas :	HKD / COP
Origen :	Swap Futuro

BOLB JANET
SET-FX
Página: 1 de 1

Ilustración 36 Ejemplo Papeleta

2.2.3.10. Comitentes

Permite consultar los clientes o comitentes creados por la entidad. El usuario puede registrar o eliminar clientes. Cualquier modificación en los comitentes, como cambio de razón social,

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

corrección de nombre o actualización del NIT, debe solicitarse al administrador del Sistema SET-FX.

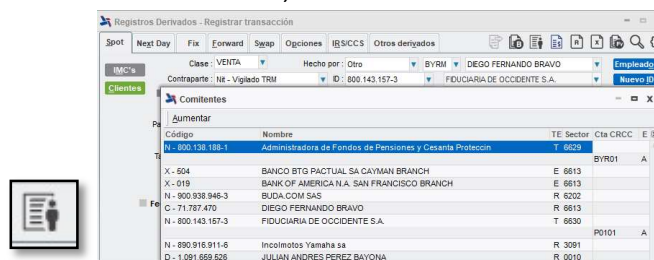


Ilustración 37 Botón Comitentes



Ilustración 38 Ventana Comitentes

Ítem	Nombre	Descripción
1	Aumentar	Permite agregar o asociar nuevos clientes en la entidad.
2	Código	Muestra el tipo y número de identificación de cada cliente creado.
3	Nombre	Nombre o razón social del cliente
4	TE	Tipo de entidad del cliente: - T – Vigilado TRM - R – Real - V – Vigilado - E – Agente del exterior
5	Sector	Sector económico o clasificación de actividad económica Código CIU que corresponde al cliente.
6	Cta CRCC	Cuenta CRCC asociada al cliente. Usada para la compensación de operaciones por CRCC.
7	E	Estado; indica si el cliente se encuentra activo o inactivo en el Sistema SET-FX.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2.2.3.11. Resumen de precios/montos transados hoy



Ilustración 39 Botón Resumen Precios/Montos

Muestra un resumen de las transacciones registradas a nivel de mercado. Permitiendo escoger dos opciones:

- Resumen divisas IMCs / Clientes

Muestra un resumen diario de los registros realizados en el mercado, según la opción seleccionada. El usuario puede consultar operaciones de días anteriores mediante el campo "Fecha" en la parte superior derecha de la ventana y también realizar consultas mensuales.



Registros Derivados IMCs - Resumen por día				
Resumen por Mes		Fecha: 18/02/2022		
Mercado	ParMnda	Hora última	Monto Negociado	Num. Trans.
Spot	EUR/COP	09:15:05	6'000,000	1
Spot	USD/COP	09:15:05	56'000,000	1
Forward	JPY/AUD	09:15:06	6'000,000	1
IRS/CCS	COP/COP	09:15:06	500'000,000	1

Ilustración 40 Ejemplo Resumen por Día

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Registros Derivados IMCs - Resumen por mes

Fecha : 2022/02

Mercado	ParMnda	Monto Negociado	Num. Trans.
Forward	EUR/USD	14'046,035	4
Forward	JPY/AUD	6'000,000	1
Forward	MXN/BRL	30'000,000	1
Forward	USD/CAD	75'000,000	1
Forward	USD/CLP	75'000,000	1
Forward	USD/MXN	10'000,000	1
Forward	USD/PEN	75'000,000	1
IRS/CCS	COP/COP	11,903'206,250	14
IRS/CCS	USD/COP	100'006,000	4
Next Day	EUR/GBP	30'000,000	1
Next Day	EUR/SEK	20,000	1
Next Day	EUR/USD	12'008,100	4

Ilustración 41 Ventana Resumen por Mes

Registros Derivados Clientes - Resumen por día

Resumen por Mes Fecha : 18/02/2022

Mercado	ParMnda	Hora última	Monto Negociado	Num. Trans.
Spot	HKD/COP	09:15:05	112'000,000	2
Spot	USD/COP	09:15:06	1,112'000,000	4
Forward	USD/COP	11:02:03	112'559,999	6
IRS/CCS	EUR/COP	12:00:31	600,000	1

Ilustración 42 Ventana Resumen por Día

Registros Derivados Clientes - Resumen por m...

Fecha : 2022/02

Mercado	ParMnda	Monto Negociado	Num. Trans.
Forward	CLP/DEM	56'000,000	1
Forward	EUR/COP	3'100,000	2
Forward	EUR/USD	23'531,000	19
Forward	USD/COP	2,457'737,135	151
Forward	USD/GBP	1'119,999	4
Forward	USD/MXN	21'000,000	3
IRS/CCS	COP/COP	523,361'800,000	17
IRS/CCS	EUR/COP	2'400,000	4
IRS/CCS	USD/COP	50,453'770,396	42
IRS/CCS	USD/USD	202'000,000	3
Next Day	CAD/COP	856,200	2
Next Day	EUR/COP	23,000	2

Ilustración 43 Ventana Resumen por Mes

Nota: Para hacer consultas tick by tick de los registros realizados por mercados debe realizar la consulta de días anteriores al actual.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2.2.3.12. Solicitudes de Registro

Opción para visualizar el estado de las solicitudes de registro entre IMCs con pares de monedas diferentes a USD/COP, incluyendo aquellas con origen sea en “efectivo”.

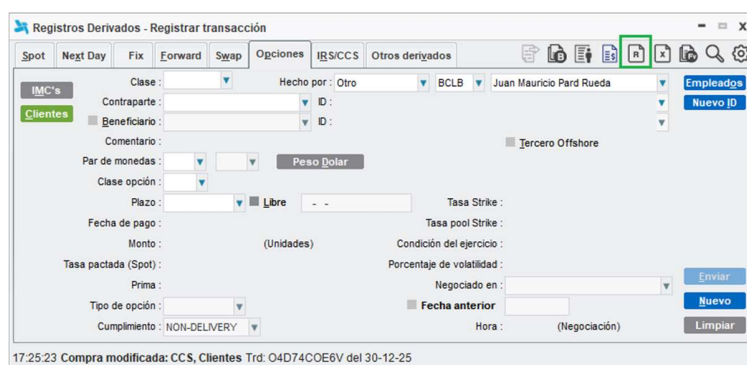


Ilustración 44 Botón Solicitud de Registro



Ilustración 45 Ventana Solicitudes de Registro

Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtros	Filtros de visualización de las solicitudes de registro de operaciones entre IMCs (otros pares de monedas)
2	Estado	Muestra el estado de cada solicitud: - Rechazada; la contraparte rechaza la solicitud del registro - Confirmada; la contraparte confirmo la solicitud del registro - Expirada; la contraparte no confirmo/rechazo la solicitud durante el tiempo establecido (10 minutos) - Pendiente; la contraparte aun no confirma/rechaza la solicitud de registro
3	Solicitudes de registros	Visualiza las solicitudes de registro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

2.2.3.13. Anulaciones y Solicitudes de anulación

Permite consultar las solicitudes de anulación de operaciones entre IMCs con pares de monedas diferentes a USD/COP.



Ilustración 46 Botón Solicitudes de Anulación

Registros Derivados - Anulaciones y Solicitudes de anulación

TodasComprasVentasTodasEnviadasRecibidasTodasExpiradasConfirmadasPendientesRechazadas

Fecha	Hora	E/R	Mercado	Grupo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo	Vence	R xFR	BA	Estado
22/02/22	08:15:23	Recibida Spot	IMC-IMC	Compra	USD / COP	DVNB HENRY		78'900.000.00	4235.5250			R		Expirada
22/02/22	08:15:23	Recibida Spot	IMC-IMC	Compra	EGS / MXN	DVNB HENRY		4,756.22	3960.3300			R		Rechazada
22/02/22	08:15:23	Recibida Next Day	IMC-IMC	Compra	EUR / USD	DVNB HENRY		4,756.22	1.2300000	3		R		Confirmada
22/02/22	08:15:23	Recibida Next Day	IMC-IMC	Compra	CNH / USD	DVNB HENRY		4,756.22	2.5688000	2		R		Pendiente

Ilustración 47 Ventana Solicitud de Anulación

Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtros	Filtros de visualización de las solicitudes de anulación de operaciones entre IMCs (otros pares de monedas)
2	Estado	Muestra el estado de cada solicitud: - Rechazada; la contraparte rechazo la solicitud de anulación - Confirmada; la contraparte confirmo la solicitud de anulación - Expirada; la contraparte no confirmo/rechazo la solicitud durante el tiempo establecido (10 minutos) - Pendiente; la contraparte aun no confirma/rechaza la solicitud de anulación
3	Solicitudes de anulación	Visualiza las solicitudes de registro

2.2.3.14. Transacciones por fecha de vencimiento:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Ilustración 48 Botón Transacciones por Fecha Vencimiento

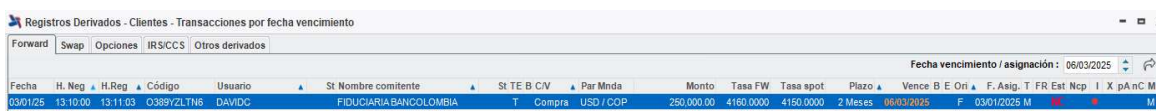


Ilustración 49 Ventana Transacciones por Fecha de Vencimiento

Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtros	Filtros de visualización de las solicitudes de operaciones por mercado entre IMCs/clientes
2	Vence	Muestra la fecha de vencimiento de cada operación color naranja.
3	Solicitudes por vencer	Visualiza las solicitudes pendientes por vencimiento

2.2.3.15. Consultas

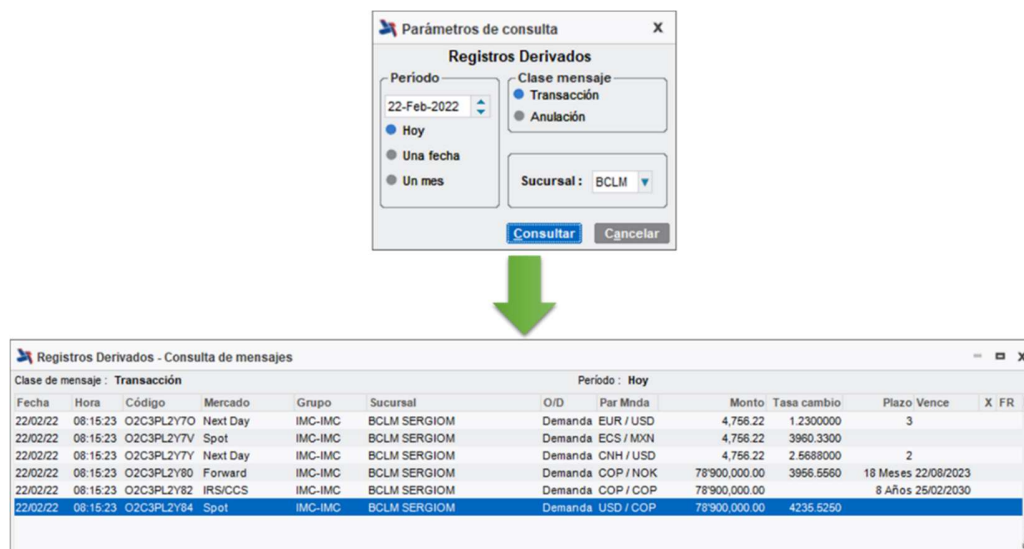
En la opción de "Consultas", el usuario podrá validar todas las transacciones y anulaciones realizadas por las sucursales en el mercado "Registro de Divisas" dentro de un rango de fechas definido: *Hoy, una fecha específica, o un mes completo.*



Ilustración 50 Botón Consultas

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Parámetros de consulta

Registros Derivados

Período: 22-Feb-2022

Clase mensaje: ☒ Transacción ☐ Anulación

Sucursal: BCLM

Registros Derivados - Consulta de mensajes

Clase de mensaje: Transacción Período: Hoy

Fecha	Hora	Código	Mercado	Grupo	Sucursal	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo Vence	X FR
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y70	Next Day	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	EUR / USD	4,756.22	1.2300000	3	
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y7V	Spot	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	ECS / M0N	4,756.22	3960.3300		
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y7Y	Next Day	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	CNH / USD	4,756.22	2.5688000	2	
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y80	Forward	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	COP / NOK	78'900.000.00	3956.5560	18 Meses 22/08/2023	
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y82	IRS/CCS	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	COP / COP	78'900.000.00		8 Años 25/02/2030	
22/02/22	08:15:23	O2C3PL2Y84	Spot	IMC-IMC	BCLM SERGIOM	Demanda	USD / COP	78'900.000.00	4235.5250		

Ilustración 51 Ejemplo Consultas

2.2.3.16. Configuración Mercado

Esta opción permite configurar la importación de operaciones a través de archivos en formato XML.



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Usuario SET-FX BCLM Mi usuario: SERGIOM

Contraparte: Nit - Vigilado TRM ID: 800.178.148-8

Beneficiario: Cédula nueva ID: 1 032 588 774

Ilustración 52 Botón Configuración de Mercado



Configuración

Tipo de importación

☒ Permitir importar XML

☒ Manual ☐ Automático

Aplicar Deshacer Cerrar

Ilustración 53 Ventana Configuración Mercado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

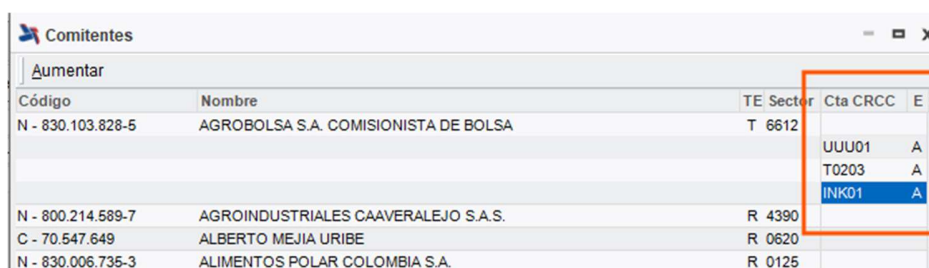
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

3. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

El sistema SET-FX permite la compensación de operaciones mediante la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC). Para utilizar esta funcionalidad, la entidad debe solicitar a la CRCC el código de compensación del cliente, el cual debe ser ingresado con el aval del administrador del aplicativo SET-FX.

Este código puede verificarse desde la ventana principal del módulo Registro de Divisas, haciendo clic en el botón Comitentes. Se abrirá una nueva ventana donde podrá consultar el cliente y su respectivo código de compensación.

Una vez completado el proceso de registro del cliente ante la CRCC, será posible enviar operaciones asociadas a dicho cliente para su compensación.



Código	Nombre	TE	Sector	Cta CRCC	E
N - 830.103.828-5	AGROBOLSA S.A. COMISIONISTA DE BOLSA	T	6612	UUU01	A
N - 800.214.589-7	AGROINDUSTRIALES CAAVERALEJO S.A.S.	R	4390	T0203	A
C - 70.547.649	ALBERTO MEJIA URIBE	R	0620	INK01	A
N - 830.006.735-3	ALIMENTOS POLAR COLOMBIA S.A.	R	0125		

Ilustración 54 Ventana Comitentes

3.1. Estados del Proceso de Compensación – CRCC

Una vez se envía una operación para compensación a través de la CRCC, esta pasa por los siguientes estados, visibles en el blotter de operaciones:

PR (Pendiente de Riesgo) – Color naranja

Indica el inicio del proceso de validación de garantías por parte de la CRCC.

Registros Derivados Clientes - Transacciones

SpotNext DayFixForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B E Ori	F. Asig	T FR SA	Est	Ncp	
10/07/18	08:09:06	ALEJANDRA		ECOPETROL	R	Venta	USD / COP	560.000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018	E	F	10/07/2018	M	PR

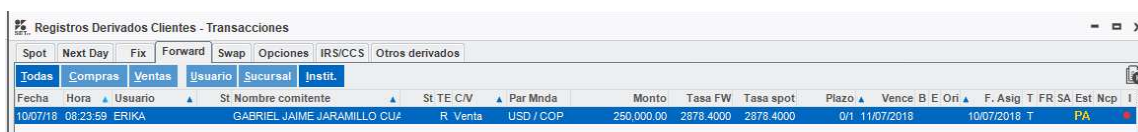
Ilustración 55 Estados de Compensación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

PA (Pendiente de Aprobación) – Color amarillo

La operación se encuentra en proceso de aprobación, tras la validación de garantías.

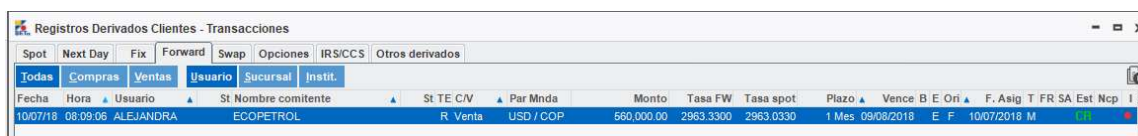


Fecha	Hora	Usuario	St Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B E Ori	F. Asig	T FR SA	Est Ncp
10/07/18	08:23:59	ERIKA	GABRIEL JAIME JARAMILLO CUA	R Venta	USD / COP	250,000.00	2878.4000	2878.4000	0/1	11/07/2018		10/07/2018	T	PA

Ilustración 56 Estados de Compensación

CR (Compensada por Cámara de Riesgo) – Color verde

La operación ha sido aceptada y compensada exitosamente por la CRCC.

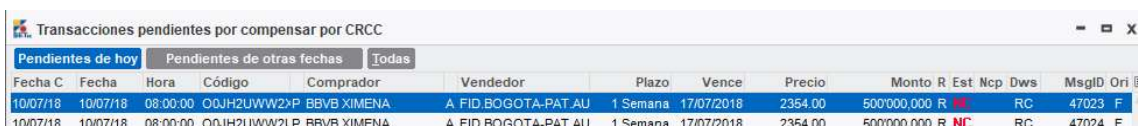


Fecha	Hora	Usuario	St Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B E Ori	F. Asig	T FR SA	Est Ncp
10/07/18	08:08:06	ALEJANDRA	ECOPETROL	R Venta	USD / COP	660,000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018	E F	10/07/2018	M	CR

Ilustración 57 Estados de Compensación

NC (No Compensada) – Color rojo

La operación fue rechazada por la CRCC.



Fecha C	Fecha	Hora	Código	Comprador	Vendedor	Plazo	Vence	Precio	Monto	R Est	Ncp	Dws	MsgID	Ori
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW2XP	BBVB XIMENA	A FID.BOGOTA-PAT.AU	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000,000	R	NC	RC	47023	F
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW2LP	BBVB XIMENA	A FID.BOGOTA-PAT.AU	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000,000	R	NC	RC	47024	F

Ilustración 58 Estados de Compensación

Cuando la contraparte de una operación es un cliente, el usuario puede seleccionar la cuenta CRCC a través de la cual se desea compensar la operación.

Para ello, siga estos pasos:

1. Seleccione la operación correspondiente en el blotter de operaciones.
2. Haga clic derecho sobre el registro.
3. Ubique y seleccione la opción "Compensar por CRCC".

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- El sistema mostrará las cuentas CRCC disponibles; seleccione la cuenta a través de la cual se compensará el registro.

3.2. Consulta de Rechazos de Compensación

Si una operación es rechazada (estado NC), el usuario puede consultar la razón del rechazo siguiendo estos pasos:

- Ubique la operación en estado NC en el blotter de operaciones.
- Haga clic derecho sobre la operación y seleccione la opción "Detalle".
- En el detalle de la operación, en el campo "Estado CRCC", se mostrará la razón específica del rechazo.

Ejemplo:



Ilustración 59 Ejemplo Rechazo de Compensación

A continuación, se enumeran las causales de rechazos que pueden presentarse cuando una operación es rechazada:

Código	Descripción
100	La operación ha quedado en estado "Pendiente". Se enviará una nueva respuesta aceptando o rechazando definitivamente la operación.
200	Código de error de validación por defecto.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

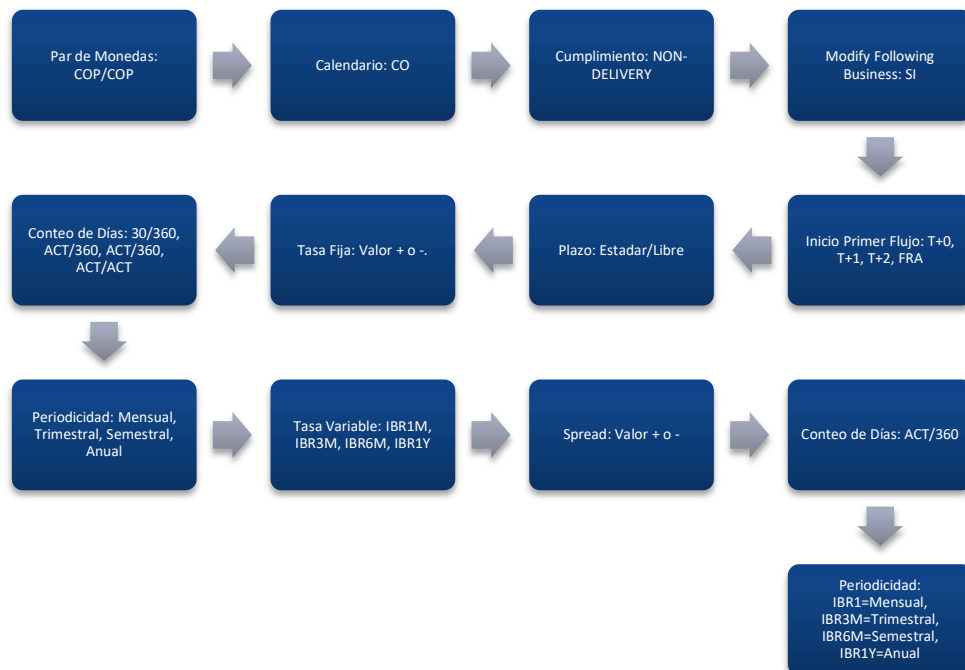
210	El sistema no está disponible para los Sistemas de Registro.
302	La versión de FpML debe ser 4-5.
304	El tipo de mensaje FpML enviado no es soportado.
305	El miembro comprador y el miembro vendedor no corresponden con el código alterno.
308	El producto FpML enviado no es soportado El producto FpML enviado no es soportado.
309	No existe ningún ID de mensaje enviado en el mensaje FpML.
323	La fecha de inicio debe ser mayor o igual a la fecha de negociación y menor a la fecha de vencimiento.
324	El inicio del primer flujo debe ser T+2.
325	El plazo de la operación debe ser menor a 18 meses.
326	La periodicidad debe ser un solo flujo.
327	El conteo de días debe ser ACT/360.
501	El Miembro o entidad (Party) participe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o definitivamente.
504	No existe un vencimiento válido para la Fecha de Vencimiento (ValueDate) enviada.
505	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo, mayor que cero.
506	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo menor que 999,999,999.
507	La estructura del precio (Rate) que fue enviada no es válida para la Cámara.
508	El valor (Amount) excede el monto por operación para alguno de los participantes.
509	La Garantía Diaria constituida para la Cuenta, no es suficiente para aceptar la operación que ha sido enviada a Cámara.
511	La fecha de creación de la operación (TradeDate) no puede ser mayor que la fecha de creación del mensaje que contiene la operación (CreationTimeStamp).
512	El mismo Miembro y Cuenta no pueden tomar posición de compra y de venta en una misma operación.
513	El número de identificación del mensaje (MessageID) ya ha sido utilizado en una operación enviada previamente a Cámara.
514	La operación que se envió para ser anulada no existe o no se negoció durante la sesión actual.
515	El monto de la operación debe ser múltiplo de 500.000.000.
516	La CRCC no acepta la operación bilateral por no pasar los criterios de elegibilidad.
517	Se ha producido un problema en la decodificación de FpML normalmente por encontrar campos que no corresponden con el esquema.
518	Operaciones pendientes que llegan a Fin de Día sin novarse.

3.3. Compensación registro IRS

Para el envío de operaciones IRS Plain Vanilla a CRCC se deben cumplir ciertas condiciones, las condiciones para el envío de estas operaciones se detallan a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

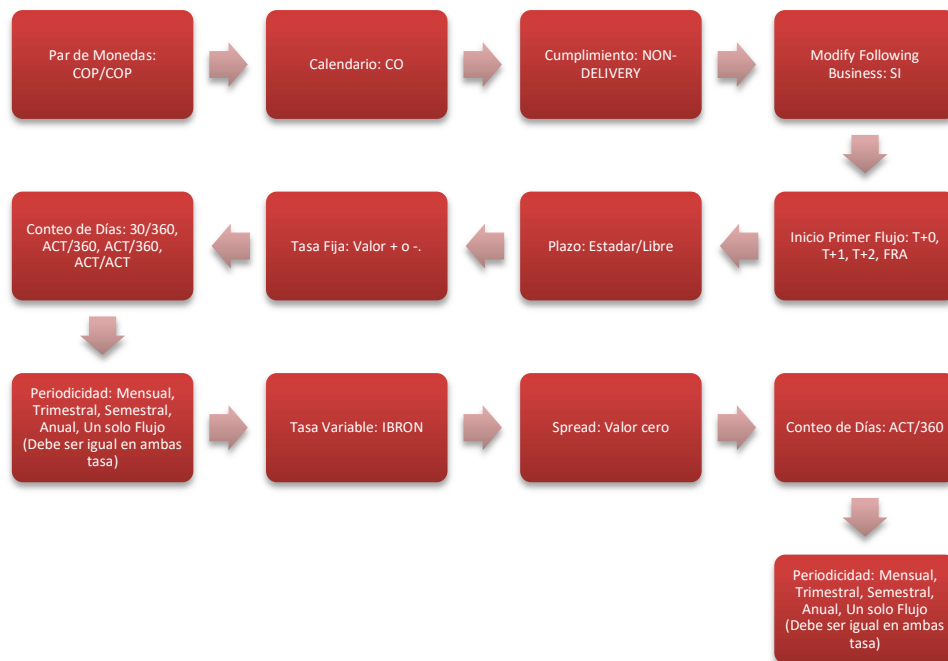
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



En el caso para la compensación de operaciones IRS OIS, se deben cumplir las siguientes condiciones:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

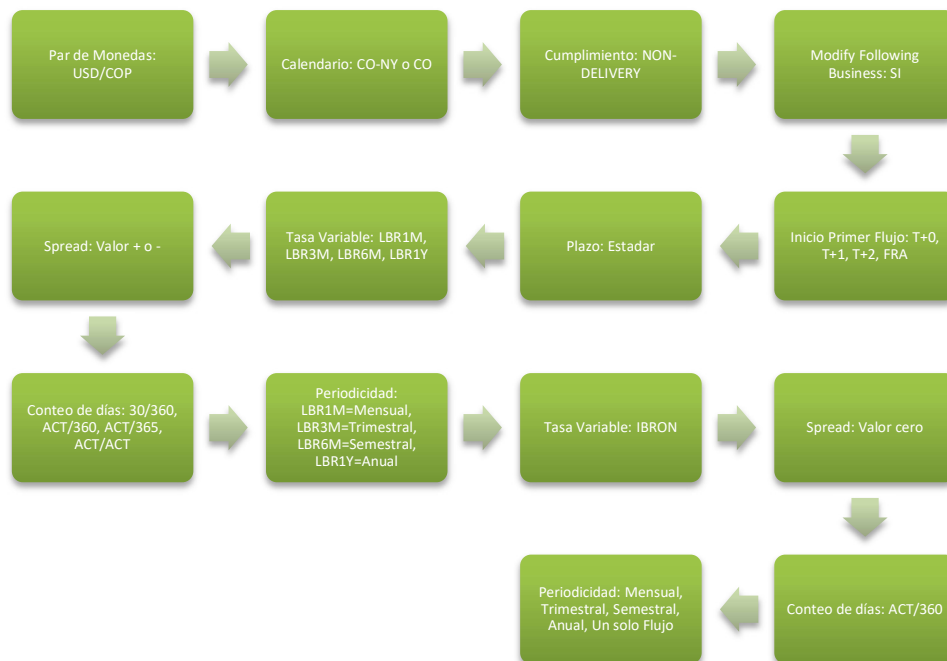
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Para los registros CCS (Cross Currency Swaps), se deben cumplir las siguientes condiciones para que la operación pueda ser compensada:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



En registros de operaciones Opciones, se deben tener en cuenta las siguientes condiciones:



Una vez se realiza el registro de la operación y se cumplen las condiciones previamente mencionadas, en el blotter de operaciones, la columna “Estado” mostrará el símbolo “...” indicando que la operación está habilitada para ser enviada a compensación.

Registros Derivados Clientes - Transacciones																										
Spot		Next Day		Fix		Forward		Swap		Opciones		IRS/CCS		Otros derivados												
Todas		Compras		Ventas		Usuario		Sucursal		Instit.																
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario		Nombre comitente		TE	B	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B	E	Est.	Ncp	Pri	Am					
30/07/25	08:05:06	10:54:29	O06BAIV5G6	JANET		Fiducoldex		T	Compra	USD / COP		562,222.00	4235.0000	1 Año	03/08/2026											
30/07/25	08:05:06	10:56:32	O06BAIV5G8	JANET		Fiducoldex		T	Compra	COP / COP		562,222.00		1 Año	31/07/2026											

Ilustración 60 Compensar Registro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Al hacer clic derecho sobre un registro y seleccionar la opción "Detalle", si algunos campos se resaltan en color rojo, esto indica que no cumplen con las condiciones requeridas por la CRCC para la compensación de operaciones en los mercados IRS, CCS u Opciones.

3.4. Retiro de Estado de Compensación

Es posible retirar el estado de compensado de una operación previamente enviada a la CRCC, siempre y cuando se cumplan las siguientes condiciones:

- La solicitud debe realizarse el mismo día en que la operación fue enviada a compensación.
- La operación debe estar vigente.
- La operación debe contar con previa autorización de la CRCC para el desmarcado de la operación y se pueda continuar el proceso de retiro.

El proceso es el siguiente:

1. Ingrese al módulo Registros Derivados Cliente – Transacciones.
2. Ubique la operación correspondiente.
3. Haga clic derecho sobre la operación y seleccione "Retirar de la CRCC".

Una vez iniciado el proceso del retiro de compensación, esta pasa por los siguientes estados, visibles en el blotter de operaciones:

PC (Pendiente Cámara) – Letras en amarillo: indica que la solicitud de desmarcación fue enviada y está pendiente de respuesta por parte de la CRCC.

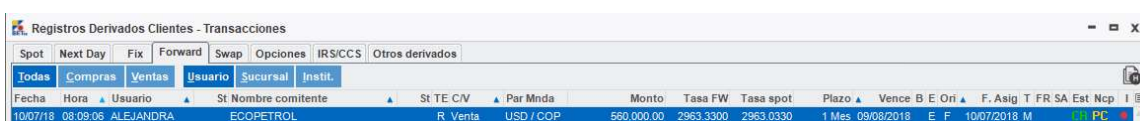


Ilustración 61 Estados de Retiro de Compensación

Si la solicitud es aprobada, la operación no mostrará ningún estado en el blotter.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

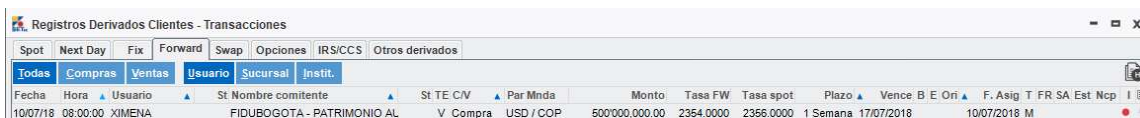


Ilustración 62 Retiro Compensación

Si la solicitud es rechazada, la operación conservará el estado CR (Compensada por Cámara de Riesgo).

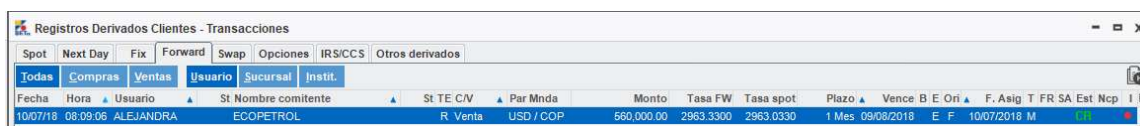


Ilustración 63 Retiro Compensación

Proceso para Operaciones IRS entre IMCs

Ingresa al módulo Registro Derivados IMCs – Transacciones, pestaña IRS/CCS.

Haga clic derecho sobre la operación y seleccione "Retirar de la CRCC".

Estados asociados:

CN: La entidad envía una solicitud a la contraparte para retirar el estado de compensación.

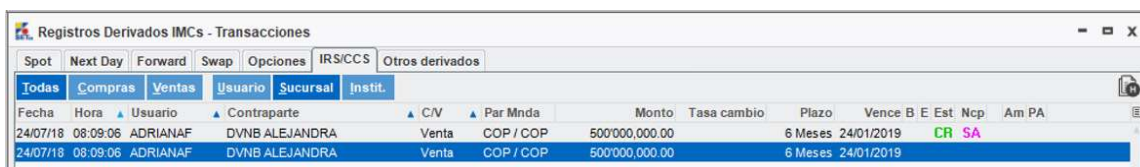


Ilustración 64 Retiro Compensación

SA (Solicita Anulación): La contraparte puede aceptar o rechazar la solicitud de desmarcación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA
24/07/18	08:09:06	ADRIANAF	DVNB ALEJANDRA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR	SA	

Ilustración 65 Retiro Compensación

PC (Pendiente Cámara) – Letras en amarillo: indica que la solicitud fue enviada y está pendiente de respuesta por parte de la CRCC.

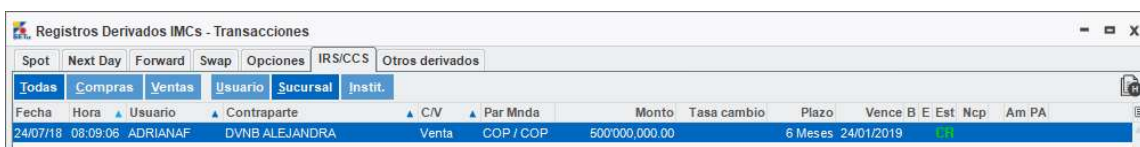


Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA
24/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	TAUB ADRIANAF	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR	PC	

Ilustración 66 Retiro Compensación

Si la solicitud es aprobada, la operación no mostrará ningún estado en el blotter.

Si la solicitud es rechazada, la operación conservará el estado CR.



Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA
24/07/18	08:09:06	ADRIANAF	DVNB ALEJANDRA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR		

Ilustración 67 Rechazo Retiro Compensación

4. MODIFICAR

El sistema permite modificar operaciones registradas, conforme a la normatividad vigente establecida por el Banco de la República.

Para realizar una modificación:

- Seleccione la operación que desea modificar.
- Haga clic derecho sobre ella y elija la opción Modificar.
- Se abrirá una ventana donde el usuario podrá editar los campos necesarios.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

4.1. Modificaciones con Contraparte IMC

Cuando la operación involucra a otro IMC como contraparte, se enviará una solicitud de modificación. La contraparte podrá aceptar o rechazar dicha solicitud.

Si la solicitud es enviada por la entidad, en el blotter de operaciones, la columna “sM” mostrará una “M” en color azul, indicando que la solicitud está pendiente de respuesta.

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.																Fecha
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	PriAm	PA	sM	PA	nC	M	
18/07/25	08:05:06	13:53:01	O06BW2YDPC	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	55,555.66		7 Años	22/07/2032										

Ilustración 68 Solicitud Modificación

Si la solicitud es enviada por la contraparte, la columna “sM” mostrará una “M” en color rojo, indicando que la entidad debe aceptar o rechazar la modificación.

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.															Fecha: 18/07/25
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	PriAm	PA	sM	PA	nC	M
18/07/25	09:05:06	09:47:27	O06BW2YDP8	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	5,600'000,000.00		8 Años	22/07/2033									
18/07/25	09:05:06	13:46:07	O06BW2YDPA	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	5,600'000,000.00		8 Años	22/07/2033									

Ilustración 69 Solicitud Modificación

Ejemplo modificación de un registro entre dos IMCs:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO		Código: IGO02024
	REGISTROS DE DIVISAS		Archivo: IGO02024

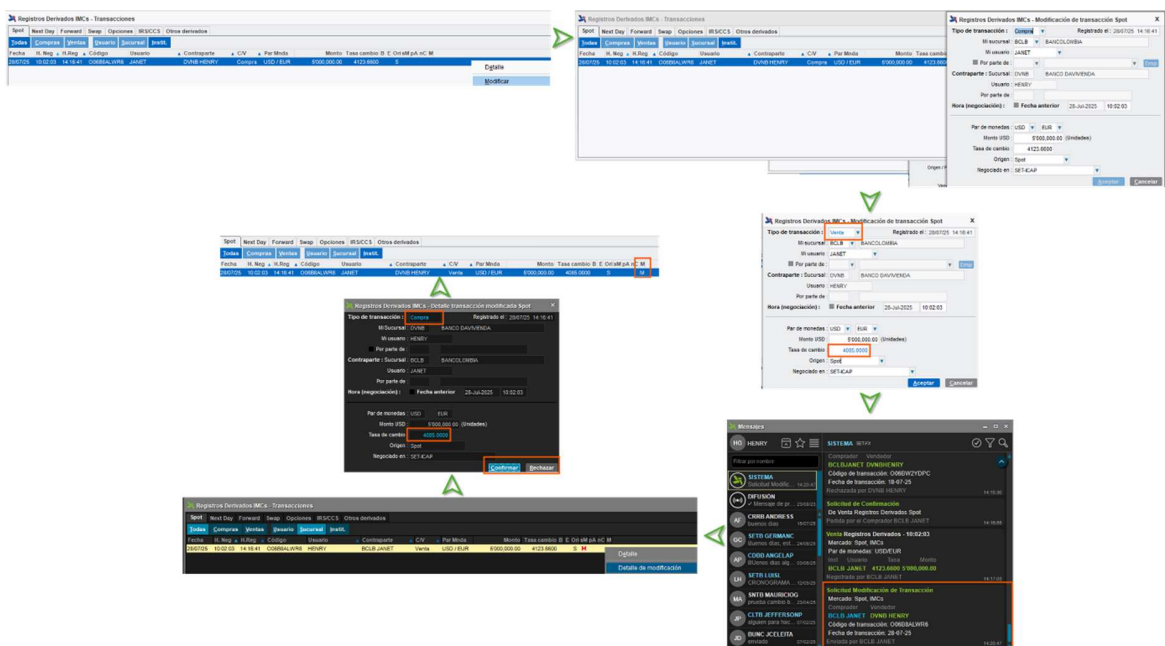


Ilustración 70 Ejemplo Modificación

4.2. Modificaciones con Clientes o Comitentes

Cuando el registro corresponde a un cliente o comitente, la modificación se aplica de forma inmediata, una vez se actualicen los campos requeridos.

Cualquier modificación realizada en la ventana de modificaciones se resaltará en color azul, indicando que se hizo una modificación.

Ejemplo modificación de un registro entre un IMC/Cliente

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

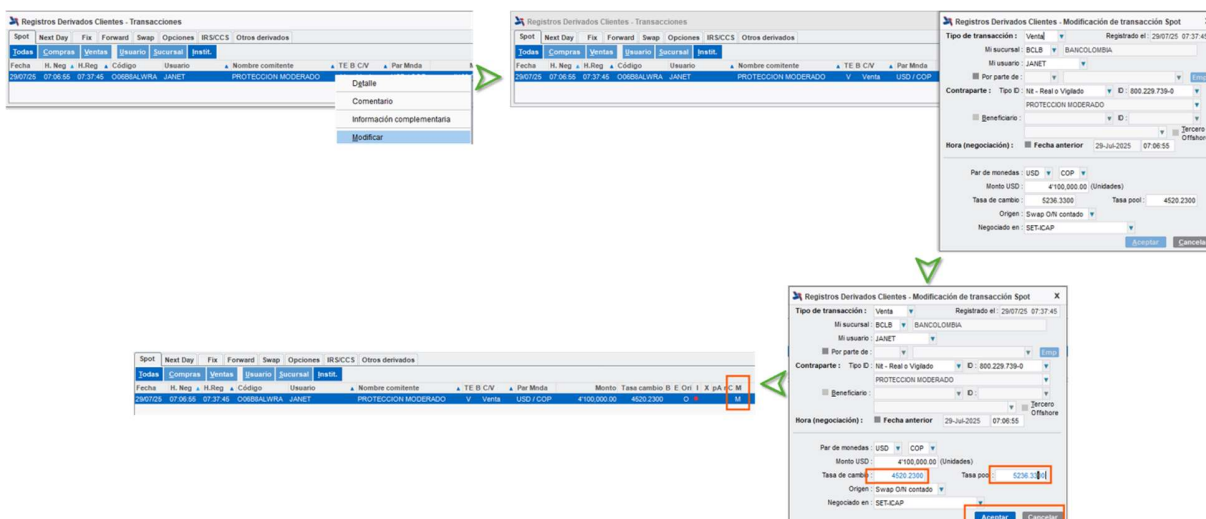


Ilustración 71 Ejemplo Modificación

5. FRACCIONAR

Brinda la opción de fraccionar registro de operaciones Forward y Swap. Para realizar el fraccionamiento de una operación registrada, siga los siguientes pasos:

- Abra la ventana del blotter de operaciones.
- Ubique el mercado correspondiente.
- Seleccione la operación deseada.
- Haga clic derecho y elija la opción "Fraccionar".

Al seleccionar la opción Fraccionar, se abrirá una nueva ventana con los detalles generales de la operación. En la parte inferior, encontrará el botón "Aumentar", que permite iniciar el proceso de fraccionamiento.

Al hacer clic en Aumentar, se desplegará una nueva ventana donde deberá ingresar la información requerida para crear la primera fracción. El usuario podrá continuar ingresando fracciones hasta alcanzar el monto total de la operación original.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO02024
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO02024

En la parte inferior de la ventana se mostrará la cantidad de fracciones ingresadas, las cuales podrán ser modificadas o eliminadas si es necesario realizar ajustes.

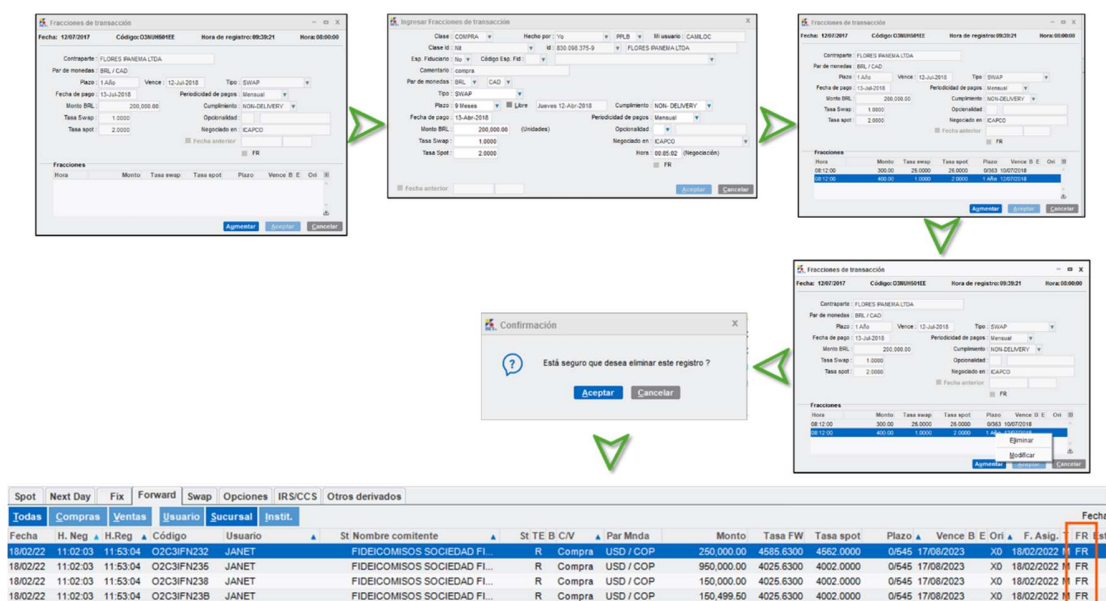


Ilustración 72 ejemplo Fraccionar

Al hacer clic derecho sobre cualquiera de las fracciones generadas, se habilita la opción "Detalle de la operación", donde se pueden visualizar los siguientes datos del registro:

- Fecha del registro original
- Código de la operación
- Hora del registro inicial

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

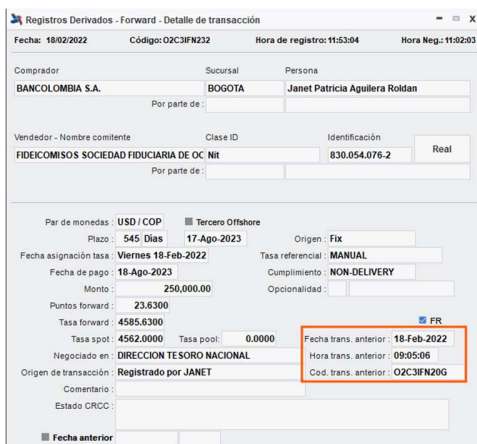


Ilustración 73 Detalle Fraccionamiento

La operación original, al ser fraccionada, es anulada automáticamente y puede ser consultada en la ventana de Anulaciones, identificada con la marca “FR”, que indica que fue anulada por fraccionamiento.



Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Plazo	Vence	Monto	Puntos	Tasa Spot	Tasa FW	Info adicional
17/02/22	11:31:59	SETB SRVPL	Asignación de precio	D	USD / COP	18 Meses	17/08/2023	560,000.00	23.6300	4002.0000	4025.6300	
18/02/22	09:25:09	BCLB JANET	Modificación de transacción	D	USD / COP	18 Meses	17/08/2023	560,000.00	23.6300	4002.0000	4025.6300	
18/02/22	10:32:46	BCLB JANET	Solicita cambio a CRCC	D	USD / COP	18 Meses	17/08/2023	560,000.00	23.6300	4002.0000	4025.6300	
18/02/22	10:51:06	SETI JEANN	Expira cambio a CRCC	D	USD / COP	18 Meses	17/08/2023	560,000.00	23.6300	4002.0000	4025.6300	
18/02/22	11:53:04	BCLB JANET	Anulación	D	USD / COP	18 Meses	17/08/2023	560,000.00	23.6300	4002.0000	4025.6300	Por fraccionamiento

Ilustración 74 Historia Fraccionamiento

Adicionalmente, en la ventana Historia de la Postura, el campo Comentario especificará que la operación fue eliminada “por fraccionamiento”.

Restricciones Importantes

- Las operaciones que ya hayan sido compensadas no pueden ser fraccionadas.
- Las operaciones fraccionadas sí pueden ser enviadas a compensación posteriormente.

6. BOTONES ENVIAR, NUEVO, LIMPIAR

- **Enviar:** El botón “Enviar” se activa cuando los datos de la operación están ingresados correctamente. Una vez activado, se procede al registro.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- **Nuevo:** Permite realizar un nuevo registro reutilizando los datos del registro anterior.
- **Limpiar:** Borra la información de todos los campos, dejando la ventana lista para un nuevo registro.

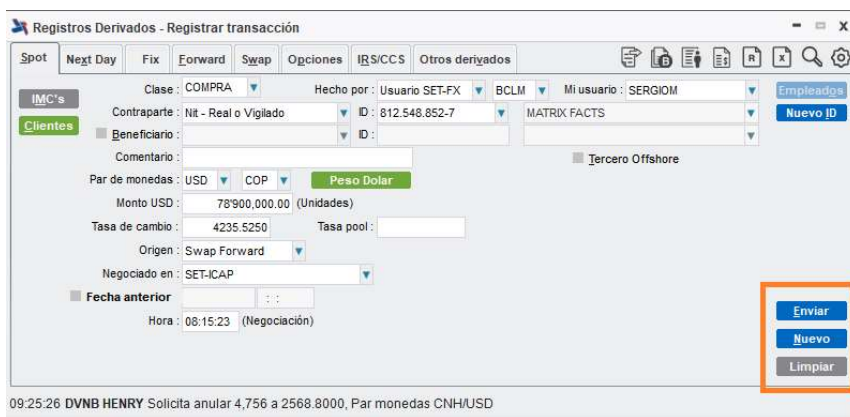


Ilustración 75 Botones Registrar Transacción

7. REGISTRO DE OPERACIONES

Para dar inicio al registro de operaciones en el mercado “Registro de Derivados” debe elegir el submercado, posterior seleccionar el tipo de registro a realizar:

IMCs – IMCs



Ilustración 76 Registro IMC

IMCs - Clientes.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Ilustración 77 Registro Clientes

Cada operación, independientemente del tipo de submercado, incluye campos Obligatorios. Si estos no son diligenciados, el botón "Enviar" no se activa.

La opción “Hecho por”, permite realizar registros:

- A nombre propio.
- A nombre de otro usuario de la misma entidad que esté vinculado en el sistema SET-FX.
- A nombre de un funcionario de la entidad que no tenga un usuario registrado en el sistema SET-FX.

Al desplegar el listado de esta opción, se muestran las tres alternativas mencionadas.

Al seleccionar la opción "**Otro**", automáticamente se activará el botón "**Empleados**", que permite crear nuevos empleados. así mismo, el usuario podrá listar los empleados ya creados.



Suc.	Identificación	Nombre completo	Cargo	Cód
BCLB	C - 91.517.957	RODRIGO ORDUZ GALVIS	TRADER SENIOR	O02X
BCLM	C - 43.982.914	DIANA MARCELA BERNAL OROZCO	TRADER	O032
BCLR	C - 73.183.125	JAIME ANTONIO SEGOVIA CARRASCAL	GERENTE COMERCIAL PYME	O0SN
BCLR	D - 1.140.828.100	JOSE NICOLAS PEREZ BORRERO	GTE CCIAL. MESA DINERO CARIBO0BB	

Ilustración 78 Botón Empleados

Para crear un Empleado se debe realizar los siguientes pasos:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Presionar Botón “Empleados”
- Seleccionar opción “Aumentar”
- Ingresar la información del usuario
- Clic en botón “Aceptar”.

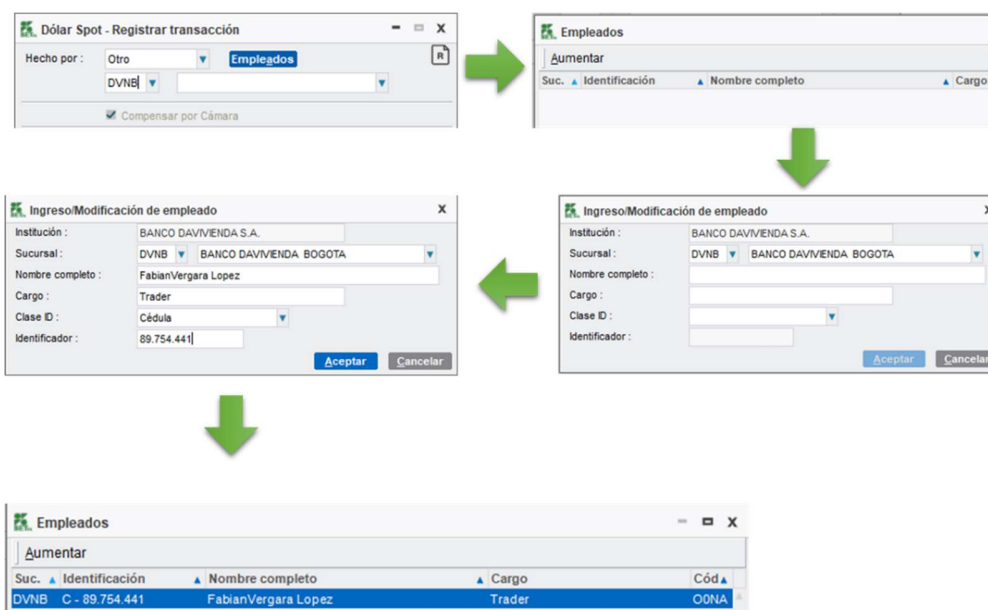


Ilustración 79 Ejemplo Ingresar Empleado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.1. Registro Spot IMC – IMC



11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio, valor expresado con base al segundo par de moneda (Obligatorio)
- Origen: Origen de la Operación (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados".
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.2. Registro Spot con origen Spot Efectivo IMC - IMC

El usuario debe seleccionar el botón “Peso Dólar” y de forma predeterminada el sistema asignara el origen “Spot Efectivo”.



Ilustración 80 Ejemplo Spot Efectivo

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: “Peso Dólar” (Opcional)
- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio, valor expresado con base al segundo par de moneda (Obligatorio)
- Origen: “Spot Efectivo”
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.3. Registro Next Day IMC – IMC



Ilustración 81 Ejemplo Next Day

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Casillas “A dos días”, “A tres días”, podrá marcar una de las dos casillas he indicará la cantidad de días de vencimiento 2 y 3 días, si no marca ninguna casi el sistema lo toma como un Next Day a 1 día.
- Origen: Origen de la Operación (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.4. Registro Forward IMC – IMC



Ilustración 82 Ejemplo Next Day

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Origen/Producto: Origen de la Operación, opciones Forward-Forward, OTRA, Swap, Fix (Opcional)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de asignación tasa: Aplica para registros Forward con origen FIX. En el cual se indicará la fecha de asignación de la tasa. (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha debe ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Puntos Forward: cantidad de puntos establecidos en la operación (Obligatorio)
- Tasa Forward (Obligatorio)
- Tasa de spot (Obligatorio)
- Tasa de Referencia: utilizada para registros con origen Fix. Para registros entre IMCs la tasa de referencia por defecto es “MANUAL”.
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.5. Registro Swap IMC – IMC



Ilustración 83 Ejemplo Swap

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Código C/P: Nemotécnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Tipo: opciones permitidas SWAP, FORWARD-FORWARD
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa Swap (Obligatorio)
- Tasa Spot (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.6. Registro Opciones IMC – IMC



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's
Clase: COMPRA Hecho por: Yo BYRM Mi usuario: JUANV Empleados

Código C/P: PPLB PPLB BANCO POPULAR BOGOTA Usuario C/P: DAVIDC

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Clase opción: PUT

Plazo: 6 Meses Libre Jueves 03-Jul-2025 Tasa Strike: 12.0000

Fecha de pago: 04-Jul-2025 Condición del ejercicio:

Monto USD: 5'000,000.00 (Unidades) Porcentaje de volatilidad: 0.10

Tasa pactada (Spot): 4344.0000 Negociado en: SET-ICAP

Prima COP/USD: 10.000000 Fecha anterior: Hora: 14:45:00 (Negociación)

Tipo de opción: AMERICANA

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Enviar Nuevo Limpiar

11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

Ilustración 84 Ejemplo Opciones

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Obligatorio)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Clase opción: PUT o CALL
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa pactada (Spot) (Obligatorio)
- Prima: Valor en función del par de monedas COP/USD (Obligatorio)
- Tipo de Opción: AMERICANA, EUROPEA, OTRA (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Tasa Strike (Obligatorio)
- Condición del ejercicio (OPCIONAL)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Porcentaje de Volatilidad (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.7. Registro IRS IMC - IMC

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 BYRM Mi usuario: JUANV Empleados

Código C/P: PPLB PPLB BANCO POPULAR BOGOTA Usuario C/P: DAVIDC

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dólar

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO Mié 08-Ene-2025 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Plazo: 10 Años Libre Mar 09-Ene-2035 Vencimiento sin ajustar: 08-Ene-2035

Fecha de pago: 09-Ene-2035 Modify following business: SI Segundo monto: 5'000,000.00 COP

Monto COP: 5'000,000.00 (Unidades) Conteo de días Periodicidad Opcionalidad: NO

Tasa de interés COP: F 2.500000% ACT/360 Trimestral Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: V SFR6M + 10.0000 ACT/360 Trimestral Negociado en: SET-ICAP

☒ P. Rotos/Amortizaciones Editar

☒ Pagos adicionales Editar

Fecha anterior

Hora: 14:45:00 (Negociación) Enviar Nuevo Limpiar

11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

Ilustración 85 Ejemplo IRS

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (OPCIONAL)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA (Obligatorio)
- Calendario: CO, CO-NY (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Fecha de pago: La fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Modify Following Business: SI, NO (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Interés: va de acuerdo con el par de monedas, pueden ser ingresadas con signo negativo. Tipo de tasa de interés: Fijo, Variable.

Si la opción seleccionada es Fijo, activara el campo para el ingreso del porcentaje de la tasa. Opción Variable, desplegará las diferentes tasas de referencias creadas en el sistema SET-FX:

- DTF90 - DTF 90 DIAS
- EUR3M - EURIBOR6M
- EUR6M - EURIBOR6M
- FBIL - FBIL Reference Price
- FED - FEDFUNDS
- FFON - FED FUNDS OVERNIGHT
- IBR1M - IBR 1 MES
- IBR3M - IBR 3 MESES
- IBR6M - IBR 6 MESES
- IBRON - IBR OVER NIGTH
- IPC - IPC
- LBR1M - LIBOR 1 MES
- LBR1Y - LIBOR 1 AÑO
- LBR3M - LIBOR 3 MESES
- LBR6M - LIBOR 6 MESES
- SFR1M - SOFR 1M
- SFR3M - SOFR 3M
- SFR6M - SOFR 6M
- SFRON - SOFR OVER NIGHT
- VAC - INDICES VAC BCR
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)

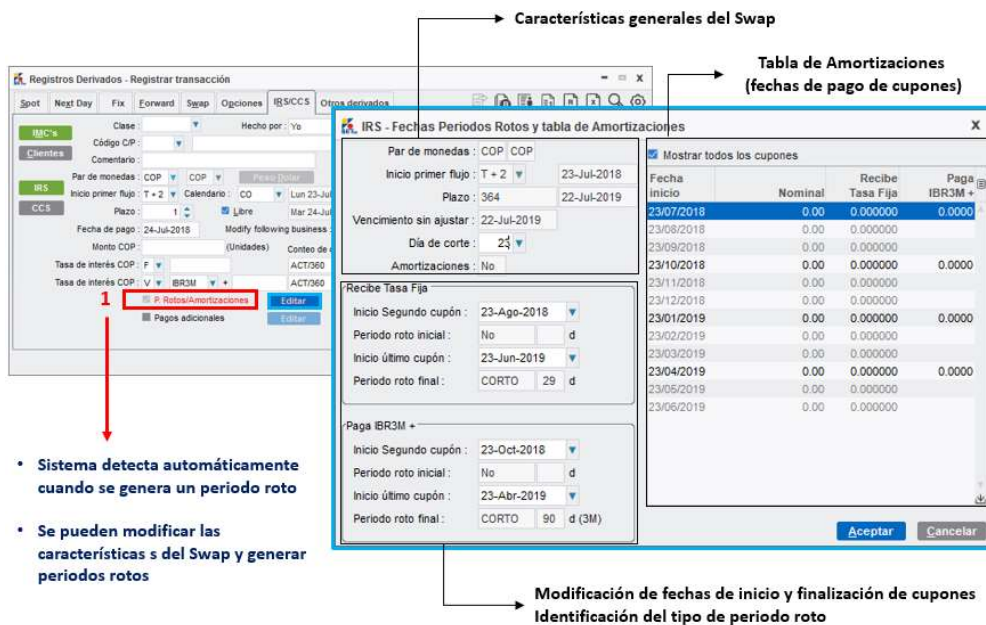
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Vencimiento sin ajustar: fecha modificable para plazos libres.
- Segundo monto: Por defecto mantiene el mismo valor del monto pactado, puede ser menor a este.
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Tipo: BULLET, IGUALES, IRREGULAR (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación
- Registro con opción de periodos rotos/amortizaciones y/o pagos adicionales: Periodo de tiempo en días, al inicio o al final de la vida de un swap que difiere del periodo regular de pago. Aplica para registros entre IMC- IMC

Características generales del Swap

Tabla de Amortizaciones (fechas de pago de cupones)



1. Sistema detecta automáticamente cuando se genera un periodo roto

2. Se pueden modificar las características s del Swap y generar periodos rotos

Modificación de fechas de inicio y finalización de cupones
Identificación del tipo de periodo roto

Ilustración 86 Periodos Rotos

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Para el caso de “pagos adicionales” el usuario podrá ingresar los pagos de acuerdo con la negociación realizada.

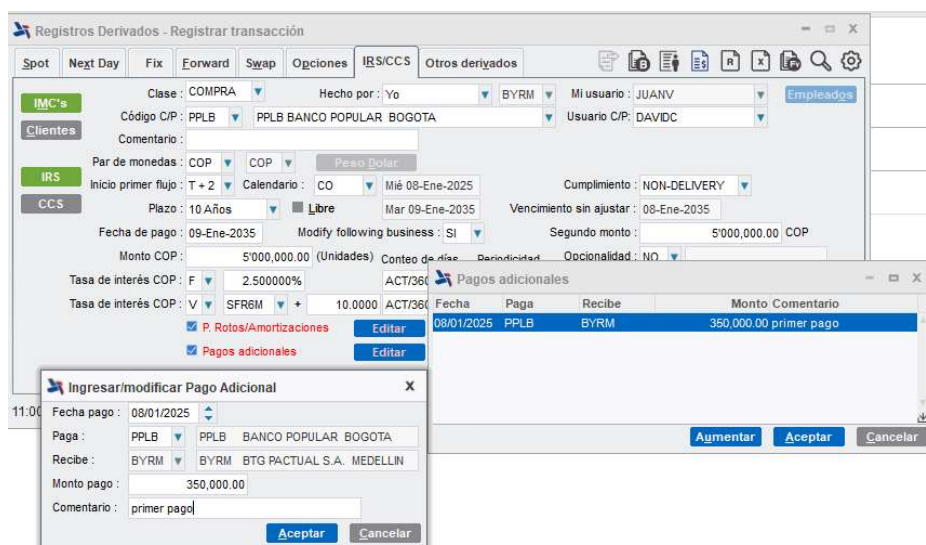


Ilustración 87 Pagos Adicionales

7.8. Registro CCS IMC – IMC



Ilustración 88 Ejemplo CCS

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemotécnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA (Obligatorio)
- Calendario: CO, CO-NY (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: La fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Modify Following Business: SI, NO (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Interés: va de acuerdo con el par de monedas, pueden ser ingresadas con signo negativo. Tipo de tasa de interés: Fijo, Variable.

Si la opción seleccionada es Fijo, activara el campo para el ingreso del porcentaje de la tasa. Opción Variable, desplegará las diferentes tasas de referencias creadas en el sistema SET-FX:

- DTF90 - DTF 90 DIAS
- EUR3M - EURIBOR6M
- EUR6M - EURIBOR6M
- FBIL - FBIL Reference Price
- FED - FEDFUNDS
- FFON - FED FUNDS OVERNIGHT
- IBR1M - IBR 1 MES
- IBR3M - IBR 3 MESES
- IBR6M - IBR 6 MESES
- IBRON - IBR OVER NIGTH
- IPC - IPC
- LBR1M - LIBOR 1 MES
- LBR1Y - LIBOR 1 AÑO
- LBR3M - LIBOR 3 MESES

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- LBR6M - LIBOR 6 MESES
- SFR1M - SOFR 1M
- SFR3M - SOFR 3M
- SFR6M - SOFR 6M
- SFRON - SOFR OVER NIGHT
- VAC - INDICES VAC BCR
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- *Tasa de cambio: tasa pactada*
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Vencimiento sin ajustar: fecha modificable para plazos libres.
- Monto segunda moneda: expresión en base a la segunda moneda.
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Tipo: BULLET, IGUALES, IRREGULAR (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados".
- Hora: Hora de cierre de la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.9. Registro Otros Derivados IMC – IMC



Ilustración 89 Ejemplo Otros Derivados

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nomenclatura institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Tipo: SWAP, FORWARD FORWARD, NO APLICA (Obligatorio)
- Plazo: por defecto es libre (Obligatorio)
- Fecha de pago (Obligatorio)
- Monto: Monto de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Tasa de Cambio (Obligatorio)
- Tasa de interés: de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Tasa de interés: de acuerdo con el segundo par de moneda (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Opcionalidad (Opcional)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.10. Registro Spot IMC – Clientes



11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

Ilustración 90 Ejemplo Spot

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- Id: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación del beneficiario seleccionado (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación. (Opcional)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Tercero Offshore: Check box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio, valor expresado con base al segundo par de moneda (Obligatorio)
- Tasa Pool: Tasa informativa para uso interno del afiliado. (Opcional)
- Origen: Swap Forward, Swap O/N contado, Spot, Swap Futuro. (Obligatorio)
- Negociado en: el campo se activa cuando la entidad contraparte esta creada como entidad del Exterior. Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados"
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.11. Registro Next Day IMC – Cliente

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

Ilustración 91 Ejemplo Next Day

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- Id: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación del beneficiario seleccionado (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Tercero Offshore: Check box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio, valor expresado con base al segundo par de moneda (Obligatorio)
- Tasa Pool: Tasa informativa para uso interno del afiliado. (Opcional)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Casillas “A dos días”, “A tres días”, podrá marcar una de las dos castillas he indicará la cantidad de días de vencimiento 2 y 3 días, si no marca ninguna casi el sistema lo toma como un Next Day a 1 día.
- Origen: Origen de la Operación (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.12. Registro FIX IMC – Clientes



Ilustración 92 Ejemplo FIX

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- ID: Número de identificación del beneficiario seleccionado (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación. (Opcional)
- Tercero Offshore: Check box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha asignación tasa: fecha en la cual se asignará la tasa. (Obligatorio)
- Monto: Representa el valor de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas seleccionado. El monto puede ser especificado según uno de los dos pares de monedas escogidos, **solo aplica para registros Fix**. (Campo Obligatorio)

Ejemplo:

- Seleccione el par de monedas USD/COP

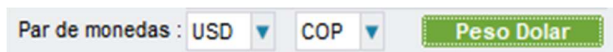


Ilustración 93 Ejemplo Par de Monedas

- Luego, elija la expresión del monto deseado.



- Si se selecciona el par **USD/COP**, el sistema muestra por defecto el valor en función de la primera moneda del par (USD).



Ilustración 94 Ejemplo Monto

- Seleccione el valor de la expresión del monto a COP.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

Monto USD : 56'000,000.00 (Unidades) USD

Puntos : 0.0000 USD

Origen : Fix COP

Ilustración 95 Expresión Monto

- Después de realizar el registro, el blotter de operaciones reflejará el par de monedas invertido como **COP/USD**

Registros Derivados Clientes - Transacciones															
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados															
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.															
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F.Asig.	T. Ori	I X pAnC M
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de	T S Compra	USD / COP	1,405.82 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140	X
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de	T S Compra	USD / COP	3'000,000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79	X
25/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S.	T Venta	COP / USD	56'000,000.00 COP		0.0000	1 Día	28/02/2022	25/02/2022	M X1	

Ilustración 96 Transacciones FIX

- Una vez asignada la tasa, el sistema SET-FX convertirá automáticamente el monto y restablecerá el par de monedas registrado inicialmente.

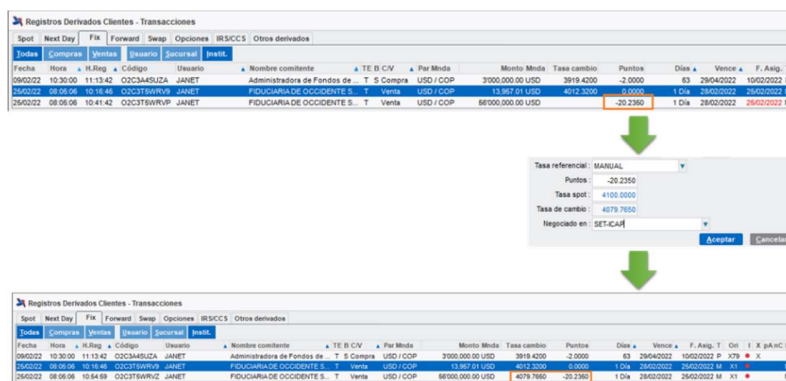
Registros Derivados Clientes - Transacciones															
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.										
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F.Asig.	T. Ori	I X pAnC M
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de	T S Compra	USD / COP	1,405.82 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140	X
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de	T S Compra	USD / COP	3,000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79	X
25/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S.	T Venta	USD / COP	13,957.01 USD	4012.3200	0.0000	1	28/02/2022	25/02/2022	M X1	M

Ilustración 97 Transacciones FIX

- Puntos: Opción para ingresar puntos adicionales. Si se ingresan con un signo negativo, estos serán restados de la tasa de referencia asignada. (Campo opcional)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



The screenshot shows the 'Registros Derivados Clientes - Transacciones' window. It contains a table with columns: Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, Nombre completo, TE B CV, Par Mida, Monto Mida, Tasa cambio, Puntos, Día, Venca, F. Asig, T. The table lists transactions for 'Administradora de Fondos de' and 'FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S. T'. A modal window is open, showing 'Tasa referencial' set to 'MANUAL', 'Puntos' as -20.2350, 'Tasa spot' as 4100.0000, 'Tasa de cambio' as 4079.7650, and 'Negociado en' as SET-ICAP. Green arrows indicate the flow from the table to the modal and then back to the table.

Ilustración 98 Transacciones FIX Puntos

- Origen: El usuario debe seleccionar la opción correspondiente al negocio, ya sea Fix o Swap Forward.
Esta selección indicará que la operación registrada corresponde a la pata corta de una operación Forward.
- Tasa referencial: Opciones permitidas Precio FIX SET-FX, TRM, Manual. La asignación de tasa se realiza dependiendo de la selección escogida:
 - Promedio SET-FX: asignación de tasa que realiza el sistema de acuerdo con el precio FIX en el mercado SPOT y su asignación se realiza a las 13:11:00.
 - TRM: es la asignación de la tasa que realiza el sistema cuando la TRM es generada por la Superintendencia Financiera de Colombia. Para esta opción la fecha de asignación de tasa corresponde a la fecha de la TRM que estará vigente.
 - Manual: asignada por el usuario.
- Negociado en: el campo se activa cuando la entidad contraparte esta creada como entidad del Exterior. Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.13. Registro Forward IMC – Cliente

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes

Clase: COMPRA Hecho por: Yo BYRM Mi usuario: JUANV

Contraparte: Nit - Vigilado TRM ID: 800.138.188-1 Administradora de Fondos de Pensiones

☒ Beneficiario: Nit - Real o Vigilado ID: 900.938.946-3 BUDA.COM SAS

Comentario: Tercero Offshore

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Origen / Producto: Forward-Forward

Plazo: 18 Meses Libre Lunes 06-Jul-2026

Fecha asignación tasa: 03-Ene-2025

Fecha de pago: 07-Jul-2026

Monto USD: 3'500,000.00 (Unidades)

☒ Puntos forward: 10.0000

Tasa forward: 4360.0000

Tasa spot: 4350.0000 Tasa pool: 4500.0000

Tasa referencial: MANUAL

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad:

Negociado en: SET-ICAP

Fecha anterior: Hora: 15:50:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

Ilustración 99 Ejemplo Forward

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación del beneficiario seleccionado (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Obligatorio)
- Tercero Offshore: Check box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Origen/Producto: Origen de la Operación, opciones: Forward-Forward, Outright, Swap, Fix (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha asignación tasa: fecha en la cual se asignará la tasa. Aplica para registros Forward con origen FIX. (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Puntos forward: Opción para indicar los puntos a ingresar. Al ingresar los puntos con el signo negativo, serán restados en la tasa Spot. (Opcional).
- Tasa Forward (Obligatorio)
- Tasa de spot (Obligatorio)
- Tasa Pool: Tasa informativa para uso interno del afiliado. (Opcional)
- Tasa de referencia: utilizada para registros con origen Fix. Para registros entre IMCs la tasa de referencia por defecto es "MANUAL".
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados".
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.14. Registro Swap IMC – Cliente

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

Clase: COMPRA Hecho por: Yo BYRM Mi usuario: JUANV

Contraparte: Nit - Vigilado TRM ID: 800.138.188-1 Administradora de Fondos de Pensiones

☒ Beneficiario: Nit - Real o Vigilado ID: 890.916.911-6 Incolmotos Yamaha sa

Comentario:

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Tipo: SWAP

Plazo: 2 Años Libre Miércoles 06-Ene-2027 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Fecha de pago: 07-Ene-2027 Periodicidad de pagos: Trimestral

Monto USD: 3'500,000.00 (Unidades) Opcionalidad: NO

Tasa Swap: 4500.0000 Negociado en: DIRECTO

Tasa Spot: 4350.0000 Tasa pool: Fecha anterior: Hora: 15:50:00 (Negociación)

Tasa referencial: MANUAL

Enviar Nuevo Limpiar

15:50:00 Compra a OTR 3'500,000.00 a 10.0000 a 0/31, Par de monedas USD/COP

Ilustración 100 Ejemplo Swap

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación del beneficiario seleccionado (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Obligatorio)
- Tercero Offshore: Check box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Tipo: tipo de Swap, opciones a elegir SWAP, FORWARD-FORWARD.
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa Swap (Obligatorio)
- Tasa de Spot (Obligatorio)
- Tasa Pool: Tasa informativa para uso interno del afiliado. (Opcional)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.15. Registro Opciones

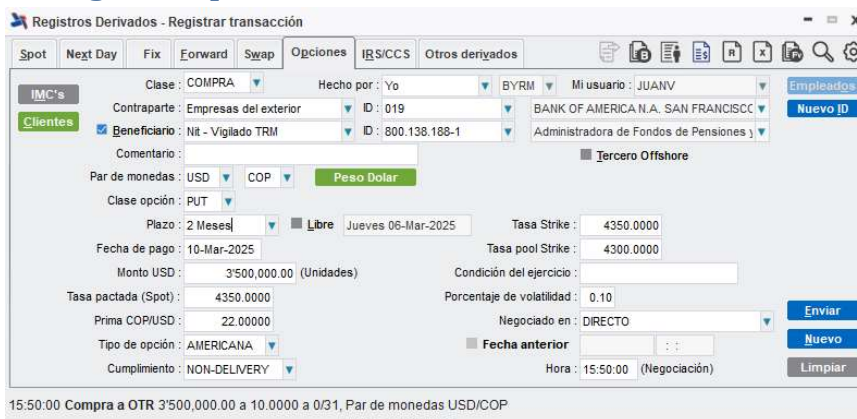


Ilustración 101 Ejemplo Opciones

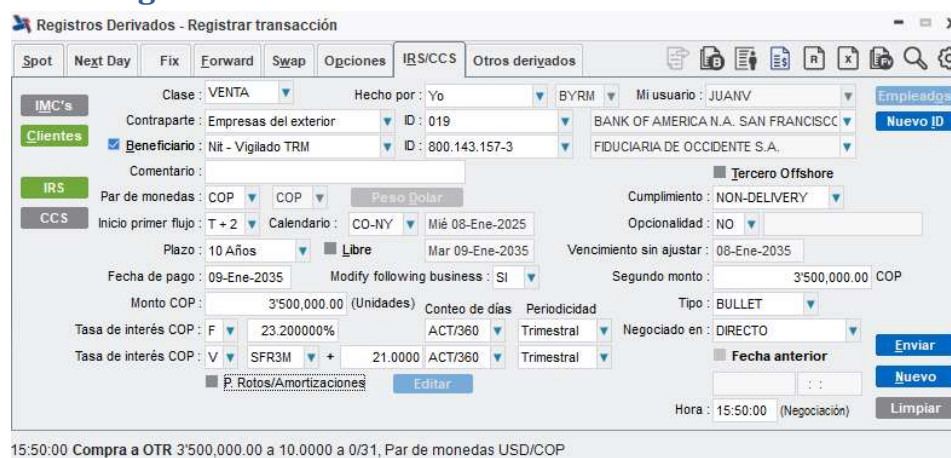
- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Obligatorio)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Clase opción: Con valores de CALL, PUT para indicar el tipo de opción.
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa pactada (Spot) (Obligatorio)
- Prima: Valor en función del par de monedas COP/USD (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

- Tipo de Opción: AMERICANA, EUROPEA, OTRA (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Tasa Strike (Obligatorio)
- *Tasa pool Strike*
- Condición del ejercicio (OPCIONAL)
- Porcentaje de Volatilidad (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

7.16. Registro IRS IMC - Clientes



15:50:00 Compra a OTR 3'500,000.00 a 10.0000 a 0/31, Par de monedas USD/COP

Ilustración 102 Ejemplo IRS

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación beneficiario (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Obligatorio)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA (Obligatorio)
- Calendario: CO, CO-NY (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Interés: va de acuerdo con el par de monedas, pueden ser ingresadas con signo negativo. Tipo de tasa de interés: Fijo, Variable.

Si la opción seleccionada es Fijo, activara el campo para el ingreso del porcentaje de la tasa. Opción Variable, desplegará las diferentes tasas de referencias creadas en el sistema SET-FX:

- DTF90 - DTF 90 DIAS
- EUR3M - EURIBOR6M
- EUR6M - EURIBOR6M
- FBIL - FBIL Reference Price
- FED - FEDFUNDS
- FFON - FED FUNDS OVERNIGHT
- IBR1M - IBR 1 MES
- IBR3M - IBR 3 MESES
- IBR6M - IBR 6 MESES
- IBRON - IBR OVER NIGTH
- IPC - IPC
- LBR1M - LIBOR 1 MES
- LBR1Y - LIBOR 1 AÑO
- LBR3M - LIBOR 3 MESES
- LBR6M - LIBOR 6 MESES

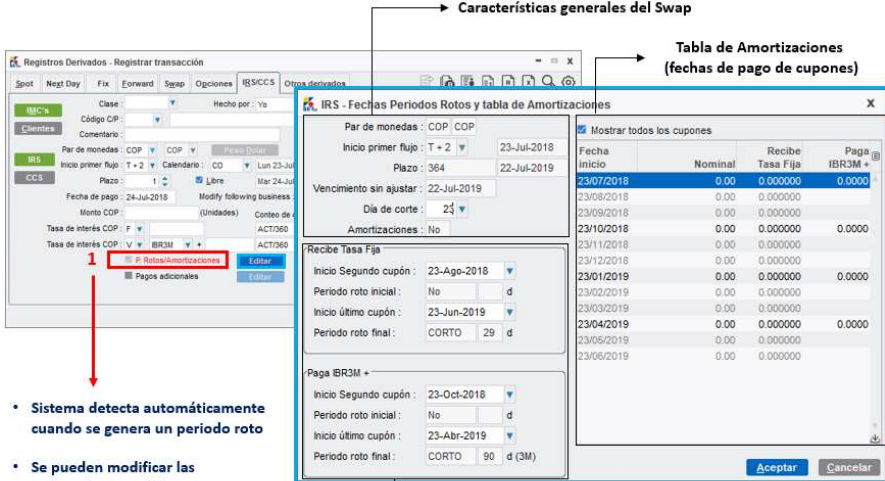
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- SFR1M - SOFR 1M
- SFR3M - SOFR 3M
- SFR6M - SOFR 6M
- SFRON - SOFR OVER NIGHT
- VAC - INDICES VAC BCR
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Vencimiento sin ajustar: fecha modificable para plazos libres.
- Segundo monto: Por defecto mantiene el mismo valor del monto pactado, puede ser menor a este.
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Tipo: BULLET, IGUALES, IRREGULAR (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados".
- Hora: Hora de cierre de la operación
- Registro con opción de periodos rotas/amortizaciones y/o pagos adicionales: Periodo de tiempo en días, al inicio o al final de la vida de un swap que difiere del periodo regular de pago. Aplica para registros entre IMC- IMC

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Características generales del Swap

Tabla de Amortizaciones (fechas de pago de cupones)

IRS - Fechas Periodos Rotos y tabla de Amortizaciones

Par de monedas : COP / COP

Inicio primer flujo : T + 2 23-Jul-2018

Plazo : 364 22-Jul-2019

Vencimiento sin ajustar : 22-Jul-2019

Día de corte : 22

Amortizaciones : No

Recibe Tasa Fija

Inicio Segundo cupón : 23-Ago-2018

Periodo roto inicial : No d

Inicio último cupón : 23-Jun-2019

Periodo roto final : CORTO 29 d

Paga IBR3M +

Inicio Segundo cupón : 23-Oct-2018

Periodo roto inicial : No d

Inicio último cupón : 23-Abr-2019

Periodo roto final : CORTO 90 d (3M)

Tabla de Amortizaciones

Fecha inicio	Nominal	Recibe Tasa Fija	Paga IBR3M +
23/07/2018	0.00	0.000000	0.0000
23/08/2018	0.00	0.000000	
23/09/2018	0.00	0.000000	
23/10/2018	0.00	0.000000	0.0000
23/11/2018	0.00	0.000000	
23/12/2018	0.00	0.000000	
23/01/2019	0.00	0.000000	0.0000
23/02/2019	0.00	0.000000	
23/03/2019	0.00	0.000000	
23/04/2019	0.00	0.000000	0.0000
23/05/2019	0.00	0.000000	
23/06/2019	0.00	0.000000	

Modificación de fechas de inicio y finalización de cupones

Identificación del tipo de periodo roto

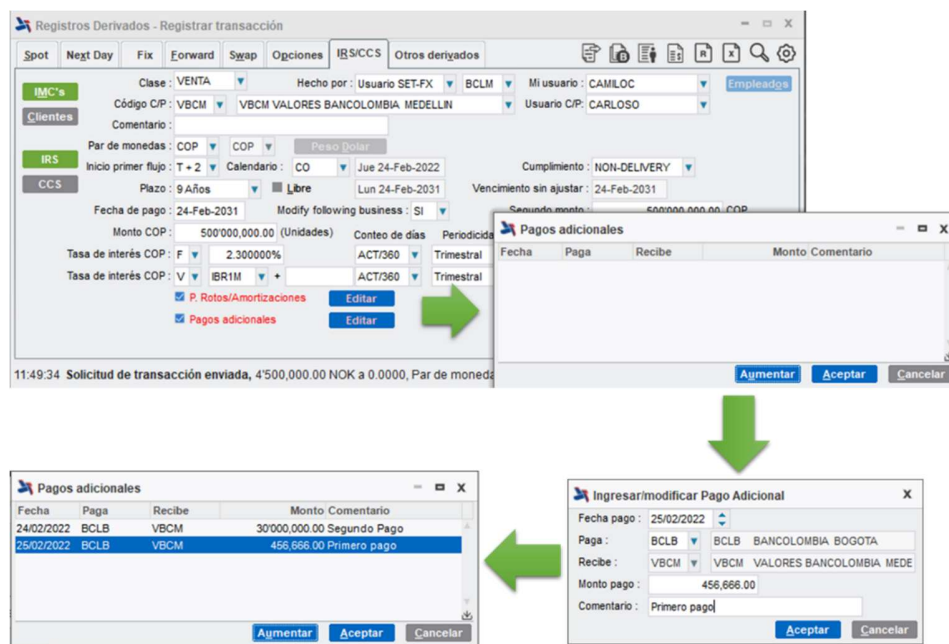
- Sistema detecta automáticamente cuando se genera un periodo roto
- Se pueden modificar las características s del Swap y generar periodos rotos

Ilustración 103 Periodos Rotos

Para el caso de “pagos adicionales” el usuario podrá ingresar los pagos de acuerdo con la negociación realizada.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204



Registros Derivados - Registrar transacción

Clase: VENTA Hecho por: Usuario SET-FX BCLM Mi usuario: CAMLOC Empleados

Código C/P: VBCM VBCM VALORES BANCOLOMBIA MEDELLIN Usuario C/P: CARLOSO

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dolar

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO Jue 24-Feb-2022 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Plazo: 9 Años Libre Lun 24-Feb-2031 Vencimiento sin ajustar: 24-Feb-2031

Fecha de pago: 24-Feb-2031 Modify following business: SI

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

Tasa de interés COP: F 2.300000% ACT/360 Trimestral

Tasa de interés COP: V IBR1M + ACT/360 Trimestral

☒ P. Rotos/Amortizaciones Editar

☒ Pagos adicionales Editar

11:49:34 Solicitud de transacción enviada, 4'500,000.00 NOK a 0.0000, Par de monedas

Pagos adicionales

Fecha	Paga	Recibe	Monto	Comentario
24/02/2022	BCLB	VBCM	30'000,000.00	Segundo pago
25/02/2022	BCLB	VBCM	456,666.00	Primer pago

Ingresar/modificar Pago Adicional

Fecha pago: 25/02/2022

Paga: BCLB BCLB BANCOLOMBIA BOGOTA

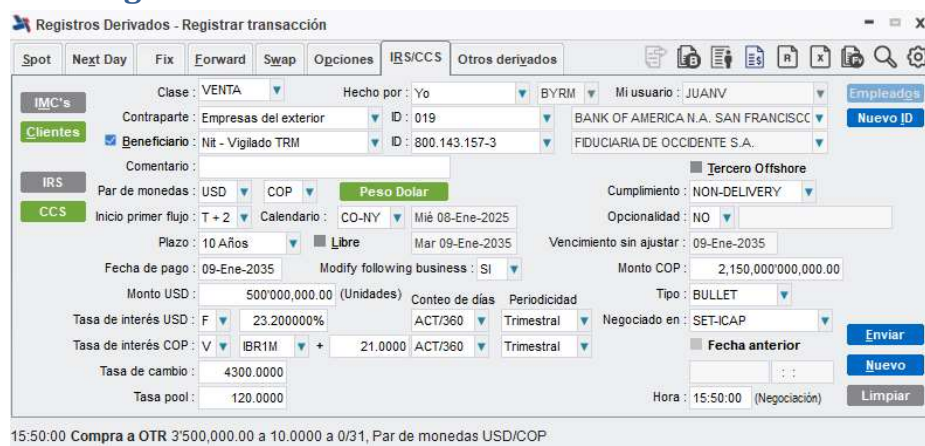
Recibe: VBCM VBCM VALORES BANCOLOMBIA MEDE

Monto pago: 456,666.00

Comentario: Primer pago

Ilustración 104 Pagos Adicionales

7.17. Registro CCS IMC – Clientes



Registros Derivados - Registrar transacción

Clase: VENTA Hecho por: Yo BYRM Mi usuario: JUANV Empleados

Contraparte: Empresas del exterior ID: 019 BANK OF AMERICA N.A. SAN FRANCISCO

☒ Beneficiario: N/A - Vigilado TRM ID: 800.143.157-3 FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S.A.

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO-NY Mié 08-Ene-2025 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Plazo: 10 Años Libre Mar 09-Ene-2035 Vencimiento sin ajustar: 09-Ene-2035

Fecha de pago: 09-Ene-2035 Modify following business: SI

Monto USD: 500'000,000.00 (Unidades) Conteo de días Periodicidad

Tasa de interés USD: F 23.200000% ACT/360 Trimestral

Tasa de interés COP: V IBR1M + 21.0000 ACT/360 Trimestral

Tasa de cambio: 4300.0000

Tasa pool: 120.0000

Monto COP: 2,150,000'000.000.00

Tipo: BULLET

Negociado en: SET-ICAP

☒ Fecha anterior

Hora: 15:50:00 (Negociación)

15:50:00 Compra a OTR 3'500,000.00 a 10.0000 a 0/31, Par de monedas USD/COP

Pagos adicionales

Fecha	Paga	Recibe	Monto	Comentario
24/02/2022	BCLB	VBCM	30'000,000.00	Segundo pago
25/02/2022	BCLB	VBCM	456,666.00	Primer pago

Ingresar/modificar Pago Adicional

Fecha pago: 25/02/2022

Paga: BCLB BCLB BANCOLOMBIA BOGOTA

Recibe: VBCM VBCM VALORES BANCOLOMBIA MEDE

Monto pago: 456,666.00

Comentario: Primer pago

Ilustración 105 Ejemplo CCS

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación beneficiario (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA (Obligatorio)
- Calendario: CO, CO-NY (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Fecha de pago: La fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento (Obligatorio)
- Modify Following Business: SI, NO (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Interés: va de acuerdo con el par de monedas, pueden ser ingresadas con signo negativo. Tipo de tasa de interés: Fijo, Variable.

Si la opción seleccionada es Fijo, activara el campo para el ingreso del porcentaje de la tasa. Opción Variable, desplegará las diferentes tasas de referencias creadas en el sistema SET-FX:

 - DTF90 - DTF 90 DIAS
 - EUR3M - EURIBOR6M
 - EUR6M - EURIBOR6M
 - FBIL - FBIL Reference Price
 - FED - FEDFUNDS
 - FFON - FED FUNDS OVERNIGHT
 - IBR1M - IBR 1 MES
 - IBR3M - IBR 3 MESES
 - IBR6M - IBR 6 MESES
 - IBRON - IBR OVER NIGTH

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- IPC - IPC
- LBR1M - LIBOR 1 MES
- LBR1Y - LIBOR 1 AÑO
- LBR3M - LIBOR 3 MESES
- LBR6M - LIBOR 6 MESES
- SFR1M - SOFR 1M
- SFR3M - SOFR 3M
- SFR6M - SOFR 6M
- SFRON - SOFR OVER NIGHT
- VAC - INDICES VAC BCR
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- *Tasa de cambio: tasa pactada*
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Vencimiento sin ajustar: fecha modificable para plazos libres.
- Monto segunda moneda: expresión en base a la segunda moneda.
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Tipo: BULLET, IGUALES, IRREGULAR (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado "Registro de Derivados".
- Hora: Hora de cierre de la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	Archivo: IGO020204

7.18. Registro Otros Derivados IMCs – clientes

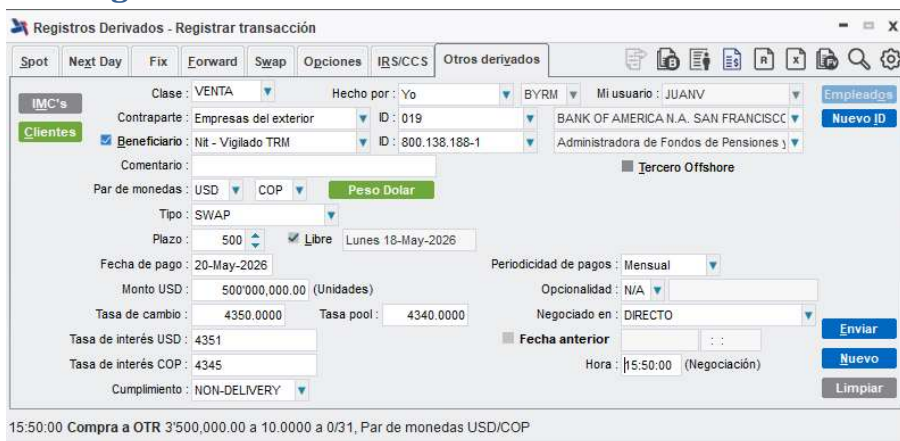


Ilustración 106 Ejemplo Otros Derivados

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- ID: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación de terceros u ordenante de la operación. Aplica cuando la entidad contraparte es NIT - Vigilado TRM, Empresas del Exterior, Código Swift. (Opcional)
- ID: Número de identificación beneficiario (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Tipo: SWAP, FORWARD FORWARD, NO APLICA (Obligatorio)
- Plazo: por defecto es libre (Obligatorio)
- Fecha de pago (Obligatorio)
- Monto: Monto de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Tasa de Cambio (Obligatorio)
- Tasa de interés: de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Tasa de interés: de acuerdo con el segundo par de moneda (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Opcionalidad (Opcional)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)
- Tasa de Interés: En función al par de monedas, se pueden ingresar con signo negativo. Opción Fijo, Variable. Opción Fijo, activa un campo para el porcentaje de la tasa. Opción Variable (Obligatorio).
- Tercero Offshore: Chuck box debe marcarse obligatoriamente en aquellos casos en los cuales el beneficiario u ordenante de la operación es una entidad del exterior. Este Chuck Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Prima: Valor en función del par de monedas COP/USD (Obligatorio)
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado con relación al primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa Swap (Obligatorio)
- Tasa de Spot (Obligatorio)
- Tasa Pool: Tasa informativa para uso interno del afiliado. (Opcional)
- Tasa de referencia: opción informativa con opciones Precio FIX SET FX, TRM, MANUAL
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Opcionalidad: Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. (Opcional)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
	REGISTROS DE DIVISAS	

- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)
- Tasa de referencia: opción informativa con opciones Precio FIX SET FX, TRM, MANUAL.

8. ASIGNACIÓN DE TASA REFERENCIAL EN OPERACIONES FIX

Para las operaciones registradas en el mercado FIX, el sistema SET-FX permite asignar tres tipos de tasa referencial:

- Promedio SET-FX

Tasa asignada automáticamente por el sistema, basada en el precio FIX del mercado SPOT. La asignación se realiza diariamente a las 13:11:00.

- TRM (Tasa Representativa del Mercado)

Tasa asignada por el sistema cuando la TRM es publicada por la Superintendencia Financiera de Colombia.

Es importante tener en cuenta que en el campo “Fecha asignación tasa” se indique la fecha correspondiente a la TRM vigente del día.

- Manual

Tasa asignada directamente por el usuario.

9. INFORMACIÓN ADICIONAL

Si existe alguna duda o comentario sobre el contenido de este manual, puede comunicarse con las líneas de soporte de SET-ICAP FX S.A. Tel.: (601) 7427778, (601)7427777 Ext 220, 221, 223 o al correo electrónico soportesetfx@set-fx.com.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026