MERCADO REGISTRO DE DIVISAS

MANUAL DE USUARIO

SET ICAP | FX

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

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

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.

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.

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:

Ilustración 2 Ventana Registro Derivados

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.

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.

- 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.

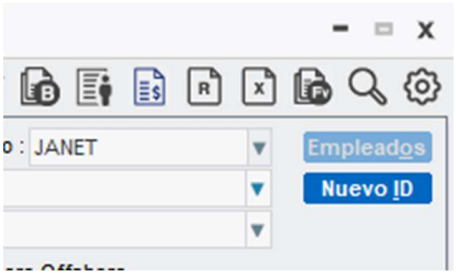


Ilustración 4 Botón Nuevo ID

1.2.1. Creación de un nuevo cliente

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

a) 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*).

b) Identificación: Ingrese el número o código correspondiente según el tipo de documento seleccionado.

c) Nombre del Comitente: Registre la razón social o nombre completo.

d) Tipo de Inversionista: Defina si es Persona Natural o Persona Jurídica.

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 CIIU 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.

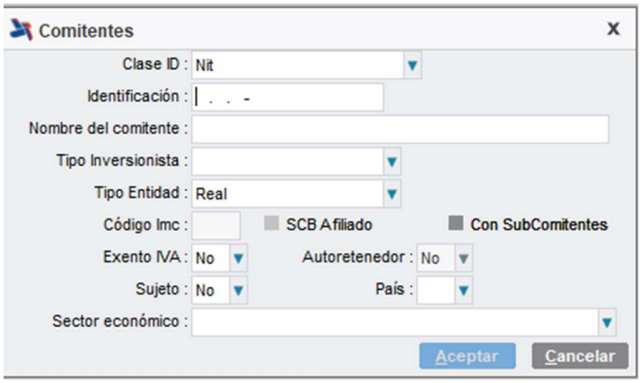


Ilustración 5 Ventana Comitentes

1.2.2. Asociación de un cliente existente

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

1. Haga clic en el botón "Nuevo ID".
2. Seleccione el Tipo de Identificación e ingrese el número o valor correspondiente.
3. El sistema cargará automáticamente la información preexistente.
4. 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.

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

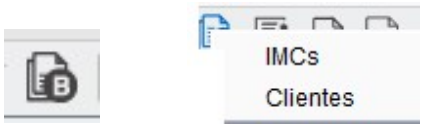
Para validar el correcto funcionamiento de este mecanismo, se recomienda consultar el instructivo de importación XML, disponible en nuestro portal web.

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.

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

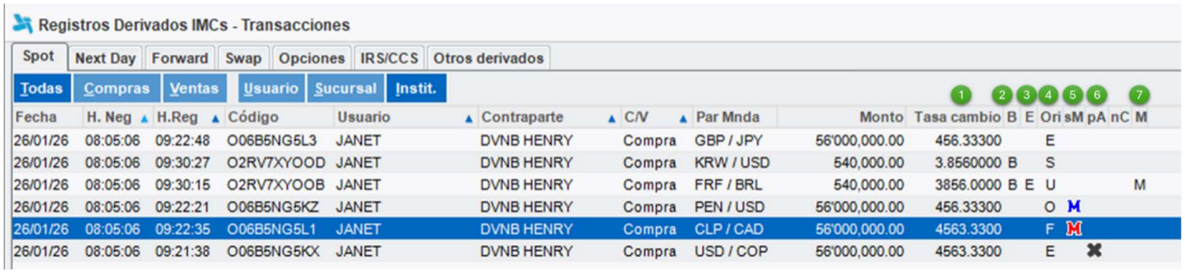


Ilustración 10 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Tasa cambio	Precio pactado.

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

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

- 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:

		• S – Swap • F – Forward-Forward • O – Outright • X0 – 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.

Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	F. Asig.	T	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
04/02/25	08:08:08	11:05:15	O06BAYHQRR	JANET	DVNB HENRY	Compra	BRL / DEM	75'000,000.00	2322.5550	2300.5600	9 Meses	04/11/2025		E	O	04/02/2025	M			M			M
04/02/25	10:02:54	11:09:04	O06BAYHQRV	JANET	DVNB HENRY	Venta	UVR / COP	75'000,000.00	5690.3300	5600.0000	9 Meses	04/11/2025		E		04/02/2025	M	NC					
04/02/25	10:02:54	11:07:11	O06BAYHQRT	JANET	DVNB HENRY	Venta	NZD / USD	75'000,000.00	4.0558500	4.5550000	9 Meses	04/11/2025		E		04/02/2025	M			M			
04/02/25	11:10:02	14:11:19	O06BAYHQS4	JANET	DVNB HENRY	Compra	UVR / COP	8'000,000.00	6899.0000	5600.0000	2 Años	04/02/2027				04/02/2025	M	...					
04/02/25	11:10:02	14:10:45	O06BAYHQS2	JANET	DVNB HENRY	Compra	UVR / COP	8'000,000.00	6899.0000	5600.0000	9 Meses	04/11/2025				04/02/2025	M	PC					
04/02/25	11:10:02	11:11:21	O06BAYHQRX	JANET	DVNB HENRY	Compra	CNH / USD	8'000,000.00	6.8990000	5.6000000	9 Meses	04/11/2025				04/02/2025	M				✖		

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

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

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

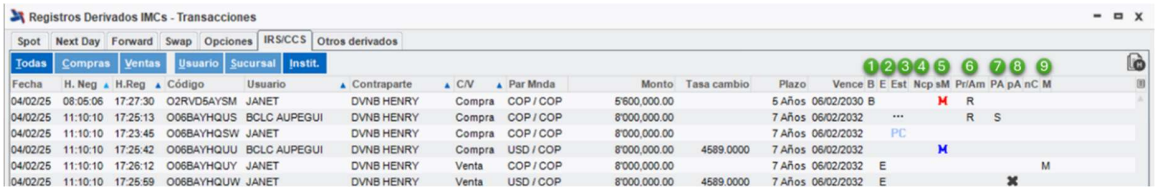


Ilustración 16 Ventana Transacciones

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:

		• 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)

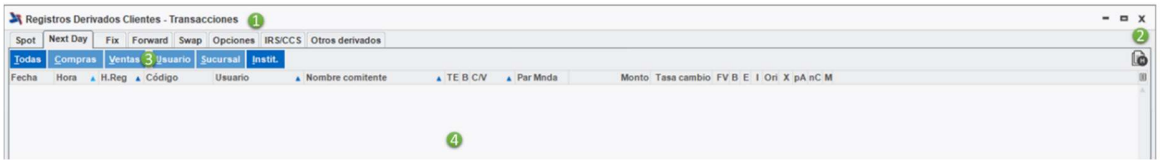


Ilustración 17 Ventana Transacciones

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 registras en fechas anteriores.
3	Filtros de visualización	El usuario podrá aplicar filtros de visualización de operaciones.
4	Operaciones registradas	Visualiza las operaciones registradas.

Ilustración 18 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Fecha	Fecha de registro.
2	H. Neg.	Hora de negociación del registro.
3	H. Reg	Hora de realización del registro.
4	Código	Código que identifica a cada operación en el Sistema SET-FX.
5	Usuario	Nombre del usuario quien realizo la negociación.
6	Nombre de comitente	Razón social o nombre de la contraparte
7	TE	Tipo de entidad de la contraparte. Valores permitidos: • R – Real • T – Vigilado TRM • V – Vigilado • E – Agentes del exterior
8	B	Registro realizado con un beneficiario S – Beneficiario contraparte
9	C/V	Tipo de operación compra/venta

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

- Submercado Spot:

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	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			E					
26/01/26	08:05:06	11:51:50	O06B5NG5LF	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R		Venta	ZAR / COP	12,000.00	4235.0052			F					
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					
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		X			

Ilustración 19 Ventana Transacciones

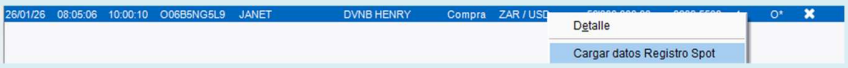
Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	Ori	Identifica el origen del registro: • S – Spot

		• 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:

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".

		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

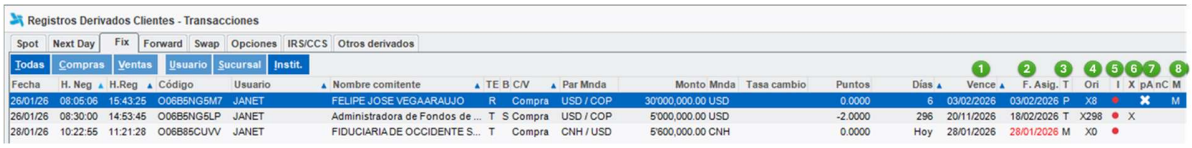


Ilustración 21 Ventana Transacciones

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.

- Submercado Forward

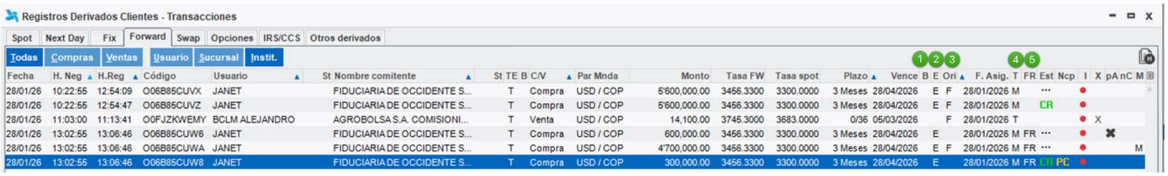


Ilustración 22 Ventana Transacciones

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.

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

- Swap

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.

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.

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

- Opciones

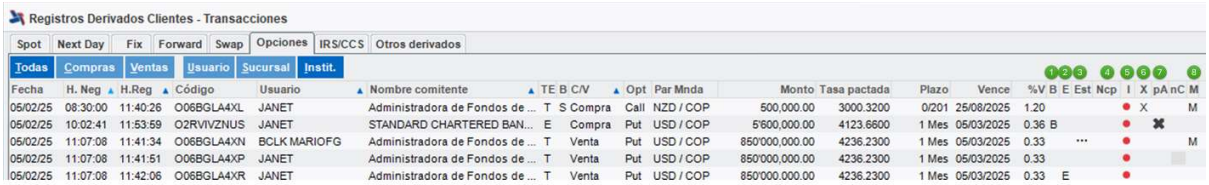


Ilustración 26 Ventana Transacciones

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

Ilustración 27 Ventana Transacciones

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

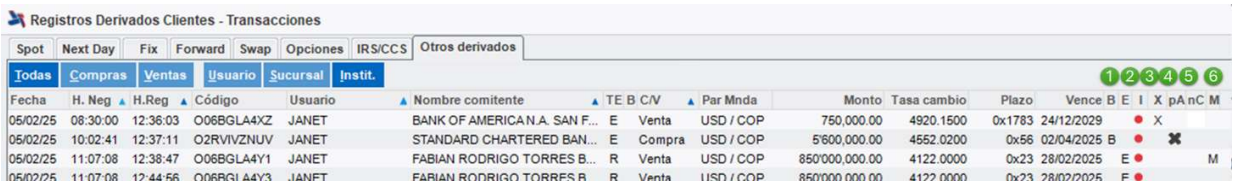


Ilustración 28 Ventana Transacciones

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.

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:

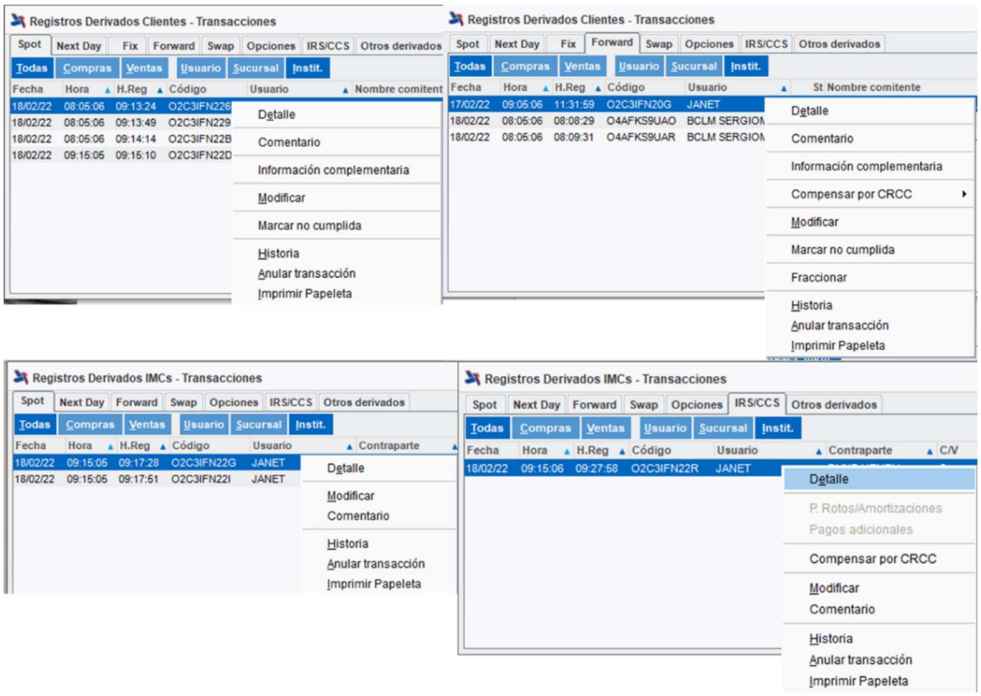


Ilustración 29 Opciones Ventana Transacciones

2.2.3.1. Detalle

La opción permite visualizar el detalle del registro

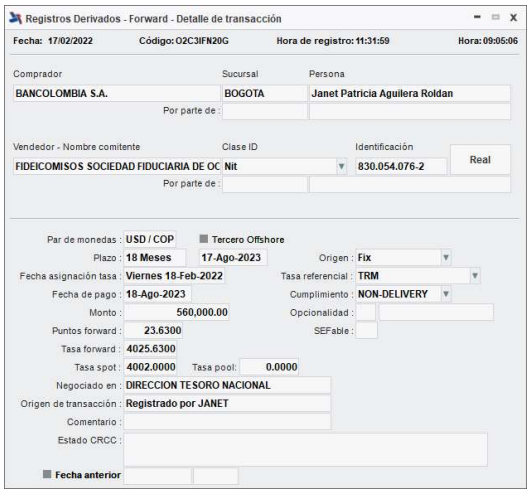


Ilustración 30 Detalle de Operación

2.2.3.2. Comentario

Permite ingresar un comentario al registro realizado

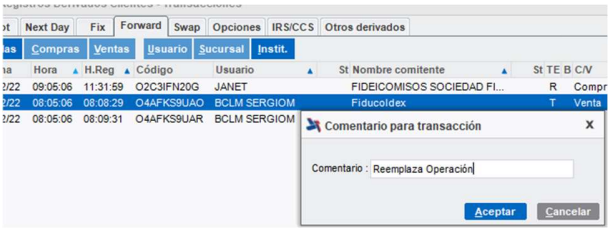


Ilustración 31 Ingreso Comentario

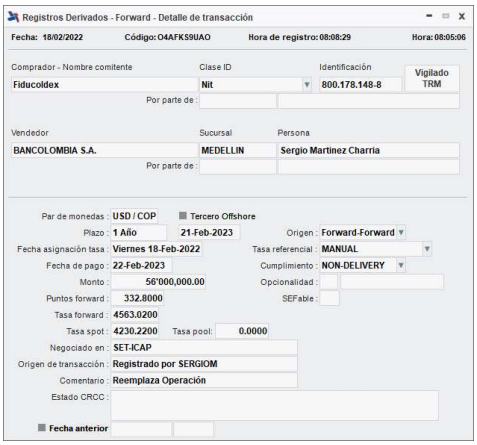


Ilustración 32 Ejemplo Comentario

2.2.3.3. Información Complementaria

Permite ingresar información adicional al registro realizado.

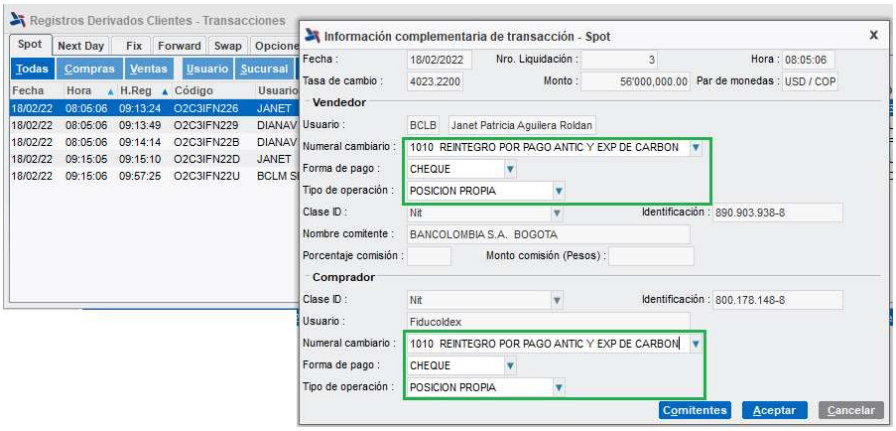


Ilustración 33 Ejemplo Información Complementaria

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.

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

Registros Derivados - Historia de transacción

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	0/545 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.

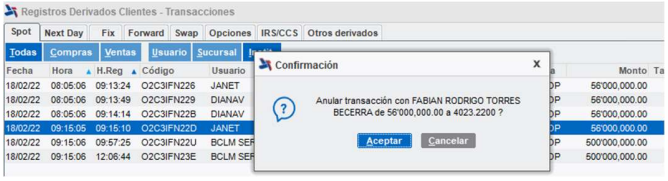
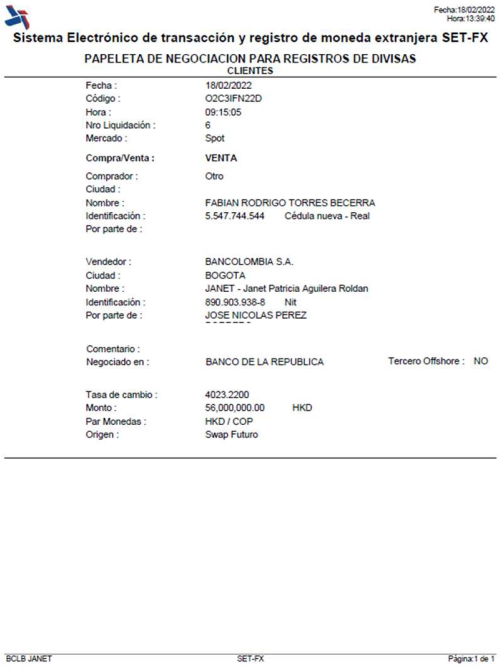


Ilustración 35 Anulación Registro

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
Nro Liquidación :	6
Mercado :	Spot
Compra/Venta :	**VENTA**
Comprador :	Otro
Ciudad :	
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

BCLB 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,

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

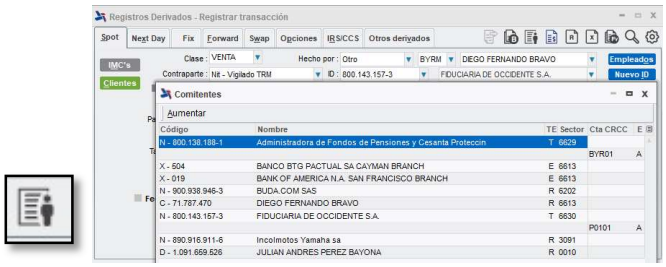


Ilustración 37 Botón Comitentes

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 CIIU 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.

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:

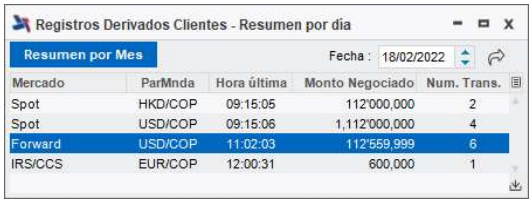
- Resumen divisas IMCs / Clientes

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.

Ilustración 40 Ejemplo Resumen por Día

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



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

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.*

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 rechazo 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

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

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:

Ilustración 48 Botón Transacciones por Fecha Vencimiento

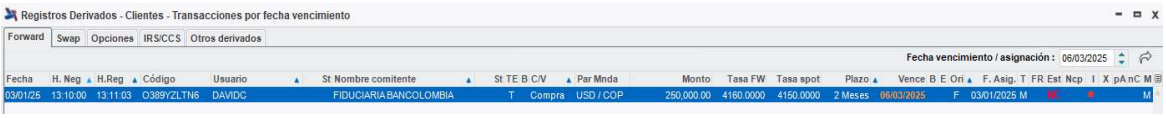


Ilustración 49 Ventana Transacciones por Fecha de Vencimiento

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

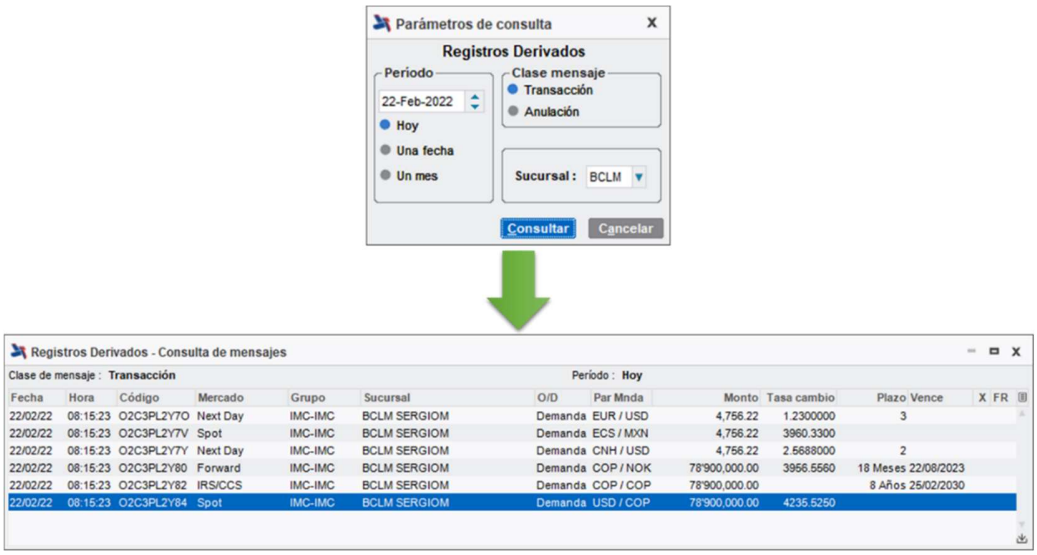


Ilustración 51 Ejemplo Consultas

2.2.3.16. Configuración Mercado

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

Ilustración 52 Botón Configuración de Mercado

Ilustración 53 Ventana Configuración Mercado

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.

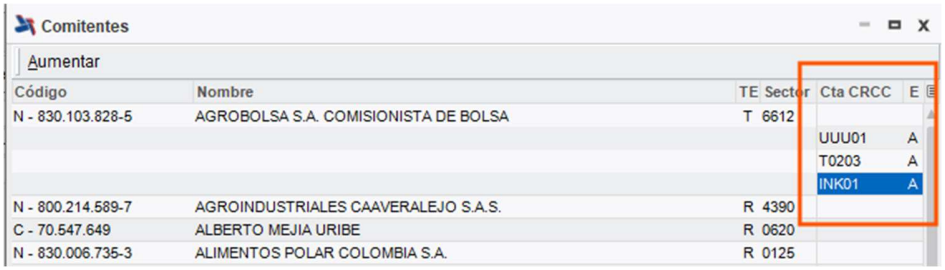


Ilustración 54 Ventana Comitentes

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.

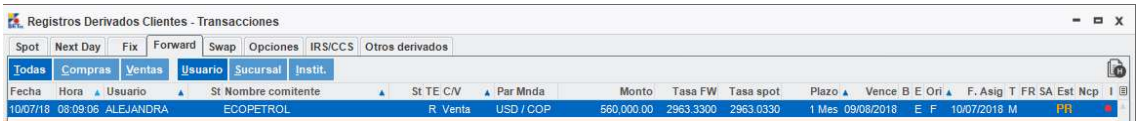


Ilustración 55 Estados de Compensación

PA (Pendiente de Aprobación) – Color amarillo

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

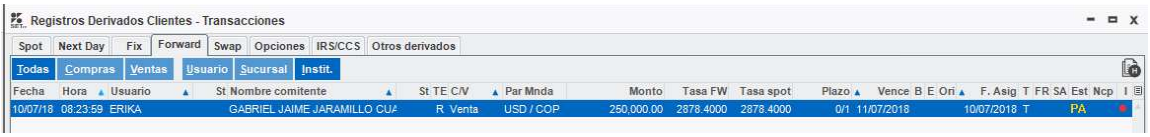


Ilustración 56 Estados de Compensación

CR (Compensada por Cámara de Riesgo) – Color verde

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

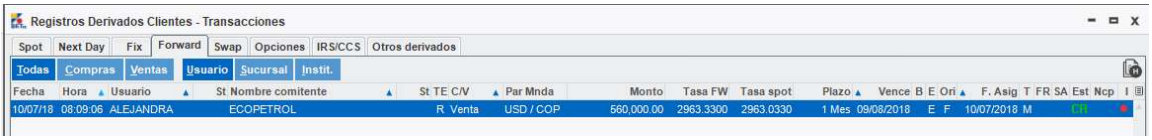


Ilustración 57 Estados de Compensación

NC (No Compensada) – Color rojo

La operación fue rechazada por la CRCC.

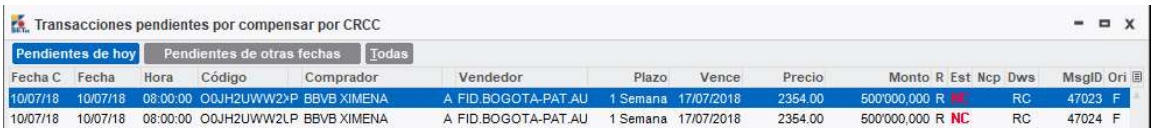


Ilustración 58 Estados de Compensación

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".

4. 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:

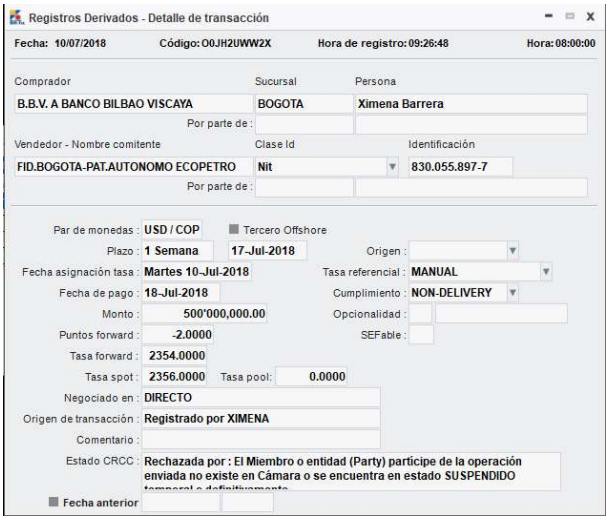


Ilustración 59 Ejemplo Rechazo de Compensación

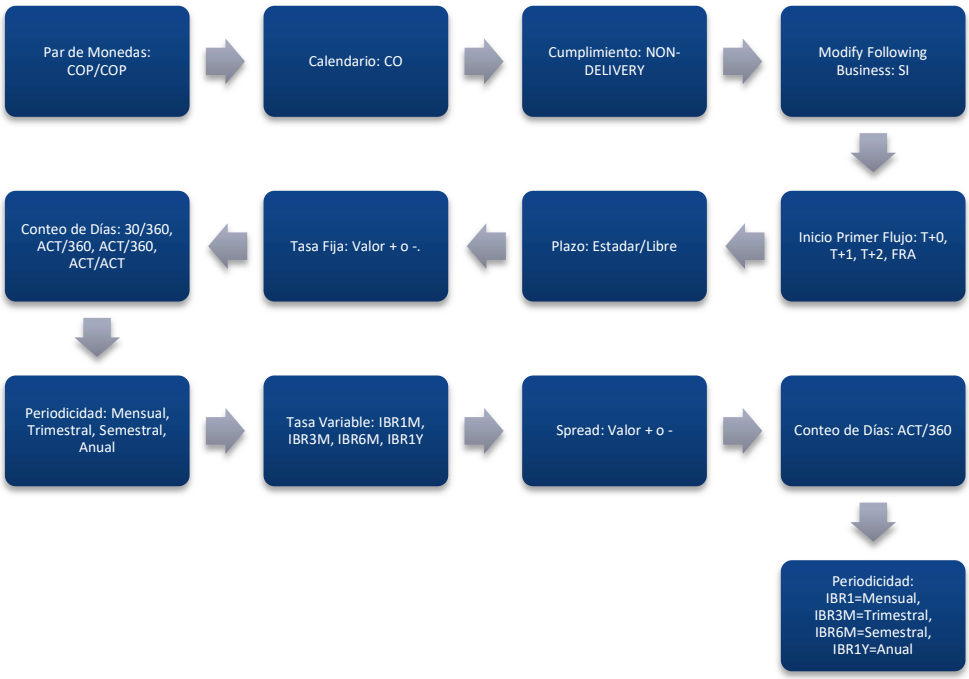
A continuación, se enumeran las causales de rechazos que pueden presentarse cuando una operación es rechazada:

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.

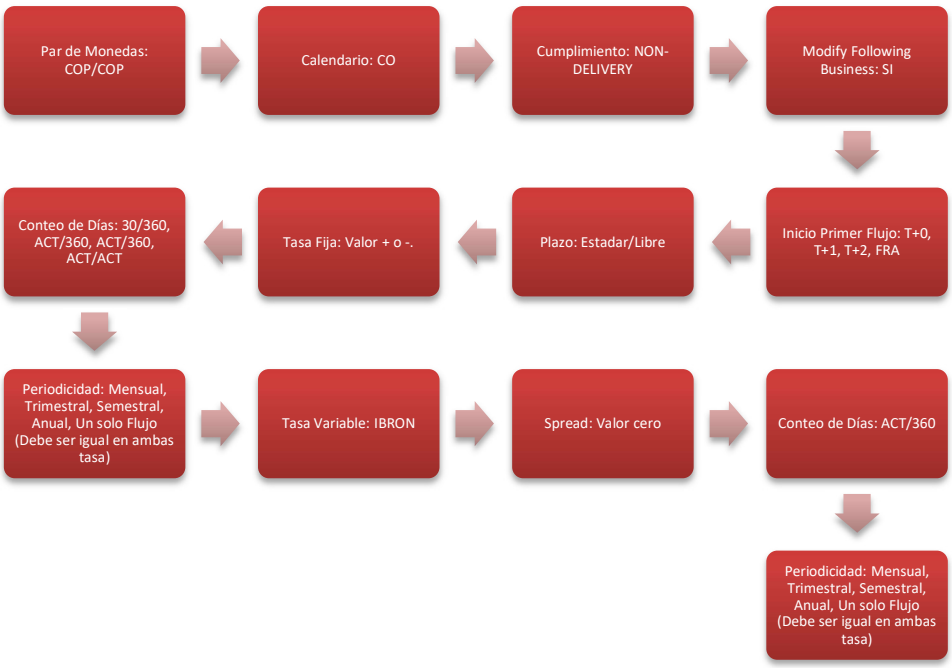
210	El sistema no está disponible para los Sistemas de Registro.
302	La versión de FpML debe ser 4-5.
304	El tipo de mensaje FpML enviado no es soportado.
305	El miembro comprador y el miembro vendedor no corresponden con el código alterno.
308	El producto FpML enviado no es soportado El producto FpML 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) partícipe 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

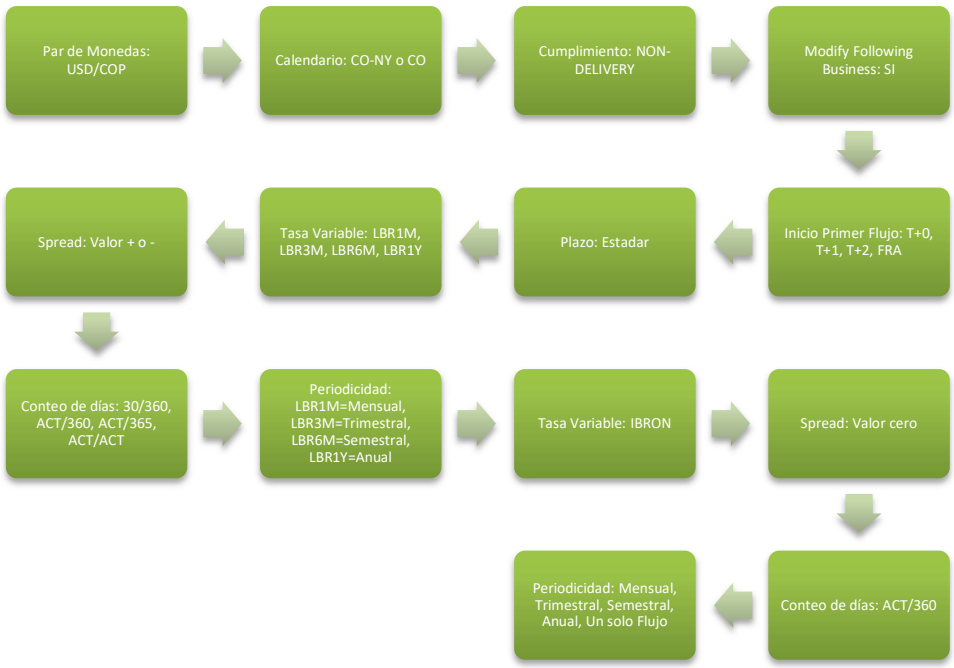
Para él envió de operaciones IRS Plain Vanilla a CRCC se deben cumplir ciertas condiciones, las condiciones para el envío de estas operaciones se detallan a continuación:



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



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



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.

Ilustración 60 Compensar Registro

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.

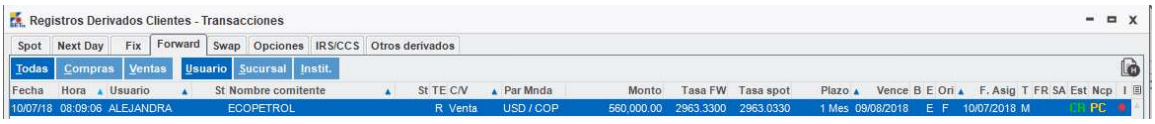


Ilustración 61 Estados de Retiro de Compensación

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

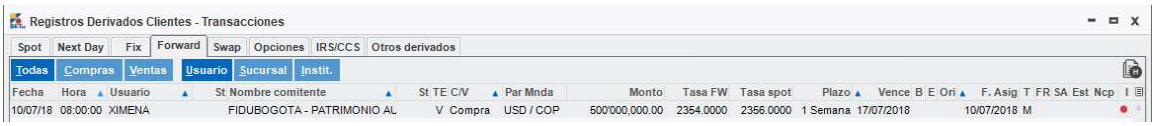


Ilustración 62 Retiro Compensación

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

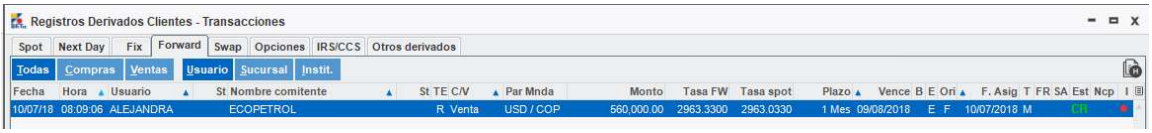


Ilustración 63 Retiro Compensación

Proceso para Operaciones IRS entre IMCs

Ingrese 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.

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.

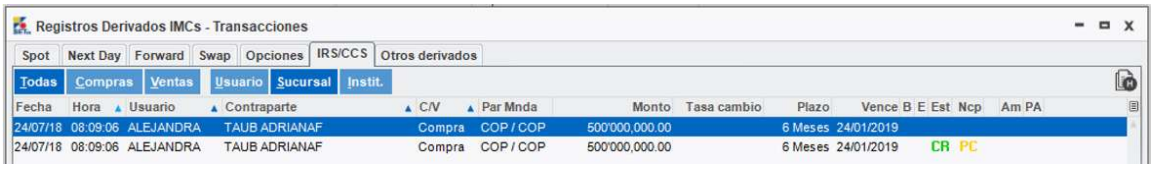


Ilustración 66 Retiro Compensación

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.

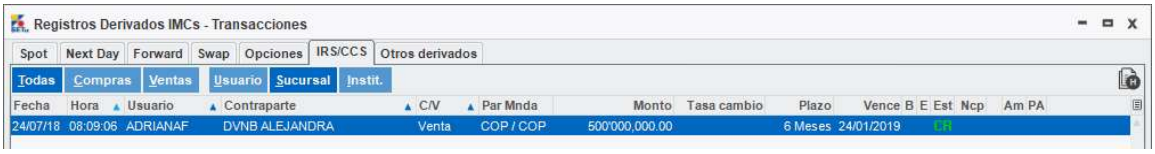


Ilustración 67 Rechazo Retiro Compensación

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.

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.

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.

Ilustración 69 Solicitud Modificación

Ejemplo modificación de un registro entre dos IMCs:

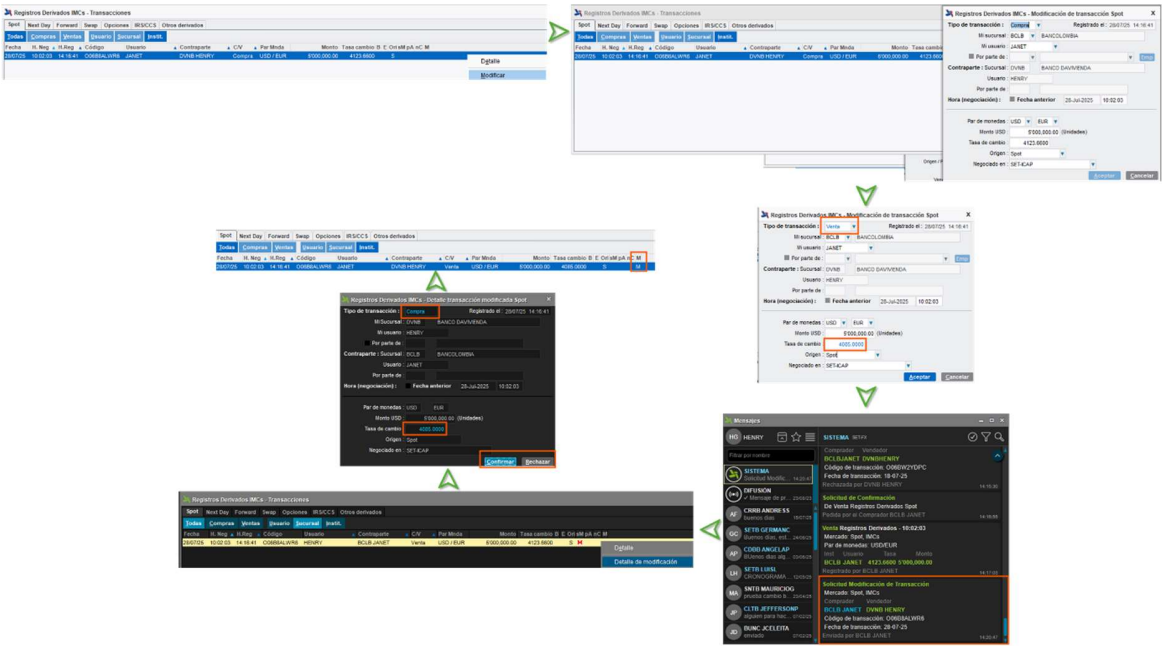


Ilustración 70 Ejemplo Modificación

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

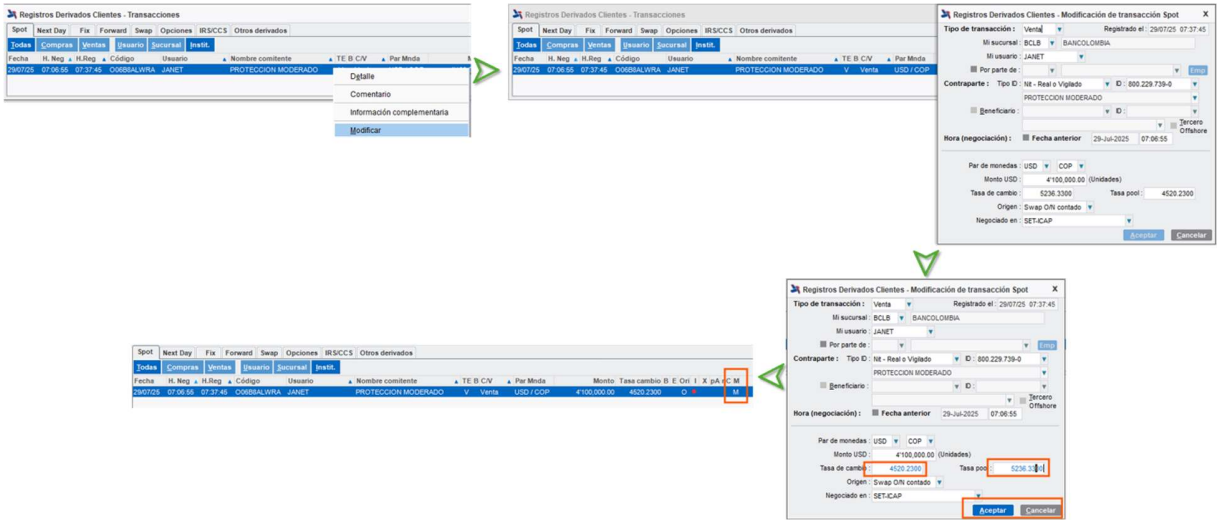


Ilustración 71 Ejemplo Modificación

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.

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.

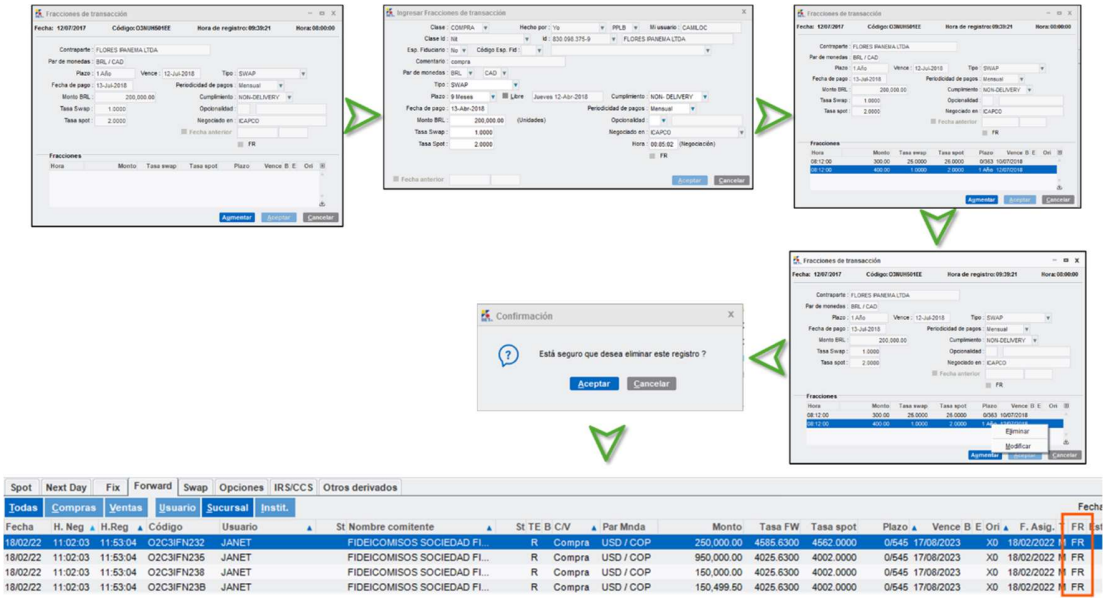


Ilustración 72 ejemplo Fraccionar

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

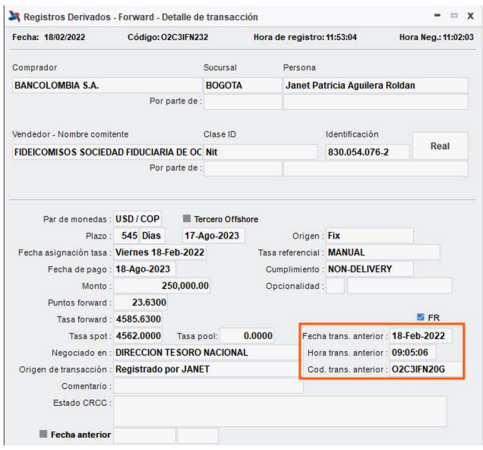


Ilustración 73 Detalle Fraccionamiento

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 SRVPPL	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.

- **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.

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.

Ilustración 78 Botón Empleados

Para crear un Empleado se debe realizar los siguientes pasos:

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

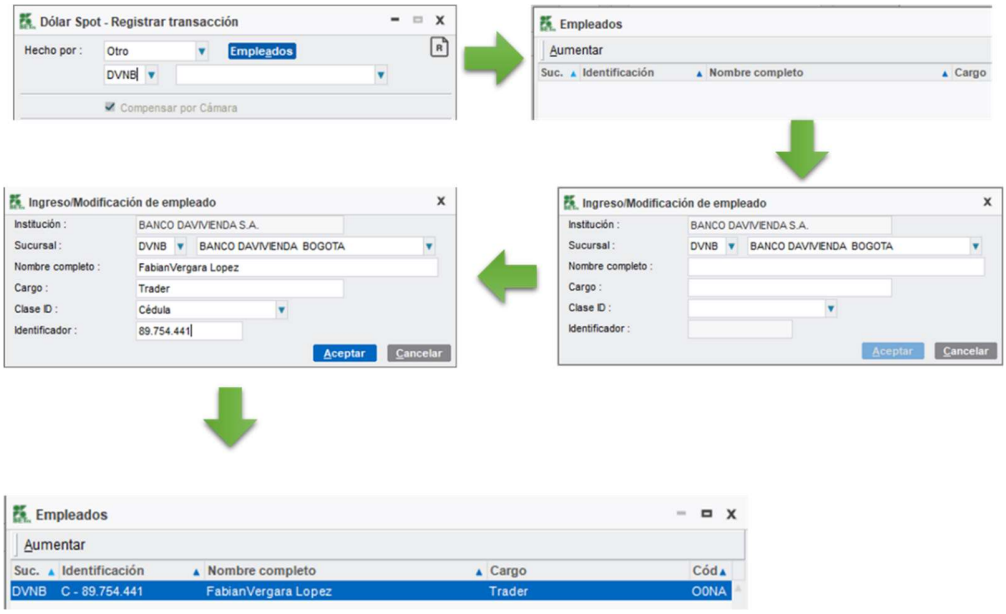


Ilustración 79 Ejemplo Ingresar Empleado

7.1. Registro Spot IMC – IMC

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- 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)
- 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).

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: Nemotécnico 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)

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: 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)
- 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)

- 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: 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)
- 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)

- 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)

- 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)

7.6. Registro Opciones IMC – IMC

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: Nemotécnico 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)

- 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

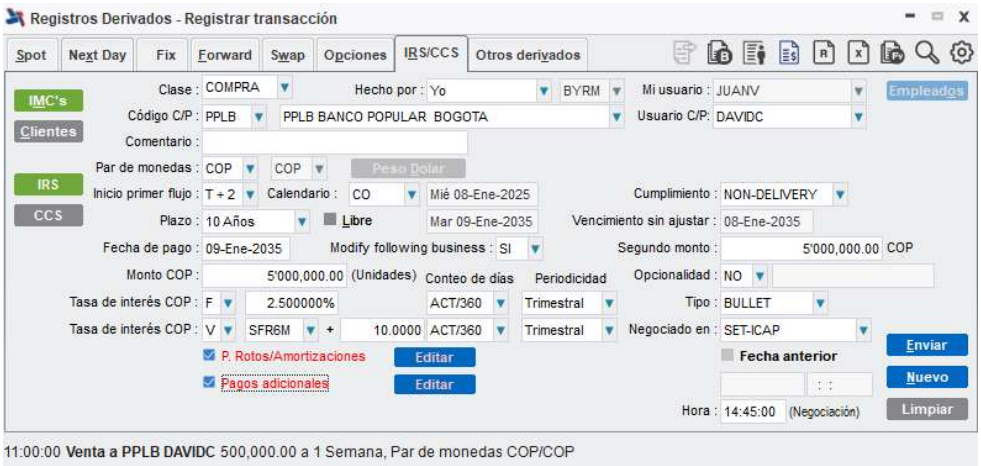


Ilustración 85 Ejemplo IRS

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

- 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

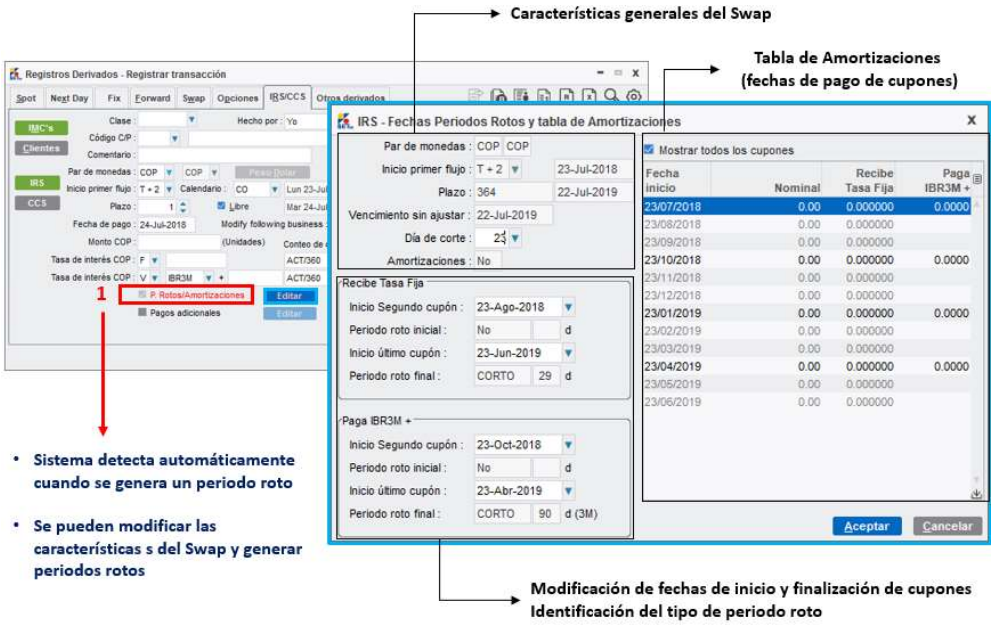


Ilustración 86 Periodos Rotos

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

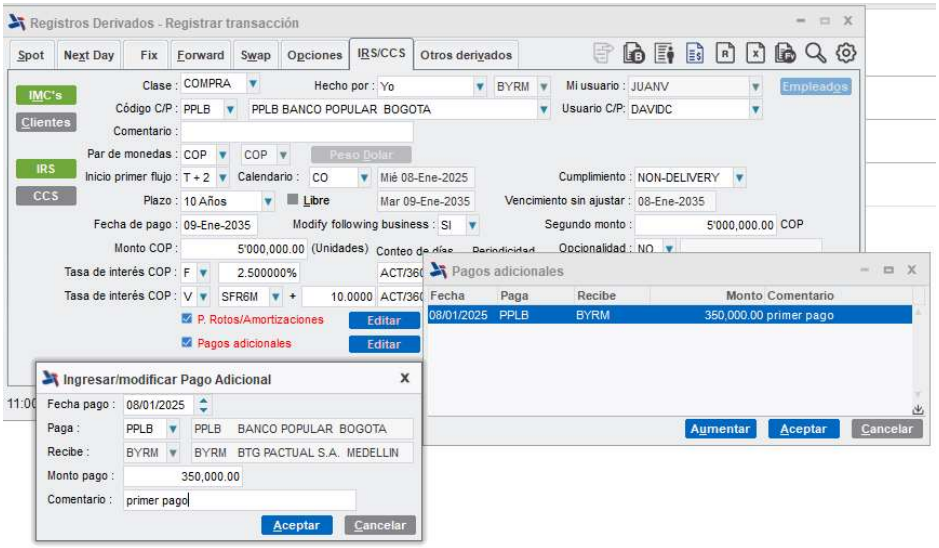


Ilustración 87 Pagos Adicionales

7.8. Registro CCS IMC – IMC

Ilustración 88 Ejemplo CCS

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)

- 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

- 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

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: 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: 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)

- 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

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)

- 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

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)

- 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

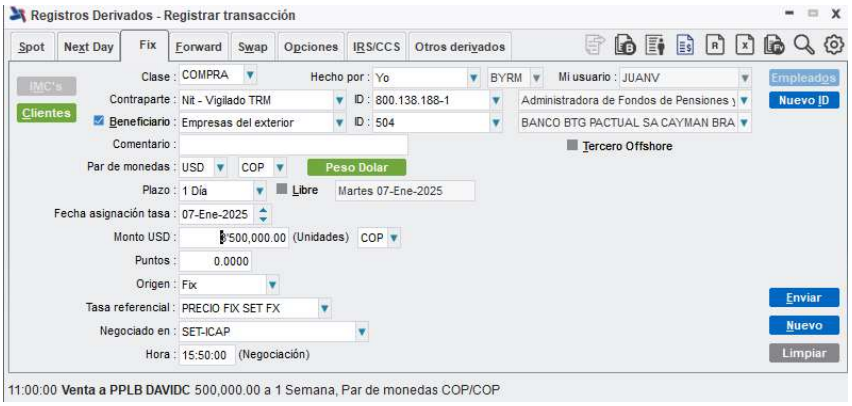


Ilustración 92 Ejemplo FIX

- 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)

- 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.

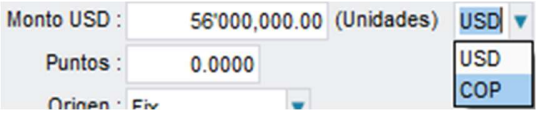


Ilustración 95 Expresión Monto

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

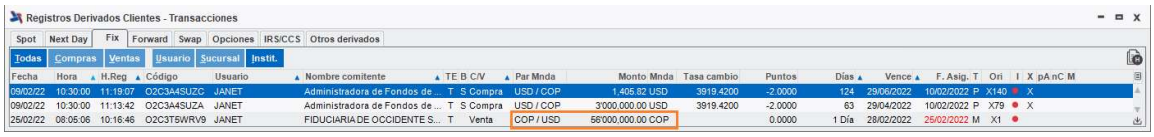


Ilustración 96 Transacciones FIX

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

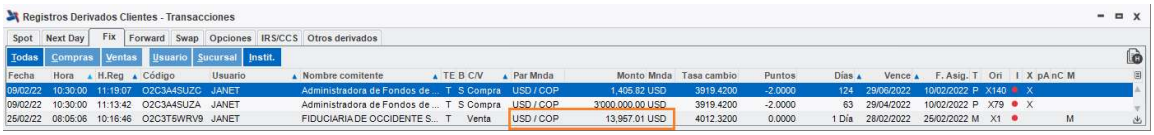


Ilustración 97 Transacciones FIX

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

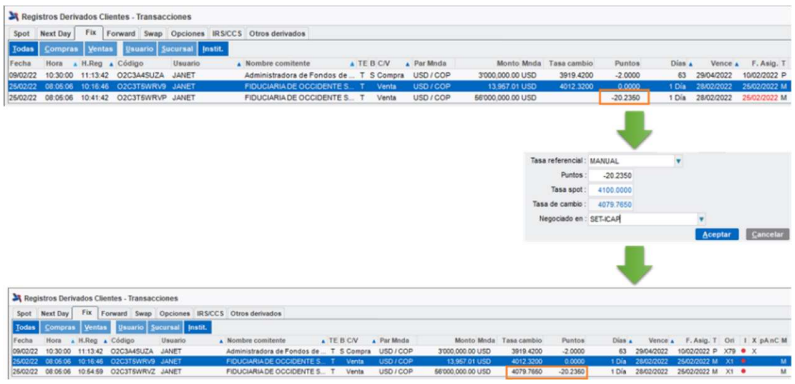


Ilustración 98 Transacciones FIX Puntos

- 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)

7.13. Registro Forward IMC – Cliente

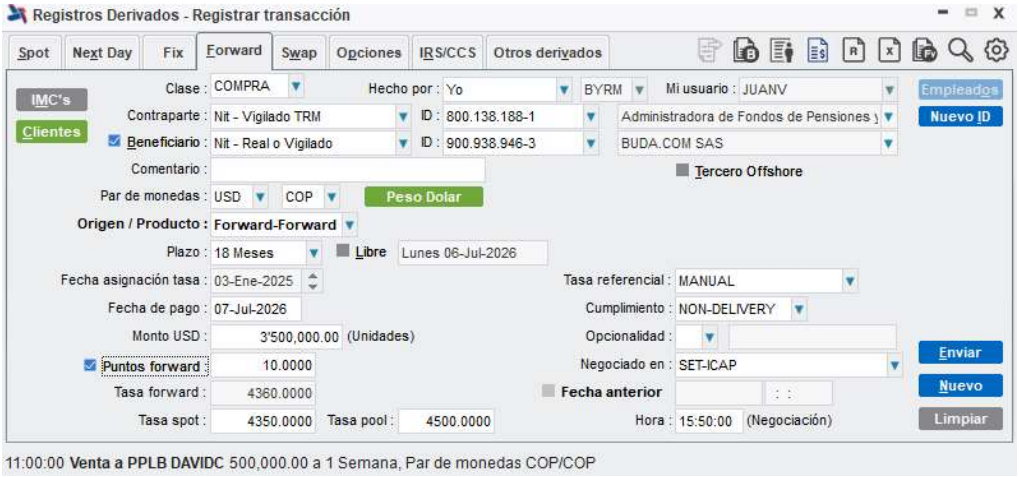


Ilustración 99 Ejemplo Forward

- 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)

- 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)

7.14. Registro Swap IMC – Cliente

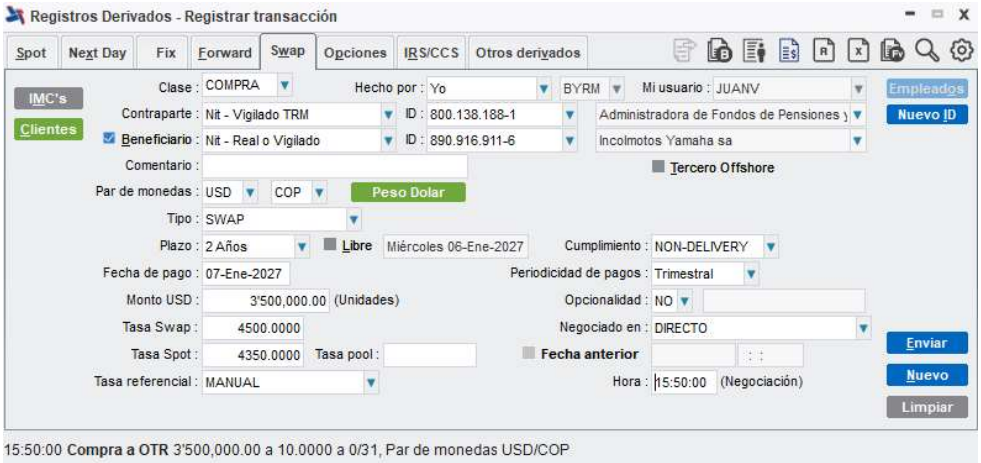


Ilustración 100 Ejemplo Swap

- 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)

- 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)

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)

- 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

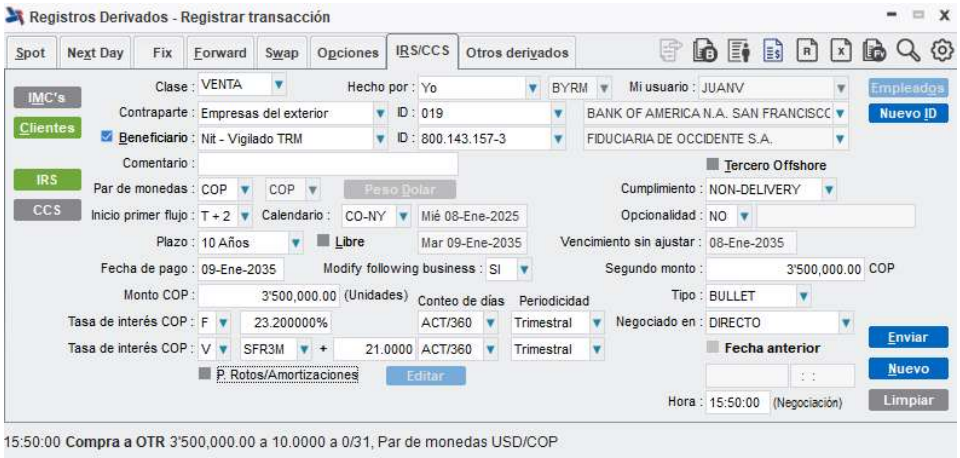


Ilustración 102 Ejemplo IRS

- 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)

- 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

- 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

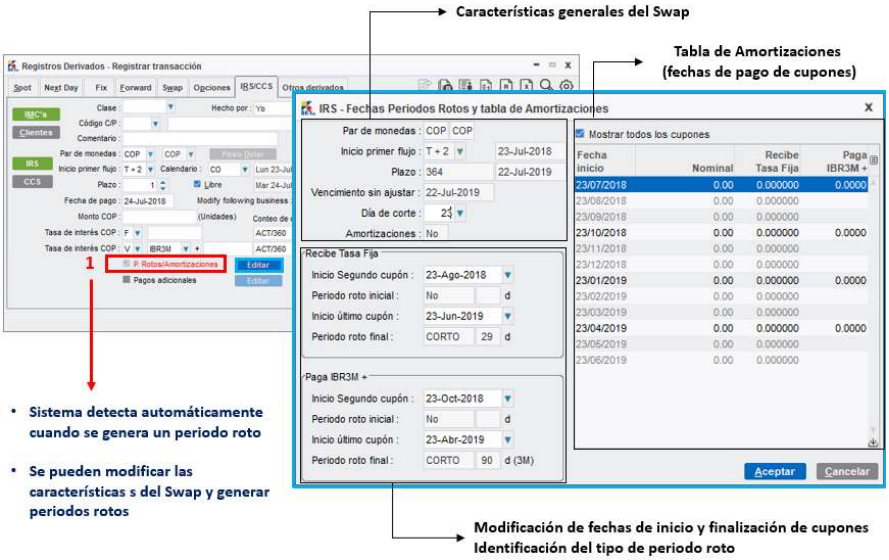


Ilustración 103 Periodos Rotos

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

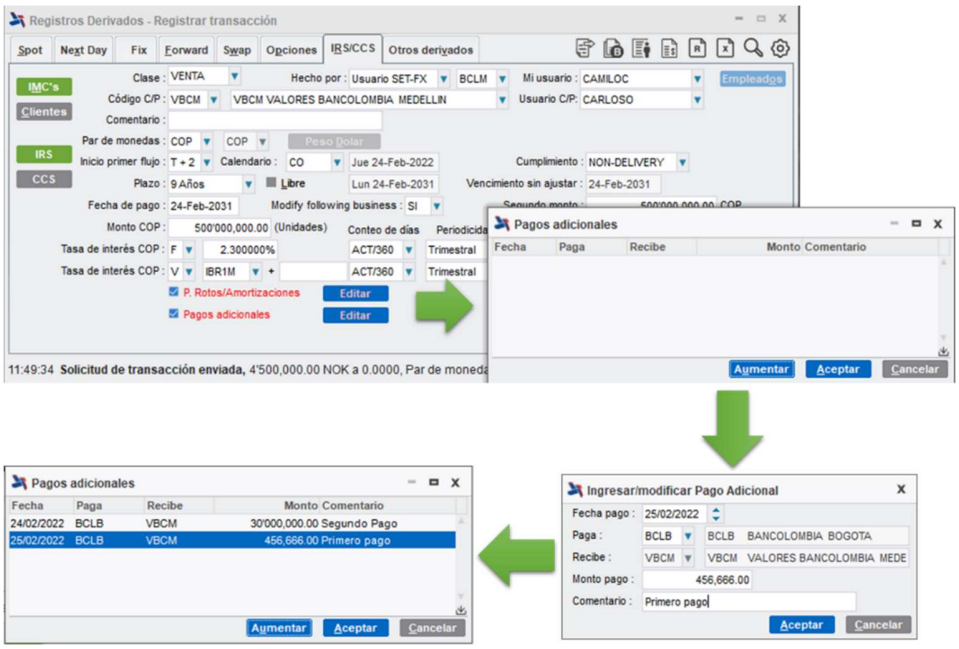


Ilustración 104 Pagos Adicionales

7.17. Registro CCS IMC – Clientes

Ilustración 105 Ejemplo CCS

- 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)
- 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
- 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

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)

- 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".

- 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.