

MERCADO DÓLAR SWAP

Manual de usuario



	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

Contenido

INTRODUCCIÓN	¡Error! Marcador no definido.
OBJETIVO	3
1. GENERALIDADES EN LA IMPORTACIÓN DE OPERACIÓN POR EL MECANISMO DE XML . ¡Error!	Marcador no definido.
2. XML	¡Error! Marcador no definido.
2.1. Importación Manual.....	¡Error! Marcador no definido.
2.2. Importación Automática	¡Error! Marcador no definido.
3. VENTANA REGISTRO DE DIVISAS CLIENTES- IMPORTACIÓN DE TRANSACCIONES XML . ¡Error!	Marcador no definido.
3.1. Importar XML	¡Error! Marcador no definido.
3.1.1. Operaciones con estado “Errónea”	¡Error! Marcador no definido.
3.2. Ultima Importación	¡Error! Marcador no definido.
4. ESTRUCTURA DEL ARCHIVO DE IMPORTACIÓN XML	¡Error! Marcador no definido.
5. EJEMPLOS DE IMPORTACIÓN XML.....	¡Error! Marcador no definido.
6. MODIFICACIÓN AUTOMÁTICA VÍA XML	¡Error! Marcador no definido.
7. ANULACIÓN DE OPERACIONES.....	¡Error! Marcador no definido.
INFORMACIÓN ADICIONAL	¡Error! Marcador no definido.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

OBJETIVO

El presente manual tiene como objetivo explicar en detalle el funcionamiento del Mercado Dólar Swap, el cual es un mercado derivado que se efectúa entre la moneda local y el dólar norteamericano. Las posturas en este mercado se realizan a una fecha futura sobre un monto y tasa previamente establecidos.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

1. GENERALIDADES

El sistema permite la negociación y el registro de operaciones Swap bajo los siguientes parámetros y condiciones operativas:

- **Intercambio de Divisas y Plazos:** Permite realizar operaciones de intercambio entre el dólar de los Estados Unidos (USD) y el peso colombiano (COP), tanto en plazos predefinidos como en plazos libres.
- **Swaps Diferidos (Forward - Forward):** Permite realizar Swaps diferidos, es decir, transacciones que inician en una fecha futura diferente a hoy y finalizan en el plazo establecido para la operación.
- **Precio Spot de Referencia:** Todas las operaciones Swap se basan en un precio Spot que se calcula a través del mercado Spot.
- **Generación Automática tras Agresión:** Posterior a la agresión de demandas u ofertas, el sistema creará de forma automática tanto la operación de la pata Spot en el mercado Spot, como la operación futura en el mercado Swap.
- **Generación de la Pata Spot tras Registro:** Posterior al registro de una operación Swap, el sistema creará la operación de la pata Spot en el mercado Spot.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

2. INGRESO AL MODULO DÓLAR SWAP

Para acceder a la plataforma de negociación de este mercado derivado, siga estos pasos desde la interfaz principal:

- Ubique la barra principal del Sistema SET-FX.
- Seleccione el botón "Mercados".
- En el menú desplegable, diríjase a la opción "Dólar" y elija "Dólar Swap".

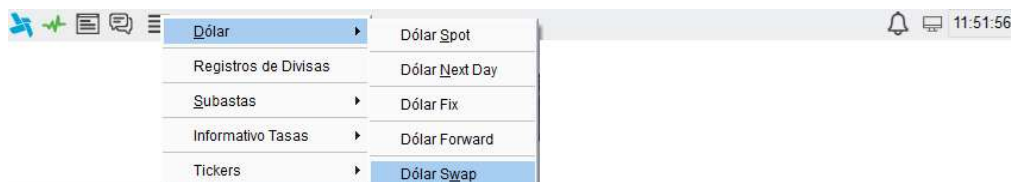


Ilustración 1 Ingreso Mercado Swap

Dólar Swap - Transacciones													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB				R
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A			
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A			
Total compras sucursal:			1'250,000										
Total ventas sucursal:			500,000										

Ilustración 2 Ventana Transacciones

3. DÓLAR SWAP - TRANSACCIONES

Los botones de las principales funciones del mercado se ubican en la parte superior derecha del Blotter. A continuación, se describe cada botón y su función correspondiente:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB									
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A								
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A								

Total compras sucursal: 1'250,000
 Total ventas sucursal: 500,000

Ilustración 3 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtro de visualización	Permite visualizar las operaciones de acuerdo con los filtros (todas, compras/ventas, usuarios, sucursales o instituciones)
2	Operaciones realizadas	En esta zona de la ventana se visualizan todas las operaciones de acuerdo con los filtros seleccionados se visualizarán las operaciones celebradas
3	Resumen operaciones realizadas	En la parte inferior de la ventana se visualizará el total de las operaciones realizadas de acuerdo con los filtros que hayan sido aplicados.
4	Mercado Swap	Abre la ventana que permite ingresar las demandas y ofertas al mercado.
5	Registrar	Permite realizar el registro de operaciones del mercado Swap.
6	Cupos	Permite acceder a la tabla global de cupos desde la cual podrá ingresar, modificar, eliminar los valores asignados a los cupos por entidad.
7	Gráficos y precios	El botón de gráficos permite acceder a las diversas representaciones gráficas de las operaciones Swap en el sistema SET-FX, proporcionando múltiples opciones de visualización.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Dólar Swap - Transacciones											
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.						
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I R E	Est
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	R	
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A	
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A	
Total compras sucursal:			1'250,000								
Total ventas sucursal:			500,000								

Ilustración 4 Ventana Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Transacciones por fecha de vencimiento	Permite a los usuarios visualizar de forma agregada las operaciones que tienen un vencimiento o una asignación de tasa programada en un periodo específico. Su diseño optimiza la revisión y el análisis al consolidar información de múltiples mercados en una sola vista.
2	Consultas	Ventana de consultas que permite al usuario revisar el historial de ingresos de posturas, transacciones y anulaciones.
3	Configuración de mercado	Permite el acceso a la configuración del manejo de límites.
4	Días Anteriores	Permite realizar una consulta histórica de las transacciones realizadas en días anteriores
5	Solicitudes de Registro	Visualiza los estados de las solicitudes de registro
6	Anulaciones y Solicitudes de Anulación	Permite visualizar los estados de las solicitudes de anulaciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

4. MERCADO TRANSACCIONAL SWAP

En la ventana de Dólar SWAP, el usuario podrá ingresar sus demandas u ofertas dependiendo de los plazos seleccionados. A continuación, se describe la composición y los campos que integran esta interfaz:

Dólar Swap - Transacciones

Todas

Compras

Ventas

Usuario

Sucursal

Instit.

R

Ilustración 5 Botón Transaccional



Plazo	Vence	Cód.	M	Monto	Puntos	TML	TML	Puntos	Monto M	Cód.
SWAPS										
1 Semana	30-Jun-2026		N	800	0.99					
2 Semanas	06-Jul-2026									
1 Mes	22-Jul-2026									
2 Meses	20-Ago-2026							0.36	8,000 N	BCLB
3 Meses	22-Sep-2026							2.30	500 N	
6 Meses	22-Dic-2026	BCLB	N	500	2.00					
9 Meses	19-Mar-2027									
1 Año	22-Jun-2027									
18 Meses	22-Dic-2027									
2 Años	22-Jun-2028									
FORWARD FORWARD										
2x6	30-Jun-2026	BCLB	N	500	0.00					
08:05:59 Compra a DVNB HENRY										
750,000 a 0.00 a 2 Semanas								Precio Spot 3486.23		

Ilustración 6 Ventana Transaccional

Ítem	Nombre	Descripción
1	Demandas/Ofertas	Muestra el listado de las posturas de compra (demandas) y venta (ofertas) activas en el

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

		sistema, detallando su modalidad (M), monto, precio y puntos.
2	Plazos y vencimientos	Despliega los diferentes plazos estandarizados o libres disponibles para la negociación, junto con su respectiva fecha exacta de vencimiento.
3	Ultima transacción realizada	Informa la última operación realizada en el mercado Forward.
4	Precio Spot	Visualiza el precio de cierre del mercado Spot en el momento.

4.1. Ingreso De Posturas

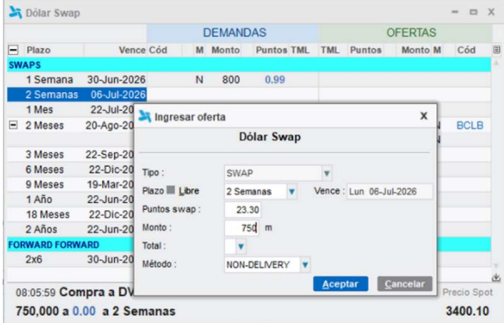
El sistema ofrece dos opciones para ingresar posturas en los diferentes plazos:

- Opción 1: Hacer clic derecho en la parte superior de la ventana, directamente sobre las palabras “Demandas” u “Ofertas”, y elegir la acción deseada (Demandar u Ofertar).
- Opción 2: Oprimir la tecla F5 para ingresar una demanda, o la tecla F6 para ingresar una oferta.

Con cualquiera de las dos alternativas, el sistema desplegará una ventana emergente para imputar la información de la postura que se desea ingresar.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Dólar Swap

DEMANDAS

Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Puntos TML	TML	Puntos	Monto M	Cód
1 Semana	30-Jun-2026	N	800	0.99					
2 Semanas	06-Jul-2026								
1 Mes	22-Jul-2026								
2 Meses	20-Ago-2026								
3 Meses	22-Sep-2026								
6 Meses	22-Dic-2026								
9 Meses	19-Mar-2027								
1 Año	22-Jun-2027								
18 Meses	22-Dic-2027								
2 Años	22-Jun-2028								

OFERTAS

Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Puntos TML	TML	Puntos	Monto M	Cód
1 Semana	30-Jun-2026	N	800	0.99					
2 Semanas	06-Jul-2026								
1 Mes	22-Jul-2026								
2 Meses	20-Ago-2026								
3 Meses	22-Sep-2026								
6 Meses	22-Dic-2026	BCLB	N	500	2.00				
9 Meses	19-Mar-2027								
1 Año	22-Jun-2027								
18 Meses	22-Dic-2027								
2 Años	22-Jun-2028								

FORWARD FORWARD

Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Puntos TML	TML	Puntos	Monto M	Cód
2x6	30-Jun-2026	BCLB	N	500	0.00				

08:05:59 Compra a DVNB HENRY
750,000 a 0.00 a 2 Semanas
Precio Spot: 3400.10

Ilustración 7 Ingreso Postura

4.2. Opciones De Posturas Ingresadas

Al hacer clic derecho sobre una intención o postura ya ingresada, el usuario tendrá acceso a las siguientes opciones de gestión:

- Detalle
- Modificar
- Retirar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 10/06/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 25/06/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 05/07/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



DEMANDAS				OFERTAS			
Plazo	Vence Cód	M	Monto	Puntos TML	TML	Puntos	Monto M
SWAPS							
1 Semana	30-Jun-2026	N	800	0.99			
2 Semanas	06-Jul-2026					23.30	
1 Mes	22-Jul-2026					0.36	8
2 Meses	20-Ago-2026					2.30	
3 Meses	22-Sep-2026						
6 Meses	22-Dic-2026	BCLB	N	500	2.00		
9 Meses	19-Mar-2027						
1 Año	22-Jun-2027						
18 Meses	22-Dic-2027						
2 Años	22-Jun-2028						
FORWARD FORWARD							
2x6	30-Jun-2026	BCLB	N	500	0.00		

08:05:59 Compra a DVNB HENRY
750,000 a 0.00 a 2 Semanas

Precio Spot: 3400.10

Ilustración 8 Opciones Posturas

4.3. Operaciones Por Tabla (Transaccionales)

La posibilidad de realizar transacciones en el mercado está limitada por el cupo bilateral y la configuración previa de los Factores de Riesgo de los plazos.

El procedimiento para negociar compras y/o ventas es idéntico. Primero se debe ubicar el mouse sobre el plazo requerido y luego ejecutar cualquiera de los siguientes métodos:

- A través de la barra de herramientas: Utilizar el botón de Vender o Comprar en la barra de botones del mercado.
- A través del teclado: Presionar la tecla F3 para vender o F4 para comprar.
- A través del menú contextual: Hacer clic derecho sobre la postura deseada y seleccionar la opción "Vender" o "Comprar", según sea el caso.

Tras ejecutar la orden por cualquiera de los métodos anteriores, aparecerá una ventana de confirmación donde el usuario podrá revisar los datos para aceptar o cancelar la operación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

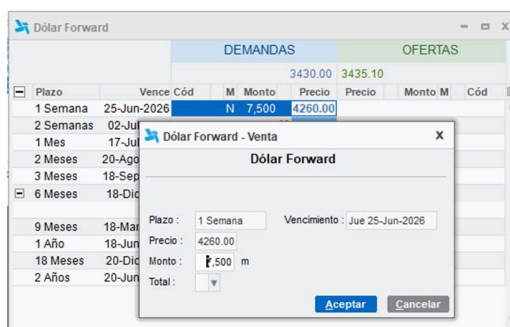


Ilustración 9 Agredir Postura

Posterior a la agresión de las posturas, el usuario podrá realizar el seguimiento y monitoreo de ambas transacciones en sus respectivos módulos:

- Mercado Swap: La operación correspondiente al Swap se visualizará en el blotter de operaciones del mercado Swap.



Ilustración 10 Ventana Transacciones

- Pata Spot: La operación de la pata Spot se visualizará de forma independiente en el blotter de operaciones del mercado Spot.

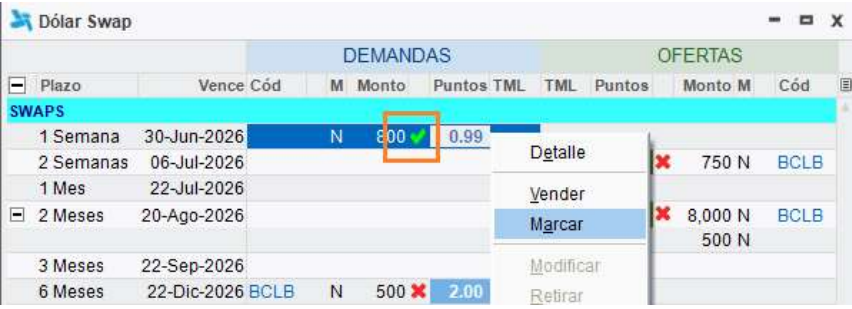
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Ilustración 11 Registro Spot

4.4. Funcionalidades Adicionales del Menú Contextual

- Opción Marcar: Al hacer clic derecho sobre una postura, se puede seleccionar la opción “Marcar” para elegir una o más posturas simultáneamente. Al dar la orden de comprar o vender, serán agredidas todas aquellas posturas que hayan sido marcadas previamente.



DEMANDAS										OFERTAS	
Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Puntos	TML	TML	Puntos	Monto	M	Cód
SWAPS											
1 Semana	30-Jun-2026	N	800	0.99							
2 Semanas	06-Jul-2026										
1 Mes	22-Jul-2026										
2 Meses	20-Ago-2026										
3 Meses	22-Sep-2026										
6 Meses	22-Dic-2026	BCLB	N	500	2.00						

Ilustración 12 Marcar Postura

- Opción Detalle: Permite visualizar la información detallada de una postura específica al hacer clic derecho sobre esta y seleccionar la opción “Detalle”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

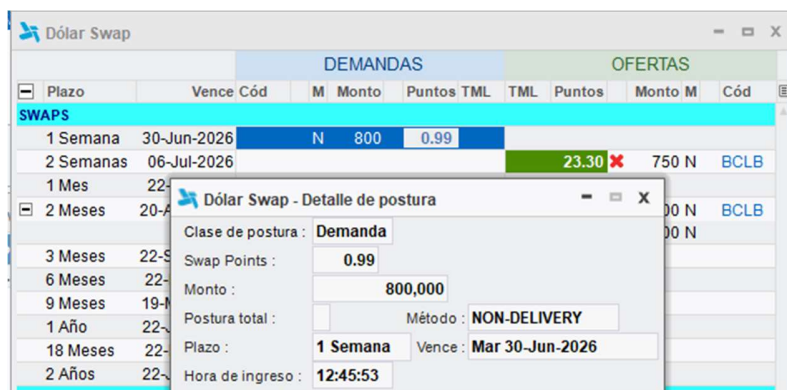


Ilustración 13 Detalle Postura

5. REGISTRO DE OPERACIONES

El sistema SET-FX permite registrar operaciones previamente negociadas en el mercado OTC o en otro sistema de negociación y registro de divisas.

Para registrar una transacción, debe hacer clic en el botón correspondiente ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.

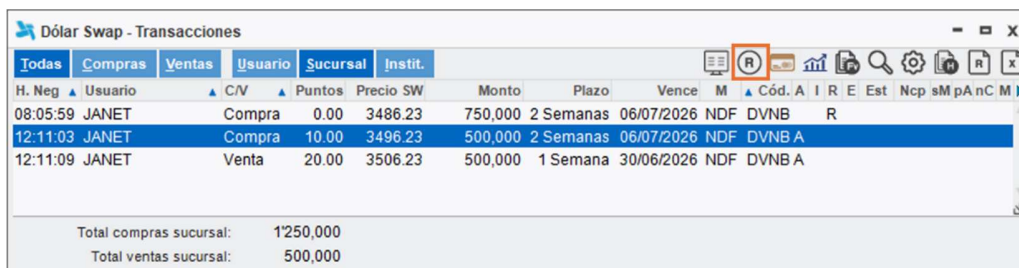


Ilustración 14 Botón Registro

4.1. Botones y funciones de la ventana “Registrar Transacción”

A continuación, se describen las principales funcionalidades de la ventana para el registro de transacciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 10/06/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 25/06/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 05/07/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

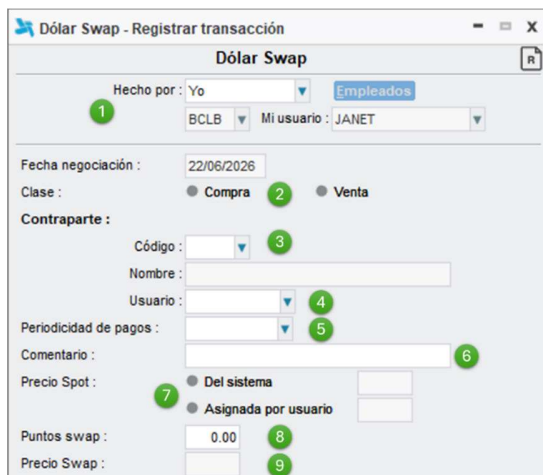


Ilustración 15 Ventana Registro

Ítem	Nombre	Descripción
1	Hecho por	El usuario puede realizar registros a nombre propio, a nombre de un usuario de la misma entidad que se encuentre vinculado en el sistema SET-FX o a nombre de un funcionario de la entidad y que no tenga un usuario registrado en el sistema SET-FX. Al desplegar el listado se dan estas 3 opciones: - Yo, - Usuario SET-FX - Otro
2	Compra/Venta	Indica si el registro es una compra o venta. Campo obligatorio
3	Código	Nemotécnico de la entidad contraparte. Campo obligatorio
4	Usuario	Nombre del usuario contraparte. Campo obligatorio.
5	Periodicidad de pagos	Indica la periodicidad de los pagos pactados en la operación, opciones para el registro: - Mensual - Trimestral - Semestral - Anual
6	Comentario	Permite el ingreso de un comentario, campo opcional.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

7	Precio Spot	Permite seleccionar dos opciones: • Precio Spot del Sistema • Precio Spot Asignada por el usuario
8	Puntos Swap	Estos puntos se suman o se restan al precio spot base de la operación, dependiendo estrictamente del signo con el que se cotice o registre la transacción en el sistema: • Signo Positivo (+): Los puntos se suman al precio spot. • Signo Negativo (-): Los puntos se restan al precio spot.
9	Precio Swap	• Precio final pactado posterior al aplicar los puntos Forward (ya sea sumando o restando según los puntos Forward) sobre el precio spot definido en la operación pactada.



Ilustración 16 Ventana Registro

Ítem	Nombre	Descripción
1	Monto en dólares	Monto del registro, expresado en unidades.
2	Tipo	Tipo de Swap: • Swap • Forward-Forward

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

3	Plazo	Tiempo de duración de la operación. Con opciones de plazos estándar o libre
4	Vence	Indica la fecha de vencimiento dependiendo del plazo seleccionado.
5	Fecha de pago	La fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento.
6	Modalidad de cumplimiento	NON-DELIVERY, DELIVERY
7	Tasa de referencia	Campo informativo sobre la tasa de referencia del registro: • Promedio SET-FX • TRM • Manual
8	Opcionalidad	• Permite indicar si existe o no una opcionalidad en la operación.
9	Tipo de opcionalidad	Indique el tipo de opcionalidad.

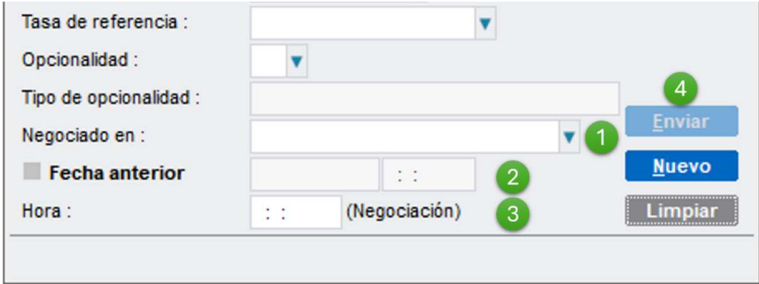


Ilustración 17 Ventana de Registro

Ítem	Nombre	Descripción
1	Negociado en	Sistema de negociación del registro, Directo, SET-ICAP, Bloomberg, Banco de la República, GFI Exchange, Tradition, OTC, Refinitiv, Dirección Tesoro Nacional. Campo obligatorio.
2	Fecha anterior	Campo para indicar que el registro es del día anterior. Solo se activa durante los primeros 15 minutos de apertura del mercado, de acuerdo con la norma DOAM-317 del Banco de la Republica.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 10/06/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 25/06/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 05/07/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

3	Hora	Hora de negociación del registro. Formato de hora militar. No se permite el ingreso de una hora superior a la hora actual del sistema.
4	Botones de Enviar, Nuevo, Limpiar	• Enviar: cuando los datos de la operación este ingresados correctamente el botón “Enviar” se activa, se procede a realizar el registro. • Nuevo: permite realizar un nuevo registro con los datos del anterior registro enviado. • Limpiar: Para borrar los datos en todos los campos y generar un nuevo registro.

4.2. Envío de Registros

Una vez ingresada la información para registrar una transacción en el sistema SET-FX, se deben realizar procesos posteriores para que el registro sea validado como una operación válida. En caso de no cumplir con los criterios, el registro no será tomado en cuenta.

4.3. Confirmación de registros

Después de que el usuario completa el diligenciamiento de los campos correspondientes al registro, el sistema envía una solicitud de confirmación a la contraparte. Esta contraparte podrá revisar en detalle la información del registro y decidir si lo confirma o lo rechaza.

Proceso de Confirmación:

a) Solicitud de registro:

El usuario BCLB JANET envía una solicitud de registro al usuario DVNB HENRY.

b) Recepción de la solicitud:

DVNB HENRY recibe un mensaje de “Solicitud de confirmación” en la bitácora de mensajes.

c) Visualización de la solicitud:

DVNB HENRY hace doble clic sobre la solicitud y se despliega la ventana “Dólar Forward – Solicitud de registro”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

d) Confirmación del registro:

Haga clic derecho sobre la solicitud y seleccione la opción “Confirmar registro”.

e) Selección del usuario que confirma:

Aparecerá una ventana de confirmación, donde se puede elegir el usuario que confirma la operación.

f) Confirmación final:

Al hacer clic en el botón “Aceptar”, el sistema enviará un mensaje a las partes involucradas, informándoles que la operación ha sido confirmada y ahora se encuentra en firme.

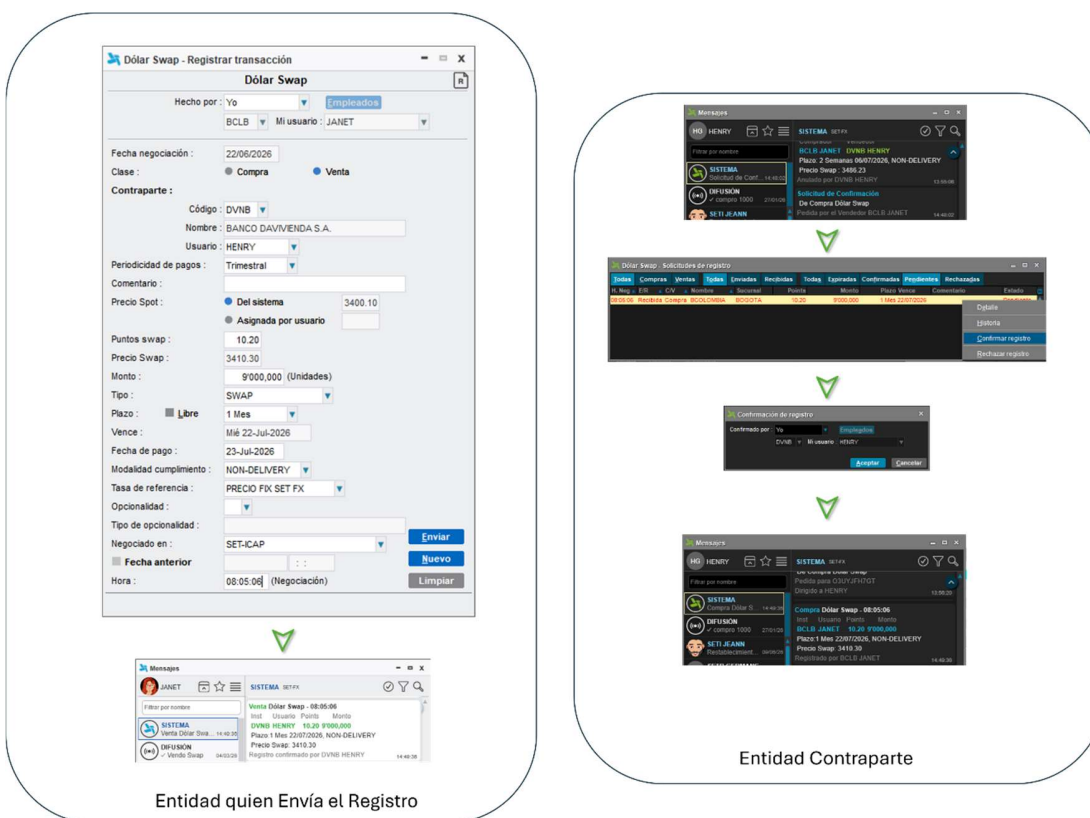


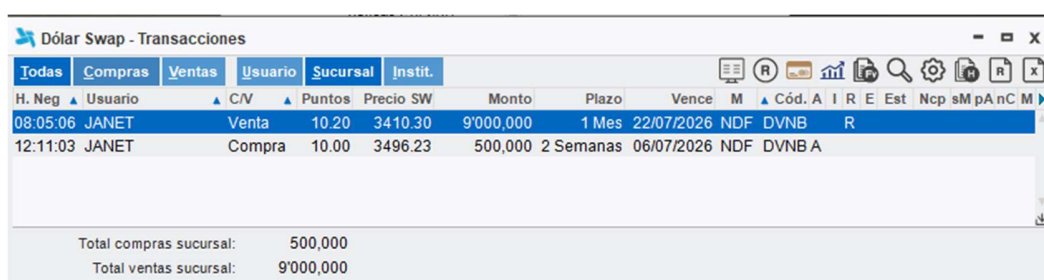
Ilustración 18 Ejemplo Registro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Posterior al registro de la operación, el usuario podrá realizar el seguimiento y monitoreo de ambas transacciones en sus respectivos módulos:

- Mercado Swap: La operación correspondiente al Swap se visualizará en el blotter de operaciones del mercado Swap.



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód	A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:06	JANET	Venta	10.20	3410.30	9'000,000	1 Mes	22/07/2026	NDF	DVNB										
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A									

Total compras sucursal: 500,000
Total ventas sucursal: 9'000,000

Ilustración 19 Ventana Transacciones

- Pata Spot: La operación de la pata Spot se visualizará de forma independiente en el blotter de operaciones del mercado Spot.



Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód	A	R	E	Ori	vC	I	C	sC	sM	pA	nC	M	Comentario
22/06/26 08:01:00	09:12:46		O07HBQZQGN	JANET	Venta	4045.20	1886		A	R		S									
22/06/26 08:01:00	09:12:46		O07HBQZQGR	JANET	Venta	4045.20	5095		A	R		S									
22/06/26 08:05:06	14:48:02		O3UYJFH7H4	JANET	Compra	3400.10	9000		R			W									
22/06/26 12:11:03			O3UYJFH7GS	JANET	Venta	3486.23	500		A			W									
22/06/26 13:27:05			O3UYJFH7H1	JANET	Venta	3400.10	250		A												

Total compras sucursal: 22'322,660 3785.11
Total ventas sucursal: 10'466,982 4003.09

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
BCL:	22'322,660		10'466,982		11'855,678
Cupo:	37'844,322		62'155,678		

Estado de transferencias: Compensación pendiente

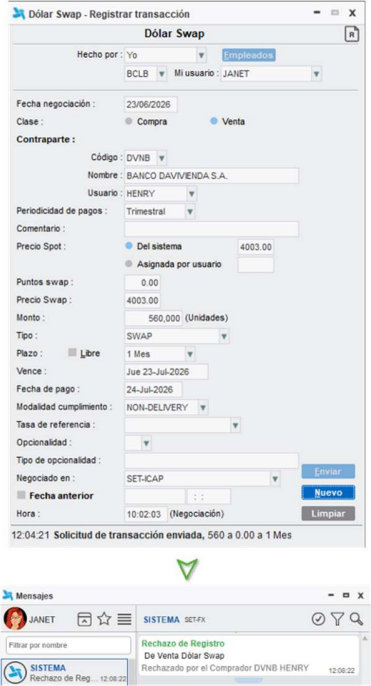
Ilustración 20 Ventana Transacciones

4.4. Rechazo De Registro

Si la solicitud de registro es rechazada por la contraparte, el sistema SET-FX enviará un mensaje al usuario que envió el registro, notificando el rechazo de la operación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	



Entidad quien Envía el Registro



Ilustración 21 Ejemplo Rechazo Registro

5. CUPOS

Para realizar operaciones transaccionales en el mercado Dólar Forward, es un requisito indispensable la asignación de límites operativos o, en su defecto, la compartición de cupos provenientes de otros mercados del sistema y el cual podrá acceder desde el siguiente icono:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 22 Botón Cupos

- Ingrese primero a la opción Mercado Forward.
- Esto habilitará el botón de Cupos, el cual da acceso a la ventana de Cupos Bilaterales. En esta interfaz se deberán configurar inicialmente los Factores de Riesgo que regulan y afectan a todo el mercado.

Definiciones Conceptuales:

- Límite: Equivalente al concepto de línea de crédito. Representa el monto máximo asignado a una contraparte específica para realizar transacciones en el sistema.
- Cupo Bilateral: Es el saldo disponible del Límite. Se calcula matemáticamente como la diferencia entre el límite total y el monto de las transacciones que aún no han sido liberadas por el sistema.



Ilustración 23 Ventana Cupos

Ítem	Nombre	Descripción
1	Configuración	Indica la configuración actual de los cupos bilaterales

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 10/06/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 25/06/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 05/07/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

2	Límite de Compra/Venta	Visualiza el límite bilateral ingresado de acuerdo con la entidad contraparte seleccionada
3	Cupo de Compra/Venta	Visualiza el cupo bilateral ingresado de acuerdo con la entidad contraparte seleccionada
4	Institución	Visualiza las entidades contraparte configuradas en el blotter de cupos bilaterales contrapartes
5	Factores de riesgo	Botón para configurar el factor de riesgo
5	Aumentar	Permite aumentar entidades contraparte cuando no se encuentre visualizadas en el blotter de cupos bilaterales contraparte

5.1. Factores de Riesgo

Los factores de riesgo determinan el porcentaje en el que se disminuirá el cupo disponible de la contraparte por cada operación registrada, según el plazo de esta.

Configuración: Para crear un factor de riesgo, diríjase al icono de “Cupos” y seleccione la opción “Factores de riesgo”. Cada entidad debe ingresar los rangos de plazos y su respectivo porcentaje de afectación. Al cerrarse una operación Forward dentro de dicho rango, el cupo se reducirá en el porcentaje configurado sobre el monto de la transacción.

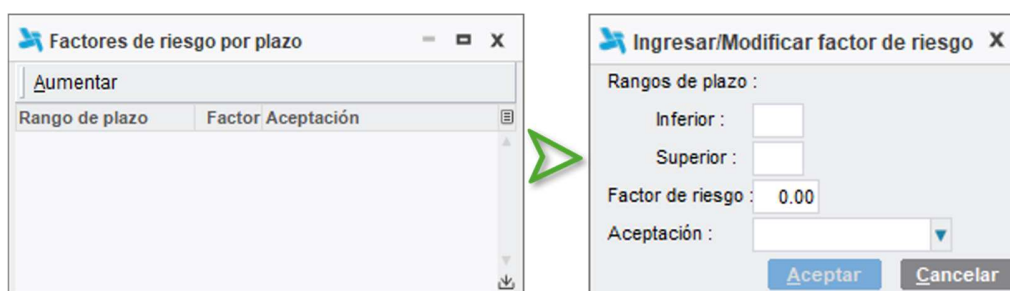


Ilustración 24 Ventana de Factor de Riesgo

Ejemplos de Configuración y Reglas de Aceptación:

- Afectación Total (Ejemplo de 1 a 7 días - Factor 100.00% / Aceptación "Automático"): Al cerrarse una operación dentro de este plazo, el cupo disponible se reducirá en un monto exactamente igual (100%) al negociado el día de la operación. La opción "Automático" permite que el registro se calce de forma directa si hay cupo.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 25 Ingreso Factor de Riesgo

- **Afectación Parcial** (Ejemplo de 15 a 30 días - Factor 50.00%): Al concretarse una operación en este rango, se descontará del cupo únicamente el 50% del monto total negociado. El cupo se mantendrá afectado por este porcentaje ponderado hasta que la operación llegue a su fecha de vencimiento.



- **Restricción de Negociación** (Ejemplo de 31 a 45 días - Opción "No negociar"): Permite bloquear plazos específicos. Si se configura un rango con la regla "No negociar", cualquier postura que se ingrese en dichos plazos será rechazada y no podrá ser ejecutada en el mercado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 26 Ejemplo Factor de Riesgo

Nota: Si no se registran plazos en la tabla de factores de riesgo, cualquier postura que se ingrese con un plazo no configurado no podrá ser negociada en ninguna circunstancia.

5.2. Asignación Y Modificación De Líneas De Crédito

- Agregar una contraparte

Para agregar una entidad contraparte que no se encuentra en la lista de contrapartes del blotter de cupos bilaterales, el administrador de cupos debe seguir estos pasos:

- Botón aumentar
- Seleccionar entidad contraparte
- Botón Aceptar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

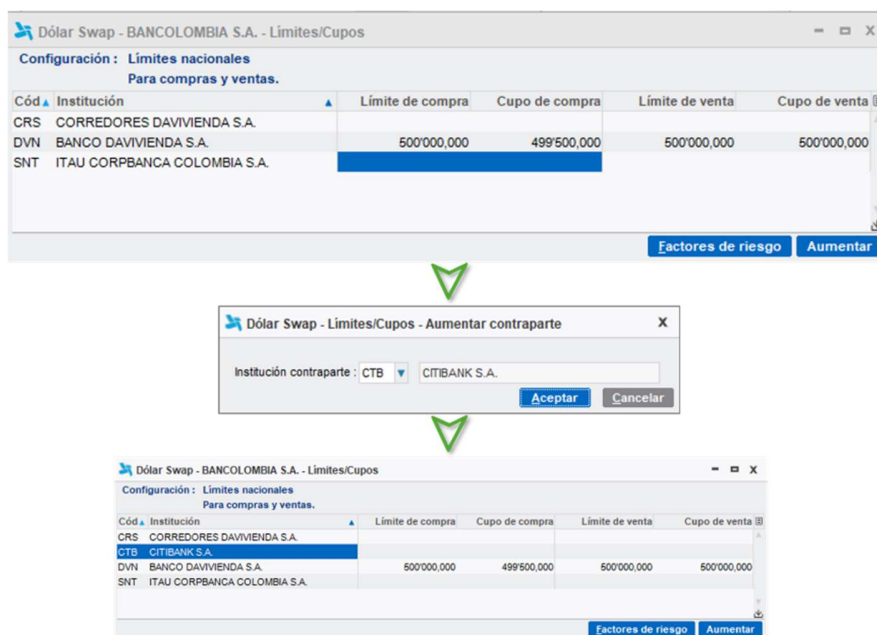


Ilustración 27 Ventana Cupos Bilaterales

- Eliminar una contraparte

Para eliminar una entidad contraparte de la lista de cupos bilaterales, el administrador de cupos debe seguir estos pasos:

- Seleccionar la entidad contraparte en la ventana de cupos
- Hacer Clic derecho y escoger la opción “Eliminar”
- Confirmar el mensaje de advertencia

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

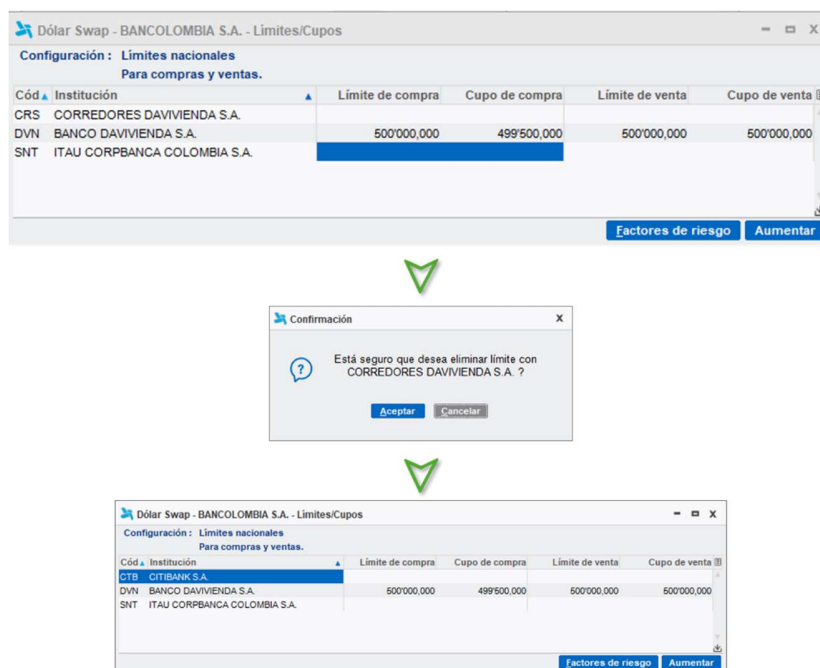


Ilustración 28 Ventana Cupos Bilaterales

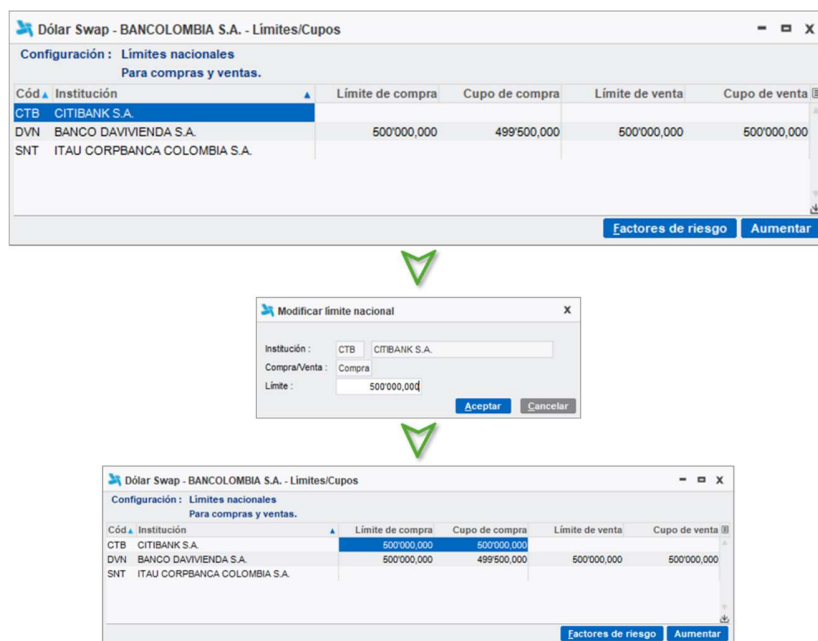
- Ingreso o Modificar Cupos Bilaterales

El administrador de cupos bilaterales debe realizar los siguientes pasos para ingresar o modificar cupos a una contraparte:

- Ubicar la entidad contraparte que se quiere modificar
- Seleccione la columna límite de comprar/venta o cupo de compra/venta
- Clic derecho modificar cupo o límite

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	



Dólar Swap - BANCOLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
CTB	CITIBANK S.A.	500'000,000	499'500,000	500'000,000	500'000,000
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.				
SNT	ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A.				

Factores de riesgo Aumentar

Modificar límite nacional

Institución: CTB CITIBANK S.A.
 Compra/Venta: Compra
 Límite: 500'000,000
 Aceptar Cancelar

Dólar Swap - BANCOLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
CTB	CITIBANK S.A.	500'000,000	500'000,000	500'000,000	500'000,000
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.	500'000,000	499'500,000	500'000,000	500'000,000
SNT	ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A.				

Factores de riesgo Aumentar

Ilustración 29 Ingreso o Modificación del Cupo

- Eliminar el Valor de los Cupos Ingresados

El administrador de cupos bilaterales puede eliminar el valor de los cupos asignados de la siguiente manera:

- Ubicar la entidad contraparte
- Seleccionar la columna límite de compra/venta o cupo de compra/venta
- Clic derecho eliminar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

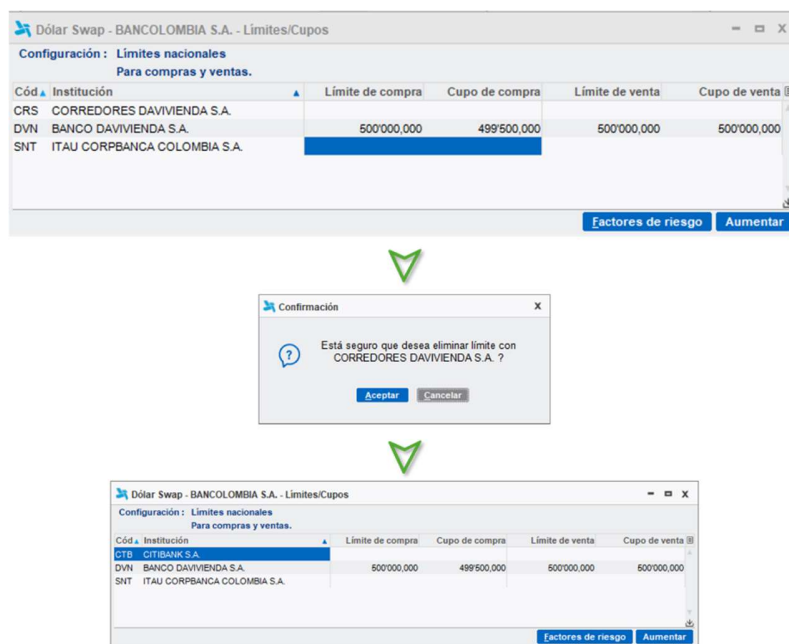


Ilustración 30 Ventana Cupos

- Suspender el Uso de Cupos Bilaterales

El administrador de cupos tiene la facultad de suspender temporal o permanentemente el uso de cupos bilaterales durante la jornada de negociación. Existen dos opciones para esta acción:

- Suspender: Detiene el uso de cupos hasta el final de la jornada de negociación. El cupo se reactivará automáticamente el siguiente día hábil.
- Suspender hasta reactivar: Detiene el uso de cupos de forma permanente con esa contraparte. El cupo solo se reactivará cuando el administrador lo haga manualmente.

6. GRAFICOS Y PRECIOS

El botón de gráficos permite acceder a las diversas representaciones gráficas de las operaciones Forward en el sistema SET-FX, proporcionando múltiples opciones de visualización.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 10/06/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 25/06/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 05/07/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB										
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A									
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A									

Total compras sucursal: 1250,000
Total ventas sucursal: 500,000

Ilustración 31 Botón Gráficos y Precios

6.1. Tasas/Montos Transacciones De Hoy

Permite visualizar los precios y montos de las operaciones realizadas durante la jornada actual.



Plazo	H. Neg	Points	Precio Spot	Monto R	M
1 Mes	10:02:03	0.00	4003.00	560,000 R	NDF
3 Meses	12:35:35	12.00	4003.00	500,000 P	NDF
6 Meses	12:35:37	0.00	4003.00	750,000 T	NDF
1 Año	12:35:39	0.00	4003.00	850,000 T	NDF

Ilustración 32 Ventana Tasa/Montos Transacciones

Ítem	Nombre	Descripción
1	Días anteriores	Permite visualizar los precios/montos transados de días anteriores.
2	Graficar	Permite graficar las operaciones dependiendo del plazo seleccionado.
3	Plazos	Tipos de plazos operados
4	Registrado	Tipo de operación realizada: - R: Registro - P: (pegada) agresión sobre demandas - T: (Tomada) agresión sobre las ofertas
5	Modalidad de Cumplimiento	Tipo de modalidad de cumplimiento de las operaciones realizadas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

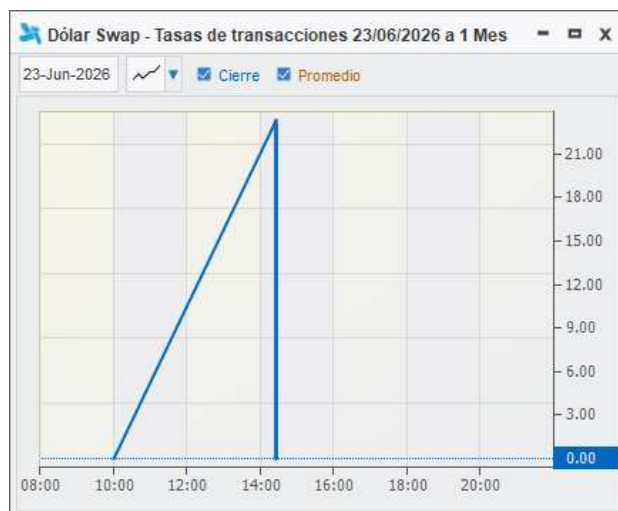


Ilustración 33 Ejemplo de grafica precios transacciones

6.2. Historia De Precios/Montos De Transacciones

El usuario puede consultar estadísticas del mercado por períodos anuales y graficar la información utilizando diversos filtros para una mejor interpretación de los datos.

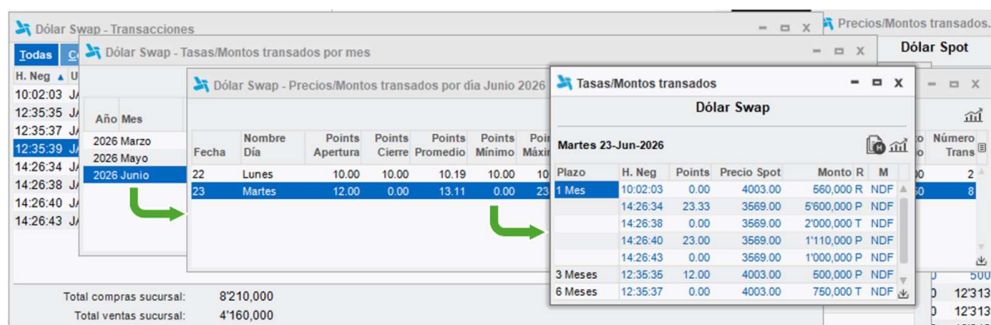


Ilustración 34 Historia Precios/Montos Transados

Desde la ventana “Dólar Forward – Precios/Montos transados por mes”, el usuario va a encontrar el icono de “Graficar”, el cual podrá seleccionar diferentes gráficos:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

Desde la ventana “Dólar Forward – Precios/Montos transados por mes”, el usuario tiene a su disposición el ícono de “Graficar”. Al acceder a esta opción, el sistema despliega varias opciones que permite seleccionar y generar diferentes tipos de gráficos estadístico:



Ilustración 35 Tasas Cierres y Promedio

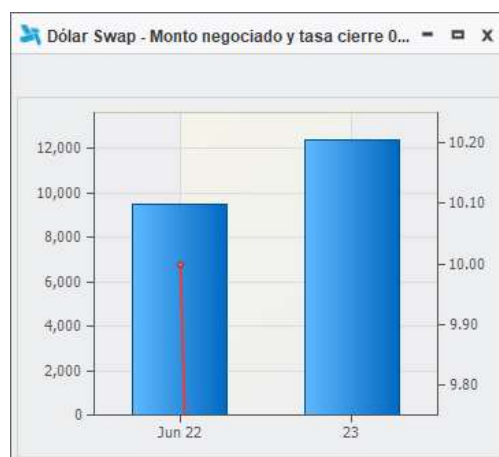


Ilustración 36 Monto Negociado y Tasa Cierre

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

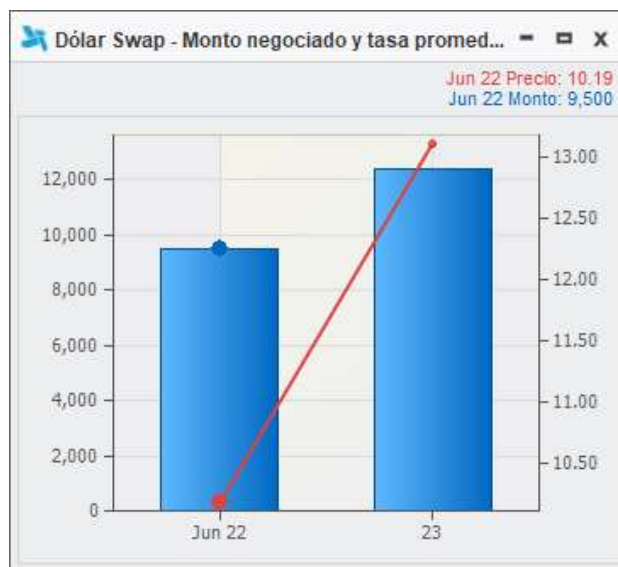


Ilustración 37 Dólar Forward - Monto negociado y tasa promedio



Ilustración 38 Dólar Forward - Monto negociado

6.3. Tasas de mejor demanda/oferta de hoy

Esta ventana permite visualizar los mejores precios de demanda y oferta del día.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Plazo	Hora	Demanda	Oferta
SWAPS			
1 Mes	14:26:40	0.00	
	14:26:25	23.33	
	14:26:00		0.00
	14:25:52	0.00	
3 Meses	12:35:04	12.00	
6 Meses	12:35:09		0.00
1 Año	12:35:18		0.00
FORWARD FORWARD			

Ilustración 39 Tasas por Hora

Y también, el usuario podrá:

- Consultar los precios de días anteriores.



Plazo	Hora	Demanda	Oferta
SWAPS			
1 Mes	14:26:40	0.00	
	14:26:25	23.33	
	14:26:00		0.00
	14:25:52	0.00	
3 Meses	12:35:04	12.00	
6 Meses	12:35:09		0.00
1 Año	12:35:18		0.00
FORWARD FORWARD			

Ilustración 40 Historia Tasas por Hora

- Generar un gráfico de precios por tipo de plazos.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Dólar Swap		
Lunes	22-Jun-2026	
Plazo Hora	Demanda	Oferta
SWAPS		
1 Semana 12:08:47	20.00	
2 Semanas 12:08:57		10.00
2 Meses 20:00:04		2.30
12:45:14		0.36
6 Meses 12:44:59	2.00	
FORWARD FORWARD		
2x6 12:47:05	0.00	

Ilustración 41 Historia Tasas por Hora

6.4. Historia De Precios Mejor Demanda/Oferta

Esta función permite visualizar los mejores precios de demanda y oferta de un día determinado por el usuario.

Asimismo, cuenta con la opción de poder generar una gráfica por plazo de la mejor demanda/oferta del día consultado.



Dólar Swap		
Lunes	22-Jun-2026	
Plazo Hora	Demanda	Oferta
SWAPS		
1 Semana 12:08:47	20.00	
2 Semanas 12:08:57		10.00
2 Meses 20:00:04		2.30
12:45:14		0.36
6 Meses 12:44:59	2.00	
FORWARD FORWARD		
2x6 12:47:05	0.00	

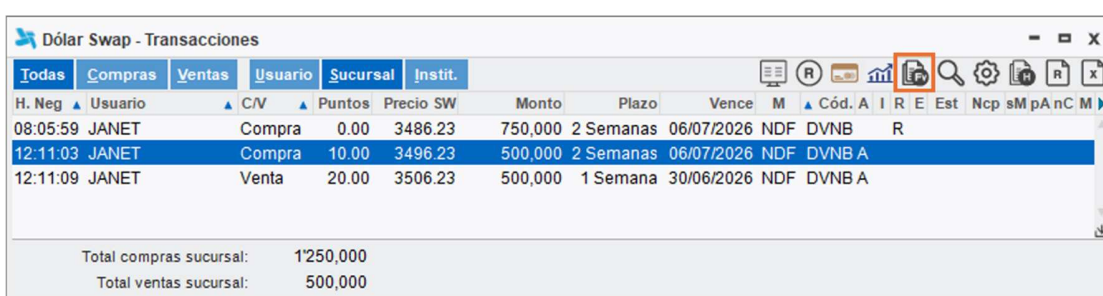
Ilustración 42 Historia Tasas por Hora

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

7. Ventana de Transacciones por Fecha de vencimiento

Esta ventana permite a los usuarios visualizar de forma agregada las operaciones que tienen un vencimiento o una asignación de tasa programada en un periodo específico. Su diseño optimiza la revisión y el análisis al consolidar la consulta una sola vista.



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB									
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A								
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A								

Total compras sucursal: 1'250,000
Total ventas sucursal: 500,000

Ilustración 43 Botón Transacciones por Fecha de Vencimiento

Parámetros de la Ventana de Consulta:

Al ingresar a esta opción, se presenta una interfaz de búsqueda con los siguientes campos:



Fecha	H. Neg	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
22/06/26	12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A								

Consulta desde Jun-2021 Consultando transacciones entre Jul-2022 y Jun-2024 1

Ilustración 44 Botón Transacciones por Fecha de Vencimiento

Ítem	Nombre	Descripción
1	Fecha Actual	Visualiza la fecha actual en la que se realiza la consulta.
2	Fecha del vencimiento	Campo para indicar la fecha específica de vencimiento que se desea consultar.
3	Días	Define la cantidad de días, a partir de la fecha de vencimiento, para ampliar el rango de la consulta.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

4	Buscar Ahora	Botón para procesar la consulta a partir de los datos ingresados.
5	Resultados de la búsqueda	Panel donde se despliegan las operaciones que coinciden con los criterios de búsqueda.

8. CONSULTAS

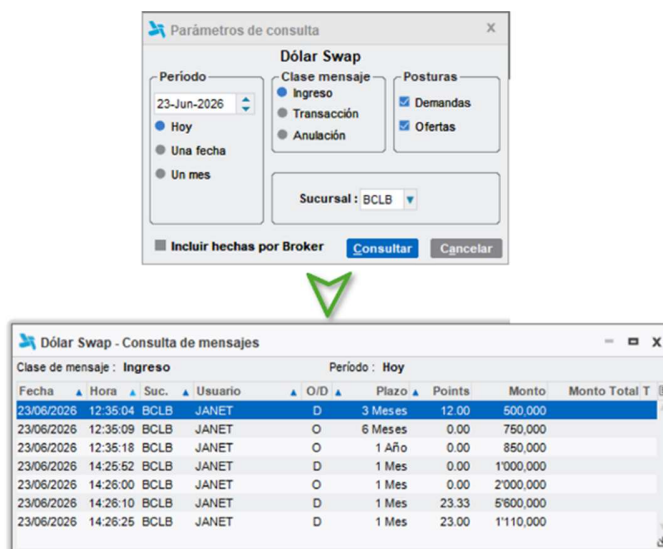
El botón abre una ventana de consultas que permite al usuario revisar el historial de ingresos de posturas, transacciones y anulaciones. Las consultas pueden ser filtradas por rango de fechas, sucursales, y por el tipo de postura, ya sea demanda u oferta.

Dólar Swap - Transacciones

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

</

Ilustración 45 Botón Consultas



Parámetros de consulta

Dólar Swap

Periodo: 23-Jun-2026
☒ Hoy
☐ Una fecha
☐ Un mes

Clase mensaje:
☒ Ingreso
☐ Transacción
☐ Anulación

Posturas:
☒ Demandas
☒ Ofertas

Sucursal: BCLB

☐ Incluir hechas por Broker **Consultar** **Cancelar**

Dólar Swap - Consulta de mensajes

Clase de mensaje: Ingreso Periodo: Hoy

Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Plazo	Points	Monto	Monto Total
23/06/2026	12:35:04	BCLB	JANET	D	3 Meses	12.00	500,000	
23/06/2026	12:35:09	BCLB	JANET	O	6 Meses	0.00	750,000	
23/06/2026	12:35:18	BCLB	JANET	O	1 Año	0.00	850,000	
23/06/2026	14:26:52	BCLB	JANET	D	1 Mes	0.00	1'000,000	
23/06/2026	14:26:00	BCLB	JANET	O	1 Mes	0.00	2'000,000	
23/06/2026	14:26:10	BCLB	JANET	D	1 Mes	23.33	5'600,000	
23/06/2026	14:26:25	BCLB	JANET	D	1 Mes	23.00	1'110,000	

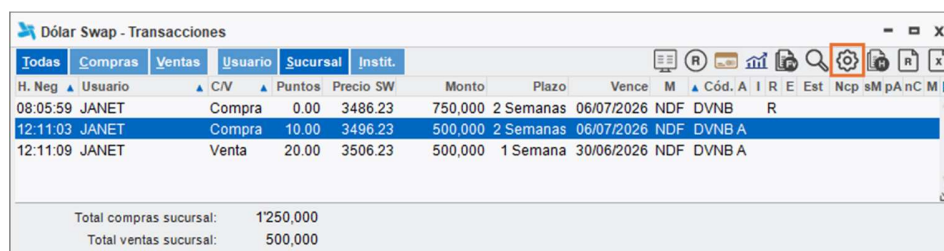
Ilustración 46 Ejemplo Consultas

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

9. CONFIGURACIÓN DEL MERCADO

El botón abre la ventana de configuración del mercado Forward, donde el usuario puede ajustar diversas opciones para el manejo de límites de negociación para este mercado.



Dólar Swap - Transacciones									
		Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.		
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A I R E Est Ncp sM pAnC M
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF DVNB	R
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF DVNB A	
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF DVNB A	
Total compras sucursal:				1'250,000					
Total ventas sucursal:				500,000					

Ilustración 47 Botón Configuración

El perfil de administrador de cupos tiene la responsabilidad de gestionar las contrapartes y asignar o modificar cupos bilaterales. A continuación, se describen las diferentes acciones que puede realizar:

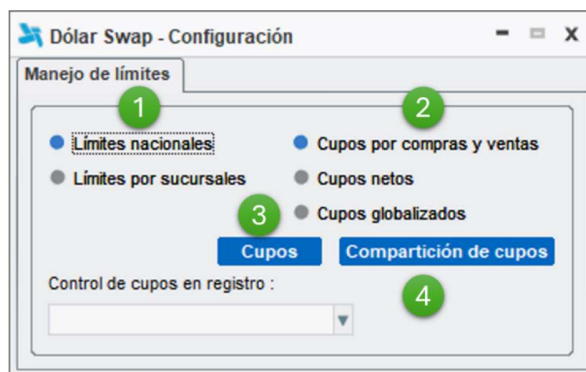


Ilustración 48 Ventana Configuración

Ítem	Nombre	Descripción
1	Configuración de límites	El perfil administrador de cupos tendrá la opción de escoger entre: Límites nacionales: Es el valor asignado a una sola sucursal (Nacional) de la entidad y las demás sucursales trabajarán sobre el mismo valor de la sucursal Nacional.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

		• Límites por sucursal: Por cada sucursal existente en la entidad podrá configurar un valor independiente.
2	Configuración de Cupos	El sistema SET-FX tiene 3 opciones de configuración los cupos bilaterales: • Cupos por compras y ventas: Permite ingresar un monto de cupo para compras y uno para ventas de manera independiente. • Cupos netos: Permite el ingreso de un cupo para compras y para ventas y estos actuarán de forma neta entre los dos valores. • Cupos globalizados: Permite ingresar un único monto global de cupos.
3	Cupos	Permite acceder a la tabla global de cupos desde la cual podrá ingresar, modificar, eliminar los valores asignados a los cupos por entidad.
4	Compartición de Cupos	El administrador de cupos, por medio de esta opción podrá compartir el cupo entre dos mercados diferentes y estos se verán afectados simultáneamente.

El sistema permite optimizar la gestión de garantías y líneas de crédito mediante la compartición de cupos entre diferentes mercados.

Al presionar el botón Compartición de cupos, el sistema despliega una ventana emergente que detalla el estado actual de las reglas de reciprocidad del cupo. En esta interfaz se indica si el mercado origen está compartiendo cupos con otro mercado del sistema, junto con su respectivo factor de conversión.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 49 Ventana Configuración

Funcionalidades Disponibles:

- Creación de Reglas ("Aumentar"): Permite ingresar una nueva configuración de compartición entre mercados.
- Modificación y Eliminación: Si una parametrización es errónea o requiere ajustes, el usuario puede modificar o eliminar los registros haciendo clic derecho directamente sobre el ítem correspondiente.

El factor de conversión establece la proporción de afectación que tiene una transacción del Mercado Origen (1) sobre el Cupo Disponible del Mercado Destino (2):

- Factor igual a 1.00: Significa que por cada dólar negociado en el Mercado Origen (1), se descontará exactamente \$1 del cupo del Mercado Destino (2).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

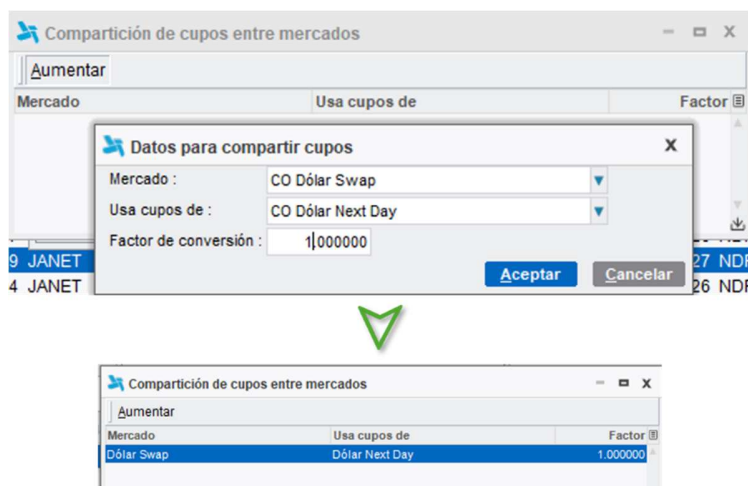


Ilustración 50 Opción Compartir Cupos

10. DÍAS ANTERIORES

La ventana “Días anteriores”, el usuario podrá consultar las operaciones realizadas de días anteriores.



Dólar Swap - Transacciones												
Todas		Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.						
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E
08:05:59	JANET	Compra	0.00	3486.23	750,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB		R	
12:11:03	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A		
12:11:09	JANET	Venta	20.00	3506.23	500,000	1 Semana	30/06/2026	NDF	DVNB	A		
Total compras sucursal:			1'250,000									
Total ventas sucursal:			500,000									

Ilustración 51 Botón Días Anteriores

Para consultar la información de una fecha específica, realice los siguientes pasos:

1. Indique la fecha requerida en formato dd/mm/aaaa en la casilla ubicada en la parte superior derecha de la ventana.
2. Haga clic en el botón “ir” para cargar las operaciones correspondientes.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Dólar Swap - Transacciones													
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit. 22/06/2026													
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I R E Est Ncp sM pA nC M
22/06/26	08:05:06	14:48:02	O3UYJFH7H3	JANET	Venta	10.20	3410.30	9'000,000	1 Mes	22/07/2026	NDF	DVNB	R
22/06/26	12:11:03		O3UYJFH7GR	JANET	Compra	10.00	3496.23	500,000	2 Semanas	06/07/2026	NDF	DVNB	A
Total compras sucursal:				500,000									
Total ventas sucursal:				9'000,000									

Ilustración 52 Ventana Días Anteriores

11. SOLICITUDES DE REGISTRO

Este botón permite acceder a la ventana de “Solicitudes de registro”, donde el usuario podrá visualizar el estado de las solicitudes de operaciones de registro bajo las siguientes clasificaciones:

- Enviadas
- Recibidas
- Expiradas
- Pendientes
- Confirmadas
- Rechazadas

Dólar Swap - Transacciones

Todas

Compras

Ventas

Usuario

Sucursal

Instit.

R

Ilustración 53 Botón Solicitud de Registros

Acciones disponibles: Al dar clic derecho sobre cualquier operación de la lista, el usuario podrá:

- Aceptar o rechazar la solicitud.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

- Obtener el detalle o la historia de esta.



Ilustración 54 Ventana Solicitudes de Registro

12. ANULACIONES Y SOLICITUDES DE ANULACIÓN

Este botón permite acceder a la ventana de “Anulaciones y solicitudes de anulación de registros”, donde es posible visualizar los registros de compra/venta bajo los siguientes estados:

- Anulados
- Enviados
- Recibidos
- Expirados
- Pendientes
- Confirmados
- Rechazados

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 55 Botón Solicitudes Anulaciones

Columna Estado

La columna “Estado” informa específicamente si la solicitud de anulación fue “confirmada”, “rechazada”, o si todavía se encuentra “pendiente” de responder.

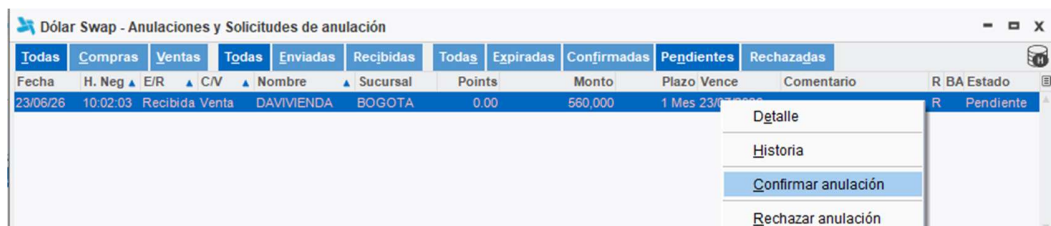


Ilustración 56 Ventana Solicitudes Anulaciones

13. MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

La modificación de operaciones de derivados solo podrá realizarse de acuerdo con lo establecido en la Circular Externa Reglamentaria DOAM-317 expedida por el Banco de la República, así como las normas que la modifiquen, deroguen o complementen.

Para proceder con la modificación de operaciones, se deben tener en cuenta las siguientes condiciones:

- La modificación de una operación Forward solo puede realizarse si se trata de una operación registrada.
- Para ejercer la modificación el registro no debe estar compensado por la Cámara De Riesgo Central De Contraparte.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Para realizar la modificación de un registro, siga el siguiente procedimiento:

- Ubique la operación a modificar en la ventana “Dólar Forward – Transacciones”. Haga clic derecho sobre la operación y seleccione la opción “Modificar”.



Dólar Swap - Transacciones									
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.				
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	
10:02:03	JANET	Venta	0.00	4003.00	560,000	1 Mes	23/07/2026	NDI	
12:35:35	JANET	Compra	12.00	4015.00	500,000	3 Meses	23/09/2026	NDI	
12:35:37	JANET	Venta	0.00	4003.00	750,000	6 Meses	23/12/2026	NDI	
12:35:39	JANET	Venta	0.00	4003.00	850,000	1 Año	23/06/2027	NDI	
14:26:34	JANET	Compra	23.33	3592.33	5'600,000	1 Mes	23/07/2026	NDI	
14:26:38	JANET	Venta	0.00	3569.00	2'000,000	1 Mes	23/07/2026	NDI	
14:26:40	JANET	Compra	23.00	3592.00	1'110,000	1 Mes	23/07/2026	NDI	
14:26:43	JANET	Compra	0.00	3569.00	1'000,000	1 Mes	23/07/2026	NDI	

Detalle
Detalle completo
Instrucciones de Pago
Cambiar instrucciones de Pago
Comentario
Compensar por CRCC
Modificar

Ilustración 57 Opción Detalle

- Se abrirá una nueva ventana con los detalles de la operación y los campos habilitados para su modificación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Dólar Swap - Modificación de transacción

Tipo de transacción : **Venta** Registrado el : 23/06/26 12:34:40

Mi sucursal : **BCLB** BANCOLOMBIA

Mi usuario : **JANET**

Por parte de : **[]** **Emp**

Contraparte : Sucursal : **DVNB** BANCO DAVIVIENDA

Usuario : **HENRY**

Por parte de : **[]**

Hora (negociación) : ☒ Fecha anterior 23-Jun-2026 10:02:03

Tipo : **SWAP**

Plazo : ☒ Libre 1 Mes

Vence : **Jue 23-Jul-2026**

Fecha de pago : **24/07/2026** **Vie 24-Jul-2026**

Precio Swap : **4003.00**

Puntos swap : **0.00**

Precio Swap : **4003.00**

Monto : **560,000** (Unidades)

Modalidad cumplimiento : **NON-DELIVERY**

Tasa de referencia : **[]**

Opcionalidad : **[]**

Tipo de opcionalidad : **[]**

Negociado en : **SET-ICAP**

Aceptar **Cancelar**

Ilustración 58 Detalle Operación

- c) Los campos modificados aparecerán resaltados en color azul, lo que facilita la identificación de los cambios realizados.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Dólar Swap - Modificación de transacción

Tipo de transacción: **Compra** Registrado el: 23/06/26 12:34:40

Mi sucursal: **BCLB** BANCOLOMBIA

Mi usuario: **JANET**

Por parte de: **Emp**

Contraparte : Sucursal: **DVNB** BANCO DAVIVIENDA

Usuario: **HENRY**

Por parte de:

Hora (negociación): ☒ Fecha anterior 23-Jun-2026 10:02:03

Tipo: **SWAP**

Plazo: ☒ Libre **2 Meses**

Vence: **Vie 21-Ago-2026**

Fecha de pago: **24/08/2026** **Lun 24-Ago-2026**

Precio Swap: **4003.00**

Puntos swap: **0.00**

Precio Swap: **4003.00**

Monto: **560,000** (Unidades)

Modalidad cumplimiento: **NON-DELIVERY**

Tasa de referencia:

Opcionalidad:

Tipo de opcionalidad:

Negociado en: **SET-ICAP**

Aceptar **Cancelar**

Ilustración 59 Opción Modificación

- d) Una vez finalizados los ajustes, presione el botón “Aceptar”. El sistema SET-FX enviará una solicitud de modificación a la contraparte de la operación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



Ilustración 60 Notificación Modificación

- e) En el blotter de operaciones del usuario que solicitó la modificación, aparecerá una “M” en la columna “sM”, indicando que la solicitud de modificación ha sido enviada.

Ilustración 61 Ejemplo Modificación

- f) La contraparte verá la solicitud de modificación identificada con una “M” en color rojo en la misma columna “sM” de su blotter de operaciones.

Dólar Swap - Transacciones

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

Ilustración 62 Ejemplo Modificación

- g) Para revisar los cambios solicitados, la contraparte debe hacer clic derecho sobre la operación y seleccionar la opción “Detalle de Modificación”. Se abrirá una nueva ventana donde podrá visualizar los campos modificados, los cuales estarán resaltados en color azul.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Dólar Swap - Transacciones														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E	Est
10:02:03	HENRY	Compra	0.00	4003.00	560,000	1 Mes	23/07/2026	NDF	BCL	R	A	R		
12:35:35	HENRY	Venta	12.00	4015.00	500,000	3 Mes								

Ilustración 63 Ejemplo Modificación

Dólar Swap - Detalle transacción modificada

Tipo de transacción: **Venta** Registrado el: 23/06/26 12:34:40

Mi Sucursal: DVNB BANCO DAVIVIENDA

Mi usuario: HENRY

Por parte de:

Contraparte: Sucursal: BCLB BANCOLOMBIA

Usuario: JANET

Por parte de:

Hora (negociación): ☒ Fecha anterior 23-Jun-2026 10:02:03

Tipo: SWAP

Plazo: ☐ Libre **2 Meses**

Vence: **Vie 21-Ago-2026**

Fecha de pago: **24/08/2026** **Lun 24-Ago-2026**

Precio Swap: 4003.00

Puntos swap: 0.00

Precio Swap: 4003.00

Monto: 560,000 (Unidades)

Modalidad cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa de referencia:

Opcionalidad:

Tipo de opcionalidad:

Negociado en: SET-ICAP

Ilustración 64 Ejemplo Modificación

h) Respuesta de la Contraparte:

- Si la contraparte rechaza la solicitud, la operación quedará en firme con las condiciones iniciales.

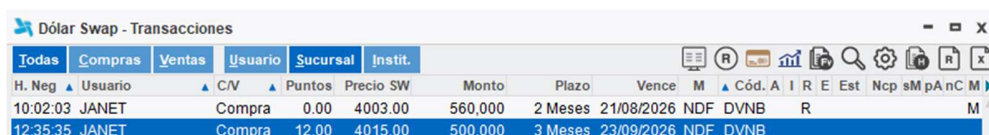
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	



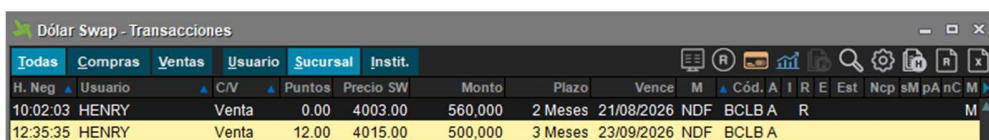
Ilustración 65 Notificación Modificación

- b. Si la contraparte acepta la solicitud, la operación será modificada y en el blotter de operaciones aparecerá la letra “M” en la columna “M”, indicando que la modificación ha sido confirmada.



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
10:02:03	JANET	Compra	0.00	4003.00	560,000	2 Meses	21/08/2026	NDF	DVNB										
12:35:35	JANET	Compra	12.00	4015.00	500,000	3 Meses	23/09/2026	NDF	DVNB										

Ilustración 66 Ejemplo Modificación



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
10:02:03	HENRY	Venta	0.00	4003.00	560,000	2 Meses	21/08/2026	NDF	BCLB A										
12:35:35	HENRY	Venta	12.00	4015.00	500,000	3 Meses	23/09/2026	NDF	BCLB A										

Ilustración 67 Ejemplo Modificación

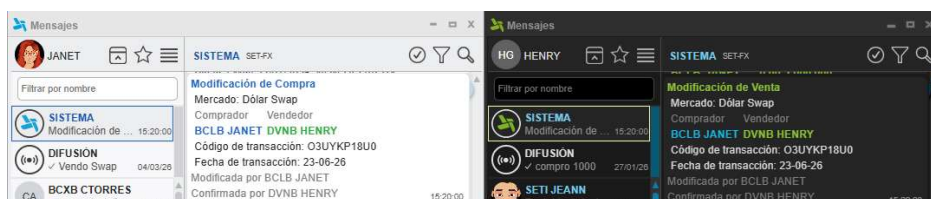


Ilustración 68 Ejemplo Modificación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL SWAP	

14. ANULACIÓN DE OPERACIONES

Cuando una operación cumple con los parámetros establecidos por la normatividad del Banco de la República en la Circular DOAM-317, cualquiera de las contrapartes iniciales puede solicitar su anulación desde la ventana "Dólar Forward - Transacciones" (Blotter de operaciones).

Una de las entidades envía la solicitud de anulación directamente a su contraparte. El sistema envía la solicitud de anulación a todos los usuarios transaccionales o de registro de la entidad contraparte.

- Si la contraparte acepta la solicitud, la operación será anulada y retirada del blotter.
- Si la contraparte rechaza la solicitud, la operación se mantendrá en firme.
- Si la solicitud de anulación no es aceptada ni rechazada dentro de los 10 minutos posteriores a su envío, esta expirará automáticamente y la operación permanecerá vigente.

Durante todo el proceso, ni el solicitante ni la contraparte revelan su identidad en las operaciones transaccionales.

El sistema SET-FX mantiene la trazabilidad completa del proceso de anulación, asegurando el registro detallado de cada acción.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

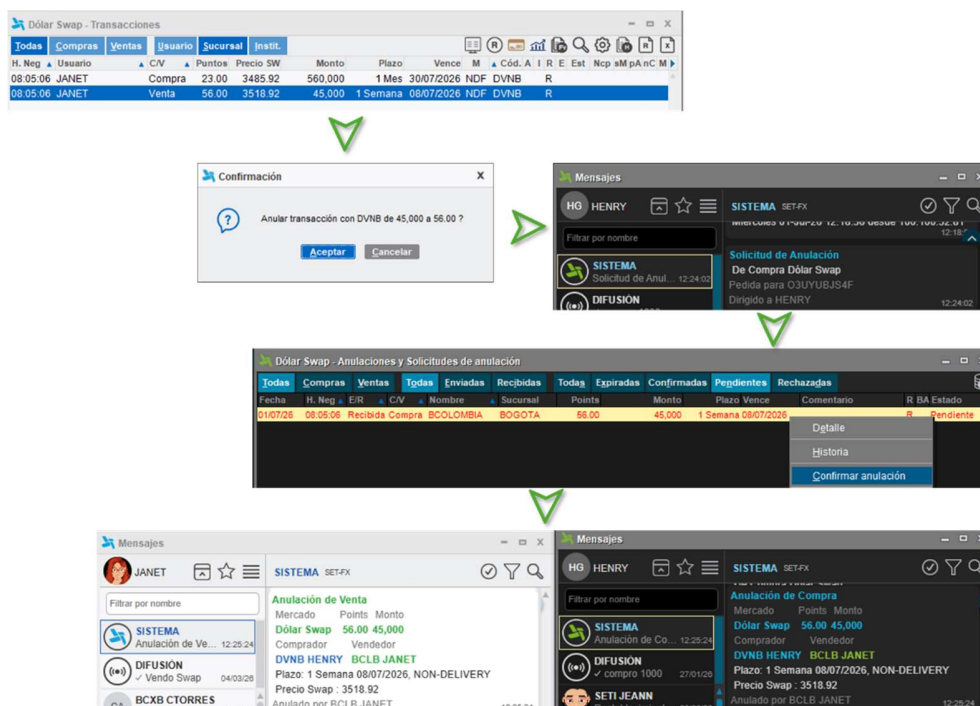


Ilustración 69 Ejemplo Anulación

15. COMPESACIÓN DE OPERACIONES

El sistema SET-FX permite la compensación de operaciones mediante la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC).

Flujo para Solicitar la Compensación:

- Selección del Registro: Una vez realizado el registro de la operación, diríjase al blotter de operaciones y seleccione el registro correspondiente.
- Haga clic derecho sobre la operación y elija la opción “Compensar por CRCC”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

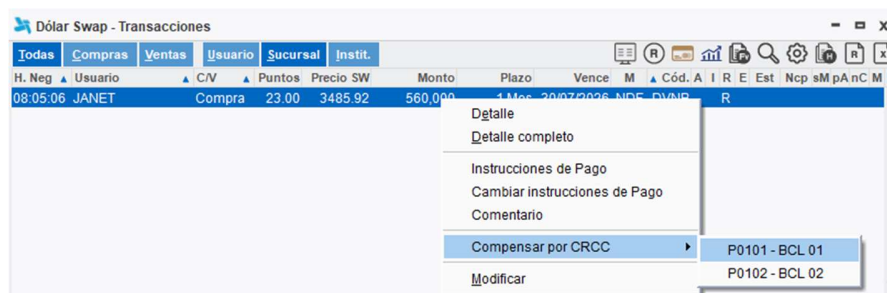


Ilustración 70 Opción Compensación

- Selección de Cuenta: Si su entidad administra diferentes cuentas para la compensación, seleccione la cuenta respectiva en el menú desplegable.



Ilustración 71 Opción Compensación

- Confirmación: El sistema mostrará una ventana de confirmación; haga clic en Aceptar.



Ilustración 72 Opción Compensación

Proceso de Aceptación y Estados:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

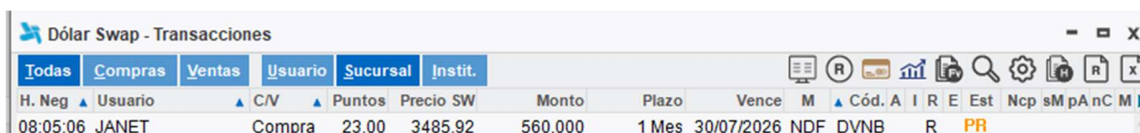
Al finalizar los pasos anteriores, se enviará la solicitud de compensación a la contraparte, quien tendrá la facultad de procesar la petición bajo las siguientes condiciones:

- Si rechaza la solicitud: La operación no iniciará el proceso de compensación.
- Si acepta la solicitud: Se dará inicio formal al proceso de compensación en la cámara.

La compensación de operaciones Forward está sujeta a los siguientes estados, visibles en el blotter de operaciones:

PR (Pendiente de Riesgo)

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

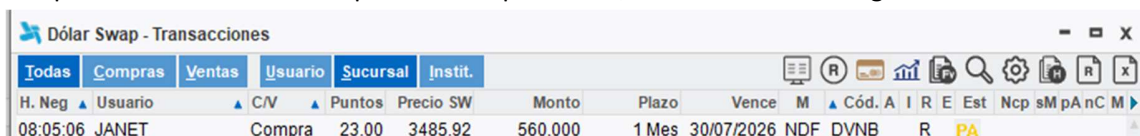


Dólar Swap - Transacciones														
Todas		Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp sM pA nC M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R	PR			

Ilustración 73 Estados de Compensación

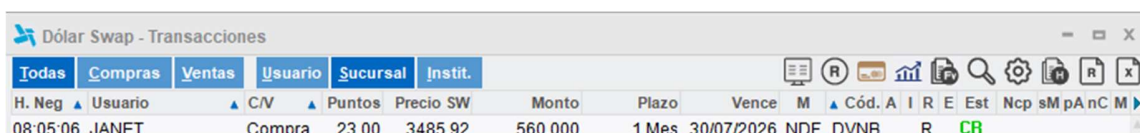
PA (Pendiente de Aprobación)

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



Dólar Swap - Transacciones														
Todas		Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp sM pA nC M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R	PA			

Ilustración 74 Estados de Compensación



Dólar Swap - Transacciones														
Todas		Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp sM pA nC M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R	CR			

Ilustración 75 Estados de Compensación

NC (No Compensada)

La operación fue rechazada por la CRCC.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

Dólar Swap - Transacciones													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R			
08:09:06	JANET	Compra	65.00	3527.92	690,000	2 Semanas	15/07/2026	NDF	DVNB	R	NC		

Ilustración 76 Estados de Compensación

15.1. 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:

Dólar Swap - Detalle de transacción			
Fecha: 01/07/2026	Código: 03UYUBJS4H	Hora de registro: 13:32:21	Hora Neg.: 08:09:06
Comprador	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan	
Por parte de:			
Vendedor	Sucursal	Persona	
BANCO DAVIVIENDA S.A.	BOGOTA	Henry Gonzales Buitrago	
Por parte de:			
Puntos swap:	65.00	Monto US\$:	690,000.00
Tasa de referencia:		Precio Swap:	3527.92
Negociado en:	SET-ICAP	Plazo:	2 Semanas
Opcionalidad:		Vence:	Miércoles 15-Jul-2026
Origen de transacción:	Registrado por DVNB HENRY	Tipo:	SWAP
Comentario:		F. Pago:	16-Jul-2026
Estado CRCC:	Rechazada por: El Miembro o entidad (Party) participe de la operación	Precio spot:	3462.92
Fecha anterior		Cumplimiento:	NON-DELIVERY
		Periodicidad de pagos:	Trimestral

Ilustración 77 Detalle de Transacción

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

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) participe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o definitivamente.
504	No existe un vencimiento válido para la Fecha de Vencimiento (ValueDate) enviada.
505	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo, mayor que cero.
506	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo menor que 999,999,999.
507	La estructura del precio (Rate) que fue enviada no es válida para la Cámara.
508	El valor (Amount) excede el monto por operación para alguno de los participantes.
509	La Garantía Diaria constituida para la Cuenta, no es suficiente para aceptar la operación que ha sido enviada a Cámara.
511	La fecha de creación de la operación (TradeDate) no puede ser mayor que la fecha de creación del mensaje que contiene la operación (CreationTimeStamp).
512	El mismo Miembro y Cuenta no pueden tomar posición de compra y de venta en una misma operación.
513	El número de identificación del mensaje (MessageID) ya ha sido utilizado en una operación enviada previamente a Cámara.
514	La operación que se envió para ser anulada no existe o no se negoció durante la sesión actual.
515	El monto de la operación debe ser múltiplo de 500.000.000.
516	La CRCC no acepta la operación bilateral por no pasar los criterios de elegibilidad.
517	Se ha producido un problema en la decodificación de FpML normalmente por encontrar campos que no corresponden con el esquema.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX

518 Operaciones pendientes que llegan a Fin de Día sin novarse.

15.2. 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:

- Ingrese al módulo Dólar Forward – Transacciones.
- Ubique la operación correspondiente.
- 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)

Indica que la solicitud de desmarcación fue enviada y está pendiente de respuesta por parte de la CRCC.



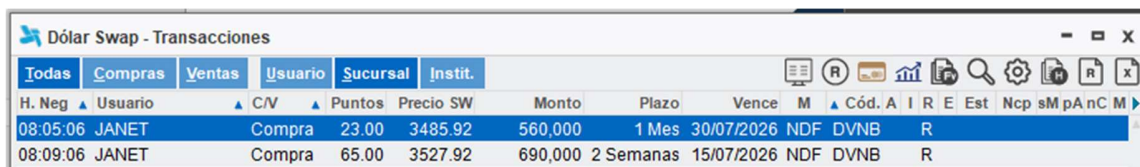
H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R									
08:09:06	JANET	Compra	65.00	3527.92	690,000	2 Semanas	15/07/2026	NDF	DVNB	R									

Ilustración 78 Estados de Compensación

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

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026

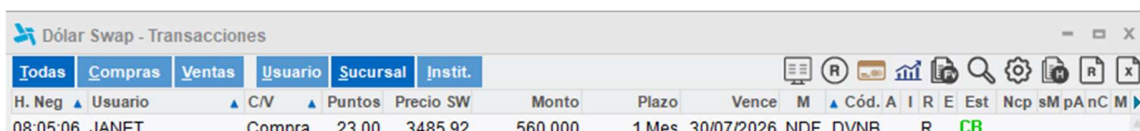
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MANUAL SWAP	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R								
08:09:06	JANET	Compra	65.00	3527.92	690,000	2 Semanas	15/07/2026	NDF	DVNB	R								

Ilustración 79 Estados de Compensación

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



H. Neg	Usuario	C/V	Puntos	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	I	R	E	Est	Ncp	sM	pA	nC	M
08:05:06	JANET	Compra	23.00	3485.92	560,000	1 Mes	30/07/2026	NDF	DVNB	R			CR					

Ilustración 80 Estados de Compensación

16. INFORMACIÓN ADICIONAL

En caso de tener alguna duda o comentario sobre el contenido de este manual, puede comunicarse con las líneas de soporte de SET-ICAP FX S.A. Tel.: 742 77 78, 742 77 77 Ext 220, 221, 223 o al correo soportesetfx@set-fx.com.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 10/06/2026	Fecha: 25/06/2026	Fecha: 05/07/2026