

MERCADO REGISTRO DE DIVISAS

MANUAL DE USUARIO



	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 2 / 83

Tabla de contenido

INTRODUCCIÓN	4
OBJETIVO	4
1. INGRESO AL MODULO REGISTRO DE DIVISAS	5
1.1. Estructura de la Ventana “Registro de Derivados – Registrar Transacciones”	5
2. BOTONES DE HERRAMIENTAS	8
2.1. Importación por XML	8
2.2. Precios/Montos Transacciones Propias	8
2.2.1. Registro Derivados IMCs – Transacciones (Blotter de Operaciones)	9
2.2.2. Registro Derivados Clientes – Transacciones (Blotter de Operaciones)	15
2.2.3. Opciones del Blotter de Transacciones	23
3. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES	34
3.1. Estados del Proceso de Compensación – CRCC	35
3.2. Consulta de Rechazos de Compensación	36
3.3. Compensación registro IRS	38
3.4. Retiro de Estado de Compensación	41
4. MODIFICAR	43
4.1. Modificaciones con Contraparte IMC	43
4.2. Modificaciones con Clientes o Comitentes	44
5. FRACCIONAR	45
6. BOTONES ENVIAR, NUEVO, LIMPIAR	47
7. REGISTRO DE OPERACIONES	48
7.1. Registro Spot IMC – IMC	50
7.2. Registro Spot con origen Spot Efectivo IMC - IMC	51
7.3. Registro Next Day IMC – IMC	52

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 3 / 83

7.4.	Registro Forward IMC – IMC	53
7.5.	Registro Swap IMC – IMC	54
7.6.	Registro Opciones IMC – IMC	55
7.7.	Registro IRS IMC - IMC	57
7.8.	Registro CCS IMC – IMC	60
7.9.	Registro Otros Derivados IMC – IMC	62
7.10.	Registro Spot IMC – Clientes	64
7.11.	Registro Next Day IMC – Cliente	65
7.12.	Registro FIX IMC – Clientes	66
7.13.	Registro Forward IMC – Cliente	69
7.14.	Registro Swap IMC – Cliente	71
7.15.	Registro Opciones	73
7.16.	Registro IRS IMC - Clientes	74
7.17.	Registro CCS IMC – Clientes	78
7.18.	Registro Otros Derivados IMCs – clientes	80
8.	ASIGNACIÓN DE TASA REFERENCIAL EN OPERACIONES FIX	82
	INFORMACIÓN ADICIONAL	83

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 4 / 83

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 5 / 83

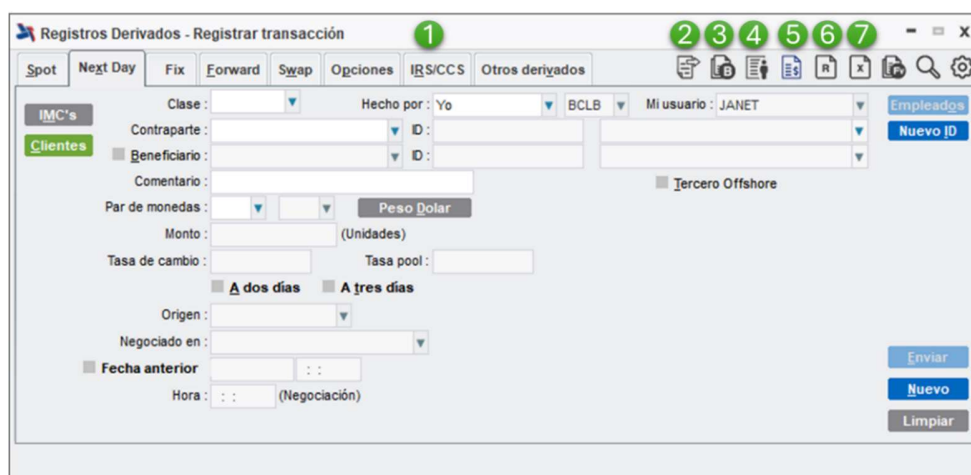
1. INGRESO AL MODULO REGISTRO DE DIVISAS

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.



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

La ventana está compuesta por los siguientes elementos:


 The image shows a window titled 'Registros Derivados - Registrar transacción'. It has a tabbed interface with tabs for 'Spot', 'Next Day', 'Fix', 'Forward', 'Swap', 'Opciones', 'IRS/CCS', and 'Otros derivados'. The 'Spot' tab is active. The window contains various input fields and buttons. Numbered callouts are present: 1 points to the tabs; 2 points to the 'Clase' dropdown; 3 points to the 'Hecho por' dropdown; 4 points to the 'BCLB' dropdown; 5 points to the 'Mi usuario' dropdown; 6 points to the 'Empleados' button; and 7 points to the 'Nuevo ID' button. Other visible elements include 'Contraparte', 'Beneficiario', 'Comentario', 'Par de monedas', 'Monto', 'Tasa de cambio', 'Tasa pool', 'Origen', 'Negociado en', 'Fecha anterior', and 'Hora'.

Ítem	Nombre	Descripción
1	Pestañas de submercados	El módulo está organizado en pestañas que representan los distintos submercados. Al

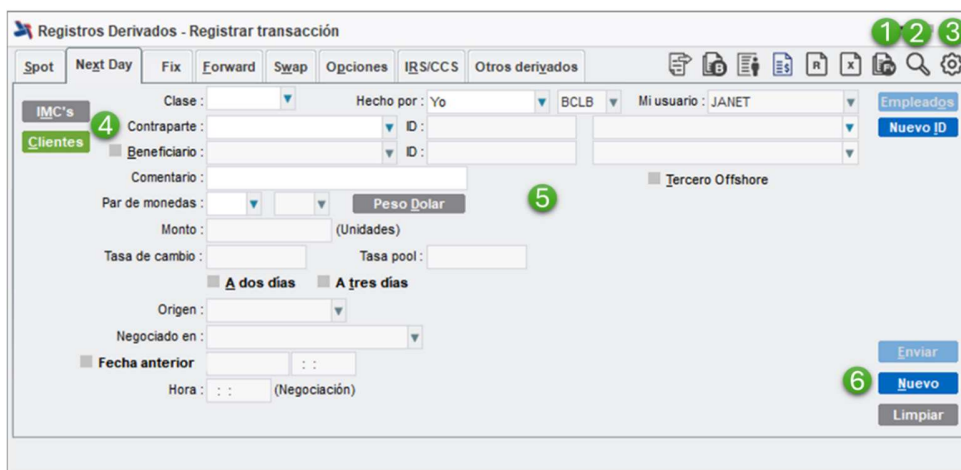
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 26/01/2026	Revisado por: Director SET-FX Fecha: 30/01/2026	Aprobado por: Gerencia TI Fecha: 04/02/2026
--	--	--

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 6 / 83

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 7 / 83



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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 8 / 83

- Limpiar: Borra todos los campos para iniciar un nuevo registro desde cero.

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.

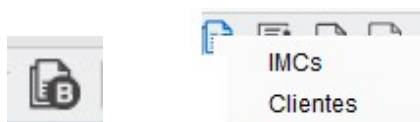


Para validar el correcto funcionamiento de este mecanismo, se recomienda consultar el instructivo de importación XML, disponible en nuestro portal web.

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.

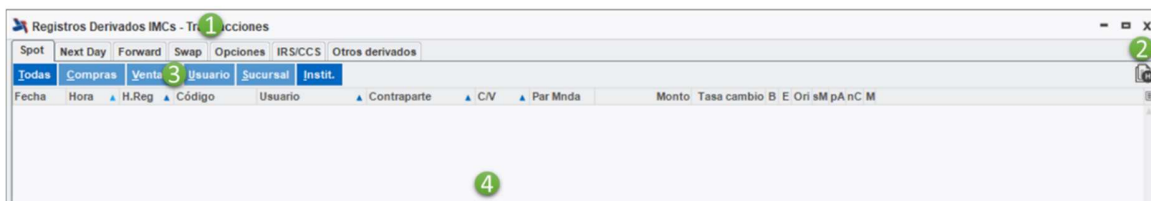
En el blotter de operaciones, se visualizan las características generales de los registros efectuados.



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 9 / 83

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



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.

Registros Derivados IMCs - Transacciones

SpotNext DayForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

6789

Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori	sM	pAnC	M
15/02/22	07:12:36	08:29:16	O2C3FZSZA0	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	ECV / CAD	2'000,000.00	3235.6000	F					
15/02/22	07:12:36	08:28:19	O2C3FZSZ9Y	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	KRW / USD	2'000,000.00	3.2356000	S					
15/02/22	08:05:02	08:29:37	O2C3FZSZA2	BCLM SERGIOM	DVNB HENRY	Venta	ZAR / COP	2'000,000.00	3235.6000	O					
15/02/22	08:05:06	08:26:35	O2C3FZSZ9W	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	642'000,000.00	4023.3200	E					M
15/02/22	08:06:05	08:30:24	O2C3FZSZA4	JANET	DVNB HENRY	Venta	ARS / COP	2'000,000.00	425.36366	E	S				
15/02/22	08:33:00	08:33:21	O2RVH7J18M	JANET	DVNB HENRY	Venta	GBP / USD	5'600,000.00	3.2555400	B	O				

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 10 / 83

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

- Submercado Spot

Registros Derivados IMCs - Transacciones

SpotNext DayForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

1234567

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

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 11 / 83

- Submercado Next Day

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	1 2 3 4 5 6 7								
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	FV B	E	Ori	sM	pAnC M
26/01/26	08:05:06	09:53:05	O06B5NG5L5	JANET	DVNB HENRY	Compra	SGD / USD	56'000,000.00	39.335500	3	E	F	M	
26/01/26	08:05:06	09:53:25	O06B5NG5L7	JANET	DVNB HENRY	Compra	ZAR / USD	56'000,000.00	3933.5500	1	O*			
26/01/26	08:05:06	09:52:07	O2RV7XYOOJ	JANET	DVNB HENRY	Compra	AUD / CAD	12'000,000.00	3.4563300	2	B	U		
26/01/26	08:05:06	10:00:10	O06B5NG5L9	JANET	DVNB HENRY	Compra	ZAR / USD	56'000,000.00	3933.5500	1	O*			

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 12 / 83

X- permitido		
7	M	Identifica los registros que han sido modificados.

- Submercados Forward

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B	E Ori	F. Asig. T
04/02/25	08:08:08	11:05:15	O06BAYHQRH	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
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	O06BAYHQRH	JANET	DVNB HENRY	Venta	NZD / USD	75'000,000.00	4.05585000	4.55500000	9 Meses	04/11/2025	E	04/02/2025 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	6.89900000	5.60000000	9 Meses	04/11/2025		04/02/2025 M

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

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B	E Ori	F. Asig. T
04/02/25	08:08:08	11:05:15	O06BAYHQRH	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
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	O06BAYHQRH	JANET	DVNB HENRY	Venta	NZD / USD	75'000,000.00	4.05585000	4.55500000	9 Meses	04/11/2025	E	04/02/2025 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	6.89900000	5.60000000	9 Meses	04/11/2025		04/02/2025 M

Ítem	Nombre	Descripción
1	Ncp	No compensado: Esta columna mostrará el estado cuando una operación previamente compensada inicia el proceso de retiro de compensación

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 13 / 83

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



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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 14 / 83

- Otros derivados

Registros Derivados IMCs - Transacciones													
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B	E sM pA nC M
04/02/25	08:05:06	16:40:50	O06BAYHQSO	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	8'000.000.00	4569.0000	0x58	03/04/2025	E	
04/02/25	08:05:06	16:40:39	O06BAYHQSM	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	8'000.000.00	4569.0000	0x58	03/04/2025	E	
04/02/25	08:05:06	16:41:01	O06BAYHQSQ	JANET	DVNB HENRY	Compra	ZAR / COP	8'000.000.00	4569.0000	0x58	03/04/2025	E	
04/02/25	08:05:06	16:42:28	O06BAYHQSS	BCLM MARGARITA	DVNB HENRY	Compra	ZAR / COP	8'000.000.00	4569.0000	0x58	03/04/2025	E	
04/02/25	08:05:06	16:42:13	O2RVD5AYPW	JANET	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	5'600.000.00	4523.0000	0x45	21/03/2025	B	M

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

Registros Derivados IMCs - Transacciones													
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados													
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.								
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B	E Est. Ncp sM PriAm PA pA nC M
04/02/25	08:05:06	17:27:30	O2RVD5AYSM	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	5'600.000.00		5 Años	06/02/2030	B	R
04/02/25	11:10:10	17:25:13	O06BAYHQUS	BCLC AUPEGUI	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	8'000.000.00		7 Años	06/02/2032	...	R S
04/02/25	11:10:10	17:23:45	O06BAYHQSW	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	8'000.000.00		7 Años	06/02/2032	PC	
04/02/25	11:10:10	17:25:42	O06BAYHQJU	BCLC AUPEGUI	DVNB HENRY	Compra	USD / COP	8'000.000.00	4589.0000	7 Años	06/02/2032	M	
04/02/25	11:10:10	17:26:12	O06BAYHQUY	JANET	DVNB HENRY	Venta	COP / COP	8'000.000.00		7 Años	06/02/2032	E	M
04/02/25	11:10:10	17:25:59	O06BAYHQUW	JANET	DVNB HENRY	Venta	USD / COP	8'000.000.00	4589.0000	7 Años	06/02/2032	E	

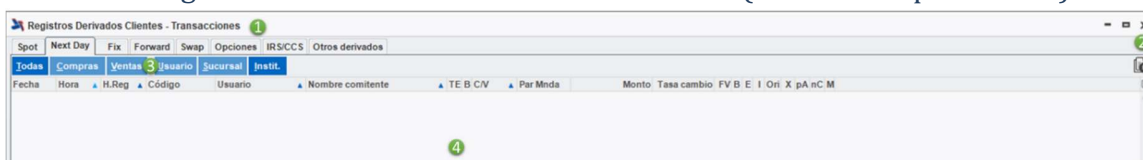
Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Indica que el registro fue realizado por medio del bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 15 / 83

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)



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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 16 / 83

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados							
1	2	3	4	5	6	7	8	9						
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori	I	X pA nC M
26/01/26	08:05:06	11:51:04	O06B5NG5LB	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Venta	FRF / CAD	56'000,000.00	4235.0052	E	S			M
26/01/26	08:05:06	11:51:30	O06B5NG5LD	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Venta	USD / COP	12,000.00	4235.0052	F	S			
26/01/26	08:05:06	11:51:50	O06B5NG5LF	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Venta	ZAR / COP	12,000.00	4235.0052	F	S			
26/01/26	08:05:06	11:52:14	O06B5NG5LH	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R Compra	CNH / USD	30'000,000.00	4.2350052	U	S			
26/01/26	08:05:06	14:57:03	O2RV7XYOOO	JANET	BANCOMER TRANSFER SERV...	E Compra	USD / COP	12'000,000.00	3562.0000	B	S			
26/01/26	08:30:00	14:16:18	O06B5NG5LJ	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500	O	S			X

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	F	S		
26/01/26	08:05:06	11:51:50	O06B5NG5LF	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R	Venta	ZAR / COP	12,000.00	4235.0052	F	S		
26/01/26	08:05:06	11:52:14	O06B5NG5LH	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO	R	Compra	CNH / USD	30'000,000.00	4.2350052	U	S		
26/01/26	08:05:06	14:57:03	O2RV7XYOOO	JANET	BANCOMER TRANSFER SERV...	E	Compra	USD / COP	12'000,000.00	3562.0000	B	S		
26/01/26	08:30:00	14:16:18	O06B5NG5LJ	JANET	Administradora de Fondos de ...	T	S Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500	O	S		X

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 17 / 83

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:

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

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 18 / 83

- 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

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Secursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente		TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig. T
26/01/26	08:05:06	15:43:25	O06B5NGSM7	JANET	FELIPE JOSE VEGAARAUJO		R	Compra	USD / COP	30'000.000.00 USD	0.0000	6	03/02/2026	03/02/2026 P
26/01/26	08:30:00	14:53:45	O06B5NGSLP	JANET	Administradora de Fondos de ...		T	S Compra	USD / COP	5'000.000.00 USD	-2.0000	296	20/11/2026	18/02/2026 T
28/01/26	10:22:55	11:21:28	O06B5CUVV	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...		T	Compra	CNH / USD	5'600.000.00 CNH	0.0000	Hoy	28/01/2026	28/01/2026 M

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 19 / 83

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

- Submercado Forward



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



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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 20 / 83

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 04/02/2025																
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados									
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.											
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B CV	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence B	E FR	Est Ncp	I x	p a n C M
04/02/25	08:30:00	19:23:54	O06BAYHQVG	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Venta	USD / COP	500,000.00	3245.3200	3123.9400	0x168	22/07/2025	E		•	X
04/02/25	13:00:00	20:34:42	O06BAYHQWB	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000,000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025		NC	•	
04/02/25	13:00:00	20:34:55	O06BAYHQWD	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T Venta	USD / COP	8'000,000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025		...	•	
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWK	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	3'000,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR	•	
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWM	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'000,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR	•	
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWI	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E Venta	USD / COP	1'600,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B	FR	•	✕

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 04/02/2025																			
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados												
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.														
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence B	E FR	Est Ncp	I	X	p	n	C M
04/02/25	08:30:00	19:23:54	O06BAYHQVG	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S	USD / COP	500,000.00	3245.3200	3123.9400	0x168	22/07/2025	E						
04/02/25	13:00:00	20:34:42	O06BAYHQWB	JANET	Administradora de Fondos de ...	T	Venta	USD / COP	8'000,000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025	NC					
04/02/25	13:00:00	20:34:55	O06BAYHQWD	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T	Venta	USD / COP	8'000,000.00	4236.2200	4320.2250	3 Meses	02/05/2025	...					
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWK	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E	Venta	USD / COP	3'000,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B FR					
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWM	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E	Venta	USD / COP	1'000,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B FR					
04/02/25	15:02:55	20:39:28	O06BAYHQWI	JANET	BANK OF AMERICAN A. SAN F...	E	Venta	USD / COP	1'600,000.00	4235.5500	4190.0000	6 Meses	04/08/2025	B FR					

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 21 / 83

4 M Identifica los registros que han sido modificados.

- Opciones

Registros Derivados Clientes - Transacciones															
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.										
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Opt	Par Mnda	Monto	Tasa pactada	Plazo	Vence	%V B E Est	Ncp	I X P a n C M
05/02/25	08:30:00	11:40:26	O06BGLA4XL	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	Call	NZD / COP	500,000.00	3000.3200	0/201	25/08/2025	1.20		X
05/02/25	10:02:41	11:53:59	O2RVIVZNUJ	JANET	STANDARD CHARTERED BAN...	E Compra	Put	USD / COP	5'600,000.00	4123.6600	1 Mes	05/03/2025	0.36 B		X
05/02/25	11:07:08	11:41:34	O06BGLA4XN	BCLK MARIOFG	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000,000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33	...	M
05/02/25	11:07:08	11:41:51	O06BGLA4XP	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000,000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33		
05/02/25	11:07:08	11:42:06	O06BGLA4XR	JANET	Administradora de Fondos de ...	T Venta	Put	USD / COP	850'000,000.00	4236.2300	1 Mes	05/03/2025	0.33 E		

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

- Submercado IRS/CCS

Registros Derivados Clientes - Transacciones del 30/12/2025														
Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados							
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B E Est	Ncp	Pr:Am
30/12/25	09:26:00	09:28:14	O3WT85IF0	JUANCI	FONDO PARA FINANCIAMIENT...	R	Venta	COP / COP	147.000'000.000.00		18 Meses	02/07/2027	NC	X
30/12/25	09:26:00	09:28:14	O3WT85IF02	JUANCI	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T	Compra	COP / COP	106.000'000.000.00		2 Años	05/01/2028		X
30/12/25	10:35:42	11:42:26	O4D74COE6X	JUANCR	EDILANDINA S.A.S	R	Compra	USD / COP	1'532.677.55	3755.0000	0/920	07/07/2028		M

Ítem	Nombre	Descripción
------	--------	-------------

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 22 / 83

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

- Otros derivados

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

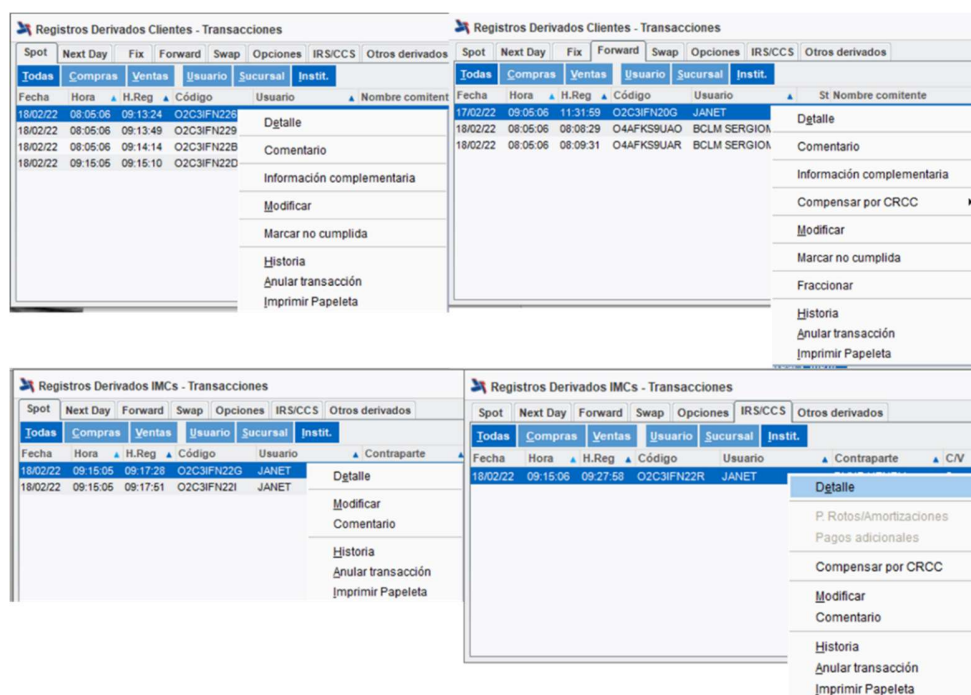
Ítem	Nombre	Descripción
1	B	Registro realizado mediante el bróker
2	E	Registro realizado a nombre de un empleado de la institución y que no tiene un perfil en el sistema SET-FX
3	I	Información Complementaria: Información adicional del registro.
4	X	Indica que la operación fue importada por el mecanismo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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 23 / 83

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:



The image displays four screenshots of the 'Registros Derivados' application interface, showing transaction details and available actions for Client and IMC records.

Top Left: Registros Derivados Clientes - Transacciones

Table with columns: Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, Nombre comitente. A context menu is open for the selected record (18/02/22, 08:05:06, 09:13:24, O2C3IFN226, JANET), showing options: Detalle, Comentario, Información complementaria, Modificar, Marcar no cumplida, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta.

Top Right: Registros Derivados Clientes - Transacciones

Table with columns: Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, St Nombre comitente. A context menu is open for the selected record (17/02/22, 09:05:06, 11:31:59, O2C3IFN20G, JANET), showing options: Detalle, Comentario, Información complementaria, Compensar por CRCC, Modificar, Marcar no cumplida, Fraccionar, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta.

Bottom Left: Registros Derivados IMCs - Transacciones

Table with columns: Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, Contraparte. A context menu is open for the selected record (18/02/22, 09:15:05, 09:17:28, O2C3IFN22G, JANET), showing options: Detalle, Modificar, Comentario, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta.

Bottom Right: Registros Derivados IMCs - Transacciones

Table with columns: Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, Contraparte, C/V. A context menu is open for the selected record (18/02/22, 09:15:06, 09:27:58, O2C3IFN22R, JANET), showing options: Detalle, P. Rotos/Amortizaciones, Pagos adicionales, Compensar por CRCC, Modificar, Comentario, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta.

2.2.3.1. Detalle

La opción permite visualizar el detalle del registro

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 24 / 83

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

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

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

Por parte de:

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

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Plazo: 18 Meses 17-Ago-2023 Origen: Fix

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

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

Monto: 560,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 23.6300 SEFable:

Tasa forward: 4025.6300

Tasa spot: 4002.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECCION TESORO NACIONAL

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario:

Estado CRCC:

Fecha anterior:

2.2.3.2. Comentario

Permite ingresar un comentario al registro realizado

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados

Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.

18/02/2022 09:05:06 11:31:59 02C3FN20G JANET FIDEICOMISOS SOCIEDAD FI... R Compr

18/02/2022 08:05:06 08:08:29 04AFKS9UJO BCLM SERGIOM Fiducoldex T Venta

18/02/2022 08:05:06 08:09:31 04AFKS9UAR BCLM SERGIOM

Comentario para transacción

Comentario: Reemplaza Operación

Aceptar Cancelar

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 18/02/2022 Código: 04AFKS9UJO Hora de registro: 08:08:29 Hora: 08:05:06

Comprador - Nombre comitente: Fiducoldex Nit: 800.178.148-8 Vigilado: TRM

Por parte de:

Vendedor: BANCOLOMBIA S.A. Sucursal: MEDELLIN Persona: Sergio Martinez Charria

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Plazo: 1 Año 21-Feb-2023 Origen: Forward-Forward

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

Fecha de pago: 22-Feb-2023 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 56'000,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 332.8000 SEFable:

Tasa forward: 4563.0200

Tasa spot: 4230.2200 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por SERGIOM

Comentario: Reemplaza Operación

Estado CRCC:

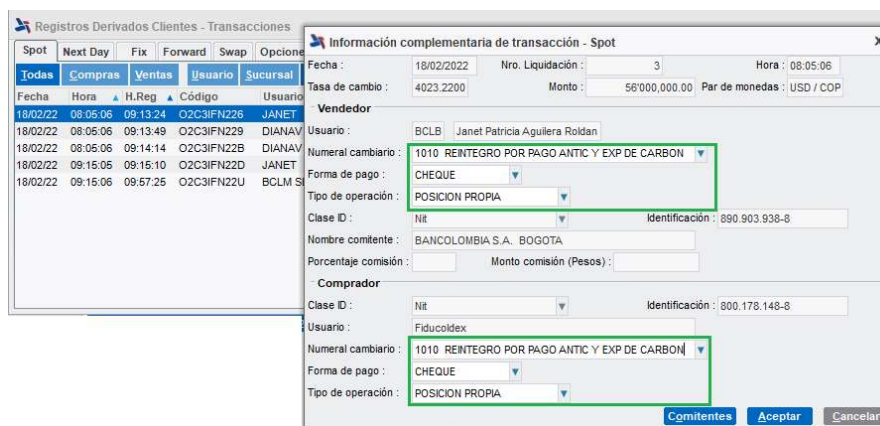
Fecha anterior:

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 25 / 83

2.2.3.3. Información Complementaria

Permite ingresar información adicional al registro realizado.



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:

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 26 / 83

- 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	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	09:25:09	BCLB JANET	Modificación de transacción	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	10:32:46	BCLB JANET	Solicita cambio a CRCC	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	10:51:06	SETI JEANN	Expira cambio a CRCC	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	
18/02/22	11:53:04	BCLB JANET	Anulación	D	USD / COP	560,000.00	4025.6300	18 Meses 17/08/2023	Por fraccionamiento
18/02/22	11:02:03	BCLB JANET	Registro x FR	D	USD / COP	250,000.00	4025.6300	01/545 17/08/2023	

2.2.3.8. Anulación

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones									
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario					
18/02/22	08:05:06	09:13:24	O2C3IFN226	JANET					
18/02/22	08:05:06	09:13:49	O2C3IFN229	DIANA V					
18/02/22	08:05:06	09:14:14	O2C3IFN22B	DIANA V					
18/02/22	09:15:06	09:15:10	O2C3IFN22D	JANET					
18/02/22	09:15:06	09:57:25	O2C3IFN22U	BCLM SEP					
18/02/22	09:15:06	12:06:44	O2C3IFN23E	BCLM SEP					

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 27 / 83

Fecha: 18/02/2022
Hora: 12:59:40

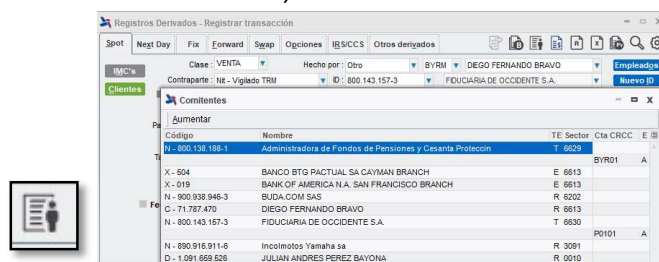
Sistema Electrónico de transacción y registro de moneda extranjera SET-FX
PAPELETA DE NEGOCIACIÓN PARA REGISTROS DE DIVISAS
CLIENTES

Fecha :	18/02/2022
Código :	COC3W22D
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

BOLB JANET SET-FX Página: 1 de 1

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.



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 28 / 83



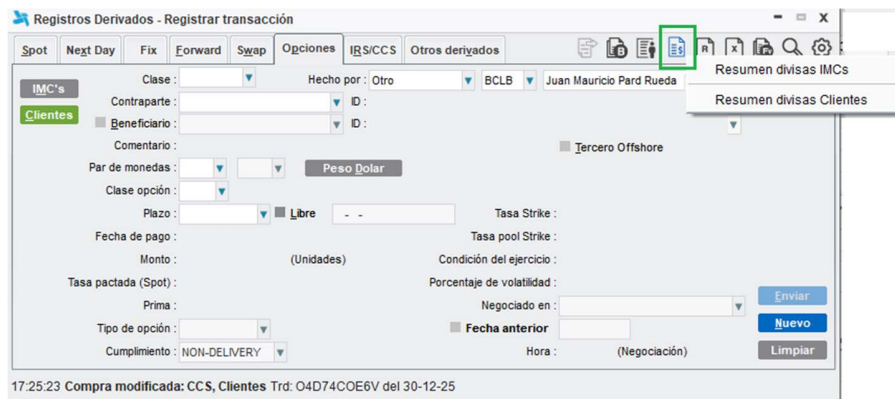
Código	Nombre	TE	Sector	Cta CRCC	E
N - 800.116.398-7	FONDO PARA FINANCIAMIENTO DEL SECTOR AGROPECUARIO	V	9499	AB412	I
N - 800.138.188-1	Administradora de Fondos de Pensiones y Cesanta Proteccin	T	6629	T0301	A
N - 800.143.157-3	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S.A.	T	6630	AIN01	A

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

2.2.3.11. Resumen de precios/montos transados hoy

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 29 / 83



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

- Resumen divisas IMCs / Clientes

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



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



Registros Derivados IMCs - Resumen por mes				
Fecha: 2022/02				
Mercado	ParMnda	Monto Negociado	Num. Trans.	
Forward	EUR/USD	14'046,035	4	
Forward	JPY/AUD	6'000,000	1	
Forward	MXN/BRL	30'000,000	1	
Forward	USD/CAD	75'000,000	1	
Forward	USD/CLP	75'000,000	1	
Forward	USD/MXN	10'000,000	1	
Forward	USD/PEN	75'000,000	1	
IRS/CCS	COP/COP	11,903'206,250	14	
IRS/CCS	USD/COP	100'006,000	4	
Next Day	EUR/GBP	30'000,000	1	
Next Day	EUR/SEK	20,000	1	
Next Day	EUR/USD	12'008,100	4	

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 30 / 83

Registros Derivados Clientes - Resumen por día

Resumen por Mes Fecha : 18/02/2022

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

Registros Derivados Clientes - Resumen por m...

Fecha : 2022/02

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

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”.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: Hecho por: Otro BCLB Juan Mauricio Pard Rueda Empleados

Contraparte: ID: Beneficiario: ID: Nuevo ID.

Comentario: Tercero Offshore

Par de monedas: Clase opción: Plazo: Libre Tasa Strike: Tasa pool Strike: Condición del ejercicio: Porcentaje de volatilidad: Negociado en: Fecha anterior: Hora: (Negociación)

Tasa pactada (Spot): Monto: (Unidades) Tipo de opción: Cumplimiento: NON-DELIVERY

Enviar Nuevo Limpiar

17:25:23 Compra modificada: CCS, Clientes Trd: 04D74COE6V del 30-12-25

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 31 / 83



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.



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 32 / 83



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 rechaza 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:



Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtros	Filtros de visualización de las solicitudes de operaciones por mercado entre IMCs/clientes

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 33 / 83

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.*





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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 34 / 83

2.2.3.16. Configuración Mercado

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



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.



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

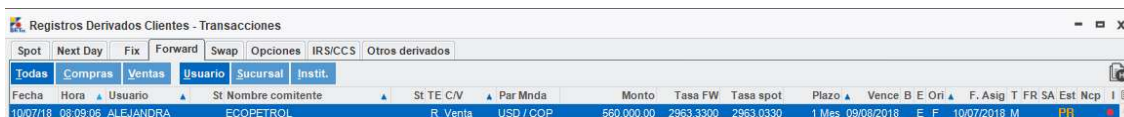
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 35 / 83

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:

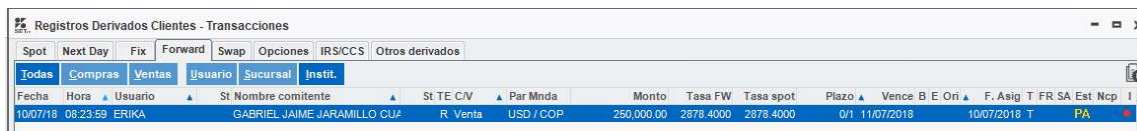
PR (Pendiente de Riesgo) – Color naranja

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



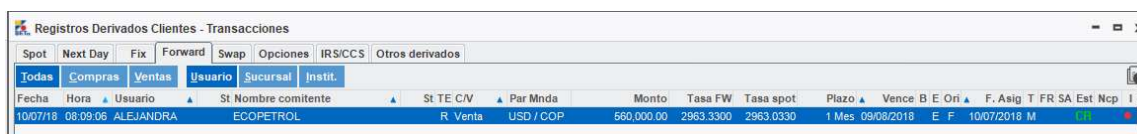
PA (Pendiente de Aprobación) – Color amarillo

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



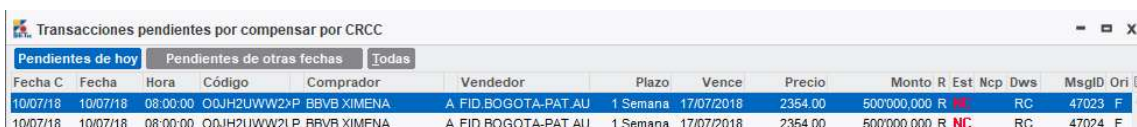
CR (Compensada por Cámara de Riesgo) – Color verde

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



NC (No Compensada) – Color rojo

La operación fue rechazada por la CRCC.



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 36 / 83

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:



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 37 / 83

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.

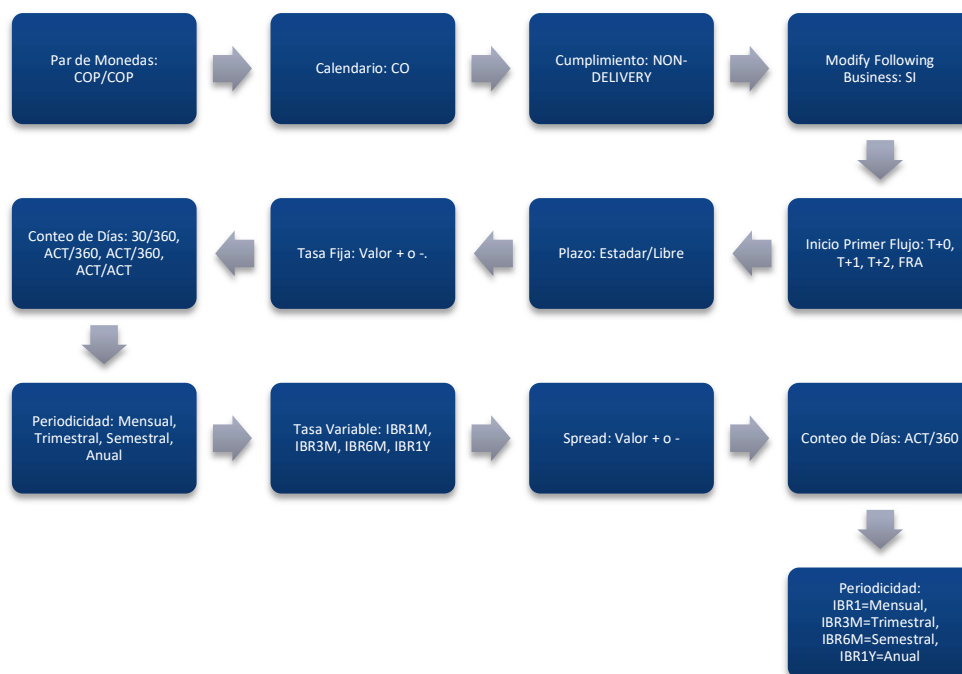
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 38 / 83

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

3.3. Compensación registro IRS

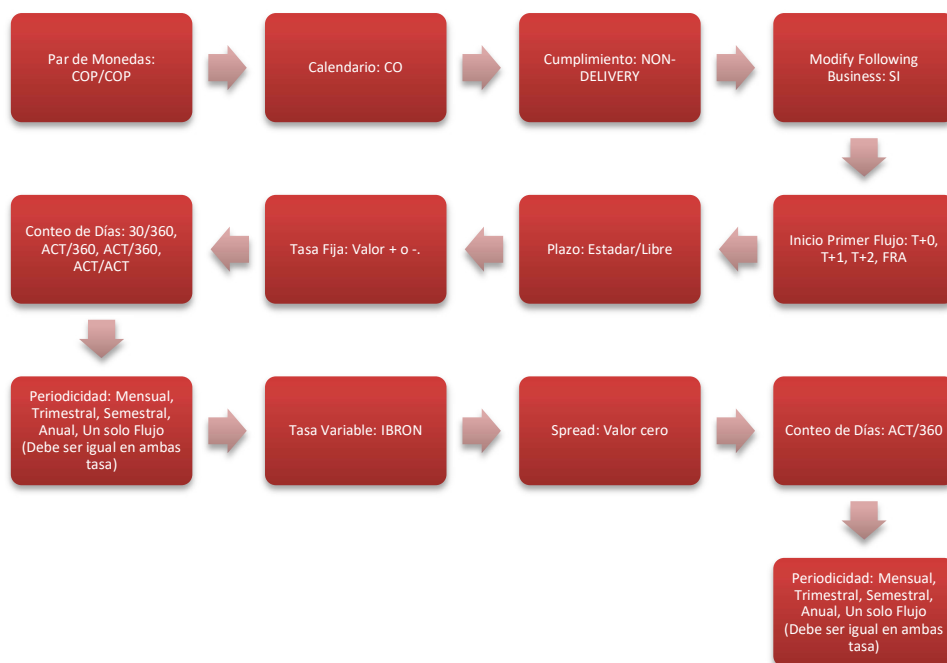
Para el envío de operaciones IRS Plain Vanilla a CRCC se deben cumplir ciertas condiciones, las condiciones para el envío de estas operaciones se detallan a continuación:



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 39 / 83

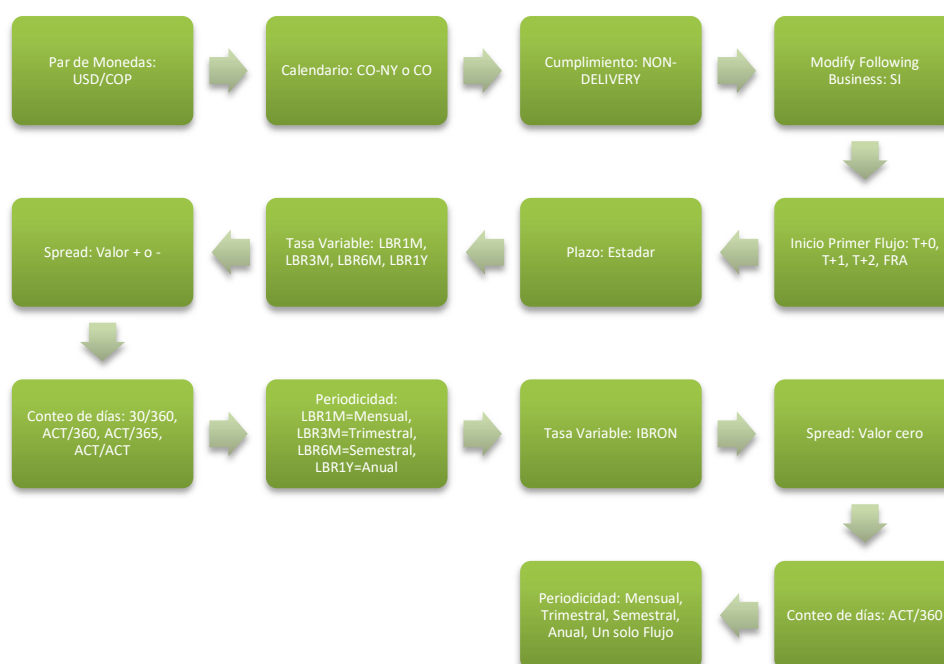
En el caso para la compensación de operaciones IRS OIS, se deben cumplir las siguientes condiciones:



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 40 / 83

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.

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp Pri/Am I
30/07/25	08:05:06	10:54:29	006BAIV5G6	JANET	Fiducoldex	T Compra	USD / COP	562,222.00	4235.0000	1 Año	03/08/2026		...	
30/07/25	08:05:06	10:56:32	006BAIV5G8	JANET	Fiducoldex	T Compra	COP / COP	562,222.00		1 Año	31/07/2026		...	

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 41 / 83

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:

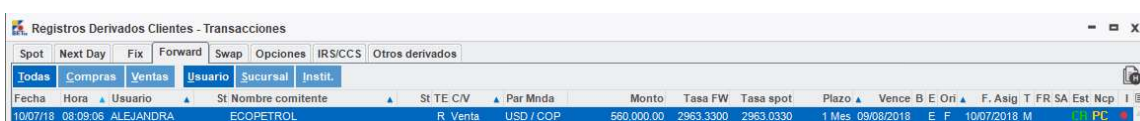
- La solicitud debe realizarse el mismo día en que la operación fue enviada a compensación.
- La operación debe estar vigente.
- La operación debe contar con previa autorización de la CRCC para el desmarcado de la operación y se pueda continuar el proceso de retiro.

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".

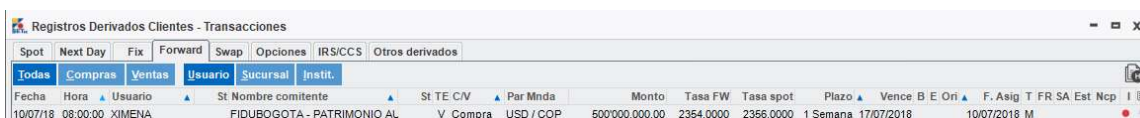
Una vez iniciado el proceso del retiro de compensación, esta pasa por los siguientes estados, visibles en el blotter de operaciones:

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



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

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



Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FIDUBOGOTA - PATRIMONIO AL	Compra	USD / COP	500'000.000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	10/07/2018 M

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 42 / 83

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	Hora	Usuario	St Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp			
10/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	ECOPETROL	R Venta	USD / COP	560.000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018	E F 10/07/2018 M	CR		

Proceso para Operaciones IRS entre IMCs

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

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

Estados asociados:

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

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B E Est Ncp	Am PA				
24/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	TAUB ADRIANAF	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR CN			
24/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	TAUB ADRIANAF	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019					

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

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B E Est Ncp	Am PA				
24/07/18	08:09:06	ADRIANAF	DVNB ALEJANDRA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR SA			
24/07/18	08:09:06	ADRIANAF	DVNB ALEJANDRA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019					

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

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B E Est Ncp	Am PA				
24/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	TAUB ADRIANAF	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019		CR PC			
24/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	TAUB ADRIANAF	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	24/01/2019					

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.

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 43 / 83

Registros Derivados IMCs - Transacciones														
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.														
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA	
24/07/18	08:09:06	ADRIANAF	DVNB ALEJANDRA	Venta	COP / COP	500'000.000.00		6 Meses	24/01/2019					

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.

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.												Fecha
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	PrAm	sM	pA
18/07/25	08:05:06	13:53:01	O06BW2YDPC	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	55.555.66		7 Años	22/07/2032						M

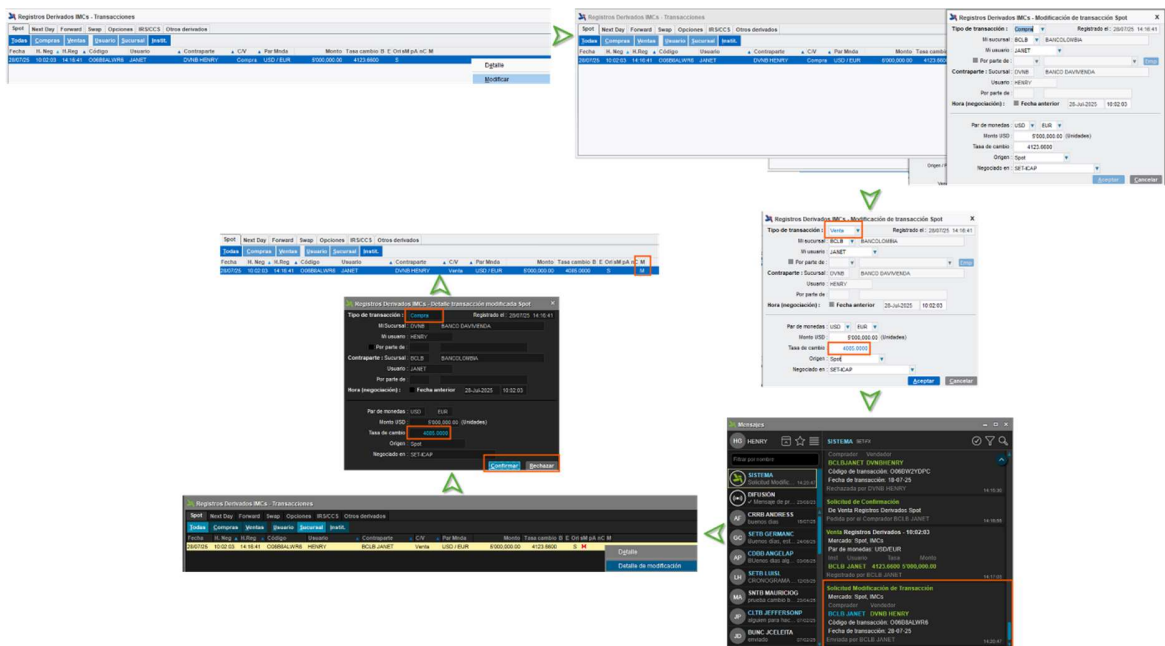
Si la solicitud es enviada por la contraparte, la columna “sM” mostrará una “M” en color rojo, indicando que la entidad debe aceptar o rechazar la modificación.

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.												Fecha	18/
Fecha	H. Neg	H.Reg	Código	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	PrAm	FA sM	a nC M	
18/07/25	09:05:06	09:47:27	O06BW2YDP8	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	5,600'000.000.00		8 Años	22/07/2033						M	
18/07/25	09:05:06	13:46:07	O06BW2YDPA	JANET	DVNB HENRY	Compra	COP / COP	5,600'000.000.00		8 Años	22/07/2033						M	

Ejemplo modificación de un registro entre dos IMCs:

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 44 / 83



4.2. Modificaciones con Clientes o Comitentes

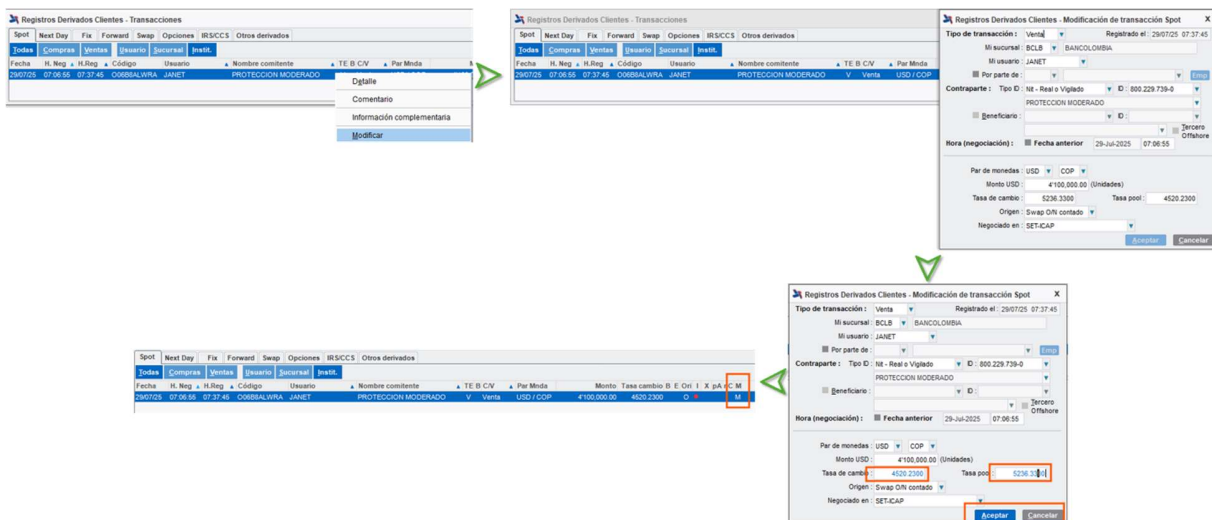
Cuando el registro corresponde a un cliente o comitente, la modificación se aplica de forma inmediata, una vez se actualicen los campos requeridos.

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

Ejemplo modificación de un registro entre un IMC/Cliente

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 45 / 83



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".

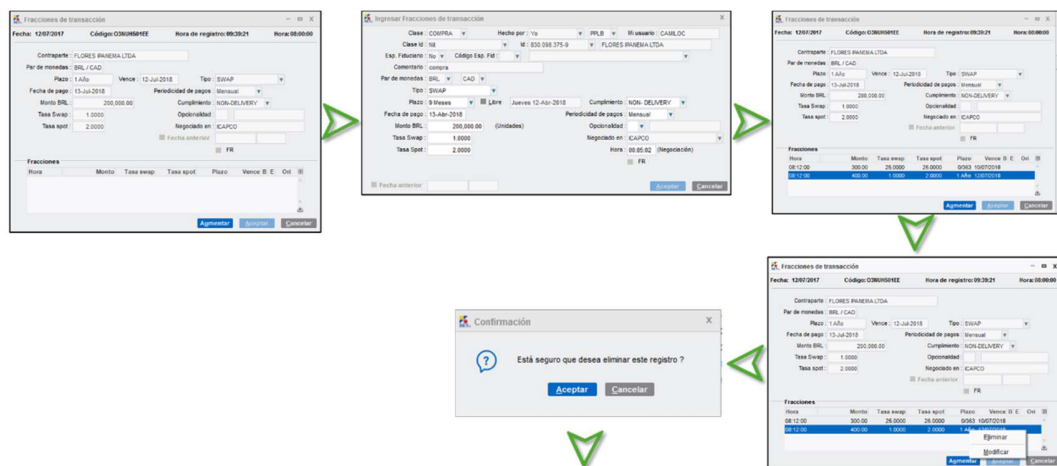
Al seleccionar la opción Fraccionar, se abrirá una nueva ventana con los detalles generales de la operación. En la parte inferior, encontrará el botón "Aumentar", que permite iniciar el proceso de fraccionamiento.

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.

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

	MANUAL DE USUARIO		Código: IGO020204
			Archivo: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML		Versión: 05
			Página: 46 / 83



Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CSS	Otros derivados														
Todas	Compra	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.																
Fecha	H. Neg	H. Reg	Código	Usuario	St	Nombre comitente	St	TE	B/C/V	Par	Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B.E.	Orl	F. Asig.	FR	st
18/02/22	11:02:03	11:53:04	O2C3FN232	JANET		FIDEICOMISOS SOCIEDAD FI...	R	Compra	USD / COP			250,000.00	4585.6300	4562.0000	0545	17/08/2023	X0		18/02/2022	FR	
18/02/22	11:02:03	11:53:04	O2C3FN238	JANET		FIDEICOMISOS SOCIEDAD FI...	R	Compra	USD / COP			950,000.00	4025.6300	4002.0000	0545	17/08/2023	X0		18/02/2022	FR	
18/02/22	11:02:03	11:53:04	O2C3FN238	JANET		FIDEICOMISOS SOCIEDAD FI...	R	Compra	USD / COP			150,000.00	4025.6300	4002.0000	0545	17/08/2023	X0		18/02/2022	FR	
18/02/22	11:02:03	11:53:04	O2C3FN238	JANET		FIDEICOMISOS SOCIEDAD FI...	R	Compra	USD / COP			150,499.50	4025.6300	4002.0000	0545	17/08/2023	X0		18/02/2022	FR	

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

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 18/02/2022 Código: O2C3FN232 Hora de registro: 11:53:04 Hora Neg.: 11:02:03

Comprador: Sucursal: BOCOTA Persona: Janet Patricia Aguilera Roldan

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

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Plazo: 545 Días 17-Ago-2023 Origen: Fix

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

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

Monto: 250,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 23.6300

Tasa forward: 4585.6300

Tasa spot: 4562.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECCION TESORO NACIONAL

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario:

Estado CRCC:

Fecha anterior:

Fecha trans. anterior: 18-Feb-2022

Hora trans. anterior: 09:05:06

Cod. trans. anterior: O2C3FN206

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 47 / 83

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.

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

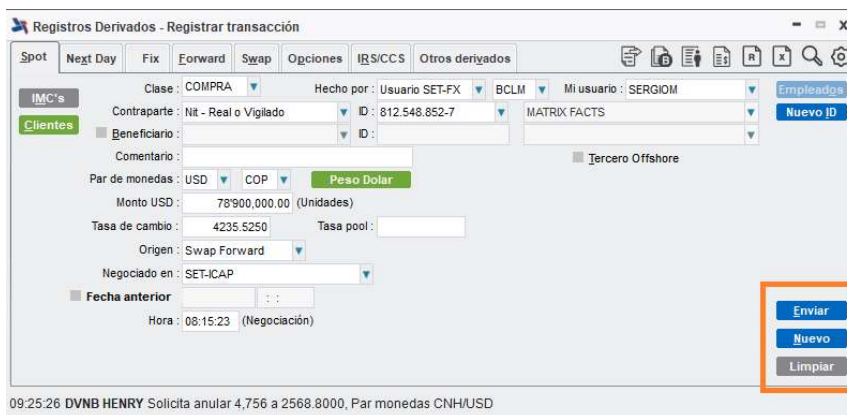
Adicionalmente, en la ventana Historia de la Postura, el campo Comentario especificará que la operación fue eliminada “por fraccionamiento”.

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.



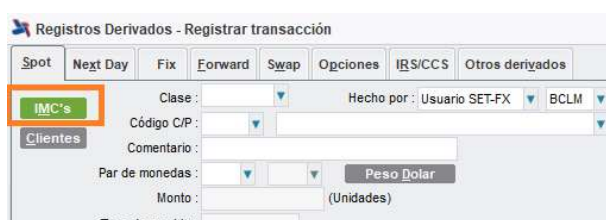
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 48 / 83

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



IMCs - 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.

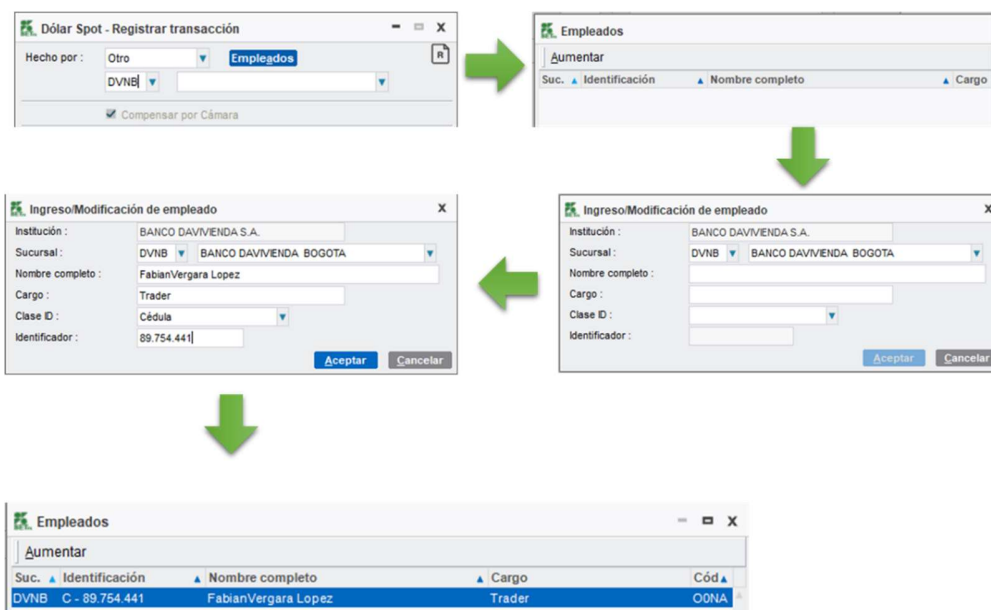
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 49 / 83



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”.



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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 50 / 83

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 51 / 83

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”.

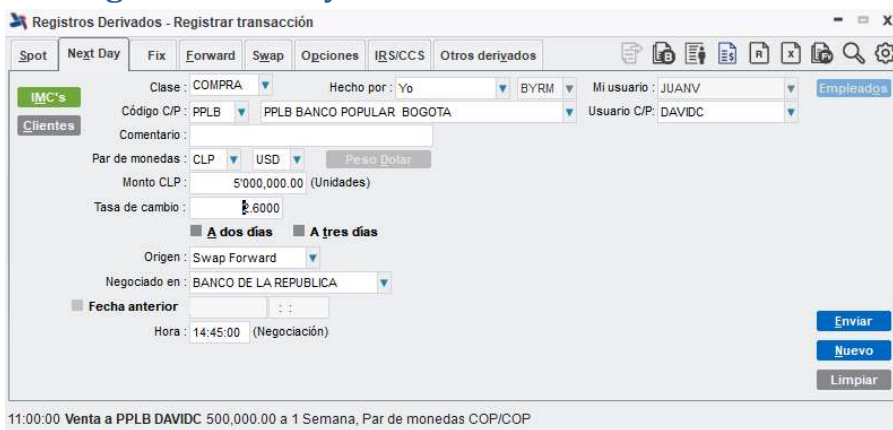


- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 52 / 83

7.3. Registro Next Day IMC – IMC



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

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

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

Comentario:

Par de monedas: CLP USD Peso Dolar

Monto CLP: 5'000,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: .6000

☒ A dos días ☐ A tres días

Origen: Swap Forward

Negociado en: BANCO DE LA REPUBLICA

☐ Fecha anterior

Hora: 14:45:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

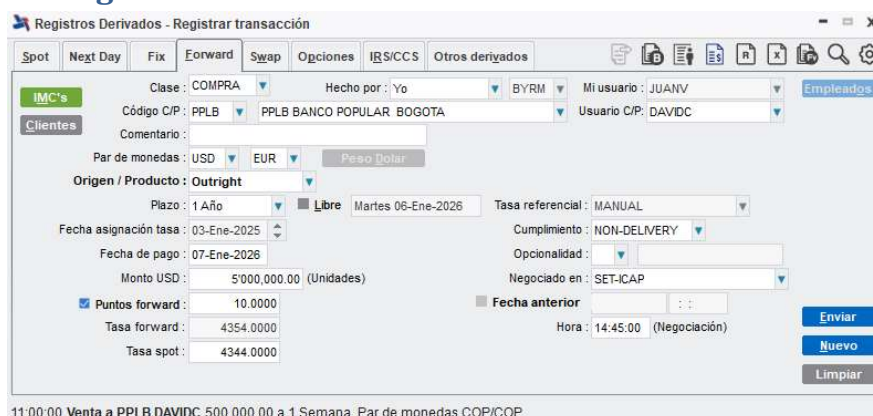
11:00:00 Venta a PPLB DAVIDC 500,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (*Opcional*)
- Par de monedas: Corresponde al par de monedas de la operación pactada. (Obligatorio)
- Monto: monto de la operación, expresado en relación con el primer par de monedas utilizado (Obligatorio)
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo con el primer par de moneda (Obligatorio)
- Casillas “A dos días”, “A tres días”, podrá marcar una de las dos casillas he indicará la cantidad de días de vencimiento 2 y 3 días, si no marca ninguna casi el sistema lo toma como un Next Day a 1 día.
- Origen: Origen de la Operación (Obligatorio)
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox. (Obligatorio)
- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación (Obligatorio)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 53 / 83

7.4. Registro Forward IMC – IMC



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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 54 / 83

- 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



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

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 55 / 83

- 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



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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 56 / 83

- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 57 / 83

7.7. Registro IRS IMC - IMC

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes IRS CCS

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

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

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dólar

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

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

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

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

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

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

☒ P. Rotos/Amortizaciones Editar

☒ Pagos adicionales Editar

Fecha anterior

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

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

- 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:

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 58 / 83

- 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)

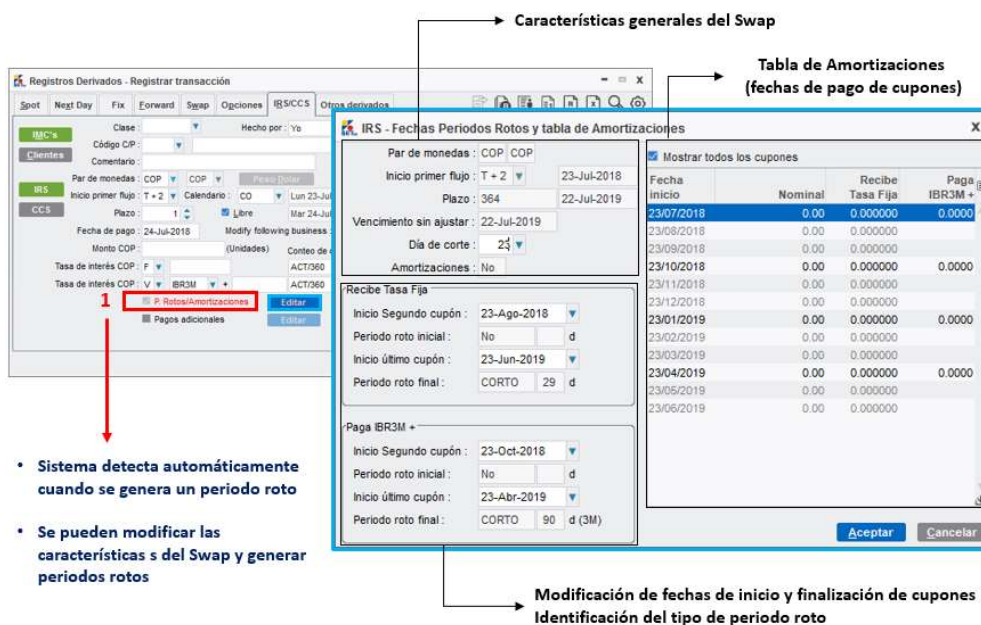
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director SET-FX	Aprobado por: Gerencia TI
Fecha: 26/01/2026	Fecha: 30/01/2026	Fecha: 04/02/2026

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 59 / 83

- Fecha anterior: Opción para indicar que el registro fue realizado el día anterior de acuerdo con la normatividad DODM-317. Solo se activará durante los primeros 15 minutos a partir de la apertura del mercado “Registro de Derivados”.
- Hora: Hora de cierre de la operación
- Registro con opción de periodos rotos/amortizaciones y/o pagos adicionales: Periodo de tiempo en días, al inicio o al final de la vida de un swap que difiere del periodo regular de pago. Aplica para registros entre IMC- IMC

Características generales del Swap

Tabla de Amortizaciones (fechas de pago de cupones)



1

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

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

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 60 / 83

Registros Derivados - Registrar transacción

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

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

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

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dolar

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

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

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

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

Tasa de interés COP: F 2.500000% ACT/360

Tasa de interés COP: V SFR6M + 10.0000 ACT/360

☒ P. Rotos/Amortizaciones Editar

☒ Pagos adicionales Editar

Ingresar/modificar Pago Adicional

Fecha pago: 08/01/2025

Paga: PPLB PPLB BANCO POPULAR BOGOTA

Recibe: BYRM BYRM BTG PACTUAL S.A. MEDELLIN

Monto pago: 350,000.00

Comentario: primer pago

Aumentar Aceptar Cancelar

7.8. Registro CCS IMC - IMC

Registros Derivados - Registrar transacción

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

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

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

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

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

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

Fecha de pago: 09-Ene-2035 Modify following business: SI Monto COP: 21,723'500,000.00

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

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

Tasa de interés COP: V SFR3M + 10.0000 ACT/360 Trimestral Negociado en: DIRECTO

Tasa de cambio: 4344.7000

☐ Fecha anterior

Hora: 14:45:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

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

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Código C/P: Nemo técnico institución contraparte (Obligatorio)
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte (Obligatorio)
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación (Opcional)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 61 / 83

- 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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 62 / 83

- 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



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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 63 / 83

- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 64 / 83

7.10. Registro Spot IMC – Clientes

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

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

Contraparte: Empresas del exterior ID: 504 BANCO BTG PACTUAL SA CAYMAN BRA Nuevo ID

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

Comentario:

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

Monto USD: 6'500,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 4350.0000 Tasa pool: 4380.0000

Origen: Spot

Negociado en: SET-ICAP

☐ Fecha anterior

Hora: 14:45:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

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

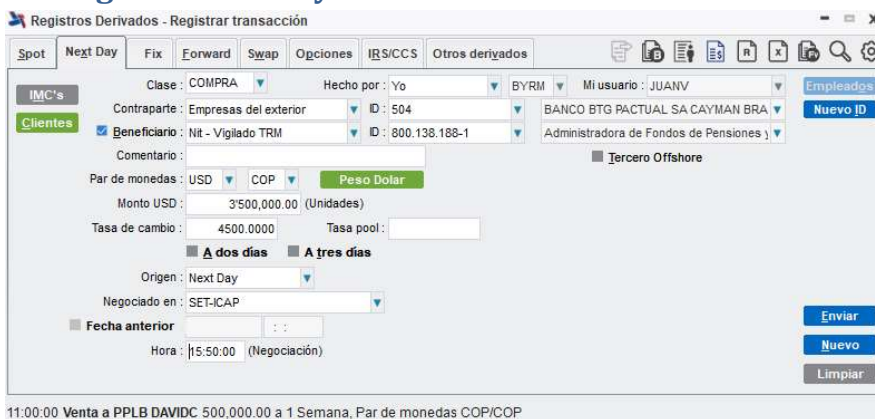
- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro (Obligatorio)
- Mi usuario: Nombre del usuario (Obligatorio)
- Contraparte: Tipo de identificación del cliente o contraparte (Obligatorio)
- Id: Número de identificación (Obligatorio)
- Beneficiario: campo para la identificación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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 65 / 83

- 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



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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 66 / 83

- 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



Registros Derivados - Registrar transacción

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

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

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

Beneficiario: Empresas del exterior ID: 504 BANCO BTG PACTUAL SA CAYMAN BRA

Comentario: Tercero Offshore

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

Plazo: 1 Día Libre Martes 07-Ene-2025

Fecha asignación tasa: 07-Ene-2025

Monto USD: 500,000.00 (Unidades) COP

Puntos: 0.0000

Origen: Fix

Tasa referencial: PRECIO FX SET FX

Negociado en: SET-ICAP

Hora: 15:50:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 67 / 83

- 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

Par de monedas :

- Luego, elija la expresión del monto deseado.

Monto USD : (Unidades)

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 68 / 83

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

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

Monto USD : 56'000,000.00 (Unidades) USD ▼
Puntos : 0.0000 USD
Origen : Fix COP

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T. Ori
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	1,406.82 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79
26/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T Venta	COP / USD	56'000.000.00 COP	4012.3200	0.0000	1 Día	28/02/2022	26/02/2022	M X1

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T. Ori
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	1,406.82 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79
26/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T Venta	USD / COP	13,957.01 USD	4012.3200	0.0000	1 Día	28/02/2022	26/02/2022	M X1

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

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T. Ori
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79
26/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T Venta	USD / COP	56'000.000.00 USD	4012.3200	0.0000	1 Día	28/02/2022	26/02/2022	M X1

Tasa referencial: MANUAL

Puntos: -20.2350

Tasa spot: 4100.0000

Tasa de cambio: 4079.7550

Registrado en: SET-CAR

Guardar Cancelar

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados														
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T. Ori
09/02/22	10:30:00	11:19:07	02C3A4SUZC	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	124	29/06/2022	10/02/2022	P X140
09/02/22	10:30:00	11:13:42	02C3A4SUZA	JANET	Administradora de Fondos de ...	T S Compra	USD / COP	3000.000.00 USD	3919.4200	-2.0000	63	29/04/2022	10/02/2022	P X79
26/02/22	08:05:06	10:16:46	02C3T5WRV9	JANET	FIDUCIARIA DE OCCIDENTE S...	T Venta	USD / COP	56'000.000.00 USD	4079.7550	-20.2350	1 Día	28/02/2022	26/02/2022	M X1

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 69 / 83

- 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

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes

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

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

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

Comentario: Tercero Offshore

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

Origen / Producto: Forward-Forward

Plazo: 18 Meses Libre Lunes 06-Jul-2026

Fecha asignación tasa: 03-Ene-2025

Fecha de pago: 07-Jul-2026

Monto USD: 3'500.000.00 (Unidades)

☒ Puntos forward: 10.0000

Tasa forward: 4360.0000

Tasa spot: 4350.0000 Tasa pool: 4500.0000

Tasa referencial: MANUAL

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad:

Negociado en: SET-ICAP

☐ Fecha anterior

Hora: 15:50:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

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

- Clase: COMPRA/VENTA (Obligatorio)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 70 / 83

- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 71 / 83

- 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



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

- 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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 72 / 83

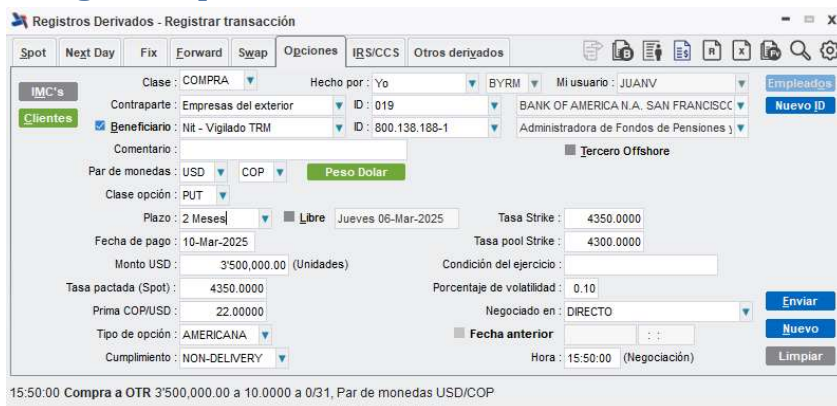
Check Box solo se habilitará en el momento que se seleccione un beneficiario en la operación.

- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 73 / 83

7.15. Registro 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 74 / 83

- 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

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes IRS CCS

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

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

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

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Polar Tercero Offshore

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

Plazo: 10 Años Libre Mar 09-Ene-2035 Opcionalidad: NO

Fecha de pago: 09-Ene-2035 Modify following business: SI Vencimiento sin ajustar: 08-Ene-2035

Monto COP: 3'500,000.00 (Unidades) Segundo monto: 3'500,000.00 COP

Tasa de interés COP: F 23.200000% Conteo de días: ACT/360 Periodicidad: Trimestral Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: V SFR3M + 21.0000 ACT/360 Trimestral Negociado en: DIRECTO

☐ P. Rotos/Amortizaciones Editar

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

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

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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 75 / 83

- 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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 76 / 83

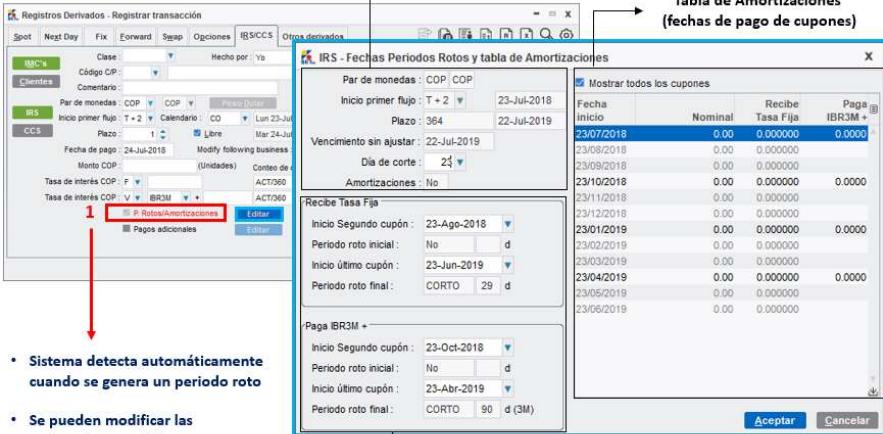
- SFRON - SOFR OVER NIGHT
- VAC - INDICES VAC BCR
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT (Obligatorio)
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo (Obligatorio)
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY (Obligatorio)
- Vencimiento sin ajustar: fecha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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 77 / 83

Características generales del Swap

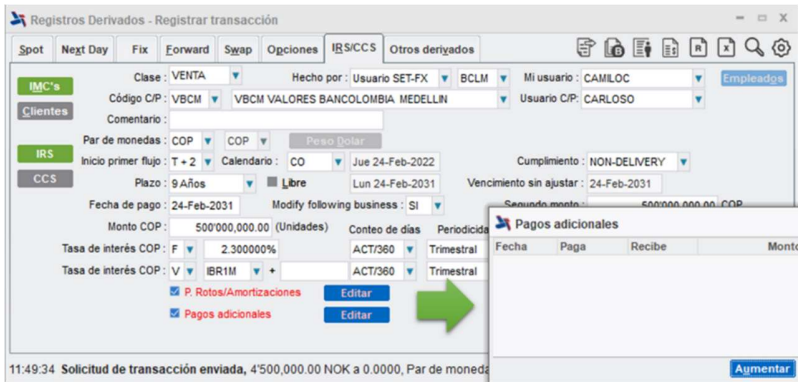
Tabla de Amortizaciones (fechas de pago de cupones)



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

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

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



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

Pagos adicionales

Fecha	Paga	Recibe	Monto	Comentario
24/02/2022	BCLB	VBCM	30'000.000.00	Segundo Pago
25/02/2022	BCLB	VBCM	456,666.00	Primero pago

Ingresar/modificar Pago Adicional

Fecha pago: 25/02/2022

Paga: BCLB BCLB BANCOLOMBIA BOGOTA

Recibe: VBCM VBCM VALORES BANCOLOMBIA MEDE

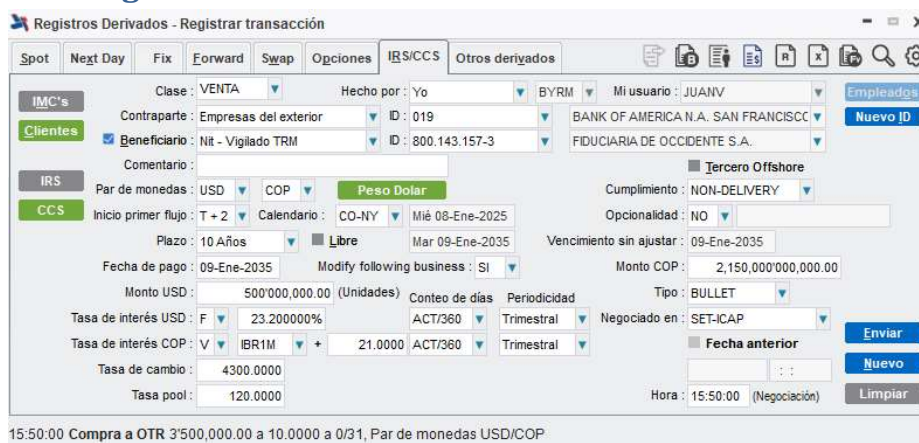
Monto pago: 456,666.00

Comentario: Primero pago

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 78 / 83

7.17. Registro CCS IMC – Clientes



- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 79 / 83

- 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:

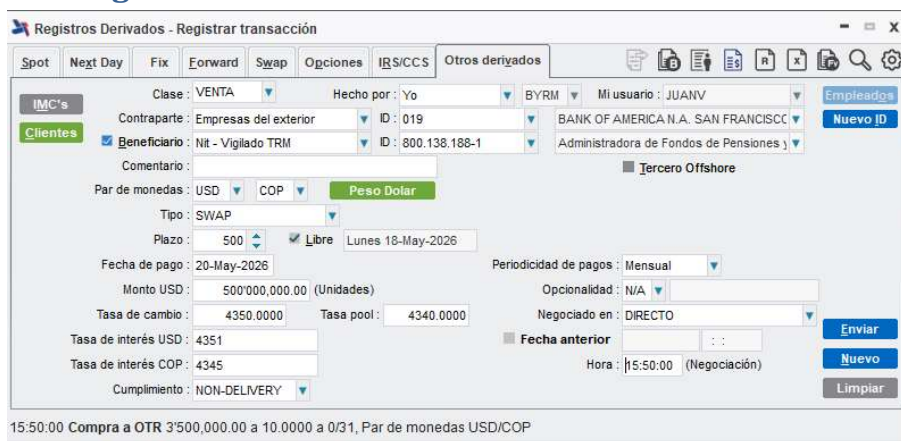
- DTF90 - DTF 90 DIAS
 - EUR3M - EURIBOR6M
 - EUR6M - EURIBOR6M
 - FBIL - FBIL Reference Price
 - FED - FEDFUNDS
 - FFON - FED FUNDS OVERNIGHT
 - IBR1M - IBR 1 MES
 - IBR3M - IBR 3 MESES
 - IBR6M - IBR 6 MESES
 - IBRON - IBR OVER NIGH
 - IPC - IPC
 - LBR1M - LIBOR 1 MES
 - LBR1Y - LIBOR 1 AÑO
 - LBR3M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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 80 / 83

- 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



- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 81 / 83

- 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)

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 82 / 83

- 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

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

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 05
		Página: 83 / 83

Tasa asignada directamente por el usuario.

INFORMACIÓN ADICIONAL

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

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