

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 1 / 116



Manual de Usuario

Mercado Dólar Spot

Febrero 2018

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 2 / 116

Contenido

OBJETIVO	5
1. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO SPOT	6
1.1. FUNCIONES DE NEGOCIACIÓN	6
1.1.1. Ingreso de posturas con monto oculto (bajo la modalidad de <i>Goteo</i>).....	10
1.1.2. Modificación y retiro de posturas	11
2. ÓRDENES MERCADO SPOT	13
3. TRANSACCIONES POR REGISTRO	18
3.1. TRANSACCIONES POR REGISTRO NO COMPENSADAS MERCADO SPOT	18
3.2. TRANSACCIONES POR REGISTRO COMPENSADAS MERCADO SPOT	21
3.2.1. Solicitante Exige Registro por Cámara	21
3.2.2. Aceptante Exige Registro por Cámara	25
4. STOP LOSS	26
5. FIXING (MATCHING)	33
6. CUPOS	41
6.1. CUPOS BILATERALES	42
6.1.1. Límites nacionales.....	43
6.1.2. Límites por sucursales.....	44
6.1.3. Cupos por compras y ventas	45
6.1.4. Cupos netos	46
6.1.5. Cupos globalizados.....	47
6.1.6. Compartición de cupos	48
6.2. CUPOS CÁMARA	51
6.2.1. Opción “Siempre por cámara en mercado electrónico”	52

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 3 / 116

6.2.2.	Opción: “Siempre por Cámara en registro”	53
6.3.	CONTROL DE CUPOS PARA REGISTROS	54
6.4.	VENTANA DE LÍMITES/CUPOS	55
6.4.1.	Ventana bajo la configuración de <i>Límites nacionales para compras y ventas</i>	56
6.4.2.	Ventana bajo la configuración de <i>Límites nacionales por neteo y globalizados</i>	63
6.4.3.	Ventana bajo la configuración de <i>Límites por sucursales para compras y ventas</i>	64
6.4.4.	Ventana bajo la configuración de <i>Límites por sucursales por neteo y globalizados</i>	65
7.	PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES PROPIAS	67
8.	TRANSACCIONES Y POSICIÓN	74
9.	GRÁFICOS Y PRECIOS	78
9.1.	GRÁFICO DE PRECIOS DE TRANSACCIONES CERRADAS HOY	78
9.2.	GRÁFICO DE PRECIOS DE MEJOR DEMANDA/OFERTA DE HOY.....	78
9.3.	GRÁFICO DE RESÚMENES POR DÍA.....	79
9.4.	GRÁFICO DE RESÚMENES POR INTERVALO	80
9.5.	PRECIOS/MONTOS TRANSACCIONES DE HOY	80
9.6.	HISTORIA DE PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES.....	81
9.7.	PRECIOS DE MEJOR DEMANDA/OFERTA DE HOY.....	83
9.8.	HISTORIA DE PRECIOS MEJOR DEMANDA/OFERTA.....	84
10.	RESUMEN DE PRECIOS/MONTOS TRANSADOS HOY	85
10.1.	RESUMEN DE HOY	86
10.2.	RESUMEN IMCs Y SECTOR REAL	88
11.	CONSULTAS	90
12.	CONFIGURACIÓN DE VISUALIZACIÓN DEL MERCADO SPOT	91
13.	INDICADOR DE CUPOS EN LAS POSTURAS	92
13.1.	PRECIO POSTURA COLOR VERDE (OFERTAS) O AZUL (DEMANDAS).....	94

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 4 / 116

13.2.	PRECIO POSTURA COLOR AMARILLO	94
13.3.	PRECIO POSTURA COLOR ROJO	95
14.	BARRIDOS NETOS	96
14.1.	BARRIDOS CON PUNTAS EN GOTEO – CANTIDAD VISIBLE	101
15.	OPCIONES SOBRE TRANSACCIONES REALIZADAS	107
15.1.	TRANSACCIONES COMPENSADAS POR CÁMARA	108
15.2.	TRANSACCIONES NO COMPENSADAS POR CÁMARA	109
15.2.1.	Compensar por Cámara	110
15.2.2.	Anular transacciones	112
15.2.3.	Modificar transacciones	114
16.	INFORMACIÓN ADICIONAL	116

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 5 / 116

OBJETIVO

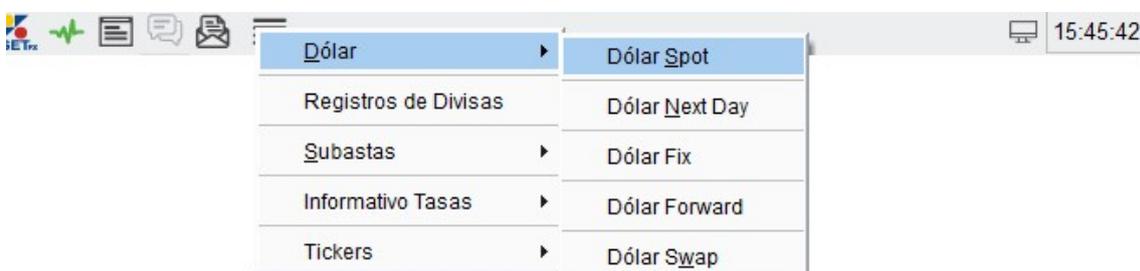
El presente manual tiene como objetivo explicar detalladamente el funcionamiento del Mercado Dólar Spot en el Sistema SET-FX; enfocándose en los procesos que se deben llevar a cabo para realizar operaciones antes de la apertura de mercado Spot del SET-FX y el envío de operaciones a la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 6 / 116

1. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO SPOT

En la barra principal de Sistema SET-FX se encuentra el botón , el cual permite ingresar a los diferentes mercados activos para el usuario. Se debe desplegar el menú DÓLAR y elegir la opción Dólar Spot, como se muestra a continuación:



1.1. FUNCIONES DE NEGOCIACIÓN

A continuación se explican las funciones de negociación del Sistema por medio de los botones de la barra de acceso y del teclado del usuario.

Para realizar una venta, se debe hacer clic en el botón de Vender  en la barra principal del Sistema SET-FX sobre la intención seleccionada en la demanda, u oprimir la tecla F3. Tanto la tecla como el botón ejecutan la misma acción sobre la mejor postura o intención seleccionada.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 7 / 116

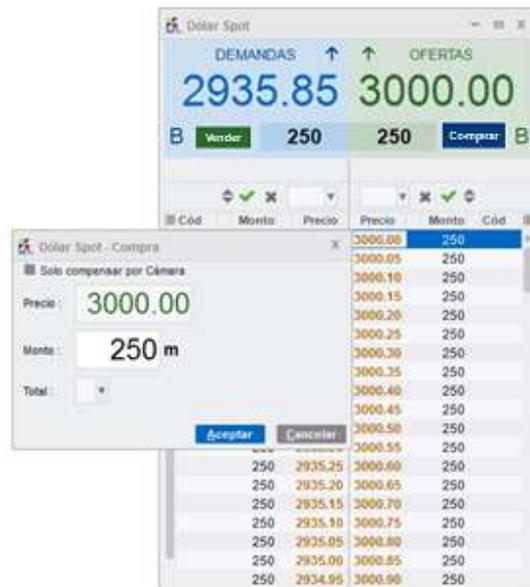


Para realizar una compra, se debe hacer clic sobre el botón  u oprimir la tecla F4 en la postura seleccionada. Tanto el botón como la tecla en mención cumplen la misma función.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 8 / 116



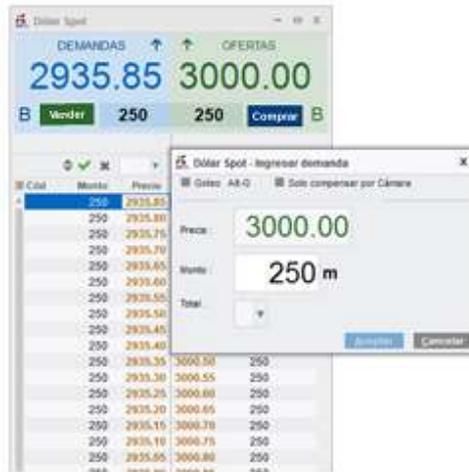
Para ingresar una demanda, se debe presionar el botón Demandar  de la barra de botones del mercado, u oprimir la tecla F5. A continuación aparecerá una ventana emergente, como se puede apreciar en la siguiente imagen, donde el usuario podrá digitar el monto en miles de dólares. Se debe tener en cuenta que el monto mínimo es 250 mil y el monto máximo 10000 m (10 millones).



Para ingresar la postura al mercado, hacer clic en el botón Aceptar.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 9 / 116



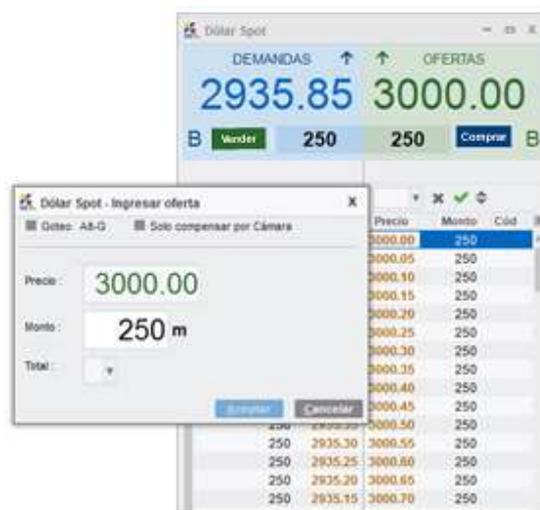
Para ingresar una Oferta, el usuario puede hacer clic en el botón de Ofertar  o presionar la tecla F6. En todas las posturas el monto esta dado en miles de dólares y el monto mínimo de ingreso para una postura serán mínimo de 250 m y máximo de 10000 m (10 millones).



Al presionar “Aceptar”, la postura se ingresará al mercado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 10 / 116



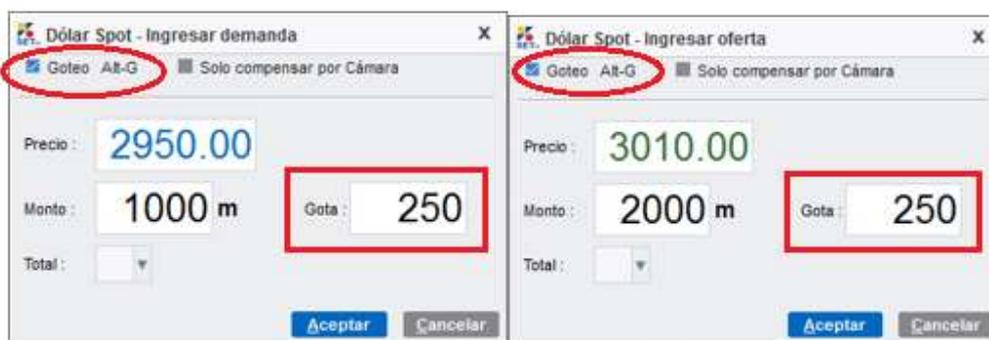
Si se ingresa una postura de demanda u oferta, y en lado contrario de la intención existe una o más posturas con un precio igual o mejor al solicitado, el Sistema calzará automáticamente dichas posturas para completar el monto de la intención. Adicionalmente, si al realizar este calce no se logra agredir el monto solicitado, se ingresará la postura con el monto remanente.

1.1.1. Ingreso de posturas con monto oculto (bajo la modalidad de Goteo)

Para ingresar una postura bajo la modalidad de goteo o cantidad visible, en atención a la definición de funcionamiento del Reglamento del SET-FX, se debe seleccionar la opción “Goteo” en la ventana *Dólar Spot- Ingresar demanda* o la ventana *Dólar Spot- Ingresar oferta*. Una vez seleccionada la opción, la ventana permitirá ingresar el monto total de la postura y el monto de cada gota, como se evidencia a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 11 / 116



Si se realiza la agresión por un monto igual o superior al tamaño de la gota y en ese momento existe una o más posturas al mismo precio, inmediatamente la postura agredida (en goteo) perderá su prioridad y se ubicará al final de las demás posturas que tengan el mismo precio.

1.1.2. Modificación y retiro de posturas

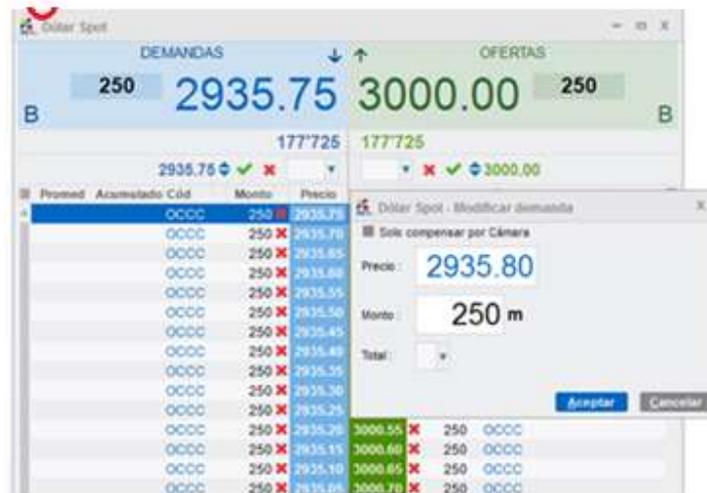
Para modificar una Demanda, se debe presionar el botón  en la barra superior o presionar la tecla F7. De la misma manera, para modificar una Oferta, se debe hacer clic en el botón  o usar la tecla F8.

Las opciones mencionadas anteriormente retirarán la postura del mercado por un momento. Una vez se modifique la postura (en precio, monto o si se quiere enviar a la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia – CCDC), se debe hacer clic en el botón Aceptar para volver a ingresar la postura a la tabla correspondiente.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 12 / 116



Para retirar la mejor Demanda que un usuario tenga en el mercado, se debe presionar el botón  de la barra de botones del mercado, o usar la tecla F9. Asimismo, Para retirar la mejor Oferta que

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 13 / 116

un usuario tenga en el mercado, se debe presionar el botón  de la barra de botones del mercado o usar la tecla F10.



El botón  de la barra de botones permite retirar todas las posturas (demandas y ofertas) ingresadas por el usuario. Por el contrario, el botón  le da la facultad al usuario para retirar las posturas ingresadas por él y por otros usuarios que pertenezcan a la misma sucursal tanto en demandas como en ofertas.

2. ÓRDENES MERCADO SPOT

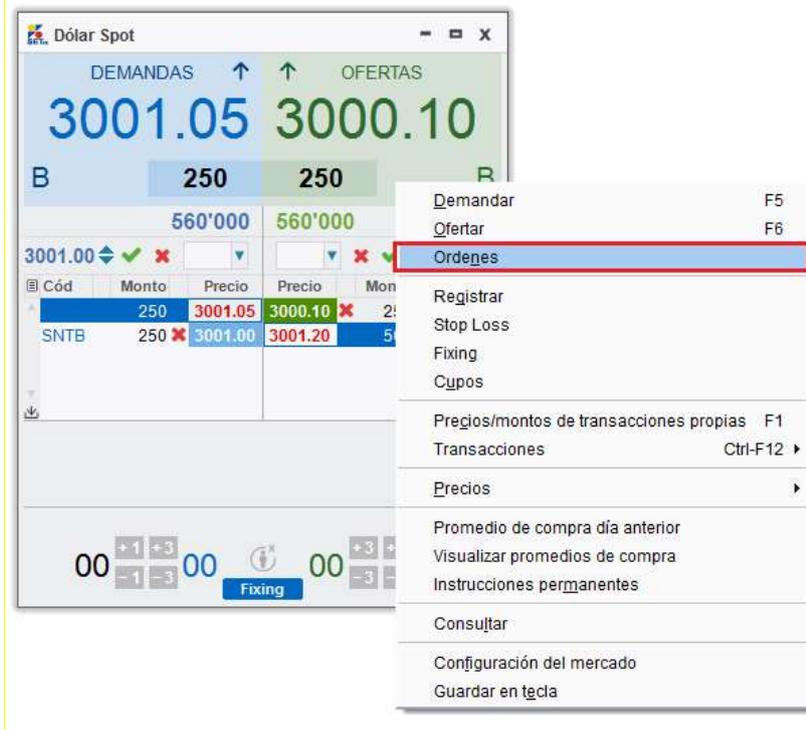


Al configurar las órdenes en SET-FX, el Sistema de manera automática hará el calce de la operación en el momento en que el precio configurado en la orden y el mejor precio de mercado sean iguales. Esta configuración funciona de la misma manera tanto para ventas como compras.

Para ingresar a la tabla de órdenes se debe hacer clic derecho sobre la tabla de mercado, seleccionar la opción *Órdenes* o hacer clic en el botón .

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 14 / 116



Automáticamente se abrirá la siguiente ventana:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 15 / 116

Haciendo clic en la pestaña “Ingresar”, seleccionamos si la orden será de venta o de compra.



A continuación el usuario debe ingresar la orden teniendo en cuenta los siguientes campos:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 16 / 116

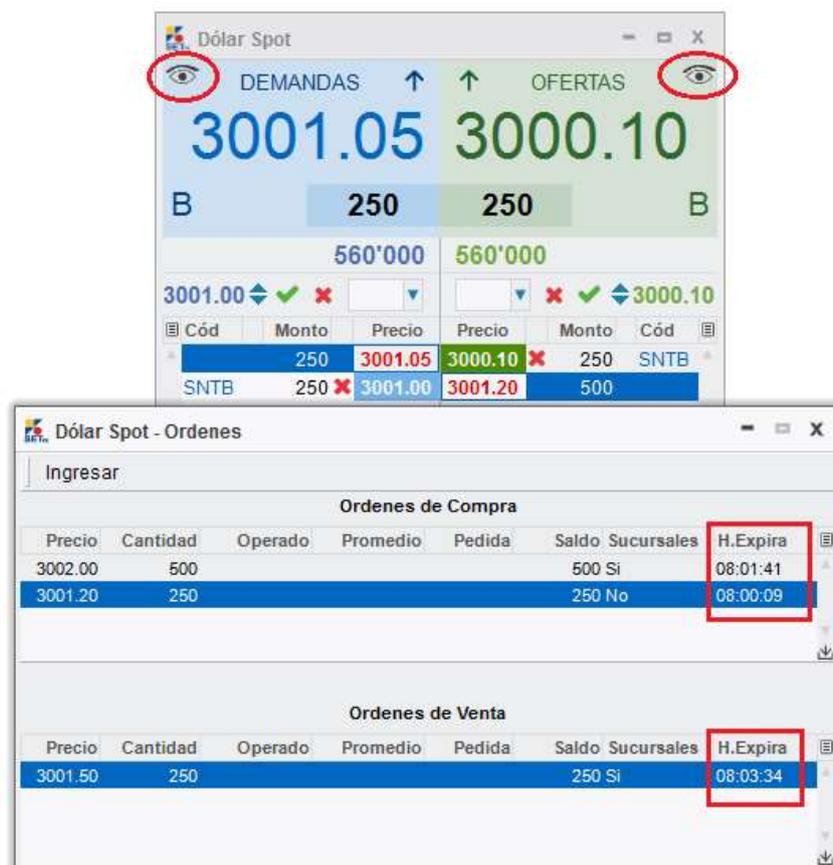


Al activar una orden, por medio del botón *Aceptar*, se muestra en la ventana del mercado la imagen  en la parte superior indicando que la orden esta activa. Al finalizar el tiempo la imagen desaparece.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 17 / 116



The screenshot displays two windows from the 'Dólar Spot' application. The top window shows market data with 'DEMANDAS' (3001.05) and 'OFERTAS' (3000.10) highlighted by eye icons. Below it, the 'Dólar Spot - Ordenes' window shows a table of orders with 'H.Expira' times highlighted by red boxes.

Ordenes de Compra						
Precio	Cantidad	Operado	Promedio	Pedida	Saldo Sucursales	H.Expira
3002.00	500				500 Si	08:01:41
3001.20	250				250 No	08:00:09

Ordenes de Venta						
Precio	Cantidad	Operado	Promedio	Pedida	Saldo Sucursales	H.Expira
3001.50	250				250 Si	08:03:34

Las operaciones calzadas dentro del mercado spot por medio de *Órdenes*, se consideran como una operación spot normal.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

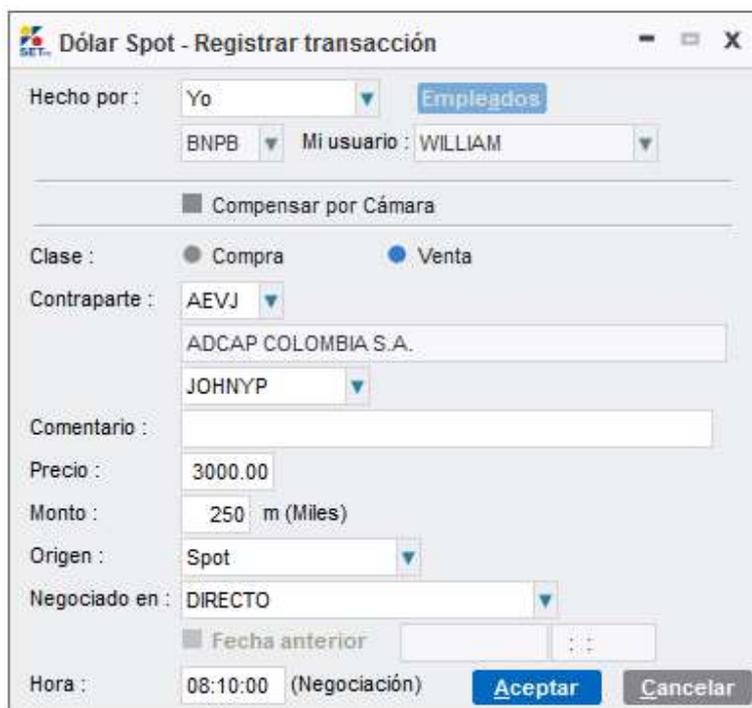
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 18 / 116

3. TRANSACCIONES POR REGISTRO

3.1. TRANSACCIONES POR REGISTRO NO COMPENSADAS MERCADO SPOT

El Sistema SET-FX permite registrar operaciones que fueron negociadas en el mercado OTC o en otro Sistema de Negociación y Registro de Divisas; es decir que fueron realizadas por fuera de la tabla (o

Ventana Dólar Spot). Para registrar una transacción, se debe presionar el botón “Registrar”  de la barra de botones del mercado.



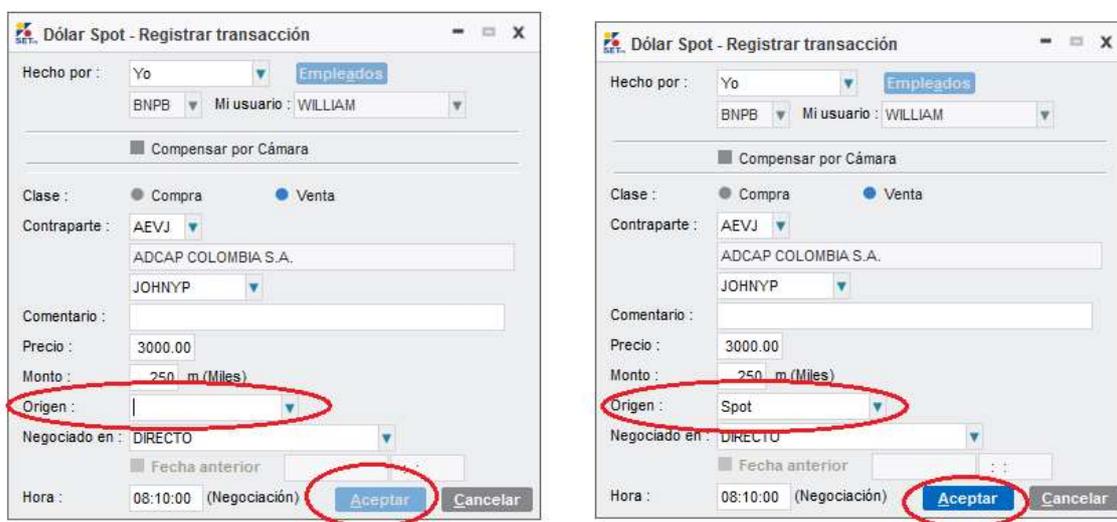
En la ventana, se deben ingresar los datos del registro tales como contraparte, monto y precio negociado, entre otros. Es importante tener en cuenta que, al momento de registrar, es obligatorio

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

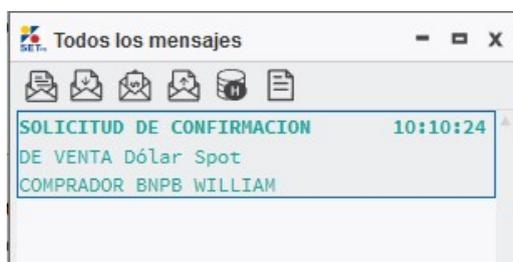
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 19 / 116

reportar el origen de la operación, por solicitud del Autorregulador del Mercado de Valores (AMV) y para mejorar la trazabilidad de los registros de operaciones del mercado Spot.

Una vez completados los campos obligatorios de la ventana de registro, se habilitará el botón “Aceptar” y de esta forma se enviará el registro a la contraparte.



Los registros en mención necesitan ser confirmados por la contraparte; es por esta razón que, al hacer clic en *Aceptar*, se envía un mensaje de manera automática de *Solicitud de Confirmación* de registro a la contraparte, donde se revela quién es el que desea realizar el registro.



Al hacer doble *clic* sobre el mensaje (imagen anterior), se abrirá la ventana de *Solicitudes de registro*. En esta ventana aparecerán todas las operaciones registradas y pendientes de confirmación; al

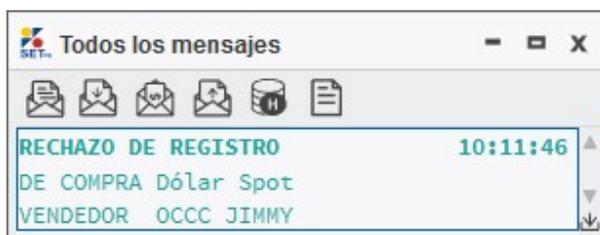
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 20 / 116

hacer clic derecho sobre una transacción, el usuario podrá escoger alguna de las dos opciones que se muestran a continuación:



Si el registro es rechazado, el Sistema enviará un mensaje automático al usuario que previamente envió la solicitud, advirtiéndole que su pedido fue rechazado por la contraparte.



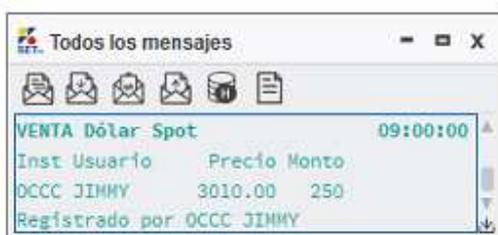
Ahora bien, si el registro es confirmado, se abrirá una ventana de *Confirmación de registro*, la cual permite elegir el usuario que confirma la operación. Se debe tener en cuenta que se debe dejar la opción de *Compensar por Cámara* vacía, si no se desea enviar la operación a compensar a la CCDC.



Al hacer clic en el botón de *Aceptar*, se envía un mensaje a las partes involucradas informándoles que la operación se encuentra en firme.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
		Administrar SET-FX
		Versión: 02
	MERCADO DÓLAR SPOT	Página: 21 / 116

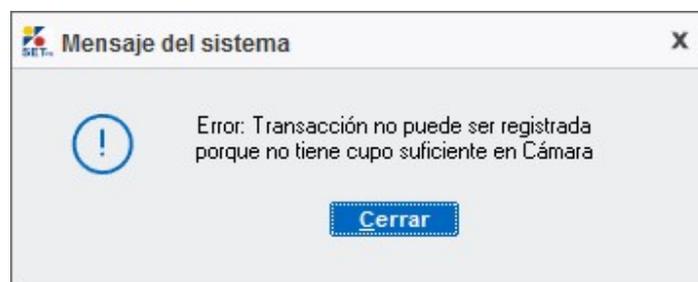


3.2. TRANSACCIONES POR REGISTRO COMPENSADAS MERCADO SPOT

Para que los registros sean compensados por la CCDC es obligatorio que exista cupo cámara entre las partes. Debido a esto, los siguientes escenarios se pueden presentar:

3.2.1. Solicitante Exige Registro por Cámara

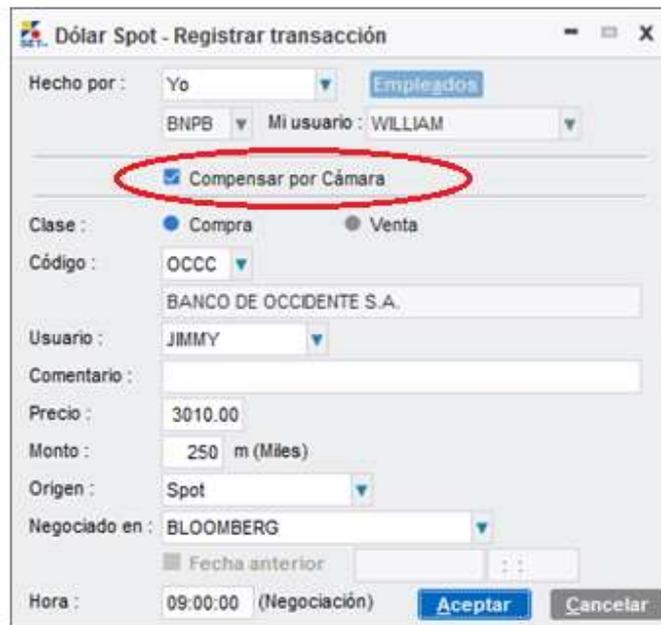
Si el solicitante del registro exige que se compense por CCDC, es necesario que este tenga suficiente cupo Cámara, de lo contrario se presenta un mensaje de error por falta de cupo:



De existir cupo cámara, al enviar la solicitud de registro, esta debe tener marcada la opción “compensar por cámara” en la ventana de registro, tal y como se evidencia en la siguiente imagen:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 22 / 116

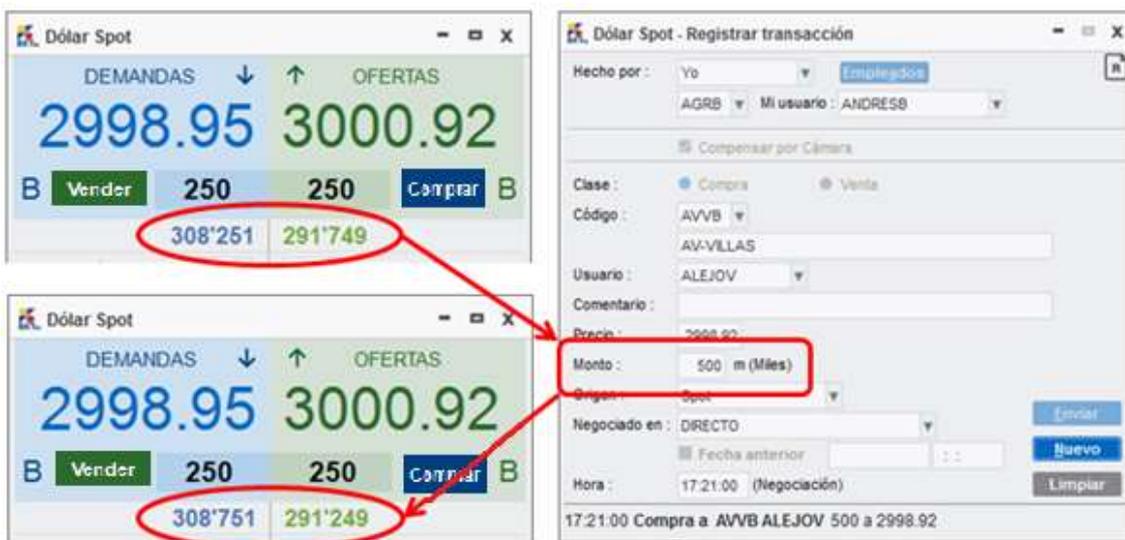


Al hacer clic en el botón *Aceptar*, se realiza una *Reserva de Cupo Cámara*, por el monto del registro solicitado. Es decir que, el cupo actual (antes de la solicitud), disminuye su valor en el monto que se desea registrar.

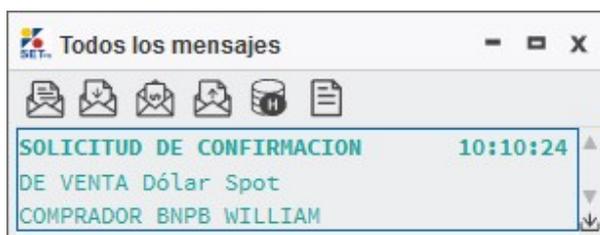
Al enviar la solicitud de registro, se disminuye el monto del registro del Cupo de Compra (rojo). El valor disminuido del cupo queda reservado hasta que la contraparte confirme el registro, que es cuando ya se ejecuta la transacción.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 23 / 116



Además de la reserva, se envía un mensaje *de Solicitud de Confirmación* de registro a la contraparte, dónde se revela quién es el que desea realizar el registro.



Con “doble clic” sobre el mensaje se presenta la ventana de Solicitudes de registro.

Si el registro es rechazado, se envía un mensaje al usuario que hizo la solicitud, en el que se advierte que su pedido fue rechazado por la contraparte. En este caso el cupo se regresa a los montos originales.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 24 / 116



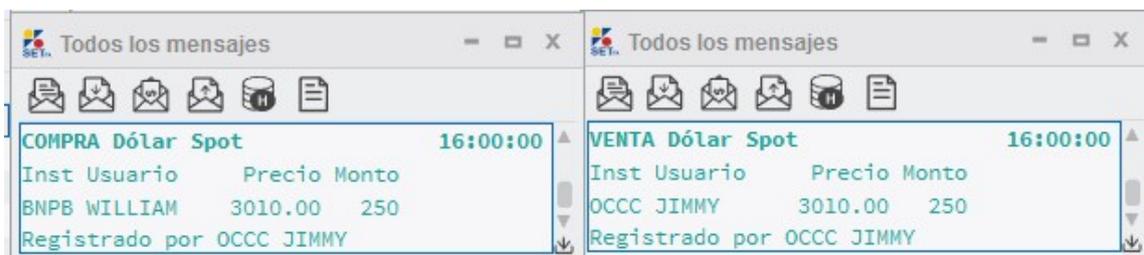
Si el registro es confirmado, se presenta la ventana de *Confirmación de Registro*, en la que se evidencia que el registro va a ser compensado por la Cámara. Nótese que la contraparte no tiene opción de deshabilitar la Compensación por Cámara.



Al hacer clic sobre el botón Aceptar, se envía un mensaje a las partes involucradas advirtiendo que se realizó la transacción:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 25 / 116



En caso de que el aceptante del registro no tuviese cupo Cámara, al momento de confirmar el registro se presenta el mensaje de error por falta de cupo Cámara:



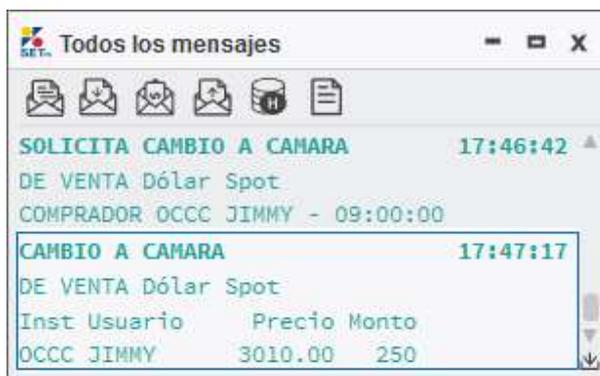
3.2.2. Aceptante Exige Registro por Cámara

Si el aceptante del registro, es decir quién recibe la solicitud, obliga a operar a través de la Cámara, es necesario que el solicitante haga una reconfirmación del registro, informando que la operación va por Cámara.

Al hacer clic sobre el botón de *Aceptar*, se envía al solicitante un mensaje de solicitud de cambio a cámara, tal y como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 26 / 116



Si el solicitante acepta, el registro se realiza y se compensa por Cámara. Si el solicitante no acepta, no se puede realizar la operación.

4. STOP LOSS

La herramienta de *Stop Loss* permite a los usuarios solicitar con anticipación una orden (de compra o venta) la cual se ejecuta cuando se cumpla una instrucción predefinida entre las contrapartes, que para este caso se denomina strike.

El *Stop Loss* es acordado entre una contraparte inicial que se denomina “solicitante” y una contraparte receptora, la cual se denomina “aceptante”. En caso de alcanzarse el nivel definido como strike, la operación se ejecutará entre las contrapartes de acuerdo con las condiciones definidas inicialmente. El botón de acceso para ingresar una orden de *Stop Loss* se encuentra

disponible en la barra principal de botones del sistema en el siguiente ícono:



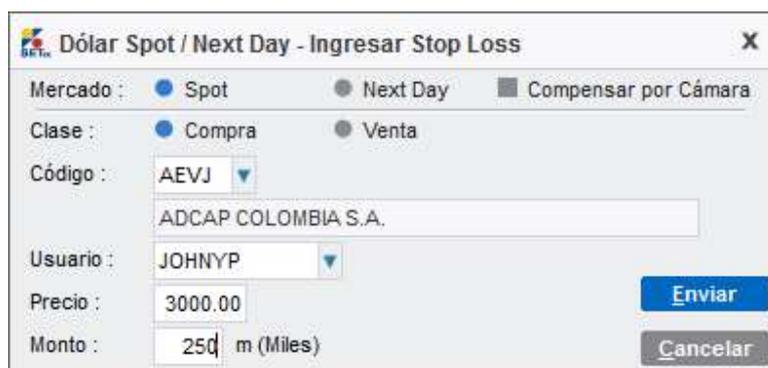
Al ingresar a esta opción el Sistema muestra la ventana de ingreso de la orden *Stop Loss* como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 27 / 116



La entidad debe especificar el mercado, compra/venta, código de contraparte, usuario, precio y monto, tal y como se muestra a continuación:



En el momento de enviar el “pre-registro” el Sistema debe verificar:

- Si es una compra, que el precio especificado sea mayor al último precio cerrado en el mercado.
- Si es una venta, que el precio especificado sea menor al último precio cerrado en el mercado.

Asimismo, al enviar la solicitud el Sistema valida los cupos bilaterales y los cupos Cámara, los cuales son reservados al momento de enviar la solicitud.

Si estas condiciones no están cumplidas, no se enviará la solicitud y se generará el siguiente mensaje de alerta:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 28 / 116



Por otra parte, si la orden es ingresada correctamente, se envía a la contraparte, que recibirá una notificación denominada *Solicitud de Confirmación* a través del sistema de mensajería “chat”, tal y como lo muestran las siguientes imágenes:



Una vez el receptor del *Stop Loss* hace “doble clic” sobre el mensaje de solicitud de confirmación, el sistema desplegará una ventana para la confirmación del registro con los datos ingresados inicialmente por el solicitante. El precio por defecto del *strike* siempre será el mismo precio de la orden.

La ejecución de la orden dependerá del precio *strike* y de si esta es de compra o venta.

En el caso de la ventana de ejemplo que se muestra a continuación, el precio de la orden es de 3.000,00 y el precio *strike* es el mismo. Se trata de una orden *Stop Loss de compra*, lo cual quiere decir que se ejecutará cuando en el mercado se cierre alguna transacción por un precio de 3.000,00 o superior.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 29 / 116



Una vez se confirme la orden por parte de la Entidad aceptante y solicitante las contrapartes reciben un mensaje de confirmación del mismo. De igual manera si se rechaza el *Stop Loss* también aparecerá un mensaje indicándolo en la ventana de mensajería “chat”, como se muestra a continuación:

```

CONFIRMA STOP LOSS                                08:10:53
DE VENTA Stop Loss : Dólar Spot
Monto Precio Strike
500 3001.00 3001.01
COMPRADOR JPMB ANDREA

```

En la ventana de *Stop Loss* se visualizarán los estados:

Vigente: Si el *Stop Loss* sigue en curso

Rechazado: Si no fue aceptado por la contraparte

Desactivado: Cuando el *Stop Loss* ya no se encuentra activo.

Solicitado: Si no ha sido confirmado por la contraparte

Recibe Strike: Cuando se modifica el precio strike de la contraparte

Desactivar Stop Loss: Si se envía solicitud de desactivación

Confirmar desactivación: Cuando la contraparte envía la solicitud de desactivación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 30 / 116



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
08:02:21	Spot	Compra	3000.50	3001.50	250	JPMB ANDREA	P	Vigente	
08:04:03	Spot	Compra	3001.50		250	JPMB ANDREA	P	Rechazado	
08:04:48	Spot	Venta	3000.04	3000.03	500	JPMB ANDREA	P	Desactivado	C
08:05:13	Spot	Venta	3000.03		1000	JPMB ANGELA	P	Solicitado	
08:06:39	Spot	Venta	3000.02	3000.01	750	JPMB ANDREA	P	Recibe Strike	C
08:08:09	Spot	Compra	3001.07	3001.15	250	JPMB ANDREA	P	Desactivar Stop Loss	D
08:10:28	Spot	Venta	3001.00	3001.01	500	JPMB ANDREA	P	Confirmar desactivación	C D

Los *Stop Loss* calzados se identifican en el blotter de operación en con la letra “L” en la columna R:



Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
18:00:18	JIMMY	Compra	3030.25	500	BNPB	A					C
18:00:18	JIMMY	Compra	3030.30	500	BNPB	A					C
18:00:18	JIMMY	Compra	3030.35	500	BNPB	A					C
18:00:18	JIMMY	Compra	3030.00	250	BNPB	A	L				

Total compras sucursal: 5'000,000 3027.14
Total ventas sucursal:

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
OCC:	4'750,000				4'750,000
Cupo:	-9,999'999,990		-9,999'999,990		

Estado de transferencias: Compensación pendiente

Si la contraparte no está en línea en el momento de enviar la solicitud, en el PU solicitante queda en estado ‘Solicitado’, y cuando se conecta el PU, a la contraparte le aparece la solicitud.

Para cambiar los estados, el usuario sólo debe hacer “clic derecho” sobre la orden:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 31 / 116

Dólar Spot / Next Day - Stop Loss

Ingresar

Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
08:02:21	Spot	Compra	3000.50	3001.50	250	JPMB ANDREA	P	Vigente	
08:04:03	Spot	Compra	3001.50		250	JPMB ANDREA	P	Rechazado	
08:04:48	Spot	Venta	3000.04	3000.03	500	JPMB ANDREA	P	Desactivado	
08:05:13	Spot	Venta	3000.03		1000	JPMB ANGELA	P	Solicitado	
08:06:39	Spot	Venta	3000.02	3000.01	750	JPMB ANDREA	P	Recibe Strike	C
08:08:09	Spot	Compra	3001.07	3001.15	250	JPMB ANDREA	P	Desactivar Stop Loss	D
08:10:28	Spot	Venta	3001.00	3001.01	500	JPMB ANDREA	P	Confirmar desactivación	C D

Detalle

Solicitar desactivar Stop Loss

Dólar Spot / Next Day - Stop Loss

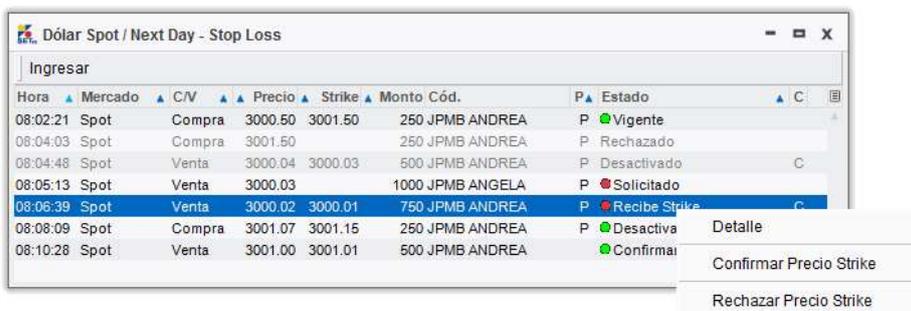
Ingresar

Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
08:02:21	Spot	Compra	3000.50	3001.50	250	JPMB ANDREA	P	Vigente	
08:04:03	Spot	Compra	3001.50		250	JPMB ANDREA	P	Rechazado	
08:04:48	Spot	Venta	3000.04	3000.03	500	JPMB ANDREA	P	Desactivado	
08:05:13	Spot	Venta	3000.03		1000	JPMB ANGELA	P	Solicitado	
08:06:39	Spot	Venta	3000.02	3000.01	750	JPMB ANDREA	P	Recibe Strike	C
08:08:09	Spot	Compra	3001.07	3001.15	250	JPMB ANDREA	P	Desactivar Stop Loss	D
08:10:28	Spot	Venta	3001.00	3001.01	500	JPMB ANDREA	P	Confirmar desactivación	C D

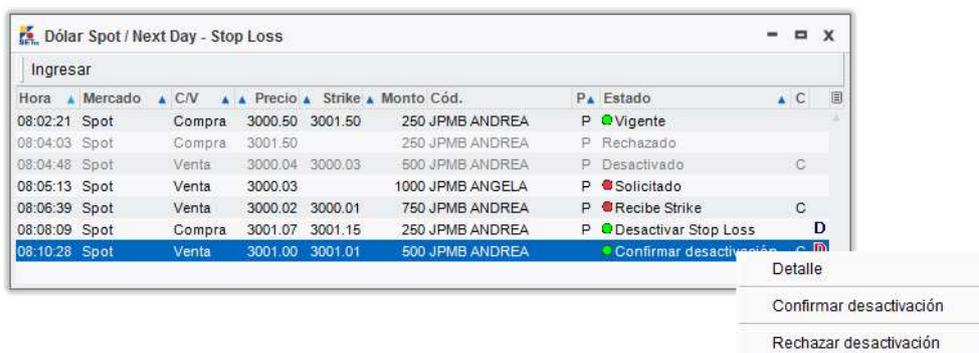
Detalle

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 32 / 116



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado
08:02:21	Spot	Compra	3000.50	3001.50	250	JPMB ANDREA	P	Vigente
08:04:03	Spot	Compra	3001.50		250	JPMB ANDREA	P	Rechazado
08:04:48	Spot	Venta	3000.04	3000.03	500	JPMB ANDREA	P	Desactivado
08:05:13	Spot	Venta	3000.03		1000	JPMB ANGELA	P	Solicitado
08:06:39	Spot	Venta	3000.02	3000.01	750	JPMB ANDREA	P	Recibe Strike
08:08:09	Spot	Compra	3001.07	3001.15	250	JPMB ANDREA	P	Desactiva
08:10:28	Spot	Venta	3001.00	3001.01	500	JPMB ANDREA		Confirma



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado
08:02:21	Spot	Compra	3000.50	3001.50	250	JPMB ANDREA	P	Vigente
08:04:03	Spot	Compra	3001.50		250	JPMB ANDREA	P	Rechazado
08:04:48	Spot	Venta	3000.04	3000.03	500	JPMB ANDREA	P	Desactivado
08:05:13	Spot	Venta	3000.03		1000	JPMB ANGELA	P	Solicitado
08:06:39	Spot	Venta	3000.02	3000.01	750	JPMB ANDREA	P	Recibe Strike
08:08:09	Spot	Compra	3001.07	3001.15	250	JPMB ANDREA	P	Desactivar Stop Loss
08:10:28	Spot	Venta	3001.00	3001.01	500	JPMB ANDREA		Confirmar desactivación

El usuario puede rechazar el *Stop Loss* señalando la operación, escogiendo la opción *Rechazar Stop Loss*, lo que hace que se genere un mensaje de rechazo en la bitácora de mensajes, el cual se desplegará de la siguiente forma:

```

CONFIRMA STOP LOSS 08:10:53
DE VENTA Stop Loss : Dólar Spot
Monto Precio Strike
500 3001.00 3001.01
COMPRADOR JPMB ANDREA
RECHAZA DESACTIVACION 08:11:05
DE VENTA Stop Loss : Dólar Spot
Monto Precio Strike
500 3001.00 3001.01
COMPRADOR JPMB ANDREA

```

09:14:40	Spot	Venta	2960.00	5000	DVNB ALEJANDRA	Rechazado	C
----------	------	-------	---------	------	----------------	-----------	---

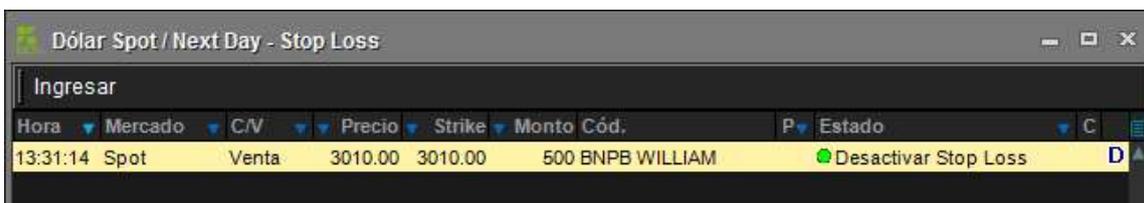
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 33 / 116

La contraparte debe confirmar la desactivación del *Stop Loss*, como se muestra en la siguiente ventana:



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
13:31:14	Spot	Compra	3010.00	3010.00	500	OCCC JIMMY	P	Confirmar desactivación	D

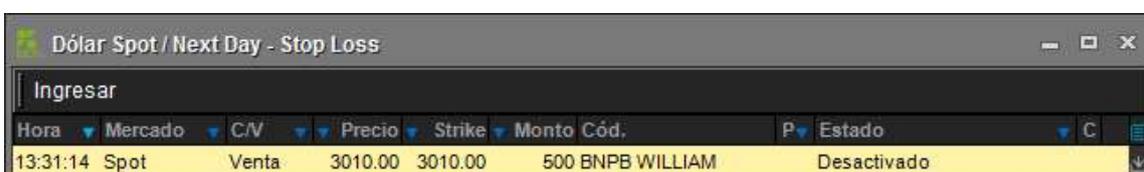


Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
13:31:14	Spot	Venta	3010.00	3010.00	500	BNPB WILLIAM		Desactivar Stop Loss	D



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
13:31:14	Spot	Compra	3010.00	3010.00	500	OCCC JIMMY	P	Confirmar desactivación	D

- Detalle
- Confirmar desactivación
- Rechazar desactivación



Hora	Mercado	C/V	Precio	Strike	Monto	Cód.	P	Estado	C
13:31:14	Spot	Venta	3010.00	3010.00	500	BNPB WILLIAM		Desactivado	

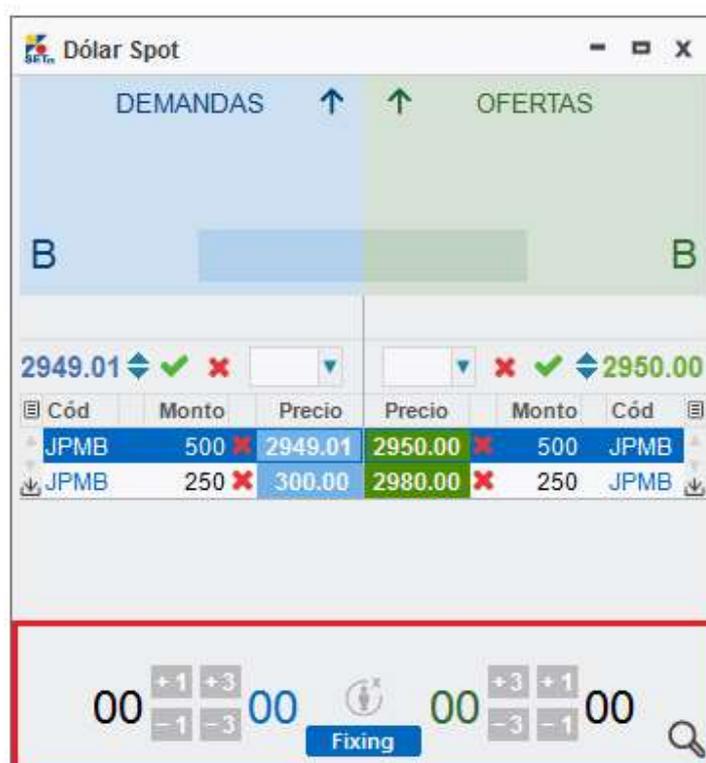
5. FIXING (MATCHING)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 34 / 116

La Herramienta Matching o Fixing, es un mecanismo de negociación entre IMC's, en el que cada Entidad podrá lanzar posturas de demanda u oferta sobre un precio determinado, de modo que otras contrapartes puedan comprar o vender sobre ese mismo precio.

Las Entidades con acceso a esta herramienta la podrán visualizar en la parte inferior de la tabla de negociación.

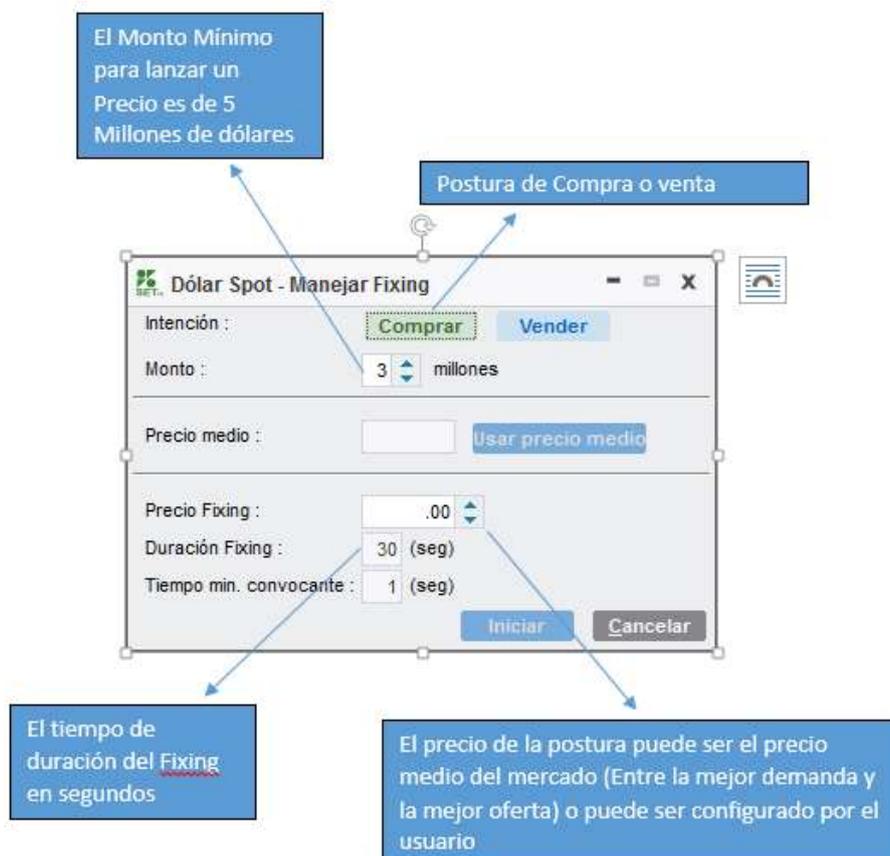


Para lanzar una postura utilizando esta herramienta, los usuarios con acceso a esta deberán hacer clic sobre el botón Fixing  de la barra de herramientas del Sistema:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 35 / 116



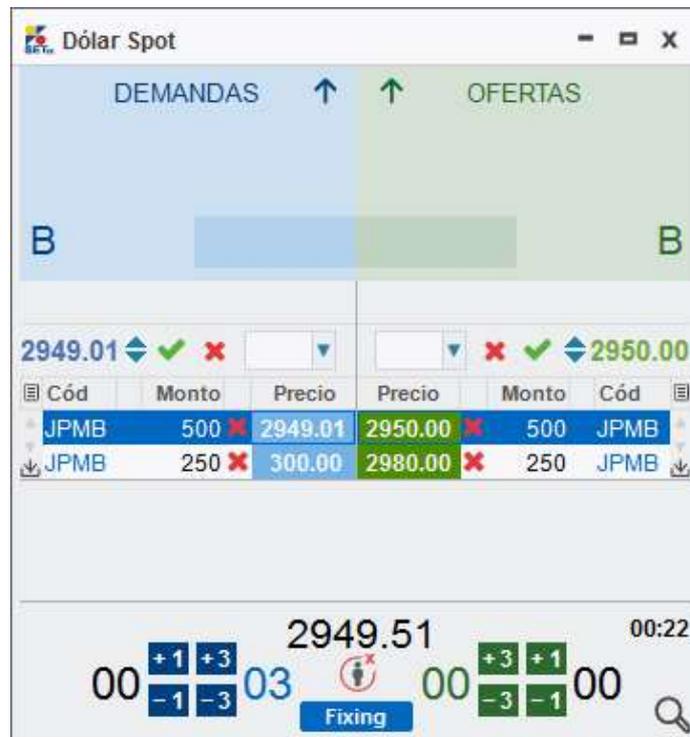
Para lanzar el Fixing, se debe hacer clic en el botón Iniciar. Una vez lanzado el precio, este aparece en la parte inferior de la tabla Spot y las Entidades lo visualizan como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 36 / 116

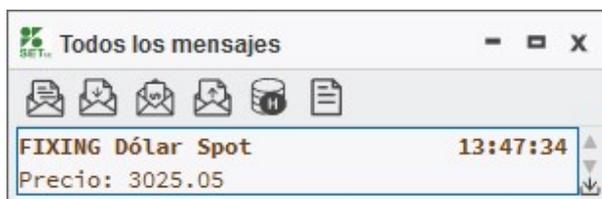


En la bitácora mensajes de todos los usuarios le llegará un mensaje con el inicio del Fixing. Adicional a esto, el Sistema emitirá una alerta sonora indicando el inicio del Fixing.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 37 / 116



Si una contraparte está interesada en participar del precio Fixing deberá utilizar los botones de demanda o de oferta, estableciendo el monto con el cual desea participar sobre el precio resaltado. El monto puede ser configurado hacia arriba o hacia abajo en múltiplos de 1 millón o de 3 millones de acuerdo con los botones de la herramienta:



Las cifras en color azul y verde, al lado de los botones de configuración del monto indican la cantidad demandada u ofertada por cada usuario sobre el precio resaltado.



El botón de emergencia sirve para retirar cualquier monto de demanda u oferta del usuario sobre el precio Fixing:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 38 / 116

El botón de consulta  sirve para visualizar la historia de precios Fixing lanzados (resumen por fecha o por mes):



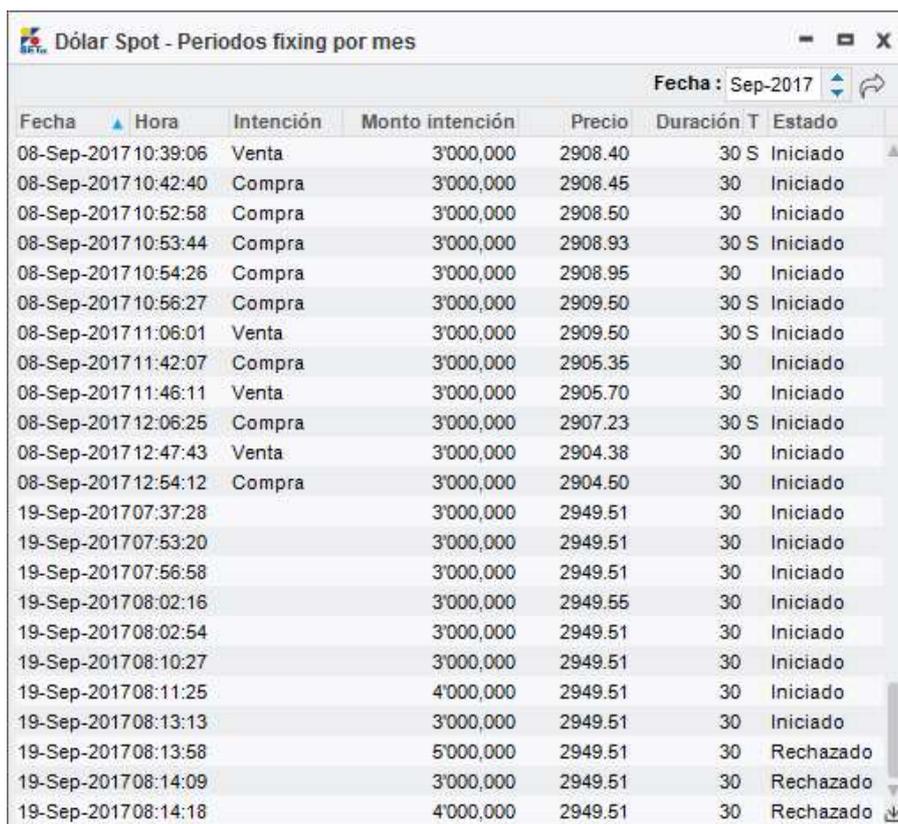
Cuando se selecciona la opción de fecha, se abrirá la siguiente ventana:

Fecha: 19/09/2017					
Hora	Intención	Monto intención	Precio	Duración T	Estado
07:37:28		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
07:53:20		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
07:56:58		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
08:02:16		3'000,000	2949.55	30	Iniciado
08:02:54		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
08:10:27		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
08:11:25		4'000,000	2949.51	30	Iniciado
08:13:13		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
08:13:58		5'000,000	2949.51	30	Rechazado
08:14:09		3'000,000	2949.51	30	Rechazado
08:14:18		4'000,000	2949.51	30	Rechazado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 39 / 116

La opción por mes abre la siguiente ventana:

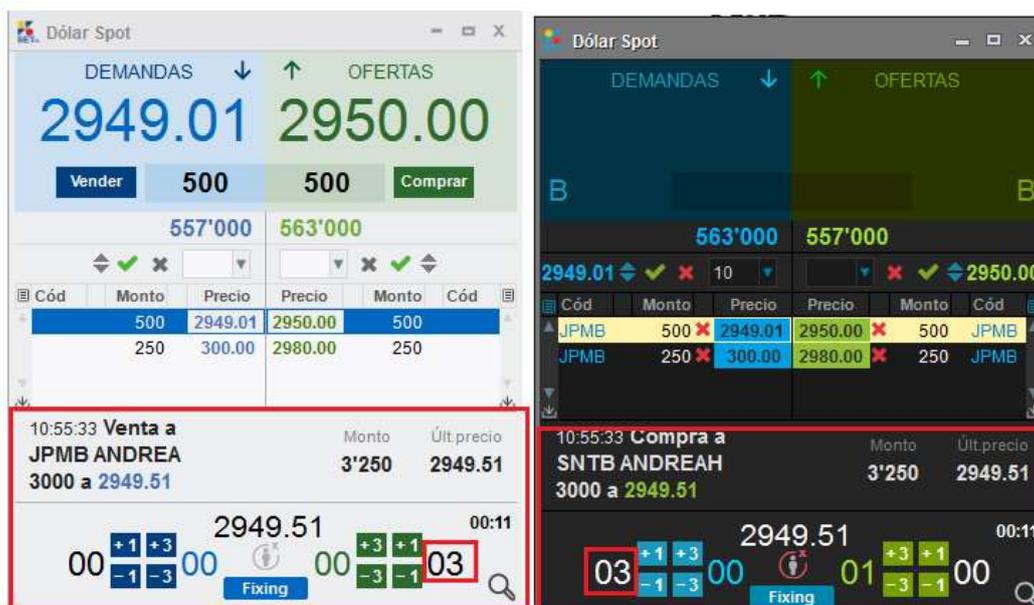


Dólar Spot - Periodos fixing por mes						
						Fecha : Sep-2017
Fecha	Hora	Intención	Monto intención	Precio	Duración T	Estado
08-Sep-2017	10:39:06	Venta	3'000,000	2908.40	30 S	Iniciado
08-Sep-2017	10:42:40	Compra	3'000,000	2908.45	30	Iniciado
08-Sep-2017	10:52:58	Compra	3'000,000	2908.50	30	Iniciado
08-Sep-2017	10:53:44	Compra	3'000,000	2908.93	30 S	Iniciado
08-Sep-2017	10:54:26	Compra	3'000,000	2908.95	30	Iniciado
08-Sep-2017	10:56:27	Compra	3'000,000	2909.50	30 S	Iniciado
08-Sep-2017	11:06:01	Venta	3'000,000	2909.50	30 S	Iniciado
08-Sep-2017	11:42:07	Compra	3'000,000	2905.35	30	Iniciado
08-Sep-2017	11:46:11	Venta	3'000,000	2905.70	30	Iniciado
08-Sep-2017	12:06:25	Compra	3'000,000	2907.23	30 S	Iniciado
08-Sep-2017	12:47:43	Venta	3'000,000	2904.38	30	Iniciado
08-Sep-2017	12:54:12	Compra	3'000,000	2904.50	30	Iniciado
19-Sep-2017	07:37:28		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	07:53:20		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	07:56:58		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:02:16		3'000,000	2949.55	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:02:54		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:10:27		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:11:25		4'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:13:13		3'000,000	2949.51	30	Iniciado
19-Sep-2017	08:13:58		5'000,000	2949.51	30	Rechazado
19-Sep-2017	08:14:09		3'000,000	2949.51	30	Rechazado
19-Sep-2017	08:14:18		4'000,000	2949.51	30	Rechazado

Por otra parte las cifras de monto en negro (al lado de los botones de subir o bajar monto) indican el monto operado. La siguiente imagen muestra las ventanas de *Dólar Spot* de un Fixing operado por dos entidades distintas:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 40 / 116



Una vez el Sistema proceda a calzar una operación Spot al precio Fixing, esta será reflejada en el *blotter* de las contrapartes como se muestra a continuación:

Dólar Spot - Transacciones									
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	A	R	E	Un
11:53:25	WILLIAM	Venta		3000.70	250	OCCC	A		
14:10:32	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
14:10:32	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
14:10:34	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
14:10:36	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC	A		FP C
14:10:37	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC	A		FP C
14:10:37	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC	A		FP C
14:10:41	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
14:10:41	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
14:10:41	WILLIAM	Compra		3005.00	1000	OCCC			FP C
				Total compras sucursal:	9'000,000	3005.00			
				Total ventas sucursal:	250,000	3000.70			
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos				
BNP:	9'000,000				9'000,000				
Cupo:	891'000,000		909'000,000		Detalle Pérd/Gan				
Estado de transferencias: Compensación pendiente									

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 41 / 116

En la columna “Ori” de origen de la operación, las operaciones realizadas a través de la herramienta Fixing, se identificarán con las letras “FP”.

Es de anotar que el calce de las operaciones mediante la herramienta Fixing, está sujeta a la disponibilidad de cupos bilaterales entre las contrapartes, así como la disponibilidad de cupos multilaterales en la Cámara de Compensación de Divisas.

Así mismo, las operaciones realizadas a través de la herramienta Fixing, son tenidas en cuenta para la generación de estadísticas en el mercado Spot.

Por último, de acuerdo con las definiciones realizadas por el Comité Técnico Cambiario del sistema SET-FX, se estableció que cada Entidad podrá lanzar como máximo ocho (8) precios Fixing al día (susceptible a ser cambiado por el Comité Cambiario).

6. CUPOS

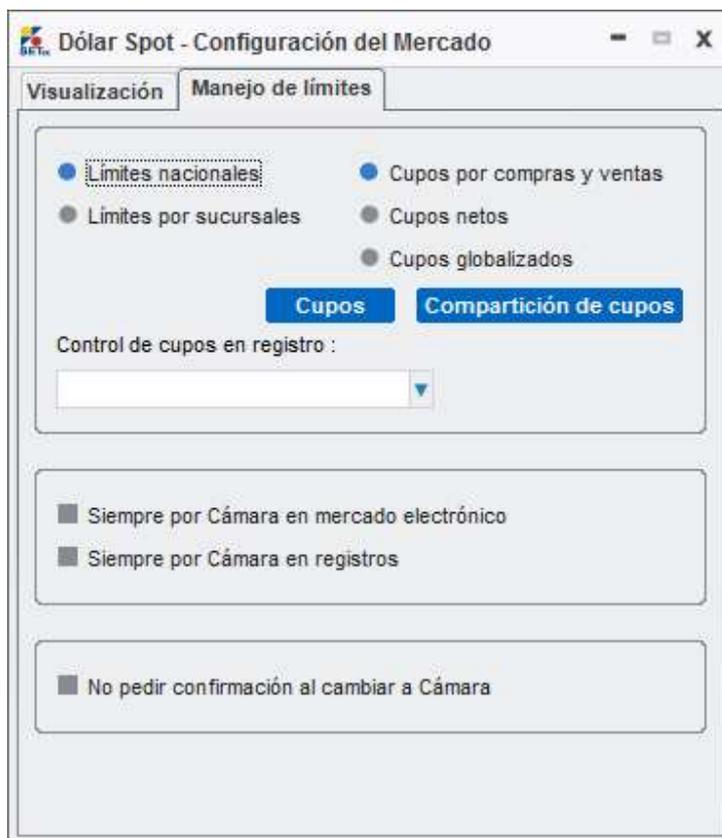
Para negociar con una contraparte, lo primero que se debe hacer es configurar los cupos y límites.



Para administrar los Límites y Cupos, el usuario puede acceder desde la barra de botones del mercado spot al botón de *Configuración del Mercado* . A continuación se abrirá una ventana, con dos pestañas; al ingresar a la pestaña de *Manejo de Límites*, aparecerán las siguientes opciones por omisión:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 42 / 116



Existen dos clases:

- ✓ Los cupos bilaterales
- ✓ Los cupos Cámara, los cuales son configurados por la Cámara de Compensación de Divisas (CCDC).

6.1. CUPOS BILATERALES

Los Cupos Bilaterales son administrados y configurados por cada Entidad, y corresponden al volumen total de negociación permitido con cada afiliado al Sistema SET-FX. Estos cupos sólo se

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 43 / 116

pueden configurar antes o después de cada mercado. Para efectos del mercado Spot, esto se puede realizar antes de las 8:00 a.m. o después de la 1:00 p.m.

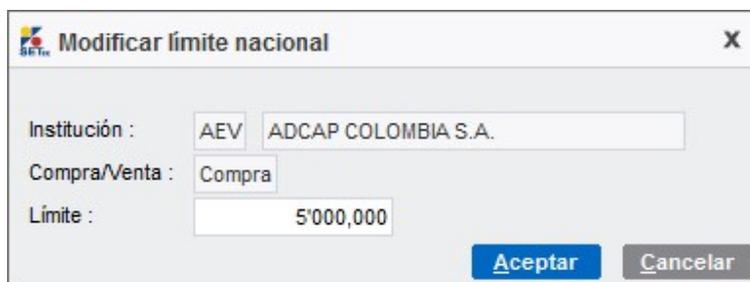
La configuración de los cupos y límites es responsabilidad de cada afiliado y sólo la puede realizar el funcionario que cuente con los privilegios y las autorizaciones necesarias para la administración de cupos.

6.1.1. Límites nacionales

Indica que los cupos y límites se controlarán desde la sucursal principal (nacional) y todas las otras sucursales de la institución tendrán que trabajar con los valores que ingrese la principal.

Para asignar o modificar estos cupos, es necesario hacer clic en la opción “Cupos”, de la pestaña “Manejo de límites”, y posteriormente elegir la opción “Detalle” haciendo clic derecho sobre la entidad a la que se desea asignar o modificar un límite.

Luego, se debe dar clic derecho sobre el límite que se desee modificar, y elegir la opción “Modificar Límite”.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 44 / 116

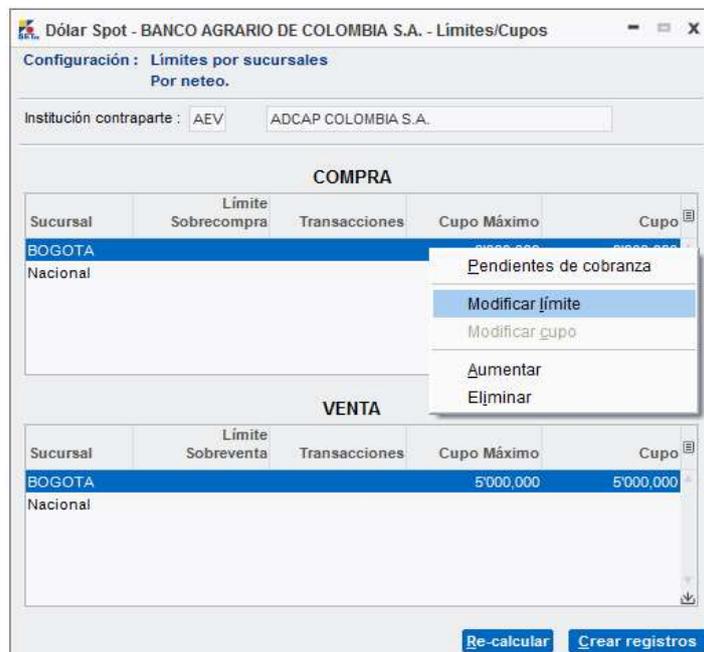
6.1.2. Límites por sucursales

Indica que los cupos y límites se controlarán por cada sucursal, es decir que cada una puede ingresar su propio monto a negociar.

Para establecer el límite de una sucursal, es necesario hacer clic derecho sobre la entidad en la ventana de “Límites/Cupos”, y elegir la opción “Detalle”.

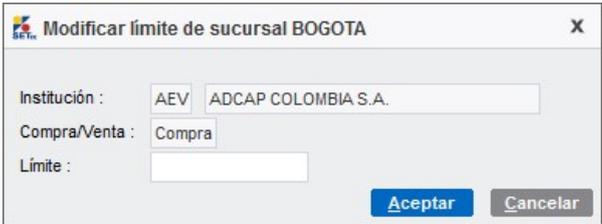


Posteriormente, se debe hacer clic derecho sobre la sucursal a la que se le desea asignar cupo en compra o en venta, y elegir la opción “Modificar Límite”.

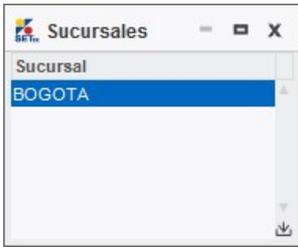


Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 45 / 116



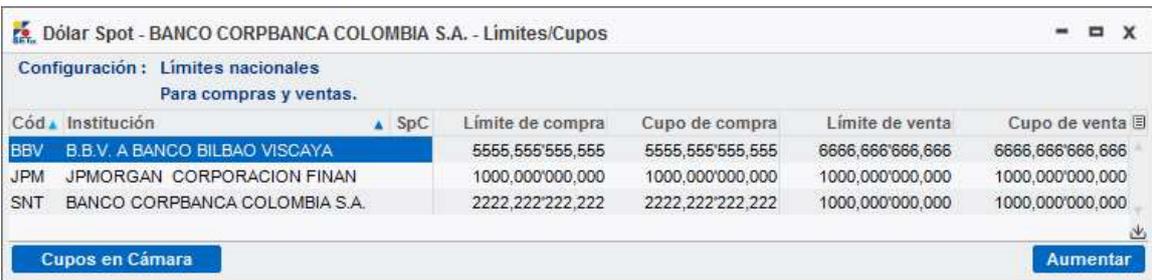
Si se desea agregar una sucursal, se debe seleccionar la opción “Aumentar” y seleccionar la nueva sucursal,



Junto a la configuración de Límites, se debe configurar la administración de Cupos.

6.1.3. Cupos por compras y ventas

Permite ingresar un monto de cupo para compras y uno para ventas de manera independiente. De acuerdo a la transacción que se realice (compra o venta), se afectará la columna respectiva.



Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA		5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
JPM	JPMORGAN CORPORACION FINAN		1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 46 / 116

Dólar Spot - BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Institución contraparte: AEV ADCAP COLOMBIA S.A.

COMPRA

Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA			3'000,000	3'000,000
Nacional				

VENTA

Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA			5'000,000	5'000,000
Nacional				

[Crear registros](#)

6.1.4. Cupos netos

Permite ingresar un monto de cupo para compras y uno para ventas. Si se realiza una compra, el monto que se disminuye en las compras, se aumenta en las ventas. Si se realiza una venta, el monto que se disminuye en las ventas, se aumenta en las compras.

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Por neteo.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA		5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
JPM	JPMORGAN CORPORACION FINAN		1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

[Cupos en Cámara](#)

[Aumentar](#)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 47 / 116

Dólar Spot - BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Por neteo.

Institución contraparte:

COMPRA

Sucursal	Límite Sobrecompra	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA			3'000,000	3'000,000
Nacional				

VENTA

Sucursal	Límite Sobreventa	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA			5'000,000	5'000,000
Nacional				

6.1.5. Cupos globalizados

Permite ingresar un único monto global de cupos. Sin importar que tipo de transacción sea realizada (compra o venta), el cupo se afectará por el valor nominal de la transacción.

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Globalizados.

Cód	Institución	SpC	Límite	Cupo
BCL	BANCOLOMBIA S.A.		9999,999'999,999	9999,999'999,999
JPM	JPMORGAN CORPORACION FINAN		9999,999'999,999	9999,999'999,999

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 48 / 116



Si los cupos son nacionales, cuando dos usuarios de diferentes sucursales hacen una transacción, se reduce por cada uno el monto negociado; es decir, si cada usuario negoció USD 250.000, se debitarán USD 500.000 del cupo bilateral.

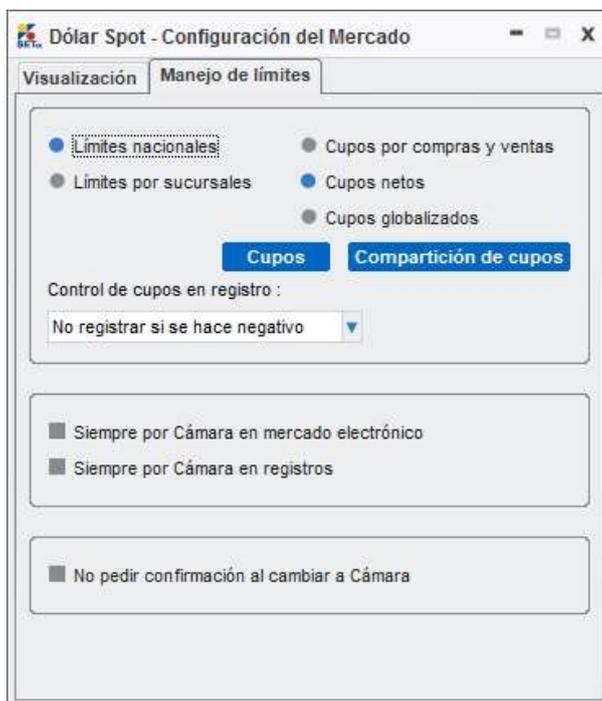
6.1.6. Compartición de cupos

Esta opción permite compartir cupos entre dos mercados determinados por el usuario, para que al realizar una transacción en cualquiera de estos, se afecte el cupo en ambos mercados de acuerdo a un factor configurable.

El Acceso a la ventana de “Compartición de cupos”, se encuentra en la ventana de “Configuración de Mercado”, En la opción “Cupos compartidos”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 49 / 116



En este ejemplo, el mercado Spot utiliza los cupos del mercado Next Day. Nótese que en el mercado Spot se muestra (Comparte con: Dólar Next Day):



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 50 / 116

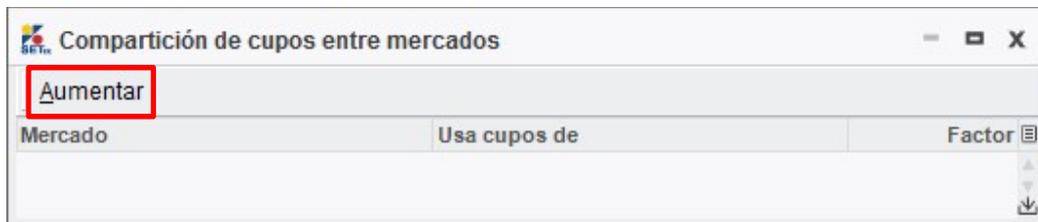


Mercado	Usa cupos de	Factor
Dólar Spot	Dólar Next Day	3000.000000

Para compartir cupos entre mercados, es necesario que los dos mercados tengan la misma configuración, de lo contrario se presenta el siguiente mensaje de error.

Estos mercados tienen formas diferentes de manejar límites/cupos

El factor de compartición de cupos indica que por cada dólar que se negocie/registre de una operación en el mercado que comparte los cupos, el cupo se afectará por el porcentaje definido.



Mercado	Usa cupos de	Factor
---------	--------------	--------



Mercado : CO Dólar Next Day
 Usa cupos de : CO Dólar Spot
 Factor de conversión : 1.000000



Mercado	Usa cupos de	Factor
Dólar Next Day	Dólar Spot	1.000000

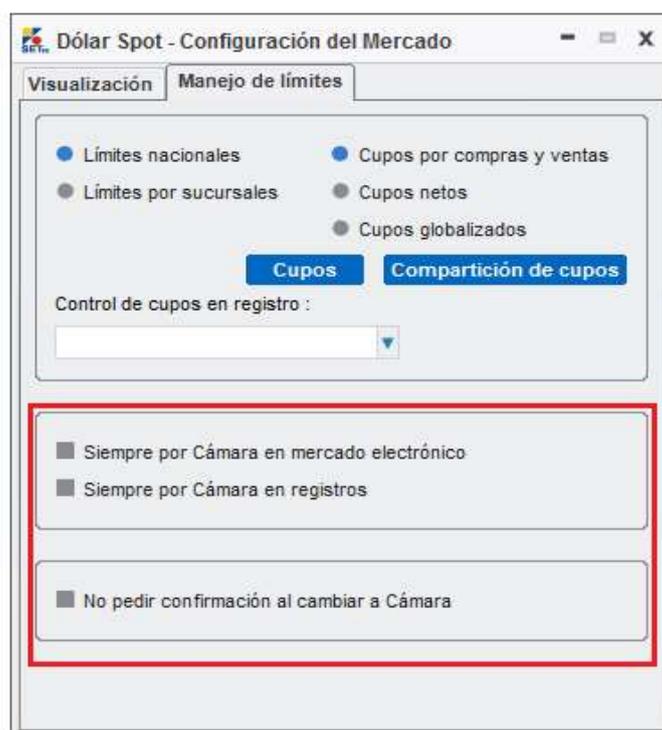
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 51 / 116

6.2. CUPOS CÁMARA

Los cupos cámara son administrados y configurados por la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC). Estos cupos podrán ser ajustados en horario de mercado, siempre de manera incremental con relación a la asignación de garantías. La Cámara de Compensación de Divisas de Colombia es la única que puede modificar dichos cupos y lo hará de acuerdo con las garantías que aporte cada Entidad.

Si una Entidad posee garantías en la CCDC, aparecerán dos opciones nuevas en la configuración de los cupos:

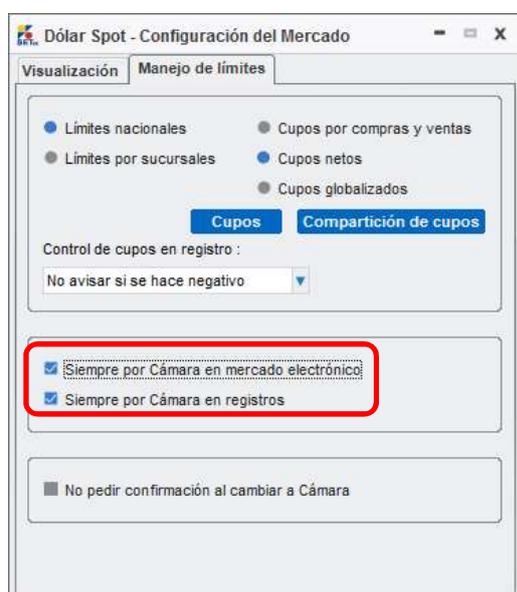


El aplicativo brinda la posibilidad de obligar a que todas las operaciones se compensen a través de la CCDC. En caso de que alguna contraparte haga uso de esta funcionalidad, el indicador de cupo se visualizará en rojo para aquellas contrapartes que no tengan cupos en CCDC.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 52 / 116

En la ventana siguiente se puede visualizar que aquellas posturas en donde el precio aparece en color rojo son aquellas en donde o bien no se tiene cupo bilateral suficiente o bien no se tiene cupo multilateral con la CCDC.



No obstante, aquellas Entidades que aun teniendo cupos suficientes en la CCDC no elijan esta posibilidad, podrán cerrar operaciones con contrapartes que no tengan garantías en la CCDC. En este caso sólo se afectarán los cupos bilaterales de las Entidades.

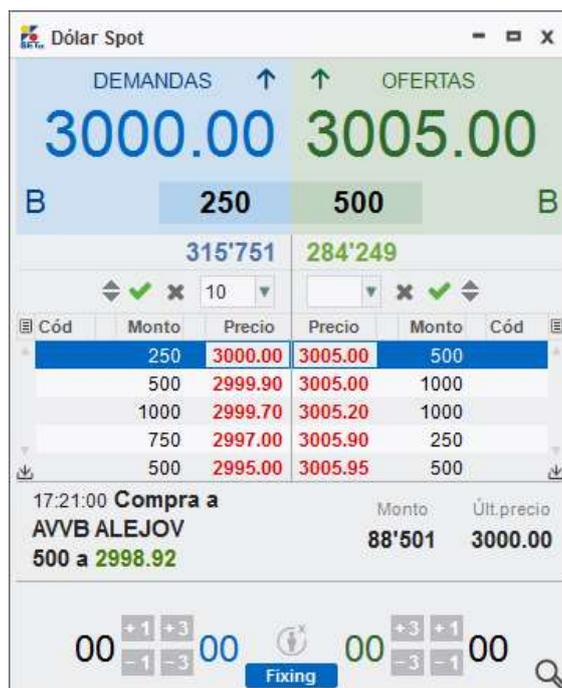
6.2.1. Opción “Siempre por cámara en mercado electrónico”

Al seleccionar esta opción, se indica al Sistema que todas las operaciones por tabla que se realicen deben ser compensadas por CCDC, y que ese afiliado no acepta posturas de Entidades que no tengan cupo Cámara. Esto quiere decir que las puntas se verán de color rojo cuando el postulante no tiene cupo cámara, aun cuando se tenga cupo bilateral. En este caso cuando ambas contrapartes tengan cupo suficiente en CCDC sus posturas se visualizarán en color azul / verde según sean de demanda u oferta respectivamente como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 53 / 116

Por el contrario, cuando alguna de las contrapartes o ambas no tengan cupo multilateral o bilateral suficiente, sus posturas se visualizarán en color rojo como se muestra en la siguiente imagen.



6.2.2. Opción: “Siempre por Cámara en registro”

Tiene la misma estructura de funcionamiento que “*Siempre por Cámara en mercado electrónico*”, ahora aplicado en las operaciones de tipo REGISTRO.

Si no se selecciona ninguna de las dos opciones, la Entidad podrá cerrar operaciones de ambas formas, compensando por CCDC y de la manera tradicional. En esta opción el Sistema le dará prioridad a la compensación por CCDC, siempre y cuando las contrapartes que intervienen en la operación tengan cupo multilateral suficiente.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 54 / 116

NOTA 1: Siempre que las contrapartes que intervienen en el cierre de una transacción tengan cupos multilaterales suficientes, el Sistema dará prioridad al calce de la operación por compensación en CCDC.

NOTA 2: El mercado FIX toma la configuración de los dos mercados: Spot y Next Day. Cuando se realiza una operación FIX X1, X2, X3, el Sistema reserva los cupos en mercado Next Day y al enviar a cumplimiento la operación, libera los cupos Next Day y reserva los cupos Spot. Para operaciones FIX X0 solo reserva el cupo en mercado Spot.

6.3. CONTROL DE CUPOS PARA REGISTROS

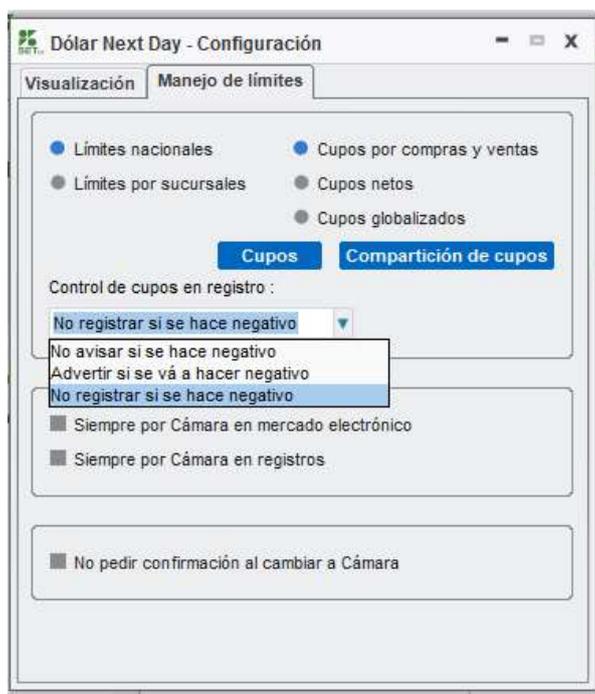
En las ventanas de mantenimiento de cupos de los usuarios, bajo la opción *Control de Cupos en Registro* existen tres opciones para configurar el comportamiento de los cupos con respecto a los registros.

A continuación se enumeran las diferentes opciones de configuración y su significado:

- **No avisar si se hace negativo:** Bajo esta opción, cuando se haya agotado el cupo bilateral con alguna contraparte, se podrán seguir realizando registros y el cupo se podrá volver negativo sin generar notificación alguna.
- **Advertir si se hace negativo:** En este caso el Sistema podrá aceptar registros aún con el cupo bilateral agotado, pero enviará una notificación al usuario en el momento de realizar el registro, avisando que los cupos se van a volver negativos.
- **No registrar si se hace negativo:** Bajo esta opción el Sistema no permitirá registrar más operaciones una vez el cupo bilateral se haya agotado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 55 / 116



No hay ninguna opción seleccionada por defecto y por esta razón el Sistema no envía notificaciones cuando el cupo se va a hacer negativo, a menos que estas estén configuradas con se describió arriba.

6.4. VENTANA DE LÍMITES/CUPOS

Para ingresar a la ventana de configuración de Límites/Cupos existen dos opciones:

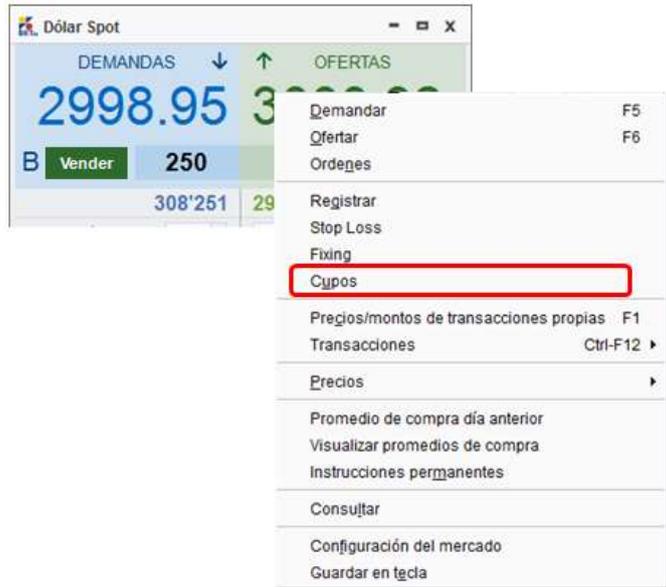
La primera es haciendo clic en el botón “Cupos”: , en la parte superior de la barra de herramientas:



La segunda opción es dar click derecho sobre los mejores precios de demanda y oferta en la pantalla transaccional, y elegir la opción “Cupos”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 56 / 116



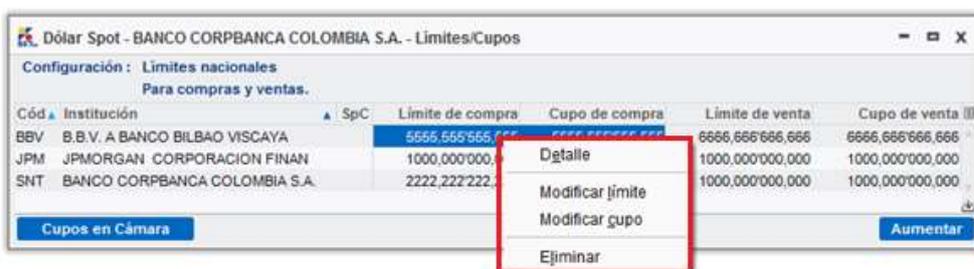
En cualquiera de los dos casos aparecerá la siguiente ventana:

Labels for the configuration window:

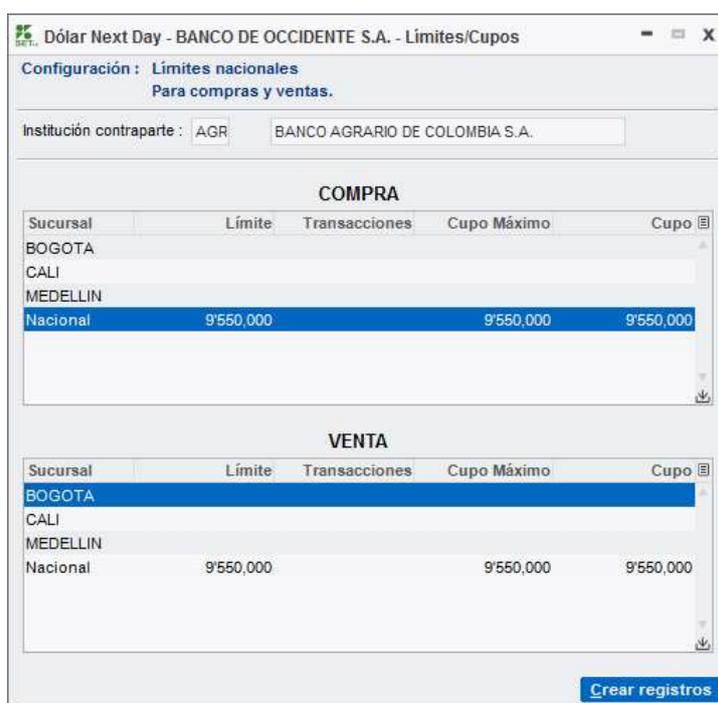
- Mercado
- Tipo configuración del mercado
- Indicador Siempre por Cámara
- Botón Informativo Cupos cámara
- Entidades contrapartes
- Valores ingresados cupos
- Aumentar Entidades en la columna Institución

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 57 / 116



La opción *Detalle* sirve para mostrar la configuración de los cupos por sucursales, tal y como se muestra a continuación:



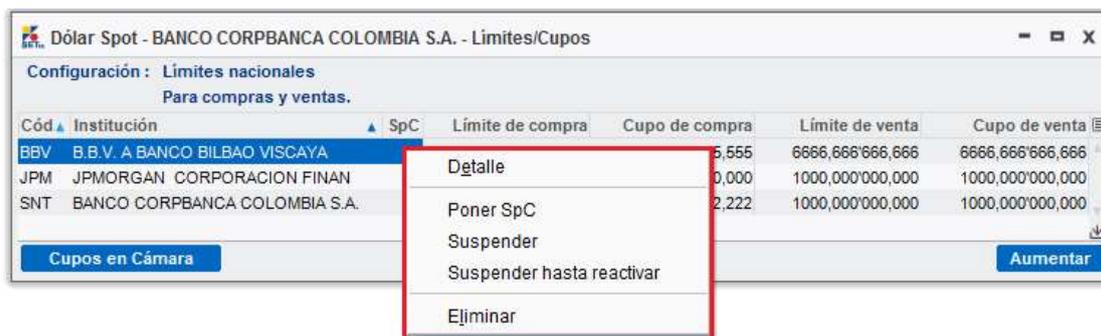
Las opciones *Modificar Límite* y *Modificar Cupo* sirven, como lo dice su nombre, para hacer cambios en los cupos y límites de otras contrapartes.

La opción de *Eliminar* permite quitarle el cupo o límite a una contraparte.

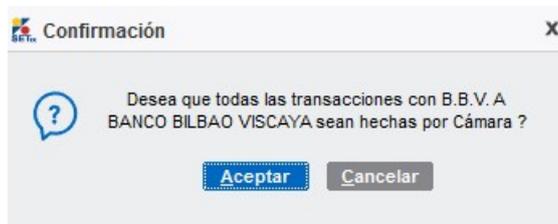
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 58 / 116

Ahora, si el usuario hace “clic derecho” bajo la columna de SpC, podrá ver las siguientes opciones:



La opción *Detalle* sirve para mostrar la configuración de los cupos por sucursales. *SpC* significa “Siempre por cámara”, lo que quiere decir que esta opción habilita a que todas las operaciones que se hagan con la contraparte seleccionada, las de tabla y registro, sean enviadas a la CCDC para su respectiva compensación. Cuando se elige esta opción, se pone la letra *S* bajo la columna SpC en ventana de Límites/cupos, indicando que toda operación realizada con la contraparte seleccionada irá siempre por cámara, no sin antes confirmarle al usuario si está seguro de realizar la acción:



Para quitar el SpC en la Entidad contraparte, selecciona la Entidad, click derecho quitar SpC

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 59 / 116

Dólar Next Day - BANCO DE OCCIDENTE S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
AGR	BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A.	S	9'550,000	9'550,000	9'550,000	9'550,000
ALN	ALIANZA VALORES S.A				1'000,000	1'000,000
AVV	AV-VILLAS		5'000,000	5'000,000	5'000,000	5'000,000
AYV	ACCIONES Y VALORES S.A.					
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA		10'300,000	10'300,000	10'300,000	10'300,000
BCL	BANCOLOMBIA S.A.		12'500,000	12'500,000	12'500,000	12'500,000
BCX	BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA		12'500,000	12'500,000	12'500,000	12'500,000
BGT	BANCO DE BOGOTA S.A.		10'000,000	10'000,000	10'000,000	10'000,000
CFC	CORP FINANCIERA COLOMBIANA		10'000,000	10'000,000	10'000,000	10'000,000
CJS	BANCO CAJA SOCIAL		2'450,000	2'450,000	2'450,000	2'450,000
CLP	RED MULTIBANCA COLPATI			3'200,000	3'200,000	3'200,000
CLT	COLTEFINANCIERA S.A.			350,000	350,000	350,000
CRR	CREDICORP CAPITAL COLC				1'000,000	1'000,000
CRS	CORREDORES DAVIVIENDA				1'000,000	1'000,000
CTB	CITIBANK S.A.			9'400,000	9'400,000	9'400,000
DTN	DIRECCION DEL TESORO N			20'000,000	20'000,000	20'000,000
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.			8'700,000	8'700,000	8'700,000
GYF	GIROS & FINANZAS S.A. C.			300,000		
PCH	BANCO PICHINCHA S.A.		400,000		400,000	400,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.		10'000,000	10'000,000	10'000,000	10'000,000

Cupos en Cámara Aumentar

La opción *Suspender* interrumpe el uso de cupos con la Entidad señalada durante la jornada del mercado y se reactiva cuando inicie la siguiente jornada al día siguiente.

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

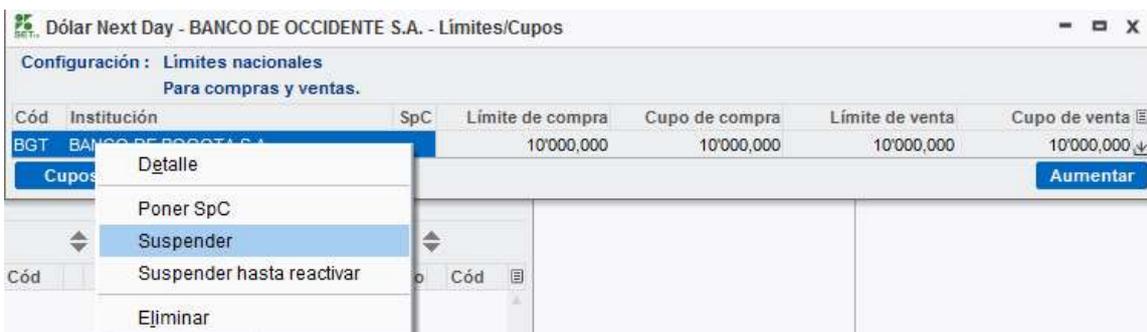
Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	S	5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
JPM	JPMORGAN CORPORACION FINAN		1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000	1000,000'000,000
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

Cupos en Cámara Aumentar

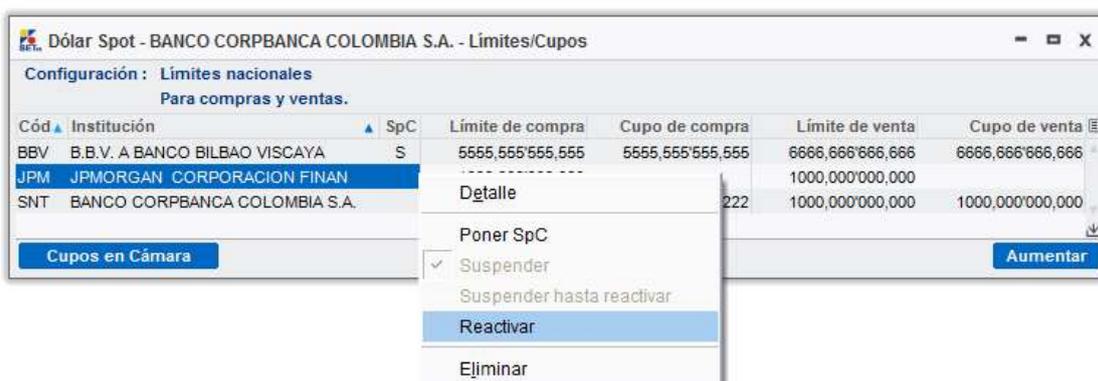
La opción *suspender hasta reactivar* interrumpe el uso de cupos hasta que esta opción sea reanudada manualmente por el usuario.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 60 / 116



Para reactivar los cupos la Entidad debe hacer “clic derecho” y escoger la opción *Reactivar*.



Para eliminar una Entidad de la columna de institución se debe utilizar la opción: Clic derecho, *Eliminar*, en cuyo caso aparecerá el siguiente mensaje de confirmación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 61 / 116



Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	S	5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
JPM	JPMORGAN CORPORACION FINAN		1000,000'000,000		1000,000'000,000	
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

Confirmación

¿Está seguro que desea eliminar límite con JPMORGAN CORPORACION FINAN ?

Aceptar Cancelar



Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	S	5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

Por el contrario, si se desea agregar una nueva Entidad, se debe hacer clic en el botón *Aumentar*, buscar la Entidad deseada y hacer clic en el botón de *Aceptar*:



Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	S	5555,555'555,555	5555,555'555,555	6666,666'666,666	6666,666'666,666
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.		2222,222'222,222	2222,222'222,222	1000,000'000,000	1000,000'000,000

Institución contraparte: PCH BANCO PICHINCHA S.A.

Aumentar

Aceptar Cancelar

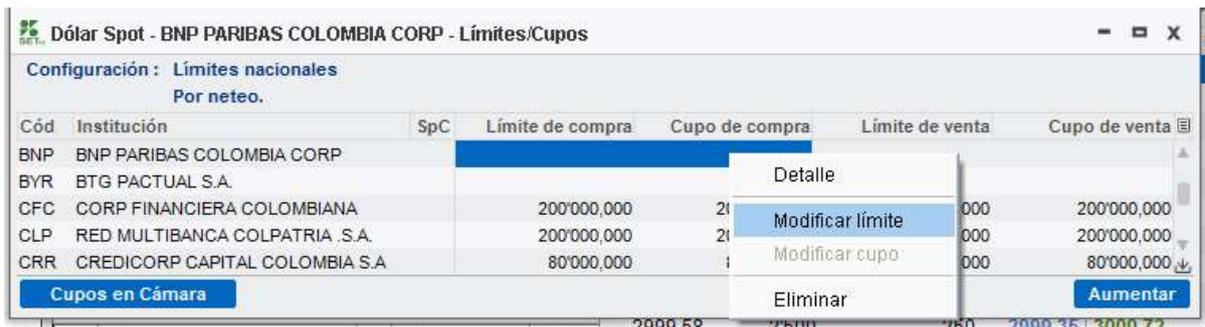
A continuación y de manera automática aparecerá una ventana emergente preguntando si el usuario desea agregar los respectivos límites a la Entidad. El usuario puede decidir hacerlo en ese momento o después.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
		Administrar SET-FX
		Versión: 02
	MERCADO DÓLAR SPOT	Página: 62 / 116



Para asignar el cupo a una Entidad el usuario deberá ubicarse en las columnas de Límite de Compra/ Cupo de compra o Límite de venta/ Cupo de venta, “clic derecho”, Modificar límite o Modificar cupo:



Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BNP	BNP PARIBAS COLOMBIA CORP					
BYR	BTG PACTUAL S.A.					
CFC	CORP FINANCIERA COLOMBIANA		200'000,000	200'000,000	000	200'000,000
CLP	RED MULTIBANCA COLPATRIA .S.A.		200'000,000	200'000,000	000	200'000,000
CRR	CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A		80'000,000	80'000,000	000	80'000,000



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 63 / 116

Dólar Spot - BNP PARIBAS COLOMBIA CORP - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Por neteo.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BNP	BNP PARIBAS COLOMBIA CORP		50'000,000	50'000,000		
BYR	BTG PACTUAL S.A.					
CFC	CORP FINANCIERA COLOMBIANA		200'000,000	200'000,000	200'000,000	200'000,000
CLP	RED MULTIBANCA COLPATRIA .S.A.		200'000,000	200'000,000	200'000,000	200'000,000
CRR	CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A		80'000,000	80'000,000	80'000,000	80'000,000

Cupos en Cámara Aumentar

La configuración puede variar de acuerdo con la opción de cupos establecida.

6.4.2. Ventana bajo la configuración de *Límites nacionales por neteo y globalizados.*

Bajo la configuración en mención, las opciones activas de esta ventana funcionan de la misma manera como se explicó en el numeral 6.4.1:

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Por neteo.

Cód	Institución	SpC	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	S	9999,999'999,999	9999,999'999,999	9999,999'999,999	9999,999'999,999
PCH	BANCO PICHINCHA S.A.					
SNT	BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.					

Cupos en Cámara Aumentar

- Detalle
- Modificar límite
- Modificar cupo
- Eliminar

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Globalizados.

Cód	Institución	SpC	Límite	Cupo
BCL	BANCOLOMBIA S.A.			

Cupos en Cámara Aumentar

- Detalle
- Modificar límite
- Modificar cupo
- Eliminar

Dólar Spot - BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Globalizados.

Cód	Institución	SpC	Límite	Cupo
BCL	BANCOLOMBIA S.A.			

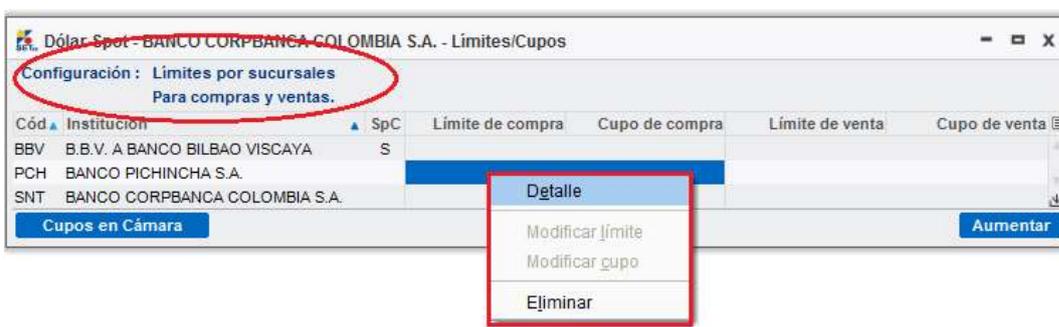
Cupos en Cámara Aumentar

- Detalle
- Poner SpC
- Suspender
- Suspender hasta reactivar
- Eliminar

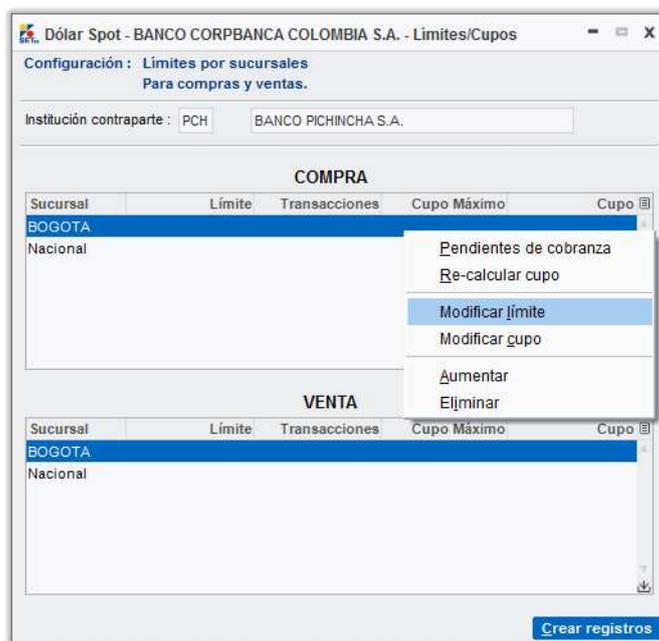
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 64 / 116

6.4.3. Ventana bajo la configuración de *Límites por sucursales para compras y ventas.*

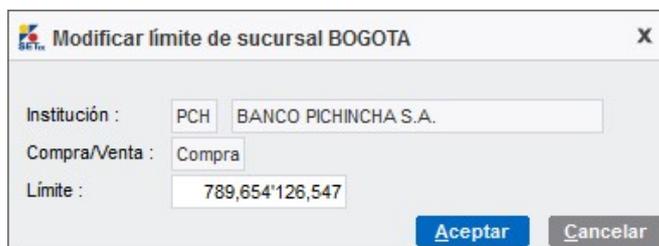
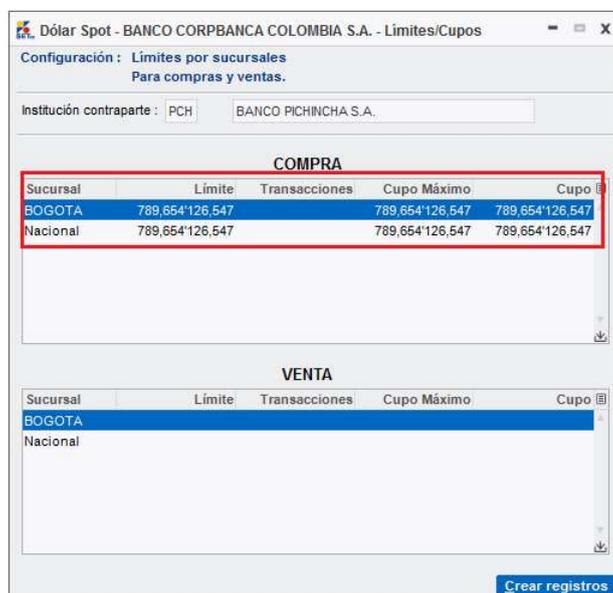


Como se observa en la imagen anterior, las opciones de Modificar límite/cupo aparecen desactivadas. Para agregar los límites, se debe escoger la opción *Detalle*, señalar la sucursal, “clic derecho” y seleccionar *modificar límite/cupo*.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 65 / 116

COMPRA				
Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA	789,654'126,547		789,654'126,547	789,654'126,547
Nacional	789,654'126,547		789,654'126,547	789,654'126,547

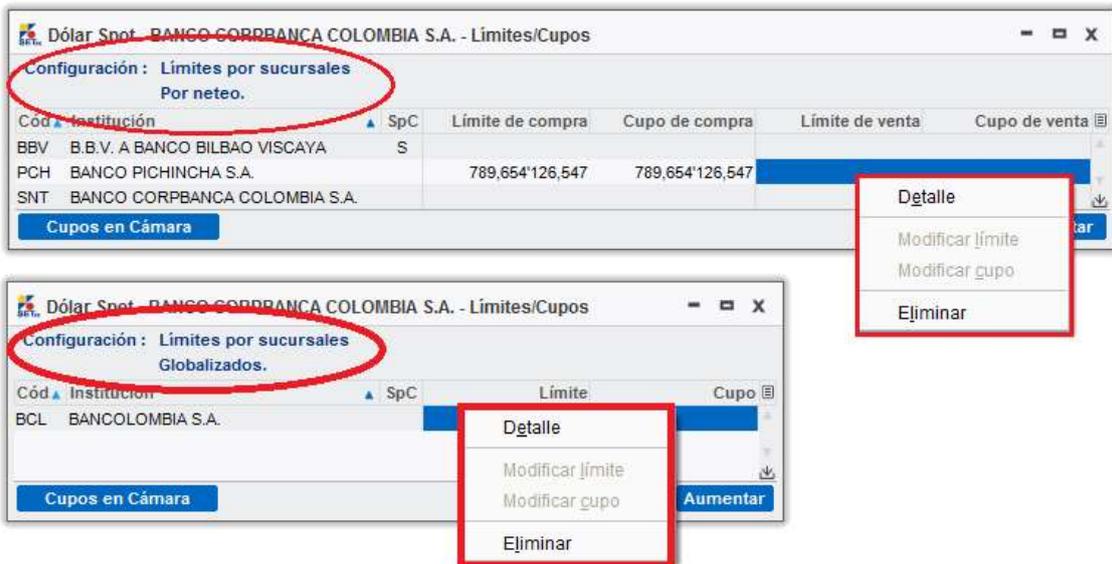
VENTA				
Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA				
Nacional				

6.4.4. Ventana bajo la configuración de *Límites por sucursales por neteo y globalizados*

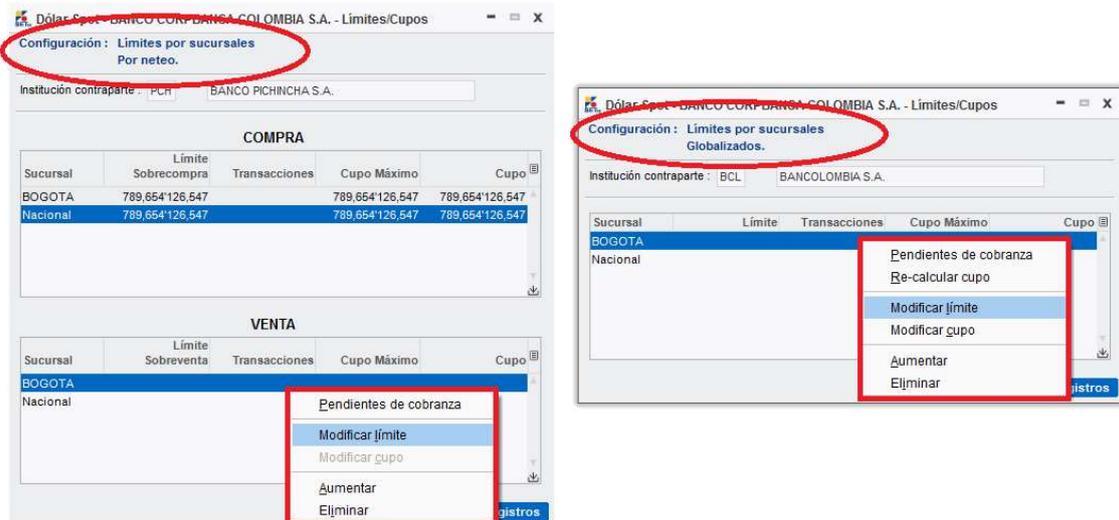
En la configuración en mención, las opciones de modificación aparecen bloqueadas. Como consecuencia, se debe hacer “clic derecho” en la opción *Detalle* para llevar a cabo las modificaciones deseadas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 66 / 116



Para modificar los límites/cupos, se debe hacer “clic derecho” en la sucursal y escoger la opción deseada:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 67 / 116

7. PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES PROPIAS

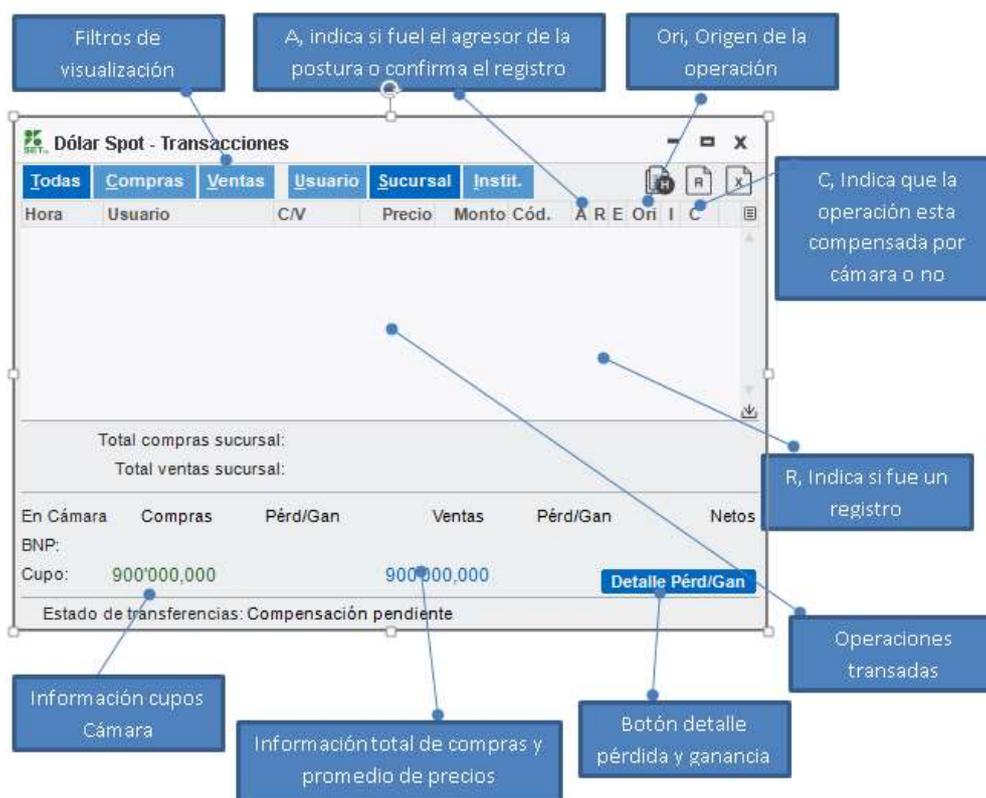
Todas las transacciones que se realicen en el mercado, se almacenan en el blotter o ventana de Precios/Montos de Transacciones Propias. Para acceder a esta ventana se debe hacer “clic” el botón



de la barra de botones del mercado.



Automáticamente se abrirá la siguiente ventana emergente:



The screenshot shows the 'Dólar Spot - Transacciones' window with the following callouts:

- Filtros de visualización**: Points to the filter tabs (Todas, Compras, Ventas, Usuario, Sucursal, Instit.).
- A, indica si fue el agresor de la postura o confirma el registro**: Points to the 'A' column header.
- Ori, Origen de la operación**: Points to the 'Ori' column header.
- C, Indica que la operación esta compensada por cámara o no**: Points to the 'C' column header.
- R, Indica si fue un registro**: Points to the 'R' column header.
- Operaciones transadas**: Points to the main transaction list area.
- Botón detalle pérdida y ganancia**: Points to the 'Detalle Pérd/Gan' button.
- Información cupos Cámara**: Points to the 'Cupo' field.
- Información total de compras y promedio de precios**: Points to the 'Total compras sucursal' and 'Total ventas sucursal' summary.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 68 / 116

Los siguientes filtros de visualización aparecen en la parte superior de la ventana:

- **Todas:** Muestra todas las operaciones realizadas por la Entidad.
- **Compras:** Refleja las operaciones de compra.
- **Ventas:** Muestra las operaciones de venta.
- **Usuario:** Operaciones realizadas por el usuario.
- **Sucursal:** Refleja las operaciones realizadas por la sucursal al cual pertenece el usuario.
- **Instit.:** Muestra las operaciones realizadas por la Entidad.

El blotter de operaciones contiene las siguientes columnas:

- **Hora:** Se refiere a la hora en la cual se realizó la operación por tabla. En los registros es la hora ingresada por el usuario al momento de registrar la operación.
- **Usuario:** Es el usuario que realizó la operación.
- **C/V:** Indica si la operación es compra o venta.
- **Precio:** Se refiere al precio de la operación.
- **Monto:** Volumen operado.
- **Cód.:** Indica el código de la Entidad contraparte.
- **A:** Se refiere a si fue el agresor de la postura o quien confirmó el registro
- **R:** Indica que la operación fue un registro. Es importante tener en cuenta que esta columna también puede tomar el valor de la letra B que significa que el registro fue realizado por un Bróker.
- **Ori:** Este campo representa el origen de la operación.
 - **N1, N2, N3** significan que la operación spot proviene de una next day (según sea su plazo T+1, T+2 y T+3 respectivamente) y que se dio cumplimiento a la misma.
 - **X0, X2, X3** representan operaciones que dieron cumplimiento y provienen de un fix (según sea su plazo).
 - **FP** representa las operaciones realizadas por la herramienta fixing.
 - **L** significa que la operación realizada fue el resultado de un stop loss.
 - **S** significa que el origen es spot.
 - **O** representa que el origen es un Swap O/N Contado.
 - **F** Si la operación corresponde a la porción Spot de un Swap forward.
 - **U** representa un swap Futuro.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 69 / 116

- **W** indica que la operación proviene de un registro realizado en el módulo Swap (un Swap de divisas compuesto por la operación futura y la operación de contado se representa por esta operación Spot).
- **C** Indica que la operación es compensada por Cámara de Compensación de Divisas.



En la parte inferior derecha de la ventana se encuentra el botón , el cual permite ingresar a la herramienta de *Pérdidas y Ganancias*. Esta herramienta despliega una ventana que muestra las compras y ventas de manera separada; asimismo, para cada una de ellas muestra el detalle de la pérdida o ganancia de la tasa negociada con respecto a la tasa de referencia determinada por la Cámara de Divisas.

COMPRAS							VENTAS										
Hora	Usuario	Contraparte	Precio	Monto	EfectoCupo	Orí	Pérd/Gan	C	Hora	Usuario	Contraparte	Precio	Monto	EfectoCupo	Orí	Pérd/Gan	C
17:05:44	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2982.50	500,000	500,000	X2		C	10:00:00	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2982.00	250,000	250,000	X2		C
10:00:00	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	3050.00	250,000	250,000	N1		C	17:05:19	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2982.50	250,000		X2		
10:56:06	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2950.00	750,000	750,000	N1		C	10:33:09	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2950.00	250,000		N1		
									10:33:23	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	3015.00	500,000		N1		
									10:53:16	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	3015.00	250,000	250,000	N1		C
									09:58:38	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	2980.00	250,000	250,000			C
									09:56:43	OCCC JIMMY	AYVB ALEXANDER	3005.00	250,000	250,000			C

Total Compras Cámara :	1'500,000	Total Ventas Cámara :	1'000,000
Efecto en Cupos :		Efecto en Cupos :	1'750,000
Total No Spot No Cámara :		Total No Spot No Cámara :	750,000

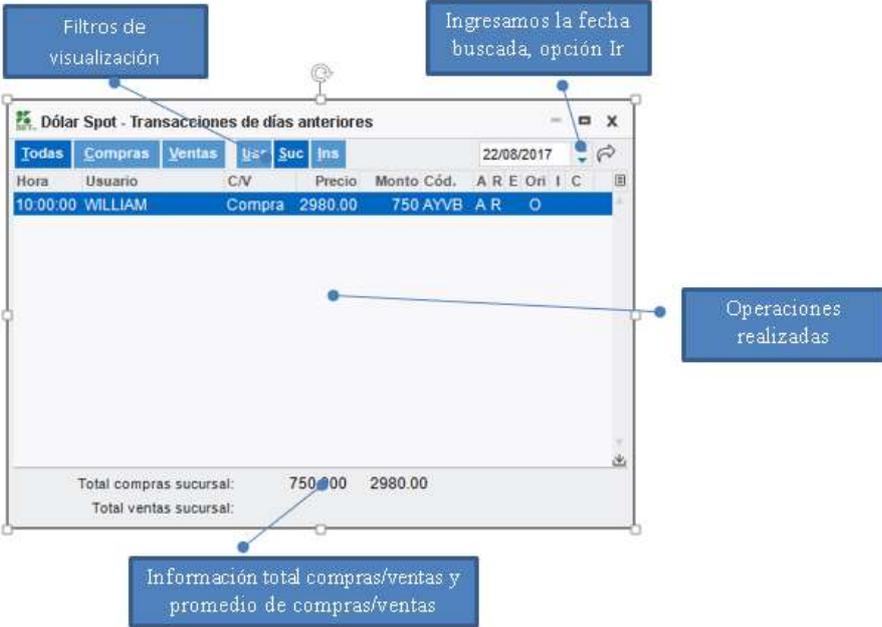
Cuando se generan pérdidas, estas son descontadas por la Cámara de Divisas del cupo multilateral, por lo tanto esta ventana sirve para calcular el posible impacto de las pérdidas sobre los cupos de cámara y las necesidades de garantías adicionales.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 70 / 116

El botón  en la parte superior derecha muestra el historial de las operaciones del mercado Spot. Los filtros y las columnas son los mismos de la ventana explicada anteriormente. En la parte superior derecha de la ventana, como se muestra a continuación, se encuentra el filtro de fecha que permite escoger la historia de un día previo en específico.



The screenshot shows a window titled "Dólar Spot - Transacciones de días anteriores" with a date filter set to "22/08/2017". The window contains a table of transactions and a summary section at the bottom. Callouts point to various elements:

- Filtros de visualización**: Points to the top navigation tabs (Todas, Compras, Ventas, etc.).
- Ingresamos la fecha buscada, opción Ir**: Points to the date input field and the search icon.
- Operaciones realizadas**: Points to the main table area.
- Información total compras/ventas y promedio de compras/ventas**: Points to the summary section at the bottom of the window.

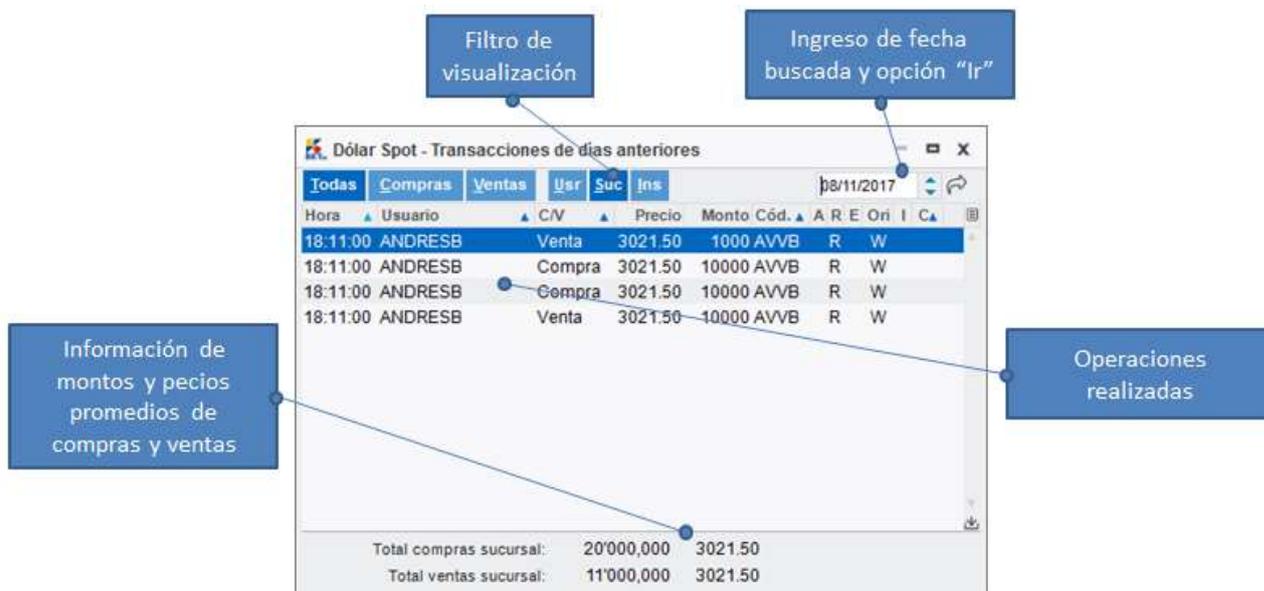
Hora	Usuario	CV	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
10:00:00	WILLIAM	Compra	2980.00	750	AYVB	A	R				O

Summary section:

Total compras sucursal: 750.00 2980.00
 Total ventas sucursal:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 71 / 116



Filtro de visualización

Ingreso de fecha buscada y opción "Ir"

Operaciones realizadas

Información de montos y precios promedios de compras y ventas

Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
18:11:00	ANDRESB	Venta	3021.50	1000	AVVB		R				W
18:11:00	ANDRESB	Compra	3021.50	10000	AVVB		R				W
18:11:00	ANDRESB	Compra	3021.50	10000	AVVB		R				W
18:11:00	ANDRESB	Venta	3021.50	10000	AVVB		R				W

Total compras sucursal:	20'000,000	3021.50
Total ventas sucursal:	11'000,000	3021.50

Al hacer "click derecho" en una operación, el usuario puede ver las siguientes opciones:



Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
14:53:07	ANDREAH	Compra	3001.00	500	JPMB						
14:53:20	ANDREAH	Compra	3000.00	500	JPMB						
14:53:38	ANDREAH	Venta	3001.00	500	JPMB	A					
14:53:53	ANDREAH	Compra	3001.00	250	JPMB	A					

Total compras sucursal:	1'250,000	3000.60
Total ventas sucursal:	500,000	3001.00

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan
SNT:	1'250,000		500,000	
Cupo:	559'250,000		560'750,000	

Estado de transferencias: Compensación pendiente

- Detalle
- Instrucciones de Pago
- Cambiar instrucciones de Pago
- Historia
- Imprimir Papeleta

La opción *Detalle* muestra los pormenores de la operación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 72 / 116

Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 21/09/2017 Código: 03PD714GOA Hora: 14:53:20

Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
BANCO CORPBANCA COLOMBIA S.A.	BOGOTA	Andrea Stella Hernandez Ospina	
Vendedor	Sucursal	Persona	
JPMORGAN CORPORACION FINAN	BOGOTA	Andrea Paola Arevalo Camargo	

Precio : 3000.00 Monto US\$: 500,000.00

Origen de transacción : **Demanda aceptada por ANDREA**

Comentario : Monto Pesos : 1,500'000,000.00

Para ver los estados de la operación y sus cambios, el usuario puede acceder a la opción *historia*:

Dólar Spot - Historia de postura

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To T	Comentario
22/09/17	08:01:00	JPMB ANDREA	Solicita registro	D	3001.20	250	250	
22/09/17	08:01:59	Motor de calce	Solicitud aceptada	D	3001.20	250	250	
22/09/17	08:01:00	Motor de calce	Registro	D	3001.20	250	250	
22/09/17	08:02:09	SNTB ANDREAH	Confirmación	D	3001.20	250		

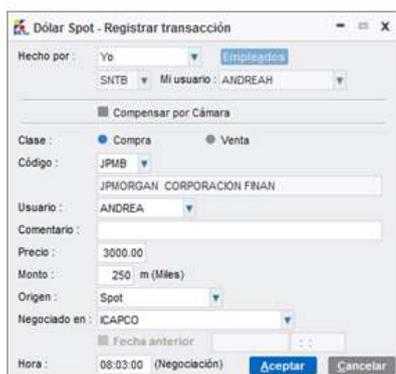
Para llevar a cabo un registro en el mercado Spot, se hace "click" en el botón  en la barra de herramientas:



Después de diligenciar todos los campos y confirmar el registro, el usuario puede ingresar al botón de solicitudes de registro  para verificar el estado de las solicitudes de registro del mercado Spot.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 73 / 116




Filtros de visualización

Estado del registro



Dólar Spot - Solicitudes de registro										
Filtros de visualización: Todas Compras Ventas Todas Enviadas Recibidas Todas Expiradas Confirmadas Pendientes Rechazadas										
Hora	Env/Rec	C/V	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor	Ori	Comentario	R Estado
08:01:00	Recibida	Venta	JPMORGAN	BOGOTA	3001.20	250	750'300,000	S		Confirmada
08:03:00	Enviada	Compra	JPMORGAN	BOGOTA	3000.00	250	750'000,000	S		Rechazada
08:05:00	Recibida	Venta	JPMORGAN	BOGOTA	2999.00	250	749'750,000	F		Pendiente

Cuando una operación no es confirmada por la contraparte dentro de los primeros diez (10) minutos luego de ser enviado el registro, se considera *Expirada* y se debe enviar un nuevo registro.



Finalmente, el botón  le permitirá acceder a la ventana de anulaciones y solicitudes de anulación registro, donde el usuario podrá visualizar los registros de compra/venta anulados, enviadas, recibidas, expiradas, pendientes, confirmadas y rechazadas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 74 / 116

8. TRANSACCIONES Y POSICIÓN

Este botón  muestra varias opciones de resumen de operaciones por compras y/o ventas para conocer la posición del usuario.



Al escoger la opción *Compras* aparece la siguiente ventana, en donde se pueden ver en detalle todas las operaciones de compras realizadas:

Dólar Spot - Compras							
Fecha: 22/09/2017							
Sucursal: BOGOTA							
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	
07:58:58	JPMORGAN	BOGOTA	3001.00	500	1500'500,000		R C
07:59:22	JPMORGAN	BOGOTA	2950.01	500	1475'005,000		R C
10:00:00	JPMORGAN	BOGOTA	3001.00	250	750'250,000	U	R
Total compras :		1'250,000.00		Promedio : 2980.60			

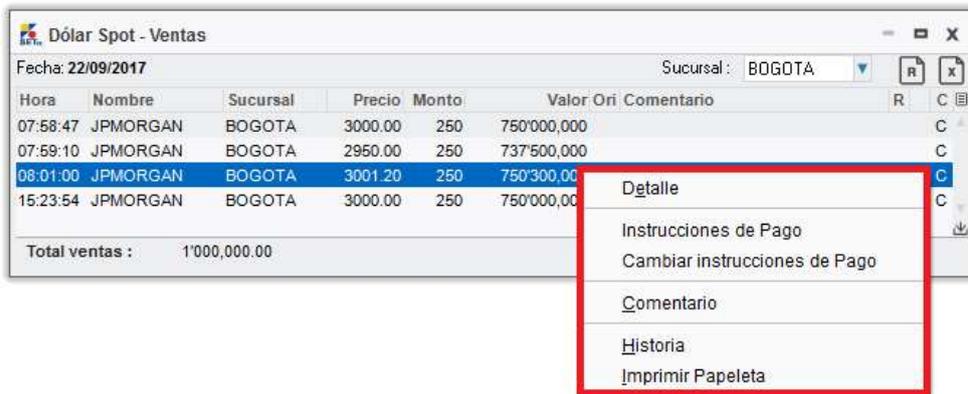
Al escoger la opción *Ventas* aparece la siguiente ventana, en donde se pueden ver en detalle todas las operaciones de ventas realizadas:

Dólar Spot - Ventas							
Fecha: 22/09/2017							
Sucursal: BOGOTA							
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	
07:58:47	JPMORGAN	BOGOTA	3000.00	250	750'000,000		R C
07:59:10	JPMORGAN	BOGOTA	2950.00	250	737'500,000		R C
08:01:00	JPMORGAN	BOGOTA	3001.20	250	750'300,000	S	R C
15:23:54	JPMORGAN	BOGOTA	3000.00	250	750'000,000		R C
Total ventas :		1'000,000.00		Promedio : 2987.80			

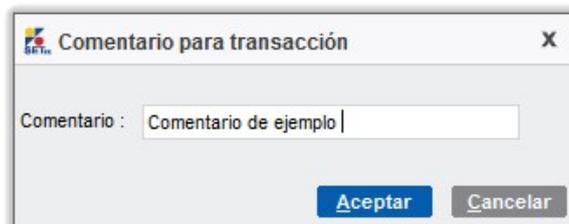
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 75 / 116

Al hacer “click derecho” sobre una operación, en la ventana de compras o ventas, se pueden ver las siguientes opciones:



La opción *Comentario* es exclusiva de esta ventana y permite que el usuario agregue un corto texto como se puede ver a continuación:



En la opción *Sucursales Propias* se encuentra el resumen de operaciones agrupadas por cada una de las sucursales. Si se hace “doble click” sobre una sucursal, se abre una ventana que muestra el detalle de las operaciones por sucursal:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 76 / 116



Sucursal	COMPRAS		VENTAS		Monto Neto
	Monto	Promedio	Monto	Promedio	
BARRANQUIL					
BOGOTA					
BUCARAMANGA					
CALI	250	3000.00	250	2950.00	
MEDELLIN					
PEREIRA					
Nacional	250	3000.00	250	2950.00	



Fecha: 22/09/2017	Sucursal: BOGOTA							
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	R C/V	C
07:58:47	JPMORGAN	BOGOTA	3000.00	250	750'000,000		Venta	C
07:58:58	JPMORGAN	BOGOTA	3001.00	500	1500'500,000		Compra	C
07:59:10	JPMORGAN	BOGOTA	2950.00	250	737'500,000		Venta	C
07:59:22	JPMORGAN	BOGOTA	2950.01	500	1475'005,000		Compra	C
08:01:00	JPMORGAN	BOGOTA	3001.20	250	750'300,000	S	R Venta	C
10:00:00	JPMORGAN	BOGOTA	3001.00	250	750'250,000	U	R Compra	C
15:23:54	JPMORGAN	BOGOTA	3000.00	250	750'000,000		Venta	C
Total compras :		1'250,000.00	Total ventas :		1'000,000.00			

En la ventana de *Sucursales Propias* se encuentra el botón  el cual permite ver el resumen histórico de transacciones por sucursal.



Fecha: 21/09/2017					
Sucursal	COMPRAS		VENTAS		Monto Neto
	Monto	Promedio	Monto	Promedio	
BOGOTA	1'250	3000.60	500	3001.00	750
Nacional	1'250	3000.60	500	3001.00	750

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 77 / 116

La opción “Resumido por Institucion Contraparte” muestra el resumen de operaciones por contraparte.



Al seleccionar la Entidad, el usuario puede hacer “click” en el botón  para realizar una consulta historica o “click” en el botón  para ver el detalle de las transacciones en total, por compras o por ventas.

Dólar Spot - Transacciones por banco								
Sucursal: NACIONAL								
Contraparte	COMPRAS			VENTAS			Total	Monto Neto
	Monto Promed	Valor	Total	Monto Promed	Valor	Total		
JPMORGAN	1'250 2980.60	3725755,000	3725755,000.00	1'000 2987.80	2987'800,000	2987'800,000.00		250
CCD	1'000 2975.51	2975'505,000	2975'505,000.00	1'000 2987.80	2987'800,000	2987'800,000.00		

Dólar Spot - Transacciones por banco								
Sucursal: NACIONAL								
Contraparte	COMPRAS			VENTAS			Total	Monto Neto
	Monto Promed	Valor	Total	Monto Promed	Valor	Total		
JPMORGAN	1'250 2980.60	3725755,000	3725755,000.00	1'000 2987.80	2987'800,000	2987'800,000.00		
CCD	1'000 2975.51	2975'505,000	2975'505,000.00	1'000 2987.80	2987'800,000	2987'800,000.00		

- Detalle de transacciones
- Detalle de compras
- Detalle de ventas

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 78 / 116

9. GRÁFICOS Y PRECIOS

El botón de gráficos  permite acceder a los diferentes gráficos del Sistema. A continuación se detalla cada uno de ellos:

9.1. GRÁFICO DE PRECIOS DE TRANSACCIONES CERRADAS HOY

Esta opción permite ver la gráfica de las operaciones spot del día, teniendo en cuenta la información de los cierres y/o promedio. Asimismo, se puede ver la gráfica lineal o escalonada.



9.2. GRÁFICO DE PRECIOS DE MEJOR DEMANDA/OFFERTA DE HOY

Esta opción permite ver gráficamente (líneas o grafica escalonada) la mejor demanda y oferta del día.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204
		Administrar SET-FX
		Versión: 02
	MERCADO DÓLAR SPOT	Página: 79 / 116



9.3. GRÁFICO DE RESÚMENES POR DÍA

Esta gráfica muestra un resumen de las operaciones con intervalos de un (1) mes, dos (2) meses, tres (3) meses y seis (6) meses. Asimismo muestra una variedad de tipos de gráficos y si se tiene en cuenta el precio de cierre y/o EMA5, como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 80 / 116



9.4. GRÁFICO DE RESÚMENES POR INTERVALO

Esta opción permite ver los resúmenes por intervalos de un (1) día, cinco (5) días, quince (15) días y un (1) mes cada quince (15), treinta (30) o sesenta (60) minutos. Puede o no tomar en cuenta el precio de cierre o EMA 5, si el usuario lo desea.

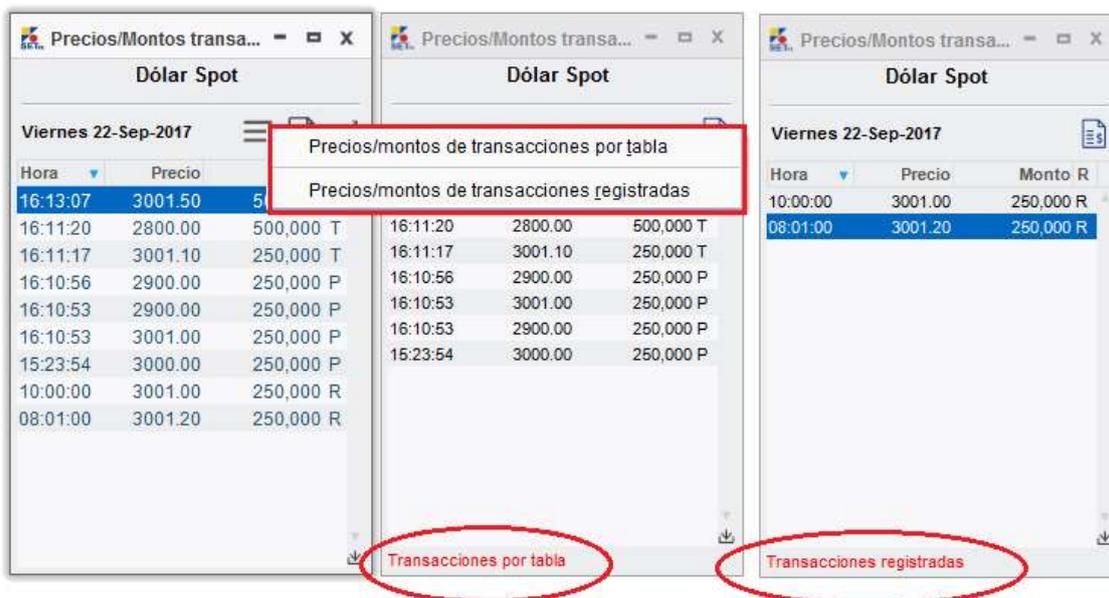


9.5. PRECIOS/MONTOS TRANSACCIONES DE HOY

Esta ventana muestra los precios y montos de las operaciones realizadas en el día. El botón  permite filtrar las operaciones hechas por tabla y las operaciones por registro, tal y como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 81 / 116



9.6. HISTORIA DE PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES

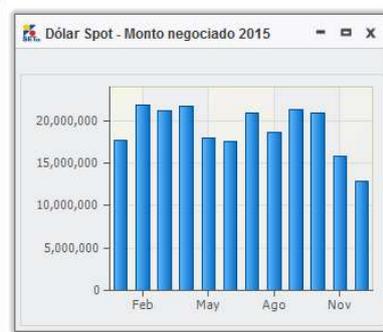
Con esta opción el usuario puede ver las estadísticas del mercado por año y adicionalmente puede graficar la información de acuerdo con los filtros que se evidencian en las siguientes imágenes:

Año Mes	Precio Apertura	Precio Cierre	Precio Promedio	Precio Mínimo	Precio Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans
2017 Enero	2985.00	2924.75	2937.38	2993.00	2997.00	14,084,667.000	2,000	20,000.000	524,314	26,863
2017 Febrero	2912.10	2928.75	2880.14	2840.35	2929.45	19,213,884.000	3,000	40,000.000	550,919	34,876
2017 Marzo	2935.00	2874.98	2942.87	2870.75	3022.50	22,527,013.000	1,000	35,000.000	549,479	40,997
2017 Abril	2875.00	2942.00	2881.42	2830.15	2965.00	15,613,590.000	1,000	30,000.000	606,635	25,738
2017 Mayo	2945.00	2916.40	2925.76	2861.20	2993.90	21,328,063.000	1,000	50,000.000	598,901	35,612
2017 Junio	2922.50	3044.90	2972.30	2881.60	3074.75	21,585,899.000	2,000	40,000.000	642,839	33,579
2017 Julio	3072.05	2986.00	3037.91	2985.00	3106.75	18,257,815.000	3,000	50,000.000	623,275	29,293
2017 Agosto	2980.00	2949.30	2967.91	2907.50	3016.90	21,438,036.000	1,000	50,000.000	671,281	31,936
2017 Septiembre	2945.00	3001.50	2919.75	2800.00	3040.00	4,073,062.111	10,000	30,000.000	635,026	6,414

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 82 / 116

Año	Mes	Precio Apertura	Precio Cierre	Precio Promedio	Precio Mínimo	Precio Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans.
2017	Enero	2985.00	2924.75	2937.38	2893.00	2997.00	14,084,867,000	2,000	20,000,000	524,314	26,863
2017	Febrero	2912.10	2928.75	2880.14	2840.35	2929.45	19,213,884,000	3,000	40,000,000	550,919	34,876
2017	Marzo	2935.00	2874.98	2942.87	2870.75	3022.60	22,527,013,000	1,000	35,000,000	549,479	40,997
2017	Abril	2875.00	2942.00	2881.42	2830.15	2965.00	15,613,590,000	1,000	30,000,000	606,635	25,738
2017	Mayo	2945.00	2916.40	2925.76	2861.20	2993.90	21,328,063,000	1,000	50,000,000	598,901	35,612
2017	Junio	2922.60	3044.90	2972.30	2881.60	3074.75	21,585,999,000	2,000	40,000,000	642,839	33,579
2017	Julio	3072.05	2986.00	3037.91	2985.00	3106.75	18,257,615,000	3,000	50,000,000	623,275	29,293
2017	Agosto	2980.00	2949.30	2967.91	2907.60	3016.90	21,438,036,000	1,000	50,000,000	671,281	31,936
2017	Septiembre	2945.00	3001.50	2919.75	2800.00	3040.00	4,073,062,111	10,000	30,000,000	636,026	6,414



De igual manera, al hacer “doble clic” en un mes del año, se abre automáticamente una ventana con las estadísticas del mercado de los días correspondientes a dicho mes; si el usuario desea ver las operaciones de un día específico, debe hacer “doble clic” sobre ese día, tal y como se muestra a continuación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 83 / 116

Fecha	Nombre Día	Precio Apertura	Precio Cierre	Precio Promedio	Precio Mínimo	Precio Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans
03	Martes	2985.00	2980.10	2981.12	2973.15	2990.00	541'694,000	2,000	10'000,000	509,110	1,064
04	Miércoles	2975.00	2970.00	2965.12	2957.00	2976.45	471'775,000	10,000	20'000,000	531,278	888
05	Jueves	2960.00	2930.51	2939.90	2913.10	2961.00	714'536,000	6,000	20'000,000	654,336	1,092
06	Viernes	2928.70	2924.95	2919.05	2909.20	2930.00	706'968,000	14,000	20'000,000	675,868	1,046
10	Martes	2925.00	2955.00	2950.04	2925.00	2958.40	724'661,000	10,000	20'000,000	728,302	995
11	Miércoles	2955.00	2972.00	2981.41	2955.00	2997.00	1,001'148,000	5,000	15'000,000	580,039	1,726
12	Jueves	2935.00	2924.25	2929.61	2920.00	2948.70	818'662,000	10,000	10'000,000	479,029	1,709
13	Viernes	2920.00	2946.00	2936.19	2920.00	2949.85	722'125,000	15,000	17'000,000	496,305	1,455
17	Martes	2935.00	2918.60	2924.58	2917.70	2936.00	894'327,000	3,000	19'000,000	509,007	1,757
18	Miércoles	2938.00	2936.00	2934.62	2927.70	2943.50	677'968,000	5,000	20'000,000	458,396	1,479

Dólar Spot		
Martes 03-Ene-2017		
Hora	Precio	Monto R
08:10:04	2985.00	500,000 T
08:10:02	2985.00	500,000 T
08:09:58	2985.00	500,000 T
08:09:55	2985.00	500,000 T
08:09:53	2985.00	500,000 T
08:09:52	2985.00	500,000 T
08:09:51	2985.00	500,000 T
08:09:48	2985.00	500,000 T
08:08:57	2985.00	250,000 T
08:06:08	2982.50	250,000 P
08:04:06	2987.00	500,000 P
08:04:05	2987.20	250,000 P
08:03:42	2990.00	250,000 T
08:03:05	2990.00	250,000 T
08:00:37	2985.00	250,000 P

9.7. PRECIOS DE MEJOR DEMANDA/OFFERTA DE HOY

Muestra las mejores demandas/ofertas ingresadas durante el mercado con su respectiva gráfica.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 84 / 116

Precios por hora de hoy - Dólar Spot

Viernes 22-Sep-2017

Hora	Demanda	Oferta
16:38:33	3000.00	
16:11:12		2800.00
16:10:53	2900.00	
15:23:44	3001.00	



9.8. HISTORIA DE PRECIOS MEJOR DEMANDA/OFERTA

Muestra las transacciones por año, mes, día e intradía.

Dólar Spot - Precios por mes

Año: 2017

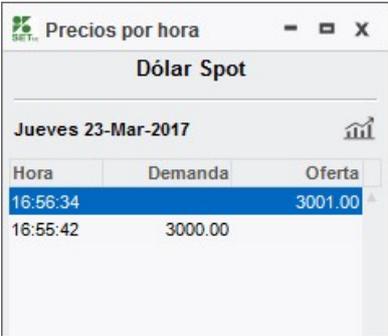
Año	Mes	Demanda Alta	Demanda Baja	Demanda Promedio	Oferta Alta	Oferta Baja	Oferta Promedio
2017	Enero	2980.00	2962.50	2969.10			
2017	Marzo	3000.00	2984.55	2992.89	3001.00	3001.00	3001.00
2017	Abril	3000.00	2828.40	2877.12	3001.46	2840.00	2883.37
2017	Mayo	3001.50	2976.05	2998.49	3018.66	3000.01	3005.18
2017	Julio	4555.00	2933.40	3039.80	3106.60	302.00	2953.45
2017	Agosto	3050.00	2901.90	2977.23	3050.10	2950.05	2997.75

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 85 / 116



Día	Nombre Día	Demanda Alta	Demanda Baja	Demanda Promedio	Oferta Alta	Oferta Baja	Oferta Promedio
22	Miércoles	2987.00	2984.55	2985.78			
23	Jueves	3000.00	3000.00	3000.00	3001.00	3001.00	3001.00



Hora	Demanda	Oferta
16:56:34		3001.00
16:55:42	3000.00	

10. RESUMEN DE PRECIOS/MONTOS TRANSADOS HOY



En la barra principal se encuentra el botón  el cual permite desplegar dos (2) opciones de resumen: *Resumen de hoy* con las estadísticas del mercado spot y *Resumen IMC's y sector real* con estadísticas de los dos segmentos en mención.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 86 / 116

10.1. RESUMEN DE HOY

Resumen de hoy comprende las estadísticas de operaciones entre las 8:00 y 13:00 para el mercado Spot

Dólar Spot - Resumen de hoy			
Precios			
Apertura :	2950.00	Mínimo :	2950.00
Cierre :	3000.40	Promedio :	2990.53
		Máximo :	3000.40
Montos en miles			
Negociado :	4'500	Ultimo :	250
Transacciones :	17	Promedio :	265
		Máximo :	500
Horario :		08:00:00 - 12:30:00	
		Imprimir	Detalle

A continuación se describe el cálculo de cada uno de los campos que contiene esta ventana:

Precios:

Dólar Spot - Resumen de hoy			
Precios			
Apertura :	3101.00	Precio Fix :	3177.31 
Cierre :	3301.00	Promedio :	3218.50
		Mínimo :	3101.00
		Máximo :	3301.00

- Apertura: Precio de la primera operación transaccional.
- Cierre: Precio de la última operación transaccional.
- Precio FIX: Precio promedio ponderado por monto de las operaciones transaccionales y operaciones de registro del mercado USD/COP Spot. Se excluyen del cálculo aquellas operaciones que provienen de otros mercados.
- Promedio: Precio promedio ponderado de todas las operaciones transaccionales y de registro con cualquier origen.
- Mínimo: Precio mínimo operado en la ventana transaccional.
- Máximo: Precio máximo operado en la ventana transaccional.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

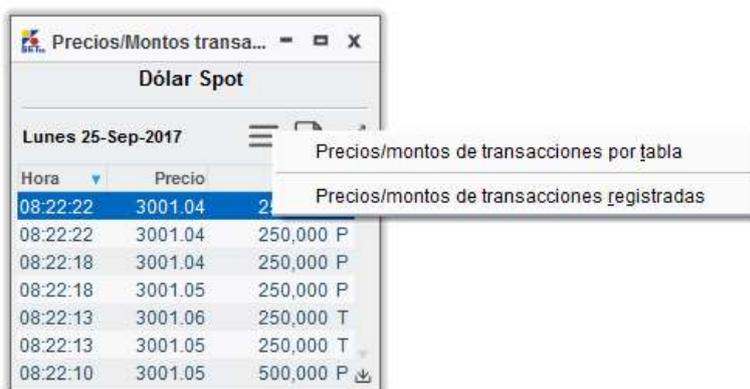
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 87 / 116

Montos en miles:

Montos en miles					
Negociado :	6'650	Ultimo :	1'000	Mínimo :	250
Transacciones :	9	Promedio :	739	Máximo :	1'000

- Negociado: Monto total negociado en la jornada (incluye operaciones transaccionales y de registro).
- Transacciones: Número total de operaciones transaccionales y de registro realizadas.
- Último: Monto de la última operación transaccional.
- Promedio: Monto promedio de todas las operaciones realizadas (incluye operaciones transaccionales y de registro).
- Mínimo: Monto de menor valor operado en operaciones transaccionales y de registro.
- Máximo: Monto de mayor valor operado, (incluye operaciones transaccionales y de registro).

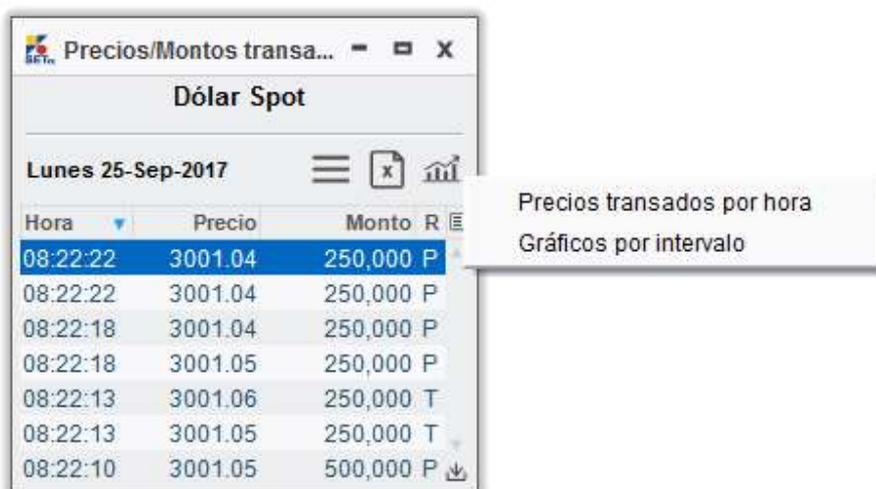
La opción *Detalle* muestra el desglose de las operaciones que hacen parte de las estadísticas, por lo que se puede ver la información con otras vistas y apreciar gráficas, tal y como lo muestra a continuación:



Dólar Spot		
Lunes 25-Sep-2017		
Hora	Precio	Monto
08:22:22	3001.04	250,000 P
08:22:18	3001.04	250,000 P
08:22:18	3001.05	250,000 P
08:22:13	3001.06	250,000 T
08:22:13	3001.05	250,000 T
08:22:10	3001.05	500,000 P

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 88 / 116



Hora	Precio	Monto	R
08:22:22	3001.04	250,000	P
08:22:22	3001.04	250,000	P
08:22:18	3001.04	250,000	P
08:22:18	3001.05	250,000	P
08:22:13	3001.06	250,000	T
08:22:13	3001.05	250,000	T
08:22:10	3001.05	500,000	P

10.2. RESUMEN IMCs Y SECTOR REAL

La primera columna corresponde al precio promedio, monto negociado entre IMCs (durante todo el día) y la segunda columna muestra las mismas cifras pero calculadas sobre todo lo negociado/registrado tanto entre IMCs como con clientes.

Al hacer clic sobre la opción *Detalle completo IMCs* se muestra el detalle de todas las operaciones y registros de los IMC, incluyendo aquellas registradas antes o después de horario de mercado por los IMC en el mercado Spot, las cuales se diferencian por ser de color azul.



	IMCs	IMCs y Sector Real
Precio promedio :	2990.53	2990.53
Monto negociado :	4'500	4'500

Horario : 07:00:00 - 18:00:00

[Detalle completo IMCs](#)
[Imprimir](#)
[Historia](#)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 89 / 116



Dólar Spot		
Viernes 25-Ago-2017		
Hora	Precio	Monto R
10:51:56	3000.40	250,000 T
10:51:56	3000.35	250,000 T
10:51:56	3000.30	250,000 T
10:51:56	3000.25	250,000 T
10:51:56	3000.20	250,000 T
10:51:56	3000.15	250,000 T
10:51:56	3000.10	250,000 T
10:51:52	3000.05	250,000 T
10:51:50	2979.50	250,000 P
10:51:50	2979.55	250,000 P
10:51:50	2979.60	250,000 P
10:51:50	2979.65	250,000 P
10:51:50	2979.70	250,000 P
10:51:50	2979.75	250,000 P
10:37:02	3000.00	500,000 T

La opción *Historia* remite al usuario a la ventana de *Resumen Transacciones por Mes*:



Dólar Spot - Resumen transacciones por mes				
Fecha: Sep-2017				
Fecha	IMCs		IMCs y Sector Real	
	Precio Promedio	Monto Transado	Precio Promedio	Monto Transado
01/09/2017	2935.94	858'956	2936.09	1,082'568
04/09/2017			2931.60	11'420
05/09/2017	2923.98	868'486	2923.21	1,113'143
06/09/2017	2919.23	861'700	2919.63	1,168'582
07/09/2017	2908.09	704'750	2907.86	873'837
08/09/2017	2909.11	762'683	2909.23	1,053'344
14/09/2017	3040.00	750	3040.00	750
15/09/2017	3000.00	1'000	3000.00	2'000
18/09/2017	2712.78	13'500	2698.04	14'000

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 90 / 116

11. CONSULTAS



El botón  abre automáticamente una ventana en la que el usuario puede crear consultas con los filtros de fecha, clase de mensaje, lado y sucursal. Es importante tener en cuenta que las consultas solo se pueden realizar al finalizar el horario del mercado Spot.

Parámetros de consulta X

Dólar Spot

Período

25-Ago-2017

Hoy

Una fecha

Un mes

Clase mensaje

Ingreso

Transacción

Anulación

Posturas

Demandas

Ofertas

Sucursal : AYVB

Incluir hechas por Broker

Consultar

Cancelar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 91 / 116

Dólar Spot - Consulta de mensajes							
Clase de mensaje: Transacción				Periodo: Hoy			
Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Precio	Monto T	Monto Total
25/08/2017	10:05:25	AYVB	ALEXANDER	D	2950.00	250	C
25/08/2017	10:31:54	AYVB	ALEXANDER	O	3000.00	250	C
25/08/2017	10:37:02	AYVB	ALEXANDER	O	3000.00	500	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.75	250	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.70	250	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.65	250	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.60	250	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.55	250	C
25/08/2017	10:51:50	AYVB	ALEXANDER	D	2979.50	250	C
25/08/2017	10:51:52	AYVB	ALEXANDER	O	3000.05	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.10	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.15	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.20	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.25	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.30	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.35	250	C
25/08/2017	10:51:56	AYVB	ALEXANDER	O	3000.40	250	C

12. CONFIGURACIÓN DE VISUALIZACIÓN DEL MERCADO SPOT



El último botón de la barra principal  abre la ventana de configuración del mercado spot.

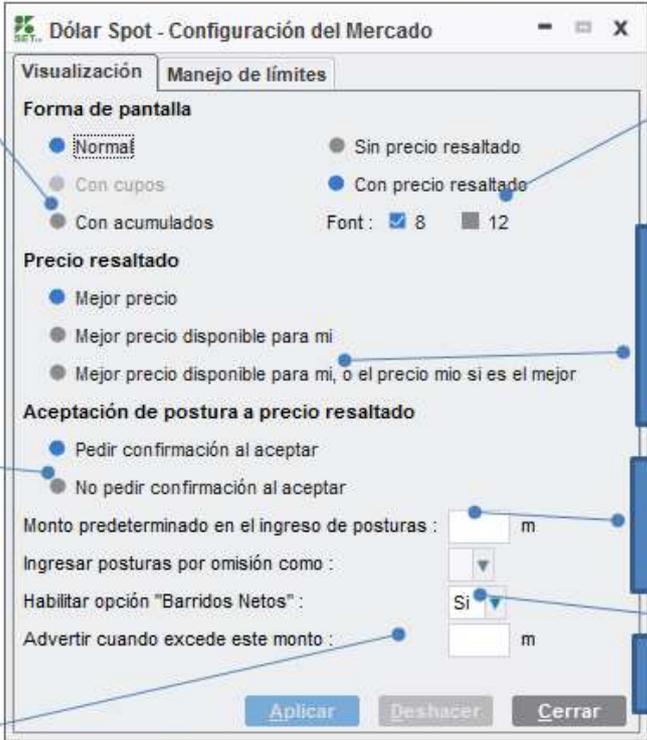
NOTA: La pestaña *Manejo de Limites* fue explicada en la sección **6:CUPOS** del presente manual.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 92 / 116

Forma de pantalla: Permite visualizar la ventana de posturas solo con precio y monto (forma normal) o con acumulados, donde se muestra el monto acumulado y precio promedio en cada línea de postura.

Precio Resaltado: Muestra en la ventana de posturas el Mejor Precio y Monto de forma resaltada y con el botón de Compra/Venta rápida activo. Adicionalmente se puede elegir ver las posturas con un Font tamaño 8 o 12.



Visualización | Manejo de límites

Forma de pantalla

- Normal
- Con cupos
- Con acumulados
- Sin precio resaltado
- Con precio resaltado

Font: 8 12

Precio resaltado

- Mejor precio
- Mejor precio disponible para mi
- Mejor precio disponible para mi, o el precio mio si es el mejor

Aceptación de postura a precio resaltado

- Pedir confirmación al aceptar
- No pedir confirmación al aceptar

Monto predeterminado en el ingreso de posturas : m

Ingresar posturas por omisión como :

Habilitar opción "Barridos Netos" : Si

Advertir cuando excede este monto : m

[Aplicar] [Deshacer] [Cerrar]

Acceptación de Posturas: Se define si al aceptar una postura se debe mostrar o no la ventana de confirmación de la transacción

Precio Resaltado: Se define que se desea ver en el precio resaltado, siempre será el mejor precio, pero con ciertas características adicionales.

Monto Predeterminado: Establece un monto que aparecerá siempre al ingresar una postura.

Habilitar opción de barridos Netos.

Mensaje de Alerta cuando se excede el monto ingresado

13. INDICADOR DE CUPOS EN LAS POSTURAS

Como se pudo evidenciar en la sección 6: **CUPOS** del presente manual, existen dos tipos de cupos: Bilaterales y Cupos por Cámara. Cuando se ingresa una postura, el precio toma un color de acuerdo con la disponibilidad de cupos:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 93 / 116

Dólar Spot

DEMANDAS ↓ ↑ OFERTAS

2979.45 3000.45

250 Vender 250 Comprar

178'975 176'475

▲	Promed	Acumulado	Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód	Acumulado	Promed	▼
▲	2979.45	250		250	2979.45	3000.45	250		250	3000.45	▲
				250	2979.42	3000.50	250		500	3000.48	
	2979.43	500		250	2979.40	3000.53	250				
	2979.40	750		250	2979.35	3000.55	250		750	3000.50	
	2979.37	1'250		500	2979.32	3000.60	250		1'000	3000.53	
	2979.36	1'500		250	2979.30	3000.62	500		1'500	3000.56	
	2979.34	1'750		250	2979.25	3000.65	250		1'750	3000.57	
	2979.32	2'000		250	2979.20	3000.70	250		2'000	3000.59	
	2979.30	2'250		250	2979.15	3000.72	500		2'500	3000.61	
	2979.27	2'750		500	2979.12	3000.75	250		2'750	3000.63	
	2979.26	3'000		250	2979.10	3000.80	250		3'000	3000.64	
	2979.24	3'250		250	2979.05	3000.83	500				
	2979.22	3'500		250	2979.00	3000.85	250		3'250	3000.66	
				500	2979.00	3000.90	250		3'500	3000.67	
	2979.21	3'750		250	2978.95	3000.95	250		3'750	3000.69	
	2979.19	4'000		250	2978.90	3001.00	250		4'000	3000.71	
	2979.17	4'250		250	2978.85	3001.00	250		4'250	3000.73	
	2979.15	4'500		250	2978.80	3001.05	250		4'500	3000.75	
▼	2979.13	4'750		250	2978.75	3001.10	250		4'750	3000.76	▼

10:51:56 **Compra a AYVB ALEXANDER** Monto Últ. precio

250 a 3000.40 **4'500** **3000.40**

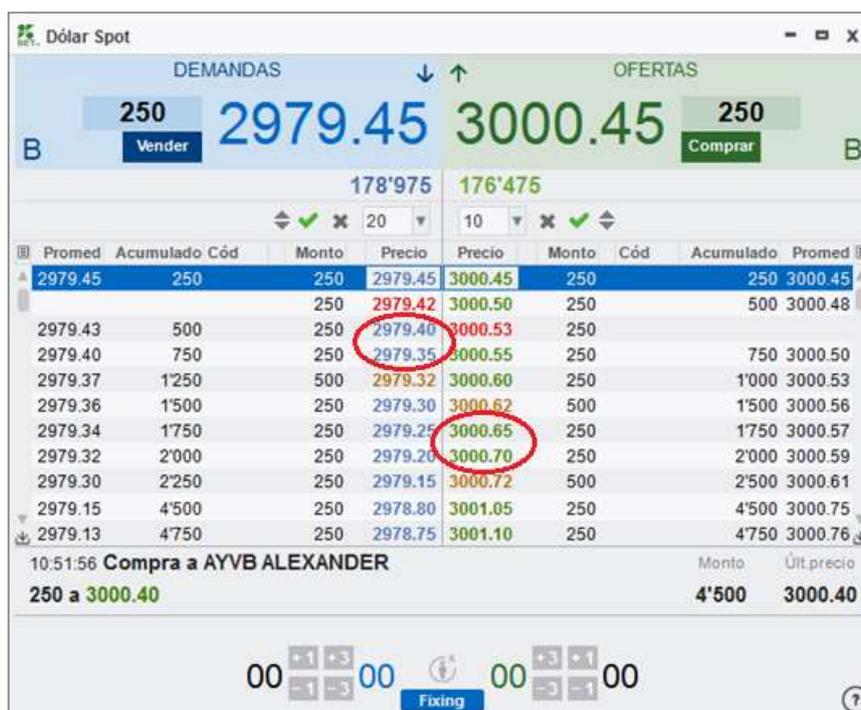
00
+1
+3
00
-1
-3
00
+3
+1
00
-3
-1
00
Fixing
?

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 94 / 116

13.1. PRECIO POSTURA COLOR VERDE (OFERTAS) O AZUL (DEMANDAS)

El precio verde en las ofertas y el azul en el lado de las demandas significa que el postulante y aceptante tienen cupo bilateral y cupo cámara suficiente para poder operar sobre esa postura y en consecuencia, esta operación será compensada a través de la CCDC.



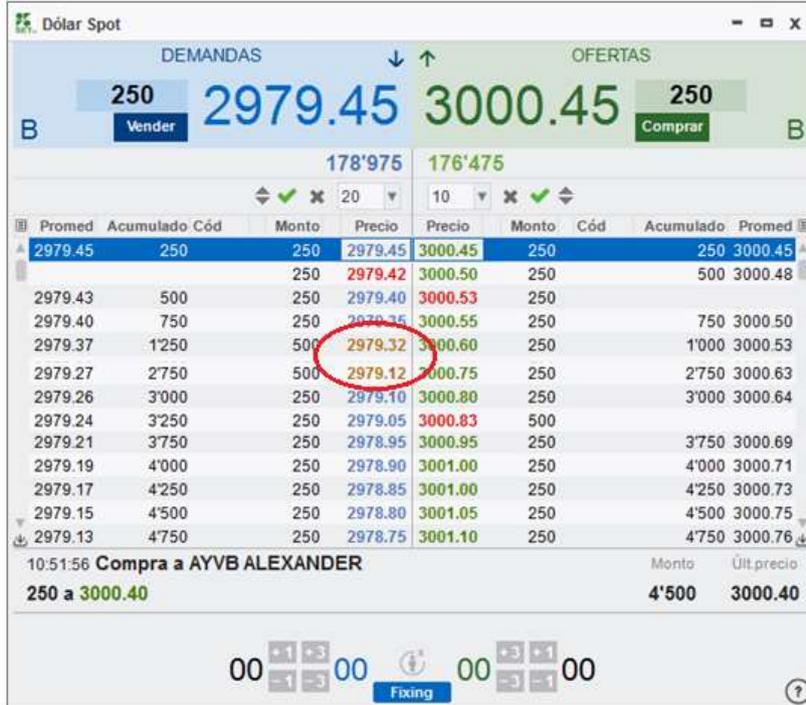
DEMANDAS		OFERTAS							
250	2979.45	3000.45	250						
Vender		Comprar							
178'975		176'475							
Promed	Acumulado	Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód	Acumulado	Promed
2979.45	250	250	250	2979.45	3000.45	250	250	3000.45	
			250	2979.42	3000.50	250	500	3000.48	
2979.43	500	250	250	2979.40	3000.53	250			
2979.40	750	250	250	2979.35	3000.55	250	750	3000.50	
2979.37	1'250	500	250	2979.32	3000.60	250	1'000	3000.53	
2979.36	1'500	250	250	2979.30	3000.62	500	1'500	3000.56	
2979.34	1'750	250	250	2979.25	3000.65	250	1'750	3000.57	
2979.32	2'000	250	250	2979.20	3000.70	250	2'000	3000.59	
2979.30	2'250	250	250	2979.15	3000.72	500	2'500	3000.61	
2979.15	4'500	250	250	2978.80	3001.05	250	4'500	3000.75	
2979.13	4'750	250	250	2978.75	3001.10	250	4'750	3000.76	
10:51:56 Compra a AYVB ALEXANDER									
250 a 3000.40						Monto		Últ.precio	
						4'500		3000.40	

13.2. PRECIO POSTURA COLOR AMARILLO

Cuando la postura toma el color amarillo, puede significar que el postulante, el aceptante o ambos no tienen cupo cámara pero sí bilateral con su contraparte. Lo importante en esta situación es que ninguna de las contrapartes obligue a compensar a través de la CCDC porque de lo contrario la postura aparecería roja.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 95 / 116



The screenshot shows the 'Dólar Spot' market interface. At the top, there are buttons for 'Vender' (250) and 'Comprar' (250) with a current price of 2979.45. Below this is a table of orders with columns for 'Promed', 'Acumulado', 'Cód', 'Monto', and 'Precio'. A red circle highlights the price '2979.32' in the 'Precio' column of the 6th row. At the bottom, there is a 'Fixing' button and a status bar showing '10:51:56 Compra a AYVB ALEXANDER' with a price of 3000.40.

Promed	Acumulado	Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód	Acumulado	Promed
2979.45	250		250	2979.45	3000.45	250		250	3000.45
			250	2979.42	3000.50	250		500	3000.48
2979.43	500		250	2979.40	3000.53	250			
2979.40	750		250	2979.35	3000.55	250		750	3000.50
2979.37	1250		500	2979.32	3000.60	250		1000	3000.53
2979.27	2750		500	2979.12	3000.75	250		2750	3000.63
2979.26	3000		250	2979.10	3000.80	250		3000	3000.64
2979.24	3250		250	2979.05	3000.83	500			
2979.21	3750		250	2978.95	3000.95	250		3750	3000.69
2979.19	4000		250	2978.90	3001.00	250		4000	3000.71
2979.17	4250		250	2978.85	3001.00	250		4250	3000.73
2979.15	4500		250	2978.80	3001.05	250		4500	3000.75
2979.13	4750		250	2978.75	3001.10	250		4750	3000.76

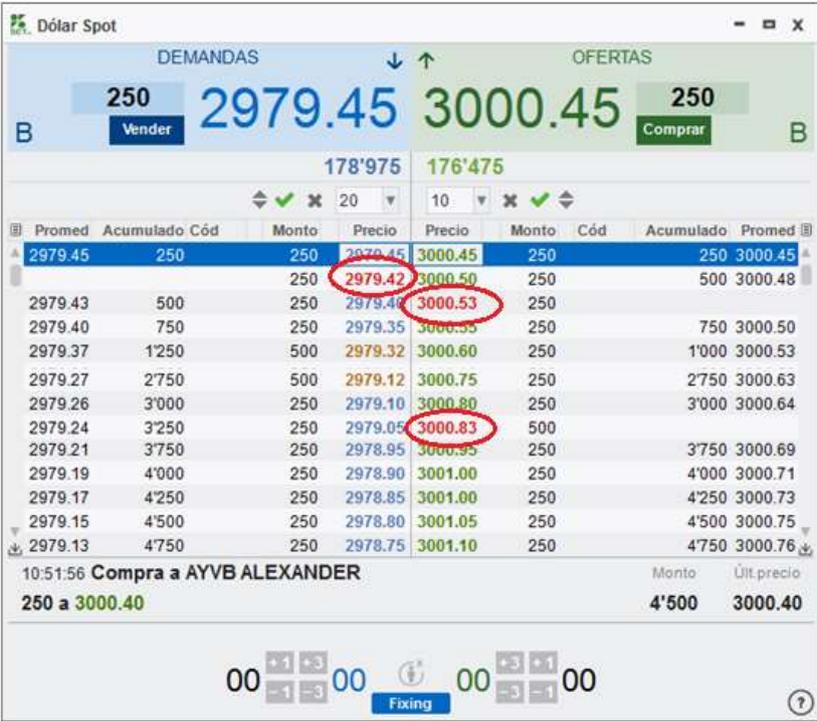
13.3. PRECIO POSTURA COLOR ROJO

Existen cuatro (4) posibilidades que explican por qué el precio de una postura es de color rojo:

- El postulante no tiene cupo bilateral con el aceptante.
- El aceptante no tiene cupo bilateral con el postulante.
- El postulante y el aceptante tienen cupos bilaterales. El Postulante obliga a operar a través de la Cámara, pero el aceptante no tiene cupos Cámara,
- El Aceptante obliga a operar a través de la Cámara, pero el Postulante no tiene cupos Cámara.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 96 / 116



The screenshot shows the 'Dólar Spot' trading window. At the top, it displays 'DEMANDAS' (bids) and 'OFERTAS' (asks) with a bid price of 2979.45 and an ask price of 3000.45. Below this is a table of market orders. Several prices in the table are circled in red, indicating specific interest: 2979.42, 3000.50, 3000.53, and 3000.83. At the bottom, there is a 'Fixing' button and a summary of a recent trade: '10:51:56 Compra a AYVB ALEXANDER 250 a 3000.40'.

Promed	Acumulado	Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód	Acumulado	Promed
2979.45	250		250	2979.45	3000.45	250		250	3000.45
				2979.42	3000.50	250		500	3000.48
2979.43	500		250	2979.43	3000.53	250		750	3000.50
2979.40	750		250	2979.35	3000.55	250		1000	3000.53
2979.37	1250		500	2979.32	3000.60	250		2750	3000.63
2979.27	2750		500	2979.12	3000.75	250		3000	3000.64
2979.26	3000		250	2979.10	3000.80	250		3750	3000.69
2979.24	3250		250	2979.05	3000.83	500		4000	3000.71
2979.21	3750		250	2978.95	3000.95	250		4250	3000.73
2979.19	4000		250	2978.90	3001.00	250		4500	3000.75
2979.17	4250		250	2978.85	3001.00	250		4750	3000.76
2979.15	4500		250	2978.80	3001.05	250			
2979.13	4750		250	2978.75	3001.10	250			

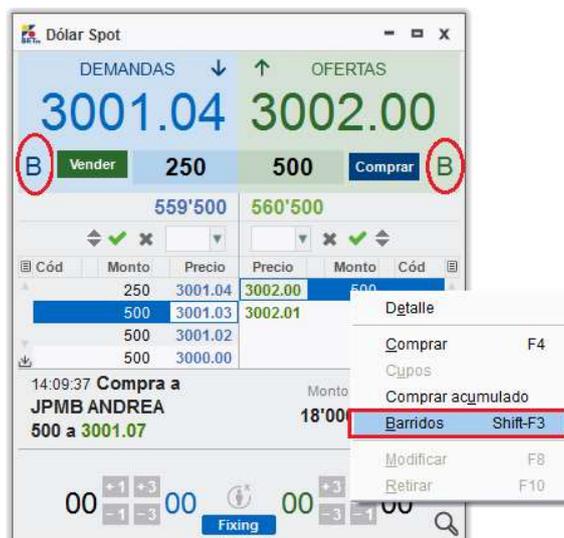
14. BARRIDOS NETOS

Esta funcionalidad permite realizar agresiones en barrido (varias posturas a la vez) de una manera más ágil.

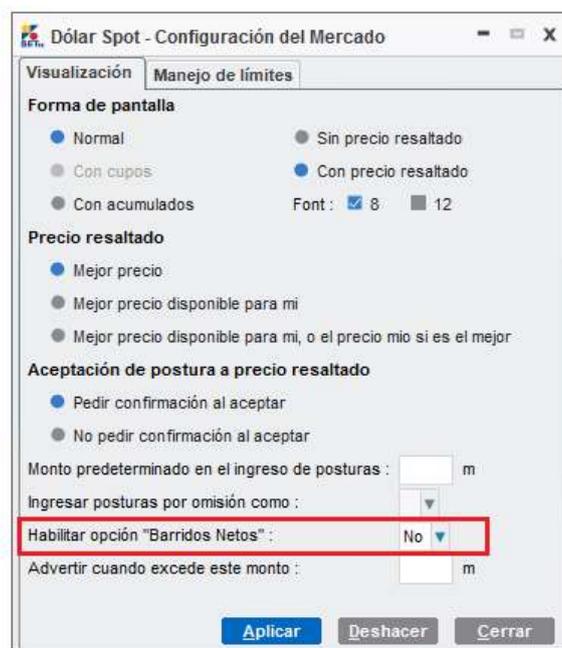
La ventana de Barridos Netos se muestra presionando el botón 'B' ubicada en la tabla de posturas, o haciendo "clic derecho" en cualquier postura sea esta demanda u oferta, o con las teclas SHITF+F3:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 97 / 116



En caso de que la tabla de posturas no tenga la letra, puede ser debido a que en la configuración no se encuentra habilitada esta opción.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 98 / 116

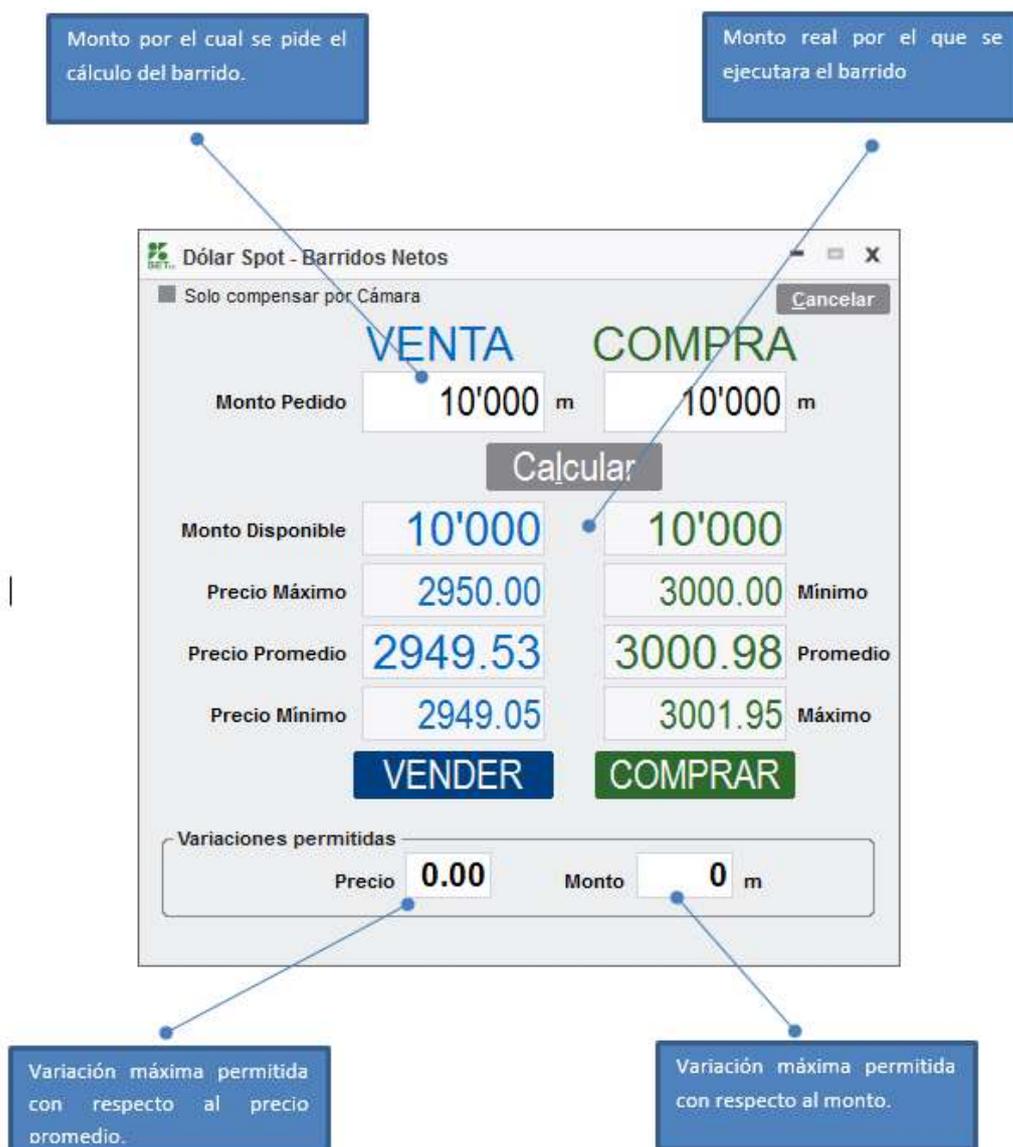
Para iniciar el barrido se debe ingresar el monto total que el usuario desea vender o comprar en la parte superior de la ventana. El monto se debe ingresar en miles y tiene un máximo de 99.999 (es decir 99 millones 999 mil dólares).

Ingresado el monto, el usuario debe hacer clic en el botón *Calcular* para realizar el cálculo u oprimir la tecla *enter*. El Sistema verificará los precios disponibles y el monto ingresado para el barrido, asegurando que sea mayor al monto mínimo configurado en el mercado para transacciones electrónicas (en este momento USD250.000).



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 99 / 116



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 100 / 116

A continuación el Sistema calculará, tanto para la compra como para la venta, el precio promedio disponible para los montos especificados, y adicionalmente identificará el precio máximo y mínimo para el posible barrido. Este cálculo se hace sobre la profundidad de posturas en el mercado, y con base en los cupos bilaterales y cupos cámara, tanto del postulante como del aceptante.

Una vez que el Sistema calcula y muestre los montos y precios disponibles en esta ventana, los valores se recalculan cada dos (2) segundos, previendo cualquier posible cambio en las posturas del mercado. Si los montos o precios cambiaron antes de tres segundos y el usuario da "clic" en comprar/ vender para ejecutar su barrido, el sistema le mostrará una advertencia sobre el cambio y mostrará los nuevos precios / montos previo a la ejecución del barrido para asegurarse que el usuario cuente con información actualizada.

Si el usuario desea configurar ciertos márgenes de cambio (en precio y en monto) para que su barrido no sea interrumpido ante cualquier cambio, deberá configurarlo en las opciones de "Variación Permitida" ubicadas en la parte inferior de la ventana.

Con base en la información que se muestra en la ventana de *Barridos Netos*, el usuario podrá decidir concretar la operación, haciendo "clic" en los botones de *Comprar* o *Vender*, y ejecutar el barrido. La ventana se cerrará automáticamente.

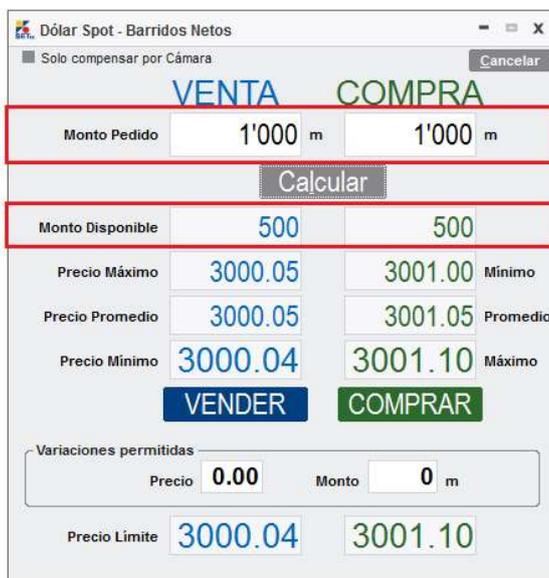
Una vez se inicie el barrido, el Sistema siempre intentará cumplir el **Monto Disponible** hasta el **Precio Límite** y las transacciones se ejecutarán de acuerdo con lo que cada contraparte haya definido previamente (a través de su perfil Administrador de Cupos) en relación a si obliga o no a enviar la operación a la CCDC.

Si hay cambios en la profundidad del mercado, desde la orden de Venta/Compra hasta que la orden es procesada por el Sistema, este buscará las posturas que se encuentren en los rangos permitidos para completar el barrido y hasta el **precio límite**. En este sentido, el Sistema siempre buscará las mejores posturas disponibles respetando el precio límite para cumplir el monto requerido.

En caso de que el sistema no encuentre el monto solicitado sino uno menor, lo informará al usuario cambiando los valores del monto, como se aprecia a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 101 / 116



En caso de que los montos especificados por el usuario no estén disponibles por completo por no haber cupos suficientes en el mercado, la ventana 'Barridos netos' mostrará únicamente los montos de compra y de venta que estarían disponibles.

14.1. BARRIDOS CON PUNTAS EN GOTEO – CANTIDAD VISIBLE

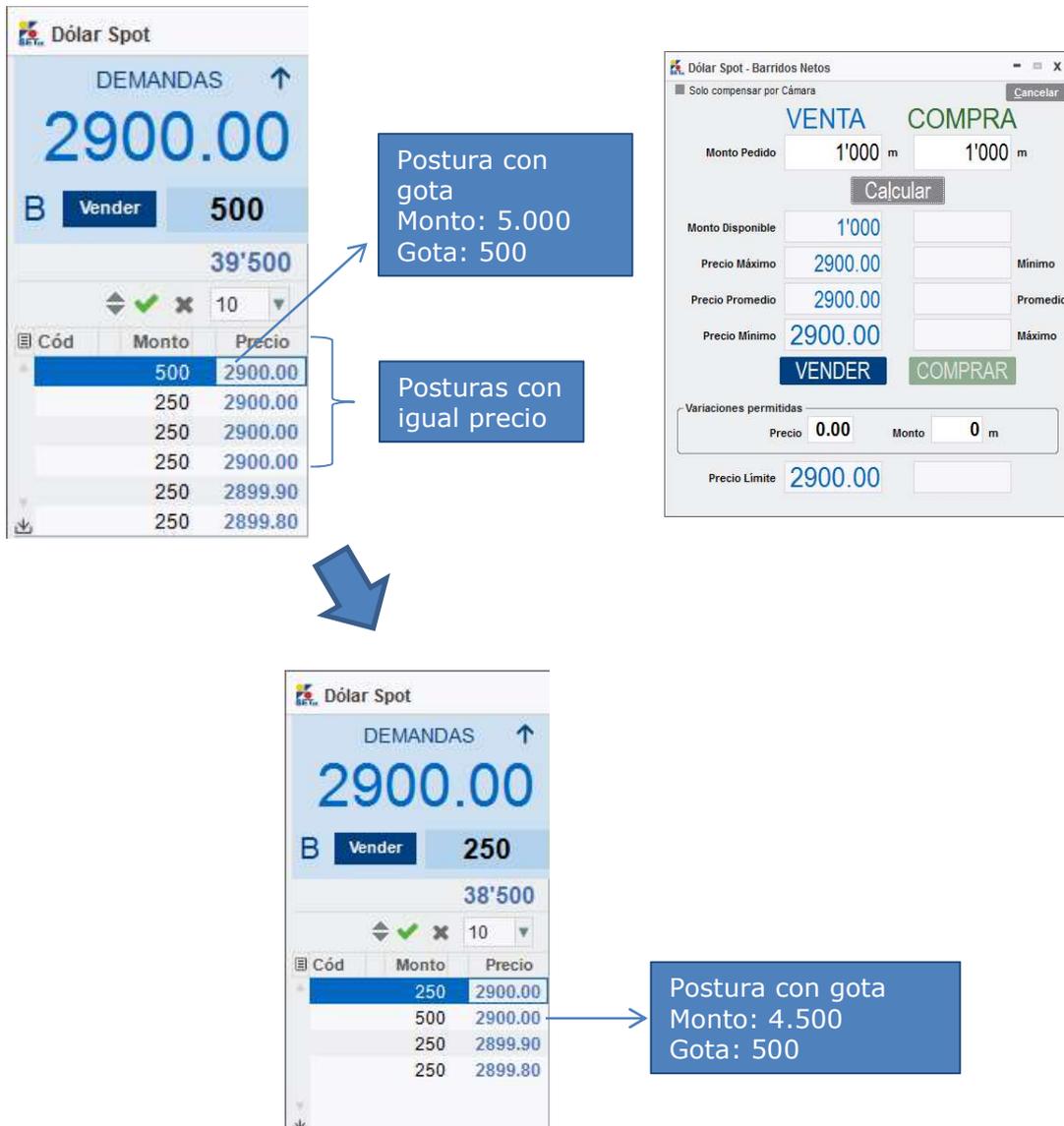
Si dentro de los límites del barrido neto se encuentra una postura en modalidad GOTEO (cantidad visible), el sistema dará prioridad a las posturas visibles al mismo precio de la gota de acuerdo con la siguiente descripción:

En el caso en el que se realice una agresión sobre una postura con la condición de gota, y si el monto solicitado supera el monto visible de la gota, el Sistema calzará solamente la primera cantidad visible de la postura, posteriormente buscará las posturas siguientes al mismo precio. Una vez agrede las posturas visibles al mismo precio, agrede nuevamente la siguiente cantidad visible de la postura inicial en gota.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 102 / 116

Es decir, si el monto total visible de una postura con condición gota, es calzado producto de una agresión múltiple, y en ese momento existe una o más posturas al mismo precio, la postura agredida perderá su prioridad y se ubicará al final de las demás posturas que tengan mismo precio.



Postura con gota
Monto: 5.000
Gota: 500

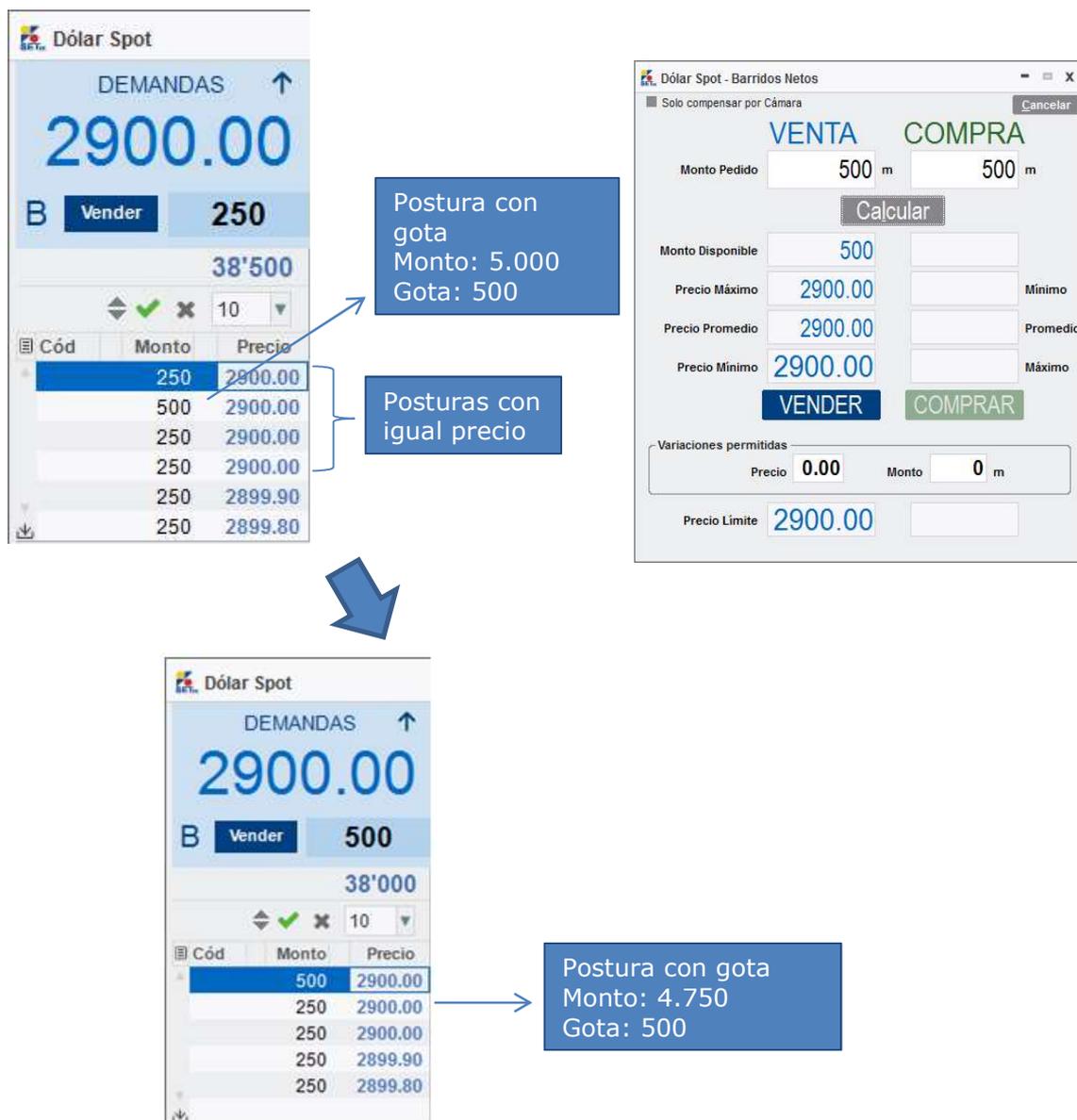
Posturas con igual precio

Postura con gota
Monto: 4.500
Gota: 500

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 103 / 116

En el caso en el que la agresión de la postura visible con la condición de gota sea parcial, esta mantendrá su posición frente a las demás posturas del mismo precio, y no perderá su prioridad.



The image illustrates the execution of a sell order with a limit condition in the Dólar Spot market. It consists of three main screenshots and explanatory text boxes:

- Initial Order Entry:** The 'Dólar Spot' window shows a sell order ('Vender') for 250 units at a price of 2900.00. The order book shows several orders at the same price (2900.00) and one at a lower price (2899.90).
- Order Execution:** A callout box indicates that the order is executed with a limit ('Postura con gota') for a partial amount of 5.000 units. The order book now shows the top order as 500 units at 2900.00.
- Order Entry Form:** The 'Dólar Spot - Barridos Netos' window shows the order entry form with 'Monto Pedido' set to 500 m and 'Precio Mínimo' set to 2900.00.
- Final Order Book:** The 'Dólar Spot' window shows the updated order book where the top order is 500 units at 2900.00. A callout box indicates that the order is executed with a limit ('Postura con gota') for a partial amount of 4.750 units.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 104 / 116

VENTANA DÓLAR SPOT

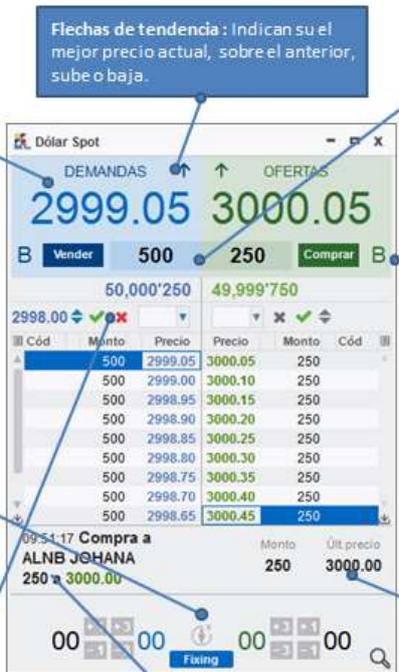
En la barra principal de Sistema SET-FX se encuentra el botón: , el cual permite ingresar a los diferentes mercados activos para el usuario. Al hacer clic sobre este botón, aparece el menú inicial, sobre el cual el usuario debe ingresar en la opción: “Dólar” y al desplegarse el submenú, el usuario deberá hacer clic sobre la opción: “Dólar Spot”, como se muestra a continuación:



Al hacer clic sobre “Dólar Spot” aparece la siguiente ventana, sobre la cual se ilustran las funciones principales:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 02
		Página: 105 / 116



Precio y monto resaltado, que según la configuración podrá ser:

- El mejor precio del mercado.
- El mejor precio disponible para mí.
- El mejor precio disponible para mí o el mío si es el mejor.

Flechas de tendencia: Indican su el mejor precio actual, sobre el anterior, sube o baja.

Cupos Cámara: Muestra el monto disponible para negociar por Cámara. Cupo Compra en Verde y Cupo Venta en Azul.

Botón de Barridos Netos.

Matching

Barra de modificación rápida: Permite modificar o retirar el precio de una postura ingresada, sin necesidad de retirarla.

Datos de la última transacción realizada en el Sistema, por el usuario activo.

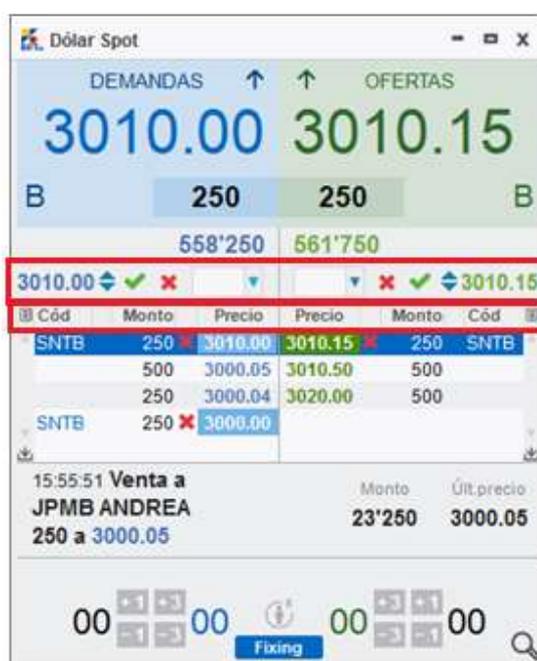
Estadística de último precio y suma de montos negociados en el mercado.

El código de la Entidad se encuentra en la primera columna de la ventana; a continuación el monto en color negro y los precios ingresados de color azul, verde, amarillo o rojo, según los cupos que se tengan on las diferentes contrapartes.

El Sistema provee la Barra de Modificación rápida, la misma que se encuentra en la ventana del mercado Spot.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

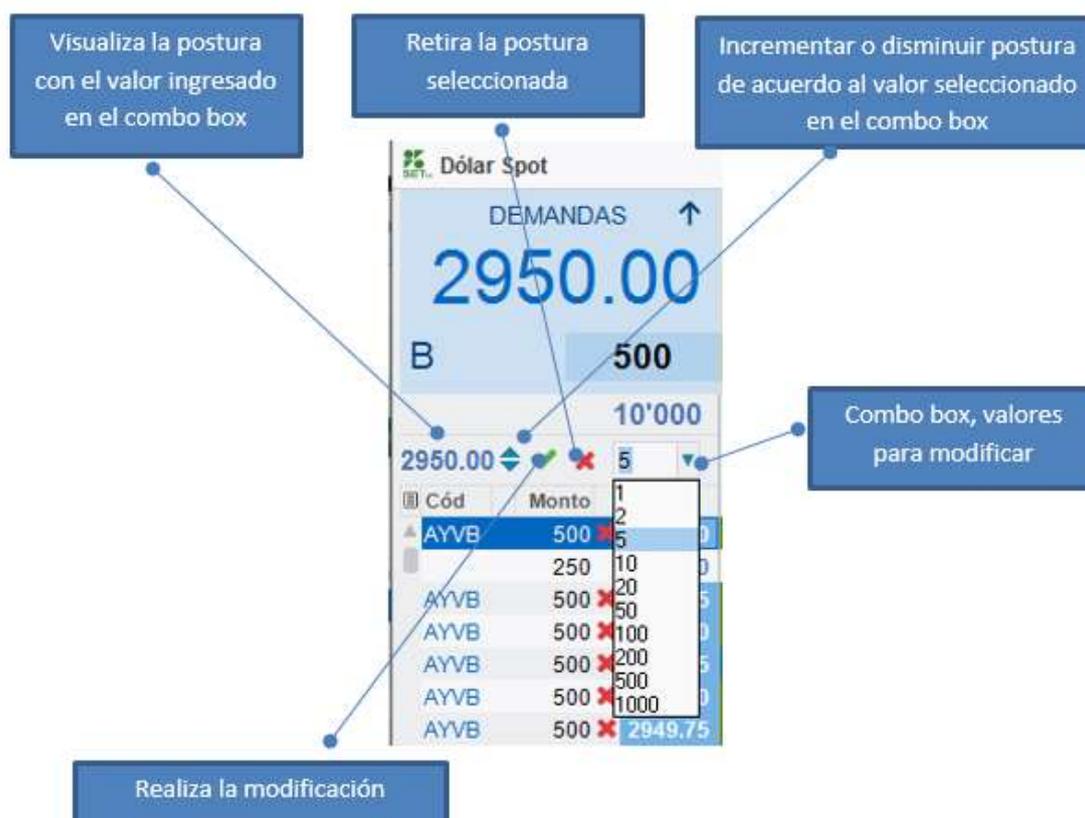
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 106 / 116



Esta barra actúa sobre la mejor de las posturas propias (está disponible tanto para demanda como para oferta) y permite modificar la postura sin necesidad de retirarla momentáneamente, pero sólo se puede modificar el precio. No se puede modificar el monto o las características de la misma.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02 Página: 107 / 116



15. OPCIONES SOBRE TRANSACCIONES REALIZADAS

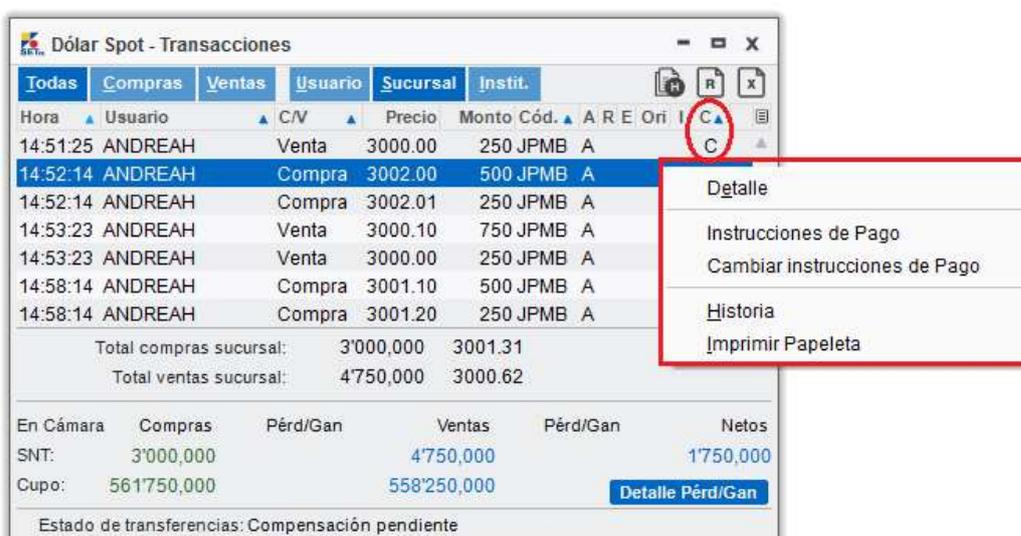
Sobre cada transacción que se encuentra en el blotter de operaciones se pueden realizar varias acciones que influyen en el procesamiento de la misma. Algunas pueden ser ejecutadas por una sola de las contrapartes y otras dependen de confirmación de las contrapartes y/o del Operador CCDC. A continuación se define cada una de ellas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 108 / 116

15.1. TRANSACCIONES COMPENSADAS POR CÁMARA

Las transacciones que son compensadas por Cámara, se identifican con la letra C; al realizar “clic derecho” sobre la operación se obtienen las siguientes opciones:



Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori
14:51:25	ANDREAH	Venta	3000.00	250	JPMB	A			
14:52:14	ANDREAH	Compra	3002.00	500	JPMB	A			C
14:52:14	ANDREAH	Compra	3002.01	250	JPMB	A			
14:53:23	ANDREAH	Venta	3000.10	750	JPMB	A			
14:53:23	ANDREAH	Venta	3000.00	250	JPMB	A			
14:58:14	ANDREAH	Compra	3001.10	500	JPMB	A			
14:58:14	ANDREAH	Compra	3001.20	250	JPMB	A			

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
SNT:	3'000,000		4'750,000		1'750,000
Cupo:	561'750,000		558'250,000		

La opción Detalle muestra las especificaciones de la operación.



Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 28/08/2017 Código: O3PD6Z4FKW Hora: 10:16:50

Comprador: ACCIONES Y VALORES S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Alexander Cardenas Por Cámara

Vendedor: BANCO DE OCCIDENTE S.A. Sucursal: CALI Persona: Jimmy Jose Tamayo

Precio: 2950.00 Monto USS: 500,000.00

Origen de transacción: Demanda aceptada por JIMMY

Comentario: Monto Pesos: 1,475'000,000.00

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 109 / 116

Instrucciones de Pago, muestra los datos de las cuentas donde se deben pagar las transacciones. Asimismo, la opción *Cambiar instrucciones de Pago*, le permite al usuario modificar los datos de las cuentas de pago, por otras cuentas.



Suc.	Moneda	Tipo	Forma de pago	Descripción	Dirección Swift	Fed. Aba	Chips Id
AYVB	COP	Debitar	Transferencia				
OCCC	USD	Debitar	Transferencia	Cuenta : 10950229 Banco : CITI BANK NA Ciudad : NEW YORK	CITIUS33	021000089	

La opción *Historia* muestra el detalle de los estados de la operación.



Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio SW	Monto	Tr/To T	Comentario
09/11/17	08:01:00	LVCB JOSER	Solicita registro	O	1 Semana	3125.00	250	250	
09/11/17	08:01:00	Motor de calce	Registro	O	1 Semana	3125.00	250	250	
09/11/17	11:07:37	Motor de calce	Solicitud aceptada	O	1 Semana	3125.00	250	250	
09/11/17	11:07:48	AGRB ANDRESB	Confirmación	O	1 Semana	3125.00	250		

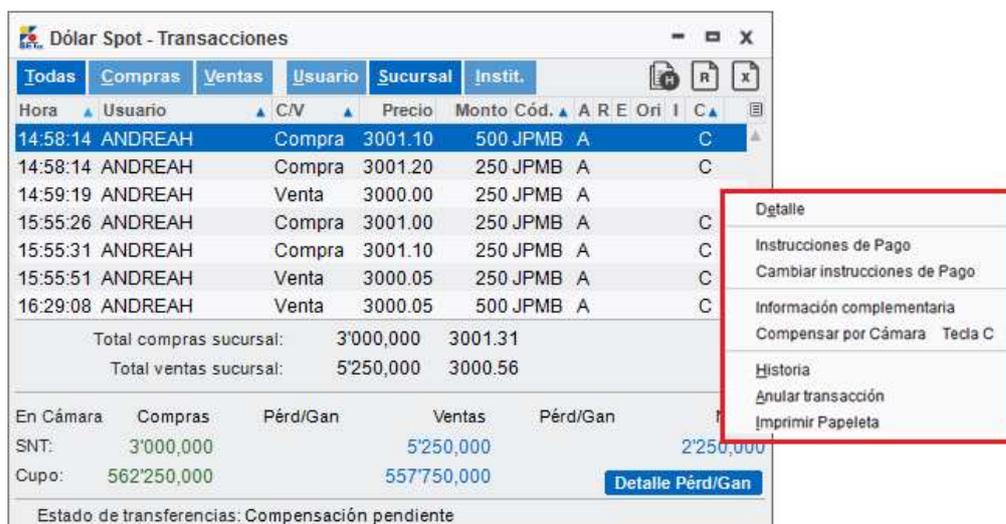
La opción *Imprimir papeleta* funciona solamente cuando el usuario ha configurado una impresora predeterminada en el menú configuración. En este caso el sistema enviará a impresión de manera automática a dicha impresora.

15.2. TRANSACCIONES NO COMPENSADAS POR CÁMARA

Las operaciones no compensadas tienen dos opciones adicionales a la mencionada anteriormente. Como se muestra en la siguiente ventana, la tercera operación no fue compensada en Cámara, pues no aparece la letra "C" bajo la columna con el mismo nombre "C" y al hacer clic derecho aparecen las siguientes opciones:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 110 / 116



15.2.1. Compensar por Cámara

Esta opción permite que el usuario pueda enviar a compensar la operación mientras este dentro de los horarios establecidos por la CCDC.

Al utilizar esta opción, el Sistema le envía una solicitud a la contraparte para su confirmación de envío a compensar la operación.

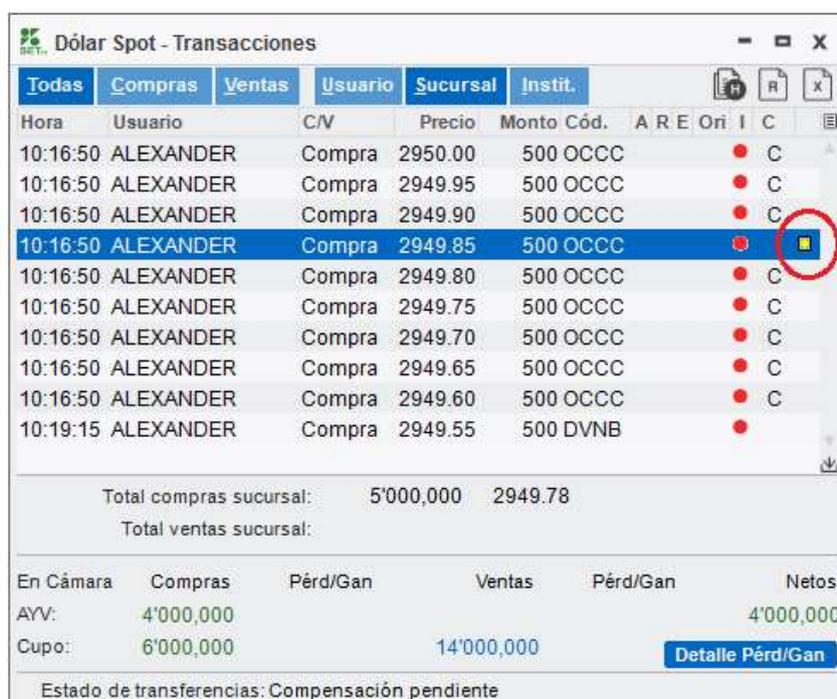
Al enviar la solicitud el Sistema le pide una confirmacion de envio:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 111 / 116

Mientras la Entidad contraparte no confirme la compensación la operación en el blotter de operaciones, esta tendrá un cuadro amarillo en el costado derecho tal y como se evidencia a continuación:



Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2950.00	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.95	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.90	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.85	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.80	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.75	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.70	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.65	500	OCCC						● C
10:16:50	ALEXANDER	Compra	2949.60	500	OCCC						● C
10:19:15	ALEXANDER	Compra	2949.55	500	DVNB						● C

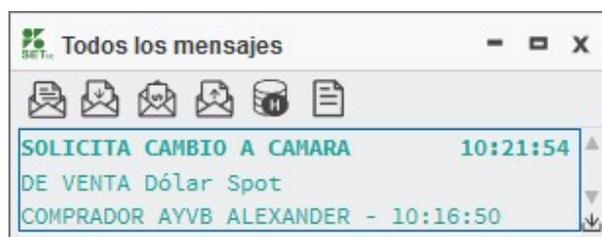
Total compras sucursal:		5'000,000	2949.78
Total ventas sucursal:			

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
AYV:	4'000,000				4'000,000
Cupó:	6'000,000		14'000,000		

[Detalle Pérd/Gan](#)

Estado de transferencias: Compensación pendiente

El usuario de la Entidad contraparte recibirá un mensaje con la solicitud de compensación:



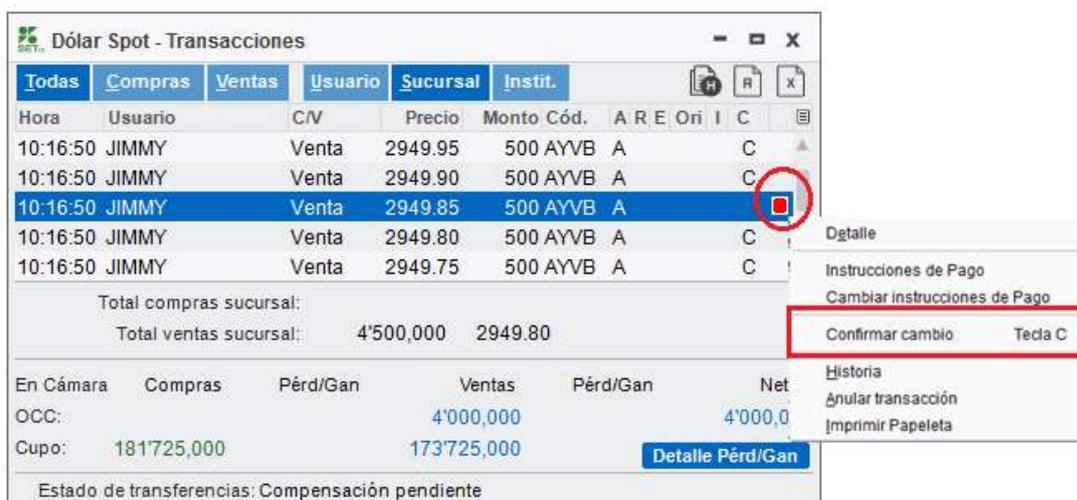
Todos los mensajes	
SOLICITA CAMBIO A CAMARA	10:21:54
DE VENTA Dólar Spot	
COMPRADOR AYVB ALEXANDER - 10:16:50	

La solicitud pendiente de confirmación se muestra en el blotter de operaciones con un cuadro rojo.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 112 / 116

Para confirmar la solicitud de confirmación se debe hacer “clic derecho” sobre la operación, y escoger la opción *Confirmar cambio*.



The screenshot shows a window titled "Dólar Spot - Transacciones" with a table of transactions. The table has columns: Hora, Usuario, C/V, Precio, Monto, Cód., A, R, E, Ori, I, C. The third row is selected, and a context menu is open over it. The menu options are: Detalle, Instrucciones de Pago, Cambiar instrucciones de Pago, Confirmar cambio (highlighted with a red box), Tecla C, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta. Below the table, there are summary statistics for purchases and sales, and a button for "Detalle Pérd/Gan".

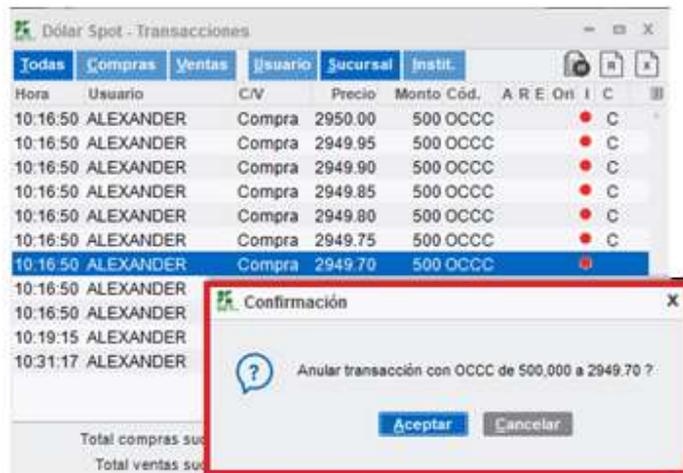
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.						
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	I	C
10:16:50	JIMMY	Venta	2949.95	500	AYVB	A					C
10:16:50	JIMMY	Venta	2949.90	500	AYVB	A					C
10:16:50	JIMMY	Venta	2949.85	500	AYVB	A					C
10:16:50	JIMMY	Venta	2949.80	500	AYVB	A					C
10:16:50	JIMMY	Venta	2949.75	500	AYVB	A					C
Total compras sucursal:											
Total ventas sucursal:			4'500,000	2949.80							
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Net						
OCC:			4'000,000		4'000,0						
Cupo:	181'725,000		173'725,000								
Estado de transferencias: Compensación pendiente											

15.2.2. Anular transacciones

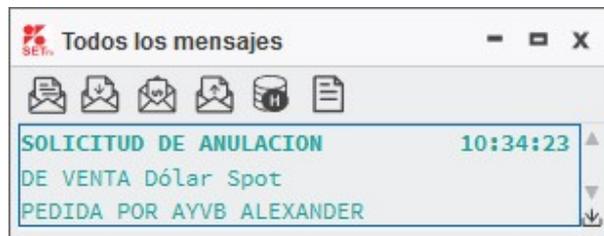
Cuando una operación debe ser anulada y está dentro los tiempos establecidos para anulación, las entidades involucradas deben hacer su solicitud a la CCDC, en los términos que esta establezca. Una vez la Cámara la ha desmarcado y haya notificado a la entidad, la operación podrá ser anulada en el Sistema. En este caso una de las Entidades debe enviar la solicitud de anulación y la contraparte podrá confirmar o rechazar la solicitud de anulación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

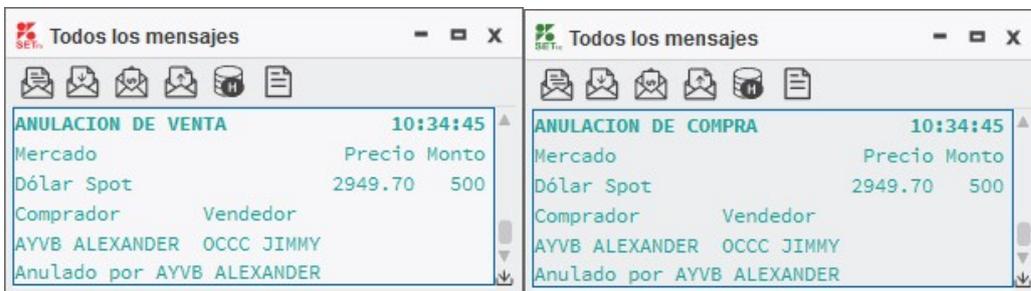
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 113 / 116



A continuación un ejemplo del mensaje que recibe la Entidad con la solicitud de anulación:



Al confirmar la anulación, en las bitacoras de mensajes a cada Entidad aparecerá el mensaje con los detalles de la anulación:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 114 / 116

15.2.3. Modificar transacciones

La modificación de operaciones de contado sólo podrá realizarse en atención a lo expuesto por la Circular Externa Reglamentaria DODM-317 expedida por el Banco de la República, así como las normas que lo modifiquen, deroguen o complementen y en atención al siguiente procedimiento:

- a. El afiliado interesado en realizar la modificación de una operación deberá informar dicha situación al administrador del Sistema a través de un medio verificable, bien sea mediante el “chat” del SET-FX, correo electrónico o vía voz (llamada telefónica). En el caso de operaciones realizadas entre dos IMC afiliados, ambos deben informar al administrador la intención de modificación.
- b. En este sentido, será responsabilidad del afiliado ingresar una nueva operación corregida, incluyendo en el campo “Comentario” el código único de la operación que contiene el error. Luego de esto, informa al administrador que ya ingresó la operación correcta.



En el caso de operaciones realizadas entre dos IMC afiliados al sistema, uno de los afiliados ingresa la nueva operación corregida, incluyendo en el campo “Comentario” el código único de la operación que contiene el error y el otro afiliado la acepta. Luego de esto informa al administrador que ya ingresó la operación correcta.

- c. Una vez el administrador confirma el ingreso de la nueva operación, este procede a habilitar el sistema y el afiliado anula la operación incorrecta mediante el mecanismo de anulación de operaciones.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 115 / 116



Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	C
08:00:00	ANDRESB	Venta	3010.00	250.457.000						
08:01:00	ANDRESB	Venta	3000.00							
09:10:00	ANDRESB	Venta	3000.00							
09:29:04	ANDRESB	Venta	3000.00							
09:35:00	ANDRESB	Venta	3000.00							
12:13:56	ANDRESB	Venta	3000.00							
12:18:17	ANDRESB	Venta	3000.00							

Total compras sucursal: _____
Total ventas sucursal: 21'750,7

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	ventas	Perd/Gan	Netos
AGR:	27'001,000		11'500,000		15'501,000
Cupo:	284'499,000		315'501,000		

Estado de transferencias: Compensación pendiente

d. Efectuada la anulación por parte del afiliado, deberá informar al Administrador con el fin que éste último proceda a cerrar la habilitación del Sistema.

En el caso de operaciones entre dos IMC que tengan problemas de cupo en la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC), se podrá realizar la anulación de la operación antes del ingreso de la operación corregida.

Así mismo, para operaciones de contado entre Intermediarios del Mercado Cambiario (IMC), en el caso en que las operaciones ya hubiesen sido enviadas y aceptadas para su compensación y liquidación en la CCDC, la modificación de dichas operaciones estará sujeta a la autorización previa de esta entidad.

Nota: La modificación de operaciones solamente procederá de conformidad con la regulación vigente, por lo tanto si bajo las normas aplicables alguna operación no es modificable, el afiliado deberá abstenerse de realizar este procedimiento.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 02
		Página: 116 / 116

16. INFORMACIÓN ADICIONAL

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

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha:	Fecha:	Fecha: 16/02/2018