

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 1 / 54</b>



**MANUAL DE USUARIO**

**MERCADO SWAP**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 2 / 54</b>

## Contenido

<b>1. Introducción</b> .....	4
<b>2. Mercado Swap</b> .....	4
<b>2.1. Cálculo del precio Spot</b> .....	4
<b>2.2. Ingreso Al Mercado Swap</b> .....	5
<b>2.3. Barra De Herramientas Dólar Swap</b> .....	6
<b>2.4. Ingreso de Posturas</b> .....	7
<b>2.5. Días Anteriores</b> .....	8
<b>2.6. Solicitudes de Registro</b> .....	9
<b>2.7. Anulaciones y Solicitudes de Anulación</b> .....	10
<b>2.8. Transacciones y Posición</b> .....	11
<b>2.9. Gráficos y Precios</b> .....	11
<b>2.9.1. Gráfico Tasas/Montos De Transacciones De Hoy</b> .....	12
<b>2.9.2. Gráfico Historia De Tasas/Montos Transacciones</b> .....	12
<b>2.9.3. Gráfico Tasas De Mejor Demanda/Ofertas De Hoy</b> .....	13
<b>2.9.4. Gráfico Historia De Tasas De Mejor Demanda /Oferta</b> .....	14
<b>2.10. Consultas</b> .....	14
<b>2.11. Operaciones por Registro</b> .....	16
<b>2.12. Administración de Limites (Cupos)</b> .....	19
<b>2.12.1. Compartición de Cupos</b> .....	26
<b>3.1. Realizar Transacciones</b> .....	32
<b>3.2. Anulación De Operaciones De Registro</b> .....	35
<b>3.3. Modificación De Operaciones De Registro</b> .....	36
<b>3.4. Blotter De Transacciones</b> .....	41

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 3 / 54</b>

<b>4.</b>	<b>Compensación De Operaciones .....</b>	<b>42</b>
<b>4.1.</b>	<b>Causales De Rechazo .....</b>	<b>48</b>
<b>4.2.</b>	<b>Compensación De Operaciones De Dias Anteriores.....</b>	<b>48</b>
<b>4.3.</b>	<b>Anulación De Compensación.....</b>	<b>49</b>

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 4 / 54</b>

## 1. Introducción

SET-FX proporciona al mercado cambiario una herramienta de liquidez, aprovechando la experiencia y la estructura global del sistema de mercados financieros provisto por ICAP-Ecuador. El presente documento explica el uso del mercado Dólar Swap y se encuentra dedicado exclusivamente a los usuarios transaccionales y de registro de este mercado.

Lo dispuesto en este manual se encontrará sujeto a todas las normas que sobre el particular expida la Junta Directiva del Banco de la República como autoridad cambiaria del país. De existir cualquier contradicción entre este Manual y lo expuesto por la regulación cambiaria vigente, prevalecerá lo expuesto por la regulación vigente.

## 2. Mercado Swap

El mercado Swap de SET FX es un mercado que permite realizar operaciones de intercambio entre el dólar de los Estados Unidos y el peso Colombiano, en plazos predefinidos y plazos libres que estipula el usuario al momento de ingresar una demanda u oferta. Además, permitirá realizar Swaps diferidos (Forward - Forward), es decir, que inician en una fecha futura diferente a hoy y terminan en el plazo establecido para la operación.

### 2.1. Cálculo del precio Spot

Todas las operaciones Swap se basan en un precio Spot que se calcula a través de un promedio de los precios en la ventana de mercado Spot, o bien el último precio operado en caso de que no haya precios en el mercado. Para facilitar el uso de los precios de cambio al que se somete la operación Swap, el precio Spot siempre será un número entero sin decimales. El precio Spot será además el promedio de precios en pantalla o el último operado al que se le aplica el redondeo mencionado en la primera parte de este párrafo. Veamos un ejemplo:

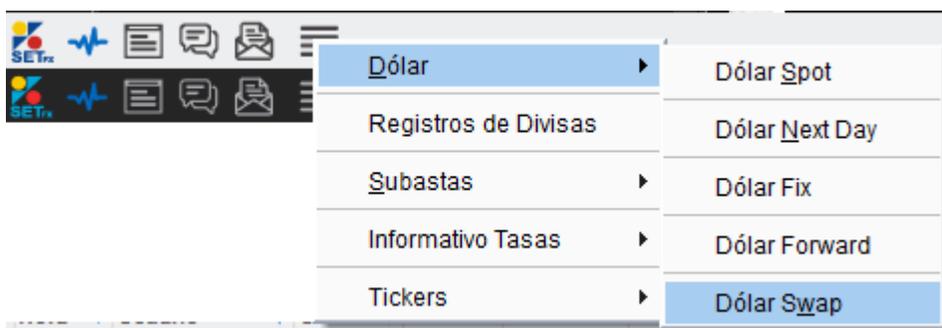
Precio Spot Demanda	Precio Spot Oferta	Último Precio	Precio Swap
2750.00	2750.80	2750.00	2751.00
2750.00	2750.60	2750.60	2750.00
		2751.60	2751.00
2750.00		2750.60	2751.00

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

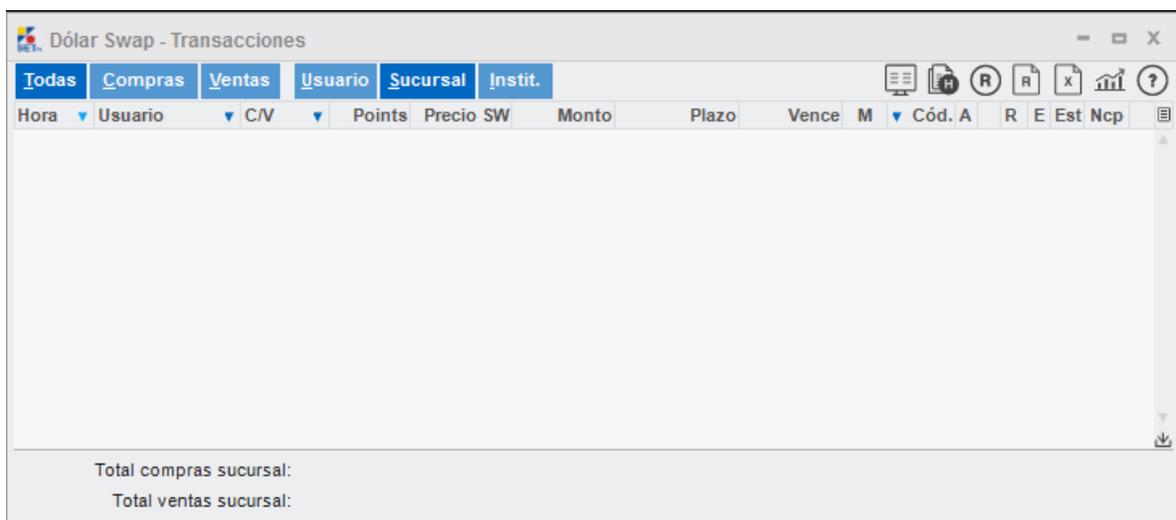
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 5 / 54</b>

## 2.2. Ingreso Al Mercado Swap

El ingreso se realiza a través de la ventana de mercados, como se muestra a continuación:



Al ingresar al mercado Swap se muestra la ventana del Blotter de operaciones:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 6 / 54</b>

## 2.3. Barra De Herramientas Dólar Swap

En la parte superior derecha del Blotter, se encuentran los botones con las principales funciones del mercado Swap.



A continuación se describen cada botón y su función:

FUNCION	ICONO	DESCRIPCION
Mercado Swap		Ingreso operaciones por tabla
Días Anteriores		Historial Blotter de operaciones
Registrar		Ingreso de registros
Solicitudes de registros		Estado de las solicitudes de registro
Anulaciones y solicitudes de anulación		Estado de la solicitudes de anulaciones
Gráficos y precios		Opciones de información histórica y del día
Consultas		Información histórica

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 7 / 54</b>

## 2.4. Ingreso de Posturas

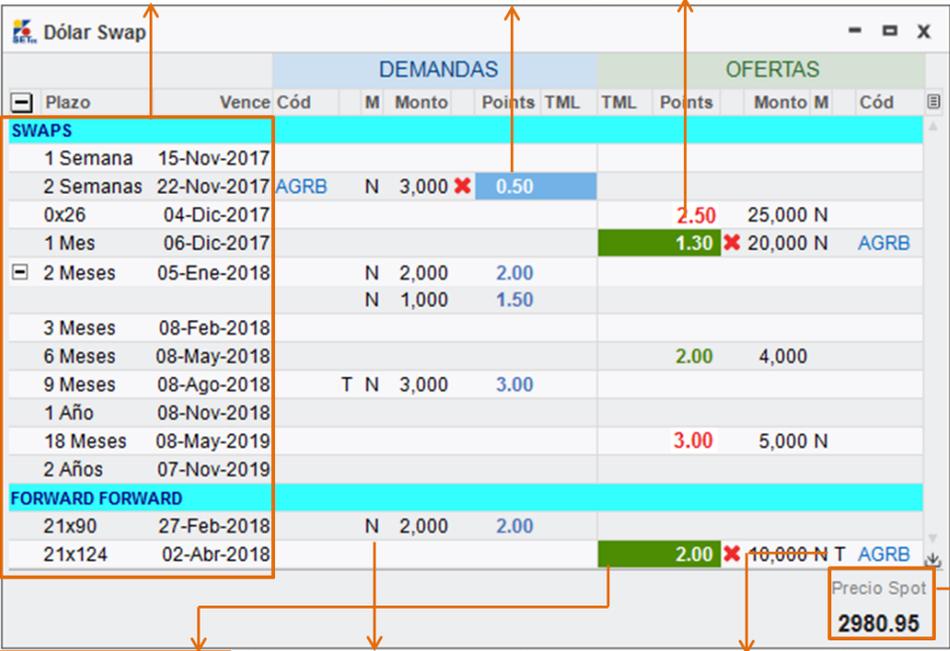
Si se desea ingresar posturas o calzar las que están en el mercado, se debe dar clic en el botón



Indica una descripción del plazo y los días correspondientes a su vencimiento. Dependiendo de los feriados, un plazo podrá contener más días reales de los indicados en su definición. Los plazos libres se diferencian por contener una fecha en su definición (16-Feb-2011) y los plazos diferidos por tener dos días separados por una x (2x4)

Para cada precio, se indican los puntos Swap y el monto.

Los precios con color de fuente rojo indican que no hay cupo suficiente para agredir la postura. Los de color azul en las demandas, y verde en las ofertas indican que existe cupo suficiente.



Los precios de las posturas propias se identifican por tener un fondo azul en las demandas, y verde en las ofertas. Adicionalmente contienen el código de la entidad.

Método: NON-Delivery (N)  
Delivery en blanco

Postura Total (T), en blanco  
Parcial

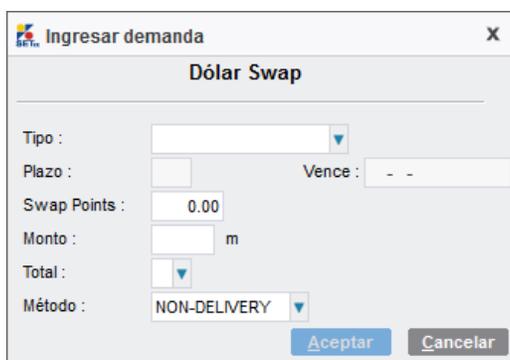
Se indica el precio Spot en basé al que se calcularán los cierres.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 8 / 54</b>

El sistema presenta el mejor precio de cada plazo en la primera línea, siendo posible ver la profundidad que existe en un plazo utilizado el botón “+” situado en la primera columna. Cuando la profundidad de un plazo se está mostrando el icono se verá como - .

Para ingresar una postura, se debe hacer clic derecho sobre “DEMANDAS” u “OFERTAS” y seleccionar la opción “Demandar” u “Ofertar”. También es posible ingresar posturas de Demanda u Oferta presionando las teclas F5 y F6 respectivamente.



## 2.5. Días Anteriores

“Con el botón  “Días anteriores” Se ingresa la fecha deseada y al dar clic al botón ir, se muestran las operaciones realizadas.



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
18:11:00	ANDRESB	Compra	1.00	3022.50	1'000,000	3 Meses	08/02/2018	NDF	AVVB	R			
18:11:00	ANDRESB	Venta	2.00	3023.50	10'000,000	3 Meses	08/02/2018	NDF	AVVB	R			
18:11:00	ANDRESB	Venta	2.00	3023.50	10'000,000	3 Meses	08/02/2018	NDF	AVVB	R			
18:11:00	ANDRESB	Compra	2.00	3023.50	10'000,000	1 Mes	06/12/2017	NDF	AVVB	R			

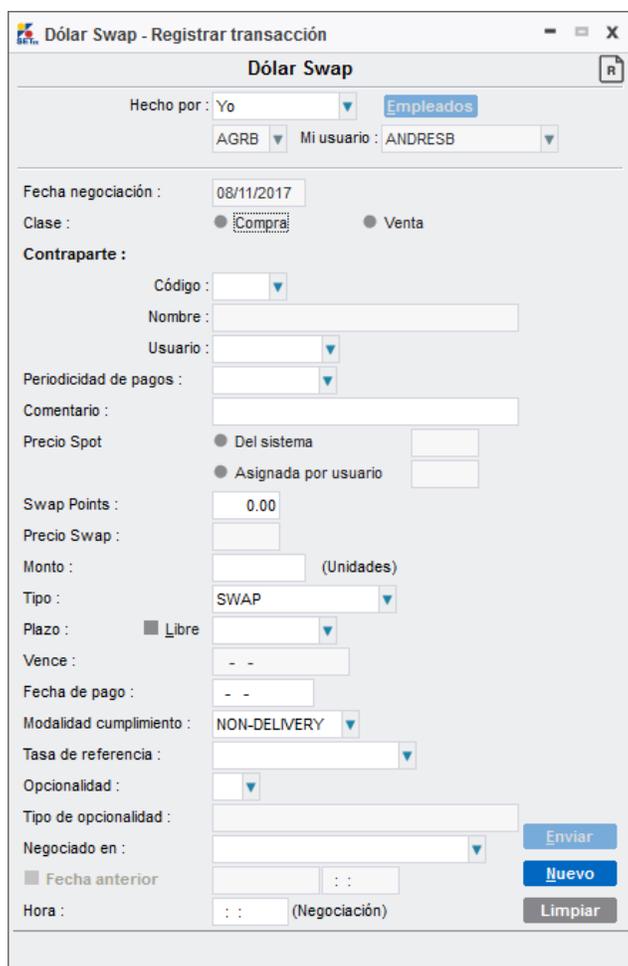
Total compras sucursal:  
Total ventas sucursal:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 9 / 54</b>

## 2.6.Solicitudes de Registro

Para registrar una operación, se debe hacer clic en el botón , e ingresar la información solicitada en los campos de la ventana “Dólar Swap – Registrar Transacción”.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 10 / 54</b>

Una vez enviada la solicitud de registro, el usuario de la contraparte debe aceptar o rechazar la solicitud. Este botón “Solicitudes de Registro”  le permitirá acceder a la Ventana de solicitudes de registro, donde podrán visualizar las solicitudes de compra/venta, enviadas, recibidas, expiradas, pendientes, confirmadas, rechazadas.



Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Recibidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes	Rechazadas
Hora	E/R	C/V	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo	Vence	Comentario	Estado
18:30:00	Recibida	Venta	AV-VILLAS	BOGOTA	1.00	1'000,000	6 Meses			Pendiente

## 2.7. Anulaciones y Solicitudes de Anulación

El botón  permite acceder a la Ventana “anulaciones y solicitudes de anulación” de registros, donde es posible visualizar los registros de compra/venta anulados, enviados, recibidos, expirados, pendientes, confirmados y rechazados.



Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Recibidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes	Rechazadas
Hora	E/R	C/V	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo	Vence	Comentario	R Estado
11:22:00	Enviada	Compra	AV-VILLAS	BOGOTA	1.00	1'000,000	2 Semanas	16/02/2018		R Confirmada



Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Recibidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes	Rechazadas
Hora	E/R	C/V	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo	Vence	Comentario	R Estado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 11 / 54</b>

## 2.8. Transacciones y Posición

Al acceder al icono “Transacciones y Posición”  En esta ventana se muestra un resumen de operaciones por compras y/o ventas para conocer su posición.

Dólar Swap - Compras							
Fecha: 08/11/2017						Sucursal: BOGOTA	
Hora	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo Vence	Comentario	R M
18:11:00	AV-VILLAS	BOGOTA	1.00	1'000,000	3 Meses 08/02/2018		R N
18:11:00	AV-VILLAS	BOGOTA	2.00	10'000,000	1 Mes 06/12/2017		R N
<b>Total compras :</b>		11'000,000					

Dólar Swap - Ventas							
Fecha: 08/11/2017						Sucursal: BOGOTA	
Hora	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo Vence	Comentario	R M
18:11:00	AV-VILLAS	BOGOTA	2.00	10'000,000	3 Meses 08/02/2018		R N
18:11:00	AV-VILLAS	BOGOTA	2.00	10'000,000	3 Meses 08/02/2018		R N
<b>Total ventas :</b>		20'000,000					

Dólar Swap - Resumen transacciones					
Sucursal	COMPRAS		VENTAS		Monto Neto
	Monto	Promedio	Monto	Promedio	
BOGOTA	11'000		20'000		-9'000
Nacional	11'000		20'000		-9'000

## 2.9. Gráficos y Precios

El botón “Gráficos Y Precios”  permite acceder a los diferentes gráficos del sistema, a continuación se detalla cada uno de ellos

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 12 / 54</b>



## 2.9.1. Gráfico Tasas/Montos de Transacciones De Hoy

Este gráfico muestra las operaciones realizadas en el día a nivel general.



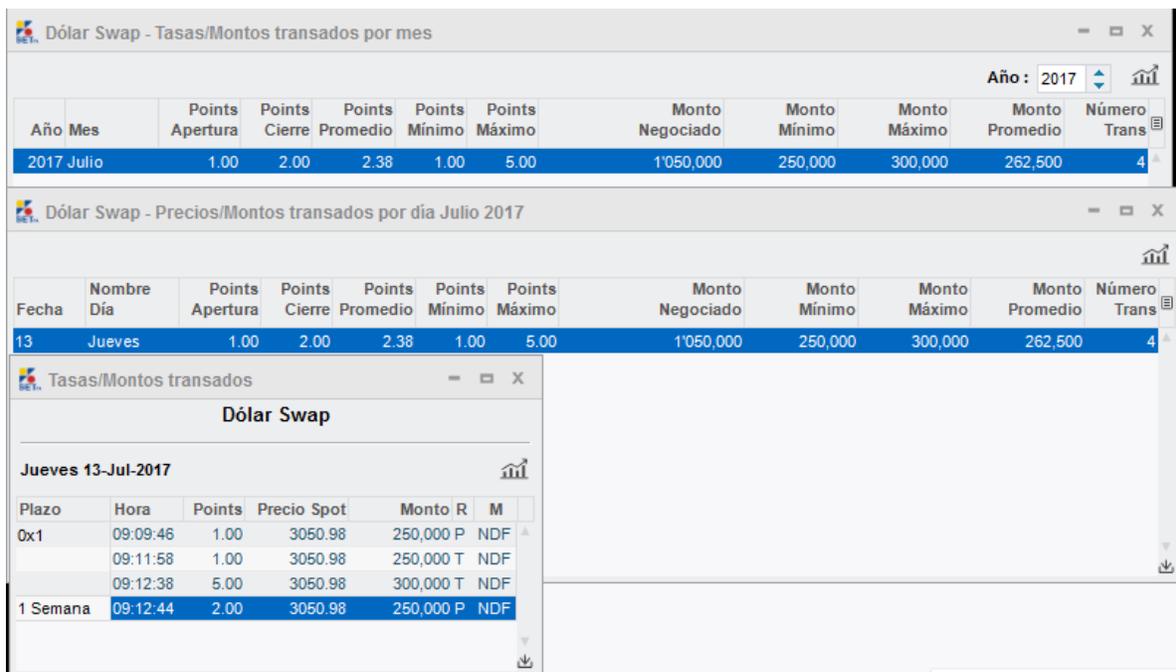
Plazo	Hora	Points	Precio Spot	Monto R	M
0x1	09:09:46	1.00	3050.98	250,000 P	NDF
	09:11:58	1.00	3050.98	250,000 T	NDF
	09:12:38	5.00	3050.98	300,000 T	NDF
1 Semana	09:12:44	2.00	3050.98	250,000 P	NDF

## 2.9.2. Gráfico Historia de Tasas/Montos Transacciones

Este gráfico muestra las transacciones por año. Al seleccionar el año, se muestra una gráfica que evidencia las estadísticas por meses. Ahora, si se hace doble clic sobre el mes, o sobre el día, mostrará las estadísticas mensuales o diarias, respectivamente.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 13 / 54</b>



The screenshot displays three windows from a financial application:

- Dólar Swap - Tasas/Montos transados por mes:** A summary table for July 2017.

Año Mes	Points Apertura	Points Cierre	Points Promedio	Points Mínimo	Points Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans
2017 Julio	1.00	2.00	2.38	1.00	5.00	1'050,000	250,000	300,000	262,500	4
- Dólar Swap - Precios/Montos transados por día Julio 2017:** A daily summary table for July 13, 2017.

Fecha	Nombre Día	Points Apertura	Points Cierre	Points Promedio	Points Mínimo	Points Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans
13	Jueves	1.00	2.00	2.38	1.00	5.00	1'050,000	250,000	300,000	262,500	4
- Tasas/Montos transados - Dólar Swap:** A detailed transaction log for Thursday, July 13, 2017.

Plazo	Hora	Points	Precio Spot	Monto R	M
0x1	09:09:46	1.00	3050.98	250,000 P	NDF
	09:11:58	1.00	3050.98	250,000 T	NDF
	09:12:38	5.00	3050.98	300,000 T	NDF
1 Semana	09:12:44	2.00	3050.98	250,000 P	NDF

### 2.9.3. Gráfico Tasas Mejor Demanda/Ofertras de Hoy

Esta gráfica muestra las tasas por hora del día, permitiendo visualizar por hora las demandas y ofertas con su respectivo plazo, como se evidencia a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 14 / 54</b>



Plazo	Hora	Demanda	Oferta
<b>SWAPS</b>			
0x1	08:56:46		1.00
	08:03:57	1.00	
0x4	08:06:48		0.00
1 Semana	09:12:39	1.00	
2 Semanas	09:08:34	5.00	
	08:45:42		20.00
<b>FORWARD FORWARD</b>			

## 2.9.4. Gráfico Historia Tasas Mejor Demanda /Oferta

Esta gráfica muestra el histórico de tasas por demanda y oferta logrando filtrar por día hábil tranzado, como se evidencia a continuación:

## 2.10. Consultas

Mediante el botón “Consultas” , se accede a esta ventana en la que se pueden realizar consultas de las transacciones realizadas por la entidad, mediante parámetros de periodos, clase de mensaje, y tipo de posturas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 15 / 54</b>

Tasas por hora

### Dólar Swap

Fecha: 12/07/2017

Plazo Hora	Demanda	Oferta
<b>SWAPS</b>		
<b>FORWARD FORWARD</b>		

Parámetros de consulta

### Dólar Swap

**Período**

13-Jul-2017

Hoy

Una fecha

Un mes

**Clase mensaje**

Ingreso

Transacción

Anulación

**Posturas**

Demandas

Ofertas

Sucursal: PPLB

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

Dólar Swap - Consulta de mensajes

Clase de mensaje: **Ingreso**      Período: **Hoy**

Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Plazo	Points	Monto	Monto Total T
13/07/2017	07:52:36	PPLB	CAMILOC	D	1 Semana	1.00	250,000	
13/07/2017	07:52:50	PPLB	CAMILOC	O	0x1	1.00	300,000	
13/07/2017	07:53:14	PPLB	CAMILOC	D	1 Semana	1.00	500,000	
13/07/2017	07:53:45	PPLB	CAMILOC	O	0x1	4.00	250,000	
13/07/2017	07:55:46	PPLB	CAMILOC	D	1 Semana	2.00	250,000	
13/07/2017	09:12:21	PPLB	CAMILOC	O	0x1	5.00	300,000	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 16 / 54</b>

## 2.11. Operaciones por Registro

Desde el Blotter de operaciones es posible enviar nuevos registros. Presionando el botón , se muestra la ventana de registro en la cual será necesario ingresar todos los datos correspondientes de la operación a registrar:



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
09:09:46	CAMILOC	Venta	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB	A			
09:11:58	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB	A			
09:12:38	CAMILOC	Venta	5.00	3055.98	300,000		0x1	14/07/2017	NDF	DVNB			
09:12:44	CAMILOC	Compra	2.00	3052.98	250,000	1 Semana	21/07/2017	NDF	DVNB				

Es importante aclarar que las operaciones por Registro NO afectan los cupos.

Los registros pueden ser enviados de las siguientes tres (3) formas para indicar quien es el propietario:

- **Yo:** Indica que el dueño del registro es el usuario que tiene la aplicación SET-FX y es él quien registra la operación.
- **Usuario SET-FX:** Indica cualquier otro usuario de la institución que tiene el aplicativo SET-FX pero no es el propietario del registro
- **Otro:** Indica cualquier empleado de la institución quien no tiene el aplicativo SET-FX

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> Administrar SET-FX
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 17 / 54</b>

**Registrar transacción**

### Dólar Swap

Hecho por : Yo Empleados

PPLB Mi usuario : CAMILOC

---

Fecha negociación : 13/07/2017

Clase :  Compra  Venta

**Contraparte :**

Código :

Nombre :

Usuario :

Periodicidad de pagos :

Comentario :

Precio Spot  Del sistema

Asignada por usuario

Swap Points : 0.00

Precio Swap :

Monto :  (Unidades)

Tipo : SWAP

Plazo :  Libre

Vence : - -

Fecha de pago : - -

Modalidad cumplimiento : NON-DELIVERY

Tasa de referencia :

Opcionalidad :

Tipo de opcionalidad :

Negociado en :

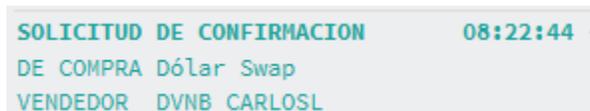
Fecha anterior  : :

Hora : : : (Negociación) Aceptar Cancelar

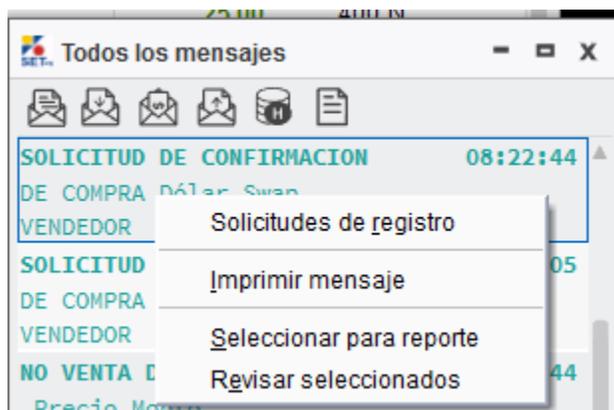
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 18 / 54</b>

Una vez hecha la solicitud por cualquiera de las partes precedentes, en el chat de la contraparte llegará dicha solicitud de registro, como se muestra a continuación:



La contraparte podrá dar clic derecho sobre la solicitud, lo que permite desplegar un menú con 4 opciones: “Solicitudes de registro”, “Imprimir mensaje”, “Seleccionar para reporte” y “Revisar seleccionados”. La contraparte debe dar clic en la opción “Solicitudes de registro”, para que dicho registro bien sea aceptado o rechazado:



Dólar Swap - Solicitudes de registro										
Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Regibidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes	Rechazadas
Hora	E/R	C/V	Nombre	Sucursal	Points	Monto	Plazo	Vence	Comentario	Estado
08:00:01	Enviada	Venta	DAVIVIENDA	BOGOTA	0.00	250	1 Semana	21/07/2017	venta	Expirada
08:01:01	Recibida	Venta	DAVIVIENDA	BOGOTA	0.00	250	1 Semana	21/07/2017	compra	Expirada
08:02:01	Recibida	Compra	DAVIVIENDA	BOGOTA	0.00	250	0x1	14/07/2017		Expirada
08:02:03	Recibida	Compra	DAVIVIENDA	BOGOTA	0.00	300	0x1	14/07/2017		Expirada
08:02:05	Enviada	Venta	DAVIVIENDA	BOGOTA	1.00	250	0x1	14/07/2017		Expirada

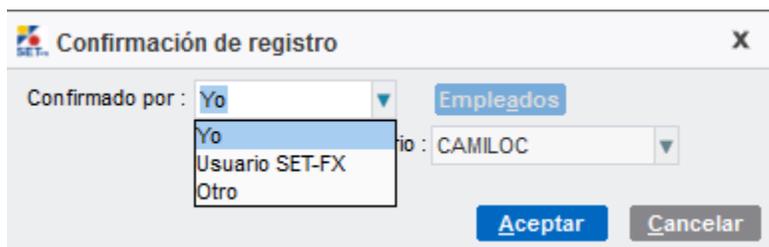
El registro también puede ser confirmado por:

- **Yo:** Es el usuario que posee la aplicación SET-FX y es quien registra el negocio.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 19 / 54</b>

- **Usuario SET-FX:** Cualquier otro usuario de la institución que posee aplicativo SET-FX.
- **Otro:** Cualquier empleado de la institución que no posee aplicativo.

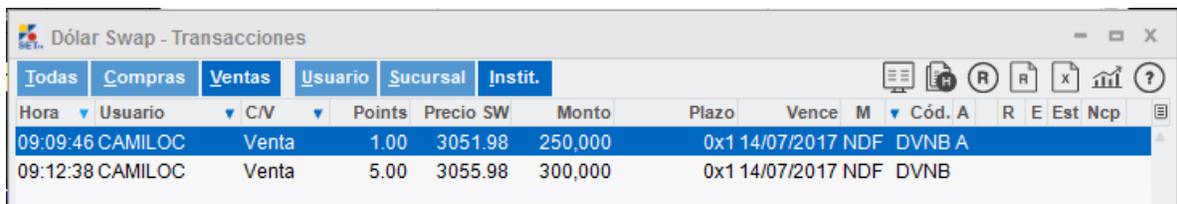


En el chat y Blotter de ambas entidades se mostrarán los datos del Registro aceptado, incluyendo la fecha de vencimiento:

```

COMPRA Dólar Swap          09:35:49
Inst Usuario      Puntos      Monto
DVNB CARLOSL      1.00      250,000
Plazo:1 Semana 21/07/2017, NON-DELIVERY
Precio Swap : 3051.98

```



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
09:09:46	CAMILOC	Venta	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB	A			
09:12:38	CAMILOC	Venta	5.00	3055.98	300,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB				

## 2.12. Administración de Límites (Cupos)

El sistema de límites, es idéntico al que usan los diferentes mercados de sistema.

- Es necesario asignar límites para poder operar
- Los cupos se manejan desde la ventana de Límites/Cupos

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 20 / 54</b>

- Para acceder a Límites/Cupos, se debe marcar la ventana del Mercado Swap y seleccionar en la barra de herramientas el botón .



A continuación se muestra la ventana de Límites/Cupos, en la cual se administran las líneas de crédito con las distintas contrapartes. Antes de ver una explicación de cómo se configuran los límites se hará la siguiente aclaración de los conceptos límite y cupo que maneja el sistema:

- Límite: Es el equivalente al concepto de línea de crédito, es decir el monto máximo asignado a la contraparte para realizar transacciones
- Cupo: Es la diferencia entre el límite y el monto en transacciones que todavía no han sido liberadas. Es decir, es aquella parte que queda disponible del límite.

Indica tipo de Mercado

Tipo configuración de cupos

Dólar Swap - BANCO POPULAR S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales Comparte con : Dólar Forward

Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.	300,000'000,000	299,849'992,497	3,000'000,000	2,849'994,500
PPL	BANCO POPULAR S.A.	3,000'000,000	2,850'000,000	3,000'000,000	2,850'000,000

Aumenta las entidades que no se encuentren dentro del listado de cupos.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 21 / 54</b>

El proceso de asignación de límites (líneas de crédito) en el sistema es el siguiente:

- Seleccionar de la lista la institución a la que se quiere asignar línea de crédito
- Con clic derecho sobre la columna de límite de compra/venta o cupo de compra/venta aparecerá un menú flotante



- Opción detalle: Esta opción muestra la configuración y los valores actuales de límites y cupos de la respectiva entidad.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 22 / 54</b>

Dólar Swap - BANCO POPULAR S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales  
Para compras y ventas.

Institución contraparte: DVN BANCO DAVVIENDA S.A.

### COMPRA

Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA		150'007,503		
Nacional	300,000'000,000	150'007,503	299,849'992,497	299,849'992,497

### VENTA

Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA		150'005,500		
Nacional	3,000'000,000	150'005,500	2,849'994,500	2,849'994,500

**Crear registros**

- Opción Modificar Limite: En esta casilla ingresa el límite (Línea de Crédito) en pesos y luego se hace clic en “Aceptar”.

Modificar límite nacional

Institución: DVN BANCO DAVVIENDA S.A.

Compra/Venta: Compra

Límite: 300,000'000,000

**Aceptar** **Cancelar**

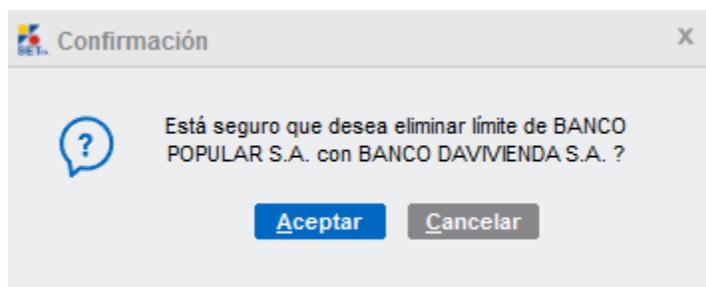
- Opción Modificar Cupo

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

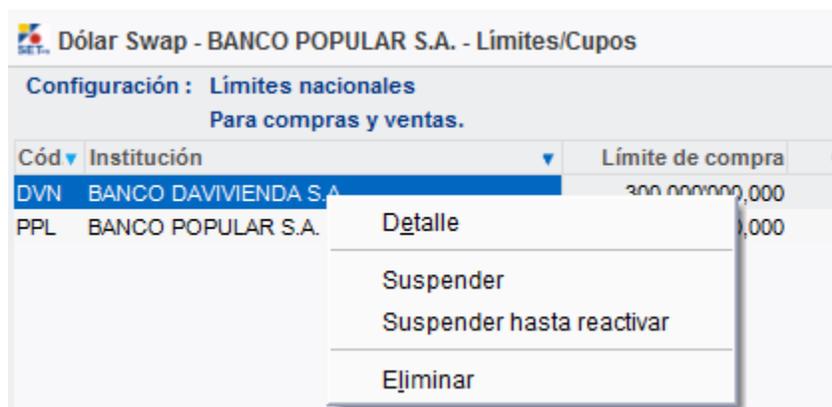
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 23 / 54</b>



- Opción Eliminar: elimina el monto que tenga asignado la entidad contraparte.



- Al seleccionar la entidad y dar clic derecho sobre la misma, encontrara las siguientes opciones:

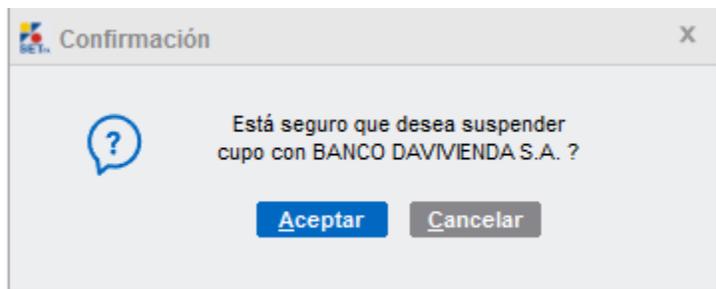


Cód	Institución	Límite de compra	C
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.	300 000 000,000	
PPL	BANCO POPULAR S.A.	0,000	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
		<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 24 / 54</b>

- Suspende: Al utilizar esta opción se suspende los cupos sobre la entidad seleccionada durante el día.



Para reactivar el cupo con la entidad se oprime clic derecho sobre la entidad y selecciona la opción reactivar.

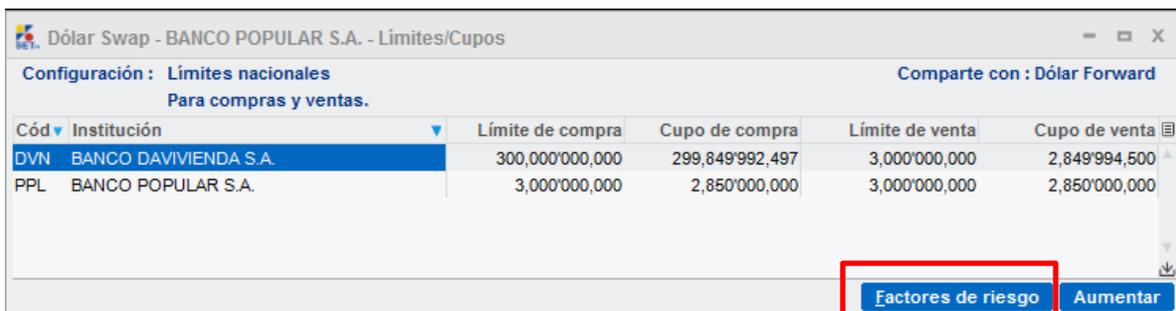
- Suspende hasta reactivar: Interrumpe el uso de cupos hasta que esta opción sea reanudada manualmente por el usuario
- Eliminar: elimina la entidad seleccionada del listado de instituciones de cupos.

En cualquiera de las opciones de cupos (por compras y ventas, netos o globalizados), se debe realizar la respectiva asignación a cada una de las instituciones ingresadas en la ventana de “Límites y cupos”.

Adicionalmente, para el Mercado Swap, se debe asignar un Factor de Riesgo para cada plazo, el cual es definido por los afiliados. Para ingresar el Factor de Riesgo se hace clic sobre el botón “Factor de Riesgo” que se encuentra en la opción Límites/Cupos, tal y como se muestra en la siguiente imagen:

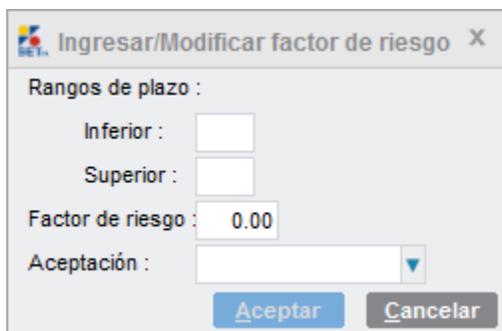
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 25 / 54</b>



Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
DVN	BANCO DAVIVIENDA S.A.	300,000'000,000	299,849'992,497	3,000'000,000	2,849'994,500
PPL	BANCO POPULAR S.A.	3,000'000,000	2,850'000,000	3,000'000,000	2,850'000,000

Una vez se haga clic en el botón “Factor de Riesgo”, se deben especificar los plazos y el factor de riesgo asignado para ese plazo.

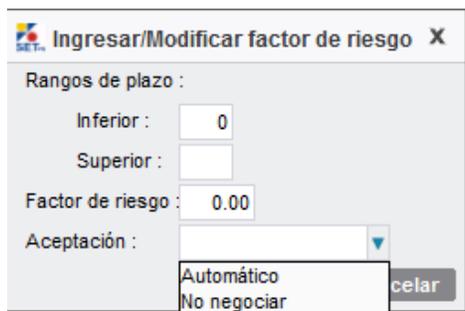


Cada entidad ingresa rangos de plazos y un porcentaje de afectación para cada uno, esto aplicará para todas sus contrapartes. Cada vez que se realiza una transacción, el límite con la respectiva contraparte va a afectarse por un valor equivalente al monto de la transacción realizada multiplicado por el porcentaje de Factor de Riesgo correspondiente.

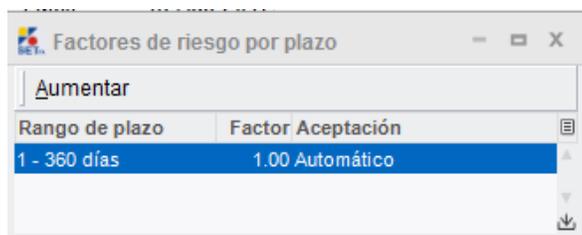
En la ventana del “Factor de Riesgo” también se determinará la Modalidad de Aceptación. En la opción “Automático”, el sistema permite el calce de operaciones en el plazo autorizado, si por el contrario se selecciona “No Negociar”, el Sistema no permitirá negociar operaciones en el plazo correspondiente.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 26 / 54</b>



El Sistema recalcula todos los días el monto de afectación de los cupos, pasando de un rango a otro cuando el plazo así lo determina y liberando el cupo de la forma establecida y esperada.



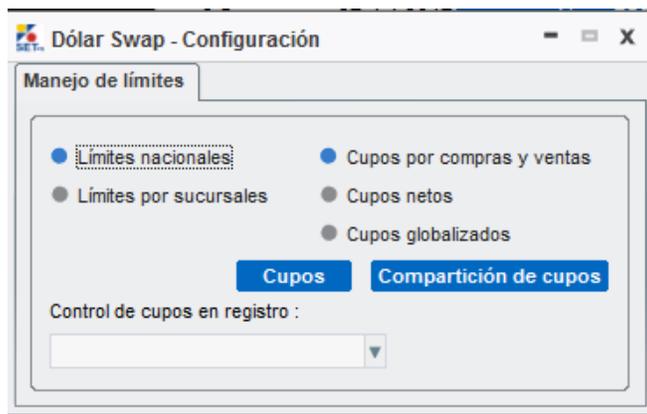
Rango de plazo	Factor Aceptación
1 - 360 días	1.00 Automático

## 2.12.1. Compartición de Cupos

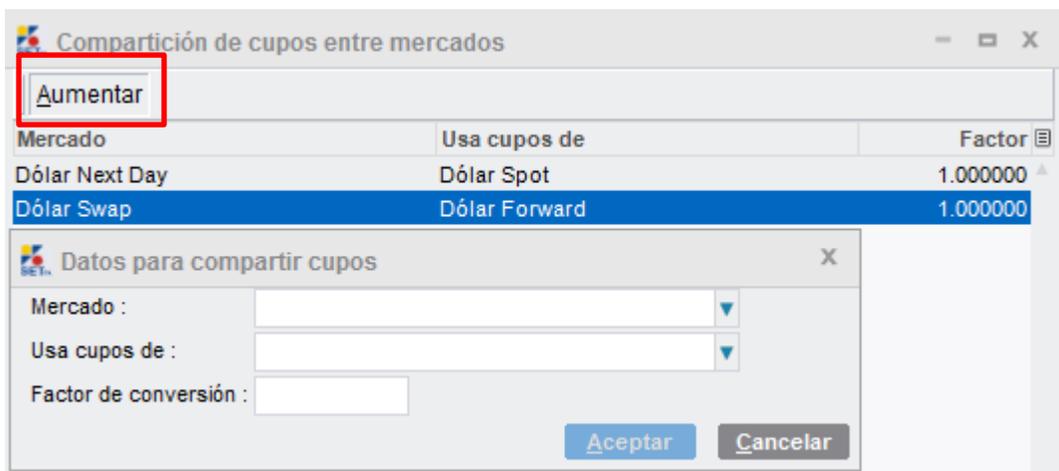
Los límites (cupos) se pueden compartir entre distintos mercados. Para compartir los cupos se accede por la opción configuración, identificada con el botón “Configuración” , permitirá ingresar al manejo de límites donde podemos identificar el botón “compartición de cupos”

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 27 / 54</b>



Aquí se abre una ventana adicional en la cual se indicará si está compartiendo cupos con otro mercado y el factor de conversión utilizado. También encuentra la opción “Aumentar” para ingresar una nueva configuración.



El factor de conversión indica que por cada dólar negociado (1) se descuenta un porcentaje de dólar del mercado (2). Si se indica 1 en el factor de conversión, quiere decir que por cada dólar negociado en (1) se descuenta 1 dólar del cupo del mercado (2).

Si la configuración no es la correcta, se pueden modificar o eliminar las opciones ingresadas dando clic derecho sobre la línea respectiva

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 28 / 54</b>



### 3. Manejo de Precios en el Mercado

Para ingresar una postura de demanda u oferta, se debe hacer clic en los iconos que se presentan a continuación:

FUNCION	ICONO	TECLA RAPIDA
Ingresar demanda		F5
Ingresar oferta		F6

Al pulsar cada botón aparecerá la ventana de ingreso de ofertas / demandas.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 29 / 54</b>

Nota: El módulo del mercado Swap de SET-FX permite realizar Swaps y Swaps diferidos (Forward-Forward). En este último, se registran dos operaciones; la entidad ofrece un compromiso de compra/venta en una primera fecha (T+1 en adelante) así como un compromiso de reventa/recompra en una segunda fecha futura. La definición de las dos fechas futuras se determina como se muestra en la imagen de Swap Diferido a continuación.

En la ventana de ingresar ofertas / demandas se debe escribir:

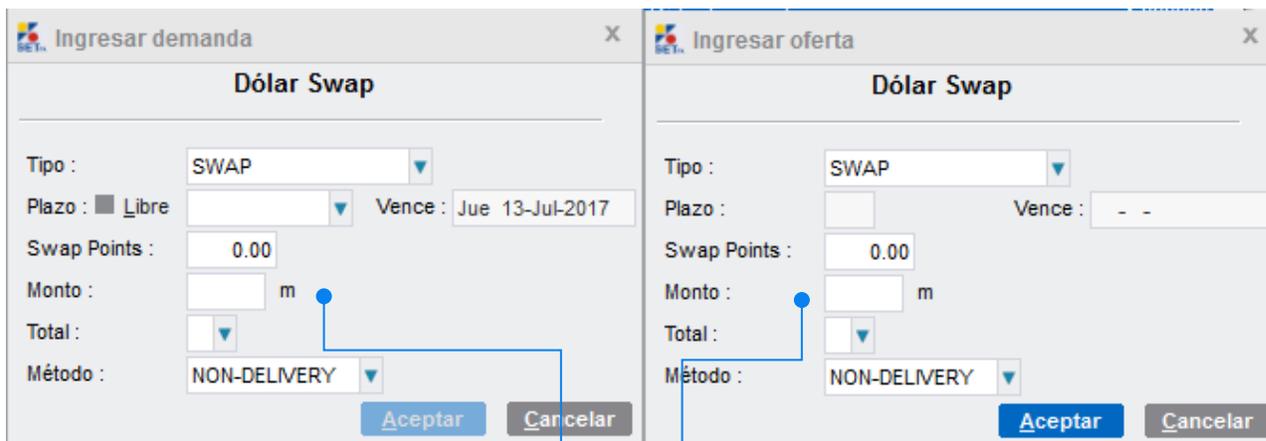
- El tipo de operación, los días de la operación (que para un Swap será uno solo mientras que para un Swap diferido serán dos: los días en que inicia la operación y el plazo de la operación)
- El precio en swap points (puntos sobre el Spot de la operación).
- El monto de la operación.
- Total: “Aceptar compras parciales” o “Solo aceptar compra total”. permite elegir si el monto de la postura al ser agredido puede ser tomado en su totalidad o por el contrario tomar solo una parte (Seleccionando “T” el total el monto deberá ser operado por completo, no permitiendo fraccionamientos).
- Método: podrá ser DELIVERY (el monto indicado es transferido entre las contrapartes) o NON-DELIVERY (solo la diferencia es transferida entre las contrapartes). Esta opción es equivalente a los términos FÍSICO o COMPENSACIÓN respectivamente.

**SWAP**

**FORWARD FORWARD**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 30 / 54</b>

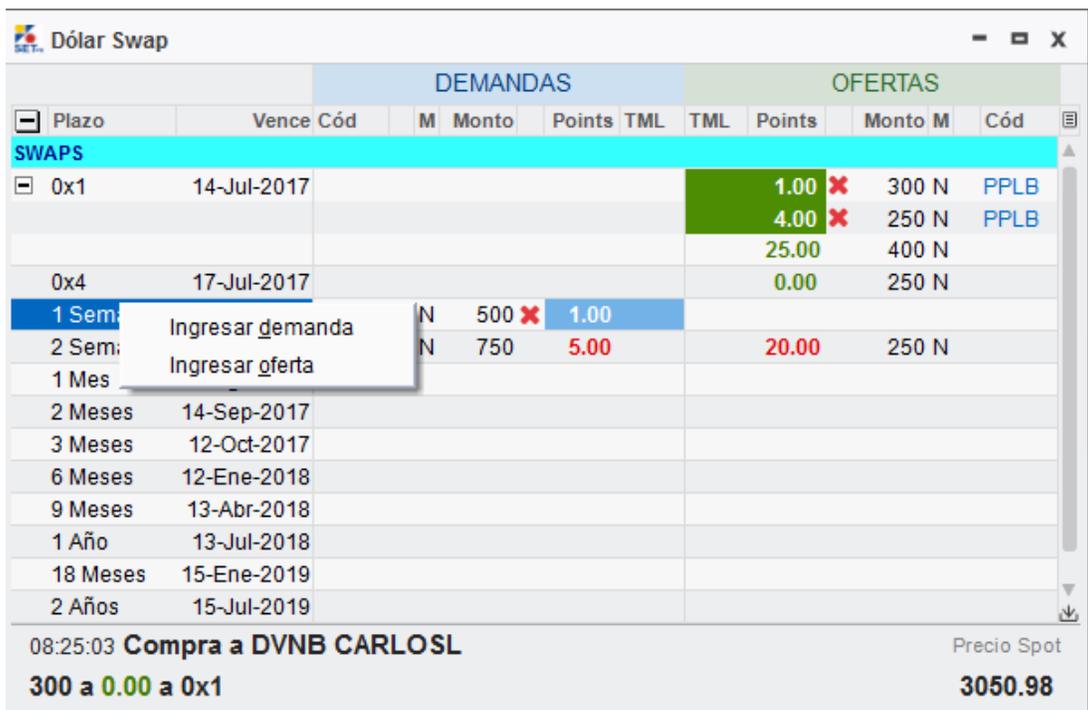


El precio podrá ser cualquier número real con tres (3) enteros y dos (2) decimales, incluidos los negativos y el cero (0)

Finalmente cuando se pulsa el botón “aceptar”, la demanda / oferta ingresará al mercado y podrá ser operada mientras no sea retirada y exista el cupo suficiente con la contraparte. Una manera más cómoda de ingresar ofertas y demandas en plazos ya incluidos en la pantalla, es pulsando con botón derecho del mouse sobre uno de los plazos en la ventana, y seleccionar “Ingresar demanda” o “Ingresar oferta”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

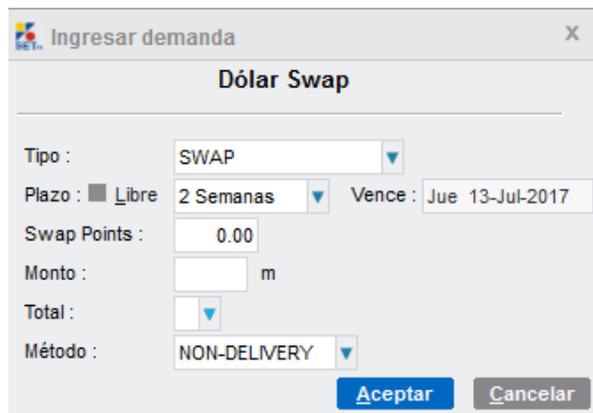
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 31 / 54</b>



DEMANDAS				OFERTAS							
Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Points	TML	TML	Points	Monto	M	Cód
<b>SWAPS</b>											
0x1	14-Jul-2017							1.00	300	N	PPLB
								4.00	250	N	PPLB
								25.00	400	N	
0x4	17-Jul-2017							0.00	250	N	
1 Sem:			N	500	1.00						
2 Sem:			N	750	5.00			20.00	250	N	
1 Mes											
2 Meses	14-Sep-2017										
3 Meses	12-Oct-2017										
6 Meses	12-Ene-2018										
9 Meses	13-Abr-2018										
1 Año	13-Jul-2018										
18 Meses	15-Ene-2019										
2 Años	15-Jul-2019										

08:25:03 **Compra a DVNB CARLOSL** Precio Spot  
**300 a 0.00 a 0x1** **3050.98**

En este caso, en la pantalla de ingreso de precios aparecerá con el plazo y tipo de operación ya indicado ahorrando así su digitación.



**Ingresar demanda**

**Dólar Swap**

Tipo : SWAP

Plazo :  Libre 2 Semanas Vence : Jue 13-Jul-2017

Swap Points : 0.00

Monto : m

Total : m

Método : NON-DELIVERY

**Aceptar** **Cancelar**

También es posible modificar y retirar los precios ingresados. Para ello se debe marcar el precio sobre el que se quiera operar y con botón derecho seleccionar la función deseada en el menú

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 32 / 54</b>

emergente (marcar / modificar / retirar), o bien utilizar las teclas de acceso rápido del teclado o los botones de la barra de herramientas, según la siguiente tabla:

FUNCION	ICONO	TECLA RAPIDA
Modificar Demanda		F7
Modificar Oferta		F8
Retirar Demanda		F9
Retirar Oferta		F10
Retirar Todos Los Precios		

En la barra de herramientas y teclas rápidas es posible agredir una postura, utilizando la marcación previamente de dicho precio, y seleccionando la opción comprar o vender:

FUNCION	ICONO	TECLA RAPIDA
Compra		F4
Vender		F3

### 3.1. Realizar Transacciones

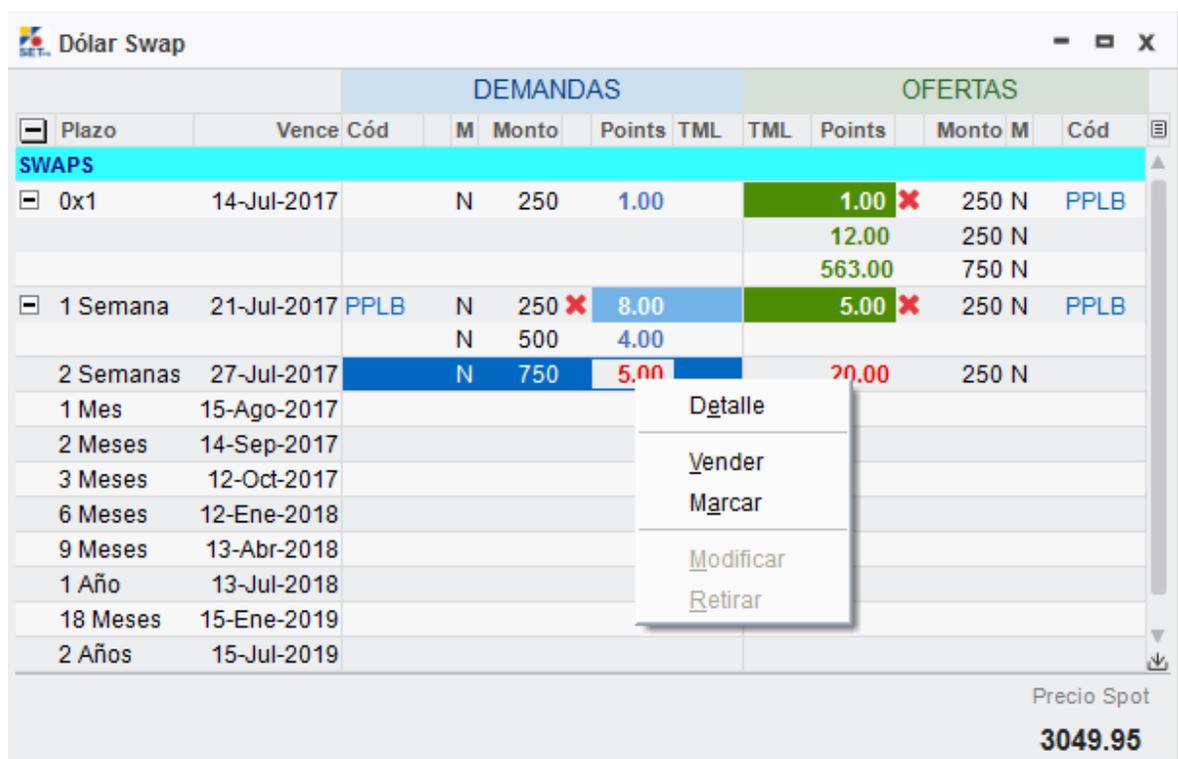
Para operar precios en el mercado primero se debe comprobar si existe cupo suficiente con la contraparte, lo cual se indica mediante una convención de colores:

- En la demanda: Si el color del precio de la postura es azul, indica que tiene cupo suficiente y es potencialmente agredible. Si el color de la postura es rojo, significa que no existe cupo suficiente y no puede ser agredida. Adicionalmente, si la postura tiene un color de fondo azul, es una postura de la misma entidad.
- En la oferta: Si el color del precio de la postura es verde, indica que tiene cupo suficiente y es potencialmente agredible. Si el color de la postura es rojo, significa que no existe cupo suficiente y no puede ser agredida. Adicionalmente, si la postura tiene un color de fondo verde, es una postura de la misma entidad.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 33 / 54</b>

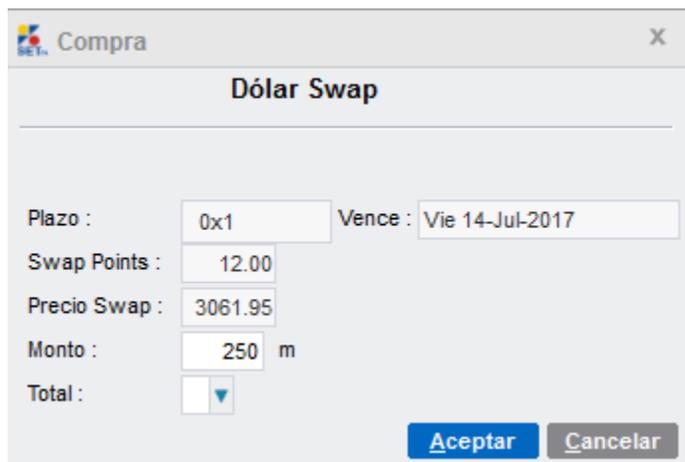
Al hacer clic derecho sobre cada postura, se mostrarán las siguientes opciones:



		DEMANDAS					OFERTAS				
Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Points	TML	TML	Points	Monto	M	Cód
<b>SWAPS</b>											
0x1	14-Jul-2017		N	250	1.00			1.00	250	N	PPLB
								12.00	250	N	
								563.00	750	N	
1 Semana	21-Jul-2017	PPLB	N	250	8.00			5.00	250	N	PPLB
			N	500	4.00						
2 Semanas	27-Jul-2017		N	750	5.00			20.00	250	N	
1 Mes	15-Ago-2017										
2 Meses	14-Sep-2017										
3 Meses	12-Oct-2017										
6 Meses	12-Ene-2018										
9 Meses	13-Abr-2018										
1 Año	13-Jul-2018										
18 Meses	15-Ene-2019										
2 Años	15-Jul-2019										

Precio Spot  
**3049.95**

- Al escoger la opción "Comprar" o "Vender", El Sistema muestra los datos de la postura para aceptar la transacción:



**Compra**

**Dólar Swap**

Plazo : 0x1      Vence : Vie 14-Jul-2017

Swap Points : 12.00

Precio Swap : 3061.95

Monto : 250 m

Total : ▼

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 34 / 54</b>

- La opción “Marcar” permite señalar varias posturas en la profundidad.



		DEMANDAS					OFERTAS				
Plazo	Vence	Cód	M	Monto	Points	TML	TML	Points	Monto	M	Cód
<b>SWAPS</b>											
0x1	14-Jul-2017		N	250	1.00			1.00	250	N	PPLB
								563.00	750	N	
1 Semana	21-Jul-2017	PPLB	N	250	8.00			5.00	250	N	PPLB
			N	500	4.00						
2 Semanas	27-Jul-2017		N	750	5.00			20.00	250	N	
1 Mes	15-Ago-2017										
2 Meses	14-Sep-2017										
3 Meses	12-Oct-2017										



**Vender marcadas**

**Dólar Swap**

Monto marcado :  m

Points promedio :

Precio Swap :

- La opción “Detalle” muestra todos los campos con la información de a postura.

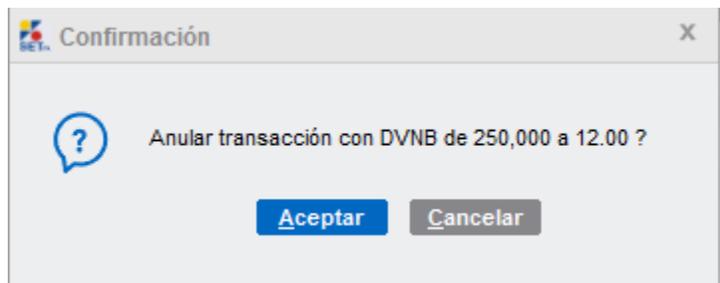
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 35 / 54</b>



### 3.2. Anulación - Operaciones Registradas

Para anular operaciones, desde el Blotter de operaciones se debe seleccionar la operación con clic derecho, luego seleccionar “Anular Transacción”; el Sistema pedirá un mensaje de confirmación:



La contraparte recibe un mensaje de solicitud de anulación, sobre el cual se debe hacer doble clic para abrir la ventana de solicitudes. Posteriormente, la contraparte debe hacer clic derecho sobre la solicitud, y escoger la opción “Confirmar” o “Rechazar”.

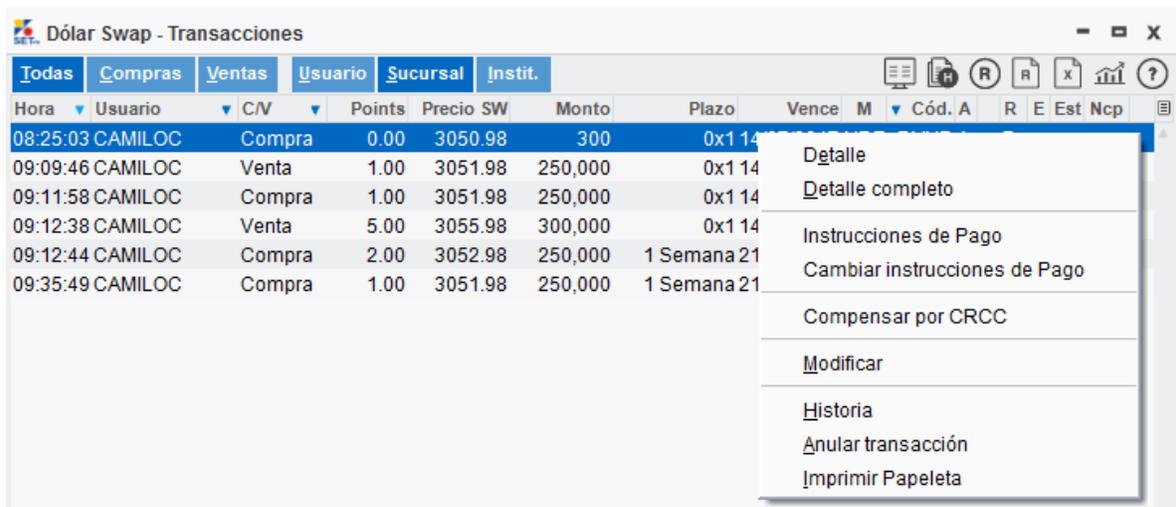
```

SOLICITUD DE ANULACION      10:44:12
DE VENTA Dólar Swap
PEDIDA POR PPLB CAMILOC
```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--



	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 37 / 54</b>

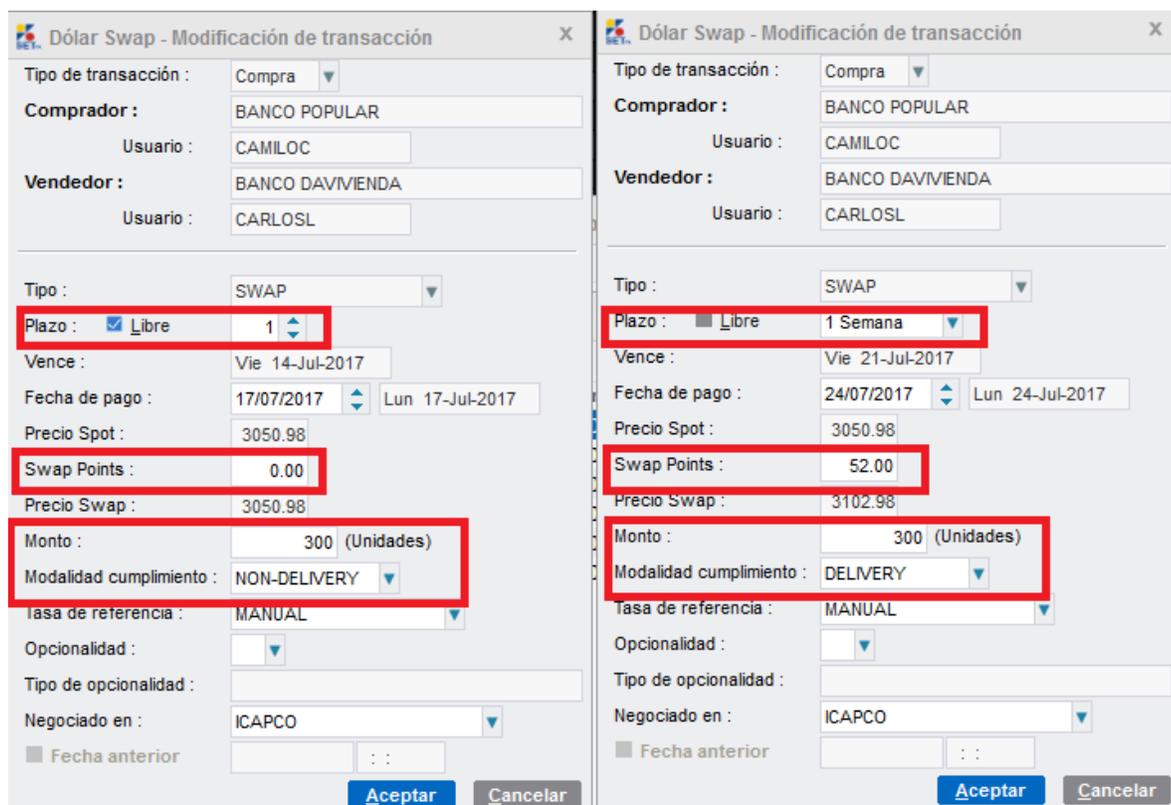


Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CAMILOC	Compra	0.00	3050.98	300	0x1 14								
09:09:46	CAMILOC	Venta	1.00	3051.98	250,000	0x1 14								
09:11:58	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	0x1 14								
09:12:38	CAMILOC	Venta	5.00	3055.98	300,000	0x1 14								
09:12:44	CAMILOC	Compra	2.00	3052.98	250,000	1 Semana 21								
09:35:49	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	1 Semana 21								

Los campos en el recuadro son los únicos que se pueden modificar:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 38 / 54</b>



En el Blotter de la entidad que envió la solicitud de modificación se identifica la operación con la letra M en color azul **M=Solicito la Modificación**



Hora	Usuario	CV	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CAMILOC	Compra	0.00	3050.98	300	0x1 14/07/2017	NDF	DVNB	A	R			

En la mensajería de la contraparte le llega el mensaje de Solicitud de Modificación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

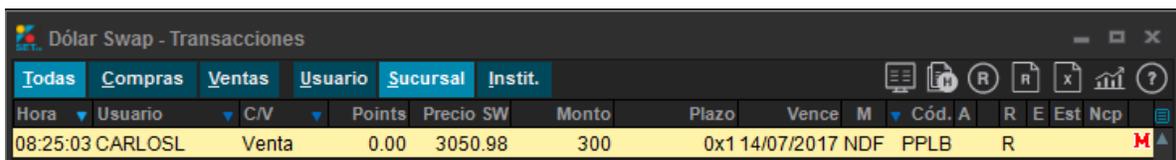
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO02024</b> <b>Archivo: IGO02024</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 39 / 54</b>

```

SOLICITUD DE MODIFICAR TRANSACC 10:51:06
Mercado : Dólar Swap
Fecha   Hora      Puntos      Monto
13-07-17 08:25:03   52.00       300
Plazo : 1 Semana 21/07/2017
Price Swap : 3102.98
Comprador      Vendedor
PPLB CAMILOC   DVNB CARLOSL
Enviada por : PPLB CAMILOC

```

En el Blotter de la contraparte la operación se identifica con la letra M en color rojo **M=Recibo solicitud de modificación**:



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CARLOSL	Venta	0.00	3050.98	300	0x1	14/07/2017	NDF	PPLB	R				

El usuario que recibe la solicitud de modificación debe dar clic derecho y luego en Detalle de modificación podrá Confirmar o Rechazar el cambio:



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CAMILOC	Compra	0.00	3050.98	300	0x1	14/07/2017	N						
09:09:46	CAMILOC	Venta	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	N						
09:11:58	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	N						
09:12:38	CAMILOC	Venta	5.00	3055.98	300,000	0x1	14/07/2017	N						
09:12:44	CAMILOC	Compra	2.00	3052.98	250,000	1 Semana	21/07/2017	N						
09:35:49	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	1 Semana	21/07/2017	NDF	DVNB					

En color azul muestra los parámetros que se están modificando:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 40 / 54</b>

 **Dólar Swap - Detalle transacción modificada** X

Tipo de transacción :  ▼

Comprador :

Usuario :

Vendedor :

Usuario :

---

Tipo :  ▼

Plazo :  Libre

Vence :

Fecha de pago :

Precio Spot :

Swap Points :

Precio Swap :

Monto :  (Unidades)

Modalidad cumplimiento :  ▼

Tasa de referencia :  ▼

Opcionalidad :  ▼

Tipo de opcionalidad :

Negociado en :  ▼

Fecha anterior  :

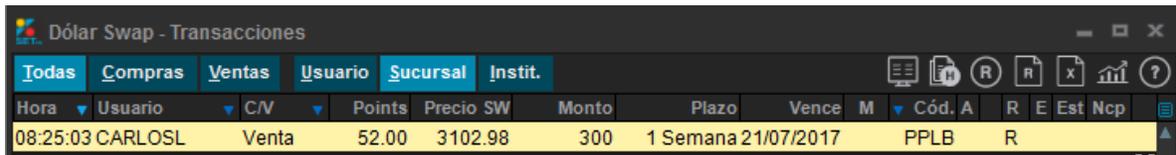
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO02024</b> <b>Archivo: IGO02024</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 41 / 54</b>

<b>MODIFICACION DE COMPRA</b> 11:04:30 Mercado : Dólar Swap Comprador      Vendedor PPLB CAMILOC      DVNB CARLOSL Modificado por DVNB CARLOSL	<b>MODIFICACION DE VENTA</b> 11:04:30 Mercado : Dólar Swap Comprador      Vendedor PPLB CAMILOC      DVNB CARLOSL Modificado por DVNB CARLOSL
--	---

Al momento de confirmar la modificación aparecerá en el chat de ambas contrapartes el cambio realizado.

También en el Blotter se ve reflejado el cambio:



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CARLOSL	Venta	52.00	3102.98	300	1 Semana	21/07/2017		PPLB		R			

En el Blotter de operaciones, “clic derecho”, opción “Historia” se pueden ver el historial de la operación y las modificaciones realizadas:

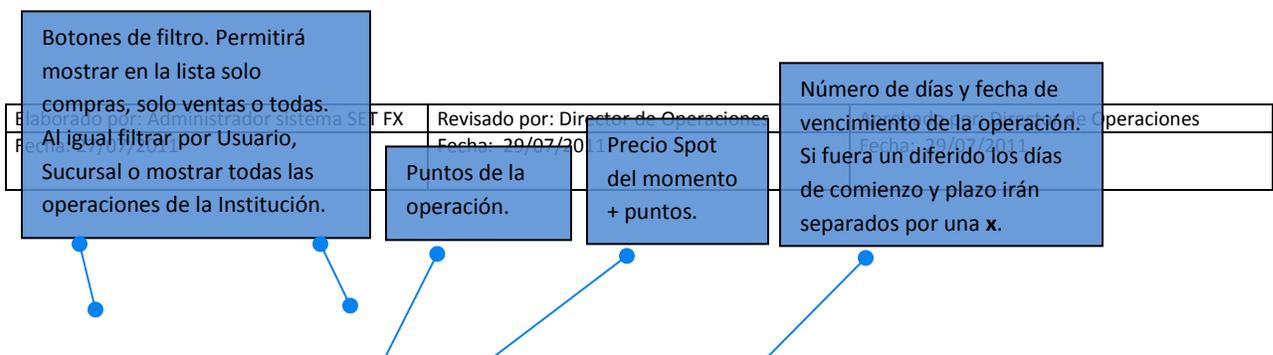


Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio SW	Monto	Tr/To	T	Comentario
13/07/17	08:25:03	DVNB CARLOSL	Solicita registro	O	0x1	3050.98	300	300		
13/07/17	08:25:03	Motor de calce	Registro	O	0x1	3050.98	300	300		
13/07/17	10:51:06	PPLB CAMILOC	Solicita modificación	O	1 Semana	3102.98	300			
13/07/17	11:04:30	DVNB CARLOSL	Modificación de transaci	O	1 Semana	3102.98	300	300		

### 3.4. Blotter de Transacciones

El *Blotter* de transacciones es una de las ventanas principales del aplicativo, en la que se puede ver la lista de las operaciones realizadas por los usuarios de la entidad. Para acceder a esta ventana se

debe pulsar el ícono  de la barra de herramientas y a continuación se muestra la descripción de las partes del *Blotter*:



	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 42 / 54</b>

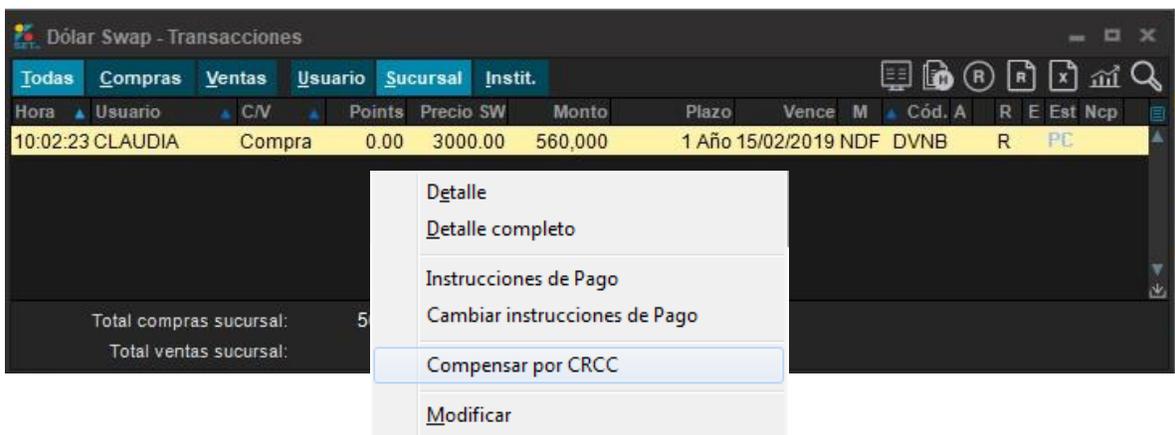
Dólar Swap - Transacciones														
<span>Todas</span> <span>Compras</span> <span>Ventas</span> <span>Usuario</span> <span>Sucursal</span> <span>Instit.</span>														
Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	A	R	E	Est	Ncp
08:25:03	CAMILOC	Compra	52.00	3102.98	300	1 Semana	21/07/2017		DVNB	A	R			
09:09:46	CAMILOC	Venta	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB	A				
09:11:58	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB	A				
09:12:38	CAMILOC	Venta	5.00	3055.98	300,000	0x1	14/07/2017	NDF	DVNB					
09:12:44	CAMILOC	Compra	2.00	3052.98	250,000	1 Semana	21/07/2017	NDF	DVNB					
09:35:49	CAMILOC	Compra	1.00	3051.98	250,000	1 Semana	21/07/2017	NDF	DVNB					

## 4. Compensación de Operaciones

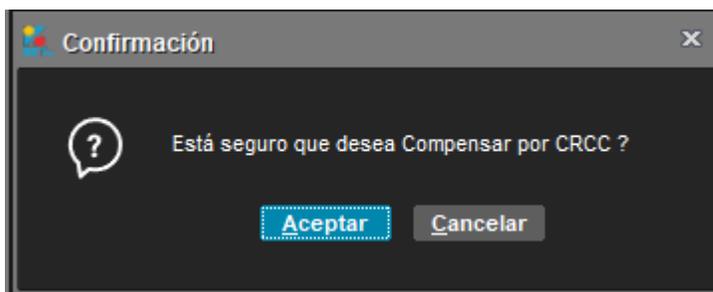
Para compensar una operación, esta se ubica en el Blotter de operaciones y luego se debe hacer clic derecho para seleccionar la opción "Compensar por CRCC".

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

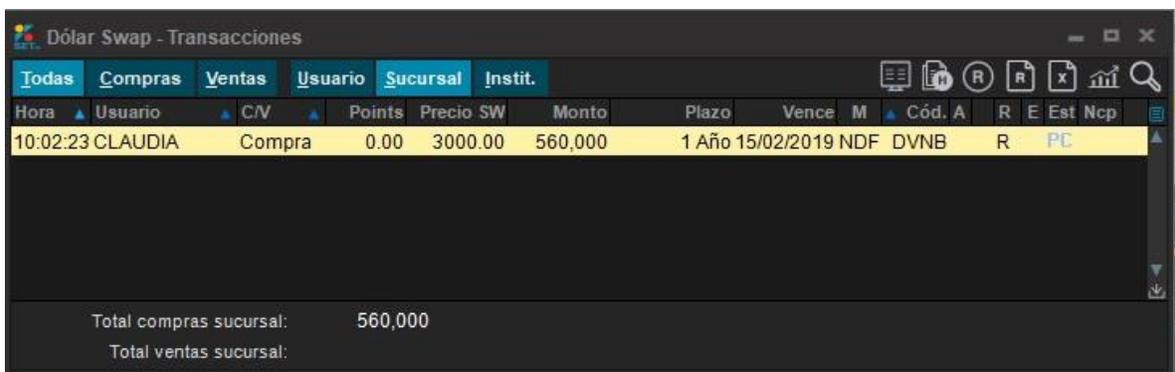
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 43 / 54</b>



Al enviar la solicitud se pedirá confirmación.



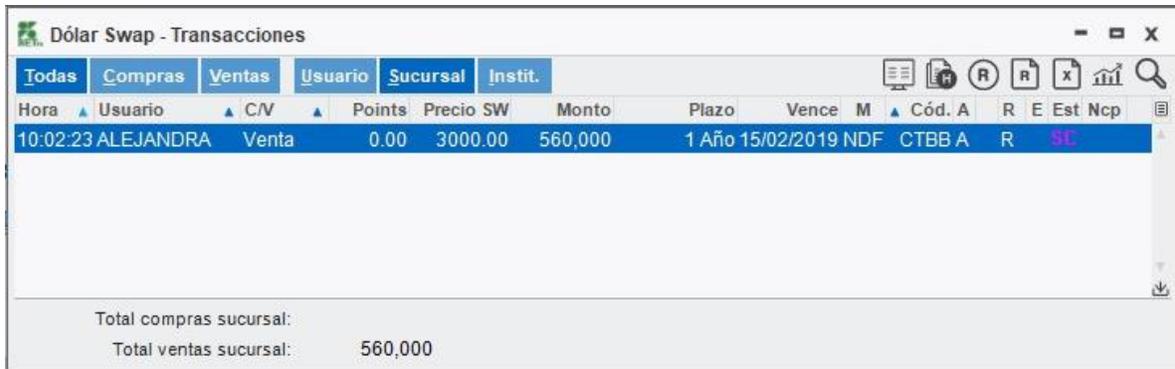
En el Blotter de la entidad que envió la solicitud a compensar por CRCC le aparece la operación con PC (Pendiente Contraparte) en color azul



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 44 / 54</b>

En el Blotter de la contraparte le aparece la operación con **SC** (Solicitud Contraparte) en color violeta



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB	A	R		SC

Total compras sucursal:   
 Total ventas sucursal: 560,000

Adicional a la luz Violeta, en el chat de la contraparte también le llega el mensaje de compensación



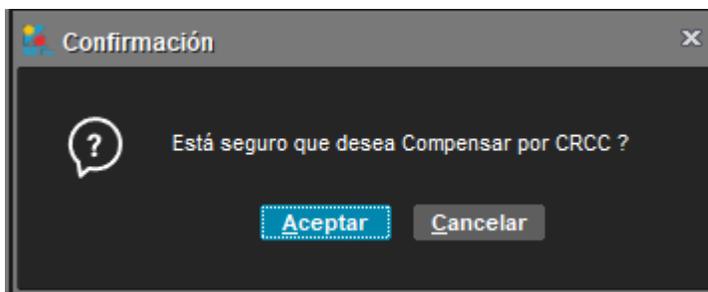
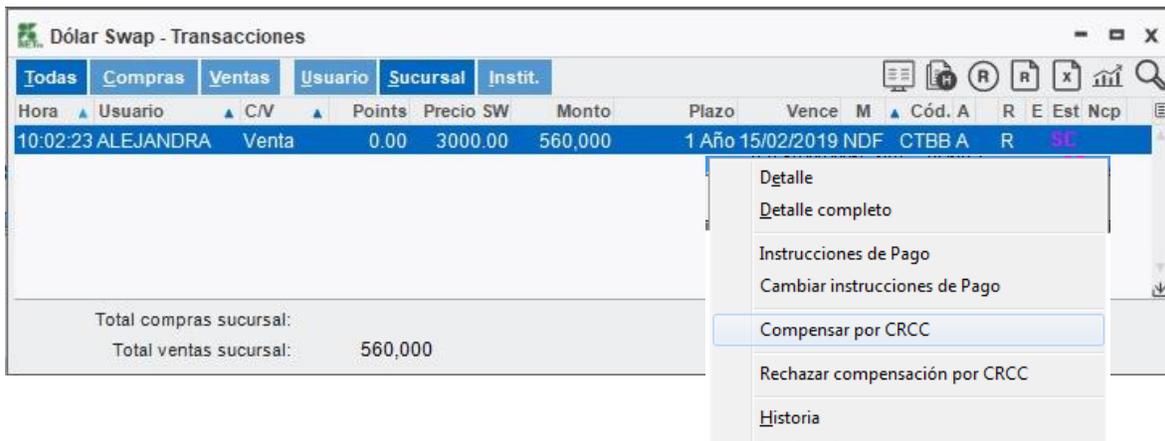
**Mensajes de : 15/Feb/2018**

CTBB CLAUDIA 87,000'000,000.00  
 Plazo: 9 Meses  
 Registrado por DVNB ALEJANDRA  
**SOLICITUD DE COMPENSAR EN CRCC 16:06:22**  
 Mercado : IRS, IMCs  
 Fecha : 15-02-18  
 Hora Monto  
 10:00:00 87,000'000,000.00  
 Plazo : 9 Meses 19/11/2018  
 Comprador Vendedor  
 CTBB CLAUDIA DVNB ALEJANDRA  
 Enviada por : CTBB CLAUDIA

La contraparte debe confirmar la solicitud, haciendo clic derecho sobre la operación y seleccionando la opción "Compensar por CRCC"

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 45 / 54</b>



Cuando la contraparte también ha enviado la solicitud Compensar por CRCC aparece en mi Chat el mensaje “PEDIDO ENVIADO A CRCC”



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO02024</b> <b>Archivo: IGO02024</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 46 / 54</b>

Luego de que ambas entidades envían la solicitud a la CRCC, les muestra la operación con **PR** (Pendiente Riesgo) en color amarillo en el Blotter:



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
08:06:03	ALEJANDRA	Compra	34.00	3000.00	560,000	9 Meses	16/11/2018	NDF	CTBB	B		PR	

Total compras sucursal: 560,000  
Total ventas sucursal:

Al llegar la solicitud de novación a la CRCC, llegara al Blotter de operaciones un estado **PA** (Pendiente de Aprobación) en color amarillo,



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
08:06:03	ALEJANDRA	Compra	34.00	3000.00	560,000	9 Meses	16/11/2018	NDF	CTBB	B		PA	

Total compras sucursal: 560,000  
Total ventas sucursal:

Al ser aceptada la compensación por parte de la CRCC, las letras en el Blotter cambian a **CR** (Compensada por Cámara de Riesgo) en color verde en las entidades involucradas



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB	A	R	CR	

Total compras sucursal:  
Total ventas sucursal: 560,000

Si la Compensación por parte de la CRCC es rechazada, se muestra la operación con **NC**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 47 / 54</b>

(No Compensada) en color rojo. Al dar clic derecho Detalle se puede observar el motivo del Rechazo

Dólar Swap - Transacciones											
<span>Todas</span> <span>Compras</span> <span>Ventas</span> <span>Usuario</span> <span>Sucursal</span> <span>Instit.</span>											
Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E Est Ncp
08:06:03	ALEJANDRA	Compra	34.00	3000.00	560,000	9 Meses	16/11/2018	NDF	CTBB	B	No
Total compras sucursal:			560,000								
Total ventas sucursal:											

Dólar Swap - Detalle de transacción			
Fecha:	15/02/2018	Código:	O3PCBPVB11
Hora de registro:	16:36:06	Hora:	08:06:03
Comprador	Sucursal	Persona	
<b>BANCO DAVIVIENDA S.A.</b>	<b>BOGOTA</b>	<b>Maria Alejandra Montealegre M</b>	
Broker	Por parte de:		
<b>SET ICAP FX</b>	<b>BOGOTA</b>	<b>Diego Arley Gil Solano</b>	
Vendedor	Sucursal	Persona	
<b>CITIBANK S.A.</b>	<b>BOGOTA</b>	<b>Claudia Pardo Cepeda</b>	
Broker	Por parte de:		
<b>SET ICAP FX</b>	<b>BOGOTA</b>	<b>Diego Arley Gil Solano</b>	
Swap Points :	<b>34.00</b>	Monto USS :	<b>560,000.00</b>
Tasa de referencia :		Precio Swap :	<b>3000.00</b>
Negociado en :		Plazo :	<b>9 Meses</b>
Origen de transacción :	<b>Registrado por DVNB ALEJANDRA</b>	F. Pago :	<b>19-Nov-2018</b>
Estado CRCC :		Precio spot :	<b>2966.00</b>
<b>Rechazada por : El Miembro o entidad (Party) participe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o</b>			
Fecha anterior			

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 48 / 54</b>

## 4.1. Causales de Rechazo en Cámara

Código	Descripción
210	El sistema no está disponible para los sistemas de Registro
501	El Miembro o entidad (Party) participe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o definitivamente
504	No existe un vencimiento válido para la Fecha de Vencimiento (ValueDate) enviada
505	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo -mayor que cero
506	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo menor que 999,999,999
507	La estructura del precio (Rate) que fue enviada no es válida para la Cámara. Debe contener exactamente 4 enteros y 2 decimales
508	La Cuenta y/o el Miembro no está habilitado en Cámara para realizar esta operación
509	"La Garantía Diaria constituida para la Cuenta con posición de Compra/Venta, no es suficiente para aceptar la operación que ha sido enviada a Cámara"
511	La fecha de creación de la operación (TradeDate) no puede ser mayor que la fecha de creación del mensaje que contiene la operación (CreationTimeStamp).
512	La Cuenta con posición de Compra debe ser diferente a la Cuenta con posición de Venta para la operación enviada a Cámara
513	El número de identificación del mensaje (MessageID) ya ha sido utilizado en una operación enviada previamente a Cámara

## 4.2. Compensación de Operaciones de Dias Anteriores

Desde el Blotter de operaciones ir al boton dias anteriores  escoger la fecha de la operación que se desea compensar, "clic derecho" "compensar por CRCC"

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 49 / 54</b>

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio SW	Monto	Tr/To T	Comentario
15/02/18	10:02:23	CTBB CLAUDIA	Solicita registro	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	10:02:23	Motor de calce	Registro	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	16:23:59	Motor de calce	Solicitud aceptada	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	16:24:17	DVNB ALEJANDRA	Confirmación	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	16:24:47	CTBB CLAUDIA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	16:27:22	DVNB ALEJANDRA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	
15/02/18	16:27:25	SETB SRVPPL	Compensado CRCC	D	1 Año	3000.00	560.000	560,000	

Detalle

Comentario

Compensar por CRCC

Modificar

Historia

### 4.3. Anulación de Compensación

En el Sistema es posible anular el estado de compensación previo a la autorización de CRCC entre las entidades involucradas. Sin embargo, solo se puede quitar el estado de compensación el mismo día de envío a CRCC.

Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
08:06:03	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560.000	1 Semana	23/02/2018	NDF	CTBB	R			CR

Total compras sucursal:

Total ventas sucursal: 560,000

---

Total compras sucursal: 560,000

Total ventas sucursal:

Detalle

Detalle completo

Instrucciones de Pago

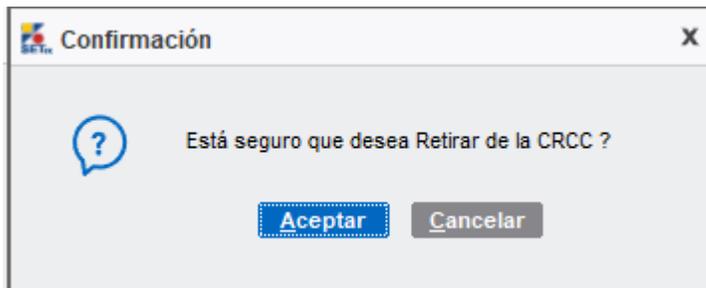
Cambiar instrucciones de Pago

Retirar de la CRCC

Posteriormente aparece un mensaje de advertencia

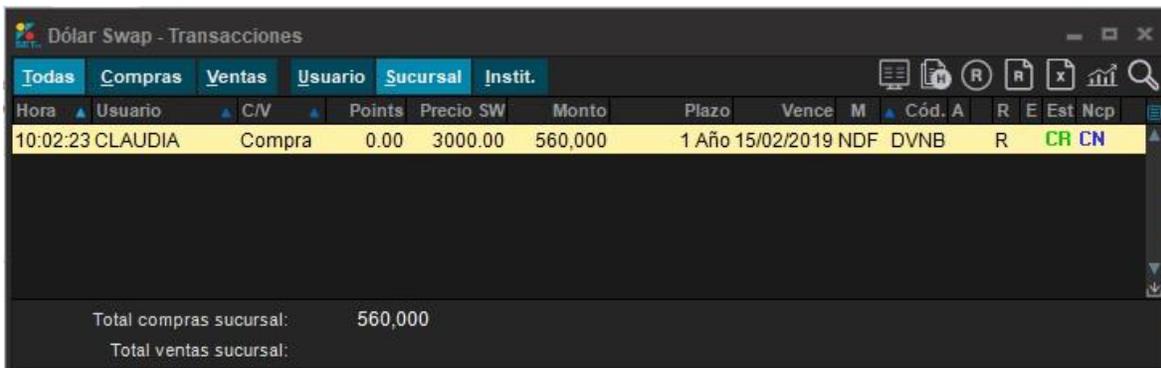
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b> <b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 50 / 54</b>



En el Blotter de operaciones aparecerán los siguientes estados en la columna “Ncp”

- **CN** Letras en azul (Contraparte No ha enviado): El usuario ha enviado la solicitud de anulación a la CRCC, pero la contraparte no ha confirmado



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	CLAUDIA	Compra	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	DVNB	R		CR	CN

Total compras sucursal: 560,000  
Total ventas sucursal:

- **SA** Letras en Violeta (Solicitud Anulación): La contraparte envió la solicitud de anulación a la CRCC, pero el usuario no ha confirmado.



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB A	R		CR	SA

Total compras sucursal:  
Total ventas sucursal: 560,000

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
<b>Versión: 02</b>		
	<b>Página: 51 / 54</b>	

Una vez recibida la solicitud, el usuario debe confirmar la anulación de la compensación.



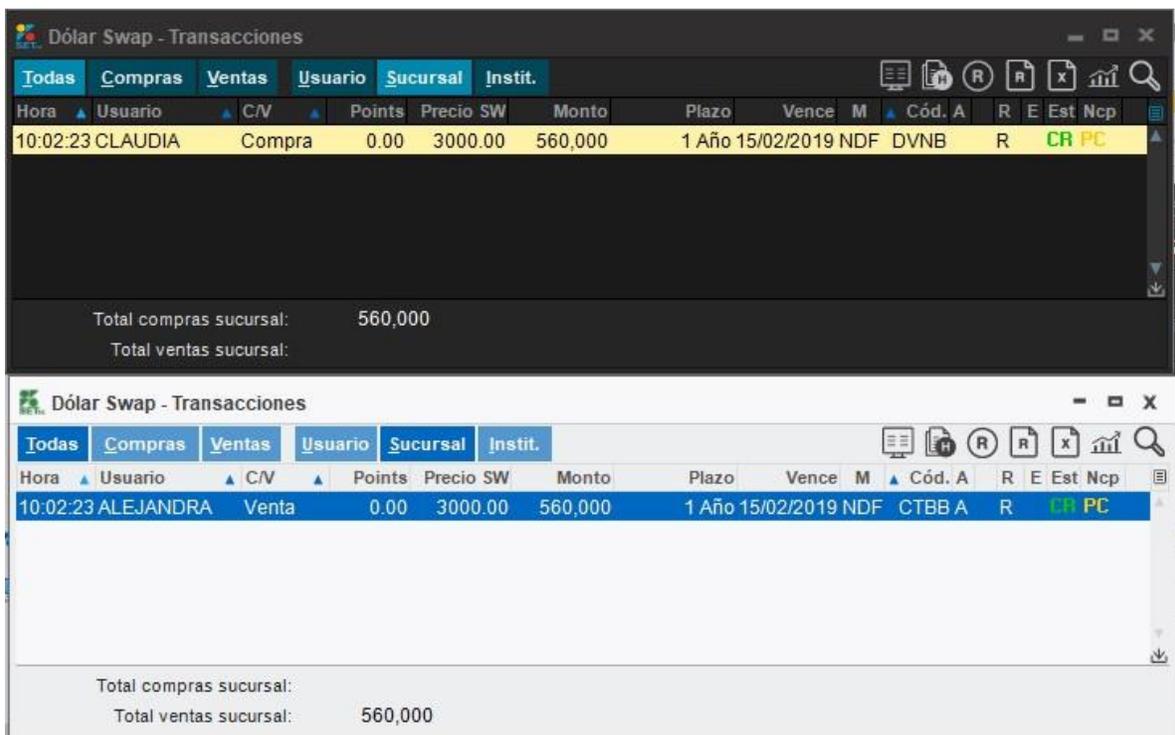
Posteriormente, la CRCC debe confirmar si se rechaza o se aprueba la solicitud de anulación de compensación.

El estado de este proceso se identifica con las siguientes letras en la columna "Ncp":

- **PC** Letras en Amarillo (Pendiente Cámara): Las dos contrapartes enviaron la solicitud de anulación a la CRCC pero está pendiente la respuesta por parte de la Cámara.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO02024</b> <b>Archivo: IGO02024</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 52 / 54</b>



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	CLAUDIA	Compra	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	DVNB	R		CR	PC
Total compras sucursal:			560,000										
Total ventas sucursal:													

Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB	A	R	CB	PC
Total compras sucursal:													
Total ventas sucursal:			560,000										

- Al llegar la solicitud de retiro novación a la CRCC llegara al Blotter de operaciones un estado **PA** (Pendiente de Aprobación) en color amarillo



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
08:06:03	ALEJANDRA	Compra	34.00	3000.00	560,000	9 Meses	16/11/2018	NDF	CTBB	B		PA	
Total compras sucursal:			560,000										
Total ventas sucursal:													

Cuando es aprobada la desmarcacion de la operación, no aparece ningun estado en el Blotter de operaciones

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

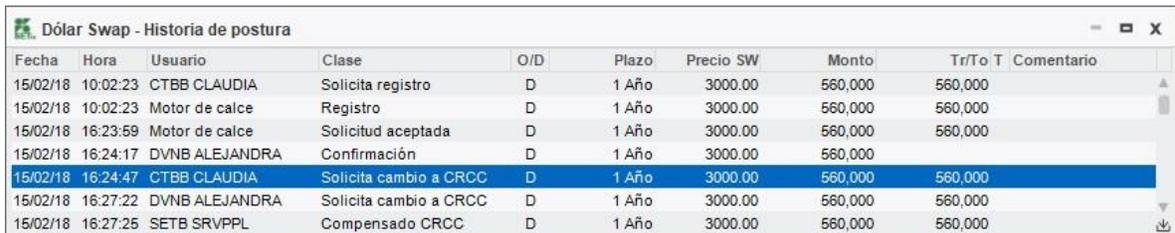
	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO02024</b> <b>Archivo: IGO02024</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b> <b>Página: 53 / 54</b>



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB A	R			

Total compras sucursal: 560,000  
Total ventas sucursal: 560,000

En la historia de la operación se verifica el estado de retiro de la compensación



Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio SW	Monto	Tr/To T	Comentario
15/02/18	10:02:23	CTBB CLAUDIA	Solicita registro	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	10:02:23	Motor de calce	Registro	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:23:59	Motor de calce	Solicitud aceptada	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:24:17	DVNB ALEJANDRA	Confirmación	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:24:47	CTBB CLAUDIA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:27:22	DVNB ALEJANDRA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:27:25	SETB SRVPL	Compensado CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	

Si CRCC rechaza la desmarcación de la operación continuara con el estado **CR**, en el historial de la operación apareciera Rechazado de CRCC.



Hora	Usuario	C/V	Points	Precio SW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód. A	R	E	Est	Ncp
10:02:23	ALEJANDRA	Venta	0.00	3000.00	560,000	1 Año	15/02/2019	NDF	CTBB A	R		CR	

Total compras sucursal: 560,000  
Total ventas sucursal: 560,000

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 27/07/2011	Revisado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011	Aprobado por: Director de Operaciones Fecha: 29/07/2011
--	--	--

	<b>MANUAL DE USUARIO</b>	<b>Código: IGO020204</b>
		<b>Archivo: IGO020204</b> <b>Administrar SET-FX</b>
	<b>DÓLAR SWAP</b>	<b>Versión: 02</b>
		<b>Página: 54 / 54</b>

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio SW	Monto	Tr/To T	Comentario
15/02/18	10:02:23	CTBB CLAUDIA	Solicita registro	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	10:02:23	Motor de calce	Registro	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:23:59	Motor de calce	Solicitud aceptada	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:24:17	DVNB ALEJANDRA	Confirmación	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:24:47	CTBB CLAUDIA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:27:22	DVNB ALEJANDRA	Solicita cambio a CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	
15/02/18	16:27:25	SETB SRVPPL	Compensado CRCC	D	1 Año	3000.00	560,000	560,000	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Director de Operaciones	Aprobado por: Director de Operaciones
Fecha: 27/07/2011	Fecha: 29/07/2011	Fecha: 29/07/2011