

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 1 / 91



MANUAL DE USUARIO

MERCADO REGISTRO DE DIVISAS

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 2 / 91

Contenido

Introducción	4
Objetivo	4
1. Ingreso al Módulo Registro de Divisas	5
2. Botones de herramientas	7
2.1. Importar XML	7
2.2. Precios/Montos transacciones Propias	8
2.2.1. Registro IMC's	9
2.2.2. Registro Clientes.....	12
2.3. Comitentes	16
2.3.1. Aumentar	17
2.3.2. Eliminar.....	17
2.4. Resumen de precios/montos transados hoy	18
2.4.1. Resumen Divisas IMC's.....	18
2.4.2. Resumen divisas Clientes	19
2.5. Solicitudes de Registro	20
2.6. Anulaciones y Solicitudes de Anulación	21
2.7. Consultas	22
2.8. Configuración Mercado	23
2.9. Botones, Enviar, Nuevo, Limpiar	23
3. Registro de Operaciones	24
3.1. Registro Operación Spot IMC's – IMC's	25
3.2. Registro Operación Next Day IMC's – IMC's.....	27
3.3. Registro Operación FRW IMC's – IMC's	29
3.4. Registro Operación Swap IMC's – IMC's.....	31

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 3 / 91

3.5.	Registro Operación Opciones IMC's – IMC's.....	33
3.6.	Registro Operación IRS IMC's – IMC's.....	35
3.7.	Registro Operación CCS IMC's – IMC's	38
3.8.	Registro Operación Otros derivados IMC's – IMC's.....	46
3.9.	Registro Operación Spot IMC's – CLIENTES	48
3.10.	Registro Operación Next Day IMC's – CLIENTES	49
3.11.	Registros Operaciones FIX IMC's – CLIENTES.....	51
3.12.	Registro Operación FRW IMC's – CLIENTES	57
3.13.	Registro Operación Swap IMC's – CLIENTES	61
3.14.	Registro Operación Opciones IMC's – CLIENTES.....	63
3.15.	Registro Operación IRS IMC's – CLIENTES.....	66
3.16.	Registro Operación CCS IMC's – CLIENTES.....	69
3.17.	Registro Operación Otros derivados IMC's – CLIENTES	72
4.	Modificación.....	73
5.	Fraccionamiento.....	77
6.	Compensación de Operaciones.....	82
6.1.	Causales de Rechazo	86
6.2.	Compensación de operaciones de Días Anteriores.....	87
6.3.	Anulación de Compensación	88

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 4 / 91

Introducción

Este instructivo contiene la descripción del Módulo de Registro de Divisas del sistema Set-FX, el cual permite a todos los afiliados registrar sus operaciones entre IMC o IMC-Cliente, dando cumplimiento a lo establecido en la Resolución No 4 de Enero de 2009 del Banco de la República así como la Circular Reglamentaria Externa DODM317.

Objetivo

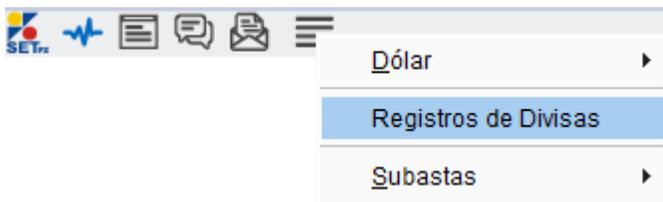
Este instructivo tiene como objetivo explicar de forma detallada las funcionalidades, opciones, y herramientas para el registro de operaciones a través del módulo registro de divisas

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

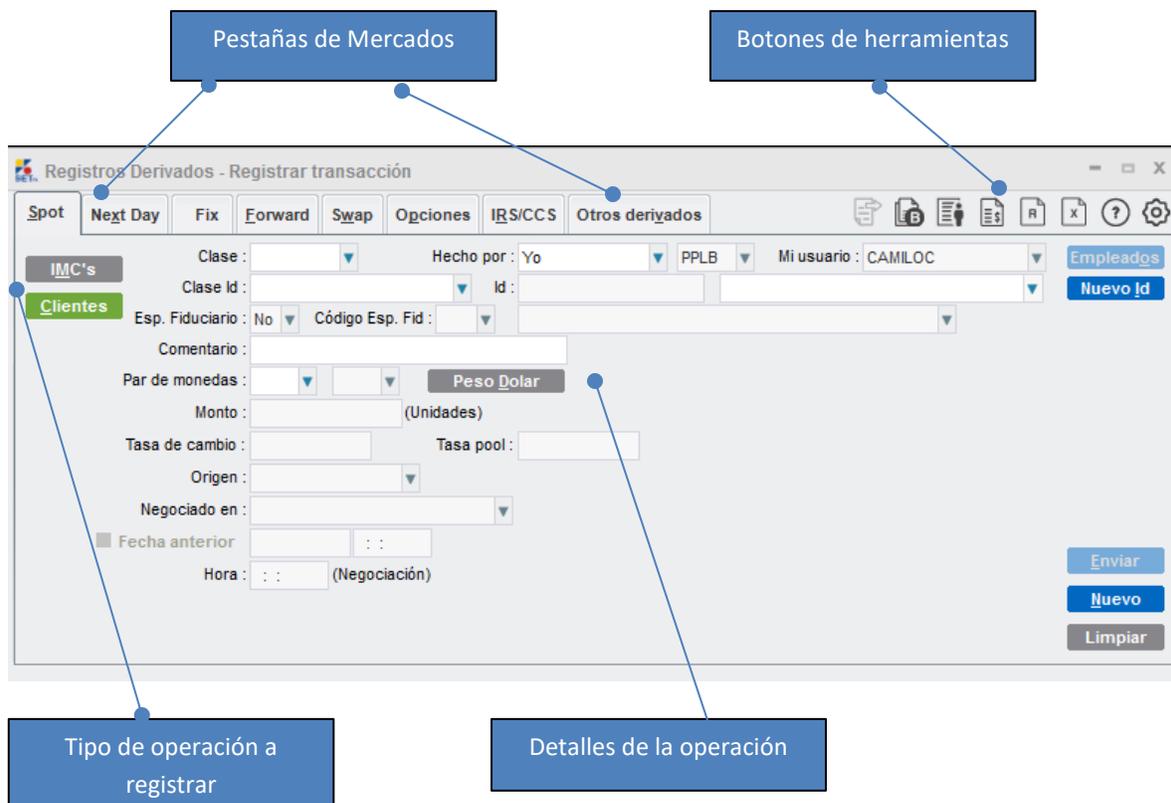
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 5 / 91

1. Ingreso al Módulo Registro de Divisas

Para ingresar al módulo Registro de Divisas, ir al botón mercado, opción Registro de Divisas:



Posteriormente se presenta la ventana donde encontraremos los mercados que componen este módulo (Spot, Next Day, Forward, Swap, IRS/CCS, Opciones, Otros Derivados):



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 6 / 91

En el campo “Clase” debe diligenciarse si se trata de una operación de compra o venta.

Posteriormente, desde el campo “Hecho por”, el usuario puede realizar los registros a nombre propio, como se muestra a continuación:

Hecho por : Yo PPLB Mi usuario : CAMILOC

También es posible hacer los registros a nombre de un usuario de la misma entidad que este registrado en SET-FX; en cuyo caso el usuario debe escoger la regional y posteriormente el nombre del usuario:

Hecho por : Usuario SET-FX PPLB Mi usuario : EDWINO

También es posible realizar el registro a nombre de otra persona que pertenece a la entidad, pero no tiene usuario en SET-FX, en la opción Hecho por se debe seleccionar la opción Otro, al escoger esta opción se activa el botón “Empleados” el cual permite crear los empleados a nombre de quien vamos a realizar el registro.

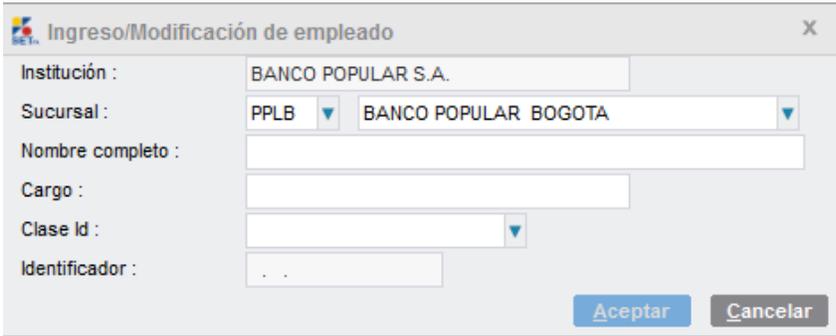
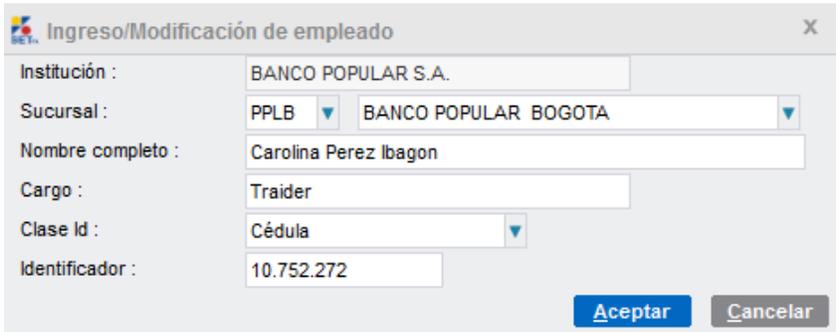
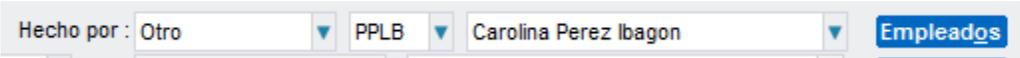
Clase : VENTA Hecho por : Otro PPLB Empleados



En este caso se hace clic sobre el botón “Empleados”, luego la opción “Aumentar”, se ingresan la información del usuario y por último hacer clic en “Aceptar”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 7 / 91

2. Botones de herramientas

2.1. Importar XML



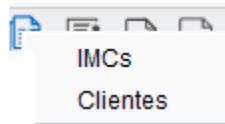
Permite a la entidad realizar la carga de operaciones entre IMC's y clientes del sector Real hacia el sistema SET-FX de manera masiva. Para mayor información sobre esta forma de importación de información se debe contactar a los funcionarios del sistema SET-FX al correo soportsetfx@set-icap.co o consultar el Manual del usuario XML en la URL <http://www.set-fx.com/content/mercadocambiario/manuales.html> **Instructivo XML.**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 8 / 91

2.2. Precios/Montos transacciones Propias

Esta opción permite visualizar las operaciones que han sido registradas a través del módulo de Registro de Divisas. Así mismo el usuario podrá listar las operaciones registradas dependiendo si son entre IMC's o entre IMC's y Clientes.



En el Blotter se puede visualizar las características de las operaciones registradas, entre ellas: la hora, comprador, vendedor, precio, monto, par de monedas, como se muestra en la siguiente ilustración:

Spot		Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	TE C/V	Par Mnda	Monto Tasa cambio B E Ori I
11/07/17	08:25:02	CAMILOC	BANCO POPULAR	V Compra	AUD / COP	1,000.00	2.0000	S ●
11/07/17	09:25:02	CAMILOC	BANCO POPULAR	V Venta	AUD / COP	5,000.00	5000	S ●

Adicionalmente en la columna "B" aparece una letra B para aquellas operaciones hechas por un Bróker. También es posible identificar el origen de la operación, en el caso de las operaciones SPOT la columna Ori mostrará los siguientes valores:

F: Swap Forward
O: Swap O/N contado
S: Spot
U: Swap Futuro
X0: Fix

Para el caso de operaciones Forward la columna Ori mostrará los siguientes valores:

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados	
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	st TE C/V	Par Mnda	Monto Tasa FW Tasa spot Plazo Vence B Ori F. Asig T FR SA Est Ncp I
11/07/17	09:45:00	CAMILOC	Alianza Fiduciaria S.A. Fideicom	V Venta	CAD / COP	50,000.00	1.0000	1.0000 2 Semanas 25/07/2017 F 11/07/2017 M ●
11/07/17	09:45:00	CAMILOC	ASESORIA EN COMUNICACIONE	R Compra	CZK / USD	50,000.00	.010000	.010000 9 Meses 11/04/2018 F 11/07/2017 M ●
11/07/17	09:45:00	CAMILOC	ASCOMINT LTDA	R Compra	USD / BRL	50,000.00	.0010000	.0010000 9 Meses 11/04/2018 F 11/07/2017 M ●
11/07/17	09:49:00	CAMILOC	ASCOMINT LTDA	R Compra	USD / AUD	50,000.00	1.0000	1.0000 3 Meses 11/10/2017 F 11/07/2017 M ●

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 9 / 91

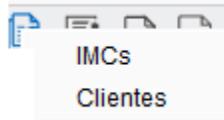
F: Forward-Forward
O: Outright
S: Swap
X0: Fix

2.2.1. Consulta de Registros entre IMCs

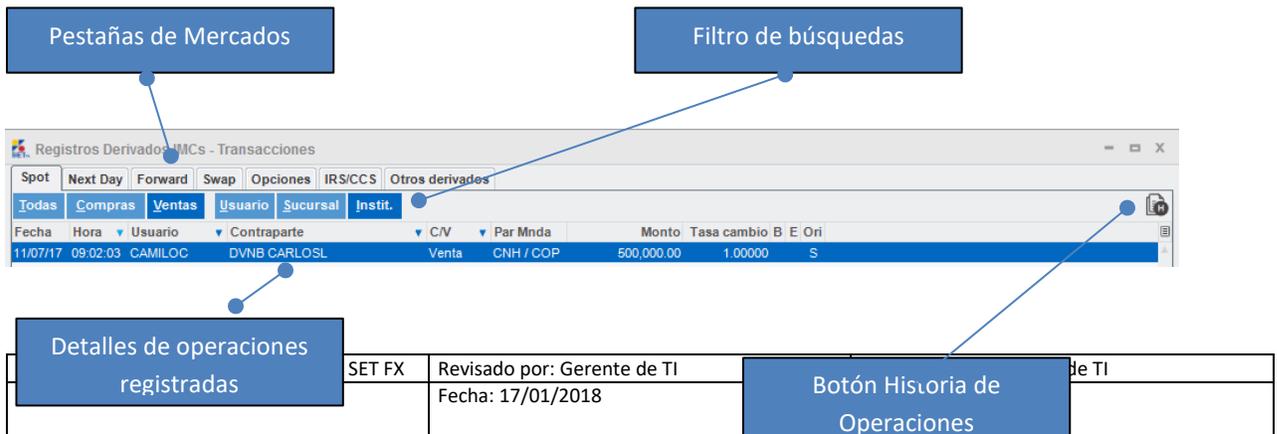
Para consultar los registros hechos con otros IMCs, se hace mediante la opción “precios montos transacciones propias “ de la barra de menú principal de registros de transacciones:



Luego se escoge la opción IMCs



La ventana que aparece contiene los registros realizados entre IMC's para aquellos pares de monedas diferentes al USD/COP.



The screenshot shows a table of transaction records with the following data:

Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	CV	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori
11/07/17	09:02:03	CAMILOC	DVNB CARLOSL	Venta	CNH / COP	500,000.00	1.00000			S

Below the table, there is a summary row:

SET FX	Revisado por: Gerente de TI	de TI
	Fecha: 17/01/2018	

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 10 / 91

Al realizar clic derecho sobre una operación, aparecerán las siguientes opciones:

Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori
11/07/17	09:02:03	CAMILOC	DVNB CARLOSL	Venta	CNH / COP	500,000.00	1.00000			S

Detalle

Historia

Anular transacción

Imprimir Papeleta

- Detalle: muestra el detalle de la operación

Registros Derivados - Detalle de transacción

Fecha: 11/07/2017 Código: 03NU6UUT2E Hora de registro: 15:58:03 Hora: 09:02:03

Comprador	Sucursal	Persona
BANCO DAVIVIENDA S.A.	BOGOTA	Carlos Fernando Landazabal
Por parte de:		
Vendedor	Sucursal	Persona
BANCO POPULAR S.A.	BOGOTA	Camilo Andrés Cespedes Molano
Por parte de:		

Par de monedas: CNH / COP

Monto: 500,000.00

Tasa de cambio: 1.00000

Monto COP: 500,000.00

Negociado en: DIRECTO

Origen de transacción: Registrado por CAMILOC

Comentario: Dolar

Origen: Spot

Fecha anterior:

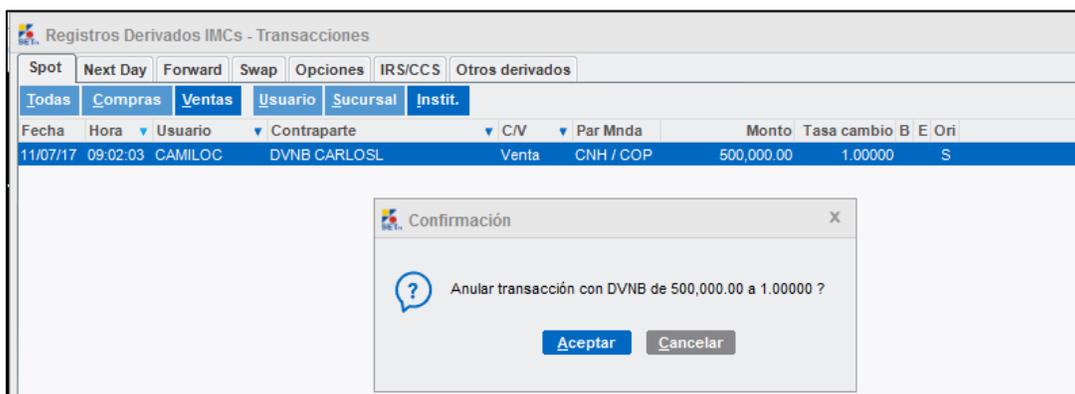
- Opción Historia: Permite presentar un detalle de registro de la operación

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Comentario
11/07/17	09:02:03	PPLB CAMILOC	Solicita registro	O	CNH / COP	500,000.00	1.00000		
11/07/17	09:02:03	PPLB CAMILOC	Registro	O	CNH / COP	500,000.00	1.00000		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 11 / 91

- Anular transacción: Permite realizar la anulación de un registro. Esta opción solo está disponible para operaciones registradas el mismo día y debe realizarse la anulación si es necesario antes de 15 minutos una vez registrada la operación.



- Opción Imprimir papeleta: permite imprimir la papeleta de la operación, cuando esta ha sido realizada el mismo día, no se puede imprimir papeletas de otras sucursales.

Fecha: 03/02/2016
Hora: 19:00:30

Sistema Electrónico de transacción y registro de moneda extranjera SET-FX

PAPELETA DE NEGOCIACION PARA REGISTROS DE DIVISAS
IMC'S

Fecha : 03/02/2016
 Código : O1BWINKI7
 Hora : 08:09:09
 Nro Liquidación : 5
 Mercado : Spot

Compra/Venta : COMPRA

Comprador: BANCO DAVIVIENDA
 Ciudad : BOGOTA
 Nombre : ALEJANDRA - Maria Alejandra Montealegre M
 Identificación : 860.034.313-7 Nit
 Por parte de :

Vendedor: ASESORES EN VALORES S.A.
 Ciudad : BOGOTA
 Nombre : JUANV - JUAN CAMILO VIVEROS
 Identificación : 890.931.609-9 Nit
 Por parte de :

Comentario :
 Negociado en :

Tasa de cambio : 3.2000000
 Monto : 50,000.00 CAD
 Par Monedas : CAD / AUD
 Origen : Swap O/N contado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 12 / 91

2.2.2. Consulta operaciones de días anteriores

En la barra de menú principal de “precios /montos Transacciones propias” existe el Botón historia, que permite visualizar las operaciones que se han registrado en días anteriores,



Una vez se de Click sobre este Icono aparecerá la siguiente ventana:

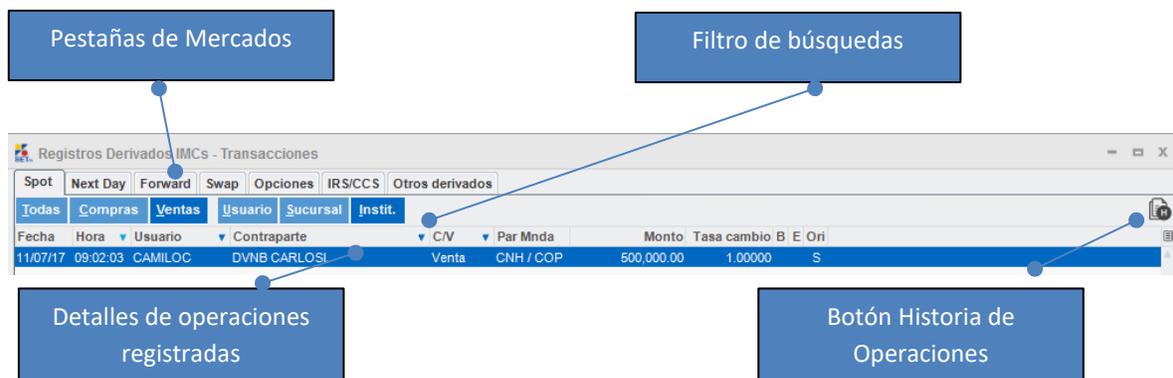


El usuario podrá escoger el mercado, y la fecha de los registros que desea buscar.



2.2.3. Registro Clientes

Son los registros realizados entre IMC's – Clientes (Sector Real), todos los pares de monedas.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 13 / 91

Al señalar una operación y hacer clic derecho aparecerán las siguientes opciones:



- Detalle: muestra el detalle de la operación

Registros Derivados - Detalle de transacción

Fecha: 11/07/2017 Código: O3NU6UUT2E Hora de registro: 15:58:03 Hora: 09:02:03

Comprador Sucursal Persona

BANCO DAVIVIENDA S.A. **BOGOTA** **Carlos Fernando Landazabal**

Por parte de :

Vendedor Sucursal Persona

BANCO POPULAR S.A. **BOGOTA** **Camilo Andrés Cespedes Molano**

Por parte de :

Par de monedas : **CNH / COP**

Monto : **500,000.00**

Tasa de cambio : **1.00000**

Monto COP : **500,000.00**

Negociado en : **DIRECTO**

Origen de transacción : **Registrado por CAMILOC**

Comentario : **Dolar**

Origen : **Spot**

Fecha anterior

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 14 / 91

- Información Complementaria: Información adicional

Información complementaria de transacción - Spot X

Fecha : 09/11/2017 Nro. Liquidación : 1 Hora : 11:14:00

Tasa de cambio : 3000.0000 Monto : 2'000,000.00 Par de monedas : USD / COP

Comprador

Usuario : AGRB Andres Augusto Bonilla Dueñas

Numeral cambiario : 1070 VENTA DE PETRO CRUDO Y GAS NAT DE PRO NA

Forma de pago : TRANSFERENCIA

Tipo de operación : POSICION PROPIA

Clase Id : Nit Identificación : 800.037.800-8

Nombre comitente : BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. BOGOTA

Porcentaje comisión : Monto comisión (Pesos) :

Vendedor

Clase Id : Nit Identificación : 800.120.681-2

Usuario : Croydon

Numeral cambiario : 1070 VENTA DE PETRO CRUDO Y GAS NAT DE PRO NA

Forma de pago : TRANSFERENCIA

Tipo de operación : POSICION PROPIA

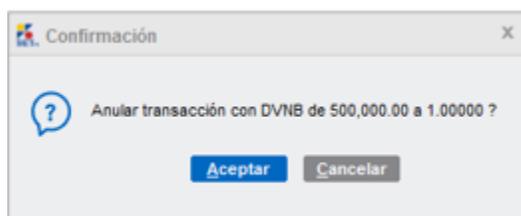
- Historia: presenta un detalle de registro de la operación

Registros Derivados - Historia de postura								
Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo Comentario
11/07/17	09:02:03	PPLB CAMILOC	Solicita registro	O	CNH / COP	500.000.00	1.00000	
11/07/17	09:02:03	PPLB CAMILOC	Registro	O	CNH / COP	500.000.00	1.00000	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 15 / 91

- Anular transacción: realiza la anulación de la operación, lo cual solamente está permitido para operaciones registradas el mismo día.



- Imprimir papeleta: permite imprimir la papeleta de la operación (solamente está permitido para operaciones registradas el mismo día).



Fecha: 04/02/2016
 Hora: 13:34:31

Sistema Electrónico de transacción y registro de moneda extranjera SET-FX

PAPELETA DE NEGOCIACION PARA REGISTROS DE DIVISAS

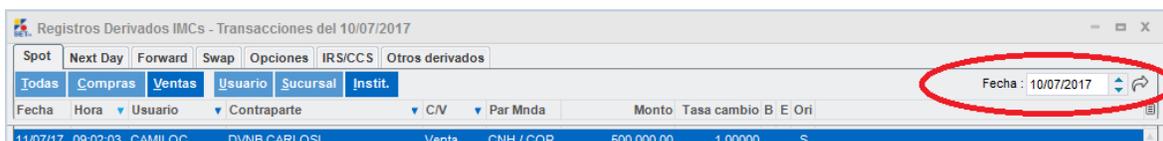
CLIENTES

Fecha :	04/02/2016	
Código :	O1BNMF8LJG	
Hora :	09:01:00	
Nro Liquidación :	2	
Mercado :	Spot	
Compra/Venta :	COMPRA	
Comprador:	BANCO DAVIVIENDA	
Ciudad :	BOGOTA	
Nombre :	CATALINA - Catalina Chaves Rodriguez	
Identificación :	860.034.313-7	Nit
Por parte de :		
Vendedor:	Otro	
Ciudad :		
Nombre :	FINAGRO	
Identificación :	800.116.398-7	Nit
Por parte de :		
Comentario :		
Negociado en :		
Tasa de cambio :	1234.0000	
Monto :	1,000,000.00	CAD
Par Monedas :	CAD / CLP	
Origen :	Spot	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 16 / 91

- Si se quieren consultar operaciones de días anteriores, se debe ir a la opción de Fecha en la parte superior derecha, esta permite visualizar las operaciones que se han registrado días anteriores, señalar el mercado, en el campo fecha, ingresar la fecha a buscar, botón Ir.



Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori
11/07/17	09:02:03	CAMILOC	DVNB CARLOSL	Venta	CNH / COP	500,000.00	1.00000			S

2.3. Comitentes

Visualiza los clientes o comitentes creados por la entidad. Tiene un botón Aumentar el cual le permite crear los clientes. El usuario solo puede ingresar o eliminar los clientes, las modificaciones como cambio de razón social, nombre mal ingresado, cambio de NIT solo las puede realizar el administrador del sistema SET-FX.



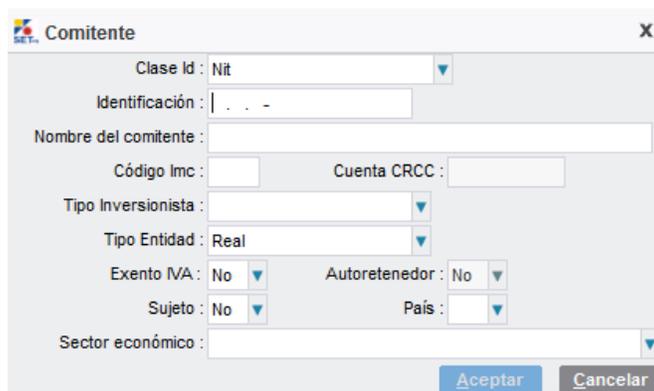
Código	Nombre	TE	Sector	Cta CRCC
N - 817.004.766-5	ALINZA GRAFICA S.A.	R	1811	
N - 860.020.382-4	ALMACEN GENERAL DE DEPOSITO S.A. ALPOPULAR	V	5210	
N - 830.134.574-2	ALPOPULAR CARGO	R	4923	
N - 800.059.688-3	ALURA ANIMAL HEALTH & NUTRITION SAS	R	2100	
N - 900.117.068-9	ANACAPE LTDA	R	4773	
C - 18.000.416	ARCHBOLD BRYAN ELWARD	R	0010	
N - 890.984.423-3	AREA METROPOLITANA DE MEDELLIN	R	7515	
N - 805.021.170-4	ARITEX DE COLOMBIA S A	R	1410	
N - 800.141.644-1	ARMADA NACIONAL (FUERZAS MILITARES)	R	8422	
N - 890.806.999-1	ARMETALES S.A.	R	4663	
N - 890.300.208-1	ARROCERA LA ESMERALDA LTDA	R	1051	
N - 830.031.778-5	ASCOMINT LTDA	R	5229	
N - 860.516.041-8	ASESORIA EN COMUNICACIONES ASECODES SA	R	6190	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 17 / 91

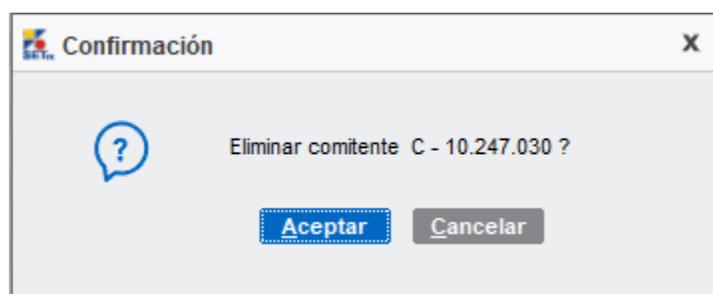
2.3.1. Aumentar

Se debe ingresar todos los datos para poder ingresar el cliente y poder aceptar la creación del cliente o comitente.



2.3.2. Eliminar

Si desea eliminar el cliente en la ventana comitentes, se debe seleccionar el cliente a eliminar y dar clic derecho eliminar, el sistema le va pedir confirmación de eliminación.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 18 / 91

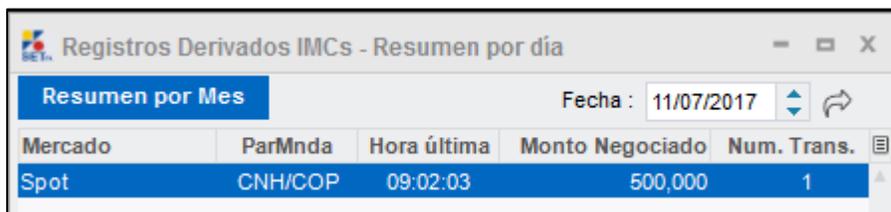
2.4. Resumen de precios/montos transados hoy

Muestra un resumen de las transacciones registradas a nivel general en este Mercado, encontramos dos opciones:



2.4.1. Resumen Divisas IMC's

Muestra un resumen detallado diario de registros IMC's – IMC's otras monedas por mercados, selecciona el mercado, doble clic y muestra el detalle de las operaciones registradas. Se podrá consultar operaciones registradas de días anteriores en el campo Fecha en la parte superior derecha de la ventana.



Mercado	ParMnda	Hora última	Monto Negociado	Num. Trans.
Spot	CNH/COP	09:02:03	500,000	1

El botón “Resumen por Mes”, muestra una nueva ventana con un resumen general de las operaciones por mes.



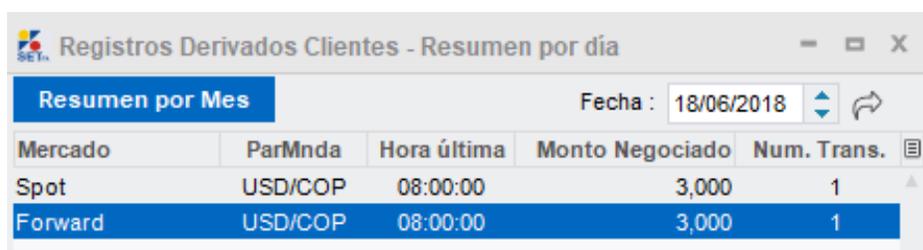
Mercado	ParMnda	Monto Negociado	Num. Trans.
Forward	ARS/USD	500,000	1
Forward	BRL/CHF	30,000	1

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 19 / 91

2.4.2. Resumen divisas Clientes

Muestra un resumen diario de registros IMC's – Clientes por pares de monedas y por mercados, selecciona el mercado, doble clic y muestra detalle de las operaciones registradas. Se podrá consultar operaciones registradas de días anteriores.



Mercado	ParMnda	Hora última	Monto Negociado	Num. Trans.
Spot	USD/COP	08:00:00	3,000	1
Forward	USD/COP	08:00:00	3,000	1

El botón Resumen por Mes, muestra una nueva ventana con un resumen por meses y mercados, puede realizar la consulta por meses en el campo Fecha



Mercado	ParMnda	Monto Negociado	Num. Trans.
Forward	ARS/USD	35,000	1
Forward	BRL/CHF	30,000	1
Forward	EUR/COP	1'410,000	2
Forward	EUR/USD	19'108,000	3
Forward	JPY/COP	7'510,000	2
Forward	USD/COP	211'183,000	40
Next Day	USD/COP	905,632	4
Spot	USD/COP	33'327,179	24
Fix	EUR/COP	24'000,000	2
Fix	EUR/USD	173'000,000	2
Fix	JPY/COP	125'600,000	5
Fix	JPY/USD	118'800,000	4

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 20 / 91

2.5. Solicitudes de Registro

Estado de los registrados enviados entre IMC's – IMC's.

Ventana de solicitud de registro IMC's: Se mostrará el detalle del registro enviado y su estado "Pendiente" indica que la contraparte no ha confirmado o "Confirmada" si fue aceptada por la contraparte



Registros Derivados - Solicitudes de registro																																
Todas			Compras			Ventas			Todas			Enviadas			Recibidas			Todas			Expiradas			Confirmadas			Pendientes			Rechazadas		
Hora	E/R	Mercado	Grupo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo Vence	Estado																						
11:02:03	Enviada	Spot	IMC-IMC	Venta	USD / BRL	DVNB CARLOSL	500,000.00	5.00000000		Pendiente																						
												<ul style="list-style-type: none"> Detalle Historia Confirmar registro Rechazar registro 																				

Ventana Solicitud de Registro contraparte, se habilita las opciones de confirmación, rechazo de registro, además del detalle del registro



Registros Derivados - Solicitudes de registro																																
Todas			Compras			Ventas			Todas			Enviadas			Recibidas			Todas			Expiradas			Confirmadas			Pendientes			Rechazadas		
Hora	E/R	Mercado	Grupo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo Vence	Estado																						
08:00:00	Recibida	Spot	IMC-IMC	Venta	CHF / CLP	BGTB ALEJANDRAB	500,000.00	2560.0000		Pendiente																						



Registros Derivados - Solicitudes de registro																																
Todas			Compras			Ventas			Todas			Enviadas			Recibidas			Todas			Expiradas			Confirmadas			Pendientes			Rechazadas		
Hora	E/R	Mercado	Grupo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo Vence	Estado																						
08:00:00	Recibida	Spot	IMC-IMC	Venta	CHF / CLP	BGTB ALEJANDRAB	500,000.00	2560.0000		Pendiente	<ul style="list-style-type: none"> Detalle Historia Confirmar registro Rechazar registro 																					

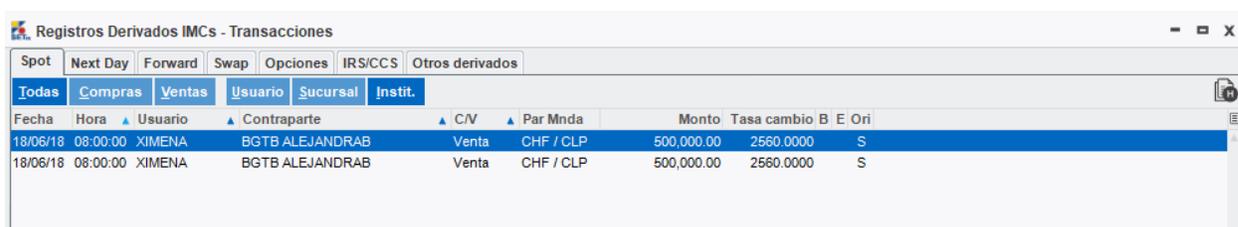
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 21 / 91

2.6. Anulaciones y Solicitudes de Anulación

Muestra el estado de las operaciones de anulación entre IMC's – IMC's.

Ventana de solicitud de anulación IMC's: Se mostrará el detalle del registro enviado para su anulación, su estado "Pendiente" indica que la contraparte no ha confirmado o "Confirmada" si fue aceptada por la contraparte.



Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori
18/06/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Venta	CHF / CLP	500,000.00	2560.0000			S
18/06/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Venta	CHF / CLP	500,000.00	2560.0000			S

Ventana Solicitud de Registro contraparte, se habilita las opciones de confirmación, rechazo de anulación, además del detalle del registro a anular. Las anulaciones solo se pueden realizar 15 minutos antes de registrar la operación.



Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori
18/06/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Venta	CHF / CLP	500,000.00	2560.0000			S
18/06/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Venta	CHF / CLP	500,000.00	2560.0000			S

- Detalle
- Historia
- Anular transacción
- Imprimir Papeleta

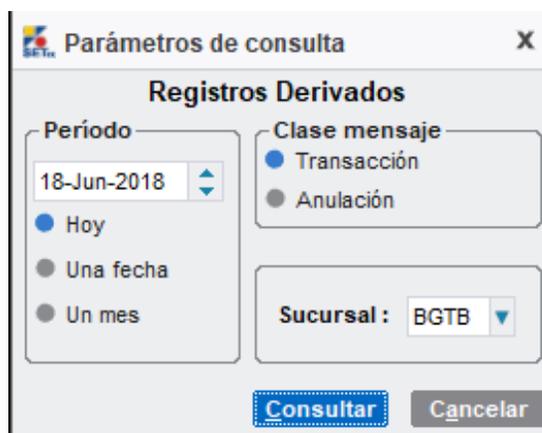
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 22 / 91

2.7. Consultas



La opción de consultas se podrá validar todas las transacciones y anulaciones realizadas en el mercado Registro de Divisas con un rango de fecha: Hoy, una fecha, un mes. El reporte con rango de un mes solo se puede realizar al finalizar el mercado SPOT interbancario (13:30).



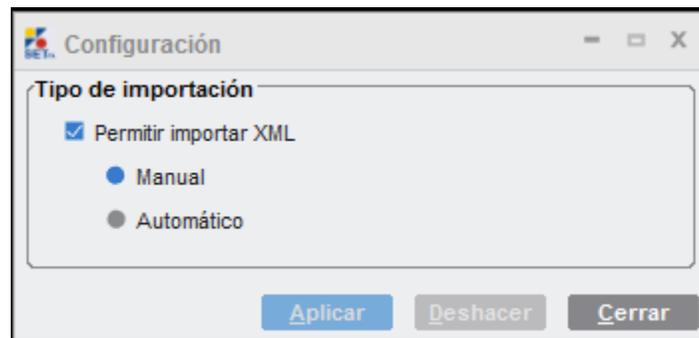
Registros Derivados - Consulta de mensajes											
Clase de mensaje : Transacción											
Período : Hoy											
Fecha	Hora	Código	Mercado	Grupo	Sucursal	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo Vence	FR
11/07/17	08:25:02	O3NUSUUT18	Spot	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Demanda	AUD / COP	1,000.00	2.0000		
11/07/17	09:02:03	O3NUSUUT2E	Spot	IMC-IMC	PPLB CAMILOC	Oferta	CNH / COP	500,000.00	1.00000		
11/07/17	09:25:02	O3NUSUUT1B	Spot	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Oferta	AUD / COP	5,000.00	.5000		
11/07/17	09:45:00	O3NUSUUT1T	Next Day	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Oferta	CAD / CHF	50,000.00	1.0000000	2	
11/07/17	09:46:00	O3NUSUUT1W	Forward	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Oferta	CAD / COP	50,000.00	1.0000	2 Semanas 25/07/2017	
11/07/17	09:46:00	O3NUSUUT1Z	Forward	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Demanda	CZK / USD	50,000.00	.010000	9 Meses 11/04/2018	
11/07/17	09:46:00	O3NUSUUT22	Forward	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Demanda	USD / BRL	50,000.00	.0010000	9 Meses 11/04/2018	
11/07/17	09:49:00	O3NUSUUT25	Forward	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Demanda	USD / AUD	50,000.00	1.0000	3 Meses 11/10/2017	
11/07/17	09:53:00	O3NUSUUT1O	Fix	IMC-Cliente	PPLB CAMILOC	Oferta	USD / COP	50,000.00		1 Día 12/07/2017	
11/07/17	12:02:03	O3NUSUUT2K	Spot	IMC-IMC	PPLB CAMILOC	Oferta	USD / BRL	500,000.00	5.0000000		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

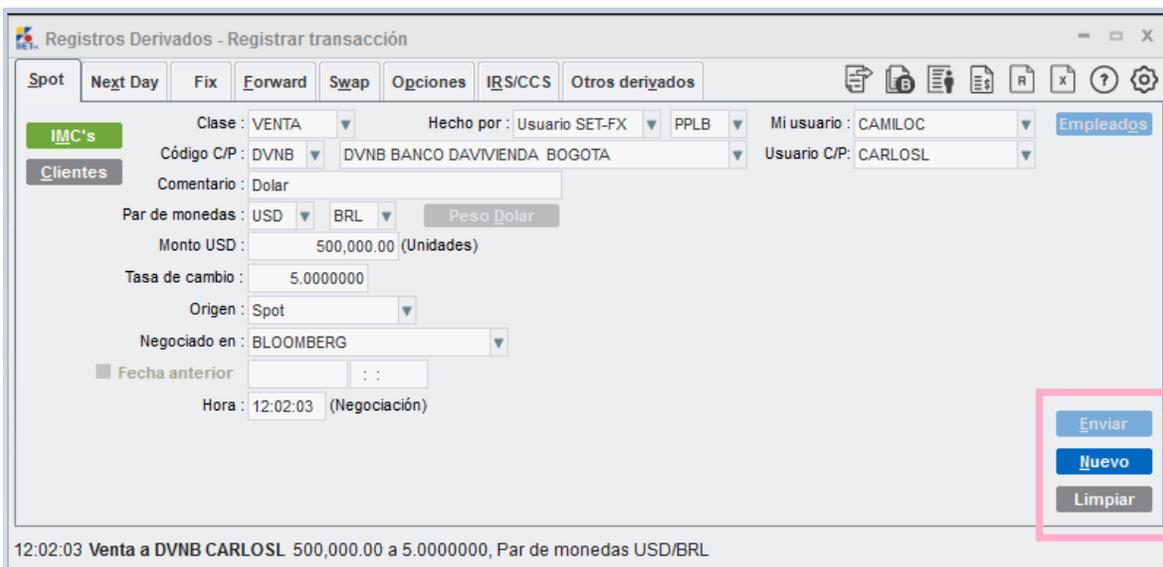
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 23 / 91

2.8. Configuración Mercado

Permite realizar la configuración del cargue del archivo XML bien sea manual o automático.



2.9. Botones: Enviar, Nuevo, Limpiar



- Enviar: cuando los datos de la operación este ingresados correctamente el Botón Enviar se activa, se procede a realizar el registro.

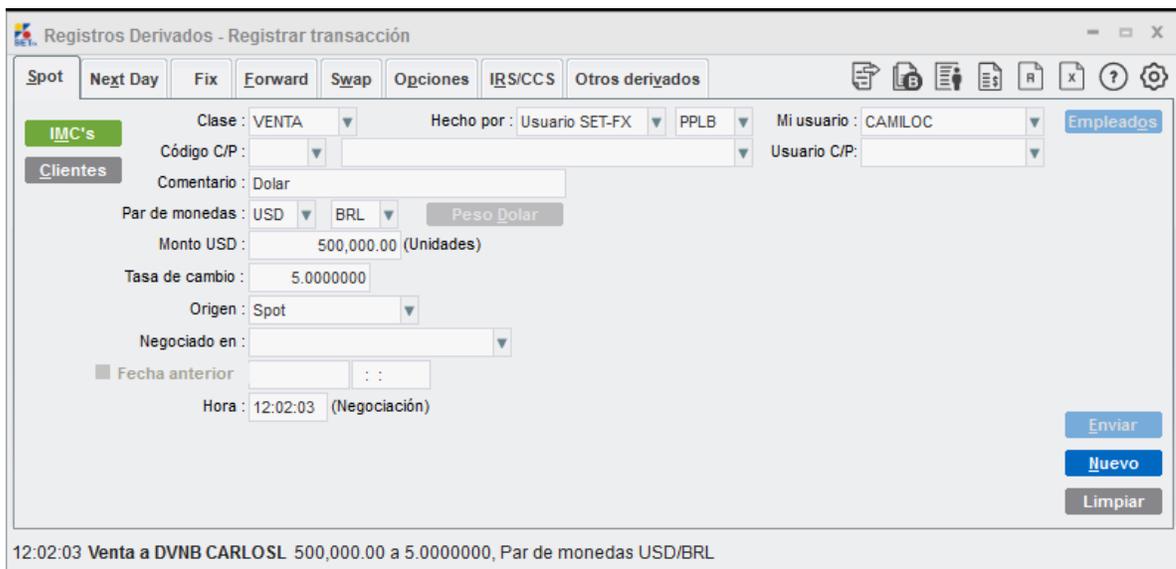
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 24 / 91

- Nuevo: permite realizar un nuevo registro con los datos del anterior registro enviado.
- Limpiar: Para borrar los datos en todos los campos y generar un nuevo registro.

3. Registro de Operaciones

Para iniciar un registro se debe elegir el mercado sobre el cual se requiere hacer el registro, luego se puede escoger el tipo de registro a realizar, es decir, si la operación es entre IMC's o es entre la entidad y un cliente de esta. Dependiendo de la opción que se escoja dando click sobre el botón correspondiente este se pondrá en color verde.



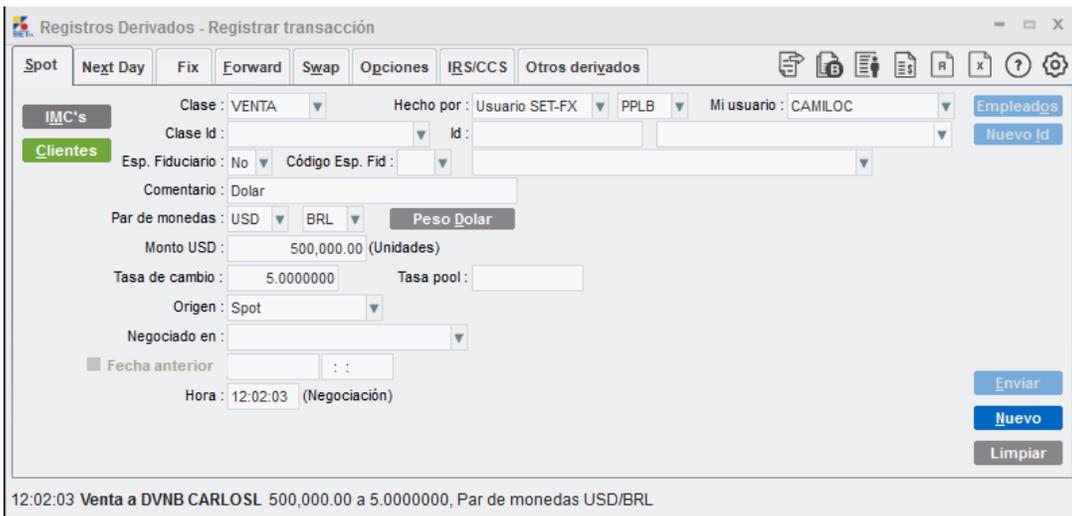
The screenshot shows a web application window titled "Registros Derivados - Registrar transacción". The interface includes a navigation menu with options like "Spot", "Next Day", "Fix", "Forward", "Swap", "Opciones", "IRS/CCS", and "Otros derivados". The "Spot" option is selected and highlighted in green. The form contains the following fields and controls:

- Clase:** VENTA (dropdown menu)
- Hecho por:** Usuario SET-FX (dropdown menu)
- PPLB:** (dropdown menu)
- Mi usuario:** CAMILOC (dropdown menu)
- Empleados:** (button)
- Código C/P:** (dropdown menu)
- Usuario C/P:** (dropdown menu)
- Comentario:** Dolar
- Par de monedas:** USD (dropdown), BRL (dropdown), with a "Peso Dolar" button.
- Monto USD:** 500,000.00 (Unidades)
- Tasa de cambio:** 5.0000000
- Origen:** Spot (dropdown menu)
- Negociado en:** (dropdown menu)
- Fecha anterior:** (input field)
- Hora:** 12:02:03 (Negociación)

At the bottom right, there are three buttons: "Enviar" (blue), "Nuevo" (blue), and "Limpiar" (grey). A status bar at the bottom of the window displays the transaction details: "12:02:03 Venta a DVNB CARLOSL 500,000.00 a 5.0000000, Par de monedas USD/BRL".

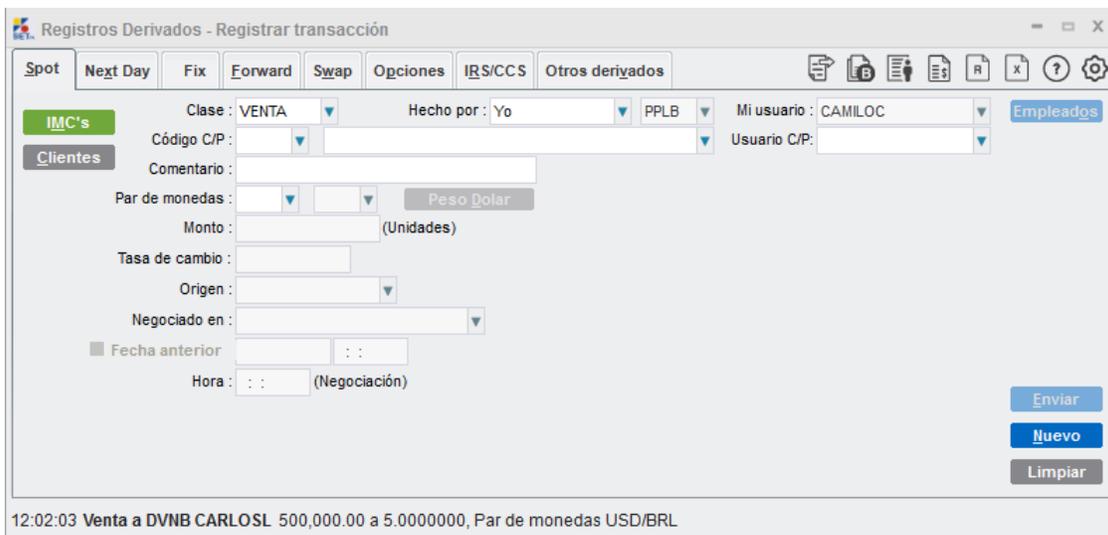
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 25 / 91



Cada registro que se haga independientemente del tipo que se elija existen campos que son obligatorios, que mientras no sean diligenciado en su totalidad el botón enviar no se va habilitar.

3.1. Registro Operación IMC's – IMC's – Mercado Spot

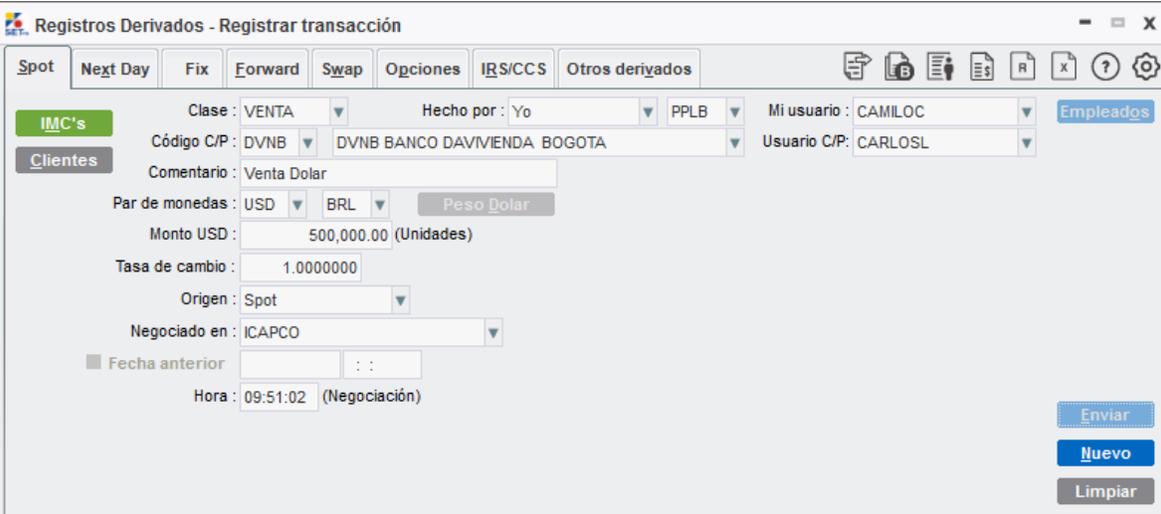


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 26 / 91

En general estos son los campos que compone la información de un registro.

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo al primer par de moneda
- Origen: Origen de la Operación
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Venta Dolar

Par de monedas: USD BRL Peso Dolar

Monto USD: 500,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 1.0000000

Origen: Spot

Negociado en: ICAPCO

Fecha anterior : :

Hora: 09:51:02 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

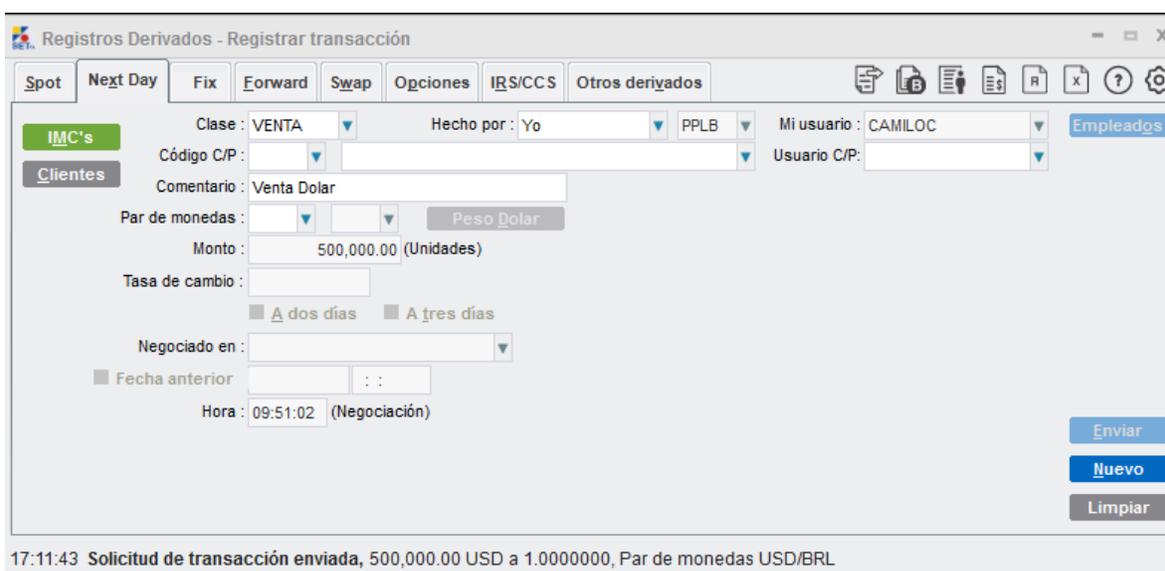
17:11:43 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 1.0000000, Par de monedas USD/BRL

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 27 / 91

Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

3.2. Registro Operación IMC's – IMC's – Mercado Next Day



- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo al primer par de moneda

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 28 / 91

- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación
- Casillas: “A dos días”, “A tres días”: al marcar la casilla va indicar la cantidad de días de vencimiento 2 y 3 días, si no marca ninguna casi el sistema lo toma como un Next Day a 1 día.

A dos días A tres días

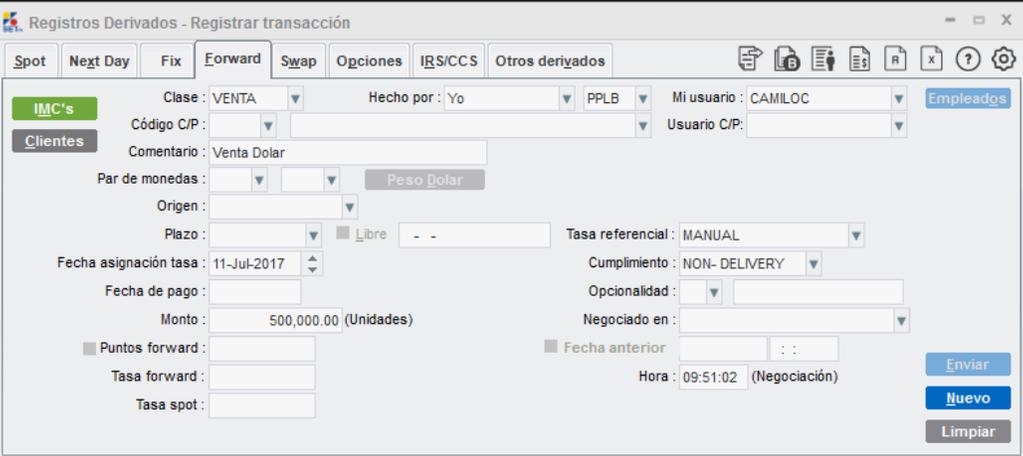


Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 29 / 91

3.3. Registro Operación IMC's – IMC's – Mercado Forward



- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 30 / 91

- Plazo libre:

Plazo : 1 Mes Libre Jueves 10-Ago-2017

- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Puntos Forward: cantidad de puntos que serán sumados a la tasa Spot
- Tasa Forward
- Tasa de spot
- Origen: Origen de la Operación, opciones Forward-Forward, OTRA, Swap, Fix
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Venta Dolar

Par de monedas: USD DEM Peso Dolar

Origen:

Plazo: 1 Mes Libre Jueves 10-Ago-2017 Tasa referencial: MANUAL

Fecha asignación tasa: 11-Jul-2017 Cumplimiento: NON- DELIVERY

Fecha de pago: 11-Ago-2017 Opcionalidad:

Monto USD: 500,000.00 (Unidades) Negociado en:

Puntos forward: 1000.0000 Fecha anterior:

Tasa forward: 1001.0000 Hora: 09:51:02 (Negociación)

Tasa spot: 1.0000

Enviar Nuevo Limpiar

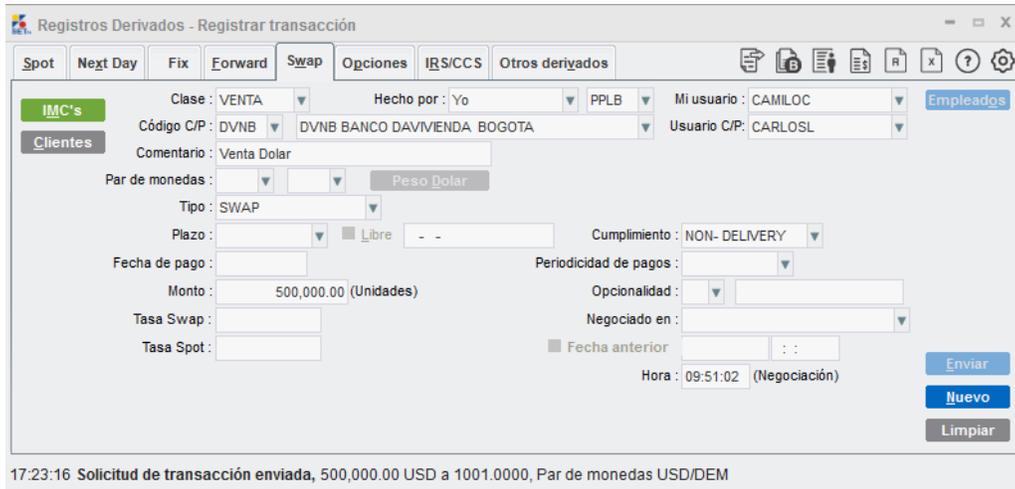
17:23:16 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 1001.0000, Par de monedas USD/DEM

Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 31 / 91

3.4. Registro Operación Swap IMC's – IMC's



17:23:16 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 1001.0000, Par de monedas USD/DEM

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:

Plazo:	▼
Fecha asignación tasa:	1 Semana
Fecha de pago:	2 Semanas
Monto USD:	1 Mes
■ Puntos forward:	2 Meses
Tasa forward:	3 Meses
Tasa spot:	6 Meses
	9 Meses
	1 Año
	18 Meses
	2 Años

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 32 / 91

- Plazo libre:

Plazo : 1 Mes Libre Jueves 10-Ago-2017

- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa Swap
- Tasa Spot
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

Clase: VENTA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Venta Dolar

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

Tipo: SWAP

Plazo: 1 Mes Libre Jueves 10-Ago-2017 Cumplimiento: NON- DELIVERY

Fecha de pago: 11-Ago-2017 Periodicidad de pagos: Mensual

Monto USD: 500,000.00 (Unidades) Opcionalidad:

Tasa Swap: 1.0000000 Negociado en: ICAPCO

Tasa Spot: .4000000 Fecha anterior

Hora: 09:51:02 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

17:29:05 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 0.6000000, Par de monedas USD/DKK

Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 33 / 91

3.5. Registro Operación IMC's – IMC's – Mercado Opciones



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Tipo: Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Venta Dolar

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

Plazo: Libre - - Cumplimiento: NON- DELIVERY

Fecha de pago: Tasa Strike:

Monto USD: 500,000.00 (Unidades) Condición del ejercicio:

Tasa pactada (Spot): Porcentaje de volatilidad:

Prima COP/USD: Negociado en: ICAPCO

Tipo de opción: Fecha anterior: Hora: 09:51:02 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

17:29:05 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 0.6000000, Par de monedas USD/DKK

- Tipo: CALL DE COMPRA/VENTA, PUT DE COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:



Plazo:

- Fecha asignación tasa: 1 Semana
- 2 Semanas
- Fecha de pago: 1 Mes
- Monto USD: 2 Meses
- 3 Meses
- Puntos forward: 6 Meses
- Tasa forward: 9 Meses
- 1 Año
- Tasa spot: 18 Meses
- 2 Años

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 34 / 91

- Plazo libre:

Plazo : Libre

- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa pactada (Spot):
- Prima COP/USD:
- Tipo de Opción: AMERICANA, EUROPEA, OTRA
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Tasa Strike:
- Condición del ejercicio:
- Porcentaje de Volatilidad:
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. . Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación
-

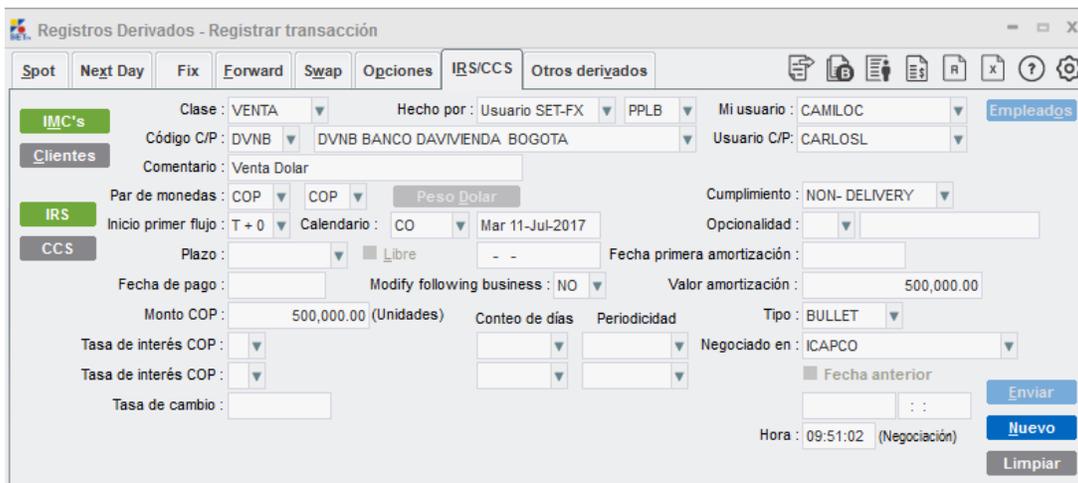


Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 35 / 91

3.6. Registro Operación IMC's – IMC's Mercado IRS



17:32:35 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 USD a 1.0000, Par de monedas USD/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA
- Calendario: CO, CO-NY
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 36 / 91

Plazo : |

Fecha asignación tasa : 1 Semana
2 Semanas

Fecha de pago : 1 Mes
2 Meses
3 Meses

■ Puntos forward : 6 Meses
9 Meses
1 Año

Tasa forward : 18 Meses
2 Años

- Plazo libre:

Plazo : 2 Semanas | Libre | Mar 25-Jul-2017

- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Modify Following Business: SI, NO
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- **Tasa de Interés: va** de acuerdo al par de monedas, se pueden ingresar con signo negativo. Fijo, Variable. Opción Fijo, activa un campo para el porcentaje de la tasa. Opción Variable

Tasa de interés COP : F | 5.000000%

Tasa de interés COP : V | | +

Tasa de cambio : |

5 Solicitud de transacción | 0,00

DTF90
EUR3M
EUR6M
FED
IBR1M
IBR3M
IBR6M
IBRON
IPC
LBR12
LBR1M
LBR3M
LBR6M
VAC

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 37 / 91

- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Opcionalidad: Si/No comentario
- Fecha primera amortización
- Valor amortización
- Tipo: BULLET, IGUALES
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Usuario SET-FX PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Venta Dolar

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Cumplimiento: NON-DELIVERY

Inicio primer flujo: T + 0 Calendario: CO Mar 11-Jul-2017 Opcionalidad:

Plazo: 2 Semanas Libre Mar 25-Jul-2017 Fecha primera amortización: 25-Jul-2017

Fecha de pago: 25-Jul-2017 Modify following business: NO Valor amortización: 500,000.00

Monto COP: 500,000.00 (Unidades) Conteo de días: 30/360 Periodicidad: Mensual Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F 5.000000% Negociado en: ICAPCO

Tasa de interés COP: V DTF90 + 1.0000 30/360 Mensual

Tasa de cambio:

Fecha anterior

Hora: 09:51:02 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

17:47:03 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 COP, Par de monedas COP/COP

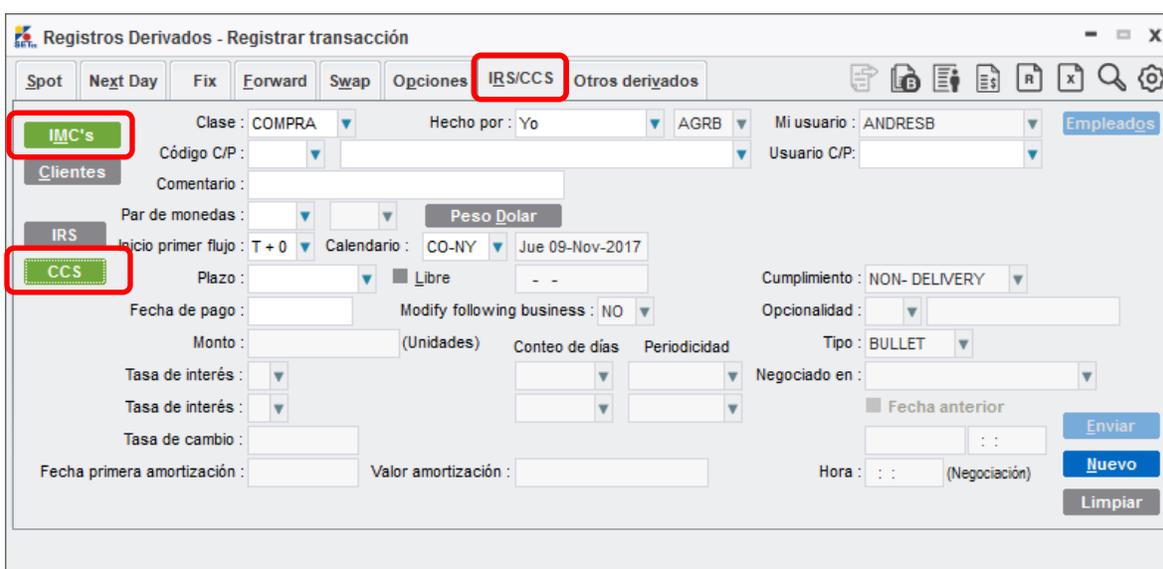
Una vez se ingrese la información completa, se habilita el botón enviar y al dar click se despliega un mensaje indicando que el registro fue enviado a la contraparte, para su aprobación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 38 / 91

3.7. Registro Operación IMC's – IMC's - Mercado IRS/CCS

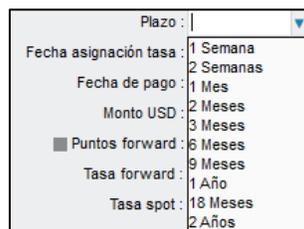
Para el ingreso de este tipo de operaciones, en la ventana de registros de derivados se debe dar click en la pestaña IRS/CCS



- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

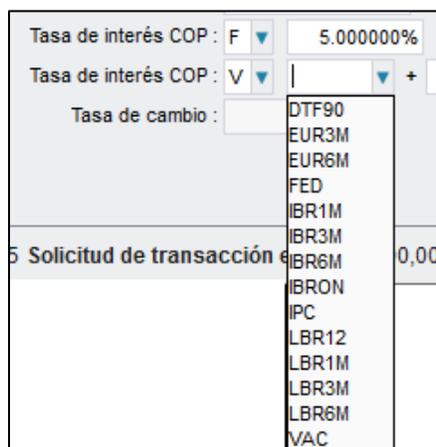
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 39 / 91



- Plazo libre:



- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Modify Following Business: SI, NO
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Interés: va de acuerdo al par de monedas, se pueden ingresar con signo negativo. Fijo, Variable. Opción Fijo, activa un campo para el porcentaje de la tasa. Opción Variable



- Tasa de cambio:
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Opcionalidad:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

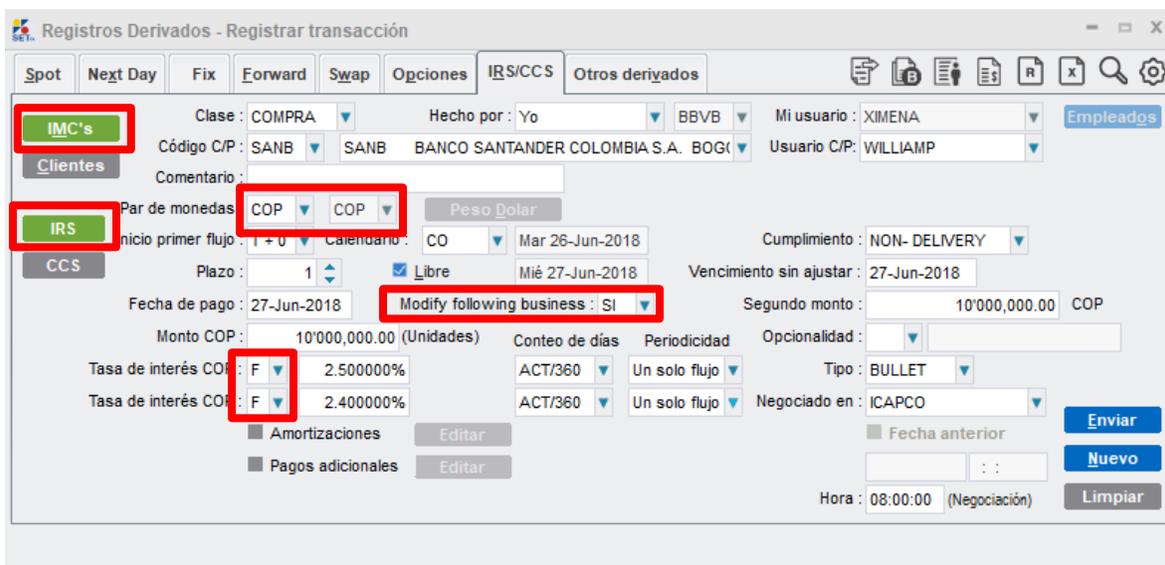
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 40 / 91

- Fecha primera amortización:
- Valor amortización:
- Tipo: BULLET, IGUALES
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

3.7.1 Compensación Operaciones IRS entre IMC's

Para el envío de operaciones IRS entre IMC's a cámara de compensación se deben cumplir ciertas condiciones, las condiciones para el envío de estas operaciones se detallan a continuación:

- El monto de la operación debe ser un múltiplo de 500'000.000 COP.
- Solo las operaciones COP/COP serán compensadas.
- Solo se aceptará la combinación de tasa en el orden: Fija / Variable.
- Dentro del campo de "Modify following bussines" siempre debe estar marcada la opción: "SI".



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 41 / 91



Hora	E/R	Mercado	Grupo	C/V	Par Mnda	Contraparte	Monto	Tasa	Plazo Vence	Estado
08:00:00	Recibida	IRS/CCS	IMC-IMC	Venta	COP / COP	BBVB XIMENA	10'000,000.00		0/ 1 27/06/2018	Pendiente

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 42 / 91

```

VENTA Registros Derivados      08:10:00
Mercado : IRS, IMCs
Par de monedas: COP/COP
Inst Usuario                    Monto
BBVB XIMENA                    534'590,000.00
Plazo: 18 Meses
Registrado por BBVB XIMENA
  
```

Registros Derivados IMCs - Transacciones																		
												IRS/CCS	Otros derivados					
													Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA					
03/07/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:00:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	5,000.00		0/6	09/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	03/01/2019				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	50'000,000.00		6 Meses	03/01/2019				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				...					

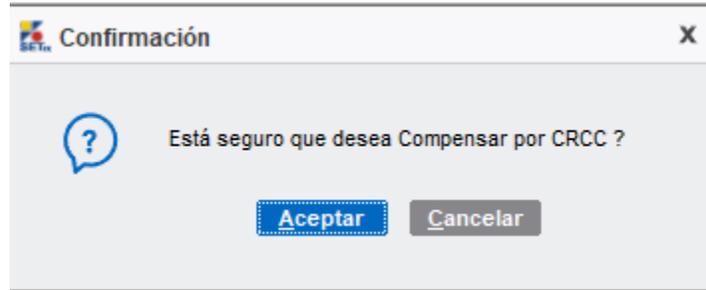
Registros Derivados IMCs - Transacciones																		
												IRS/CCS	Otros derivados					
													Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence B	E	Est	Ncp	Am PA					
03/07/18	08:00:00	XIMENA	BGTB ALEJANDRAB	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:00:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	5,000.00		0/6	09/07/2018									
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	03/01/2019				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	50'000,000.00		6 Meses	03/01/2019				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				PR					
03/07/18	08:10:00	XIMENA	OCCB MARCELA	Compra	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020				...					

Detalle

- Amortizaciones
- Pagos adicionales
- Compensar por CRCC**
- Modificar
- Historia
- Anular transacción
- Imprimir Papeleta

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 43 / 91



Registros Derivados IMCs - Transacciones

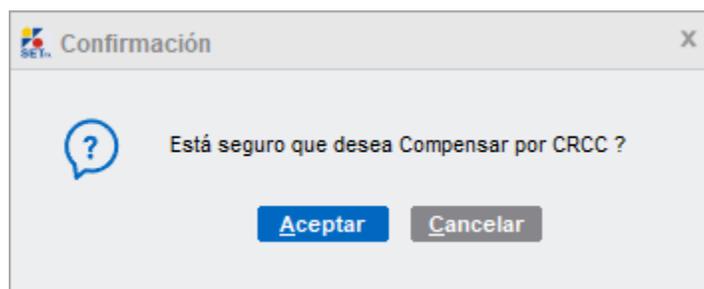
Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.									
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B	E	Est	Ncp	Am PA
03/07/18	08:00:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	USD / USD	5,000.00			0/1	04/07/2018				
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	USD / USD	5,000.00			0/1	04/07/2018				
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	5,000.00			0/6	09/07/2018				
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	03/01/2019			PR		
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	50'000,000.00		6 Meses	03/01/2019			PR		
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020			PR		
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020			PR		
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020			SC		

Detalle

- Amortizaciones
- Pagos adicionales
- Compensar por CRCC
- Rechazar compensación por CRCC
- Historia
- Imprimir Papeleta

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 44 / 91



Registros Derivados IMCs - Transacciones															
Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados															
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.															
Fecha	Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence	B	E	Est	Ncp	Am	PA
03/07/18	08:00:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018						
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018						
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	USD / USD	5,000.00		0/1	04/07/2018						
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	5,000.00		0/6	09/07/2018						
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	500'000,000.00		6 Meses	03/01/2019						PR
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	50'000,000.00		6 Meses	03/01/2019						PR
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020						PR
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020						PR
03/07/18	08:10:00	MARCELA	BBVB XIMENA	Venta	COP / COP	534'590,000.00		18 Meses	06/01/2020						PR

Estados de compensación CRCC

- PC: Pendiente Contraparte
- SC: Solicitud Contraparte
- PR: Pendiente de Riesgos
- CR: Compensada
- NC: No Compensada
- Pendiente

En el Blotter en la columna Estado en las transacciones que son compensadas por la CRCC y tienen el menú habilitado "Compensar por CRCC" se muestran de la siguiente manera "...", las transacciones que no son compensables por CRCC, no tienen el menú habilitado Compensar por CRCC, en la columna estado este campo llegará vacío.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 45 / 91

Tasa cambio	Plazo	Vence B	F	Est	Ncp	Am PA
	0/1	04/07/2018				
	0/1	04/07/2018				
	0/1	04/07/2018				
	0/1	04/07/2018				
	0/6	09/07/2018				
6 Meses	03/01/2019			PR		
6 Meses	03/01/2019			PR		
18 Meses	06/01/2020			PR		
18 Meses	06/01/2020			PR		
18 Meses	06/01/2020			PR		

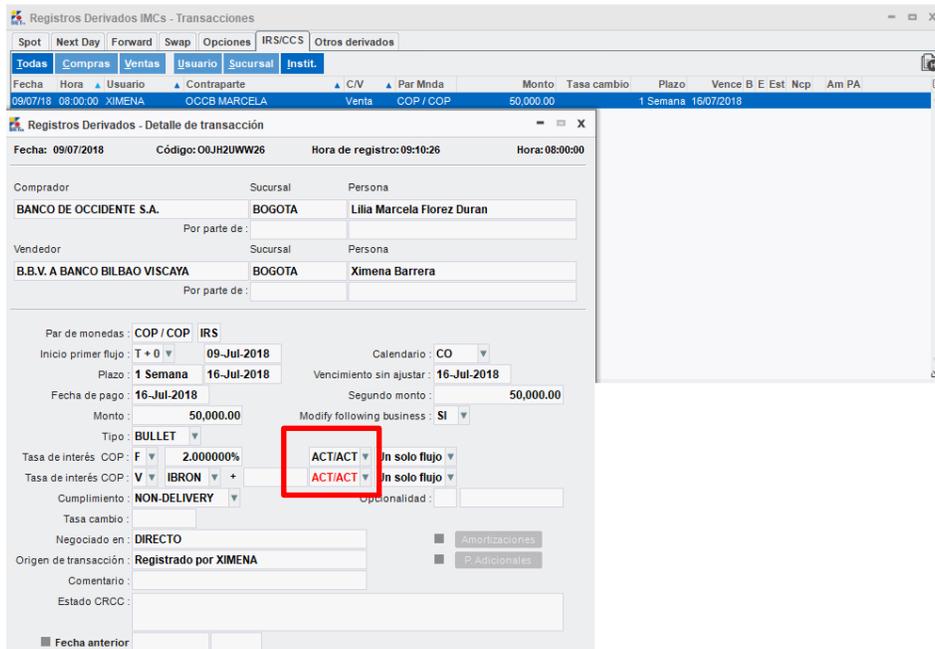
Detalle	
Amortizaciones	
Pagos adicionales	
Compensar por CRCC	
Modificar	
Historia	
Anular transacción	
Imprimir Papeleta	

Aquellos campos que no cumplan con las condiciones anteriormente mencionadas para que puedan ser compensadas por la CRCC se mostraran de color rojo dando click derecho detalle desde el blotter de operaciones y se podrá visualizar los campos que no cumplen estas condiciones.

La operación no podrá ser compensada hasta que no cumpla con las condiciones anteriormente indicadas.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 46 / 91



Registros Derivados - Transacciones

Spot Next Day Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados

Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.

Fecha Hora Usuario Contraparte CV Par Mnda Monto Tasa cambio Plazo Vence B E Est Ncp Am PA

09/07/18 08:00:00 XIMENA OCCB MARCELA Venta COP / COP 50,000.00 1 Semana 16/07/2018

Registros Derivados - Detalle de transacción

Fecha: 09/07/2018 Código: 00JH2UWW26 Hora de registro: 09:10:26 Hora: 08:00:00

Comprador: BANCO DE OCCIDENTE S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Lilia Marcela Florez Duran

Vendedor: B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA Sucursal: BOGOTA Persona: Ximena Barrera

Par de monedas: COP / COP IRS

Inicio primer flujo: T + 0 09-Jul-2018 Calendario: CO

Plazo: 1 Semana 16-Jul-2018 Vencimiento sin ajustar: 16-Jul-2018

Fecha de pago: 16-Jul-2018 Segundo monto: 50,000.00

Monto: 50,000.00 Modify following business: SI

Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F 2.000000% ACT/ACT In solo flujo

Tasa de interés COP: V IBRON ACT/ACT In solo flujo

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa cambio:

Negociado en: DIRECTO

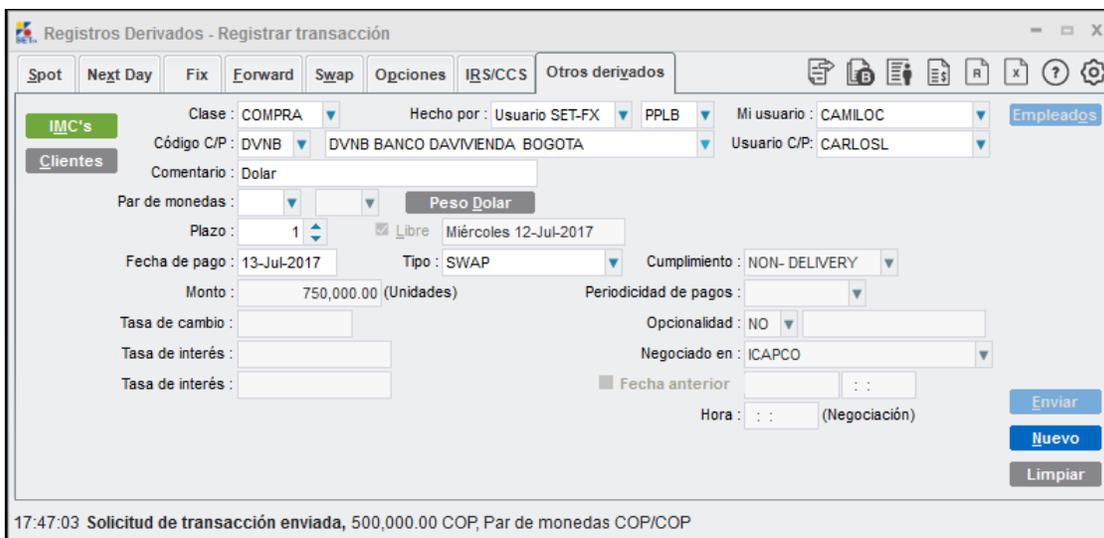
Origen de transacción: Registrado por XIMENA

Comentario:

Estado CRCC:

Fecha anterior

3.8. Registro Operación Otros derivados IMC's – IMC's



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's

Clase: COMPRA Hecho por: Usuario SET-FX PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Código C/P: DVNB DVNB BANCO DAVIVIENDA BOGOTA Usuario C/P: CARLOSL

Comentario: Dolar

Par de monedas: Peso Dolar

Plazo: 1 Libre Miércoles 12-Jul-2017

Fecha de pago: 13-Jul-2017 Tipo: SWAP Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 750,000.00 (Unidades) Periodicidad de pagos:

Tasa de cambio:

Tasa de interés:

Tasa de interés:

Negociado en: ICAPCO

Fecha anterior

Hora: (Negociación)

Enviar

Nuevo

Limpiar

17:47:03 Solicitud de transacción enviada, 500,000.00 COP, Par de monedas COP/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 47 / 91

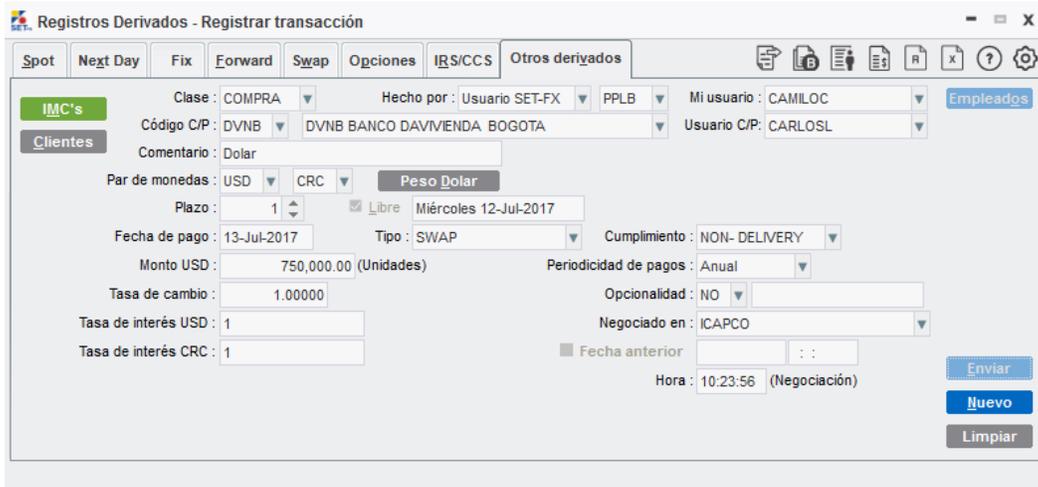
- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Código C/P: Institución contraparte
- Usuario C/P: Nombre usuario contraparte
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: por defecto es libre

Plazo : Libre

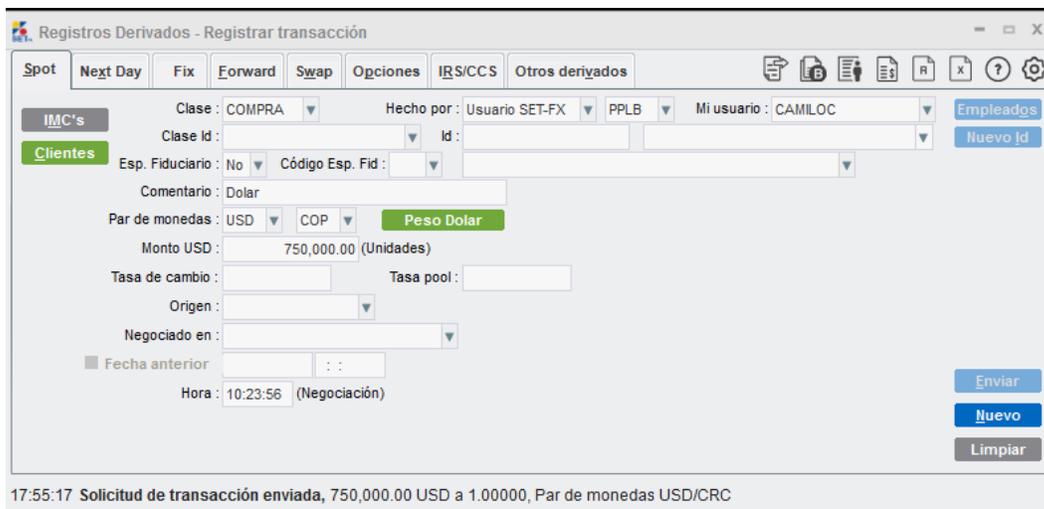
- Fecha de pago
- Monto: Monto de acuerdo al primer par de moneda
- Tasa de Cambio
- Tasa de interés: de acuerdo al primer par de moneda
- Tasa de interés: de acuerdo al segundo par de moneda
- Tipo: SWAP, FORWARD FORWARD, NO APLICA
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Opcionalidad:
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 48 / 91



3.9. Registro Operación Spot IMC's – CLIENTES



17:55:17 Solicitud de transacción enviada, 750,000.00 USD a 1.00000, Par de monedas USD/CRC

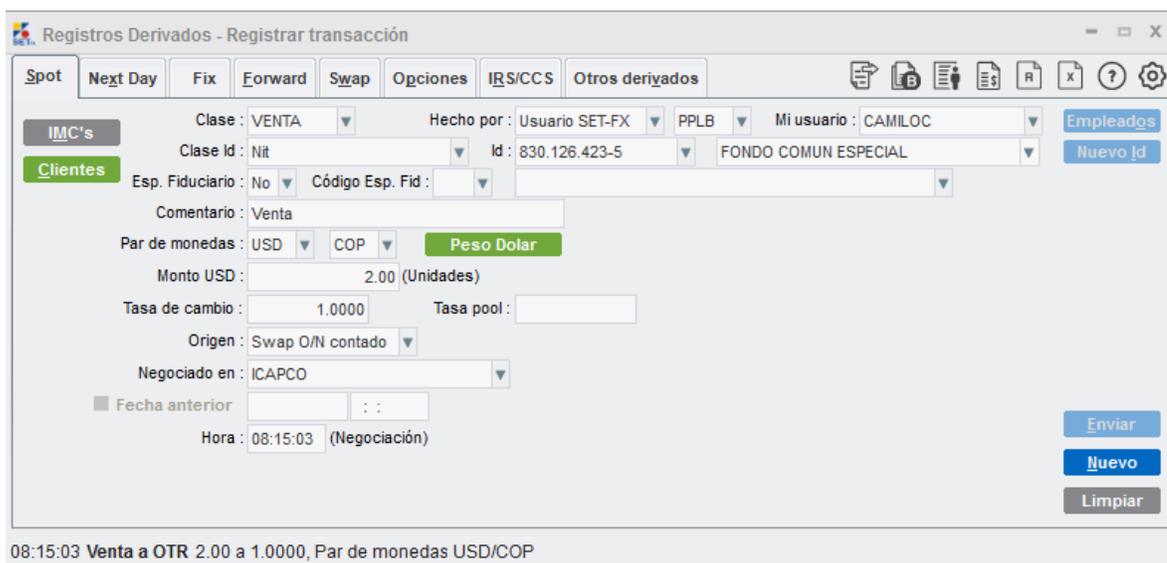
- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 49 / 91

- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación.
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar.
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado.
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo al primer par de moneda.
- Origen: Swap Forward, Swap O/N contado, Spot, Swap Futuro.
- Negociado en: el campo se activa cuando la entidad contraparte esta creada como entidad del Exterior. Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

3.10. Registro Operación Next Day IMC's – CLIENTES



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Usuario SET-FX PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Clase Id: Nit Id: 830.126.423-5 FONDO COMUN ESPECIAL Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario: Venta

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

Monto USD: 2.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 1.0000 Tasa pool:

Origen: Swap O/N contado

Negociado en: ICAPCO

Fecha anterior

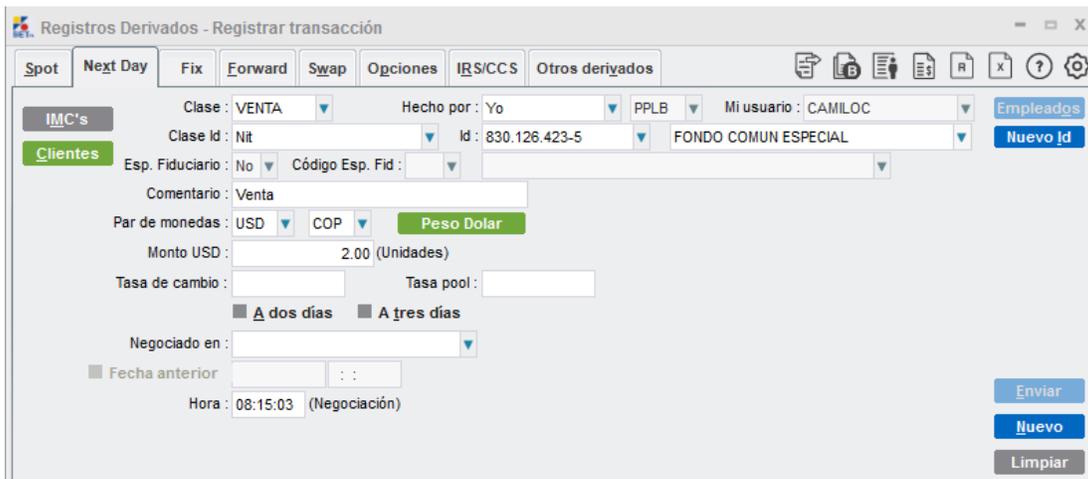
Hora: 08:15:03 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

08:15:03 Venta a OTR 2.00 a 1.0000, Par de monedas USD/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 50 / 91



08:15:03 Venta a OTR 2.00 a 1.0000, Par de monedas USD/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Cambio: tasa de cambio va de acuerdo al primer par de moneda
- Casillas “A dos días”, “A tres días”: al marcar la casilla va indicar la cantidad de días de vencimiento 2 y 3 días, si no marca ninguna casi el sistema lo toma como un Next Day a 1 día.

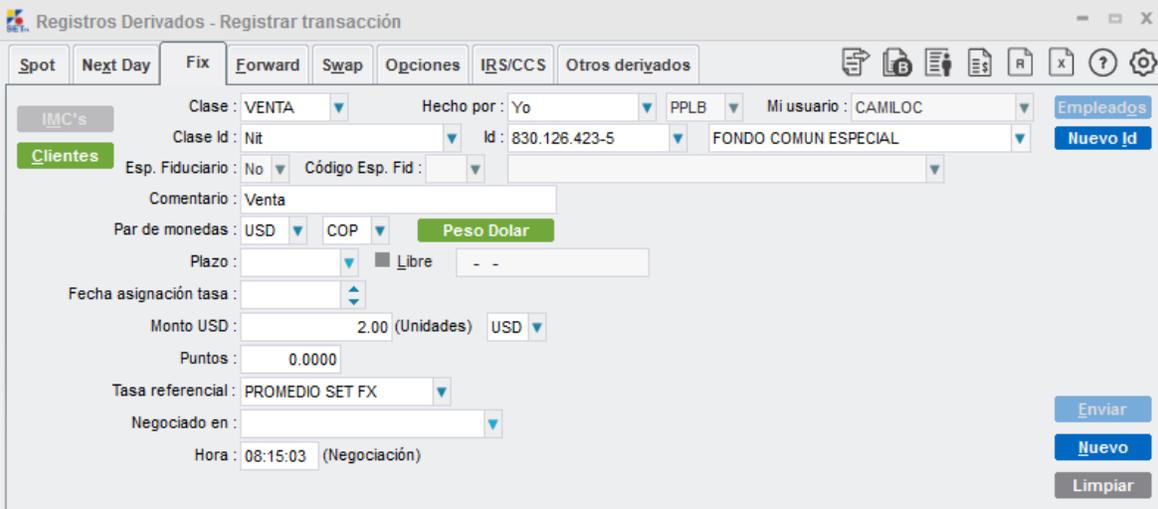
A dos días A tres días

- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación. Escoger una de las opciones del checkbox.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 51 / 91

3.11. Registros Operaciones FIX IMC's – CLIENTES



08:15:03 Venta a OTR 2.00 a 1.0000, Par de monedas USD/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte0
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: por defecto el par de monedas es USD/COP, sin embargo, se permite el registro de operaciones FIX sobre cualquier par de monedas.
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Puntos: Se indican los puntos que se deben adicionar o restar a la tasa de referencia seleccionada.
- Fecha asignación precio:
- Tasa referencial: Promedio SET-FX, TRM, Manual
- Plazo: Hoy, 1 Día, 2 días, 3 días. Casilla para marcar plazo libre

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 52 / 91

Plazo : 1 Día
 Fecha asignación tasa : Hoy
 Monto USD :
 Puntos : 0.0000

Plazo : 1 Día Libre
 Fecha asignación tasa : Hoy 2016
 Monto USD :
 Puntos :
 Hora : : (Negociación)

Plazo : 1 Libre Jueves 13-Jul-2017
 Fecha asignación tasa : 13-Jul-2017

- Hora: Hora de cierre de la operación

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase : VENTA Hecho por : Yo PPLB Mi usuario : CAMILOC Empleados
 Clase Id : Nit Id : 830.126.423-5 FONDO COMUN ESPECIAL Nuevo Id
 Esp. Fiduciario : No Código Esp. Fid :
 Comentario : Venta
 Par de monedas : USD COP **Peso Dolar**
 Plazo : 1 Libre Jueves 13-Jul-2017
 Fecha asignación tasa : 13-Jul-2017
 Monto USD : 20,000.00 (Unidades) USD
 Puntos : 0.0000
 Tasa referencial : PROMEDIO SET FX
 Negociado en : ICAPCO
 Hora : 08:15:03 (Negociación)

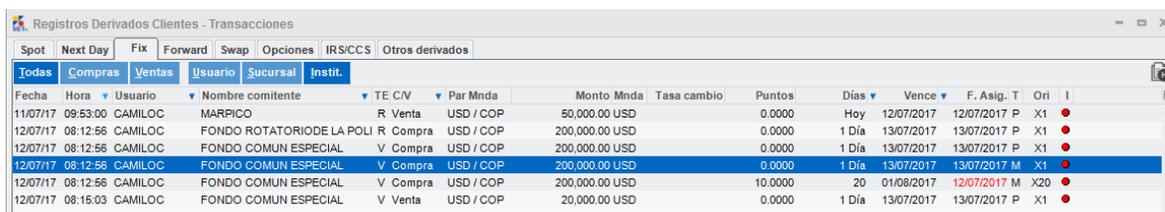
Enviar Nuevo Limpiar

08:15:03 Venta a OTR 2.00 a 1.0000, Par de monedas USD/COP

Estas operaciones que fueron registradas podrá ubicarse de manera consolidada podemos ubicar en el botón precios/montos transacciones propias, clientes

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

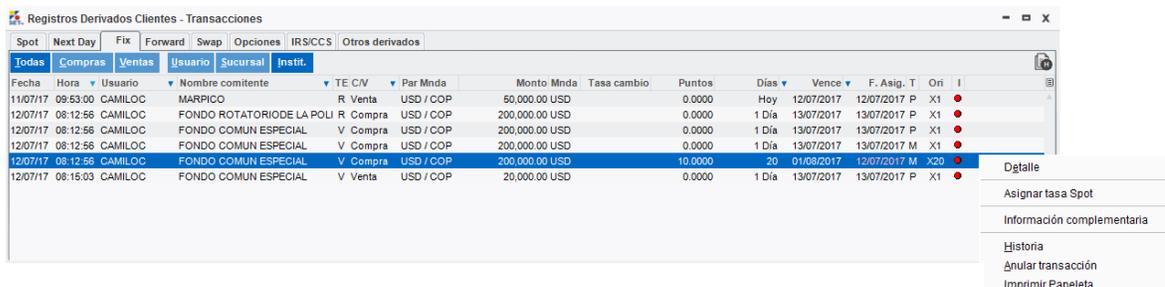
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 53 / 91



Fecha	Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T	Ori	I
11/07/17	09:53:00	CAMILOC	MARPICO	R Venta	USD / COP	50,000.00 USD		0.0000	Hoy	12/07/2017	12/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO ROTATORIO DE LA POLI	R Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	M	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		10.0000	20	01/08/2017	12/07/2017	M	X20	●
12/07/17	08:15:03	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Venta	USD / COP	20,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●

La asignación del precio spot se puede realizar desde que realiza el registro hasta incluso el día del vencimiento. Después de cumplida la operación no puede asignarle el precio spot.

Para asignar el precio ubicamos la operación en el Blotter de operaciones, clic derecho, asignar precio spot.



Fecha	Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio	Puntos	Días	Vence	F. Asig.	T	Ori	I
11/07/17	09:53:00	CAMILOC	MARPICO	R Venta	USD / COP	50,000.00 USD		0.0000	Hoy	12/07/2017	12/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO ROTATORIO DE LA POLI	R Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	M	X1	●
12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		10.0000	20	01/08/2017	12/07/2017	M	X20	●
12/07/17	08:15:03	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Venta	USD / COP	20,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●

Detalle

- Asignar tasa Spot
- Información complementaria
- Historia
- Anular transacción
- Imprimir Papeleta

12/07/17	08:12:56	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Compra	USD / COP	200,000.00 USD		10.0000	20	01/08/2017	12/07/2017	M	X20	●
12/07/17	08:15:03	CAMILOC	FONDO COMUN ESPECIAL	V Venta	USD / COP	20,000.00 USD		0.0000	1 Día	13/07/2017	13/07/2017	P	X1	●

Registros Derivados - Asignación de precio Spot

Tipo de transacción: Compra

Comprador: BANCO POPULAR

Usuario: CAMILOC

Vendedor: FONDO COMUN ESPECIAL

Clase Id: Nit 830.126.423-5

Par de monedas: USD/COP

Plazo: 20 Martes 01-Ago-2017

Fecha asignación tasa: Miércoles 12-Jul-2017

Monto: 200,000.00 USD

Tasa de cambio:

Puntos: 10.0000

Tasa spot: 3256.0000 MANUAL

Origen: X20

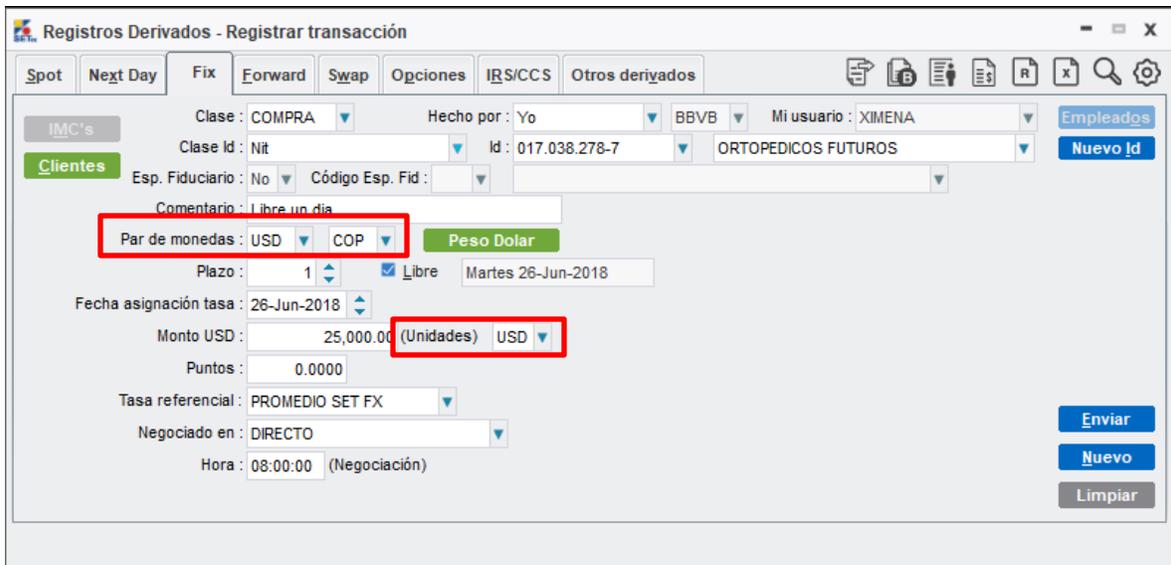
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 54 / 91

Puede reasignar el precio de una operación, señalando la operación clic derecho, Re-asignar tasa Spot



NOTA: Para el registro de operaciones Fix desde el módulo de Registros Derivados se debe tener en cuenta las condiciones en las que se va a realizar la operación, si se está negociando en par de monedas dólar peso, se debe especificar en el campo Unidades si es **USD** o **COP** y se debe especificar la moneda en la que está expresando el monto de la operación, la herramienta realizara la conversión de forma automática expresando el monto en la moneda seleccionada.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 55 / 91

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: XIMENA Empleados

Clase Id: Nit Id: 001.820.997-1 BBVA MADRID Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Plazo: 1 Libre Martes 26-Jun-2018

Fecha asignación tasa: 26-Jun-2018

Monto USD: 30,000.00 (Unidades) COP

Puntos: 0.0000

Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Negociado en: DIRECTO

Hora: 08:30:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Compra a OTR 25,000.00 a 1 Día, Par de monedas USD/COP

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Usuario SET-FX OCCB Mi usuario: MARCELA Empleados

Contraparte: Cédula nueva ID: 1.016.003.201 MAZORRA OTERO CLAUDIA ALEJANDRA Nuevo Id

Beneficiario: ID:

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Plazo: 0 Libre Miércoles 30-Ene-2019

Fecha asignación tasa: 30-Ene-2019

Monto USD: 1,000.00 (Unidades) COP

Puntos: 0.0000

Tasa referencial: MANUAL

Negociado en: ICAPCO

Hora: 08:00:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Tercero Offshore

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 56 / 91

NOTA: Para la opción de Tasa Referencial cuando se selecciona manual, al momento de asignar la Tasa Spot aparece ventana emergente, donde se indica que si esta si está seguro de asignar la tasa que se coloca, una vez confirmada la tasa esta no puede ser modificada.

Tasa referencial : PRECIO FIX SET FX
Negociado en : PRECIO FIX SET FX
Hora : MANUAL

Registros Derivados Clientes - Transacciones

Spot		Next Day		Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.				
Fecha	Hora	Usuario	Nombre comitente	TE B / C / V	Par Mnda	Monto Mnda	Tasa cambio		
11/01/19	15:00:00	MARCELA	HERNANDEZ RENDON ALEJAND R	Venta	USD / COP	1,000.00 USD			
30/01/19	08:00:00	MARCELA	MAZORRA OTERO CLAUDIA ALE R	Compra	COP / USD	1,000.00 COP			

Detalle
Asignar tasa Spot
Comentario
Información complementaria
Historia
Anular transacción
Imprimir Papeleta

Registros Derivados - Asignación de precio Spot

Tipo de transacción : Compra
Comprador : BANCO DE OCCIDENTE
Usuario : MARCELA
Vendedor : MAZORRA OTERO CLAUDIA ALEJANDRA
Clase ID : Cédula nueva 1.016.003.201
Par de monedas : COP/USD

Plazo : Hoy Miércoles 30-Ene-2019
Fecha asignación tasa : Miércoles 30-Ene-2019
Monto : 1,000.00 COP
Tasa de cambio :
Puntos : 0.0000
Tasa spot : 2900.0000 MANUAL
Origen : X0

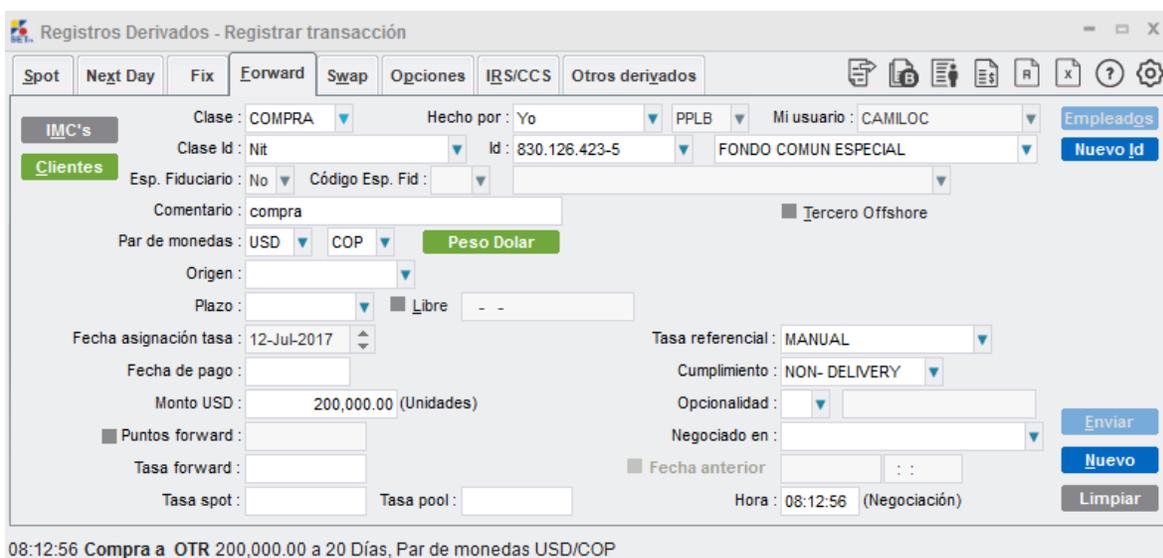
Aceptar Cancelar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 57 / 91



3.12. Registro Operación FRW IMC's – CLIENTES

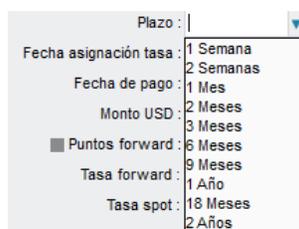


- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 58 / 91

- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:



- Plazo libre:



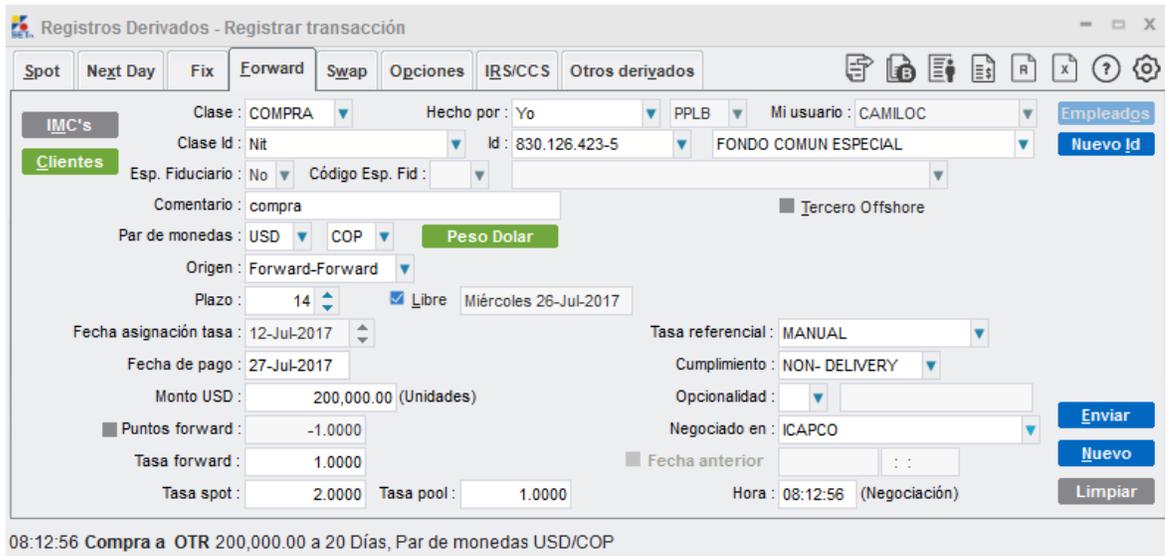
- Fecha asignación precio:
- Tasa referencial:
- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Puntos Forward: Se indican los puntos que se deben adicionar o restar a la tasa de referencia seleccionada.
- Tasa Forward:
- Tasa de spot:
- Origen: Origen de la Operación, opciones: Forward-Forward, OTRA, Swap, Fix
- Tasa Pool: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados Forward, Swap, Opciones e IRS.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 59 / 91

- Tercero Offshore: Es un campo informativo, el cual permitirá indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad del exterior de la cual aún no se conoce el nombre.

Las operaciones con origen Fix se pueden registrar sin la tasa Spot, solo se ingresan los datos generales de la operación más/menos los puntos Forward.



08:12:56 Compra a OTR 200,000.00 a 20 Días, Par de monedas USD/COP

Realizado el registro se puede visualizar en el Blotter de operaciones, sin la tasa spot, si en el campo origen es Fix.



Fecha	Hora	Usuario	Nombre comitente	st	TE	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	F	Asig	T	FR	SA	Est	Ncp	
12/07/17	08:00:00	CAMILOC	FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		200,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017	F										
12/07/17	08:00:00	CAMILOC	FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		200,000.00	1.0000000	0.0000000	1 Semana	19/07/2017	X0										
12/07/17	08:00:00	CAMILOC	FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / COP		200,000.00			1 Semana	19/07/2017	X0										

Para asignar la tasa señalamos la operación, clic derecho, modificar, asignamos la tasa.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 60 / 91

Registros Derivados - Modificación de transacción

Tipo de transacción : Compra

Comprador : BANCO POPULAR

Usuario : CAMILOC

Vendedor : FLORES IPANEMA LTDA

Clase Id : Nit 830.098.375-9

Par de monedas : USD/CHF

Origen : Fix

Tasa referencial : MANUAL

Plazo : Libre 1 Semana

Vencimiento : Mié 19-Jul-2017

Fecha asignación : 12/07/2017 Mié 12-Jul-2017

Fecha de pago : 21/07/2017 Vie 21-Jul-2017

Monto USD : 200,000.00 (Unidades)

Puntos forward : 1.0000000

Tasa forward : 2.0000000 Tercero Offshore

Tasa spot : 1.0000000

Tasa pool : 1.0000000

Cumplimiento : NON-DELIVERY

Opcionalidad :

Negociado en : ICAPCO

Fecha anterior

Aceptar **Cancelar**

Registros Derivados Clientes - Transacciones

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

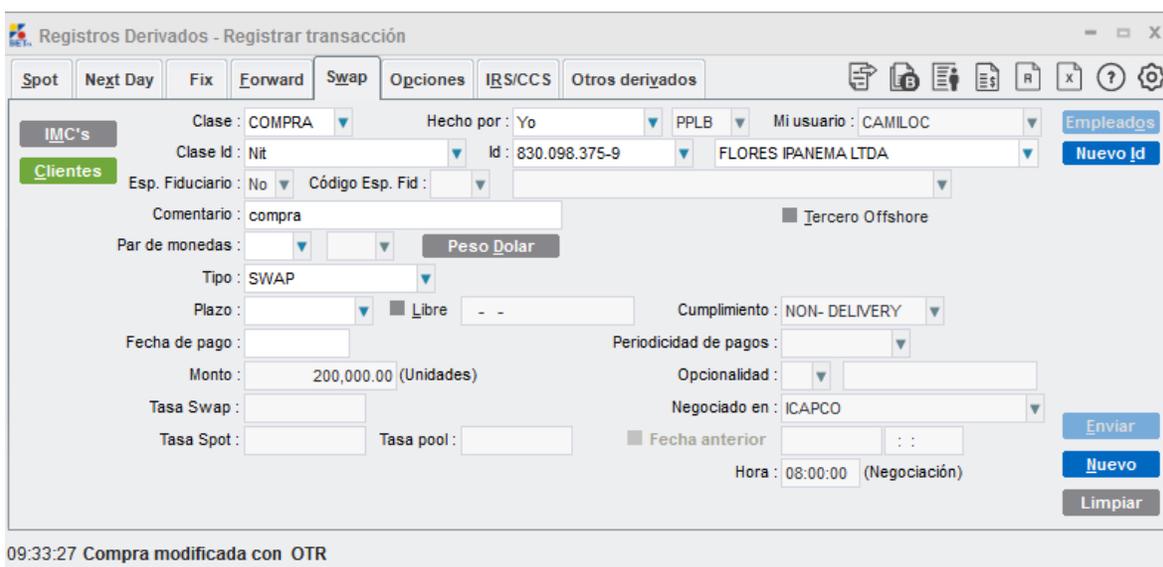
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	Fecha	Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	TE CV	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
						12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF	200,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017	F 12/07/2017 M
						12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF	200,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017	12/07/2017 M
						12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF	200,000.00	2.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017	XD 12/07/2017 M
						12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / COP	200,000.00			1 Semana	19/07/2017	XD 12/07/2017 M

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 61 / 91

- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación

3.13. Registro Operación Swap IMC's – CLIENTES



- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 62 / 91

- Plazos estándar:



- Plazo libre:



- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa Swap
- Tasa Spot
- Tasa Pool: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados Forward, Swap, Opciones e IRS.
- Tercero Offshore: Es un campo informativo, el cual permitirá indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad del exterior de la cual aún no se conoce el nombre.
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 63 / 91

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes

Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Tercero Offshore

Comentario: compra

Par de monedas: BRL CAD **Peso Dolar**

Tipo: SWAP

Plazo: 1 Año Libre Jueves 12-Jul-2018 Cumplimiento: NON- DELIVERY

Fecha de pago: 13-Jul-2018 Periodicidad de pagos: Mensual

Monto BRL: 200,000.00 (Unidades) Opcionalidad:

Tasa Swap: 1.0000 Negociado en: ICAPCO

Tasa Spot: 2.0000 Tasa pool: 2.0000 Fecha anterior: Hora: 08:00:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

3.14. Registro Operación Opciones IMC's – CLIENTES

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes

Tipo: Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Tercero Offshore

Comentario: compra

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

Plazo: Libre - - Tasa Strike:

Fecha de pago: Tasa pool Strike:

Monto USD: 200,000.00 (Unidades) Condición del ejercicio:

Tasa pactada (Spot): Porcentaje de volatilidad:

Prima COP/USD: Negociado en:

Tipo de opción: Fecha anterior: Hora: 08:00:00 (Negociación)

Cumplimiento: NON- DELIVERY

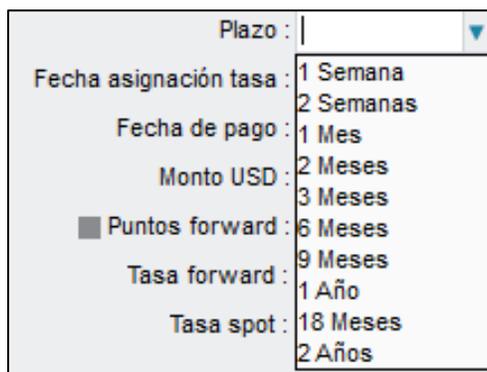
Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a -1.0000 a 1 Año, Par de monedas BRL/CAD

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 64 / 91

- Tipo: CALL DE COMPRA/VENTA, PUT DE COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:



- Plazo libre:



- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa pactada (Spot)
- Prima COP/USD

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 65 / 91

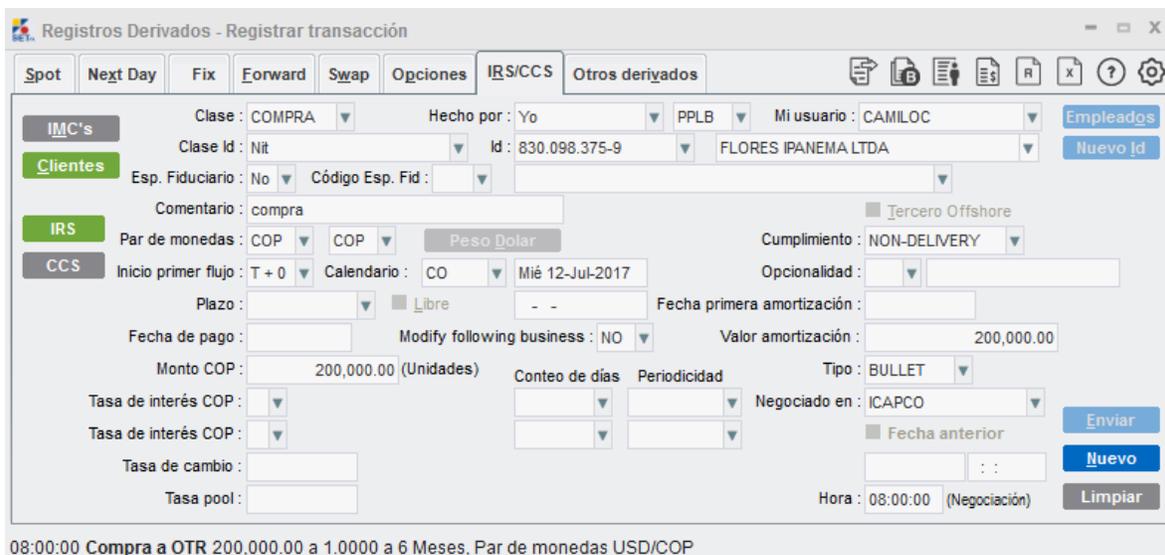
- Tipo de Opción: AMERICANA, EUROPEA, OTRA
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Tercero Offshore: Es un campo informativo, el cual permitirá indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad del exterior de la cual aún no se conoce el nombre.
- Tasa Strike
- Tasa Pool Strike: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados Forward, Swap, Opciones e IRS.
- Condición del ejercicio:
- Porcentaje de Volatilidad:
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 66 / 91

3.15. Registro Operación IRS IMC's – CLIENTES



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Cientes Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

IRS Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Comentario: compra Tercero Offshore

CCS Par de monedas: COP COP Peso Dólar Cumplimiento: NON-DELIVERY

Inicio primer flujo: T+0 Calendario: CO Mié 12-Jul-2017 Opcionalidad:

Plazo: Libre Fecha primera amortización:

Fecha de pago: Modify following business: NO Valor amortización: 200,000.00

Monto COP: 200,000.00 (Unidades) Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: Conteo de días Periodicidad Negociado en: ICAPCO

Tasa de interés COP: Fecha anterior

Tasa de cambio: Hora: 08:00:00 (Negociación) Limpiar

Tasa pool: Enviar Nuevo

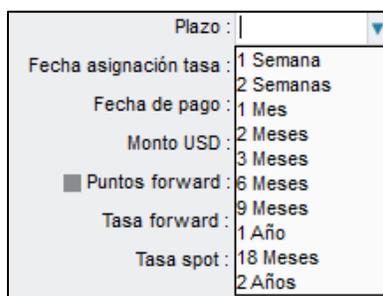
08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1.0000 a 6 Meses, Par de monedas USD/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA
- Calendario: CO, CO-NY
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 67 / 91

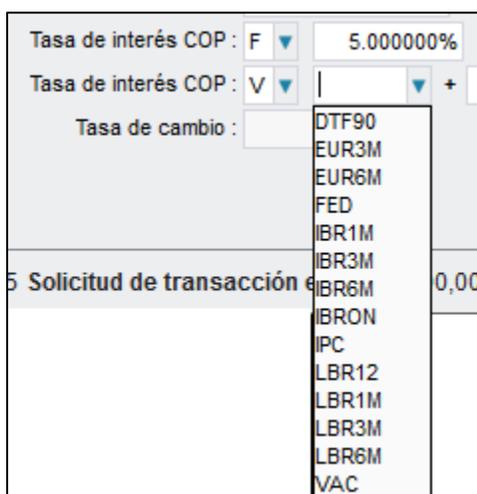
- Plazos estándar:



- Plazo libre:



- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Modify Following Business: SI, NO
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Interés: va de acuerdo al par de monedas, se pueden ingresar con signo negativo. Fijo, Variable. Opción Fijo, activa un campo para el porcentaje de la tasa. Opción Variable.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 68 / 91

- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Tasa Pool: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados Forward, Swap, Opciones e IRS.
- Tercero Offshore: Es un campo informativo, el cual permitirá indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad del exterior de la cual aún no se conoce el nombre.
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Opcionalidad:
- Fecha primera amortización:
- Valor amortización:
- Tipo: BULLET, IGUALES
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Cientes Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

IRS Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Tercero Offshore

CCS Comentario: compra Cumplimiento: NON-DELIVERY

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Opcionalidad:

Inicio primer flujo: T+0 Calendario: CO Mié 12-Jul-2017 Fecha primera amortización: 19-Jul-2017

Plazo: 1 Semana Libre Mié 19-Jul-2017 Valor amortización: 200,000.00

Fecha de pago: 19-Jul-2017 Modify following business: NO

Monto COP: 200,000.00 (Unidades) Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F 1.000000% 30/360 Mensual Negociado en: ICAPCO

Tasa de interés COP: V LBR12 + 1.0000 30/360 Mensual

Tasa de cambio:

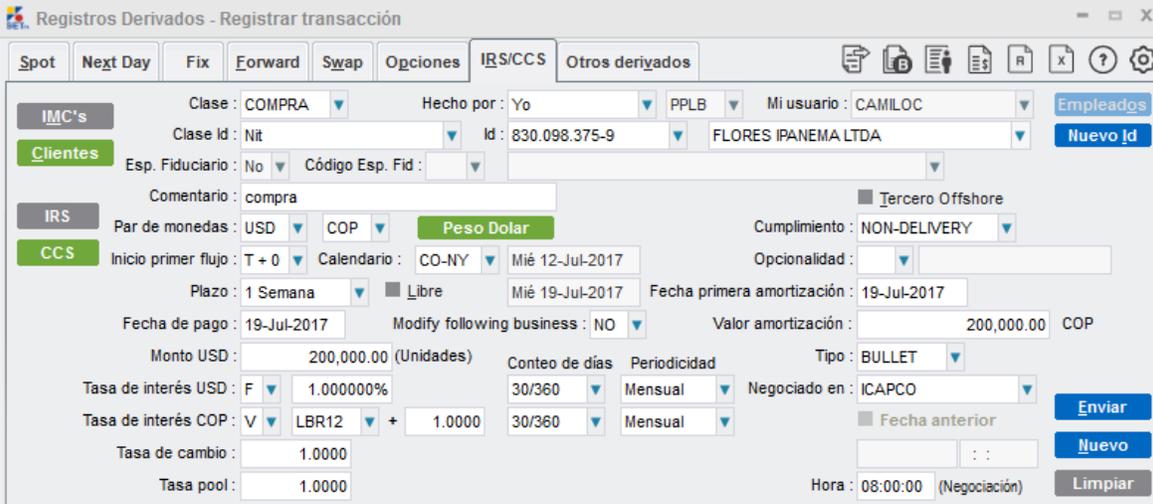
Tasa pool: 1.0000 Hora: 08:00:00 (Negociación) Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1.0000 a 6 Meses, Par de monedas USD/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 69 / 91

3.16. Registro Operación CCS IMC's – CLIENTES



Registros Derivados - Registrar transacción

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

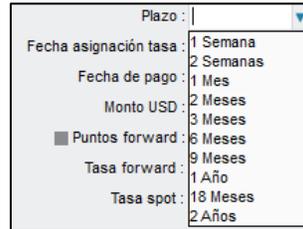
IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados
Cientes Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id
 Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Tercero Offshore
IRS Comentario: compra
CCS Par de monedas: USD COP **Peso Dolar** Cumplimiento: NON-DELIVERY
 Inicio primer flujo: T+0 Calendario: CO-NY Mié 12-Jul-2017 Opcionalidad:
 Plazo: 1 Semana Libre Mié 19-Jul-2017 Fecha primera amortización: 19-Jul-2017
 Fecha de pago: 19-Jul-2017 Modify following business: NO Valor amortización: 200,000.00 COP
 Monto USD: 200,000.00 (Unidades) Tipo: BULLET
 Tasa de interés USD: F 1.000000% 30/360 Mensual Negociado en: ICAPCO
 Tasa de interés COP: V LBR12 + 1.0000 30/360 Mensual
 Tasa de cambio: 1.0000 Hora: 08:00:00 (Negociación)
 Tasa pool: 1.0000

08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1 Semana, Par de monedas COP/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Inicio primer flujo: T+0, T+1, T+2, FRA
- Plazo: tiempo de duración de la operación. Se tienen plazos ya establecidos o puede marcar la casilla **Libre** para indicar la cantidad de días.
- Plazos estándar:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

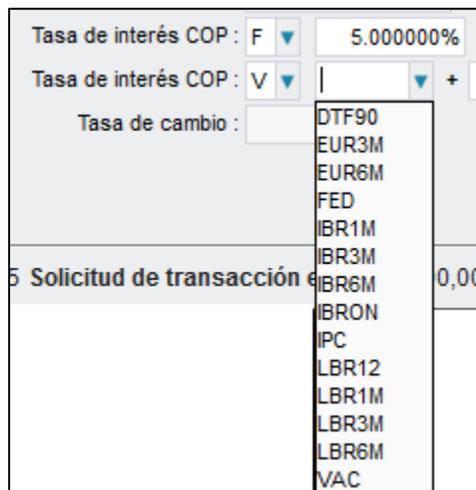
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 70 / 91



- Plazo libre:
-



- Fecha de pago: la fecha de ser mayor o igual a la fecha del vencimiento
- Modify Following Business: SI, NO
- Monto: monto de la operación, va de acuerdo al primer par de monedas utilizado
- Tasa de Interés: va de acuerdo al par de monedas, se pueden ingresar con signo negativo. Fijo, Variable. Opción Fijo, activa un campo para el porcentaje de la tasa. Opción Variable



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 71 / 91

- Tasa de cambio:
- Tasa Pool: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados Forward, Swap, Opciones e IRS.
- Tercero Offshore: Es un campo informativo, el cual permitirá indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad del exterior de la cual aún no se conoce el nombre.
- Conteo de días: 30/360, 30/365, ACT/360, ACT/365, ACT/ACT
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Opcionalidad: Si/No, comentario
- Fecha primera amortización
- Valor amortización
- Tipo: BULLET, IGUALES
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Cientes Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

IRS Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Tercero Offshore

CCS Comentario: compra Cumplimiento: NON-DELIVERY

Par de monedas: USD COP Peso Dolar Opcionalidad:

Inicio primer flujo: T+0 Calendario: CO-NY Mié 12-Jul-2017 Fecha primera amortización: 19-Jul-2017

Plazo: 1 Semana Libre Mié 19-Jul-2017 Valor amortización: 200,000.00 COP

Fecha de pago: 19-Jul-2017 Modify following business: NO

Monto USD: 200,000.00 (Unidades) Tipo: BULLET

Tasa de interés USD: F 1.000000% Conteo de días: 30/360 Periodicidad: Mensual Negociado en: ICAPCO

Tasa de interés COP: V LBR12 + 1.0000 Conteo de días: 30/360 Periodicidad: Mensual

Tasa de cambio: 1.0000 Hora: 08:00:00 (Negociación)

Tasa pool: 1.0000

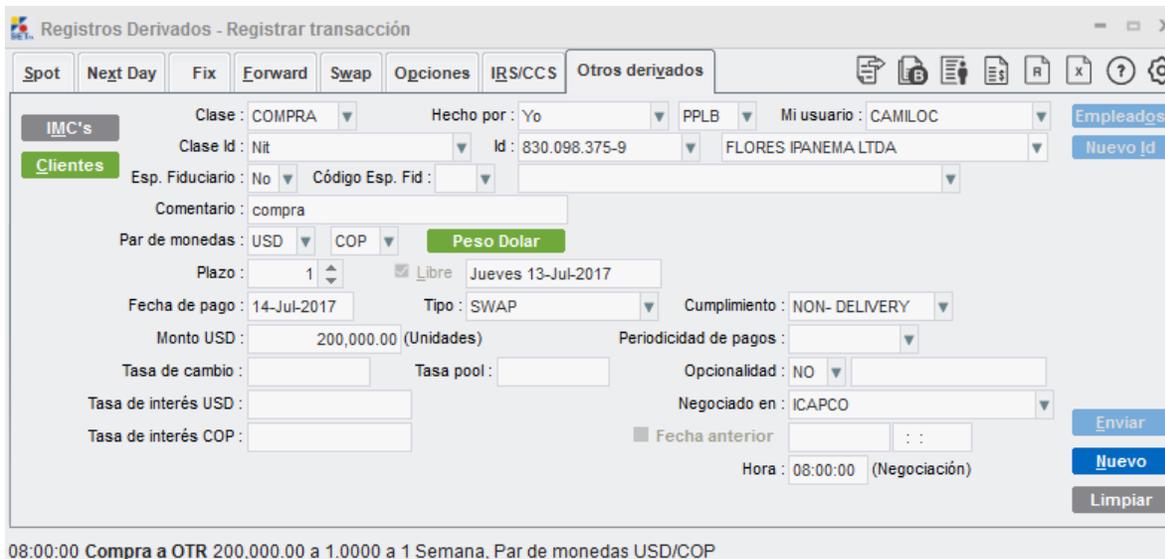
Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1.0000 a 1 Semana, Par de monedas USD/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 72 / 91

3.17. Registro Operación Otros derivados IMC's – CLIENTES



08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1.0000 a 1 Semana, Par de monedas USD/COP

- Clase: COMPRA/VENTA
- Hecho por: YO, Usuario SET-FX, Otro
- Mi usuario: Nombre del usuario
- Clase Id: Tipo de identificación del cliente o contraparte
- Id: Número de identificación
- Comentario: campo para colocar un detalle adicional de operación
- Par de monedas: debemos tener en cuenta la primera moneda debe ser la más fuerte en el par de monedas a registrar
- Plazo: por defecto es libre
-

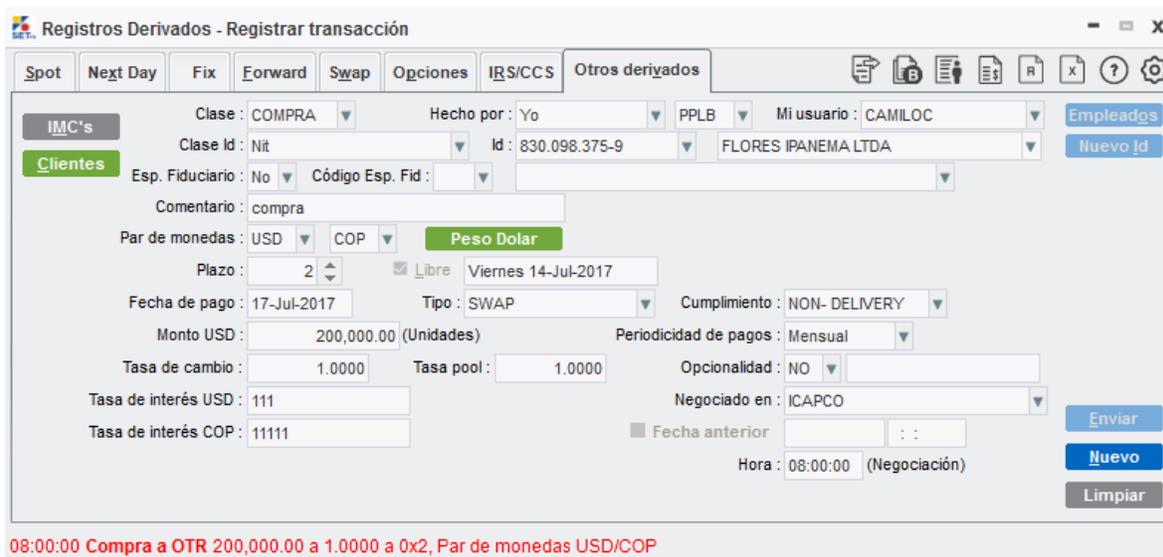
Plazo : Libre

- Fecha de pago
- Monto: Monto de acuerdo al primer par de moneda
- Tasa de Cambio

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 73 / 91

- Tasa Pool: Es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Se habilita para los mercados de Registro de Derivados (174) sub_mercados; Forward, Swap, Opciones e IRS.
- Tasa de interés: de acuerdo al primer par de moneda
- Tasa de interés: de acuerdo al segundo par de moneda
- Tipo: SWAP, FORWARD FORWARD, NO APLICA
- Cumplimiento: NON-DELIVERY, DELIVERY
- Periodicidad de pagos: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un solo flujo
- Opcionalidad:
- Negociado en: Sistema de negociación donde realizo la operación.
- Hora: Hora de cierre de la operación



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Yo PPLB Mi usuario: CAMILOC Empleados

Clase Id: Nit Id: 830.098.375-9 FLORES IPANEMA LTDA Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario: compra

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

Plazo: 2 Libre Viernes 14-Jul-2017

Fecha de pago: 17-Jul-2017 Tipo: SWAP Cumplimiento: NON- DELIVERY

Monto USD: 200,000.00 (Unidades) Periodicidad de pagos: Mensual

Tasa de cambio: 1.0000 Tasa pool: 1.0000 Opcionalidad: NO

Tasa de interés USD: 111 Negociado en: ICAPCO

Tasa de interés COP: 11111 Fecha anterior: Hora: 08:00:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Compra a OTR 200,000.00 a 1.0000 a 0x2, Par de monedas USD/COP

4. Modificación

La modificación de operaciones registradas aplica para los mercados Forward, Swap, Opciones e IRS/CCS. La modificación se puede realizar hasta el día del cumplimiento o hasta que la operación

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 74 / 91

no haya sido enviada para ser compensada en la Cámara de Riesgo Central de Contraparte. Es importante anotar que no todos los campos se pueden modificar.

Para modificar una operación, es necesario abrir la ventana con el Blotter de operaciones (IMC's o Clientes) y luego seleccionar el mercado, para que finalmente se ubique la operación y se da click derecho sobre esta y aparece un menú donde se debe escoger la opción modificar.

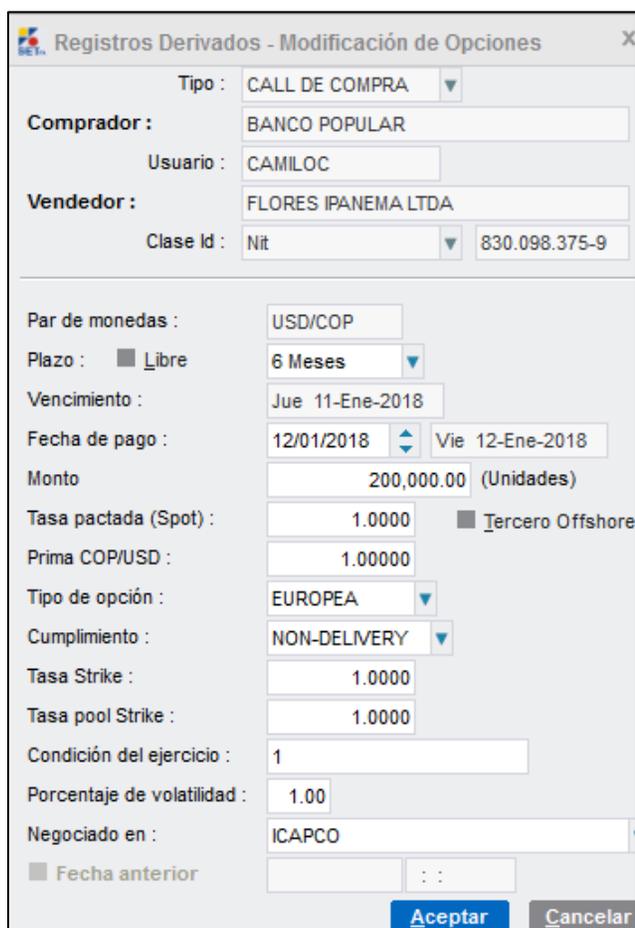
- Solo los campos que se pueden modificar en operaciones del mercado **forward, Swap** aparecen disponibles para edición. Los que no, se muestran a manera informativa.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 75 / 91

- Solo los campos que se pueden modificar en operaciones del mercado de **opciones** **aparecen disponibles para edición. Los que no, se muestran a manera informativa.**



- Los Campos que se pueden modificar en operaciones del mercado IRS/CCS Swap aparecen disponibles para edición. Los que no, se muestran a manera informativa.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 76 / 91

Registros Derivados - Modificación de IRS/CCS - IRS

Clase : Compra

Comprador : BANCO POPULAR

Usuario : CAMILOC

Vendedor : FLORES IPANEMA LTDA

Clase Id : Nit 830.098.375-9

Par de monedas : COP/COP IRS

Inicio primer flujo : T + 0 Calendario : CO Mié 12-Jul-2017

Plazo : Libre 1 Semana

Vencimiento : Mié 19-Jul-2017

Fecha de pago : 19/07/2017 Mié 19-Jul-2017

Fecha primera amortización : 19/07/2017 Mié 19-Jul-2017

Monto COP : 200,000.00 (Unidades) Modify following business : NO

Valor amortización : 200,000.00

Tasa de interés COP : F 1.000000% 30/360 Mensual

Tasa de interés COP : V LBR12 + 1.0000 30/360 Mensual

Tasa cambio : Tercero Offshore

Tasa pool : 1.0000

Cumplimiento : NON- DELIVERY

Opcionalidad :

Tipo : BULLET

Negociado en : ICAPCO

Fecha anterior

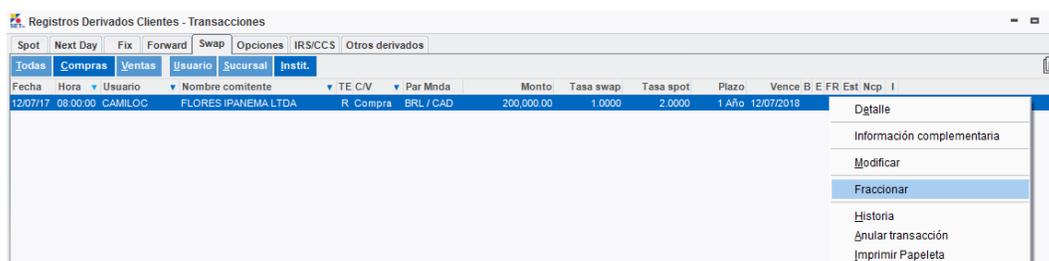
Aceptar **Cancelar**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 77 / 91

5. Fraccionamiento

Para realizar el fraccionamiento de una operación registrada es necesario abrir la ventana del Blotter de operaciones, luego ubicar el mercado y finalmente se selecciona la operación, clic derecho, y escoger la opción fraccionar.



Esto hará aparecer una nueva ventana con los detalles generales de la operación a fraccionar y en esa misma ventana aparece en la parte inferior el botón aumentar, con el cual se podrá fraccionar la operación inicial.

Fracciones de transacción

Fecha: 12/07/2017 Código: O3NUH501EE Hora de registro: 09:39:21 Hora: 08:00:00

Contraparte: FLORES IPANEMA LTDA
 Par de monedas: BRL / CAD
 Plazo: 1 Año Vence: 12-Jul-2018 Tipo: SWAP
 Fecha de pago: 13-Jul-2018 Periodicidad de pagos: Mensual
 Monto BRL: 200,000.00 Cumplimiento: NON-DELIVERY
 Tasa Swap: 1.0000 Opcionalidad:
 Tasa spot: 2.0000 Negociado en: ICAPCO
 Fecha anterior FR

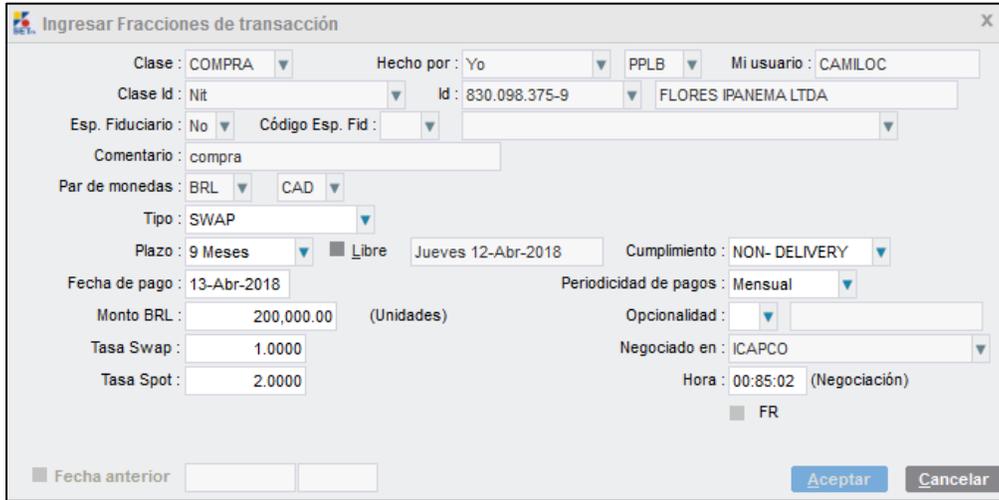
Fracciones

Hora	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori

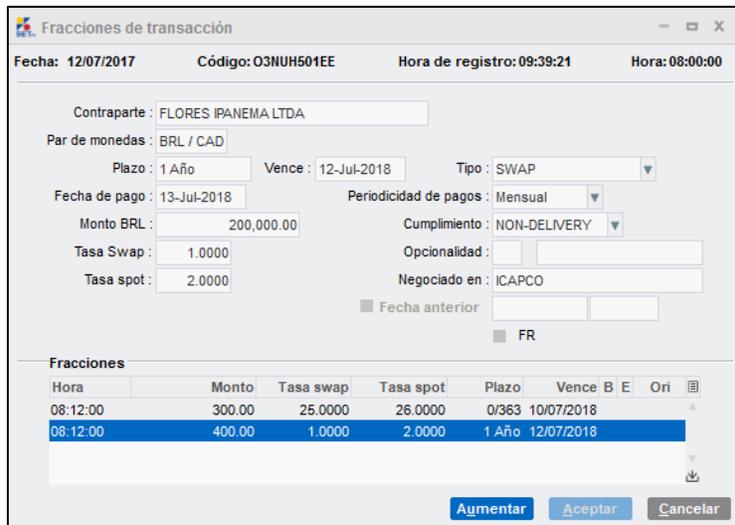
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 78 / 91

Una vez se de click en el botón Aumentar aparecerá la siguiente ventana



Una vez se haya ingresado la información requerida y se presiona el botón aceptar se crea la primera fracción y, el usuario podrá seguir ingresando operaciones o fracciones hasta alcanzar el monto inicial.

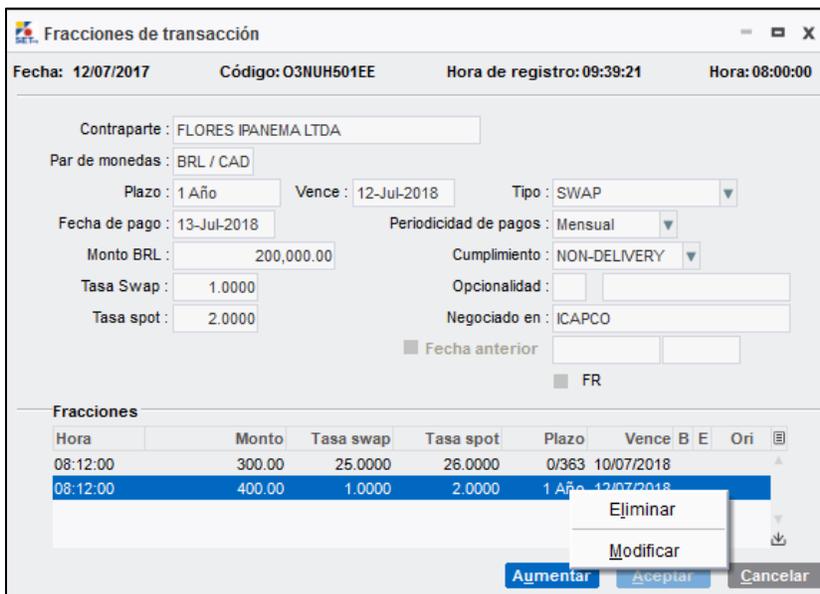


Fracciones							
Hora	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	B E	Ori
08:12:00	300.00	25.0000	26.0000	0/363	10/07/2018		
08:12:00	400.00	1.0000	2.0000	1 Año	12/07/2018		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 79 / 91

En la parte inferior aparecerá la cantidad de fracciones ingresadas y estas a su vez pueden ser modificadas o eliminadas si se desea corregir.



Fecha	Código	Hora de registro	Hora
12/07/2017	O3NUH501EE	09:39:21	08:00:00

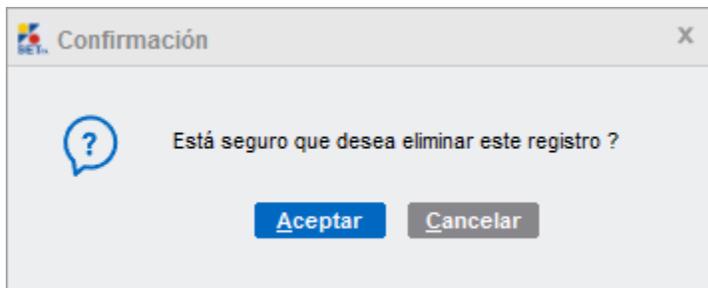
Contraparte: FLORES IPANEMA LTDA
 Par de monedas: BRL / CAD
 Plazo: 1 Año Vence: 12-Jul-2018 Tipo: SWAP
 Fecha de pago: 13-Jul-2018 Periodicidad de pagos: Mensual
 Monto BRL: 200,000.00 Cumplimiento: NON-DELIVERY
 Tasa Swap: 1.0000 Opcionalidad:
 Tasa spot: 2.0000 Negociado en: ICAPCO
 Fecha anterior FR

Fracciones	Hora	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence B E	Ori
	08:12:00	300.00	25.0000	26.0000	0/363	10/07/2018	
	08:12:00	400.00	1.0000	2.0000	1 Año	12/07/2018	

Botones: Aumentar, Aceptar, Cancelar, Eliminar, Modificar

Una vez se realice el fraccionamiento total, exitosamente se habilitará el botón aceptar,

El botón aceptar realizará el proceso de anulación de la operación original y dejará en el sistema la cantidad de fracciones realizadas



Confirmación
 ¿Está seguro que desea eliminar este registro?
 Aceptar Cancelar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

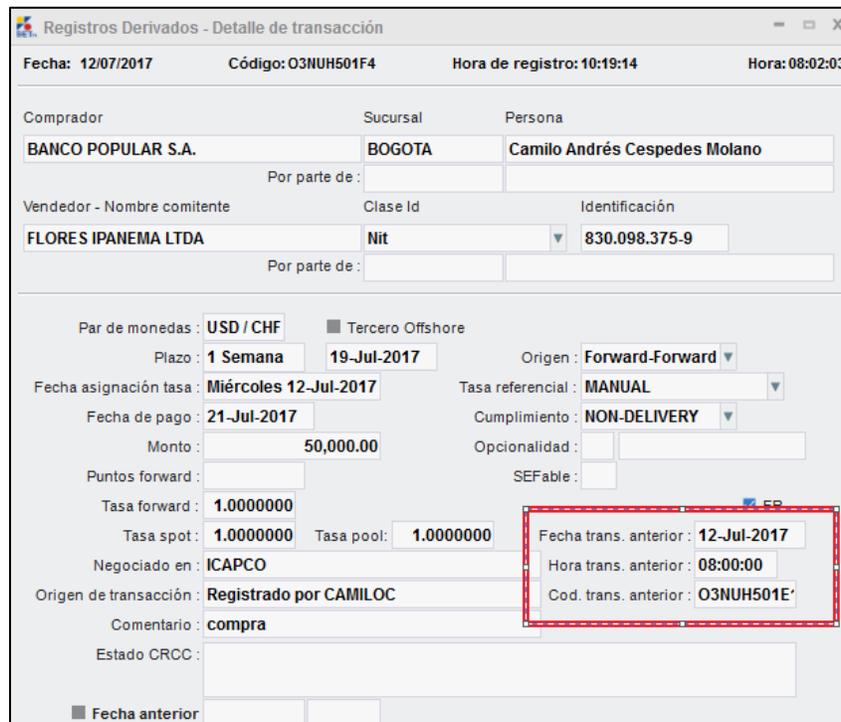
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 80 / 91

Una manera de identificar que una operación es de un fraccionamiento se hace desde la ventana del Blotter de operaciones donde podemos identificar la columna FR con el valor FR.



Fecha	Hora	Usuario	st	Nombre comitente	TE	CV	Par	Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	F. Asig	T	FR	SA	Est	Ncp	
12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		200,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017										
12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		200,000.00	2.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017										
12/07/17	08:00:00	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / COP		200,000.00			1 Semana	19/07/2017										
12/07/17	08:02:03	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		50,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017										
12/07/17	08:02:03	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		100,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017										
12/07/17	08:02:03	CAMILOC		FLORES IPANEMA LTDA	R	Compra	USD / CHF		50,000.00	1.0000000	1.0000000	1 Semana	19/07/2017										

Al dar click derecho sobre cualquiera de las fracciones se muestra la opción detalle de la operación, la cual al ser escogida muestra una nueva ventana con los datos del registro y también se puede identificar los datos de la operación original como es: fecha, hora y código de la operación original, y código de la operación original



Fecha: 12/07/2017 Código: O3NUH501F4 Hora de registro: 10:19:14 Hora: 08:02:03

Comprador: BANCO POPULAR S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Camilo Andrés Cespedes Molano

Vendedor - Nombre comitente: FLORES IPANEMA LTDA Clase Id: Nit Identificación: 830.098.375-9

Par de monedas: USD / CHF Tercero Offshore:

Plazo: 1 Semana 19-Jul-2017 Origen: Forward-Forward

Fecha asignación tasa: Miércoles 12-Jul-2017 Tasa referencial: MANUAL

Fecha de pago: 21-Jul-2017 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 50,000.00 Opcionalidad:

Tasa forward: 1.0000000 SEFable:

Tasa spot: 1.0000000 Tasa pool: 1.0000000

Negociado en: ICAPCO

Origen de transacción: Registrado por CAMILOC

Comentario: compra

Estado CRCC:

Fecha anterior:

Fecha trans. anterior: 12-Jul-2017
Hora trans. anterior: 08:00:00
Cod. trans. anterior: O3NUH501E

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 81 / 91

La operación original como se mencionó fue anulada y podrá ser consultada en la ventana de anulaciones con una marca "FR" que representa que fue anulada hoy por fraccionamiento. de igual manera, en la ventana "Historia de la Postura", en el campo de "Comentario", se especifica que la operación fue eliminada "por fraccionamiento".

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Plazo Vence	Comentario
12/07/17	08:00:00	PPLB CAMILOCC	Registro	D	USD / CHF	200,000.00	1.0000000	1 Semana 19/07/2017	
12/07/17	08:02:03	PPLB CAMILOCC	Registro x FR	D	USD / CHF	100,000.00	1.0000000	1 Semana 19/07/2017	
12/07/17	10:19:14	PPLB CAMILOCC	Anulación	D	USD / CHF	200,000.00	1.0000000	1 Semana 19/07/2017	Por fraccionamiento

Fecha: 12/07/2017	Código: O3NUH501E1	Hora de registro: 09:23:09	Hora: 10:19:14
Comprador: BANCO POPULAR S.A.	Sucursal: BOGOTA	Persona: Camilo Andrés Cespedes Molano	
Por parte de:			
Vendedor - Nombre comitente: FLORES IPANEMA LTDA	Clase Id: Nit	Identificación: 830.098.375-9	
Por parte de:			
Par de monedas: USD / CHF	<input checked="" type="checkbox"/> Tercero Offshore		
Plazo: 1 Semana	19-Jul-2017	Origen: Forward-Forward	
Fecha asignación tasa: Miércoles 12-Jul-2017		Tasa referencial: MANUAL	
Fecha de pago: 21-Jul-2017		Cumplimiento: NON-DELIVERY	
Monto: 200,000.00		Opcionalidad:	
Puntos forward:		SEFable:	
Tasa forward: 1.0000000			
Tasa spot: 1.0000000	Tasa pool: 1.0000000		
Negociado en: ICAPCO			
Origen de transacción: Registrado por CAMILOCC			
Comentario: Por fraccionamiento			
Estado CRCC:			
<input checked="" type="checkbox"/> Fecha anterior			

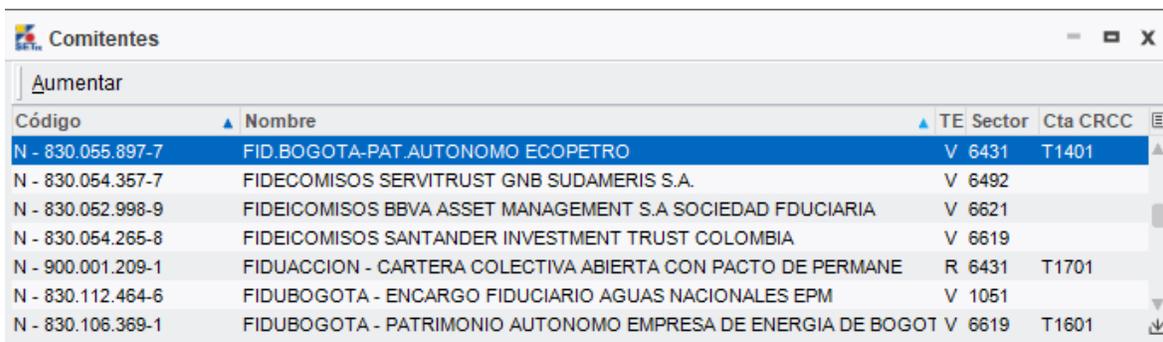
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 82 / 91

Una operación que fue enviada a la CRCC , que ya haya sido compensada no se puede fraccionar. Las operaciones fraccionadas también se pueden enviar a la CRCC.

6. Compensación de Operaciones

SET-FX permite la compensación en la CRCC de operaciones con Clientes; la entidad que utilice esta funcionalidad debe solicitar a la Cámara de Riesgo Central de contraparte, que registre el código del cliente que está en SET-FX para compensación. Este puede ser verificado desde la ventana principal de registro de Divisas, ubicando el Botón comitentes, y luego de dar click en ese botón, aparecerá una ventana nueva donde podrá encontrar al cliente que se quiere registrar en la CRC. Una vez sea hallado hay una columna "Cta. CRCC" donde está el código asociado.



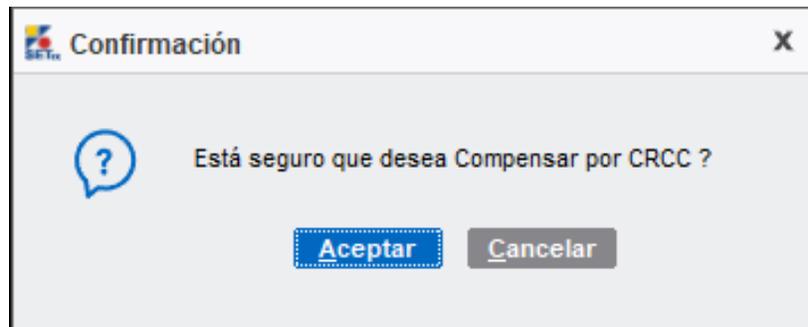
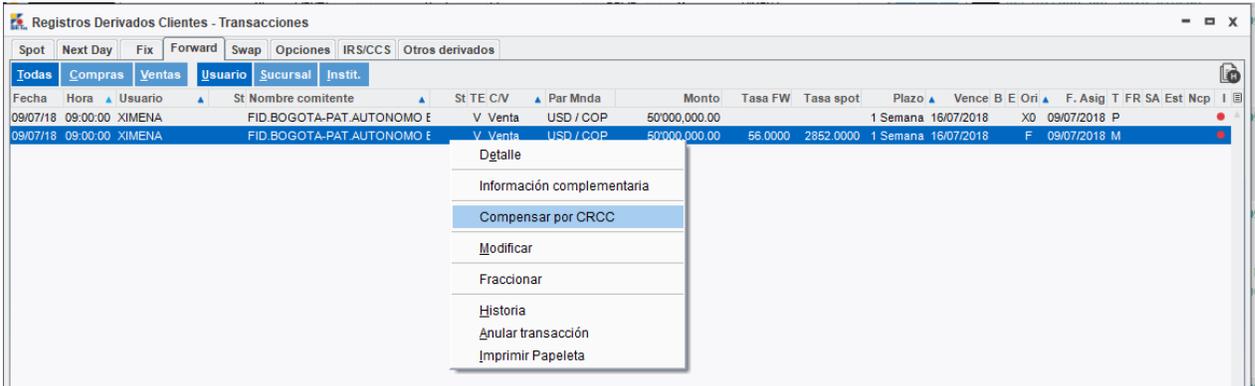
Código	Nombre	TE Sector	Cta CRCC
N - 830.055.897-7	FID.BOGOTA-PAT.AUTONOMO ECOPEPETRO	V 6431	T1401
N - 830.054.357-7	FIDECOMISOS SERVITRUST GNB SUDAMERIS S.A.	V 6492	
N - 830.052.998-9	FIDEICOMISOS BBVA ASSET MANAGEMENT S.A SOCIEDAD FDUCIARIA	V 6621	
N - 830.054.265-8	FIDEICOMISOS SANTANDER INVESTMENT TRUST COLOMBIA	V 6619	
N - 900.001.209-1	FIDUACCION - CARTERA COLECTIVA ABIERTA CON PACTO DE PERMANE	R 6431	T1701
N - 830.112.464-6	FIDUBOGOTA - ENCARGO FIDUCIARIO AGUAS NACIONALES EPM	V 1051	
N - 830.106.369-1	FIDUBOGOTA - PATRIMONIO AUTONOMO EMPRESA DE ENERGIA DE BOGOT	V 6619	T1601

Cuando se ha cumplido el proceso de registro del cliente en la CRCC ya podrá enviarse una operación asociada a este cliente para que sea compensada.

Para el envío de la operación a compensación es necesario abrir la ventana del Blotter de operaciones ubicar la operación y sobre esta dar click derecho y aparecerá la opción enviar a compensar a CRCC.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 83 / 91



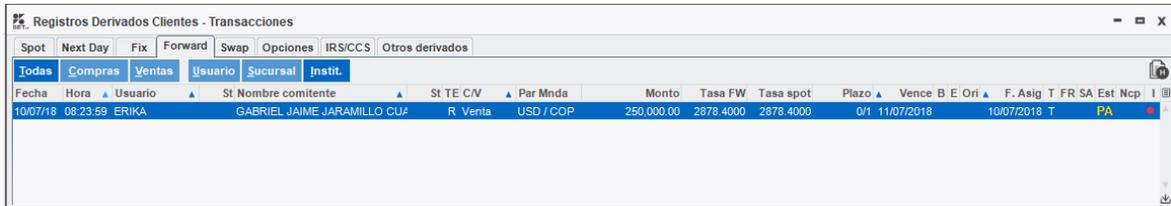
Una vez se acepte él envió de la operación para ser compensada, en el blotter de operaciones la operación cambiara de estado a **PR** (Pendiente Riesgo) en color amarillo



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

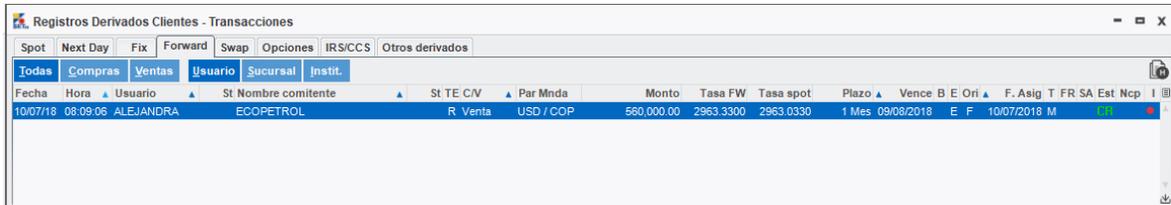
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 84 / 91

Cuando la operación llegue al istema de la CRCC su estado cambiará a **PA** (Pendiente de Aprobación) en color amarillo.



Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	F. Asig	T	FR	SA	Est	Ncp	
10/07/18	08:23:59	ERIKA		GABRIEL JAIME JARAMILLO CUJ	R	Venta	USD / COP	250.000.00	2878.4000	2878.4000	0/1	11/07/2018									PA

Si la operación es **aceptada** por parte de la CRCC, las letras en el estado cambiará a **CR** (Compensada por Cámara de Riesgo) en color verde



Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	F. Asig	T	FR	SA	Est	Ncp		
10/07/18	08:09:06	ALEJANDRA		ECOPETROL	R	Venta	USD / COP	560.000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018		E	F							CR

De lo contrario si la Compensación por parte de la CRCC es rechazada, el estado de la operación se muestra con **NC**(No Compensada) en color rojo.



Fecha C	Fecha	Hora	Código	Comprador	Vendedor	Plazo	Vence	Precio	Monto	R	Est	Ncp	Dws	MsgID	Ori
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW2>P	BBVB XIMENA	A FID.BOGOTA-PAT.AU	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000.000	R	NC		RC	47023	F
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW2LP	BBVB XIMENA	A FID.BOGOTA-PAT.AU	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000.000	R	NC		RC	47024	F
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW30P	BBVB XIMENA	A FIDUBOGOTA - PATR	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000.000	R	NC		RC	47025	F
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW37P	BBVB XIMENA	A FIDUACCION - CARTI	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000.000	R	NC		RC	47026	F
10/07/18	10/07/18	08:00:00	O0JH2UWW34P	BBVB XIMENA	A SEGUROS DE VIDA C	1 Semana	17/07/2018	2354.00	500'000.000	R	NC		RC	47028	F

Para saber la razón del rechazo por parte de la CRCC, se da click derecho sobre la operación en la ventana del Blotter de operaciones, se escoge la opción “Detalle” y en la nueva ventana que aparece en el campo “estado CRCC” se muestra la información requerida.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 85 / 91

Registros Derivados - Detalle de transacción

Fecha: 10/07/2018 Código: 00JH2UWW2X Hora de registro: 09:26:48 Hora: 08:00:00

Comprador: B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA Sucursal: BOGOTA Persona: Ximena Barrera

Por parte de: []

Vendedor - Nombre comitente: FID.BOGOTA-PAT.AUTONOMO ECOPEPETRO Clase Id: Nit Identificación: 830.055.897-7

Por parte de: []

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Plazo: 1 Semana 17-Jul-2018 Origen: []

Fecha asignación tasa: Martes 10-Jul-2018 Tasa referencial: MANUAL

Fecha de pago: 18-Jul-2018 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 500'000,000.00 Opcionalidad: []

Puntos forward: -2.0000 SEFable: []

Tasa forward: 2354.0000

Tasa spot: 2356.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECTO

Origen de transacción: Registrado por XIMENA

Comentario: []

Estado CRCC: Rechazada por : El Miembro o entidad (Party) participe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o definitivamente.

Fecha anterior []

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 86 / 91

6.1. Causales de Rechazo

Esta es una descripción de códigos de rechazo que genera la CRCC

Código	Descripción
210	El sistema no está disponible para los sistemas de Registro
501	El Miembro o entidad (Party) partícipe de la operación enviada no existe en Cámara o se encuentra en estado SUSPENDIDO temporal o definitivamente
504	No existe un vencimiento válido para la Fecha de Vencimiento (ValueDate) enviada
505	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo -mayor que cero
506	El monto de la operación (Amount) debe ser un número entero positivo menor que 999,999,999
507	La estructura del precio (Rate) que fue enviada no es válida para la Cámara. 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

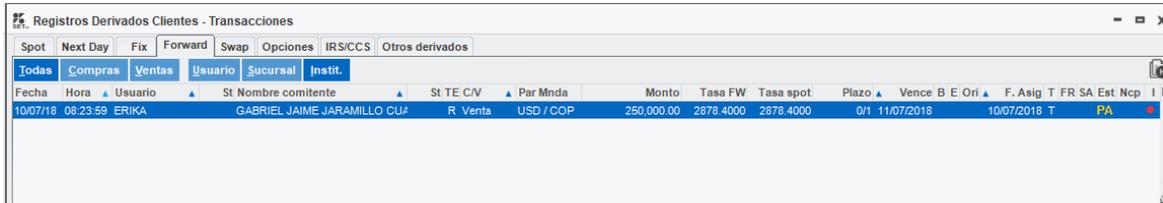
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

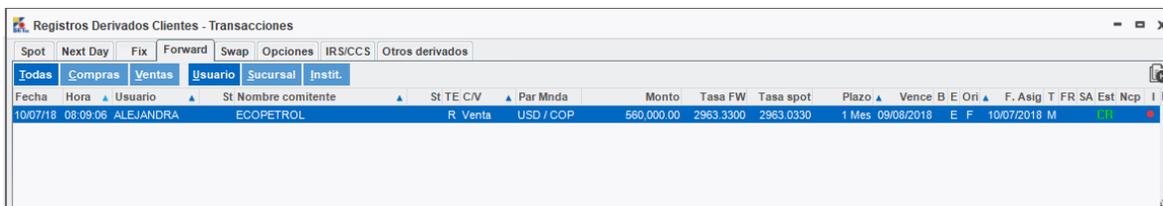
	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 87 / 91

6.2. Compensación de operaciones de Días Anteriores

Desde el Blotter de operaciones ir al botón días anteriores  y luego de dar click sobre el, se despliega un campo que permite escoger la fecha de la operación donde esta la operación que se quiere enviar para ser compensada, una vez se encuentres se da click derecho sobre la operación y se escoge la opción compensar por CRCC.

A partir de ese momento empiezan a aplicarse los estados de la operación tal como se describió en el capítulo anterior.

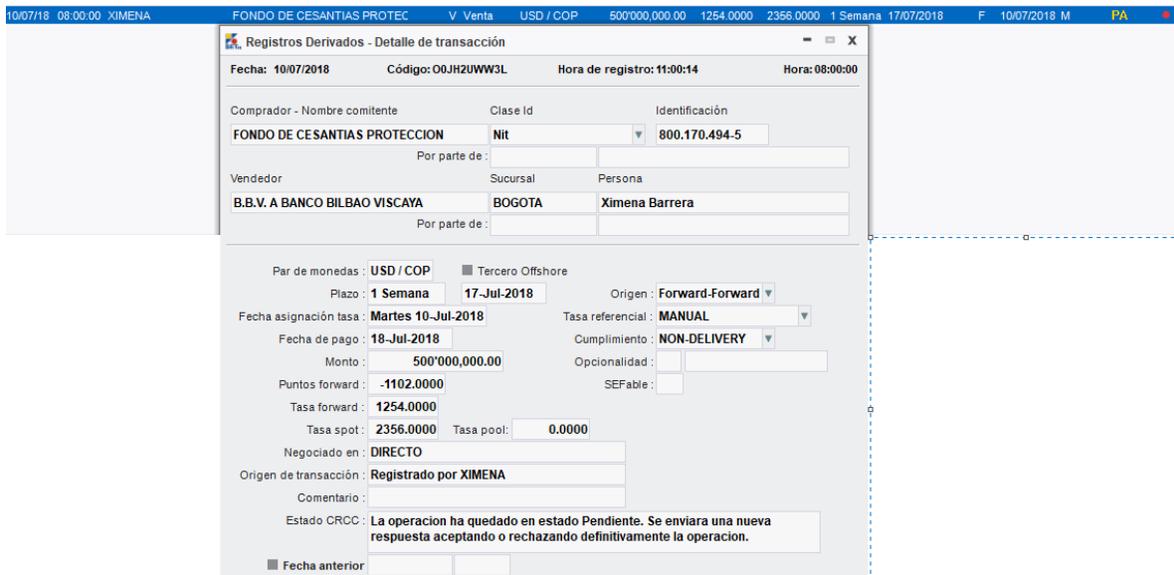


Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SG00202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 88 / 91

6.3. Anulación de Estado de Compensación

Se levanta el estado de compensado de una operación previamente compensada a la autorización de CRCC. Solo se puede quitar el estado de compensación el mismo día de envío a CRCC.



Registros Derivados - Detalle de transacción

Fecha: 10/07/2018 Código: 00JH2UWW3L Hora de registro: 11:00:14 Hora: 08:00:00

Comprador - Nombre comitente: FONDO DE CESANTIAS PROTECCION Clase Id: Nit Identificación: 800.170.494-5

Vendedor: B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA Sucursal: BOGOTA Persona: Ximena Barrera

Par de monedas: USD / COP Plazo: 1 Semana 17-Jul-2018 Origen: Forward-Forward

Fecha asignación tasa: Martes 10-Jul-2018 Tasa referencial: MANUAL

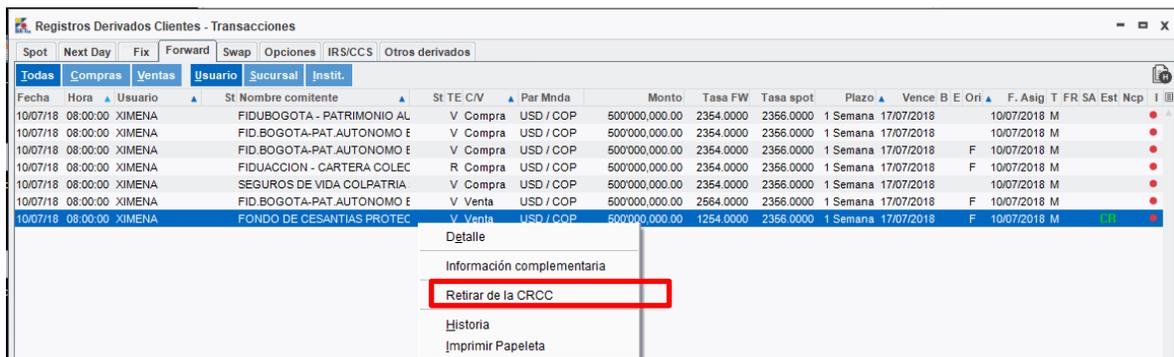
Fecha de pago: 18-Jul-2018 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 500'000,000.00 Puntos forward: -1102.0000 Tasa forward: 1254.0000

Tasa spot: 2356.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECTO Origen de transacción: Registrado por XIMENA

Estado CRCC: La operacion ha quedado en estado Pendiente. Se enviara una nueva respuesta aceptando o rechazando definitivamente la operacion.



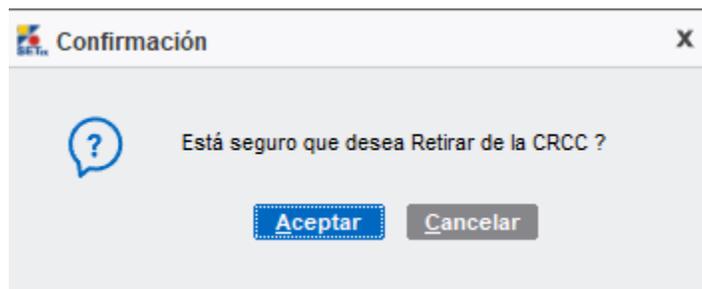
Registros Derivados Clientes - Transacciones

Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FIDUBOGOTA - PATRIMONIO AL	Compra	USD / COP	500'000,000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FID.BOGOTA-PAT.AUTONOMO E	Compra	USD / COP	500'000,000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FID.BOGOTA-PAT.AUTONOMO E	Compra	USD / COP	500'000,000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	F 10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	R	FIDUACCION - CARTERA COLEC	Compra	USD / COP	500'000,000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	F 10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	SEGUROS DE VIDA COLPATRIA	Compra	USD / COP	500'000,000.00	2354.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FID.BOGOTA-PAT.AUTONOMO E	Venta	USD / COP	500'000,000.00	2564.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	F 10/07/2018 M
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FONDO DE CESANTIAS PROTEC	Venta	USD / COP	500'000,000.00	1254.0000	2356.0000	1 Semana	17/07/2018	F 10/07/2018 M

Context menu options: Detalle, Información complementaria, Retirar de la CRCC, Historia, Imprimir Papeleta

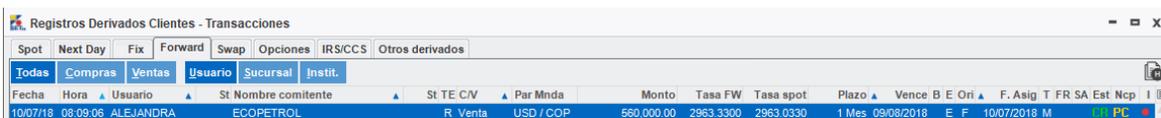
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 89 / 91



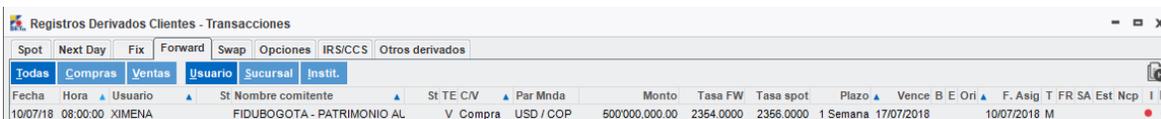
En el Blotter de operaciones aparecerán los siguientes estados

PC Letras en Amarillo (Pendiente Cámara): La entidad envía la solicitud de levantar compensación a la CRCC pero está pendiente la respuesta por parte de la Cámara PC.



Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE CV	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
10/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	R	ECOPETROL	Venta	USD / COP	560,000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018	E F 10/07/2018 M

Cuando es aprobada la desmarcación de la operación no aparece ningún estado en el Blotter de operaciones



Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE CV	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
10/07/18	08:00:00	XIMENA	V	FIDUBOGOTA - PATRIMONIO AL	Compra	USD / COP	500,000,000.00	2364.0000	2366.0000	1 Semana	17/07/2018	10/07/2018 M

Si CRCC rechaza la desmarcación de la operación continuará con el estado **CR**



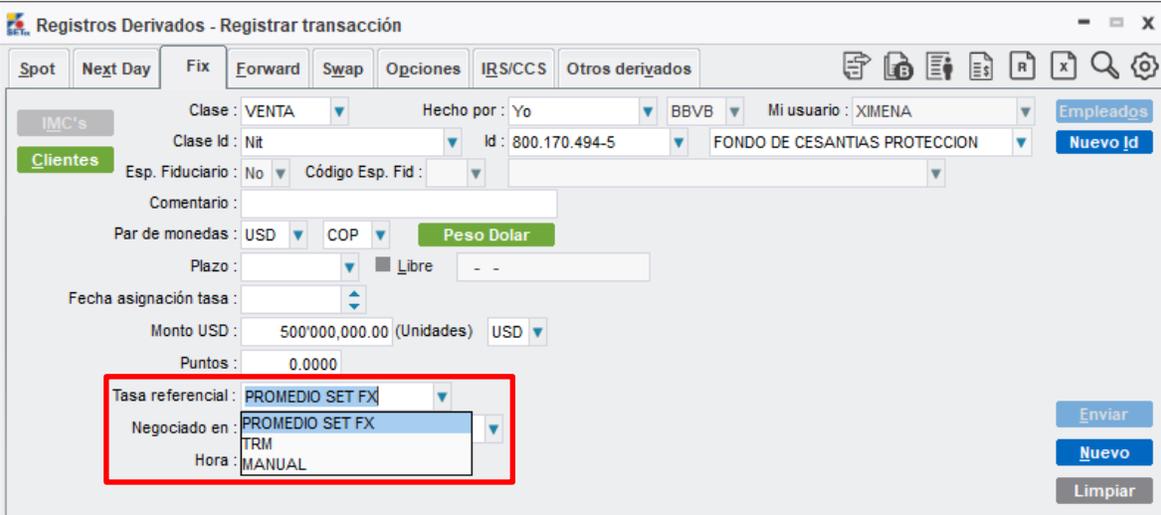
Fecha	Hora	Usuario	St	Nombre comitente	St TE CV	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence B E Ori	F. Asig T FR SA Est Ncp
10/07/18	08:09:06	ALEJANDRA	R	ECOPETROL	Venta	USD / COP	560,000.00	2963.3300	2963.0330	1 Mes	09/08/2018	E F 10/07/2018 M

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/01/2019	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018	Aprobado por: Gerente de TI Fecha: 17/01/2018
--	--	--

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 90 / 91

7. Tasa referencial

En la ventana de registros para las operaciones FIX de contado entre IMC-Clientes y FIX Forward tanto para las operaciones IMC-IMC como IMC-Clientes, el proceso de asignación de la tasa va a ser automático dependiendo si elige “Promedio SET-FX” o “TRM”. También existe una tercera opción para tasas “Manuales”.



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: XIMENA Empleados

Clase Id: Nit Id: 800.170.494-5 FONDO DE CESANTIAS PROTECCION Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario:

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Plazo: Libre - -

Fecha asignación tasa:

Monto USD: 500'000,000.00 (Unidades) USD

Puntos: 0.0000

Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Negociado en: PROMEDIO SET FX

Hora: MANUAL

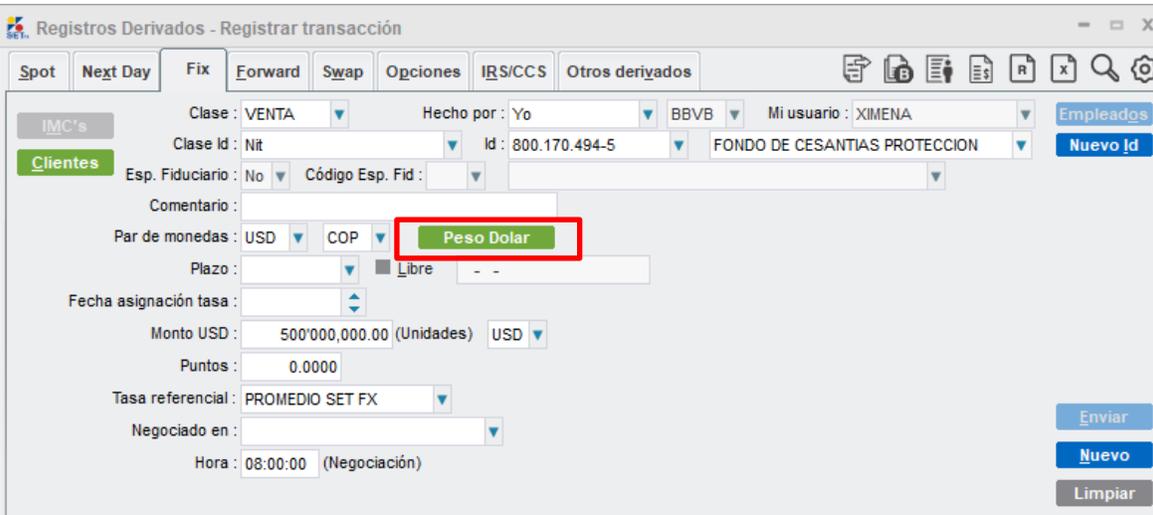
Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Venta a OTR 500'000,000.00 a 1254.0000 a 1 Semana, Par de monedas USD/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018

	SGO0202 ADMINISTRACIÓN DEL APLICATIVO SET-FX	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MANUAL DE REGISTRO DE DIVISAS	Versión: 01 Página: 91 / 91

En la pestaña del mercado FIX del módulo Registro de Divisas; se permite especificar la moneda en la que está expresado el monto de la operación.



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: XIMENA Empleados

Clase Id: Nit Id: 800.170.494-5 FONDO DE CESANTIAS PROTECCION Nuevo jd

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid:

Comentario:

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

Plazo: Libre --

Fecha asignación tasa:

Monto USD: 500'000,000.00 (Unidades) USD

Puntos: 0.0000

Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Negociado en:

Hora: 08:00:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 Venta a OTR 500'000,000.00 a 1254.0000 a 1 Semana, Par de monedas USD/COP

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerente de TI
Fecha: 14/01/2019	Fecha: 17/01/2018	Fecha: 17/01/2018