



Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas Set-FX

Instructivo – Módulo Posición y Ganancia

SEPTIEMBRE

Introducción

El presente instructivo tiene como objetivo explicar en detalle el funcionamiento del modulo Posición y Ganancia, el cual permite calcular en línea la posición de cada operador, sucursal o entidad (según el perfil que se determine). Este módulo está disponible para los mercados Spot y Next Day USD/COP.

1. Acceso al modulo posición y ganancia

Una vez dentro del mercado SPOT / NEXT DAY, seleccione "Transacciones y Posición" posteriormente "Posición y Ganancia".

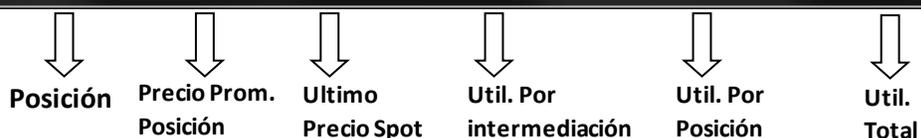


Aparece la siguiente ventana "Dólar Spot – Posición y Ganancia".

Usuario	Posición (USD)			Utilidad (COP)		
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
ALEJANDRO	-250,000	1971.80	1900.00		17'950,000	17'950,000

2. Descripción ventana posición y Ganancia

Usuario	Posición (USD)			Utilidad (COP)		
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
ALEJANDRO	-250,000	1973.93	1977.70	-1'885,000	-942,500	-2'827,500



Posición

Largo/Corto: Es la diferencia en dólares, entre la suma de las compras y la suma de las ventas. Si la suma de las compras es mayor, se muestra en azul '**largo**', y si la suma de las ventas es mayor, se muestra en rojo '**corto**'.

Promedio: el precio ponderado de compra, o de venta.

Utilidad

Precio: se muestra el precio de la última transacción en el mercado Spot (realizado por cualquier participante). Este precio es utilizado para calcular la Utilidad Posición.

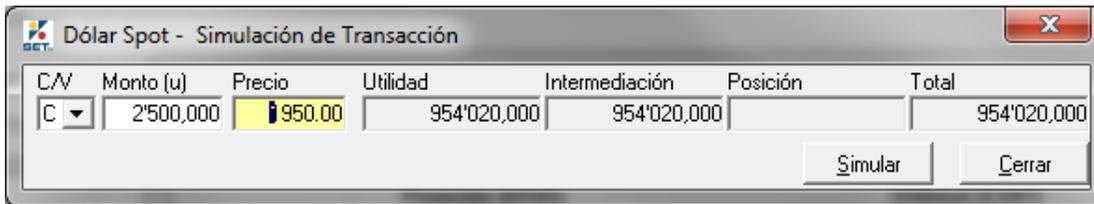
Utilidad Intermediación: cuando el tamaño de la posición disminuye (se vende Dólares que se habían comprado, o se compra Dólares que se habían vendido), se calcula la utilidad en pesos. Esta es la diferencia en precio de la venta o compra con el promedio ponderado de la posición multiplicado por el monto. Este campo muestra la suma de utilidad de intermediación acumulada el día de operación.

Utilidad Posición: Cada vez que haya una transacción en el mercado Spot, se compara este último precio del mercado, con el precio promedio de la posición, para calcular Utilidad Posición en Pesos.

Barra de Botones



Simular Operación: Al oprimir el botón “Simular Operación”, se abre la siguiente ventana:

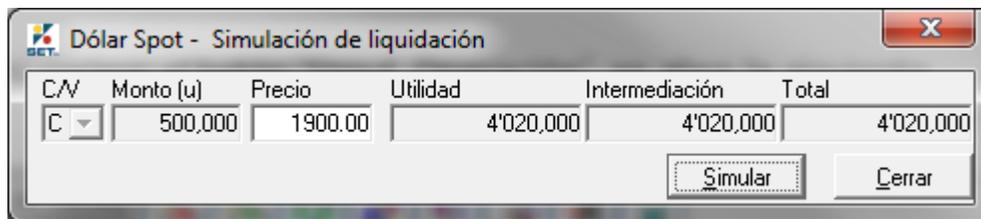


C/V	Monto (u)	Precio	Utilidad	Intermediación	Posición	Total
C	2'500,000	1950.00	954'020,000	954'020,000		954'020,000

Simular Cerrar

En esta ventana el operador puede digitar Monto, Precio y C o V (Compra o Venta) de una transacción futura, para así calcular la utilidad de Intermediación y Posición.

Simular Liquidación: Al oprimir el botón “Simular Liquidación”, se abre la siguiente ventana:

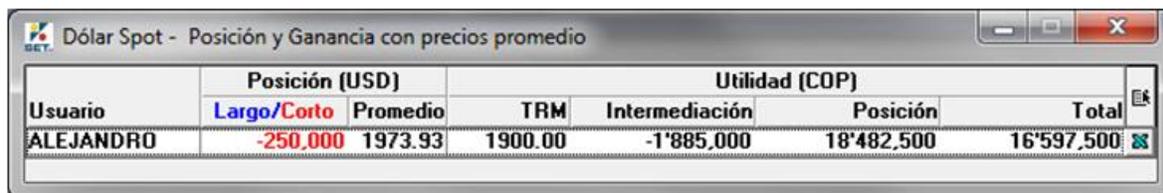


C/V	Monto (u)	Precio	Utilidad	Intermediación	Total
C	500,000	1900.00	4'020,000	4'020,000	4'020,000

Simular Cerrar

Esta permite calcular la utilidad de una posible transacción para llevar su posición a cero.

P&G Precios Promedio: Al oprimir este botón se desplegara la siguiente ventana:



Usuario	Posición (USD)		Utilidad (COP)				Total
	Largo/Corto	Promedio	TRM	Intermediación	Posición		
ALEJANDRO	-250,000	1973.93	1900.00	-1'885,000	18'482,500	16'597,500	

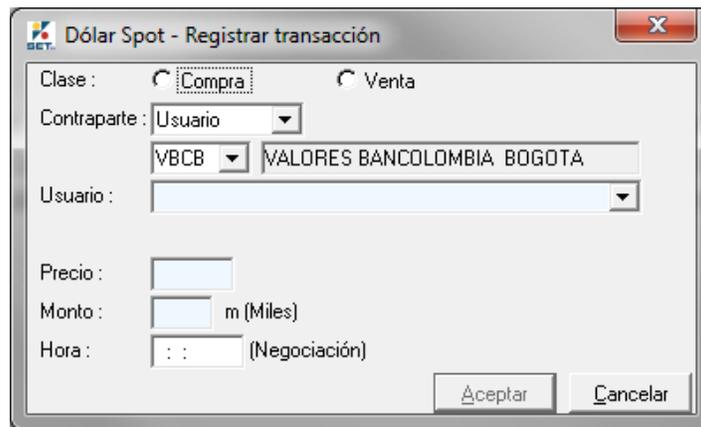
En esta ventana se podrá observar la valoración de la posición respecto al precio Promedio del SET-FX (FIX) o respecto a la TRM vigente en el momento.

Dependiendo de la hora del día se valorara la posición de la siguiente manera.

- 08:00(T+0) – 13:10(T+0) → TRM vigente (TRM del día anterior)

- 13:10(T+0) – 17:30(T+0) → FIX Sistema SET-FX
- 17:30(T+0) – 13:10(T+1) → TRM vigente (TRM del día)

Registrar: Al hacer clic en este botón, se abre una ventana para crear una transacción (por fuera del mercado transaccional SPOT o NEXT DAY USD/COP) que se ha realizado y debe tenerse en cuenta para calcular la posición.



Este tipo de registros pueden estar asociadas a operaciones con:

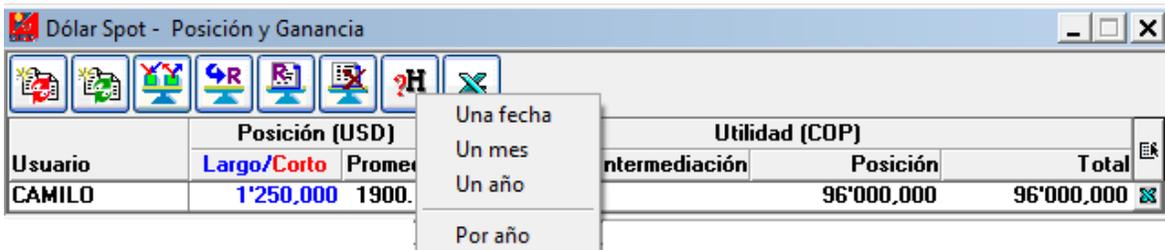
- Contraparte en la misma entidad. En este caso se solicitará la confirmación del usuario.
- Contraparte tipo Empleado
- Contraparte tipo Cliente
- Consolidado de operaciones

Solicitudes de registro y/o anulación: Al oprimir alguno de estos botones accederá a un blotter, en el cual encontrara las solicitudes realizadas por otros participantes (Usuarios de su misma entidad y/o empleados) con el fin de aceptar (Solicitudes de registro) o anular (Solicitudes de anulación) operaciones realizadas dentro del modulo de posición & Ganancia.

Una vez dentro del blotter de registros o anulaciones deberá hacer clic derecho dentro de la operación deseada, con el fin confirmar o rechazar la anulación o registro.



Historia: este botón permite consultar posiciones anteriores, los filtros permitidos son los siguientes:



Al seleccionar la opción de “Una fecha” despliega la ventana con la posición del día anterior y el usuario puede ingresar la fecha que desea consultar.



Al seleccionar la opción “Un mes” despliega una ventana con la posición día a día del mes actual incluyendo la del día de hoy, el usuario puede consultar el mes que desea en la opción de esta en la parte superior derecha. Adicionalmente si hace clic sobre un día específico, muestra la posición de ese día.

Dólar Spot - Posición y Ganancia de un mes

Mes/Año: Sep-2014

Mes/Día	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
Septiembre/11	1'250,000	1900.00	1931.00		38'750,000	38'750,000
Septiembre/12	1'250,000	1900.00	1966.00		82'500,000	82'500,000
Septiembre/13	1'250,000	1900.00				
Septiembre/14	1'250,000	1900.00				
Septiembre/15	1'250,000	1900.00	1986.00		107'500,000	107'500,000
Septiembre/16	1'250,000	1900.00				

Al seleccionar la opción "Un año" despliega una ventana con la posición mes a mes del año actual, el usuario puede consultar el año que desea en la opción de esta en la parte superior derecha. Adicionalmente si hace clic sobre un mes específico, muestra la posición día a día del mes seleccionado.

Dólar Spot - Posición y Ganancia de un año

Año: 2014

Mes	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
Septiembre	3'750,000	1950.67	1986.00		228'750,000	228'750,000

Al seleccionar la opción "Por año" despliega una ventana con la posición año a año, adicionalmente si el usuario hace clic sobre un año específico, trae la posición mes a mes del año seleccionado.

Dólar Spot - Posición y Ganancia por año

Año	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
2014	7'500,000	1965.00	1986.00		388'750,000	388'750,000

Detalle de operaciones: este botón permite exportar a Excel el listado de Compras, Ventas, y posición final en el momento de ser oprimido (incluye posiciones de apertura, cierre y transacciones manuales).

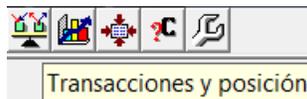
Detalle: Al hacer doble clic sobre la línea de la posición de un usuario, se abre una nueva ventana que muestra los cálculos de posición y utilidad para cada una de las transacciones de este en orden cronológico.

A diferencia de la ventana general de la posición, en la cual la utilidad se valora con base en el último precio del mercado Spot (transaccional), en este caso la valoración de la posición se realiza de acuerdo con el último precio registrado por el operador.

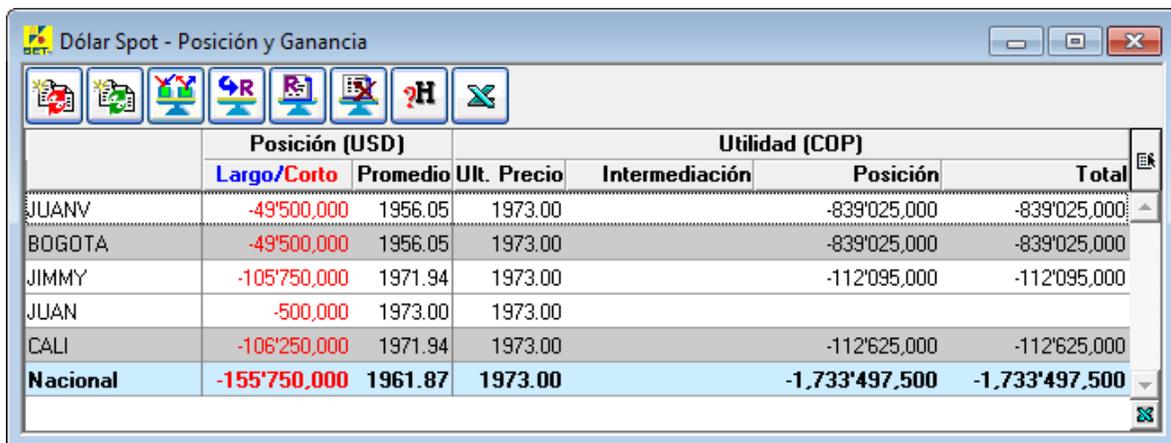


Transacción				Posición (USD)			Utilidad (COP)				
Fecha	Hora	Ori	C/V	Precio	Monto (USD)	Utilidad (COP)	Largo/Corto	Promedio	Intermediación	Posición	Total
15/09/2014	Apertura		V				-250,000	1971.80			
16/09/2014	10:45:40		V	1975.00	500,000		-750,000	1973.93		-802,500	-802,500
16/09/2014	10:45:55		C	1977.70	500,000	-1'885,000	-250,000	1973.93	-1'885,000	-942,500	-2'827,500

Supervisor de Institución: El modulo permite configurar el perfil de usuario como supervisor de la entidad permitiendo ver la posición de todos los usuarios de la institución y seguir segundo a segundo el comportamiento de las negociaciones realizadas por los usuarios de SET FX.



Haciendo clic en la opción **Transacciones y posición** y seleccionando "Posición y Ganancia" el sistema nos muestra la información de los usuarios y las sucursales que conformen la entidad.



	Posición (USD)			Utilidad (COP)		
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
JUANV	-49'500,000	1956.05	1973.00		-839'025,000	-839'025,000
BOGOTA	-49'500,000	1956.05	1973.00		-839'025,000	-839'025,000
JIMMY	-105'750,000	1971.94	1973.00		-112'095,000	-112'095,000
JUAN	-500,000	1973.00	1973.00			
CALI	-106'250,000	1971.94	1973.00		-112'625,000	-112'625,000
Nacional	-155'750,000	1961.87	1973.00		-1,733'497,500	-1,733'497,500

Haciendo clic en el botón  se muestra la información valorando la posición contra la TRM.

Dólar Spot - Posición y Ganancia con precios promedio

	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	TRM	Intermediación	Posición	Total
JUANV	-49'500,000	1956.05	1900.00		2,774'475,000	2,774'475,000
BOGOTA	-49'500,000	1956.05	1900.00		2,774'475,000	2,774'475,000
JIMMY	-105'750,000	1971.94	1900.00		7,607'655,000	7,607'655,000
JUAN	-500,000	1973.00	1900.00		36'500,000	36'500,000
CALI	-106'250,000	1971.94	1900.00		7,643'625,000	7,643'625,000
Nacional	-155'750,000	1961.87	1900.00		9,636'252,500	9,636'252,500

Perfil supervisor de sucursal: El modulo permite configurar el perfil de usuario como supervisor únicamente para la sucursal a la cual pertenece, desde donde se puede ver la posición de todos los usuarios pertenecientes a la misma, contando también con la información en detalle de la posición valorada con respecto a la TRM o a la tasa promedio de mercado.

Dólar Spot - Posición y Ganancia










	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	Ult. Precio	Intermediación	Posición	Total
JIMMY	-105'750,000	1971.94	1973.00		-112'095,000	-112'095,000
JUAN	-500,000	1973.00	1973.00			
CALI	-106'250,000	1971.94	1973.00		-112'625,000	-112'625,000

Dólar Spot - Posición y Ganancia con precios promedio

	Posición (USD)		Utilidad (COP)			
	Largo/Corto	Promedio	TRM	Intermediación	Posición	Total
JIMMY	-105'750,000	1971.94	1900.00		7,607'655,000	7,607'655,000
JUAN	-500,000	1973.00	1900.00		36'500,000	36'500,000
CALI	-106'250,000	1971.94	1900.00		7,643'625,000	7,643'625,000