



## **Manual de Usuario Mercado Dólar Forward.**

Versión 6.03.  
SET-FX Colombia

Julio 2007.

## INDICE

Objetivo.....	1
Ingreso al Modulo Dólar Forward .....	2
Cupos y Límites .....	3
Ingreso de Mi Precio Spot .....	6
Plazos .....	8
Descripción de la Ventana Dólar Forward.....	9
Configuración de Límites.....	10
Ingreso de Posturas .....	10
Visualización de Posturas .....	13
Modificación de Posturas .....	16
Retiro de Posturas .....	18
Transacciones .....	19
Visualización de Transacciones .....	21
Operaciones sobre Transacciones.....	22
Transacciones Por Registro .....	27

## Objetivo

El presente manual tiene como objetivo, explicar en detalle el funcionamiento del Mercado Dólar Forward, el cual es un mercado derivado que se efectúa entre la moneda local y el dólar norteamericano. Las posturas se realizan a una fecha futura sobre un monto y tasa previamente establecidos.


El precio del dólar para el día de vencimiento se establece a través de la tasa indicada en la postura y el precio del dólar spot acordado en el momento de la transacción por ambas contrapartes.

Es un mercado no estandarizado en el cual los plazos de las posturas pueden ser fijos (previamente definidos el administrador del sistema) o libres (definidos por el postulante). Los días de vencimiento son validados por el sistema, teniendo en cuenta que no sean días no laborables (fines de semana y feriados).

Todas las posturas tienen dos métodos de cumplimiento: por Compensación (NDF) o Físico (Delivery Forward).

El mercado es de modalidad semi-ciego, donde el usuario solo conoce la contraparte una vez cerrada la operación.

## Ingreso al Modulo Dólar Forward

En todos los Usuarios del sistema, en la barra principal de Sistema Set-Fx se encuentra el botón  Mercados, el cual permite ingresar a los diferentes mercados activos del sistema. Se debe desplegar el menú DÓLAR y elegir la opción Dólar Forward.




Se presenta la ventana del Mercado Dólar Forward, con su respectiva barra de botones de operación, como en el siguiente gráfico.



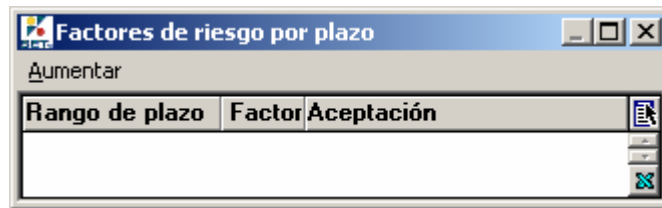
Dólar Forward									
Demandas					Ofertas				
Inc :	2	Mio :		Ok	Mio :		Ok		
Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
3er mar	01-Jun-2007								
1M	18-Jul-2007								
2M	16-Ago-2007								
3M	18-Sep-2007								
6M	18-Dic-2007								
1A	18-Jun-2008								

10:05:23 - Compra BCLB CAMILO de 1000\$ a 2303.00 en 0/15

## Cupos y Límites

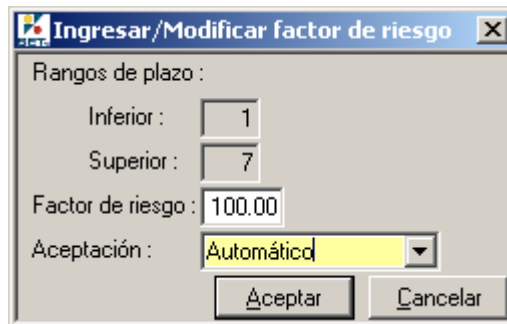
Al igual que en otros mercados, en Dólar Forward es necesario asignar límites para poder operar o en su defecto compartir límites de otros mercados. Con el botón “**Cupos**”  **Cupos**, se accede a la ventana de los Cupos Bilaterales, la forma de ingreso es similar a la del Mercado Spot, la diferencia aquí es que es necesario configurar Factores de Riesgo que afectan a todo el mercado.

En la ventana de Cupos, con clic sobre el botón **Factores de riesgo**, se accede a la ventana para ingresar los porcentajes o factores de riesgo, los cuales se deben crear de acuerdo con un rango de plazos.



Cada entidad ingresa rangos de plazos y un porcentaje de riesgo, por lo tanto cada vez que se cierre una operación Forward en el rango de plazos ingresado, se reduce del cupo el porcentaje de monto configurado.

En este ejemplo, se crea un factor de riesgo por los plazos de 1 a 7 días, con un % de 100.00. Esto indica que cuando se cierre una operación en dicho plazo, se reducirá el cupo por un monto total igual al negociado el día de la operación. La opción Automático, indica que si es permitido negociar en estos plazos o de lo contrario la opción “no negociar” no permite cerrar operaciones en el plazo señalado.



En este otro ejemplo, se crea un factor de riesgo por los plazos de 15 a 30 días, con un % de 50.00. Esto indica que cuando se cierre una operación en dicho plazo, se reducirá del cupo el 50% del monto total negociado el día de la operación. Los cupos se mantendrán afectados de acuerdo con el factor de riesgo indicado en cada plazo hasta que la operación llegue a su fecha de vencimiento.

Por otro lado, se puede configurar en factores de riesgo, plazo en los cuales no se permitirá negociar. En este ejemplo, se crea un factor de riesgo por los plazos de 31 a 45 días, con un % de 100.00, pero con la opción No negociar, esto indica que toda postura que se ingrese en los plazos definidos no podrán ser negociados.

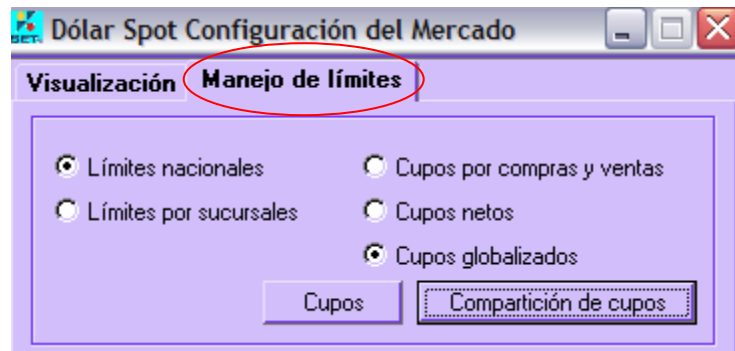
Por último, si no se registran plazos en factores de riesgo, cualquier postura que se ingrese con el plazo no configurado, no podrá ser negociada.

### Compartición de Cupos

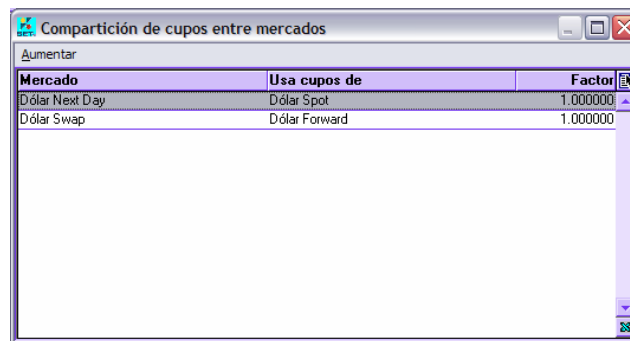
Los límites (cupos) se pueden compartir entre distintos mercados. En la opción configuración:



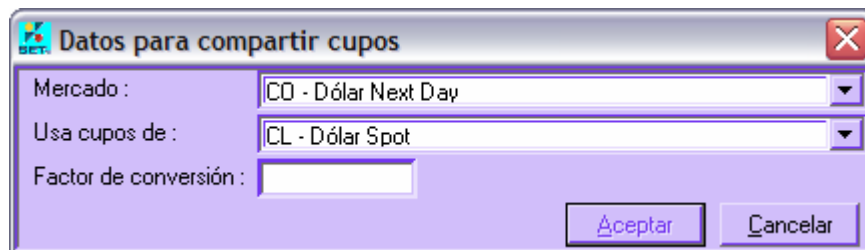
Haciendo clic en la pestaña de manejo límites:



haciendo clic en el botón "Compartición de Cupos" se accede a la ventana:




En donde se ingresa con el botón "aumentar" una nueva instrucción de compartición de cupos.



En este caso quiere decir que el mercado Next Day va a descontar de los mismos cupos del mercado Spot, quiere decir que ambos van a quedar compartidos. En la anterior ventana de ejemplo, el factor de conversión indica que por cada dólar negociado en Next Day debo descontar un porcentaje de dólar del mercado Spot. Si se indica 1, quiere decir que por cada dólar negociado en Next Day se descuenta 1 dólar del cupo de spot.

## Ingreso de Mi Precio Spot

Para ingresar posturas y negociar en el mercado Forward, es necesario tener un precio Spot que sirve de referencia al cual se añaden los puntos Forward y estos valores generan el Precio Forward (o precio outright) a negociar.

Con el botón “**Mi precio Spot**” , se accede a la ventana de ingreso del precio Spot, la cual presenta tres (3) opciones para tomar un precio referencial, siendo el precio por omisión “**Mi precio mercado Spot**”.



Donde;



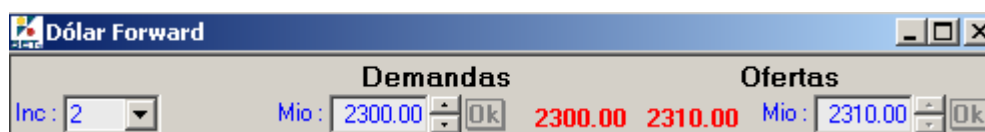
**Mi precio mercado Spot:**

Toma los mejores precios de Demanda y Oferta que la sucursal tenga ingresados en el mercado Dólar Spot, los publica y utiliza en el mercado Forward, si no hay precios en Spot la ventana de Forward no permite ingresar posturas.

En este ejemplo, ALNB tiene los siguientes precios en el mercado Dólar Spot.

Demandas ↑			↑ Ofertas		
100			100		
2300.00		2	2310.00		
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
ALNB	300	2300.00	2310.00	300	ALNB
			2310.01	300	ALNB

En el mercado Forward, en los campos Mío, ubicados bajo Demandas y Ofertas, se colocan los precios Spot referencial tomados de los mejores Precios ingresados en el mercado Spot. En color rojo aparecen las puntas públicas del mercado Spot. En este caso coinciden con los mejores precios de ALNB debido a que no hay otro postulante.



### La segunda opción. Ingresar precio spot:



**Precio spot**

Ingresar precio spot

Demanda : 2300.00

Oferta : 2310.00

Con esta opción el usuario se ve obligado a ingresar precios spot de referencia para demanda y oferta, los cuales serán utilizados para negociar en Forward.



**Precio spot**

Mi precio mercado Spot

Ingresar precio spot

Demanda : 2300.00

Oferta : 2310.00

Precio outright

Aceptar ✓ Cancelar ✗

Los precios ingresados, que se muestran en los campos Mío, ubicados bajo Demandas y Ofertas, reemplazan a los mejores precios Spot del mercado Dólar Spot, a pesar que estos se publican en rojo en el mercado Forward.

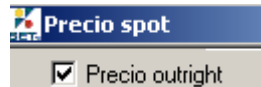


**Dólar Forward**

Inc: 2

Demandas		Ofertas	
Mio: 2301.00	Ok	2300.00 2310.00	Mio: 2311.00

### La tercera opción. Precio Outright:



**Precio spot**

Precio outright

Al elegir esta opción, no se utiliza precios Spot referencial, sino que el precio forward será ingresado directamente al momento de colocar una punta.

## Plazos

En el mercado Forward, se tienen dos (2) modalidades para el ingreso de plazos, Predeterminados o Libres. Todos los plazos tienen una fecha de vencimiento.

**Plazos Predeterminados:** Son plazos creados desde el administrador del sistema los cuales no pueden ser modificados por el usuario. Por ejemplo podrían ser:

Plazo	Vence
3er mar	01-Jun-2007
1M	18-Jul-2007
2M	16-Ago-2007
3M	18-Sep-2007
6M	18-Dic-2007
1A	18-Jun-2008

Donde;

**3er mar:** Indica vencimiento en el tercer martes del mes actual o del siguiente mes.

**1M:** Indica vencimiento en 1 mes a la fecha de la transacción.

**2M:** Indica vencimiento en 2 meses a la fecha de la transacción.

**3M:** Indica vencimiento en 3 meses a la fecha de la transacción.

**6M:** Indica vencimiento en 6 meses a la fecha de la transacción.

**1A:** Indica vencimiento en 1 año a la fecha de la transacción.

**Plazos Libres:** Son plazos que crea el usuario. Cuando se ingresa una postura con este tipo de plazos, el plazo libre se añade, en número de días, en la columna plazo del mercado.

Ingresar demanda  
Dólar Forward  
Plazo :  Libre 1

## Descripción de la Ventana Dólar Forward

La ventana Dólar Forward tiene las siguientes características:

**Modificación Rápida de Precio (Inc):** Permite modificar el precio de una postura ingresada, sin necesidad de retirarla.

**Mio:** Mi Precio Spot referencial para demandas.

Mejor Precio en Mercado Spot.

**Mio:** Mi Precio Spot referencial para ofertas.

**+**: Indicador de que hay profundidad en el plazo.

**Plazo:** Plazos predeterminados y/o libres.

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

**Luz Verde:** Indica que se puede operar, pues hay cupo bilateral se permite en factor de riesgo.

**Luz Roja:** Indica que no se puede operar, pues no hay cupo bilateral o no se permite en factor de riesgo.


Posturas con código en azul: Posturas propias.

Cuando en un plazo se presenta el símbolo **+**, se indica que hay profundidad en el plazo, es decir que hay más posturas presentes. Por omisión se muestra la mejor postura.

Al presionar clic sobre **+**, se despliegan todas las posturas.

Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio
3er mar	19-Jun-2007			600	2302.60
		ALNB		500	2302.50

## Configuración de Límites


El Mercado Forward, tiene el mismo formato de configuración de Límites y Cupos que el Mercado Dólar Spot. Para acceder a esto se debe utilizar el botón  Configuración del mercado, de la barra de botones del mercado. Las opciones por omisión son Límites Nacionales y Cupos por Compras y Ventas.



## Ingreso de Posturas

Como se explico antes, para ingresar posturas en el Mercado Forward, es necesario tener configurado un precio Spot Referencial o en su defecto ingresar un Precio Outright en la postura.

### Con Precio Spot Referencial:

Para ingresar una **DEMANDA**, se debe presionar el botón **Demandar**  de la barra de botones del mercado, o la tecla **F5**. Se presenta la ventana de ingreso de posturas.

Donde;

**Precio Spot:** Es el precio Spot Referencial, tomado del mercado Dólar Spot o ingresado por el usuario

**Plazo:** El plazo que tendrá la transacción, este puede ser Libre o Predeterminado.

**Vencimiento:** La fecha exacta del vencimiento de la transacción tomando en cuenta el plazo de la misma.

**Puntos Forward:** Los puntos adicionales al precio Spot que tendrá la transacción.

**Precio Forward:** Resultado de la suma del precio Spot, más los puntos forward (para el caso de la opción "ingresar precio outright" en el botón  no se ingresan puntos sino que se ingresa directamente el precio forward).

**Monto:** Cantidad a negociar.

**Total:** Indica si se permite o no negociar por monto parcial.


**Método:** Indica la forma de pago de la transacción. Si es física, el monto indicado es transferido entre las contrapartes; y si es por compensación, sólo la diferencia es transferida entre las contrapartes.

Al presionar Aceptar, la postura se presenta en el mercado.



Demandas				Ofertas					
Inc:	5	Mio:	2300.00	Ok	2300.00	2310.00	Mio:	2310.00	Ok
Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
3er mar	19-Jun-2007								
1M	18-Jul-2007	ALNB		500	2302.50				
2M	16-Ago-2007								

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

Para ingresar una **OFERTA**, se debe presionar el botón **Ofertar**  de la barra de botones del mercado, o la tecla **F6**.



**Modificar orden postura oferta**

**Dólar Forward**

Precio Spot : 2310.00

Plazo :  Libre 7

Vencimiento : Lunes 25-Jun-2007

Puntos Forward : 1.80

Precio Forward : 2311.80

Monto : 600 m

Total :

Método : FISICO

Aceptar Cancelar

Demandas						Ofertas				
+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	3er mar	19-Jun-2007								
	0/7	25-Jun-2007					2311.80	600	F	ALN
	1M	18-Jul-2007	ALNB		500	2302.50				

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

En todas las posturas el **Monto** esta dado en miles.

### Con Precio Outright:

El ingreso de posturas con Precio Outright, tiene los mismo pasos que en el punto anterior, lo único que cambia es que en este caso ya no se necesita un precio Spot referencial, sino que la postura es ingresada con un precio general al cual ya no se suman puntos.

Al presionar **F5** o **F6**, se presenta la ventana de ingreso de postura donde se que el único campo nuevo es Precio Forward.

**Ingresar demanda**

**Dólar Forward**

Plazo :  Libre 1M

Vencimiento : Miércoles 18-Jul-2007

Precio Forward : 2305.00

Monto : 500 m

Total :

Método : COMPENSACION

Aceptar Cancelar

Al presionar Aceptar, la postura se presenta en el mercado.

Demandas						Ofertas				
+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	1M	18-Jul-2007	ALNB		500	2305.00				
	2M	16-Ago-2007								

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

## Visualización de Posturas

Toda postura ingresada, será visualizada con dos tipos de luces por las contrapartes:

**Posturas con Luz Verde:** Las posturas se muestran en verde cuando el postulante y contraparte, tienen cupo bilateral. Además, se debe tener en cuenta los plazos configurados como Automático en factores de riesgo.

Rango de plazo	Factor	Aceptación
1 - 7 días	100.00	Automático
15 - 30 días	50.00	Automático
31 - 45 días	30.00	Automático

En todos estos plazos verá luz verde y por lo tanto se podrá negociar. En este ejemplo se observa que las posturas ingresadas en los plazos 3er mar, 1M y 45 días, como si están configurados en Factores de riesgo, las posturas se ven con luz verde.

Demandas						Ofertas				
+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	3er mar	19-Jun-2007	●		500	2301.30				
	1M	18-Jul-2007					2312.50	600	F	●
	0/45	02-Ago-2007	●		700	2303.10				

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

**Posturas con Luz Roja:** En contraste con el punto anterior, una postura se ve con luz roja por tres razones específicas:

- 1) **No hay cupo bilateral:** En este ejemplo, BCL no tiene cupo con ALN.

Cod.	Institución	Límite	Cupo
ALN	ALIANZA VALORES S.A		

Factores de riesgo    Aumentar

Por esto la postura ingresada por BCL es vista en rojo por ALN.

Demandas				Ofertas						
Inc:	1	Mio:	2300.00	2300.00	2310.00	Mio:	2310.00			
+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	3er mar	19-Jun-2007		500		2301.30				

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

- 2) **Hay cupo bilateral pero no se ha creado los plazos en factores de riesgo:** En este caso, ALN y BCL tienen cupo bilateral. BCL ingresa la postura a 3m (90 días), pero ALN no ha creado el factor de riesgo para dicho plazo.

Rango de plazo	Factor	Aceptación
1 - 7 días	100.00	Automático
15 - 30 días	50.00	Automático
31 - 45 días	30.00	Automático
46 - 60 días		No negociar

Por lo tanto la postura ingresada por de BCL es vista en rojo por ALN

Demandas				Ofertas						
Inc:	1	Mio:	2300.00	2300.00	2310.00	Mio:	2310.00			
+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	3M	18-Sep-2007		500		2301.30				
	6M	18-Dic-2007								

11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar

- 3) **Hay cupo bilateral y se ha creado el plazo con factor de riesgo pero bajo la opción: "No Negociar"**: Como último caso, se tiene que ALN y BCL tienen cupo bilateral. BCL ingresa la postura a 3m (60 días), pero ALN ha creado el factor de riesgo para dicho plazo en con formato No Negociar.

The screenshot shows the 'Dólar Forward' application window. At the top, there are input fields for 'Inc' (set to 1), 'Mio' (set to 2300.00), and 'Ofertas' (set to 2310.00). Below this is a table with columns for 'Plazo', 'Vence', 'Cod', 'M', 'Monto', 'Precio', 'Precio', 'Monto', 'M', and 'Cod'. The first row shows a demand for 0/49, due on 06-Ago-2007, with a 'Cod' of 500 and a price of 2303.30. The second row shows a demand for 2M, due on 16-Ago-2007. At the bottom of the window, a status bar reads: '11:48:51 - Compra BCLB CAMILO de 500\$ a 2302.00 en 3er mar'.

+	Plazo	Vence	Cod	M	Monto	Precio	Precio	Monto	M	Cod
	0/49	06-Ago-2007	●		500	2303.30				
	2M	16-Ago-2007								


Por lo tanto la postura ingresada por de BCL es vista en rojo por ALN

The screenshot shows the 'Factores de riesgo por plazo' application window. It has a title bar with the text 'Factores de riesgo por plazo' and a button labeled 'Aumentar'. Below the title bar is a table with columns for 'Rango de plazo', 'Factor', and 'Aceptación'. The table lists four risk ranges: '1 - 7 días' (Factor: 100.00, Aceptación: Automático), '15 - 30 días' (Factor: 50.00, Aceptación: Automático), '31 - 45 días' (Factor: 30.00, Aceptación: Automático), and '46 - 60 días' (Factor: No negociar, Aceptación: No negociar). The '46 - 60 días' row is highlighted in blue.

Rango de plazo	Factor	Aceptación
1 - 7 días	100.00	Automático
15 - 30 días	50.00	Automático
31 - 45 días	30.00	Automático
46 - 60 días	No negociar	No negociar

## Modificación de Posturas

Para modificar una **Demanda**, se debe ubicar en el plazo y sobre la postura presionar el botón

**Modificar Demanda**  de la barra de botones del mercado ó la tecla **F7**.



**Modificar orden postura demanda**

**Dólar Forward**

Precio Spot : 2300.00

Plazo :  Libre 19

Vencimiento : Lunes 06-Ago-2007

Puntos Forward : 3.30

Precio Forward : 2303.30


Monto : 500 m

Total : [seleccionado]

Método : COMPENSACION

Aceptar Cancelar

Para modificar una **Oferta**, se debe ubicar en el plazo y sobre la postura presionar el botón

**Modificar Oferta**  de la barra de botones del mercado o la tecla **F8**.



**Modificar orden postura oferta**

**Dólar Forward**

Precio Spot : 2310.00

Plazo :  Libre 3M

Vencimiento : Martes 18-Sep-2007

Puntos Forward : 2.50

Precio Forward : 2312.50

Monto : 700 m

Total : [seleccionado]

Método : COMPENSACION

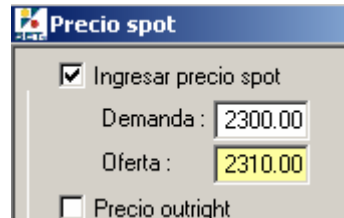
Aceptar Cancelar

Estas opciones retirarán momentáneamente la postura del mercado, y luego de modificar el precio o puntos, monto, plazo, total y método, al presionar Aceptar, la presentará en la tabla de posturas.

Además de la opción de modificar posturas, indicada anteriormente, el sistema provee la Barra de Modificación rápida, la misma que se encuentra en la parte superior de la ventana del mercado Forward.



Esta barra se activa únicamente cuando el precio Spot es ingresado por el usuario, es decir con las opciones:



***Nunca se activa con la opción Mi precio mercado Spot.***


Esta opción permite modificar la postura sin necesidad de retirarla momentáneamente, pero sólo se puede modificar el precio más no el monto ni las características de la misma.

En este ejemplo, la postura original de 2305.00, al elegir en el combo box el numero 1, incrementa de 0.01 en 0.01 el precio de la postura hasta llegar 0.05, en el campo Mío, se puede observar el nuevo valor que va a tener la postura, si se está de acuerdo, al presionar el botón OK, la postura se modificará.




## Retiro de Posturas

Para retirar la mejor **Demanda** que un usuario tenga en un plazo, se debe presionar el botón


**Retirar Demanda**  de la barra de botones del mercado o la tecla **F9**.

Para retirar la mejor **Oferta** que un usuario tenga en un plazo, se debe presionar el botón **Retirar**

**Oferta**  de la barra de botones del mercado o la tecla **F10**.

Si se desea retirar una demanda u oferta que no sea la mejor del usuario, se debe ubicar sobre la postura y con clic derecho elegir la opción **Retirar**.




Con el botón "**Retirar todas las posturas de mi sucursal**"  el Usuario puede retirar todas las posturas ingresadas por el y por otros usuarios que pertenezcan a la misma sucursal.

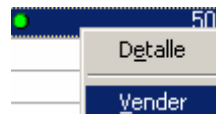
## Transacciones

Como se ha explicado antes, la posibilidad de realizar transacciones en el mercado, está limitada a tener cupo bilateral y que se hayan creado los Factores de riesgo de los plazos.

La forma de negociar compras y/o ventas es igual, por lo que solo se explica el proceso de ventas, es decir tomar demandas.

Para tomar una mejor postura de un plazo, se debe ubicar en el plazo y utilizar el botón de **Vender**  de la barra de botones del mercado o la tecla **F3**.

Si se desea negociar una postura que no sea la mejor, se debe ubicar sobre la postura y con clic derecho elegir la opción Vender. (Para las ofertas elegir Comprar).



En cualquiera de los casos expuestos, antes de ejecutarse la transacción, se presenta la ventana de confirmación. Al presionar aceptar la transacción ha sido ejecutada.

**Venta**  
**Dólar Forward**

Plazo : 1M      Vence : Miércoles 18-Jul-2007

Precio : 2306.00

Monto : 500

Total : [dropdown]

Aceptar      Cancelar

Cuando las transacciones se realizan satisfactoriamente, se registran en la ventana de Precios/Montos transados y en la bitácora, revelando quienes son las contrapartes con las que se ha negociado.

Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Plazo	Vence	Cod.	A	R
10:01:15	CAMILO	Venta	2302.00	500	0/1	19/06/2007	ALNB	A	
10:05:23	CAMILO	Venta	2303.00	1000	0/15	03/07/2007	ALNB	A	
11:48:51	CAMILO	Venta	2302.00	500	3er mar	19/06/2007	ALNB	A	
13:42:00	CAMILO	Venta	2306.00	500	1M	18/07/2007	ALNB	A	
<b>Total compras sucursal:</b>									
<b>Total ventas sucursal:</b>				2'500,000	2303.20				




## Visualización de Transacciones

Todas las transacciones que se realicen en el mercado, se almacenan en el Blotter o ventana de Precios/Montos de Transacciones Propias. Para acceder a esta ventana se debe presionar el botón

“Precios/Montos de transacciones propias”  de la barra de botones del mercado.

Esto presenta la ventana de transacciones que se explica a continuación:



The screenshot shows a window titled "Dólar Forward - Transacciones" with a table of transaction data. The table has columns for Hora, Usuario, C/V, Precio, Monto, Plazo, Vence, Cod, and A-R. Below the table, there are summary rows for "Total compras sucursal" and "Total ventas sucursal".

Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Plazo	Vence	Cod	A-R
10:01:15	CAMILO	Venta	2302.00	500	0/1	19/06/2007	ALNB	A
10:05:23	CAMILO	Venta	2303.00	1000	0/15	03/07/2007	ALNB	A
11:48:51	CAMILO	Venta	2302.00	500	3er mar	19/06/2007	ALNB	A
13:42:00	CAMILO	Venta	2306.00	500	1M	18/07/2007	ALNB	A
Total compras sucursal:								
Total ventas sucursal:				2'500,000	2303.20			

Callouts explaining the interface elements:

- Todas:** Visualiza todas las transacciones
- Compras:** Visualiza sólo las compras
- Ventas:** Visualiza sólo las ventas
- Usuario:** Visualiza las transacciones de un usuario activo
- Sucursal:** Visualiza las transacciones de todos los usuarios de la sucursal
- Hora:** Hora de la transacción
- Usuario:** Quien hizo la transacción
- C/V:** Lista de Compras y/o Ventas
- Precio:** Muestra el precio de cada transacción
- Total Ventas:** Suma de ventas y promedio de precios
- Total Compras:** Suma de compras y promedio de precios
- Monto:** Cantidad a negociar
- Plazo:** Plazo de vencimiento.
- R:** Indica si fue un registro
- A:** Indica si fue agresor de la postura
- Cod.:** Código de contraparte
- Vence:** Fecha de vencimiento

## Operaciones sobre Transacciones

Sobre cada transacción se puede realizar varias acciones que influyen en el procesamiento de la transacción, algunas operaciones son libres de ejecutar por las partes involucradas y otras dependen de confirmación de la contraparte.

En cada transacción, con clic derecho sobre la transacción se tiene las siguientes opciones:

Detalle
Detalle completo
Instrucciones de Pago
Cambiar instrucciones de Pago
Completar información
Historia
Anular transacción
Imprimir papeleta

Donde;

**Detalle:** Muestra los datos básicos de la transacción.

Dólar Forward Detalle de transacción		
<b>Fecha:</b> 18/06/2007	<b>Código:</b> 011T8DHB7T	<b>Hora:</b> 15:05:01
Comprador	Sucursal	Persona
ALIANZA VALORES S.A	BOGOTA	Jose Manuel Quintero
Vendedor	Sucursal	Persona
BANCOLOMBIA	BOGOTA	Camilo Rodriguez
Tipo de cambio : 2310.00	Monto US\$ : 1'000,000.00	Monto Pesos : 2,310'000,000.00
Origen de transacción : Demanda aceptada por CAMILO	Plazo : 1M	
Comentario :		

**Detalle completo:** Muestra los datos generales de la transacción.

**Detalle de transacciones**

Instrumento : FRWD

Consecutivo :

Tipo de transacción : Compra

**Comprador :** ALIANZA VALORES S.A

Nit : 860.000.185-4 IMC :

Usuario : JOSEM

Sector :

Condición Tributaria :

Tipo inversionista :

**Vendedor :** BANCOLOMBIA

Nit : 890.903.938-8 IMC :

Usuario : CAMILO

Sector :

Condición Tributaria :

Tipo inversionista :

Puntos forward :

Tasa de contado : 2310.00

Tasa forward : 2310.00

Monto en dólares (m): 1'000,000.00

Plazo : 1M

Fecha vencimiento : Miércoles 18 Julio 2007

Modalidad cumplimiento : DF

**Instrucciones de Pago:** Muestra los datos de las cuentas donde se deben pagar las transacciones.

**Instrucciones Pago de transacción Compra - 011TD0W9ID**

Suc.	Moneda	Tipo	Forma de pago	Descripción	Dirección Swift	Fed Aba	Chips Id
ALNB	COP	Debitar	Transferencia				
ALNB	USD	Acreditar	Transferencia	Cuenta : 2000192001669 Banco : WACHOVIA BANK N.A Ciudad : NEW YORK	PNBPUS3NNYC	026005092	0509

**Cambiar instrucciones de Pago:** Permite modificar los datos de las cuentas de pago, por otras cuentas.

Compras - Instrucciones						
Acreditar USD						
Tipo	Forma de pago	Descripción	Dirección Swift	Fed Aba	Chips Id	
Acreditar	Transferencia	Cuenta : 2000192001669 Banco : WACHOVIA BANK N.A. Ciudad : NEW YORK	PNBPUS3NNYC	026005092	0509	
	Acreditar	Cuenta : 2000192001669 Banco : WACHOVIA BANK N.A. Ciudad : NEW YORK	PNBPUS3NNYC	026005092	0509	✓
Debitar COP						
Tipo	Forma de pago	Descripción	Dirección Swift	Fed Aba	Chips Id	
Debitar	Transferencia					
	Debitar	Transferencia				✓

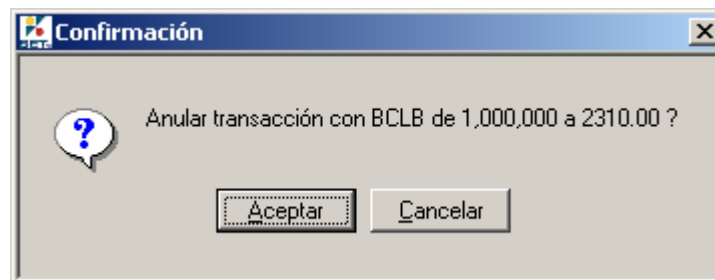
**Completar información:** Esta opción se habilita para las transacciones realizadas por instituciones que no sean Bancos, y se presentan en el blotter con ●. En la ventana siguiente se debe registrar los datos del comitente.

Detalle de transacción, asignación de comitentes y de contraparte			
Fecha :	18/06/2007	Nro. Liquidación :	5
		Hora :	15:05:01
Tipo de cambio :	2310.00	Monto US\$ :	1'000,000
		Monto \$ :	2,310'000,000
<b>- Comprador</b>			
Usuario :	ALNB	Jose Manuel Quintero	
Numeral cambiario :			
Forma de pago :	TRANSFERENCIA		
Tipo de operación :			
Clase Id :		Identificación :	
Nombre comitente :			
Porcentaje comisión :		Monto comisión (Pesos) :	
<b>- Vendedor</b>			
Usuario :	BCLB	Camilo Rodriguez	
Numeral cambiario :			
Forma de pago :			
Tipo de operación :			
		Comitentes	Aceptar
			Cancelar

**Historia:** Muestra el proceso que ha tenido la transacción, desde que usuario ingreso la postura, que acciones se hicieron sobre la postura, hasta la transacción.

Fecha	Hora	Usuario	Clase	D/D	Plazo	Precio	Monto T	Tr/To	Comentario
18/06/07	15:04:58	ALNB JOSEM	Ingreso	D	1M	2310.00	1000		
18/06/07	15:05:01	BCLB CAMILO	Aceptación	D	1M	2310.00	1000		
18/06/07	15:05:01	ALNB JOSEM	Transacción	D	1M	2310.00	1000	1000	
18/06/07	15:05:01	ALNB JOSEM	Retiro	D	1M	2310.00			

**Anular transacción:** Opción que permite eliminar transacciones realizadas. Al ejecutar se presenta la ventana de confirmación. Dicha anulación se puede realizar siempre y cuando no hayan transcurrido más de 10 minutos, de acuerdo al Reglamento del sistema "SETFX"



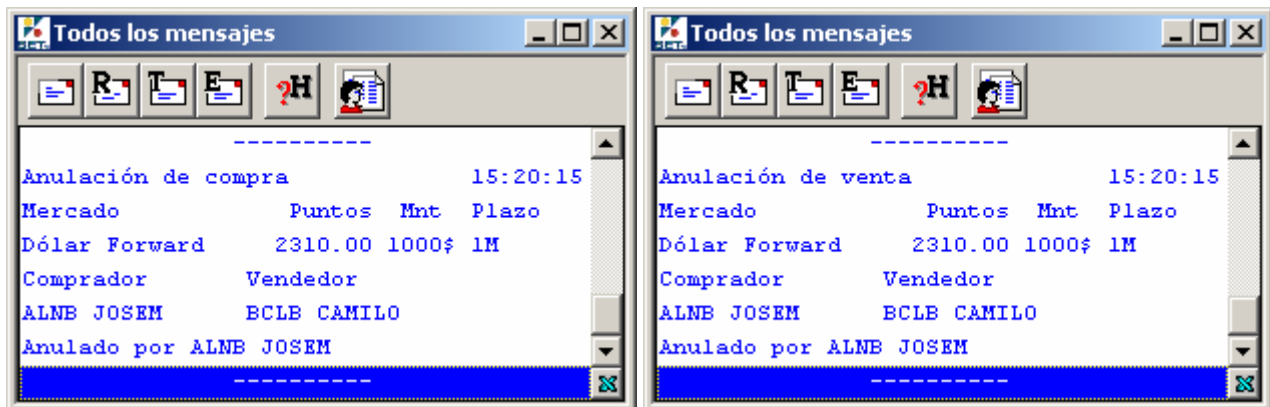
Al presionar Aceptar, se envía un mensaje de solicitud de Anulación, a la contraparte.



Con doble clic sobre el mensaje se presenta la ventana de solicitudes de anulación, y con clic derecho se debe elegir la opción Confirmar anulación.

Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Plazo	Vence	Comentario
15:05:01	ALIANZA	BOGOTA	2310.00	1000	1M	18/07/2007	Confirmar anulación

Con la anulación aceptada, se envían mensajes de anulación de la transacción a las dos partes involucradas.




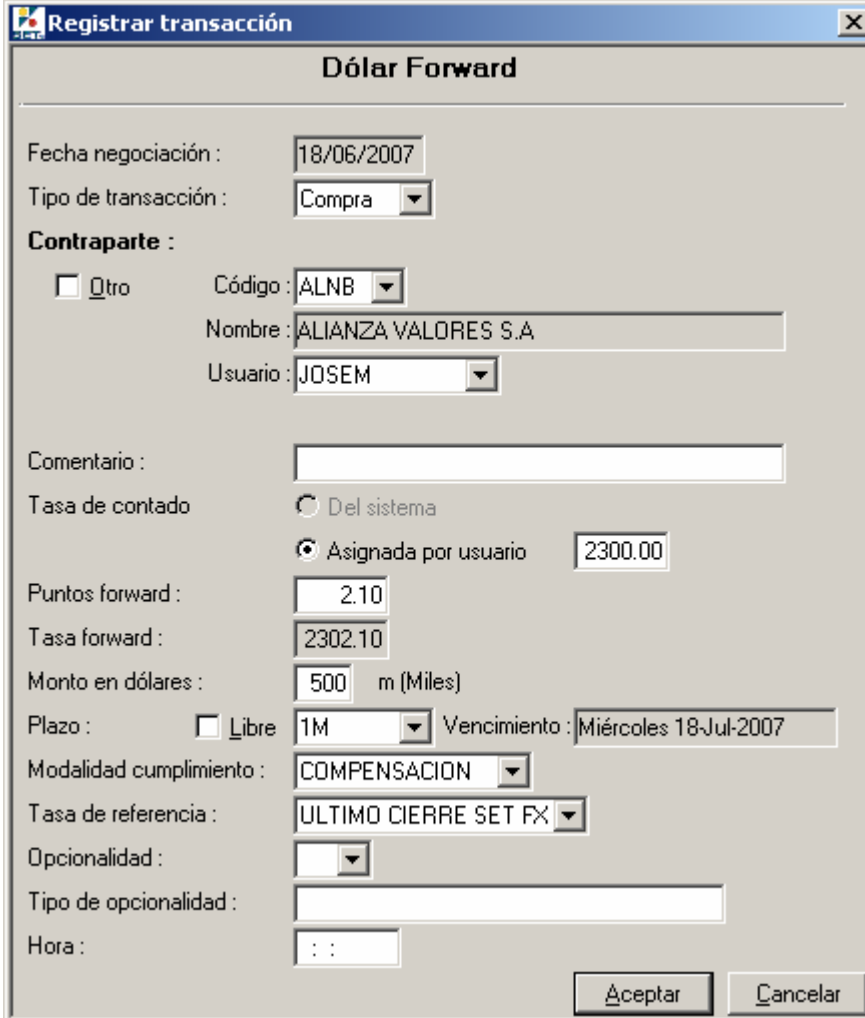
**Imprimir papeleta:** Envía a impresora el detalle de la transacción realizada.

## Transacciones Por Registro

El sistema permite ingresar operaciones que fueron realizadas fuera de tabla es decir fuera de la ventana de mercado, por ejemplo transacciones cerradas por teléfono.

Las transacciones registradas necesitan ser confirmadas por la contraparte, si esta es un usuario del sistema.

Para registrar una transacción, se presionar el botón “Registrar”  de la barra de botones del mercado lo que despliega la ventana de ingreso de datos del registro.



The screenshot shows a window titled "Registrar transacción" with a subtitle "Dólar Forward". The window contains the following fields and controls:

- Fecha negociación : 18/06/2007
- Tipo de transacción : Compra (dropdown)
- Contraparte :
  - Otro
  - Código : ALNB (dropdown)
  - Nombre : ALIANZA VALORES S.A (text box)
  - Usuario : JOSEM (dropdown)
- Comentario : (text box)
- Tasa de contado :
  - Del sistema
  - Asignada por usuario 2300.00 (text box)
- Puntos forward : 2.10 (text box)
- Tasa forward : 2302.10 (text box)
- Monto en dólares : 500 m (Miles) (text box)
- Plazo :  Libre 1M (dropdown) Vencimiento : Miércoles 18-Jul-2007 (text box)
- Modalidad cumplimiento : COMPENSACION (dropdown)
- Tasa de referencia : ULTIMO CIERRE SET FX (dropdown)
- Opcionalidad : (dropdown)
- Tipo de opcionalidad : (text box)
- Hora : : : (text box)

Buttons: Aceptar, Cancelar

Aquí se ponen los datos de la contraparte y que tipo de operación se desea registrar, con precio, monto, puntos forward, forma de cumplimiento.

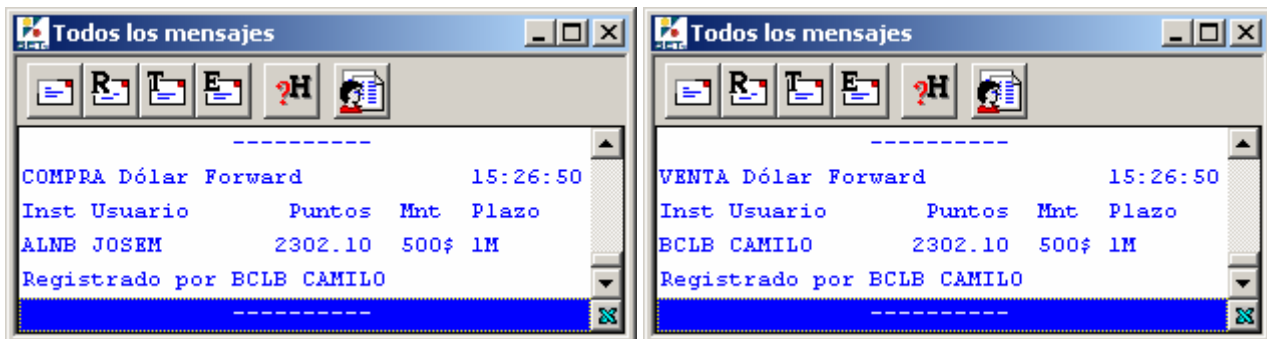
Al presionar Aceptar, se envía un mensaje de Solicitud de Confirmación de registro a la contraparte, donde se revela quien es el que desea realizar el registro.



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

Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Plazo	Vence	Comentario	R
15:26:50	COLOMBIA	BOGOTA	2302.10	500	1M	18/07/2007		R

Al confirmar el registro, se envía un mensaje a las partes involucradas advirtiendo que se realizó la transacción.



En el blotter de las contrapartes, se presenta la transacción con la letra R, que indica que fue un registro.

Dólar Forward - Transacciones									
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal									
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Plazo	Vence	Cod.	A	R
15:26:50	CAMILO	Compra	2302.10	500	1M	18/07/2007	ALNB		R
<b>Total compras sucursal:</b>				500,000	2302.10				
<b>Total ventas sucursal:</b>				2'500,000	2303.20				

Para este tipo de transacciones, se activan las mismas opciones de operaciones que para las que se realizan por tabla.