

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_SPOT_001
		Versión: 1.0
	Mercados Dólar Spot/Next Day/FIX	Página 0 de 55


Manual de Usuario

Mercados:
Dólar Spot
Dólar Next Day
Dólar Fix



Febrero 2011


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 1 de 55

INDICE

1. Objetivo	2
2. Ingreso al Módulo Dólar Spot	2
3. Ingreso al Módulo Dólar Spot	3
4. Ingreso al Módulo Dólar FIX	4
5. Manejo de cupos	4
6. Manejo de limites	7
7. Mercado Dólar Spot	12
7.1 Ventana de posturas (Demandas/Ofertas)	12
7.2 Configuración - Mercado Dólar Spot	13
8. Luces en posturas	14
9. Ingreso de posturas	16
10. Modificación de posturas	20
11. Retiro de posturas	23
12. Realizar Transacciones	23
13. Barridos Netos	25
13.1 Barridos con puntas en goteo	27
14. Opciones sobre transacciones realizadas	33
15. Opciones sobre transacciones realizadas	39
16. Transacciones de registro	42
17. Transacciones por Ordenes	49
18. Mercado Fix	52
18.1 Ventana de posturas (Demandas/Ofertas)	52


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 2 de 55

1. Objetivo

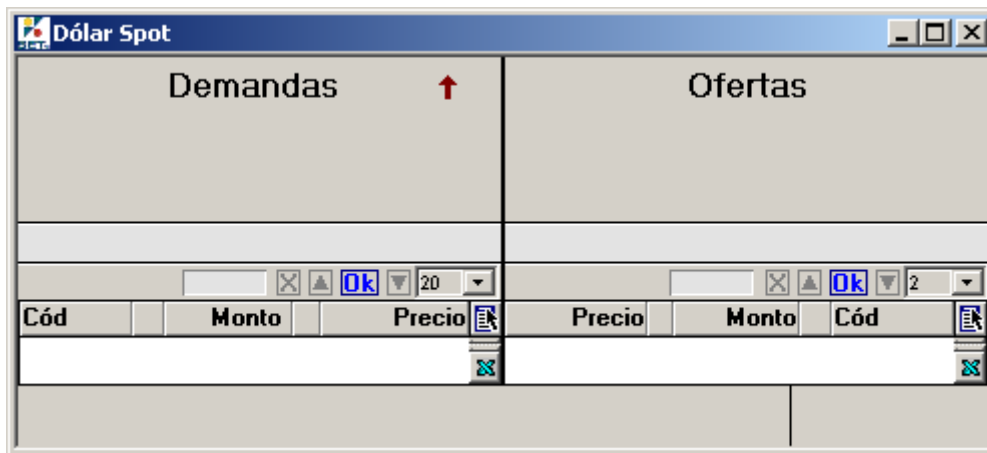
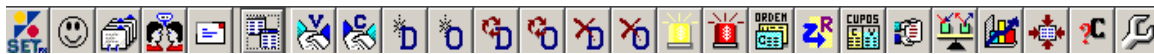
El presente manual tiene como objetivo explicar en detalle el funcionamiento del Mercado Dólar Spot, el mercado Next Day y el mercado FIX utilizando la funcionalidad de la Cámara de Compensación de Divisas (CCD) y operaciones realizadas antes de la apertura de mercado SPOT.

2. Ingreso al Módulo Dólar Spot


En los perfiles de usuario Transaccional (TR) y No transaccional con Chat (NPP), en la barra principal de Sistema SET-FX se encuentra el botón , el cual permite ingresar a los diferentes mercados activos del sistema. Se debe desplegar el menú DÓLAR y elegir la opción Dólar Spot:




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

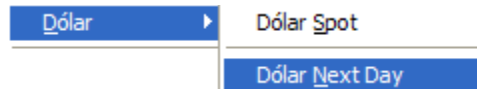


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

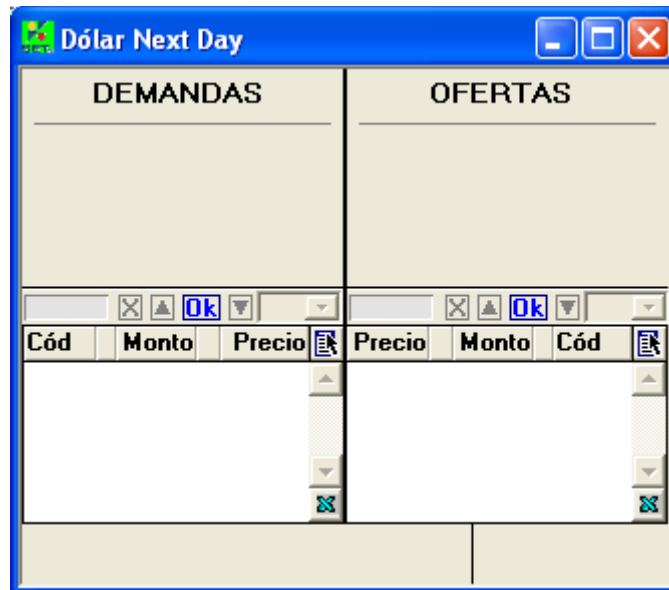
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 3 de 55

3. Ingreso al Módulo Dólar Spot


En los perfiles de usuario Transaccional (TR) y No transaccional con Chat (NPP), 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 Next Day:




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

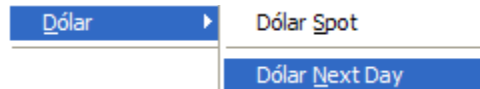


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 4 de 55

4. Ingreso al Módulo Dólar FIX

En los perfiles de usuario Transaccional (TR) y No transaccional con Chat (NPP), 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 FIX:



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



Dolar Fix						
Demanda			Oferta			
Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód	
26-Ene-2011			Hoy			
27-Ene-2011			1 Día			
28-Ene-2011			2 Días			
				Hoy		250 9'500

5. Manejo de cupos


5.1 Dólar Spot

Es importante tener en cuenta que el Mercado Dólar Spot con Cámara trabaja con dos tipos de cupos; los Cupos Bilaterales y los Cupos Cámara (Multilaterales).

Cupos Bilaterales: Son aquellos que cada entidad afiliada al sistema le abre a sus contrapartes para la compra y venta de divisas.

Cupos Multilaterales: Son los establecidos por las garantías puestas en la Cámara de compensación y liquidación de divisas CCD las cuales serán el equivalente al 6.5% del cupo neto que se desee utilizar durante la jornada. Este porcentaje estará sujeto a modificaciones dependiendo de la variación de la tasa durante la jornada de negociación.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 5 de 55

Es indispensable que el operador tenga cupos bilaterales con cada una de las entidades con que cerrará operaciones a través del sistema SET FX, independientemente si ha realizado la asignación de garantías en la CCD, al realizar la solicitud de calce una transacción el sistema hará la validación de los cupos bilaterales y luego de los cupos multilaterales:

- Si las contrapartes tienen cupos bilaterales y multilaterales suficientes, las ofertas y demandas serán visualizadas en color **VERDE**,
- Si las contrapartes tienen cupo Bilateral pero no multilateral, las ofertas y demandas de se verán de color **AMARILLO**
- Si no existe cupo Bilateral entre las contrapartes, independiente que exista cupo cámara, las ofertas y demandas se verán de color **ROJO**;

Nota: Este tema será tratado a fondo adelante

Para que las transacciones se compensen por Cámara, es necesario que **el Operador de la Cámara**, asigne a cada entidad participante el valor correspondiente en cupos según las garantías que hayan asignado para el día de negociación. La Cámara de divisas exige ingresar garantías por el 6.5% del monto total neto que la entidad pretende negociar durante la jornada de operación. Los cupos Cámara tienen la modalidad de CUPOS NETOS, es decir el valor por el que se disminuya en el las ofertas se aumenta en las demandas y viceversa.

NOTA: Se podrá realizar operaciones aun sin tener cupos asignados por la CCD dichas operaciones deberán ser cumplidas liquidadas entre las partes solamente con base en los Cupos Bilaterales, con la opción de luego durante horario de mercado realizar su cambio a compensación por CCD.


5.2 Afectacion de cupos Multilaterales por operaciones provenientes del mercado Next day T+1 y T+2

Existen operaciones que provienen del mercado Next Day, bien sea T+1 o T+2, estas operaciones el día de su cumplimiento podrán ser enviadas a compensar por Camara de Divisas, afectando el campo multilateral o cámara de ese día:

Para las operaciones que generen utilidad se descontara el valor nominal de la operación y se incrementara el cupo tanto para venta como para compra en el valor de la utilidad dividido en 0.065, siempre y cuando este incremento no supere el valor del monto asignado como limite en cupo:

Afectación en cupo multilateral = $\frac{+valor\ utilidad}{0.065} - Valor\ nominal\ de\ la\ operación$	
Formula:	0.065

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 6 de 55



Para las operaciones que generen pérdida, se descontara el valor nominal de la operación en ventas o en compras según corresponda y también el valor de la pérdida dividido en 0.065 tanto en compras como en ventas:

Afectación en cupo multilateral = $\frac{-\text{valor pérdida}}{\text{valor nominal de la operación}}$	
Formula:	0.065

Los cupos bilaterales spot serán afectados por el valor nominal de la operación en el día de su cumplimiento.

Cuando el **Operador Cámara** ha asignado cupo a una entidad (cupo multilateral), esta podrá ver esos valores asignados en la ventana del mercado SPOT en la columna de Demanda (**Azul**) (cupo para venta) y en la columna Oferta (**Rojo**) (Cupo para compra).


Demandas	Ofertas
4'530	4'960

Con el botón , accederá a la ventana de los Cupos Bilaterales, desde esta ventana podrá visualizar los cupos cámara haciendo clic en el botón , se abre una nueva ventana con el detalle del cupo cámara asignado y consumido hasta el momento.

Dólar Spot - Cupos con CCD		
Por neteo.		
	Compra	Venta
Límite :	5'000,000	5'000,000
Transacciones :	1'030,000	1'000,000
Cupo máximo :	4'960,000	4'530,000
Cupo :	4'960,000	4'530,000

NOTA: Cada vez que se realice una transacción, independiente si es o no compensada por Cámara, siempre se verá afectado el Cupo Bilateral por el valor nominal de la operación.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 7 de 55

5.3 Dólar Next Day

Cupos Bilaterales: Este mercado nos ofrece la posibilidad de compartir los cupos con el mercado SPOT o asignarlos de manera independiente en cada uno de los mercados y a cada una de las entidades con las que se realizarán transacciones durante la jornada de mercado.

Cupos Multilaterales: Para este mercado no aplica la asignación de cupos multilaterales ya que la compensación de las operaciones realizadas en el se hará el día del cumplimiento y en ese momento hará la respectiva afectación de los cupos multilaterales en el mercado Spot.

La asignación de cupos bilaterales se realiza en la misma forma que los cupos bilaterales en el mercado spot, o bien, es posible que el mercado Next Day comparta cupos con el mercado Spot


5.4 Dólar Fix

Este mercado permite negociar o registrar montos a una tasa Fix o a la tasa promedio de cierre del día, el cual es fijado a la 1.10 pm. Al momento de la negociación se define el monto de la compra o venta, y el día de la liquidación, luego al cierre se asigna que el precio de la transacción será el precio Promedio del mercado Dólar Spot.


Cupos Bilaterales: Este mercado para operaciones T+0, harán la afectación de cupos en el mercado Dólar Spot, y para operaciones T+1 y T+2 realizarán la afectación de cupos en el mercado Dólar Next Day. El día del vencimiento de estas operaciones T+1 y T+2, se liberará el cupo Next Day y se consume el cupo Dólar Spot.

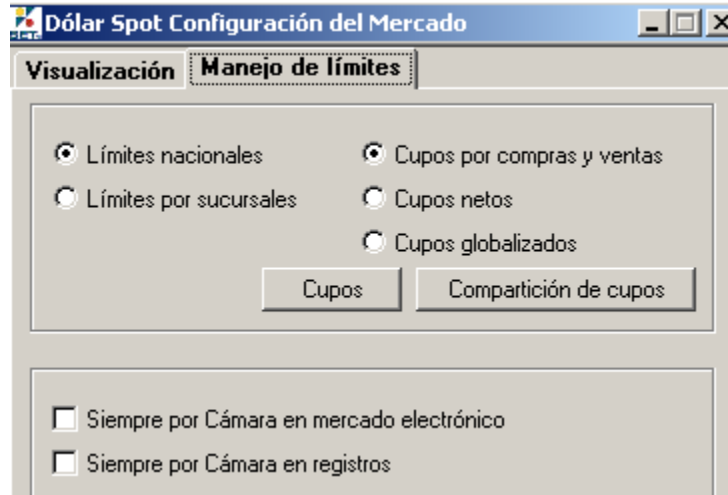
6. Manejo de limites

El aplicativo brinda la posibilidad de hacer obligatorio que todas las operaciones se compensen a través de la CCD. Esto permite que entidades que tengan cupos en la cámara, y que no obliguen a operar a través de esta, puedan cerrar operaciones con otras entidades que no tienen garantías en la CCD. En este caso solo se afectarán los cupos bilaterales de las entidades.

El Mercado Spot puede manejar diversas opciones para administrar Límites y Cupos. Para acceder a esta opción se debe utilizar el botón  Configuración del mercado, de la barra de herramientas de SET FX. Las opciones por omisión son Límites Nacionales y Cupos por Compras y Ventas.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 8 de 55



Donde;

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

Configuración : Límites nacionales				
Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA				
CALI				
MEDELLIN				
Nacional	7'000,000		7'000,000	7'000,000


Límites por Sucursales: Indica que los cupos y límites se controlarán por cada sucursal, es decir que a cada una se le ingresará su propio monto a negociar.

Configuración : Límites por sucursales				
Sucursal	Límite	Transacciones	Cupo Máximo	Cupo
BOGOTA	1'000,000		1'000,000	1'000,000
CALI	2'000,000		2'000,000	2'000,000
MEDELLIN	3'000,000		3'000,000	3'000,000
Nacional	6'000,000		6'000,000	6'000,000

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

Cupos por Compras y Ventas: Permite ingresar un monto de cupo para compras y uno para ventas de manera independiente. De acuerdo a la transacción que se realice (Compra o Venta), se afectará la columna respectiva.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 9 de 55

Configuración : Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cod.	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BCL	BANCOLOMBIA	5'000,000	4'700,000	8'000,000	7'750,000

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

Configuración : Límites nacionales
Por neteo.

Cod.	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BCL	BANCOLOMBIA	5'000,000	5'250,000	8'000,000	7'750,000

Cupos Globalizados: Permite ingresar un único monto general de cupos. Sin importar que tipo de transacción sea realizada (Compra o Venta), el cupo se afectará por el valor nominal de esta.

Configuración : Límites nacionales
Globalizados.

Cod.	Institución	Límite	Cupo
BCL	BANCOLOMBIA	5'000,000	4'750,000

- Si los Cupos son Nacionales, cuando dos usuarios de diferentes sucursales hacen una transacción, se reduce por cada uno el monto negociado, es decir, si se negocio USD 250.000 cada uno, se debitará USD 500.000 del cupo bilateral.
- Se debe tener en cuenta que cualquier cambio de cupos BILATERALES solo es posible realizarlo fuera del horario de mercado.
- Los cupos CAMARA podrán ser ajustados en horario de mercado siempre de manera incremental con relación a la asignación de garantías. La Cámara de Compensación y Liquidación de Divisas es la única que puede modificar dichos cupos y se hará en referencia a las garantías que se asignen.

Uso compartido de Cupos: Permite que dos o más mercados compartan los montos de cupos entre ellos, de esta manera cuando se hace una transacción en cualquiera de los mercados involucrados, se afectará el cupo para los mercados que lo estén usando. Para compartir cupos entre mercados, es necesario que los dos mercados tengan la misma configuración, de lo contrario se presenta el siguiente mensaje de error.

Estos mercados tienen formas diferentes de manejar limites/cupos


Datos para compartir cupos

Mercado :

Usa cupos de :

Factor de conversión :

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 10 de 55

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

Configuración : Límites nacionales
Para compras y ventas.

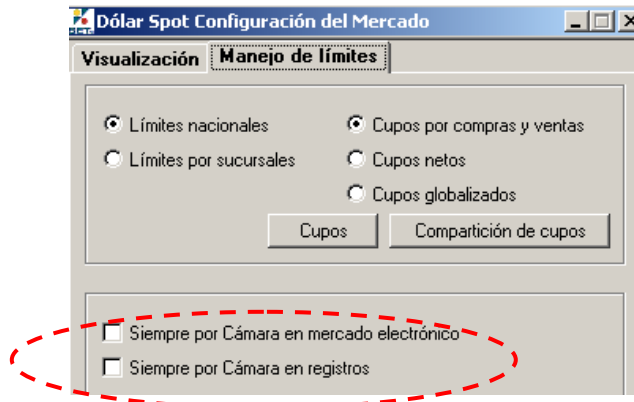
Cod.	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BCL	BANCOLOMBIA	5'000,000	5'000,000	8'000,000	8'000,000

Configuración : Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cod.	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
BCL	BANCOLOMBIA	5'000,000	5'000,000	8'000,000	8'000,000

Comparte con : Dólar Spot

- Si una entidad posee garantías en la CCD, aparecerán dos opciones en la configuración de los cupos:




- **Siempre por Cámara en mercado electrónico:** Al seleccionar esta opción, se indica al sistema que todas las operaciones por tabla que se realicen deben ser compensadas por CCD, y que no acepta posturas de entidades que no tengan cupo Cámara, por lo tanto esas posturas serán mostradas en color rojo; con esta opción seleccionada solo se verán posturas en verde; correspondientes a entidades con cupo multilateral y bilateral simultáneamente. Y las puntas se verán de color rojo cuando el postulante no tiene cupo cámara aun cuando se tenga cupo bilateral.
- Es posible obligar que todas las operaciones con entidades específicas sean compensadas a cámara de Divisas, para ello dentro de la ventana de Límites/Cupos se debe seleccionar sobre cada institución la opción con clic derecho "Poner SpC" (Siempre por cámara):

Dólar Spot - BANCOLOMBIA - Límites/Cupos

Configuración : Límites nacionales
Globalizados.


Cód.	Institución	SpC	Límite	Cupo
DVN	BANCO DAVIVIENDA		982'328,482	982'328,482

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 11 de 55

Cód	Institución	SpC
DVN	BANCO DAVIVIENDA	
FEN	FINANCIERA ENERGETICA NACIONAL	Poner SpC

Confirmación


 Desea que todas las transacciones con BANCO DAVIVIENDA sean hechas por Cámara ?

Dólar Spot - BANCOLOMBIA - Límites/Cupos				
Configuración : Límites nacionales Globalizados.				
Cód	Institución	SpC	Límite	Cupo
DVN	BANCO DAVIVIENDA	S	982'328,482	982'328,482

- **Siempre por Cámara en registros:** Tiene la misma estructura de funcionamiento que “Siempre por Cámara en mercado electrónico” ahora aplicado en las operaciones de tipo REGISTRO.
- Si no se selecciona ninguna de las dos opciones la entidad podrá cerrar operaciones de ambas formas, compensando por CCD y de la manera tradicional, en esta opción el sistema le dará prioridad a la compensación por CCD, siempre y cuando las contrapartes que intervienen en la operación tengan cupo multilateral suficiente.

NOTA: Siempre que las contrapartes que intervienen en el cierre de una transacción tengan cupos multilaterales suficientes, el sistema dará prioridad al calce de la operación por compensación en Cámara de Divisas

- **Control de Cupos para registros**

En la configuración del mercado existe otra “Control de cupos negativos en registros” la cual permite controlar el consumo de cupos cuando se realizan registros,

Control de cupos en registro :

No avisar si se hace negativo

Advertir si se va a hacer negativo

No registrar si se hace negativo

Al habilitar esta opción, se habilitan tres opciones. Por omisión no está marcada ninguna opción, pero es posible que el usuario configure la opción que desea controlar:


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

7. Mercado Dólar Spot

A continuación se describe el uso del modulo para este mercado

7.1 Ventana de posturas (Demandas/Ofertras)

A continuación se describe la ventana principal del mercado SPOT y sus características:



Barra de Modificación Rápida: Permite modificar o retirar el precio de una postura ingresada, sin necesidad de retirarla. **No aplica en mercado next Day.**

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

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

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

Botón de compra/venta directa, permite operar el mejor precio y aparece cuando se tiene línea con la contraparte y el mejor precio no es el mío.

Luz Verde: Indica que se puede operar y compensar por Cámara, hay cupo bilateral y cupo camara.

Luz Roja: Indica que no se puede operar, pues no hay cupo bilateral o se exige que sea por camara y no hay cupo camara en el aceptante.

Cupos Cámara: Muestra el monto disponible para negociar por Cámara. Cupo Compra en **ROJO** y cupo Venta en **AZUL**.

Luz Amarilla: Indica que se puede operar sin compensación por cámara pues hay cupo bilateral pero no hay cupo camara.

Posturas con código en azul: Posturas propias.


Posturas con código en negro: Pertenecen a otro PU de la misma sucursal.

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

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

Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
●	300	2300.09			
●	250	2300.08			
●	300	2300.07			
●	250	2300.06			
●	300	2300.05			
●	250	2300.04			
ALNB	250	2300.03			
ALNB	250	2300.02			
ALNB	300	2300.01			
ALNB	250	2300.00			


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 13 de 55

Las posturas de otra sucursal de una institución, se identificaran con la ultima letra que indica la sucursal correspondiente, en el ejemplo adjunto se encuentra una postura de la sucursal Bancolombia Cali "BCLB" y vista desde la sucursal Bogotá es mostrada con la letra "C"

Cód	Monto	Precio	Cód	Monto	Precio
BCLC	250	1960.01	C	250	1960.01

7.2 Configuración - Mercado Dólar Spot

Esta ventana puede ser configurada de diversas formas, dependiendo de la necesidad del usuario, para esto se debe utilizar el botón  Configuración del mercado, de la barra de botones del mercado.

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

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


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

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

Posturas Parcial/Total: Se define si una postura se ingresa con aceptación Total y Parcial.

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

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

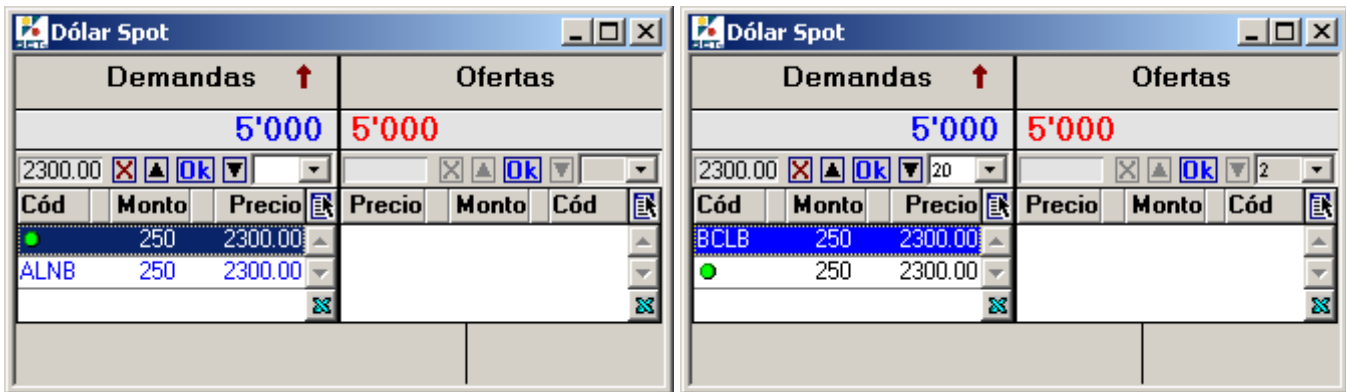
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 14 de 55

8. Luces en posturas

Como se vio anteriormente, hay dos tipos de cupos en el mercado, esto provoca que por cada postura ingresada, se pueda tener tres tipos de luces, a excepción del Mercado Next Day el cual no usan cupo cámara, siempre serán Luces verdes y rojas

Luces VERDES

- a) Postulante y Aceptante tienen cupo bilateral y cupo cámara suficiente para poder operar sobre esa postura. Esta operación será compensada a través de la CCD.



Demandas ↑			Ofertas		
5'000			5'000		
2300.00	X ▲ Ok ▼			X ▲ Ok ▼	
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
●	250	2300.00			
ALNB	250	2300.00			

Demandas ↑			Ofertas		
5'000			5'000		
2300.00	X ▲ Ok ▼	20		X ▲ Ok ▼	2
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
BCLB	250	2300.00			
●	250	2300.00			

Luces AMARILLAS

En este caso existen tres posibilidades:

- a) Postulante no tiene cupo cámara pero si bilateral con el aceptante. El aceptante tiene cupos bilaterales y puede o no tener cupos en cámara. Lo importante aquí es que el aceptante no obliga a compensar a través de la CCD, pues de lo contrario la luz aparecería roja.
- b) Aceptante no tiene cupo cámara pero si bilateral
- c) Postulante y Aceptante no tienen cupo cámara pero si bilateral

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011



DOCUMENTO

**Manual Usuario
Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day -
FIX**

Código: MO_SPOT_001

**Archivo: MA_TECSET1003
Versión: 1.0**

Página 15 de 55

Demandas ↑			Ofertas		
2300.00	×	▲	Ok	▼	
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
●	250	2300.00			
ALNB	250	2300.00			

Demandas ↑			Ofertas		
2300.00	×	▲	Ok	▼	20
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
BCLB	250	2300.00			2
●	250	2300.00			

Luces ROJAS


Tenemos 4 posibilidades:

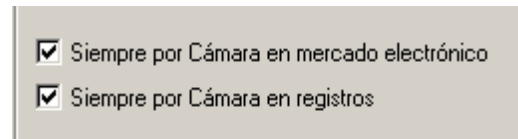
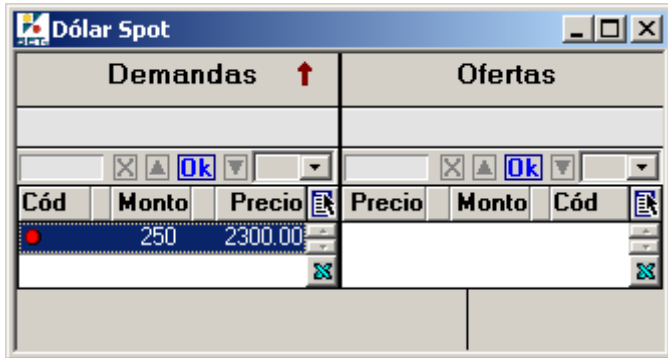
- a) Postulante no tiene cupo bilateral con el aceptante
- b) Aceptante no tiene cupo bilateral con el postulante
- c) El postulante y el aceptante tienen cupos bilaterales. El Postulante obliga a operar a través de la Cámara, pero el aceptante no tiene cupos Cámara
- d) El Aceptante obliga a operar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

Demandas ↑			Ofertas		
5'000			5'000		
2300.00	×	▲	Ok	▼	
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
●	250	2300.00			
ALNB	250	2300.00			

Demandas ↑			Ofertas		
5'000			5'000		
2300.00	×	▲	Ok	▼	20
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
BCLB	250	2300.00			2
●	250	2300.00			

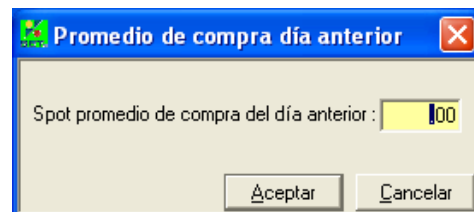
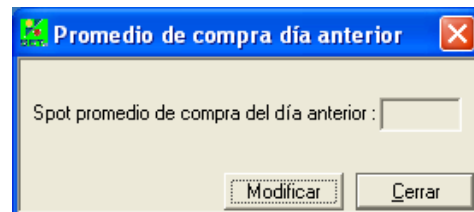
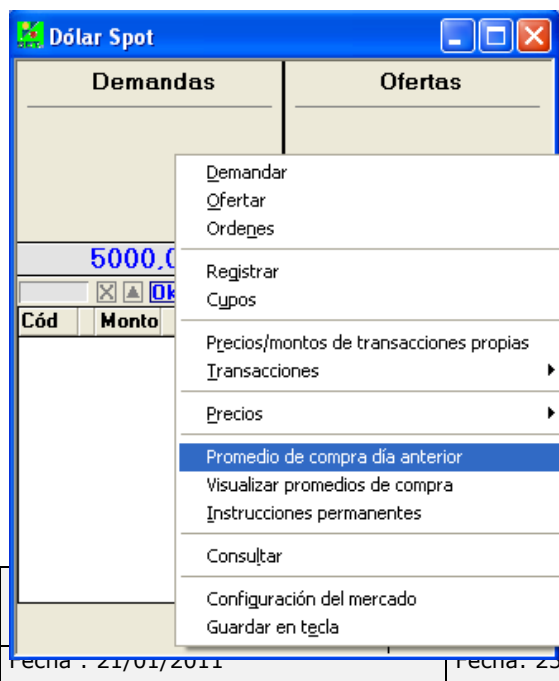
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011


	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 16 de 55



9. Ingreso de posturas

Al inicio del mercado se deberá ingresar el promedio de compra del día anterior para calcular el IVA generado por las operaciones realizadas durante la jornada de negociación. Esto se hace clic en "Promedio de compra del día anterior" y luego "modificar" para ingresar el nuevo promedio de compra y "aceptar"

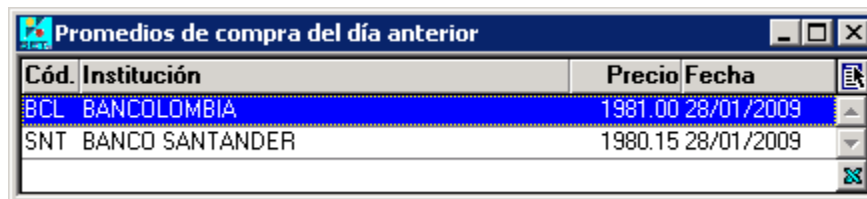


	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 17 de 55

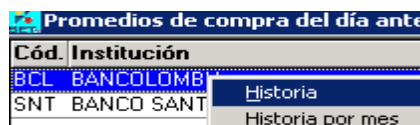
- Los usuarios podrán ver las diferentes TPCs registradas en días anteriores, no podrán ver TPCs de otros usuarios.



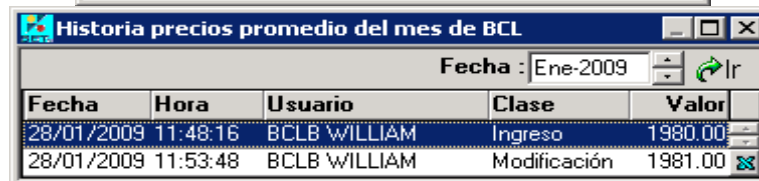
- Resultado en Azul es la institución local, con clic derecho se puede acceder a la historia. No es posible hacer cambios sobre la TPC de otra institución.




Cód.	Institución	Precio	Fecha
BCL	BANCOLOMBIA	1981.00	28/01/2009
SNT	BANCO SANTANDER	1980.15	28/01/2009




Hora	Usuario	Clase	Valor
11:48:16	BCLB WILLIAM	Ingreso	1980.00
11:53:48	BCLB WILLIAM	Modificación	1981.00



Fecha	Hora	Usuario	Clase	Valor
28/01/2009	11:48:16	BCLB WILLIAM	Ingreso	1980.00
28/01/2009	11:53:48	BCLB WILLIAM	Modificación	1981.00

- Para ingresar una **DEMANDA**, se debe presionar el botón **Demandar**  de la barra de botones del mercado, o la tecla **F5**. El monto máximo de la operación será de 10.000.000 de dólares.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011



Dólar Spot - Ingresar demanda

Goteo Alt-G Solo compensar por Cámara

Precio: **2300.00**

Monto: **10000** m

Total: [Dropdown]

Aceptar Cancelar



Dólar Spot

Demandas ↑

4'550

2300.00 [X] [▲] [Ok] [▼]

Cód	Monto	Precio
ALNB	250	2300.00

- Para ingresar una **OFERTA**, se debe presionar el botón



Ofertar

de la barra de botones del mercado, o la tecla **F6**.



Dólar Spot - Ingresar oferta

Goteo Alt-G Solo compensar por Cámara

Precio: **2310.00**

Monto: **10000** m

Total: [Dropdown] No puede ser mayor a 10000 m (Miles)

Aceptar Cancelar



Dólar Spot

Ofertas ↑


5'450

2310.00 [X] [▲] [Ok] [▼]

Precio	Monto	Cód
2310.00	250	T ALNB

- En todas las posturas el **Monto** esta dado en Miles y el monto mínimo de ingreso para una postura será de 250. M y máximo de 10.000 M.
- Las posturas con **T** indican que se deben negociar por el monto completo. Las que no tienen **T** permiten negociar por un monto menor al indicado en la postura, pero mayor o igual a 250 mil dólares es decir Parcial.
- Presionar **Aceptar** la postura se ingresará al mercado.
- Para ingresar una postura en **GOTEO** se debe seleccionar la opción "Goteo" la ventana para ingreso de postura ya sea Demanda u Oferta se modificara y permitirá el ingreso de el monto total y el monto de cada gota.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 19 de 55



- El campo “solo compensar por cámara” no podrá ser modificado por el perfil negociador. Dicho perfil debe ser definido por el administrador de riesgos y de cupos de la entidad.

Con las características anteriores, las posturas ingresadas son visualizadas por los usuarios contrapartes de la siguiente forma:


- a) Posturas en verde desde usuarios que tienen cupo bilateral y cupo cámara.



Demandas ↑			↑ Ofertas		
5'450			4'550		
Ok	20		Ok	2	
Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
250		2300.00	2310.00	250 T	
08:37:33 - Compra a ALNB JOSEM 250 a 2310.00			Monto: 1'550 UltPrecio: 2310.00		

- b) Posturas en amarillo desde usuarios que tienen cupo bilateral, pero no tienen cupo cámara. Algunas de las contrapartes también pueden tener cupos cámara pero no obligar a compensar a través de esta.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011


	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 20 de 55

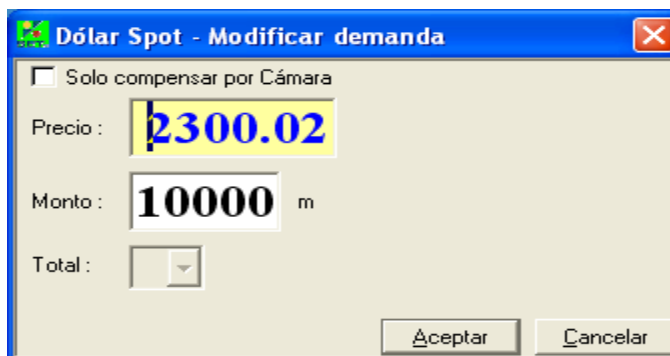



- c) Posturas en rojo desde usuarios que no tienen cupo bilateral. (Aquí es indiferente si tiene o no cupo cámara). También puede suceder que tengan cupos bilaterales, pero alguna de las entidades que sí tiene cupos cámara obliga a que sus transacciones se compensen a través de la Cámara y sus contrapartes no tienen cupos Cámara.




10. Modificación de posturas

- Para modificar una **Demanda**, se debe presionar el botón **Modificar Demanda**  de la barra de botones del mercado ó la tecla **F7**




- Para modificar una **Oferta**, se debe presionar el botón **Modificar Oferta**  de la barra de botones del mercado o la tecla **F8**.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 21 de 55




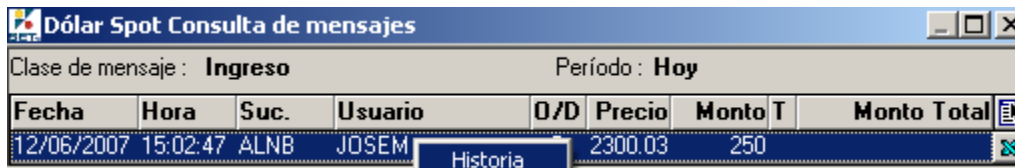
- Estas opciones retirarán momentáneamente la postura del mercado, y luego de modificar el precio, monto, o si se desea que se compense por Cámara, al presionar Aceptar, la presentará en la tabla de posturas.
- Sobre cada postura ingresada, se puede consultar la “historia” de la postura, donde se observa si esta fue modificada utilizando los métodos antes explicados.
- Para esto se debe presionar el botón  Consultas, y en la ventana que se presenta elegir Ingreso – Demandas/Ofertas en la fecha deseada.



En la postura elegida, presionar clic derecho y elegir HISTORIA.

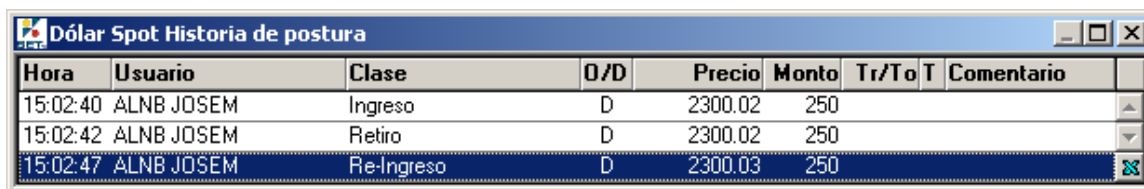
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 22 de 55



Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Precio	Monto T	Monto Total
12/06/2007	15:02:47	ALNB	JOSEM		2300.03	250	

Esto despliega una nueva ventana de historia de la postura, en donde se puede observar el ingreso de la postura, un retiro y un re-ingreso. Estas acciones indican que la postura fue modificada.



Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To T	Comentario
15:02:40	ALNB JOSEM	Ingreso	D	2300.02	250		
15:02:42	ALNB JOSEM	Retiro	D	2300.02	250		
15:02:47	ALNB JOSEM	Re-Ingreso	D	2300.03	250		

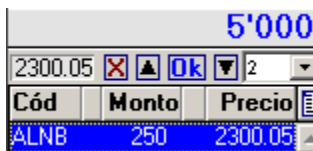
- Además, de la opción de modificar posturas indicada anteriormente, el sistema provee de la Barra de Modificación rápida, la misma que se encuentra en la ventana del mercado Spot.



2300.05	X	▲	OK	▼	2
Cód	Monto	Precio			
ALNB	250	2300.03			

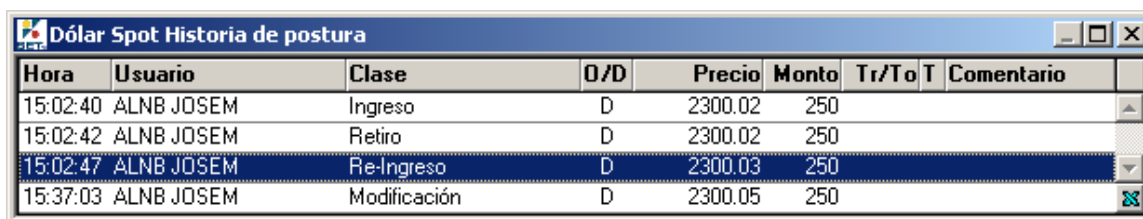
Esta barra actúa sobre la mejor de las posturas propias (está disponible tanto para demanda como para oferta) y permite modificar la postura sin necesidad de retirarla momentáneamente, pero sólo se puede modificar el precio. No se puede modificar el monto o las características de la misma.

En este ejemplo, la postura original era de 2300.03. Al elegir en el combo box el número 2, incrementa en .02 el precio de la postura. En la parte izquierda 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 modifica.




5'000					
2300.05	X	▲	OK	▼	2
Cód	Monto	Precio			
ALNB	250	2300.05			

Al consultar la historia, de la misma forma que se indico anteriormente, se puede observar que la postura que primero fue modificada con retiro momentáneo, ahora se modificó sin retiro.





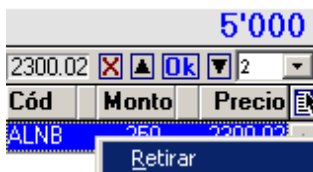
Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To T	Comentario
15:02:40	ALNB JOSEM	Ingreso	D	2300.02	250		
15:02:42	ALNB JOSEM	Retiro	D	2300.02	250		
15:02:47	ALNB JOSEM	Re-Ingreso	D	2300.03	250		
15:37:03	ALNB JOSEM	Modificación	D	2300.05	250		



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 23 de 55

11. Retiro de posturas

- Para retirar la mejor **Demanda** que un usuario tenga en el mercado, 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 el mercado, 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 mis posturas”** , el usuario activo, puede retirar las posturas únicamente ingresadas por él.
- 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.

De igual forma que en las modificaciones, se puede consultar la historia de una postura para saber cuando fue retirada.

Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To	T	Comentario
15:41:48	ALNB JOSEM	Ingreso	D	2300.03	250			
15:41:54	ALNB JOSEM	Retiro	D	2300.03	250			


12. Realizar Transacciones

Como se ha explicado antes, la posibilidad de realizar transacciones en el mercado, está limitada a tener cupo bilateral y cupo cámara o únicamente cupo bilateral.

La forma de negociar compras y/o ventas es igual. A continuación se explica el proceso de ventas, es decir la toma de demandas. Dicho procedimiento aplica también para las ofertas

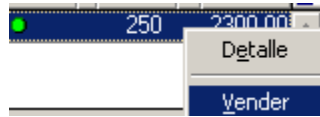
Se puede además utilizar el botón de **Vender**  de la barra de botones del

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 24 de 55

mercado o la tecla **F3** para poder **Vender** a la mejor postura del mercado.


Si se desea negociar una postura que no sea la mejor, se puede 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.



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 25 de 55


13. Barridos Netos

El perfil negociador en el mercado SPOT y Next Day podrá usar la funcionalidad “Barridos Netos” la cual permite ingresar el monto total que se desea vender o comprar.

<input checked="" type="checkbox"/> Solo compensar por Cámara			
	VENTA	COMPRA	
Monto Pedido	20'000	30'000	
<input type="button" value="Calcular"/>			
Monto Disponible	20'000	25'700	
Precio Máximo	2192.00	2192.50	Min
Precio Promedio	2189.14	2195.25	Promed
Precio Mínimo	2187.00	2197.50	Max
	<input type="button" value="VENDER"/>	<input type="button" value="COMPRAR"/>	
	<input type="button" value="Cancelar"/>		

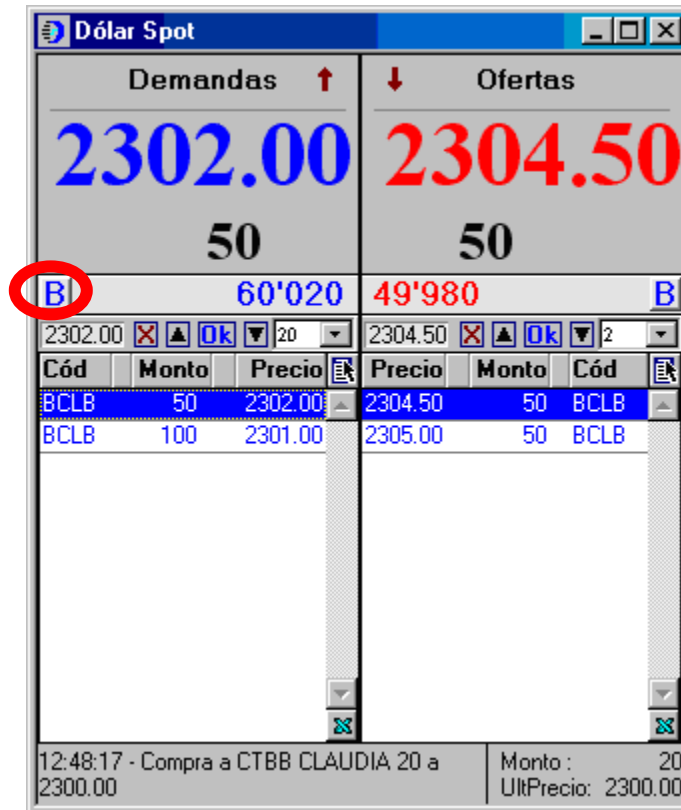
- El formato para ingresar el monto sería igual como en las ventanas actuales de compra/venta, en miles, con la posibilidad de ingresar montos hasta 99 millones.
- Una vez se ingrese el monto, el usuario debe hacer clic en el botón **<Calcular>** para realizar el cálculo, o teclear 'Enter'. El sistema inicialmente verifica los montos ingresados, para asegurar que sean mayores al monto mínimo configurado en el mercado para transacciones electrónicas (en este momento 250mil).
- El sistema calculará, tanto para la compra, como para la venta, el precio promedio disponible para los montos especificados, y adicionalmente el precio máximo y mínimo que se genera para el posible barrido. Este cálculo se haría sobre la profundidad de posturas en el mercado, y con base a los cupos bilaterales y cupos cámara, del postulante y del aceptante.
- Una vez que el sistema calcule y muestre los montos y precios disponibles en esta ventana, estos valores se recalculan cada 3 segundos, previendo cualquier posible cambio en las posturas en el mercado.
- El valor de si se compensa o no por cámara viene deshabilitado para el perfil negociador y sus transacciones se ejecutarán de acuerdo con lo que se haya definido previamente por el perfil Administrador de Cupos de SET-FX.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 26 de 55

- Para disponer de esta herramienta, la entidad debe tener configurado para su mercado Dólar Spot la opción 'Barridos Netos'. Esto se hace a través de una solicitud al Administrador del Sistema.

La ventana de Barridos Netos se muestra presionando el botón 'B', o con una opción clic derecho en cualquier postura sea esta demanda u oferta.



- Con base en los precios promedio, máximo y mínimo para una compra, y/o para una venta, el usuario podrá decidir concretar la operación, haciendo clic en la misma ventana para realizar el barrido de compra, o el barrido de venta. Al hacer clic en 'Comprar' o 'Vender', y ejecutar el barrido, la ventana se cierra igual como las ventanas de compras/ventas acumuladas existentes.
- En caso de que los montos especificados por el usuario no estén disponibles por completo, por no haber cupos suficientes en el mercado, la ventana 'Barridos netos' mostraría sólo los montos de compra y de venta que estarían disponibles.
- El cálculo y subsiguiente barrido podría involucrar la aceptación parcial de posturas, para llegar al monto especificado por el usuario. En caso que no sea posible llegar al monto

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

exacto especificado por el trader, el sistema mostrará el monto mayor pero más cercano posible.

13.1 Barridos con puntas en goteo

Si dentro de los límites del barrido neto se encuentra una postura en modalidad **GOTEO** el cálculo del barrido se hará únicamente con la punta que se muestra en la tabla, pero su afectación al realizar el barrido será al monto total de la postura en gota siempre y cuando se tenga el cupo suficiente para el calce de esta operación; de la siguiente manera.

Entidad Postulante

El postulante asignará para la punta; el monto de cada gota y el monto total de la postura

Dólar Spot

Demandas ↑ ↑ **Ofertas**

2001.78

400

B 8'300 11'700 B

Cód	Monto	Precio
OCCB	400	2001.78
OCCB	500	2001.75
OCCB	250	2001.65
OCCB	300	2001.00
OCCB	500	2000.95
OCCB	250	2000.00
OCCB	450	2000.00

16:40:19 - Compra a IBLB LIDA 250 a 2001.65 Monto : 8'250
UltPrecio: 2001.65

Dólar Spot - Detalle de postura

Clase de postura : Demanda

Institución : INTERBOLSA S.A.

Ciudad : BOGOTA

Usuario : IBLB LIDA

Nombre : Lida Maria Giraldo Zuluaga-Med

Precio : 2001.65

Gota : 250,000 Saldo : 2'000,000

Postura total : Solo compensar por Cámara

Hora de ingreso : 11:37:58

Dólar Spot

Demandas ↑ ↑ **Ofertas**

2001.78

Vender **400**

B 11'700 8'300 B


Cód	Monto	Precio
●	400	2001.78
●	500	2001.75
●	250	2001.65
●	300	2001.00
●	500	2000.95
●	250	2000.00
●	450	2000.00

16:40:19 - Venta a OCCB MARCELA 250 a 2001.65 Monto : 8'250
UltPrecio: 2001.65

Entidad Contraparte

La postura será visualizada como todas las demás en la tabla sin forma de diferenciar si ha sido colocada en mercado como postura con goteo.

Por: Director de es y Soporte	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 28 de 55

Dólar Spot - Detalle de postura

Clase de postura :

Precio :

Monto :

Postura total : Solo compensar por Cámara

Hora de ingreso :

Características de la postura.

Entidad Contraparte – Calculo Para Barrido Neto

Dólar Spot - Barridos Netos


Solo compensar por Cámara

	VENTA	COMPRA	
Monto Pedido	<input style="width: 100px;" type="text" value="4'000 m"/>	<input style="width: 100px;" type="text" value="4'000 m"/>	
	<input type="button" value="Calcular"/>		
Monto Disponible	2'650		
Precio Máximo	2001.78		Mínimo
Precio Promedio	2001.05		Promedio
Precio Mínimo	2000.00		Máximo
	<input type="button" value="VENDER"/>	<input type="button" value="COMPRAR"/>	

Monto por el cual se pide el cálculo del barrido.

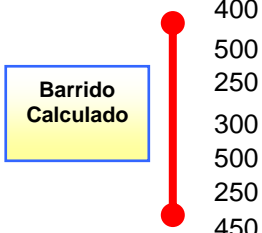
Monto real por el que se ejecutara el barrido

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 29 de 55

Al momento de ejecutar el barrido se afectaran las posturas de la tabla de la siguiente manera:

- Contando con que tenemos una punta en configuración de goteo por 2001.65 con un monto por gota de 250 hasta un valor total de 2.000.

MONTO DE LA POSTURA	PROFUNDIDAD DE LA GOTA	PRECIO	
	400	2001.78	
	500	2001.75	
	250	250 250 250 250 250 250 250	2001.65
	300		2001.00
	500		2000.95
	250		2000.00
450		2000.00	
Sumatoria del barrido		Precio promedio	
2650		2001.05	

Puntas restantes en tabla después de la ejecución del barrido



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

Marcar Posturas

Por último, se puede realizar transacciones sobre posturas que no sean consecutivas; es decir, eligiendo una a una. Para esto se debe ubicar sobre cada postura y con clic derecho elegir la opción Marcar.



- Con todas las posturas marcadas, se debe ubicar sobre cualquiera de estas y con clic derecho elegir Vender.



- Esto presenta la ventana de confirmación de negociar posturas marcadas, donde se muestra la suma de montos y el promedio ponderado de precios.



- En cualquiera de los casos mencionados antes, 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.

Dólar Spot - Transacciones									
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal									
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cod.	ND	A	R	C
06:58:16	JOSEM	Venta	2310.00	250	BCLB				C
07:14:25	JOSEM	Compra	2310.01	300	BCLB	A			C
08:28:56	JOSEM	Compra	2310.00	250	BCLB	A			C
08:32:26	JOSEM	Venta	2310.00	250	BCLB				C
08:34:46	JOSEM	Venta	2310.00	250	BCLB				C
Total compras sucursal:			1'300,000	2304.23					
Total ventas sucursal:			1'000,000	2310.00					
Datos en Cámara		Compras	Ventas	Netos					
Montos locales:		1'300,000	1'000,000	300,000					
Montos Cámara:									
Cupo en Cámara:		4'250,000	5'750,000						
Estado de transferencias: Compensación pendiente									

Todos los mensajes		
COMPRA Dólar Spot		17:02:59
Inst Usuario	Precio	Monto
BCLB CAMILO	2300.00	250

COMPRA Dólar Spot		17:02:59
Inst Usuario	Precio	Monto
BCLB CAMILO	2300.00	250

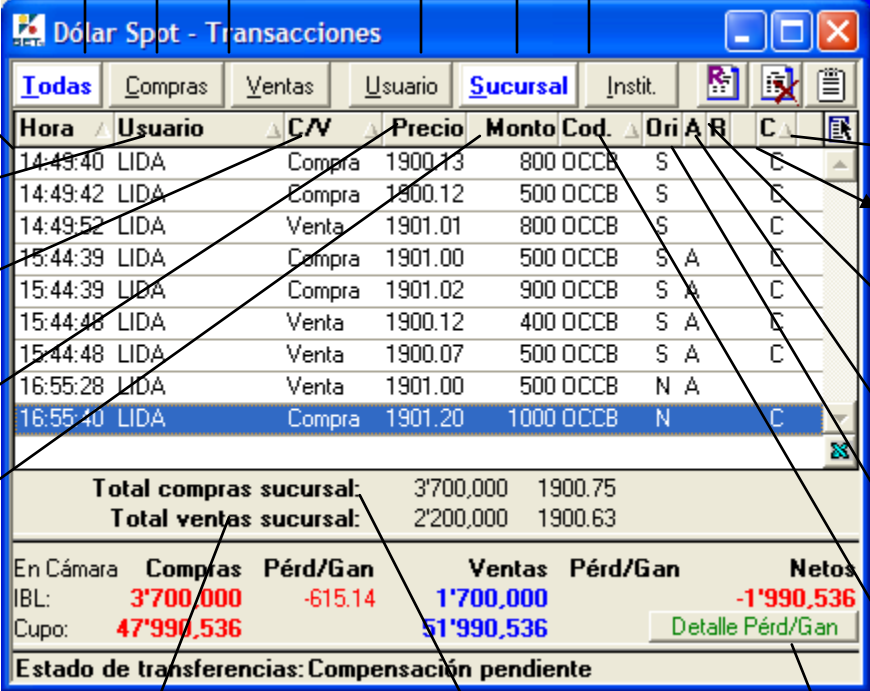
COMPRA Dólar Spot		17:02:59
Inst Usuario	Precio	Monto
BCLB CAMILO	2300.00	250

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

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:



Compras: Muestra tipo de operación seleccionada

Filtrando la procedencia de las operaciones.

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

Monto: Muestra el monto de cada transacción

C: Compensada por Cámara o No

●: Falta información de comitente

R: Indica si fue un registro

A: Indica si fue agresor de la postura

Indica el mercado origen de la transacción

Código entidad contraparte

Total Ventas: Suma de ventas y promedio de precios

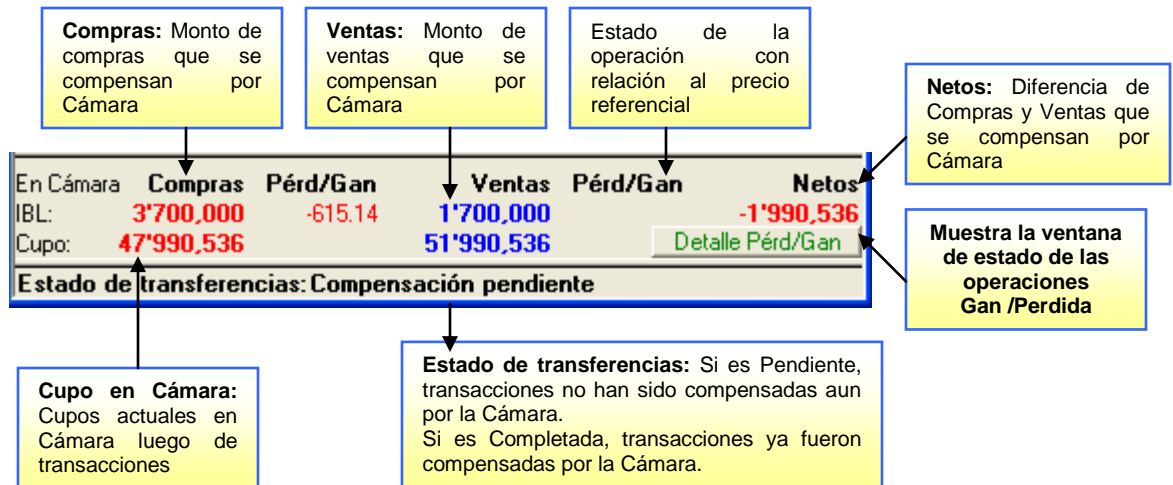
Total Compras: Suma de compras y promedio de precios

Abre Ventana de Pérdida o ganancia

Dólar Spot - Transacciones									
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.									
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cod.	Ori	A	R	C
14:49:40	LIDA	Compra	1900.13	800	OCCB	S			C
14:49:42	LIDA	Compra	1900.12	500	OCCB	S			C
14:49:52	LIDA	Venta	1901.01	800	OCCB	S			C
15:44:39	LIDA	Compra	1901.00	500	OCCB	S	A		C
15:44:39	LIDA	Compra	1901.02	900	OCCB	S	A		C
15:44:48	LIDA	Venta	1900.12	400	OCCB	S	A		C
15:44:48	LIDA	Venta	1900.07	500	OCCB	S	A		C
16:55:28	LIDA	Venta	1901.00	500	OCCB	N	A		C
16:55:40	LIDA	Compra	1901.20	1000	OCCB	N			C
Total compras sucursal:				3'700,000	1900.75				
Total ventas sucursal:				2'200,000	1900.63				
En Cámara		Compras	Pérd/Gan	Ventas		Pérd/Gan	Netos		
IBL:		3'700,000	-615.14	1'700,000			-1'990,536		
Cupo:		47'990,536		51'990,536			Detalle Pérd/Gan		
Estado de transferencias: Compensación pendiente									

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

En la parte inferior del Blotter se añade un apartado que afecta exclusivamente a las transacciones que se han compensado por Cámara.




Al hacer clic en el botón [Detalle Pérd/Gan](#) En la parte inferior del Blotter se visualizará una ventana, que muestra en detalle las operaciones de la entidad y el mercado del cual procede.


COMPRAS						VENTAS					
Hora / Usuario	Contraparte	Precio	Monto	Orí	Pérd/Gan	Hora / Usuario	Contraparte	Precio	M	Realizada & Proyectada	Realizada & Proyectada
14:49:40 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1900.13	800,000	S	C	14:49:52 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1901.01	800,000	C	C
14:49:42 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1900.12	500,000	S	C	15:44:48 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1900.12	400,000	S	C
15:44:39 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1901.00	500,000	S	C	15:44:48 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1900.07	500,000	S	C
15:44:39 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1901.02	900,000	S	C	16:55:28 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1901.00	500,000	N	254.99 ✓
16:55:40 IBLB LIDA	OCCB MARCELA	1901.20	1'000,000	N	-615.14 C						

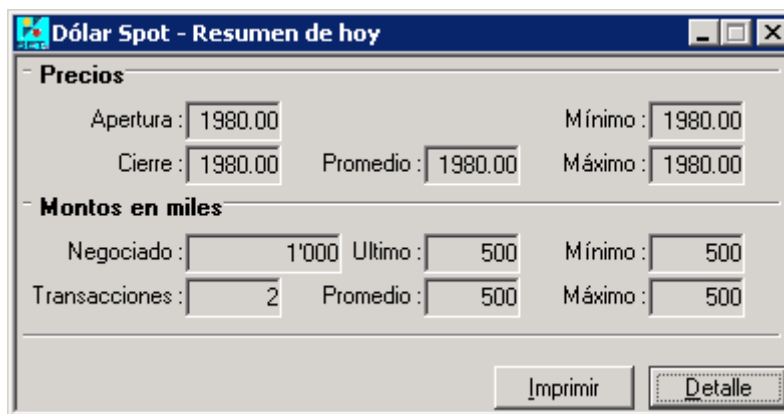
Total Compras Cámara :	3'700,000	-615.14	Total Ventas Cámara :	1'700,000	
Total No Spot No Cámara :			Total No Spot No Cámara :	500,000	254.99
Efecto en Cupos :	3'709,464	-9,464	Efecto en Cupos :	2'196,077	3,923

Estado de la Operación tanto para ventas como compras y calculo de las operaciones seleccionadas para proyección CCD y afectación proyectada en cupos.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 33 de 55

A esta ventana accedemos haciendo clic sobre el botón  y se desplegará la ventana que se muestra a continuación, en esta ventana se muestra la información estadística del mercado; especificando en la parte superior los precios y en la inferior los montos en miles.



Dólar Spot - Resumen de hoy					
Precios					
Apertura:	1980.00	Mínimo:	1980.00		
Cierre:	1980.00	Promedio:	1980.00	Máximo:	1980.00
Montos en miles					
Negociado:	1'000	Ultimo:	500	Mínimo:	500
Transacciones:	2	Promedio:	500	Máximo:	500
				Imprimir	Detalle

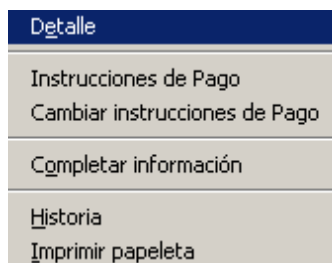
- Se incluye en estadísticas de Mercado SPOT, la parte spot que se genera cuando se realiza una operación SWAP.

14. Opciones sobre transacciones realizadas

Sobre cada transacción se puede realizar varias acciones que influyen el procesamiento de la misma. Algunas operaciones son libres de ejecutar por las partes involucradas y otras dependen de confirmación de la contraparte y/o por el Operador Cámara.


a) Transacciones Compensadas por Cámara:

En transacciones que son compensadas por Cámara (C), con clic derecho sobre la transacción se tiene las siguientes opciones:



Detalle
Instrucciones de Pago
Cambiar instrucciones de Pago
Completar información
Historia
Imprimir papeleta

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 34 de 55



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

Dólar Spot Detalle de transacción			
Fecha: 13/06/2007		Código: 011TD0W9ID	
		Hora: 10:56:15	
Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
ALIANZA VALORES S.A	BOGOTA	Jose Manuel Quintero	
Vendedor	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA	BOGOTA	Camilo Rodriguez	
Tipo de cambio :	2300.00	Monto US\$:	250,000.00
		IVA :	
Origen de transacción :	Demanda aceptada por CAMILO		Monto Pesos :
			575'000,000.00
Comentario :			


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

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

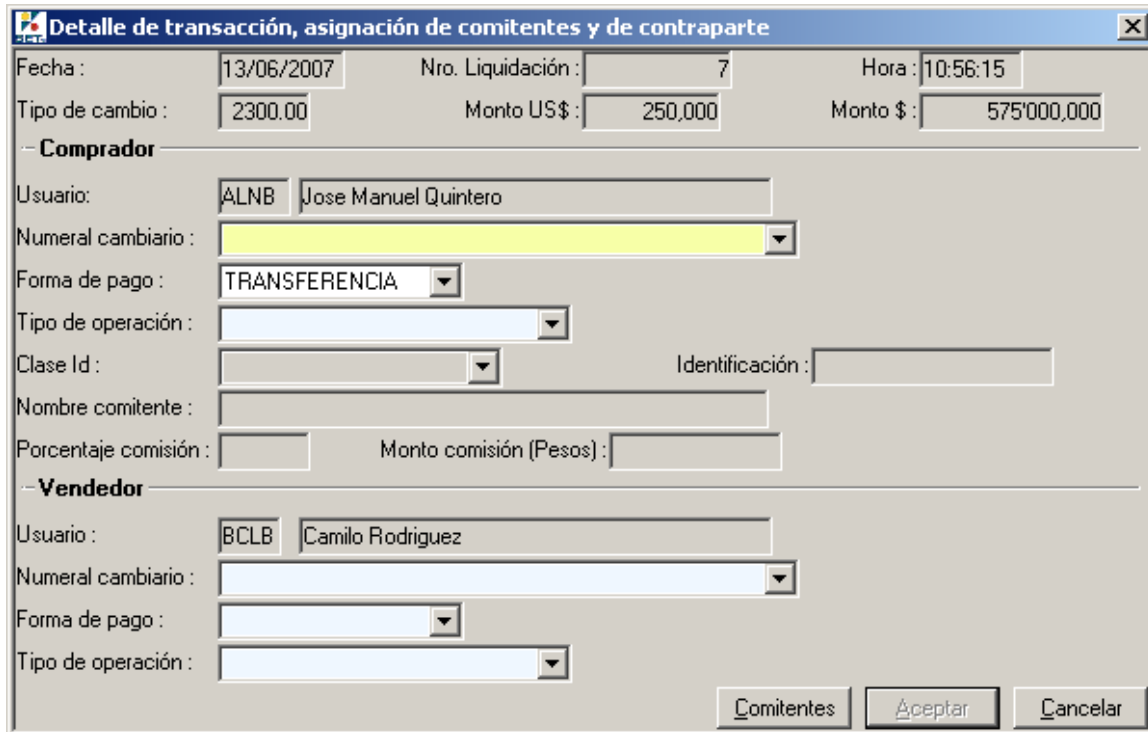
- **Cambiar instrucciones de Pago:** Permite modificar los datos de las cuentas de pago, por otras cuentas.

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	Transferencia	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					✓

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 35 de 55

- **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.



- **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.




Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To	T	Comentario
11:19:29	ALNB JOSEM	Ingreso	D	2300.00	250			
11:19:33	ALNB JOSEM	Modificación	D	2300.02	250			
11:19:35	ALNB JOSEM	Retiro	D	2300.02	250			
11:19:37	ALNB JOSEM	Re-Ingreso	D	2300.03	250			
11:07:14	BCLB CAMILO	Aceptación	D	2300.03	250			
11:19:42	ALNB JOSEM	Transacción	D	2300.03	250	250		
11:19:42	ALNB JOSEM	Retiro	D	2300.03				

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

b) Transacciones No Compensadas por Cámara:

En transacciones que NO son compensadas por Cámara, con clic derecho sobre la transacción se tiene las siguientes opciones:

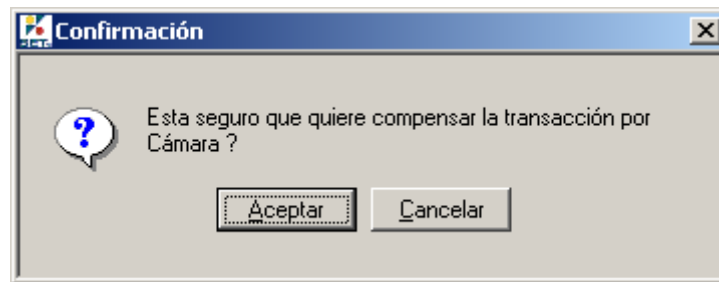
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 36 de 55

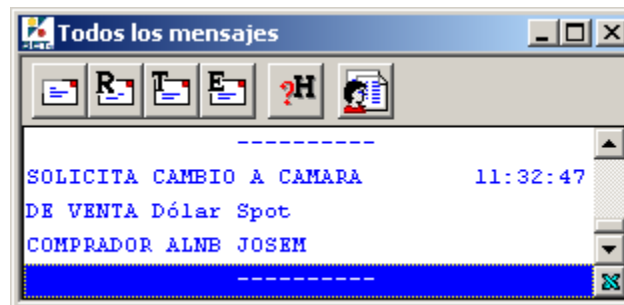
Detalle
Instrucciones de Pago Cambiar instrucciones de Pago
Completar información Compensar por Cámara
Historia Anular transacción Imprimir papeleta

Nótese que sólo se aumentan dos nuevas opciones, respecto a la explicación anterior.

- **Compensar por Cámara:** Esta opción permite que la entidad modifique la forma de pago de la transacción, con esta versión se da la posibilidad de compensar también las operaciones realizadas en mercados NEXT DAY a 1 y a 2 días. En este caso afectaría cupos Cámara. Al ejecutarse, se presenta la ventana de confirmación.




- Al Aceptar, se envía un mensaje de Solicitud de Cambio a Cámara, a la contraparte involucrada en la transacción; La contraparte debe aceptar dicha solicitud para que la operación sea compensada y liquidada a través de la CCD.



- En el blotter de las partes involucradas se presenta junto a la transacción una nueva luz.

Luz amarilla en el usuario que solicita el Cambio a Cámara

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

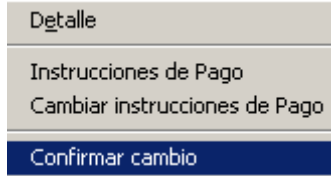
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 37 de 55

Hora	Usuario	L/V	Precio	Monto	Cod.	ND	A	H	C
11:23:41	JOSEM	Compra	2300.00	300	BCLB				

Luz roja en el usuario que ha recibido la solicitud de Cambio a Cámara

Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cod.	ND	A	R	C
11:23:41	CAMILO	Venta	2300.00	300	ALNB		A		

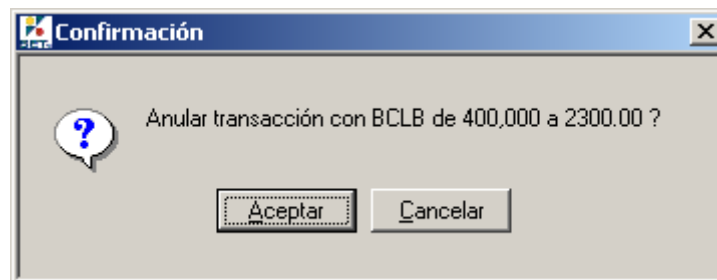
- Si no se confirma el cambio, la transacción no se liquidará a través de la CCD; en caso contrario, para confirmar el cambio, el usuario que recibió la solicitud, con clic derecho sobre la postura elige la opción Confirmar cambio.




- Es importante anotar que el sistema validará, al momento de ser aceptado ese cambio, que existan garantías suficientes de ambas contrapartes en la CCD, de lo contrario el cambio no se realizará.
- Con el cambio aceptado, el solicitante recibe un mensaje de confirmación de cambio.



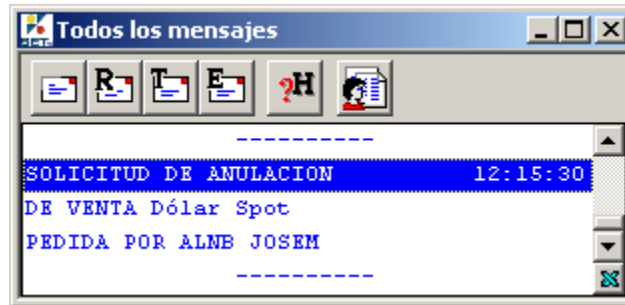
- **Anular transacción:** esta opción permite anular una operación, únicamente cuando esta no es compensada por Cámara. Al ejecutar dicha operación se presenta la ventana de confirmación.



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 38 de 55

- 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.


Dólar Spot Solicitudes de anulación de ventas							
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor	Monto IVA	Total ND Comen
12:19:33	ALIANZA	BOGOTA	2300.00	400	920'000,000		920'000,000

[Confirmar anulación](#)

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



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 39 de 55

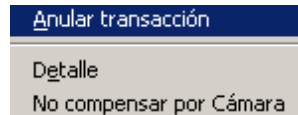
15. Opciones sobre transacciones realizadas

Para poder anular operaciones que fueron enviadas a la Cámara de Compensación y Liquidación de Divisas, la entidad interesada debe inicialmente pedir autorización directa a la Cámara, y esta le permitirá realizar dicha anulación siempre y cuando no hayan transcurrido los 10 minutos que especifican el reglamento de SETFX.

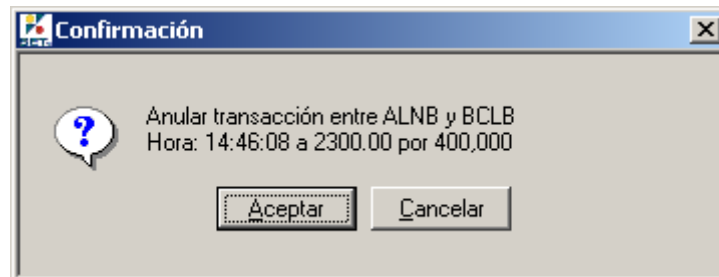
El Operador Cámara puede realizar las siguientes acciones sobre las transacciones:

a) Transacciones Compensadas por Cámara:

En transacciones que son compensadas por Cámara (**C**), con clic derecho sobre la transacción se tiene las siguientes opciones:




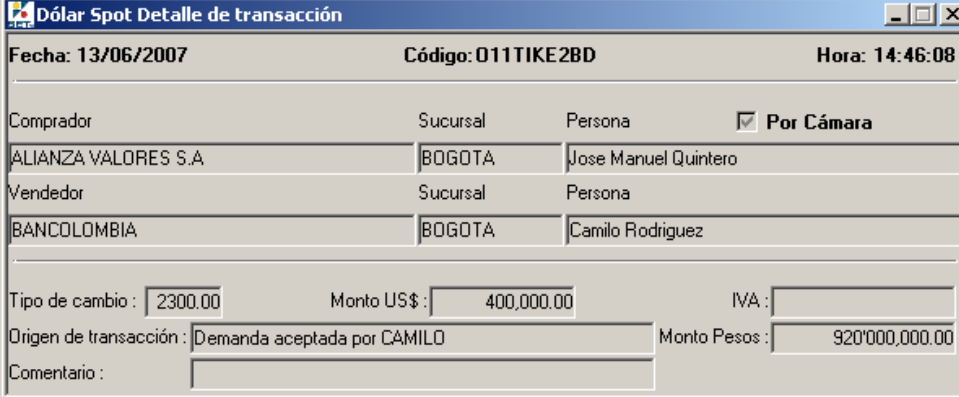
- **Anular Transacción:** permite al operador anular únicamente las transacciones compensadas por Cámara. En este caso las dos contrapartes deben comunicarse directamente con la Cámara y solicitar la anulación de dicha operación.



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

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 40 de 55



Dólar Spot Detalle de transacción

Fecha: 13/06/2007 Código: 011TIKE2BD Hora: 14:46:08

Comprador: ALIANZA VALORES S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Jose Manuel Quintero **Por Cámara**

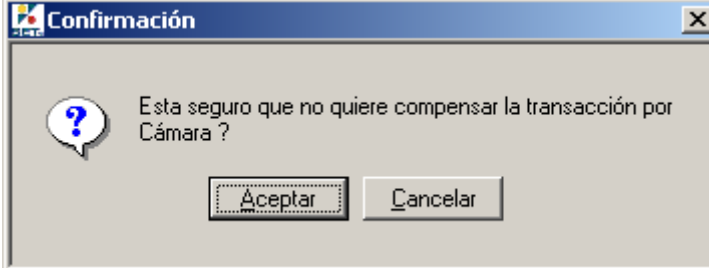
Vendedor: BANCOLOMBIA Sucursal: BOGOTA Persona: Camilo Rodriguez

Tipo de cambio: 2300.00 Monto US\$: 400,000.00 IVA:

Origen de transacción: Demanda aceptada por CAMILO Monto Pesos: 920'000,000.00

Comentario:

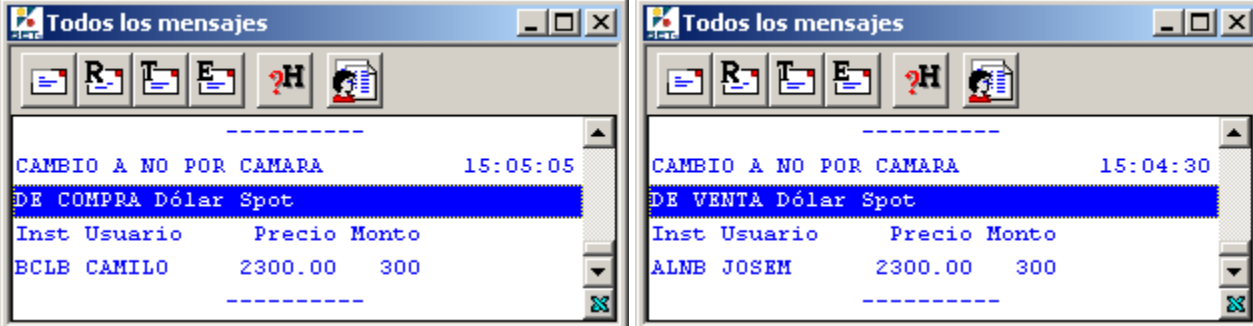
- **No compensar por Cámara:** Opción que modifica la forma de pago de la transacción, para que NO sea compensada por la Cámara. Al ejecutarse, se presenta la ventana de confirmación. Si las contrapartes desean que una transacción que en principio se solicito fuera compensada a través de la Cámara, sea ahora compensada y liquidada por fuera de la Cámara, deben realizar dicha solicitud directamente a la Cámara.



Confirmación

Esta seguro que no quiere compensar la transacción por Cámara ?

Al presionar Aceptar, se envía un mensaje de Cambio a NO por Cámara a los involucrados en la transacción.



Todos los mensajes (Left):

```

-----
CAMBIO A NO POR CAMARA      15:05:05
DE COMPRA Dólar Spot
Inst Usuario   Precio Monto
BCLB CAMILO   2300.00  300
-----

```


Todos los mensajes (Right):

```

-----
CAMBIO A NO POR CAMARA      15:04:30
DE VENTA Dólar Spot
Inst Usuario   Precio Monto
ALNB JOSEM    2300.00  300
-----

```

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

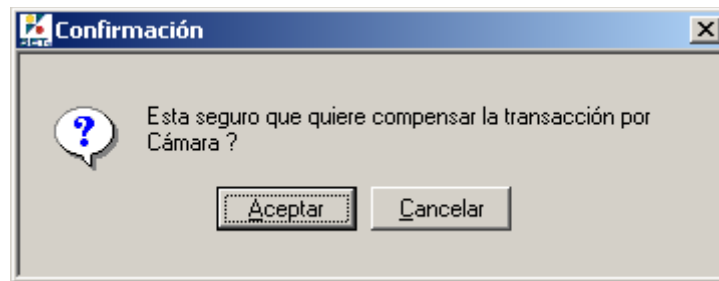
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 41 de 55

b) Transacciones No Compensadas por Cámara:

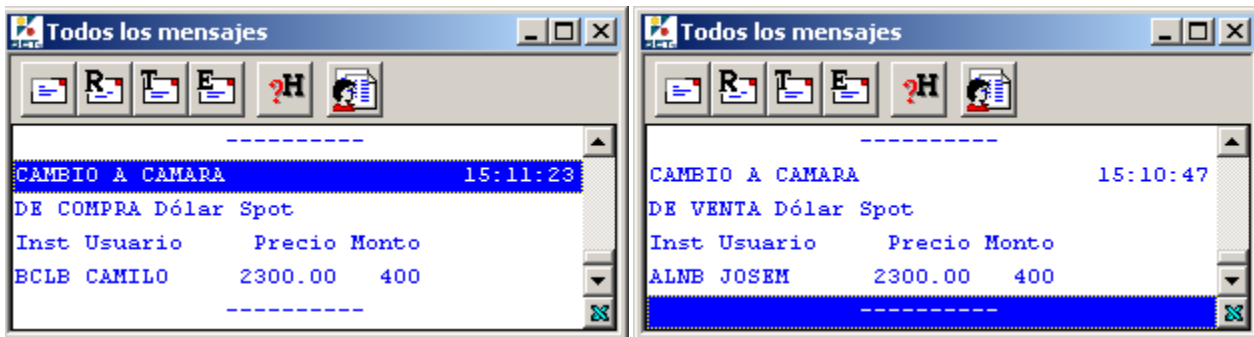
Las entidades también pueden solicitarle a la CCD Compensar y Liquidar operaciones que en principio no iban por Cámara; para esto, el usuario de perfil Cámara hace clic derecho sobre la transacción y se tienen las siguientes opciones:




- Nótese que sólo se aumenta una nueva opción, respecto a la explicación anterior.
- **Compensar por Cámara:** Opción que modifica la forma de pago de la transacción, para que sea compensada por la Cámara. Al ejecutarse, se presenta la ventana de confirmación.




- Al presionar Aceptar, se envía un mensaje de Cambio a Cámara a los involucrados en la transacción y la operación ahora será compensada por Cámara.




- Si no se tiene abierta la ventana de mensajes, al llegar un mensaje el botón en la barra del sistema cambia de color y titila hasta que se revise el mensaje. 

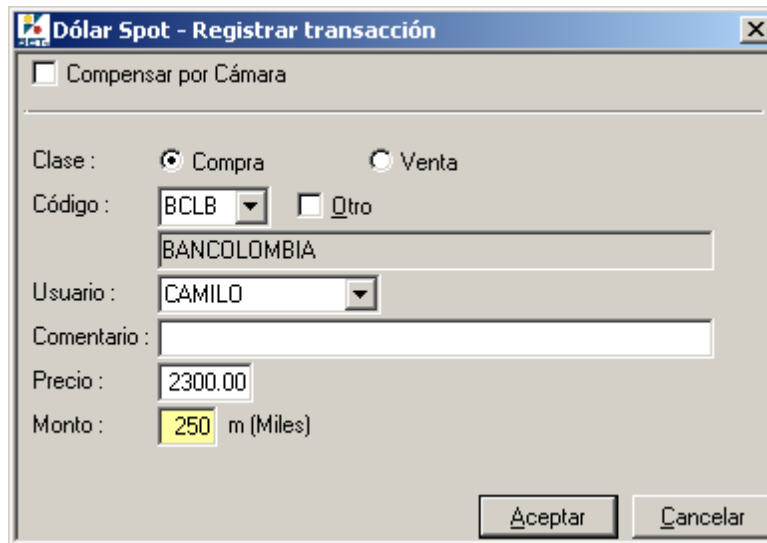
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 42 de 55

16. Transacciones de registro


a) Transacciones por registro No Compensadas por Cámara:

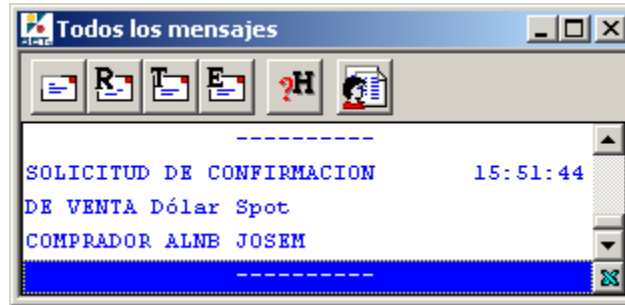
- El sistema permite registrar operaciones que fueron realizadas por fuera de la tabla (o Ventana Dólar Spot); es decir operaciones previamente acordadas por teléfono u otro medio.
- Las transacciones registradas necesitan ser confirmadas por la contraparte. Para registrar una transacción, se presionar el botón “Registrar”  de la barra de botones del mercado. Se debe dar ingreso a los datos del registro.



- Aquí se ponen los datos de la contraparte y que tipo de operación se desea registrar, con el precio y monto negociado.
- 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.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 43 de 55



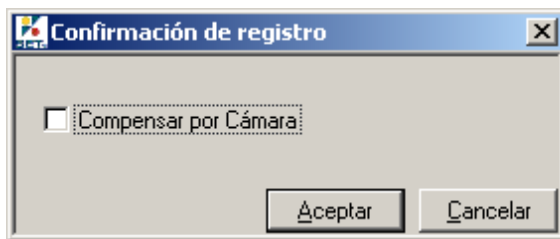
- Con doble clic sobre el mensaje se presenta la ventana de Solicitudes de registro, en esta ventana se tiene dos opciones básicas:



Si el registro es rechazado, al usuario que hizo la solicitud se le envía un mensaje donde se advierte que su pedido fue rechazado por la contraparte.




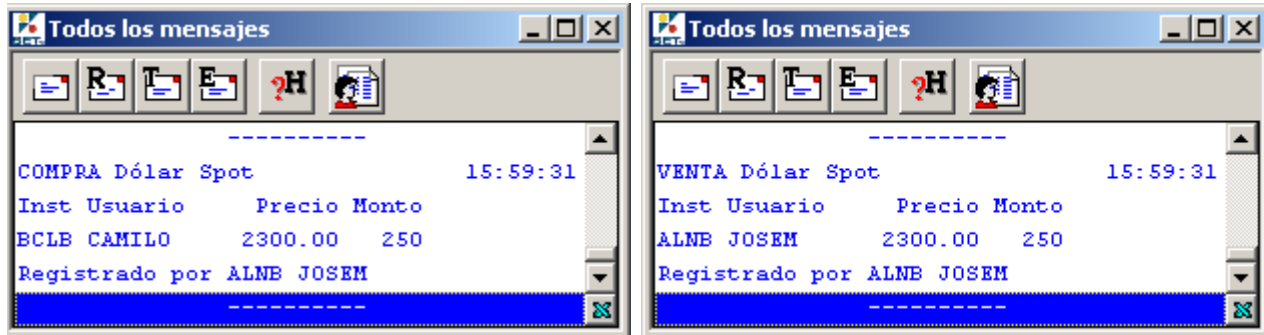
Si el registro es confirmado, se presenta la ventana de confirmación de que el registro no va a ser compensado por la Cámara.



- Al presionar Aceptar, se envía un mensaje a las partes involucradas advirtiendo que se realizó la transacción.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 44 de 55



En el blotter del Operador Cámara, se presenta la transacción con la letra **R**, que indica que fue un registro.

Hora	Cód	Comprador	Vendedor	Precio	Monto	ND	R	C
15:59:31	011TIKE2BR	ALNB JOSEM	BCLB CAMILO	2300.00	250,000		R	

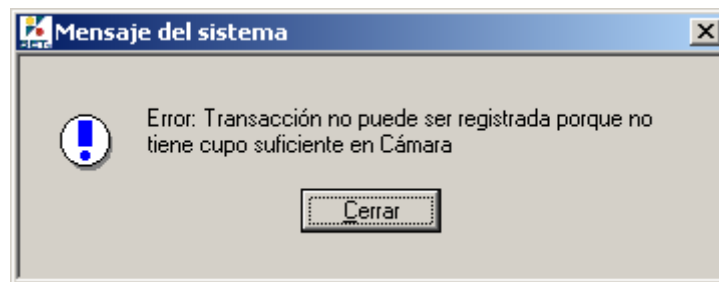
Para este tipo de transacciones, se activan las mismas opciones aquellas operaciones que son realizadas por tabla.

b) Transacciones por registro Compensadas por Cámara:

Para que los registros sean compensados por Cámara es obligatorio que exista cupo Cámara entre las partes. Para esto pueden existir los siguientes escenarios:


- **Solicitante Exige Registro por Cámara:**

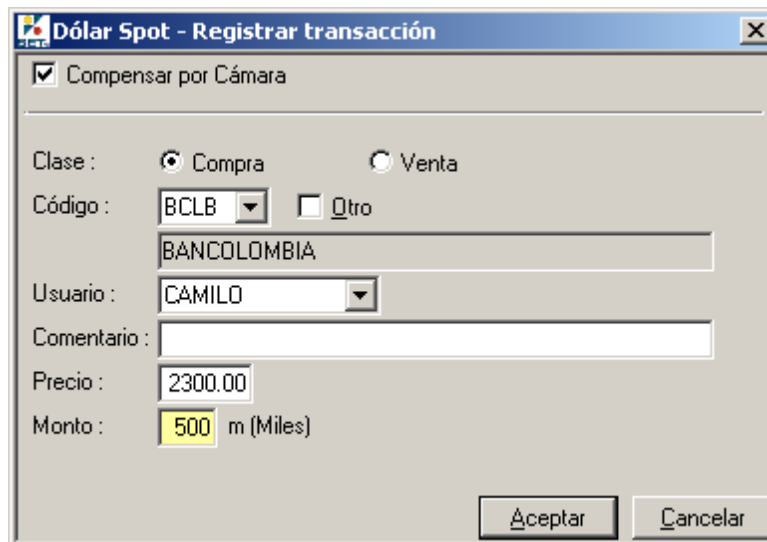
Si el solicitante del registro, exige que se compense por cámara es necesario que este tenga suficiente cupo Cámara, de lo contrario se presenta un mensaje de de error por falta de cupo.



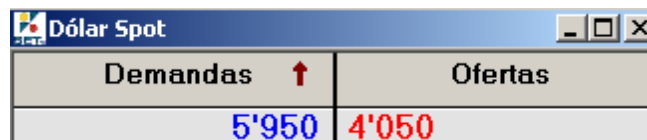
- De existir cupo Cámara, al enviar la solicitud de registro, esta debe tener marcada la opción **Compensar por Cámara** de la ventana de registro.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 45 de 55



- Al presionar Aceptar, en el solicitante del registro, se realiza una **Reserva de Cupo Cámara**, por el monto del registro solicitado. Es decir que del cupo actual (antes de la solicitud) se disminuye en el monto que se desea registrar.
- En este ejemplo, antes de enviar la solicitud de registro se tiene el siguiente cupo Cámara



Demandas ↑	Ofertas
5'950	4'050


- Al enviar la solicitud de registro, se disminuye el monto del registro del Cupo de Compra (**ROJO**), quedando así.

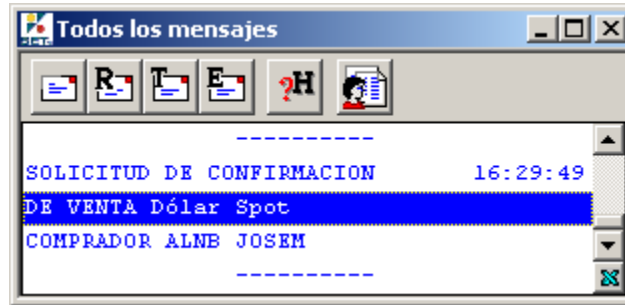


Demandas ↑	Ofertas
5'950	3'550

- El valor disminuido del cupo queda reservado hasta que la contraparte confirme el registro, que es cuando ya se ejecuta la transacción.
- Además de la reserva, se envía un mensaje de Solicitud de Confirmación de registro a la contraparte, donde se revela quien es el que desea realizar el registro.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 46 de 55



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

Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor	Monto IVA	Total	ND	Comentario	R
16:39:50	ALIANZA	BOGOTA	2300.00	500	1150'000.000		1150'000.000.00			R

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



Si el registro no es respondido, hasta que finalice el tiempo de registro, el usuario que hizo la solicitud tendrá un monto reservado. Para el usuario que no respondió la solicitud, en la ventana de solicitudes de registro se muestra la solicitud caducada con luz **roja**.

Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor	Monto IVA	Total	ND	Comentario	R
16:48:55	ALIANZA	BOGOTA	2300.00	500	1150'000.000		1150'000.000.00			R

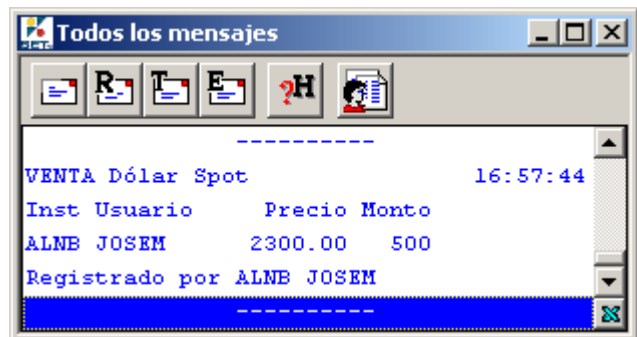
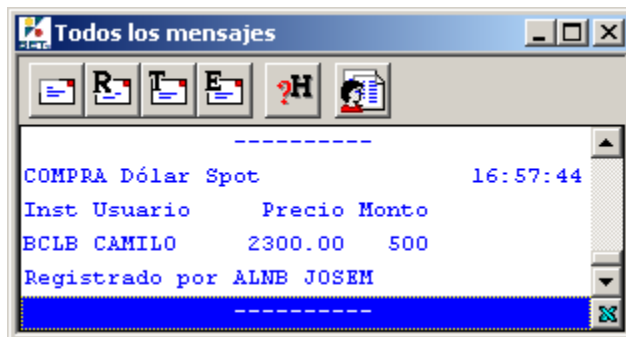
Si el registro es confirmado, se presenta la ventana de confirmación de que el registro va a ser compensado por la Cámara. Nótese que la contraparte no tiene opción de deshabilitar la Compensación por Cámara

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

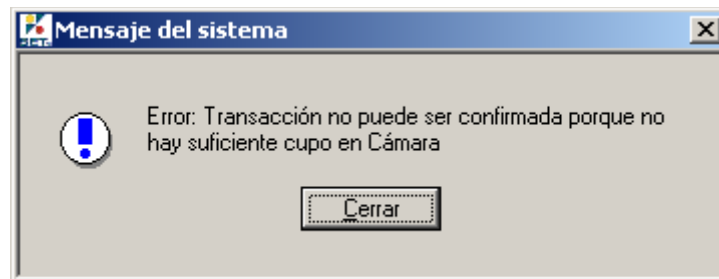
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 47 de 55



- Al presionar Aceptar, se envía un mensaje a las partes involucradas advirtiendo que se realizó la transacción.

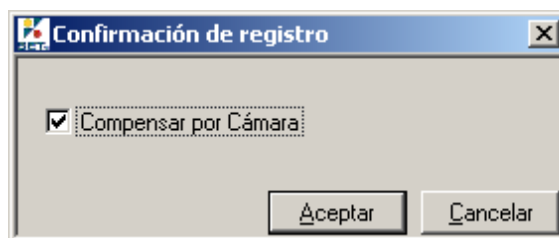


- Si el aceptante del registro no tuviera cupo Cámara, al momento de confirmar el registro se presenta el mensaje de error por falta de cupo Cámara.




○ **Aceptante Exige Registro por Cámara:**

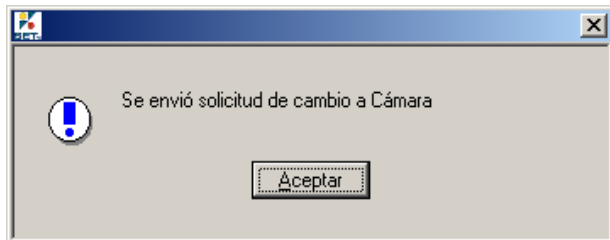
Si el aceptante del registro, es decir quien recibe la solicitud, obliga a operar a través de la Cámara, es necesario que el solicitante haga una Re-confirmación del Registro, aduciendo que la operación va por Cámara.



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011


	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 48 de 55

- Al presionar Aceptar, se envía al solicitante un mensaje de solicitud de cambio a cámara



- Si el solicitante Acepta, el registro se realiza y se compensa por Cámara. Si el solicitante no acepta entonces no se puede realizar la operación.
- Al realizar la compensación de operación por registro el monto mínimo de la operación deberá ser de 250 de no cumplir con este requisito no se permitirá el cambio de la operación a compensada por CCD.

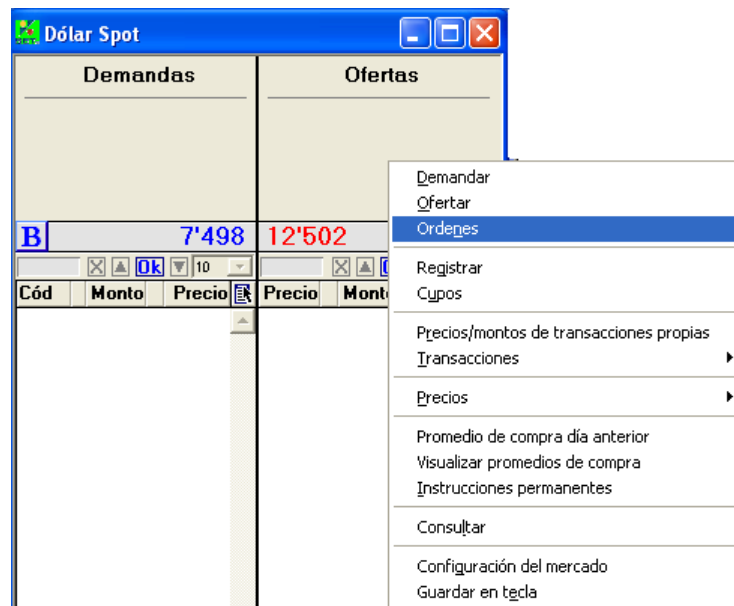
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 49 de 55

17. Transacciones por Ordenes

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

- La configuración de la plataforma para el calce por medio de órdenes se hace de la siguiente manera.
- Para ingresar a la tabla de órdenes se debe hacer clic derecho sobre la tabla de mercado spot y luego seleccionar ordenes




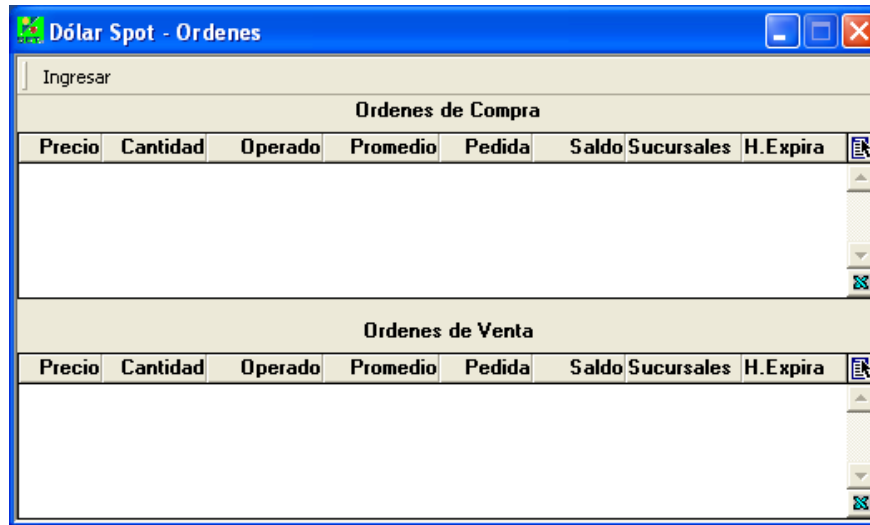
O haciendo clic en la barra de opciones del aplicativo en el botón “Ordenes”

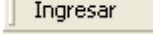


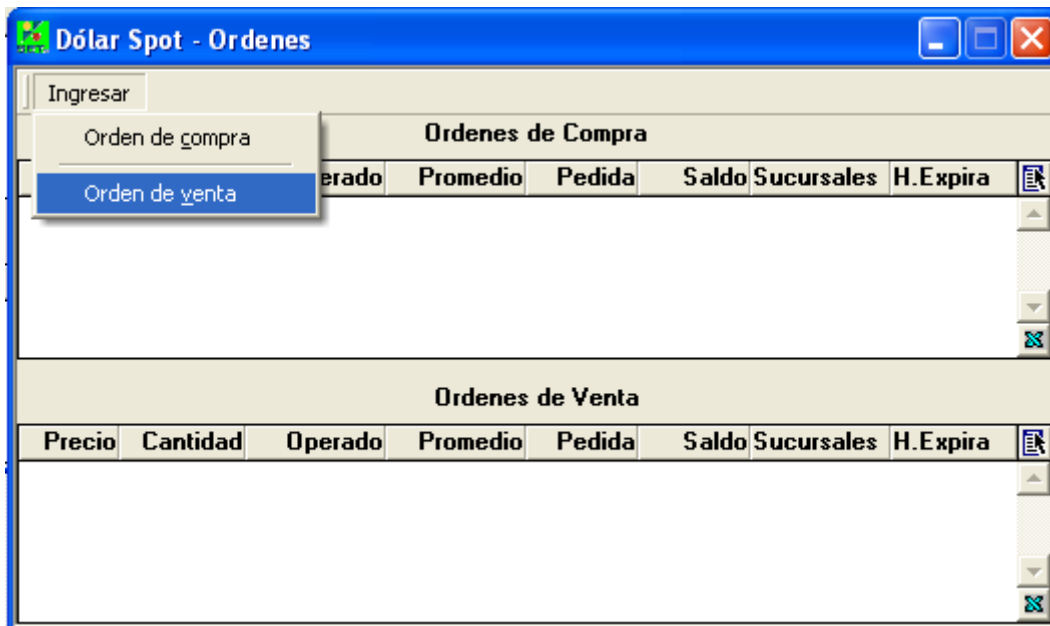
de esta manera accedemos a la ventana de visualización de las ordenes en el sistema.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 50 de 55



- Haciendo clic en el botón ingresar  seleccionamos si la orden será de venta o de compra.



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011


Datos de ingreso para una orden:

Una vez ingresadas las órdenes se visualizan como en el grafico siguiente.

Ordenes de Compra							
Precio	Cantidad	Operado	Promedio	Pedida	Saldo	Sucursales	H.Expira
2300.00	500				500	No	16:46:24

Ordenes de Venta							
Precio	Cantidad	Operado	Promedio	Pedida	Saldo	Sucursales	H.Expira
2301.50	500				500	No	16:46:43

Si la orden es calzada parcialmente se mostrara en la columna saldo el monto pendiente por calzar hasta que el tiempo de la orden se cumpla.

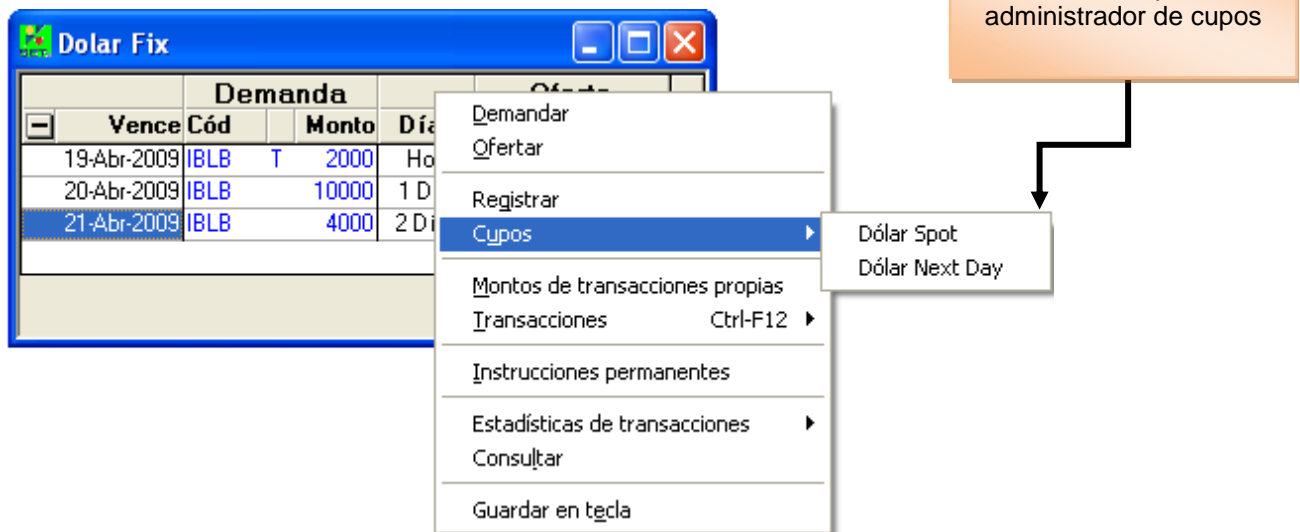
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 52 de 55

18. Mercado Fix

A continuación se describe el uso del modulo para este mercado

18.1 Ventana de posturas (Demandas/Ofertas)

A continuación se describe la ventana principal del mercado FIX y sus características:



Opción habilitada únicamente para el administrador de cupos

- Ingreso demanda / oferta

Ingresar demanda

Dolar Fix

Días:

Vence:

Monto: m

Total:

Aceptar Cancelar

Ingresar oferta

Dolar Fix

Días:


Vence:

Monto: m

Total:

Aceptar Cancelar

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

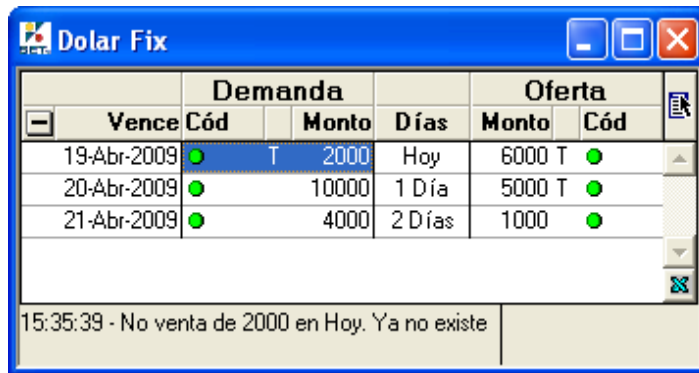
	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003
		Versión: 1.0
		Página 53 de 55

- **Ventana postulante**



		Demanda			Oferta	
Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód	
19-Abr-2009	IBLB T	2000	Hoy	6000 T	IBLB	
20-Abr-2009	IBLB	10000	1 Día	5000 T	IBLB	
21-Abr-2009	IBLB	4000	2 Días	1000	IBLB	

- **Ventana Contraparte**



		Demanda			Oferta	
Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód	
19-Abr-2009	T	2000	Hoy	6000 T		
20-Abr-2009		10000	1 Día	5000 T		
21-Abr-2009		4000	2 Días	1000		

15:35:39 - No venta de 2000 en Hoy. Ya no existe

- Las posturas estarán ordenadas dependiendo de la fecha de cumplimiento de dichas operaciones. Primero aparecerán las operaciones con cumplimiento el mismo día y en forma descendente las demás de acuerdo a si son a 1 o 2 días.
- Al tratar de agredir una oferta o una demanda nos mostrara la siguiente ventana de confirmación.



Venta

Dolar Fix


Días :

Vence :

Monto :

Total :

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011

	DOCUMENTO	Código: MO_SPOT_001
	Manual Usuario Mercado Dólar Spot-Dólar Next Day - FIX	Archivo: MA_TECSET1003 Versión: 1.0
		Página 54 de 55

- **Blotter de operaciones**

Las operaciones calzadas con vencimiento el mismo día se mostraran en el blotter de operaciones del mercado SPOT y las de vencimiento a 1 o 2 días en el blotter del mercado Next Day



Hora	Usuario	C/V	Monto	Días	Vence	Cód.	Ori	A	R
15:46:34	SEBASTIAN	Compra	2000	Hoy	19/04/2009	SUMB	X0		
15:46:40	SEBASTIAN	Venta	6000	Hoy	19/04/2009	SUMB	X0		
Total compras sucursal:			2'000,000						
Total ventas sucursal:			6'000,000						

Identificador del origen de la transacción

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 21/01/2011	Fecha: 25/01/2011	Fecha: 26/01/2011