



MANUAL DE USUARIO

Código: MO_RDIV_004

Versión: 1.2

**Mercado
Registro de Divisas**

Página 1 de 34

Manual de Usuario

Mercados de Registros de Divisas



Agosto 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 : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 2 de 34

INDICE

Introducción	3
Ingreso al modulo Registro de Divisas (Derivados)	4
Interbancario Forward.....	12
Envío de operaciones forward derivados clientes sector real a CRCC.....	13
Interbancario Swap	18
Interbancario Opciones.....	25
Interbancario IRS/CCS (Interest rate Swaps / Cross currency swap)	26
Interbancario Otros Derivados	27
Sector Real (Clientes) Spot – Next Day	28
Sector Real(Clientes) Forward.....	30
Sector Real(Clientes) Swap	31
Sector Real(Clientes) Opciones.....	32
Sector Real(Clientes) IRS (Interest Rate Swaps)	33
Sector Real(Clientes) Otros Derivados	34
Control de cambios	34

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 3 de 34

Introducción

A continuación se explican de manera detallada las funcionalidades sobre el Sistema de Negociación y Registro del Mercado de Divisas “SET FX”, para el registro de operaciones entre IMC’s e IMC’s – con sus Clientes, en cumplimiento de la Resolución No. 4 de Enero de 2009 expedida por el Banco de la República de Colombia y posteriores.

Dentro de las características principales se encuentran:

- Módulo para registro de operaciones llamado “Registro de Divisas”, donde se podrán registrar operaciones en otras monedas entre IMC’s, IMC’s y sus Clientes del sector real
- Fácil acceso y uso para el usuario
- La información puede ser exportada a Excel desde las ventanas de los mercados
- Se crean ventanas de resumen y estadísticas para los distintos mercados

Los siguientes mercados de registro incluidos en el módulo de “Registro de Divisas” son:

Entre IMC’s:

- Spot otras monedas
- Next Day otras monedas
- Forward otras monedas
- Swap otras monedas
- IRS/CCS otras monedas y peso/dólar
- Opciones otras monedas y peso/dólar
- Otros Derivados otras monedas y peso/dólar

Entre IMC y Clientes:

- Spot otras monedas y peso/dolar
- Next Day otras monedas y peso/dolar
- Forward otras monedas y peso/dolar
- Swap otras monedas y peso/dolar
- IRS/CCS otras monedas y peso/dólar
- Opciones otras monedas y peso/dólar
- Otros Derivados otras monedas y peso/dólar

Para cada uno de estos mercados, se dispone de una ventana que muestra los campos necesarios a diligenciar para las operaciones de registros realizadas IMC’s, como entre IMC y su cliente.

Algunas de las características principales de estos mercados son:

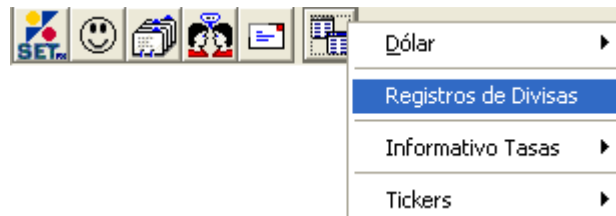
- No harán uso de los cupos bilaterales ni cupos Camara de Divisas (CCD)
- Los registros entre IMC’s requieren confirmación de la contraparte
- El registro de una operación realizada con un cliente del sector real solo podrá ser registrado por el IMC

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

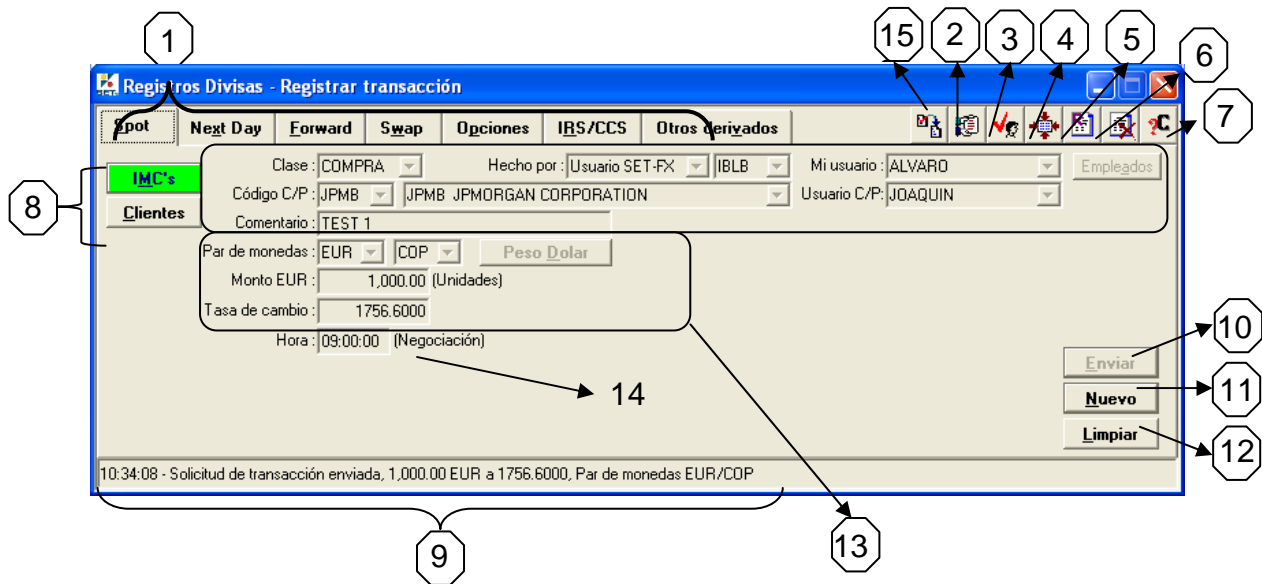
 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 4 de 34

Ingreso al modulo Registro de Divisas

Para ingresar al módulo de “Registros de Divisas” se debe ingresar en el botón “Mercados” y posteriormente en la sección: “Registros de Divisas” como se muestra a continuación:




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




Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

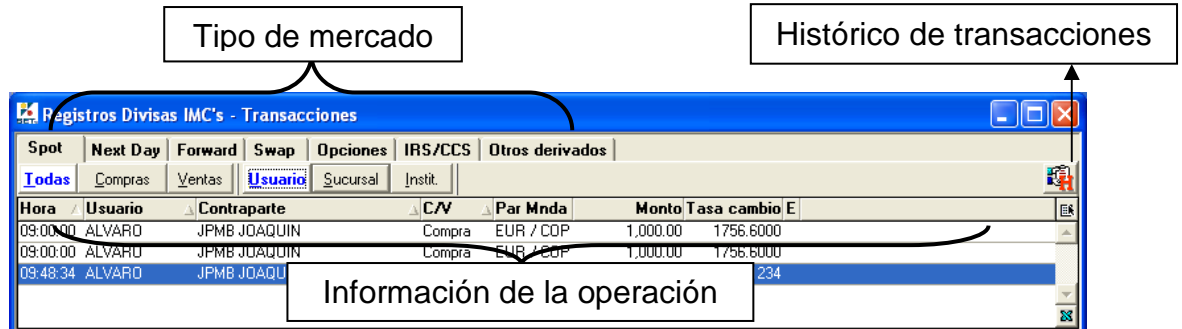
A continuación se describen cada uno de los campos y su función de este módulo:
Funcionalidad de los botones en todos los mercados:

1. El Trader seleccionará una de las 7 viñetas de mercados, Spot / Next Day / Forward / Swap / Opciones / IRS-CCS / Otros Derivados.

2. El Botón  permite visualizar las operaciones registradas; generando información referente al mercado activo en el momento de usarlo,

con clic sobre este botón se despliegan dos opciones: , al seleccionar cada una de estas opciones se muestra la información de las operaciones para cada tipo de mercado, con la posibilidad de ver cualquiera de los mercados dentro de la categoría seleccionada (Interbancarios "IMC's" – Sector Real "Clientes"); en las siguientes ventanas:

Interbancarios "IMC's"



Hora	Usuario	Contraparte	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	E
09:00:00	ALVARO	JPMB JOAQUIN	Compra	EUR / COP	1,000.00	1756.6000	
09:00:00	ALVARO	JPMB JOAQUIN	Compra	EUR / COP	1,000.00	1756.6000	
09:48:34	ALVARO	JPMB JOAQUIN					234


Sector Real "Clientes"



Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	E
09:00:00	ALVARO	ARCADIO SUAREZ PENAGOS	R Compra	USD / COP	1,500.00	1756.6000	●
09:54:24	ALVARO	ARCADIO SUAREZ PENAGOS	R Compra	USD / COP	1,500.00	1756.6000	●

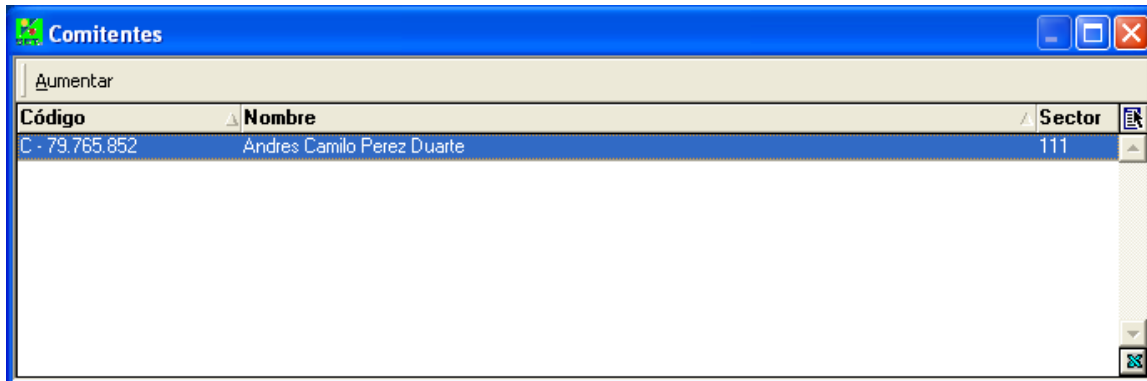
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado	Versión: 1.2
	Registro de Divisas	Página 6 de 34

Desde estas ventanas podemos acceder a la información histórica de las transacciones realizadas en los diferentes mercados, haciendo clic en el botón , visualizaremos la siguiente ventana;



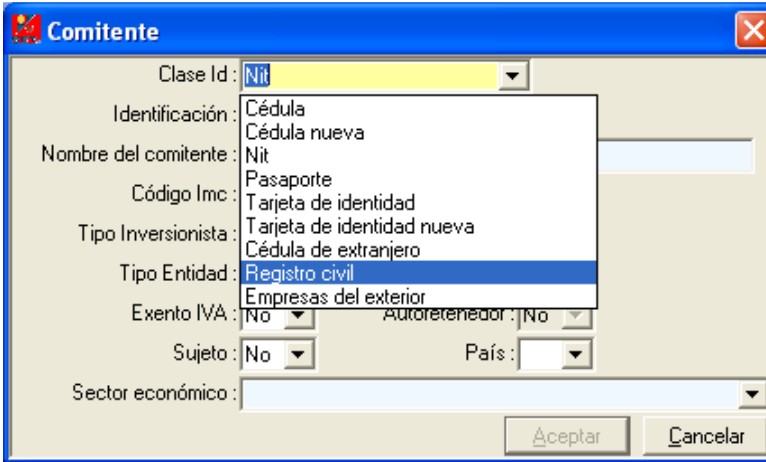
3. Botón comitentes , abrimos la ventana siguiente:



Haciendo clic en Aumentar podemos crear nuevos Comitentes.


Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

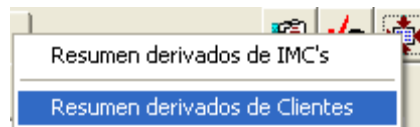
	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 7 de 34




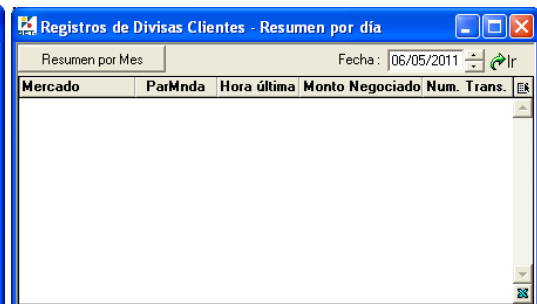
El Banco de la República pide que la información sobre los comitentes incluya un campo obligatorio, 'Tipo Entidad', que debe tener uno de estos tres valores:

- Real
- Agentes del Exterior
- Vigilado Súper Financiera

4.  Resumen de precios/montos transados hoy encontramos la información de todas las operaciones registradas de mercado; por este botón podemos seleccionar si la información que se visualizara corresponde al mercado Interbancario "IMC's" o de Sector real "Clientes"




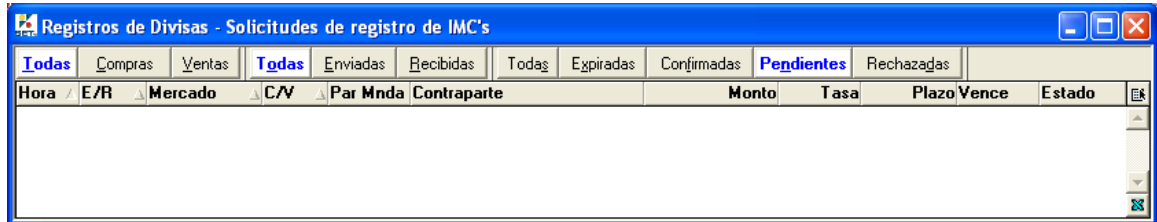
Cada una de estas opciones nos lleva a una ventana como la que se muestra a continuación en la que se visualizara la información de las operaciones realizadas a la hora de la consulta


	
---	--

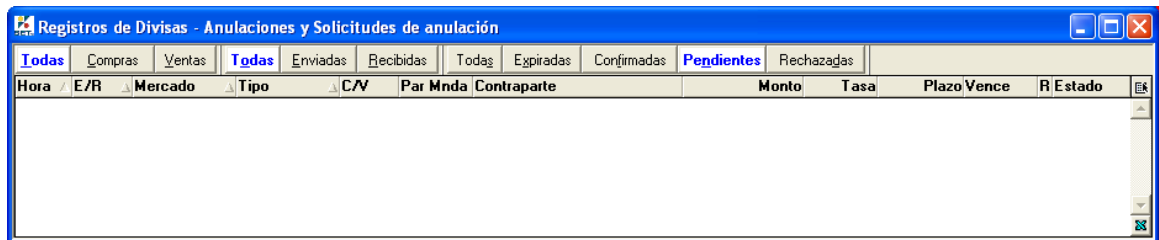
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011


 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 8 de 34

5.  **Solicitudes de Registro**, haciendo clic en este botón vemos la información de los registros, enviados, recibidos, tanto para compra como para venta. Este botón no aplica para el mercado Sector Real "Clientes" dado que este tipo de registro no solicitan, ni reciben confirmación de contraparte.



6.  **Anulaciones y Solicitudes de anulación**, haciendo clic en este botón accedemos a la tabla en la que se nos muestra todas las operaciones anuladas durante la jornada o las solicitudes de anulación, esto se observa haciendo clic en una de las opciones en las pestañas de la ventana.

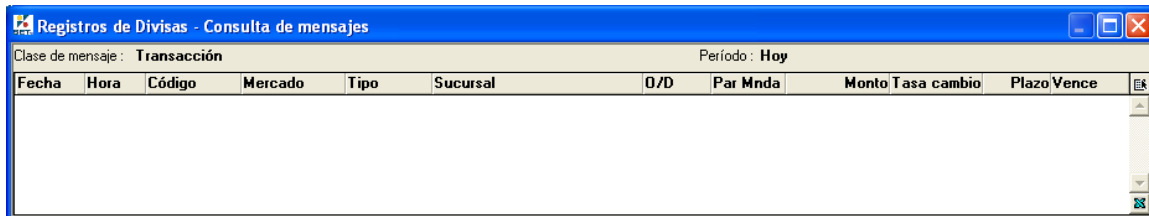


7.  **Consultas** por medio de este botón se pueden realizar consultas de las transacciones y anulaciones realizadas en el mercado Registros Derivado:

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 9 de 34

Al hacer clic en Consultar mostrará la información según los parámetros seleccionados para la consulta en la siguiente ventana:



8. Se debe seleccionar "IMC's" o "Clientes" dependiendo del tipo de operación a registrar. Esta opción va a ser persistente – si el trader hacer clic en la viñeta Spot y la última transacción que hizo en el Spot fue Interbancario "IMC's", el botón Interbancario va a estar seleccionado y se mostrara en color verde.



9. Estos campos se deberán diligenciar con la información de la contraparte a quien se le enviara el registro y con el tipo de operación que se enviara (compra o venta).

10. Al completar la información salvo 'Hora' y 'Comentario' que son opcionales, se activa el botón 'Enviar'. Este botón envía el pedido de registro en los mercados "IMC's" Derivados, y registra una transacción en los mercados "Clientes" Después de hacer clic en 'Enviar', se desactiva este botón y todos los campos con los detalles de un registro (Compra/Venta, Par de monedas, Monto etc.).

11. Para crear un nuevo registro, se puede hacer clic en 'Nuevo', que activa todos los campos de los detalles de un registro, y deja los valores del registro anterior.

12. Alternativamente se puede hacer clic en 'Limpiar' para borrar los datos en todos los campos. Cuando todos los campos salvo 'Hora' y 'Comentario' tengan datos, nuevamente se activa el botón 'Enviar'.

13. Campo "Clase" tipo de operación (Compra/venta, Pull de compra etc) depende del mercado

Campo "Hecho Por", donde se puede seleccionar 3 tipos de usuarios:

- Yo: Es el usuario que posee la aplicación SETFX quien registra la operación
- Usuario SET-FX: Cualquier otro usuario de la institución que posee aplicativo SET-FX
- Otro: Cualquier empleado de la institución y que no posee aplicativo

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

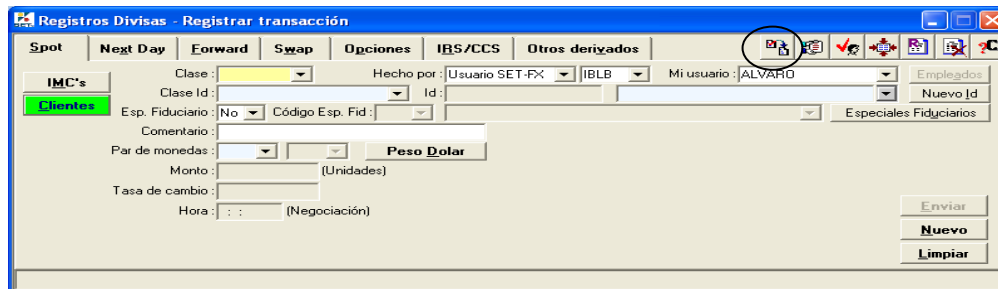
	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 10 de 34

Campo monedas y monto de la transacción dependiendo del tipo de monedas, una vez seleccionado el par de monedas para un registro, van a aparecer los códigos de tres letras de las monedas

14. Hora de Negociación, es la hora en que el usuario cerró el negocio con la contraparte, se ingresa manualmente por el usuario.

15. Botón Importar XML: Desde esta opción podremos cargar las operaciones de registro de entre IMC's y su clientes del Sector Real" hacia el sistema SET-FX de manera masiva.

(Previamente se deberá configurar la estructura del archivo XML para que pueda ser importado y enviado a SET FX), para mayor información contáctenos.



Una vez cargado el archivo, se muestra a continuación el estado de cada unas de las operaciones a cargar en el sistema:

Dicho estado puede ser:

- Por enviar. Pendiente
- Errónea: Se deben corregir campos
- Enviada: Cargada en set-fx
- Duplicada: enviada previamente con el mismo ID de operación
- SET-FX: Ya se encuentra en el sistema de Registro 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 : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Registros de Divisas Clientes - Transacciones XML

Hora	Id	Mercado	E	Usuario	Contraparte	Tipo	Par Mnda	Monto	Tasa pactad	Plazo	2V FV	Operación	Estado
08:00:05	SP1	Spot	Y	ANDREA	Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP13	Spot	Y	ANDREA	APPLEFORD MANAGMENT	Venta	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP4	Spot	Y	ANDREA	Ciente prueba XML	Venta	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
09:00:05	SP2	Spot	O	ALBERTO	Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	22.0010			Ingreso	Errónea
09:00:05	SP5	Spot	O	ALBERTO	Ciente prueba XML	Venta	USD / COP	999999.999.00	22.0010			Ingreso	Errónea
09:30:05	SP3	Spot	E	ANDREA	Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	22.0010			Ingreso	Errónea
09:30:05	SP6	Spot	E	ANDREA	Ciente prueba XML	Venta	USD / COP	999999.999.00	22.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP10	Spot	Y	ANDREA	Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP11	Spot	Y	ANDREA	DTR	Compra	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP12	Spot	Y	ANDREA	DTR	Venta	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP7	Spot			Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP8	Spot			Ciente prueba XML	Venta	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea
08:00:05	SP9	Spot	Y	ANDREA	Ciente prueba XML	Compra	USD / COP	999999.999.00	21.0010			Ingreso	Errónea

Spot: 7 Forward: 0 Opciones: 0 Otros Derivados: 0 Por enviar: 0 Duplicadas: 0
 Next Day: 0 Swap: 0 IRS/CCS: 0 Emónea: 6

Registros de Divisas - Detalle de transacción

Fecha: 14/10/2010 Código: 01LXNSHMR8 Hora de registro: 19:24:36 Hora: 09:30:05

Comprador - Nombre comitente: Cliente prueba XML Clase Id: Identificación: Nit: 800.015.379-3

Por parte de: Vendedor: B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA Sucursal: BOGOTA Persona: Paula Andrea Montoya Rodriguez

Por parte de: BOGOTA hermano Angel

Par de monedas: USD / COP Cod. importación: 006

Plazo: x7 21-Oct-2010 Tipo: SWAP DIFERIDO

Monto: 999999.999.00 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa de cambio: 22.0010 Periodos de pago: Un solo flujo

Tasa de interés USD: LIBOR Opcionalidad: NO TESTOTRDER

Tasa de interés COP: LIBOR1

Origen de transacción: Registrado por ANDREA

Comentario: PRUEBAS FORWARD

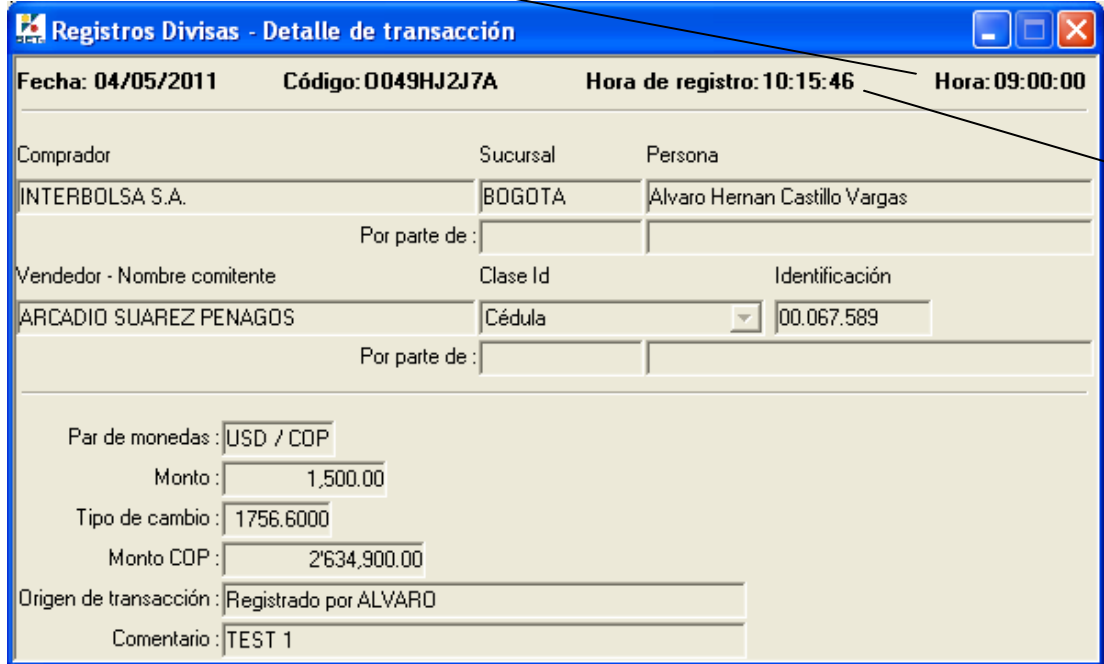
En esta parte se muestra un resumen de La cantidad de operaciones por mercado Importadas y/o caradas en SET-FX

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 12 de 34

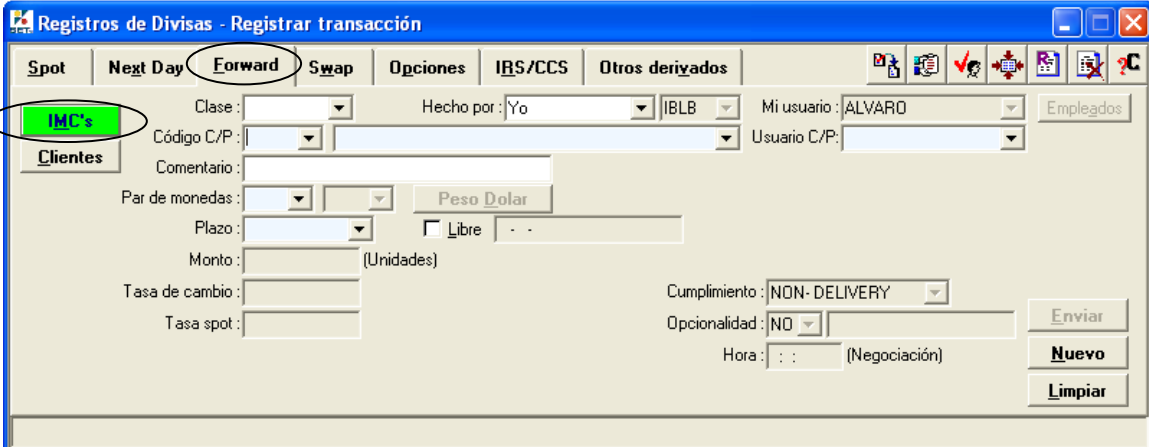
Haciendo clic derecho sobre cualquier operación, se puede visualizar el detalle de la misma:

Hora de negociación



Hora oficial del sistema al momento de ingresar la transacción

Interbancario Forward



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 13 de 34

En este mercado se deberá diligenciar campos adicionales a los descritos en el mercado spot y Next Day, algunos de ellos:

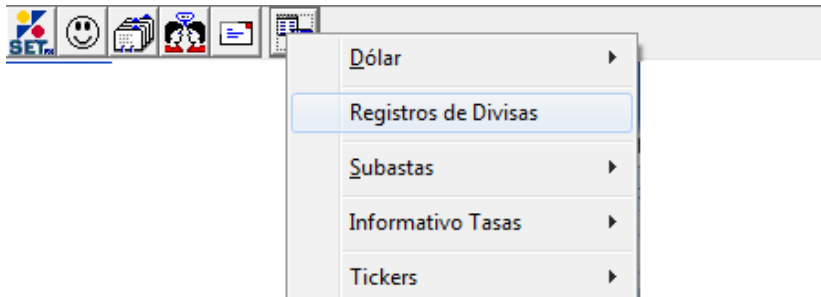
- Plazo : 2 Semanas Libre Martes 02-Feb-2010 El plazo del la operación forward podrá ser uno de los predefinidos para los mercados SWAP y FORWARD, o podrá ser un plazo libre Plazo : 21 Libre Martes 09-Feb-2010 elegido por el trader.
- Cumplimiento : NON- DELIVERY o puede ser Cumplimiento : DELIVERY
- Opcionalidad : NO o Opcionalidad : SI de marcar este campo como si, será porque tiene una opción implícita en el contrato.
- Hora : 08:02:00 Este campo se puede diligenciar con la hora en que se acordó la transacción al igual que en el mercado Spot y/o Next Day.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

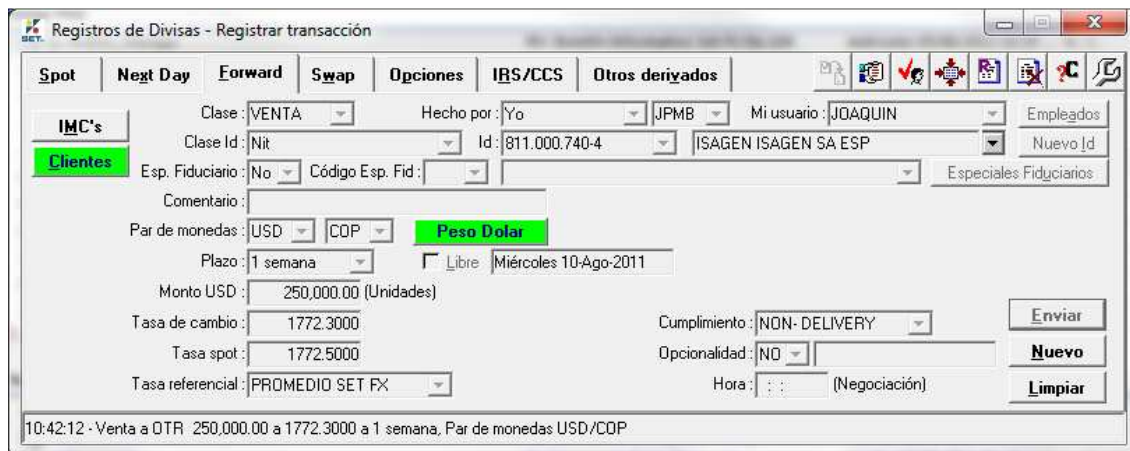
	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 14 de 34

Envío de Operaciones Forward con Clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Se ingresa al Mercado Dólar Forward:



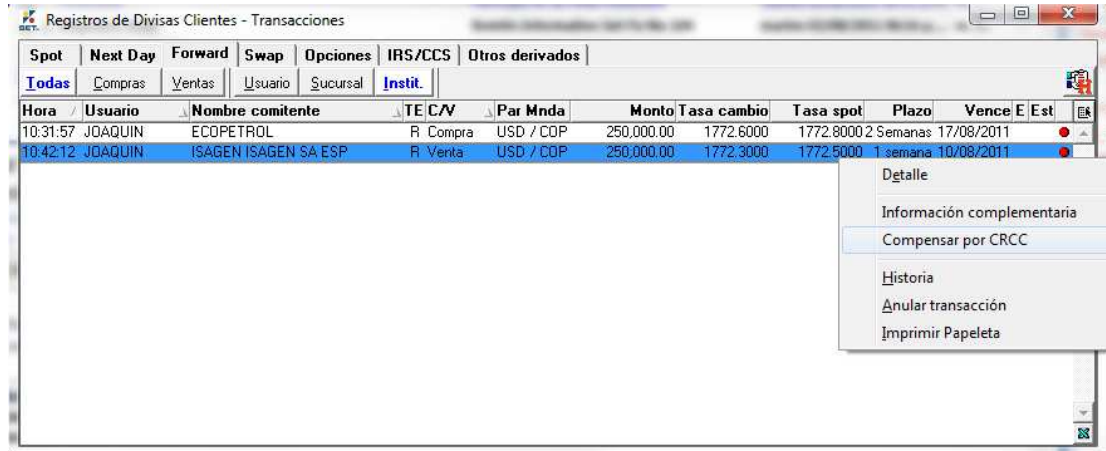
- Se deberá diligenciar cada uno de los campos requeridos para el correcto ingreso de la una operación forward.



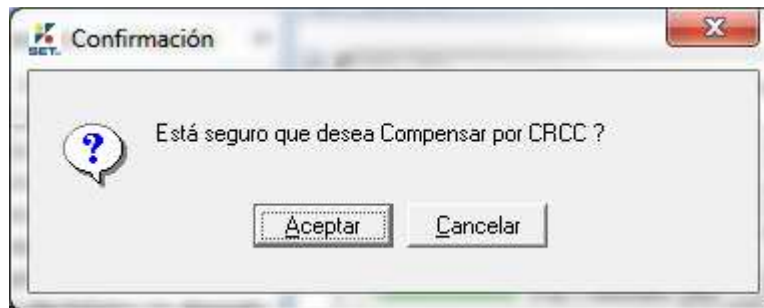
- Para enviar la operación a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte, CRCC, se debe abrir el resumen de operaciones realizadas como se muestra en la siguiente tabla:

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

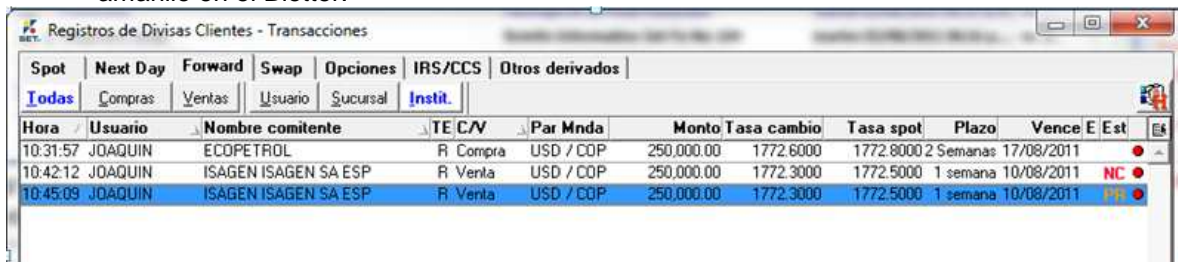
 <p>SET FX SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</p>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 15 de 34



Al ubicarse en la operación deseada y realizar clic derecho, el sistema le muestra la opción “Compensar por CRCC”. Una vez se envíe la solicitud, el sistema pedirá una confirmación:



- Una vez enviada la solicitud a la CRCC, en la columna estado “Est” se mostrará el estado de la operación. El texto **PR** significa “Pendiente Riesgo” y se mostrará en color amarillo en el Blotter:



- Una vez la operación sea aceptada y compensada por la CRCC su estado cambiará a **CR** (Compensada por Cámara de Riesgo) en color verde.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011



MANUAL DE USUARIO

Código: MO_RDIV_004

**Mercado
Registro de Divisas**

Versión: 1.2

Página 16 de 34

Registros de Divisas Clientes - Transacciones										
Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados				
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.					
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Tasa spot	Plazo	Vence	E Est
10:31:57	JOAQUIN	ECOPETROL	R Compra	USD / COP	250,000.00	1772.6000	1772.8000	2 Semanas	17/08/2011	●
10:42:12	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.5000	1 semana	10/08/2011	NC ●
10:45:09	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.5000	1 semana	10/08/2011	CR ●

- Si la operación es rechazada su estado será **NC** (no compensada). Y la causa de rechazo podrá verse en el detalle de la operación como se muestra a continuación:

Registros de Divisas - Detalle de transacción

Fecha: 03/08/2011 Código: 010EHPYRLR Hora: 10:42:12

Comprador - Nombre comitente	Clase Id	Identificación
ISAGEN ISAGEN SA ESP	Nit	811.000.740-4
Por parte de:		
Vendedor	Sucursal	Persona
JPMORGAN CORPORATION	BOGOTA	Joaquin Caicedo Russi
Por parte de:		

Par de monedas: USD / COP

Plazo: 1 semana 10-Ago-2011

Monto: 250,000.00 Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Tasa de cambio: 1772.3000 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa spot: 1772.5000 Opcionalidad: NO

Origen de transacción: Registrado por JOAQUIN

Comentario:

Descripción: El número de identificación del mensaje (MessageID) ya ha sido utilizado en una operación enviada previamente a Camara.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 17 de 34

Mensajes de rechazo


El cuadro siguiente, muestra las posibles causales de rechazo:

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

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

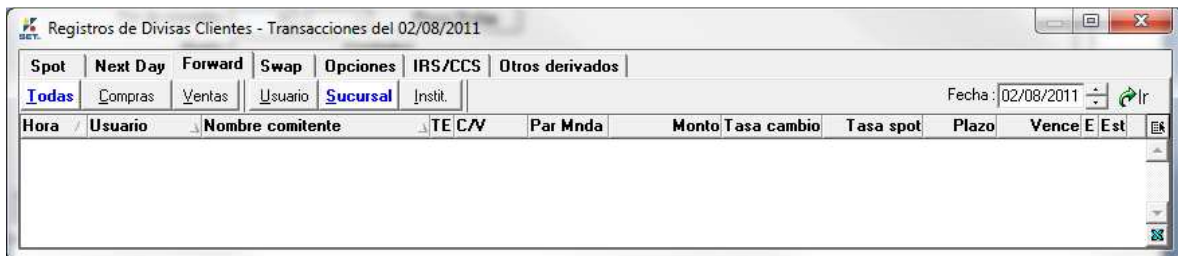
 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 18 de 34

Compensar Operaciones de días anteriores

Desde el blotter del Forward se puede ir al botón  el cual abre un blotter adicional con las operaciones históricas de días anteriores, en esa ventana se puede escoger la fecha de la operación que deseo compensar como se muestra a continuación:

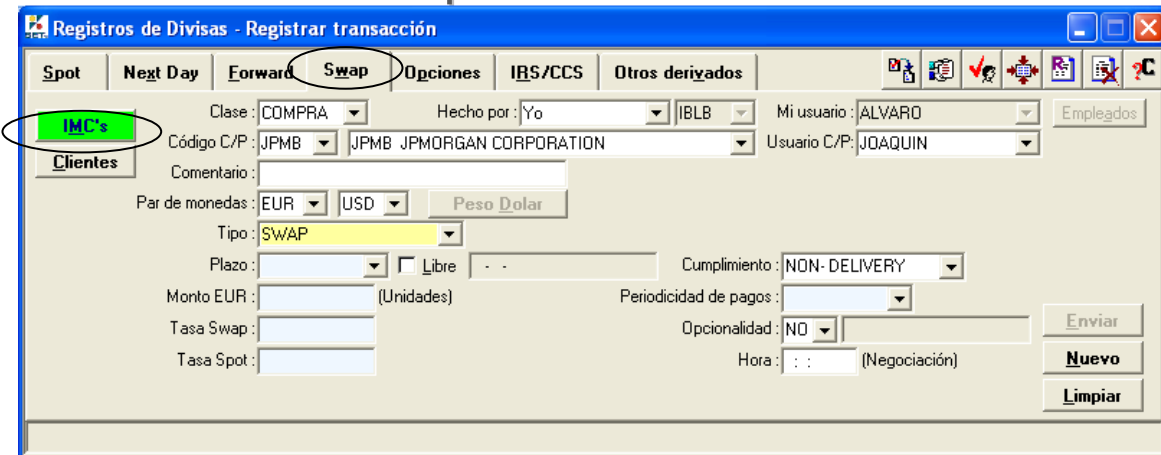


Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados				
<u>Todas</u>	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.					
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Tasa spot	Plazo	Vence	E Est
10:31:57	JOAQUIN	ECOPETROL	R Compra	USD / COP	250,000.00	1772.6000	1772.8000	2 Semanas	17/08/2011	
10:42:12	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.5000	1 semana	10/08/2011	
10:45:09	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.5000	1 semana	10/08/2011	



Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados				
<u>Todas</u>	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.					
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Tasa spot	Plazo	Vence	E Est
Fecha: 02/08/2011										

Interbancario Swap



Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados				
<u>IMC's</u>	Clase: COMPRA		Hecho por: Yo	IBLB	Mi usuario: ALVARO	Empleados				
Código C/P: JPMB	JPMB JPMORGAN CORPORATION		Usuario C/P: JOAQUIN							
Comentario:										
Par de monedas: EUR	USD	Peso Dolar								
Tipo: SWAP										
Plazo:	<input type="checkbox"/> Libre	Cumplimiento: NON- DELIVERY								
Monto EUR:	(Unidades)	Periodicidad de pagos:								
Tasa Swap:	Opcionalidad: NO	Enviar								
Tasa Spot:	Hora: (Negociación)	Nuevo								
		Limpia								

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 19 de 34

En este mercado se deberá diligenciar campos adicionales a los descritos en el mercado spot, Next Day y Forward como:

- El swap puede ser Tipo: o Tipo:
- Al seleccionar diferido cambia la casilla de Plazo por: Plazo: X
- Cuando la operación es swap la casilla Plazo cambia a:
 Plazo: Libre dándonos la opción de tomar uno de los plazos preestablecidos en el sistema o
 Plazo: Libre que nos permite tomar una fecha libremente.
- La Periodicidad de pagos será predefinida en el sistema

Periodicidad de pagos:

Opcionalidad:

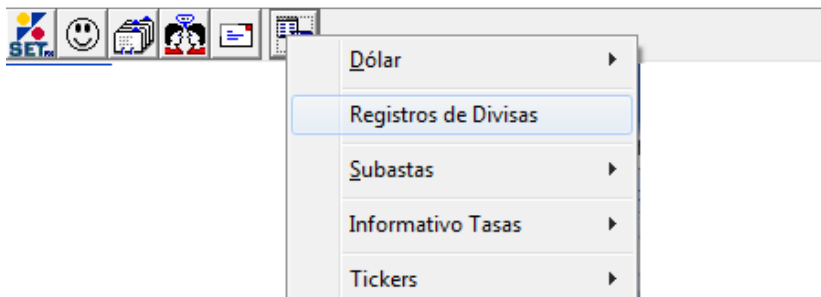
Hora:

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 20 de 34

Operaciones cliente Forward derivados compensadas con Cámara de riesgo central de Contraparte

Se ingresa al Mercado Dólar Swap:



- Se deberá realizar el diligenciamiento de cada uno de los campos requeridos para el respectivo registro de la operación forward.



The screenshot shows the 'Registros de Divisas - Registrar transacción' window. The 'Forward' tab is selected. The form contains the following fields and values:

- Clase:** COMPRA
- Hecho por:** Yo
- JPMB:** JPMB
- Mi usuario:** JOAQUIN
- Empleados:** Empleados
- Clase Id:** Nit
- Id:** 811.000.740-4
- ISAGEN ISAGEN SA ESP**
- Nuevo Id:** Nuevo Id
- Esp. Fiduciario:** No
- Código Esp. Fid.:** [Empty]
- Especiales Fiduciarios:** Especiales Fiduciarios
- Comentario:** [Empty]
- Par de monedas:** USD / COP
- Peso Dolar** (highlighted)
- Tipo:** SWAP
- Tasa referencial:** PROMEDIO SET FX
- Plazo:** 1 semana
- Libre:** Miércoles 10-Ago-2011
- Cumplimiento:** NON- DELIVERY
- Monto USD:** 250.000.00 (Unidades)
- Periodicidad de pagos:** Un solo flujo
- Tasa Swap:** 1770.5000
- Opcionalidad:** NO
- Tasa Spot:** 1770.5600
- Hora:** :: (Negociación)

Buttons: Enviar, Nuevo, Limpiar.

Status bar: 12:25:29 - Compra a OTR 250.000,00 a 1770.5000 a 1 semana, Par de monedas USD/COP

- Si se desea enviar la operación a compensar con la CRCC, se ubica en la operación con clic derecho seleccionar la opción Compensar por CRCC:

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Registros de Divisas Clientes - Transacciones

Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas							Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.			
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE	C/V	Par	Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	E	Est	
10:02:00	JOAQUIN	ECOPETROL	R	Compra	USD / COP		250.000.00	1772.6000	1773.0000	1 mes	01/09/2011			
10:46:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Venta	USD / COP		250.000.00	1772.3000	1772.3600	1 semana	10/08/2011		CR	
12:25:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Compra	USD / COP		250.000.00							

Detalle

Información complementaria

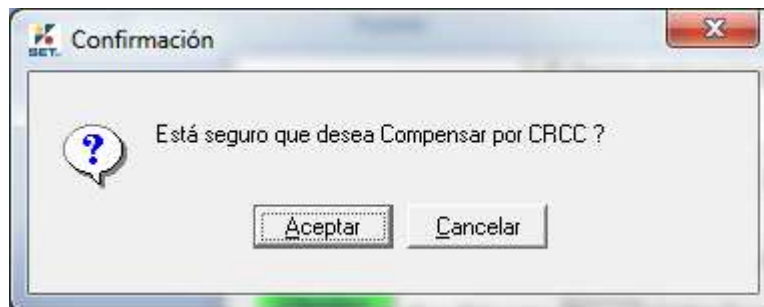
Compensar por CRCC

Historia

Anular transacción

Imprimir Papeleta

- Al enviar la solicitud le pedirá confirmación:



- Una vez enviada la solicitud a la CRCC, en la columna estado "Est" se mostrará el texto **PR** (Pendiente Riesgo) en color amarillo en el blotter:

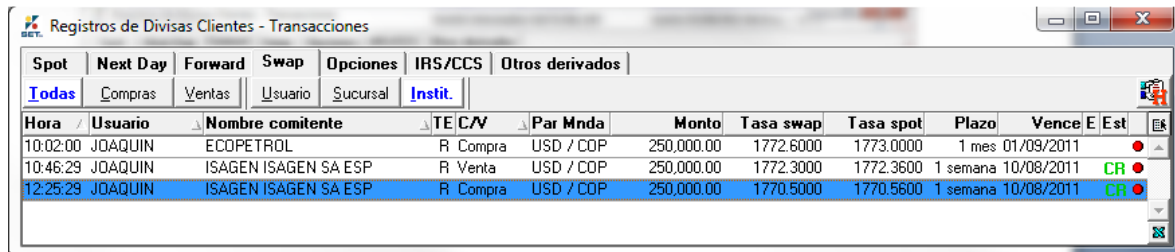
Registros de Divisas Clientes - Transacciones

Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas							Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.			
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE	C/V	Par	Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	E	Est	
10:02:00	JOAQUIN	ECOPETROL	R	Compra	USD / COP		250.000.00	1772.6000	1773.0000	1 mes	01/09/2011			
10:46:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Venta	USD / COP		250.000.00	1772.3000	1772.3600	1 semana	10/08/2011		CR	
12:25:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Compra	USD / COP		250.000.00	1770.5000	1770.5600	1 semana	10/08/2011		PR	

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

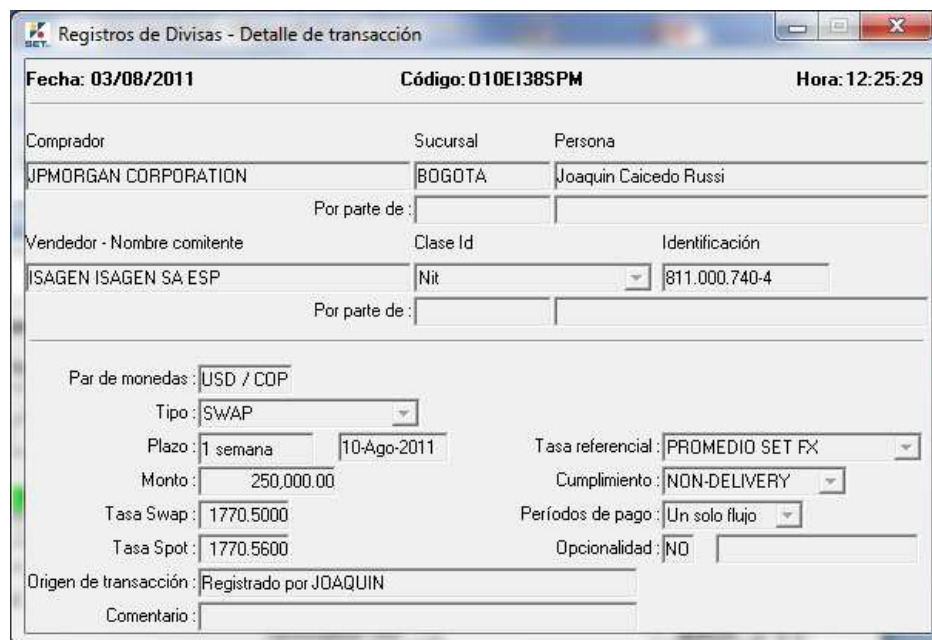
 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 22 de 34

- Si esta es aceptada y compensada por La operación una vez será aceptada y compensada por la CRCC su estado cambiará a **CR** (Compensada por Cámara de Riesgo) en color verde.



Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados								
Todas							Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.			
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE	C/V	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	E	Est		
10:02:00	JOAQUIN	ECOPETROL	R	Compra	USD / COP	250,000.00	1772.6000	1773.0000	1 mes	01/09/2011				
10:46:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.3600	1 semana	10/08/2011		CR		
12:25:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R	Compra	USD / COP	250,000.00	1770.5000	1770.5600	1 semana	10/08/2011		CR		

- Si la operación es rechazada su estado será **NC** (no compensada). Y la causal de rechazo podra verse en el detalle de la operación como se muestra a continuación:



Fecha: 03/08/2011 **Código:** 010E138SPM **Hora:** 12:25:29

Comprador: JPMORGAN CORPORATION Sucursal: BOGOTA Persona: Joaquin Caicedo Russi

Por parte de: []

Vendedor - Nombre comitente: ISAGEN ISAGEN SA ESP Clase Id: Nit Identificación: 811.000.740-4

Por parte de: []

Par de monedas: USD / COP Tipo: SWAP

Plazo: 1 semana 10-Ago-2011 Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Monto: 250,000.00 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Tasa Swap: 1770.5000 Periodos de pago: Un solo flujo

Tasa Spot: 1770.5600 Opcionalidad: NO

Origen de transacción: Registrado por JOAQUIN

Comentario: []

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 23 de 34


Mensajes de rechazo

El cuadro siguiente, muestra las posibles causales de rechazo:

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

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Compensar Operaciones de días anteriores

Desde el blotter del SWAP se puede ir al botón  el cual abre un blotter adicional con las operaciones de días anteriores, en esa ventana se puede escoger la fecha de la operación que deseo compensar como se muestra a continuación:

Registros de Divisas Clientes - Transacciones

Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados					
<u>L</u> odas	Compras	Ventas	Uuario	Sucursal	Instit.						
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	E	Est
10:02:00	JOAQUIN	ECOPETROL	R Compra	USD / COP	250,000.00	1772.6000	1773.0000	1 mes	01/09/2011		
10:46:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Venta	USD / COP	250,000.00	1772.3000	1772.3600	1 semana	10/08/2011	CR	
12:25:29	JOAQUIN	ISAGEN ISAGEN SA ESP	R Compra	USD / COP	250,000.00	1770.5000	1770.5600	1 semana	10/08/2011	CR	

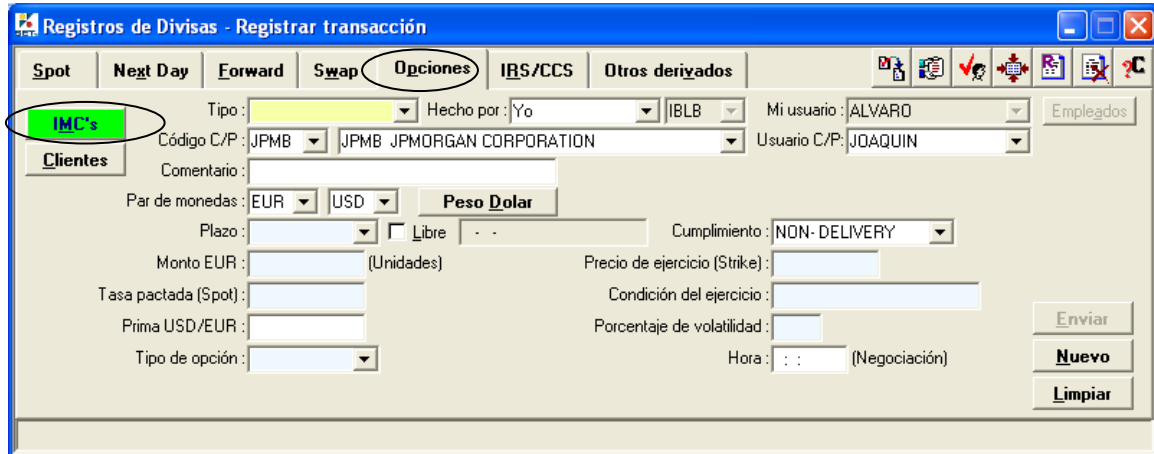
Registros de Divisas Clientes - Transacciones del 02/08/2011

Spot	Next Day	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados					
<u>L</u> odas	Compras	Ventas	Uuario	Sucursal	Instit.						
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Tasa swap	Tasa spot	Plazo	Vence	E	Est

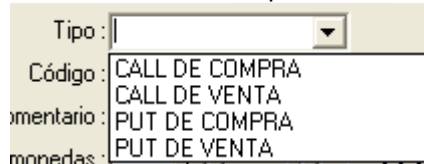
Fecha: 02/08/2011

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Interbancario Opciones

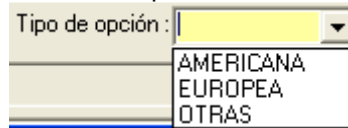


- Entre las opciones que ofrece este mercado se encuentra “Call de Compra”, “Call de Venta”, “Put de Compra” y “Put de venta”, estas opciones son elegibles en el campo **Tipo**:



- Se debe seleccionar la contraparte, por el código de la entidad creada en Set-Fx por tres letras y una cuarta que indica la sucursal; ejemplo: Bancolombia sucursal Bogotá; BCLB; y el usuario al que se le enviara la solicitud de registro.
- El plazo para el cumplimiento de esta operación puede ser uno de los configurados en el sistema, o bien seleccionar una fecha libre, indicando el número de días en el que se realizara el cumplimiento de la operación; en esta modalidad el sistema le indicara si la fecha de cumplimiento es un día feriado o un día hábil.

- En el campo tipo de opción el sistema nos permite seleccionar si la opción es :

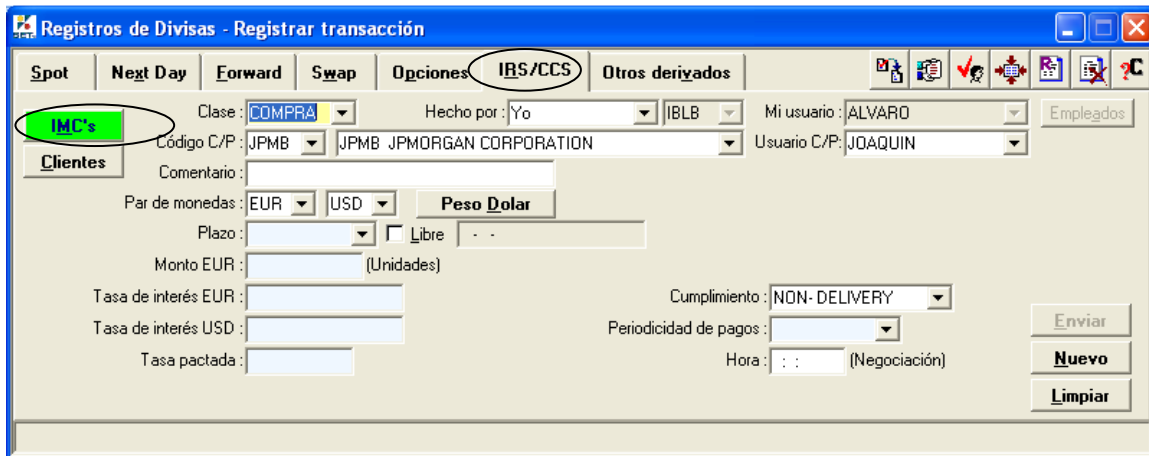


- Una vez se hayan completado todos los campos el botón enviar **Enviar** se activará y podrá ser enviada la solicitud de registro a la contraparte para su respectiva confirmación.
- Para una operación en monedas Peso / Dólar se debe hacer clic en el botón **Peso Dolar** y realizar el registro diligenciando los campo antes mencionados.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 <p>SET SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</p>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 26 de 34

Interbancario IRS/CCS (Interest rate Swaps / Cross currency swap)



- En este mercado al igual que en los anteriores se deberá completar la información de todos los campos de esta forma el botón, **Enviar** se activara y podrá ser enviada la solicitud de registro.
- Los registros IRS/CCS pueden tomar valores para su cumplimiento: DELIVERY o NON-DELIVERY.



- Indicadores 'Peso Dólar' y 'Otras monedas'
 - Para realizar un registro en peso dólar, se debe presionar la opción 'Peso Dólar' como se muestra en el gráfico, si es en otra moneda esta opción estará deshabilitada

Peso Dólar

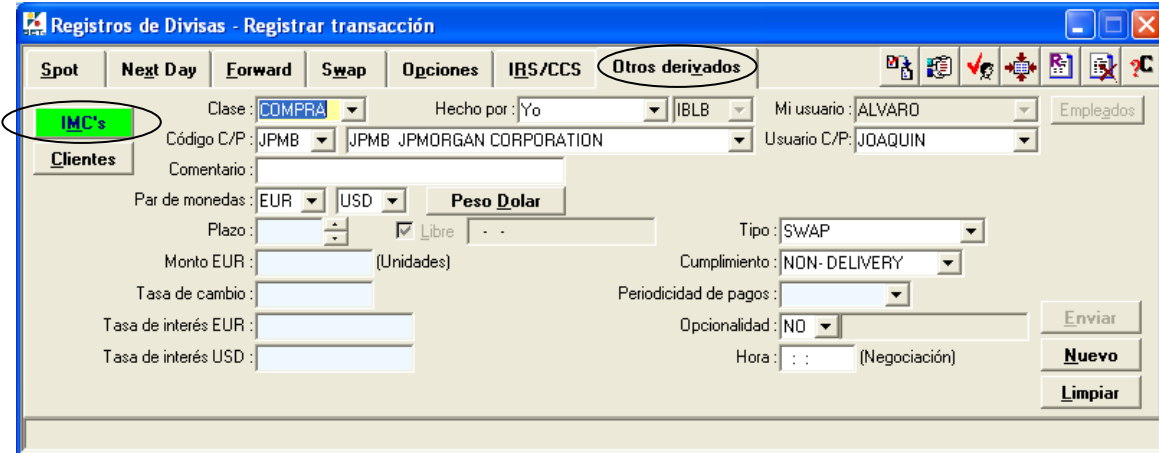
Peso Dólar

- El plazo para el cumplimiento de esta operación puede ser uno de los configurados en el sistema, o bien puede seleccionar una fecha libre indicando el número de días en el que se realizara el cumplimiento de la operación; en esta modalidad el sistema le indicara si la fecha de cumplimiento es un día feriado o un día hábil.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 <p>SET FX SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</p>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 27 de 34

Interbancario Otros Derivados



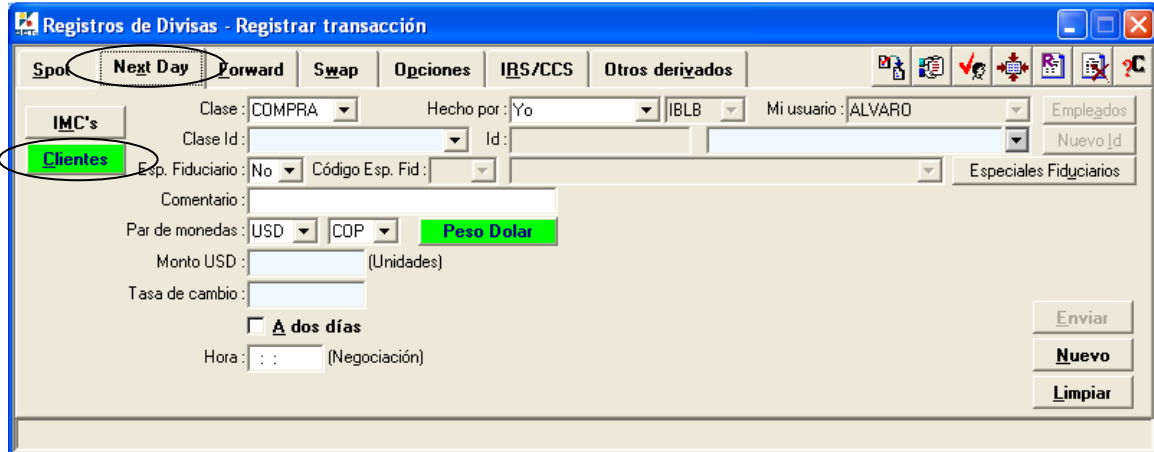
- Al igual que los demás formularios el botón **Enviar**, se activara únicamente cuando todos los campos del formulario estén diligenciados.
- Los registros en Otros derivados tienen la posibilidad en su cumplimiento de ser: DELIVERY o NON-DELIVERY.



- Al igual que todos los mercados en modo Interbancario la contraparte deberá confirmar el registro para su calce.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Sector Real (Clientes) Spot – Next Day



Registros de Divisas - Registrar transacción

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

IMC's **Clientes**

Clase: COMPRA Hecho por: Yo IBLB Mi usuario: ALVARO Empleados

Clase Id: Id: Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario:

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

Monto USD: (Unidades)

Tasa de cambio:

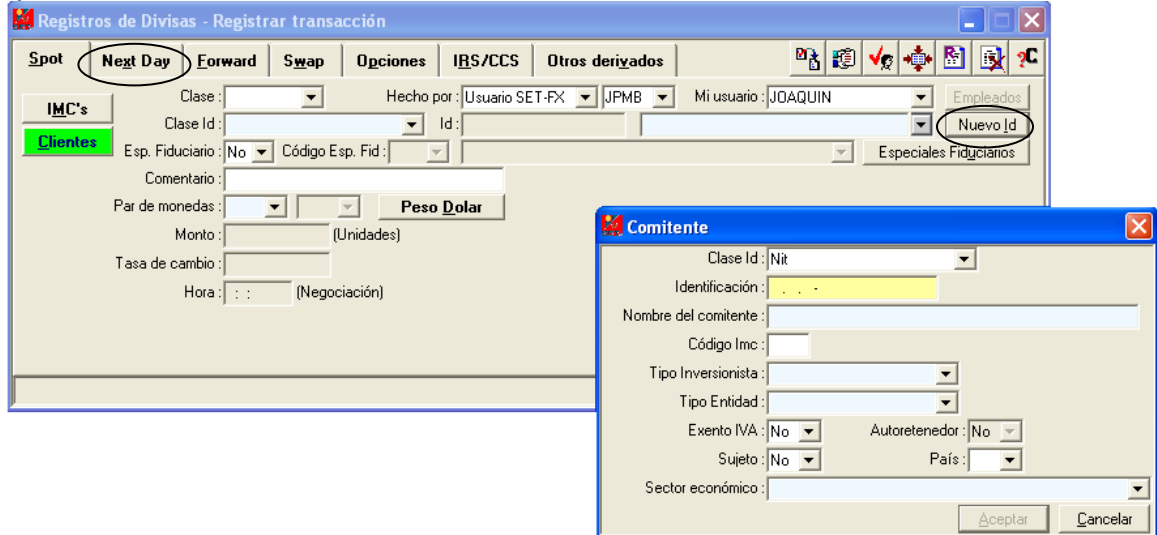
A dos días

Hora: : : (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

- Al contrario que en el mercado Interbancario las operaciones registradas en el mercado Sector Real (Clientes) no requieren confirmación de contraparte, por lo cual se muestran los campos de identificación de los comitentes (Clientes) para todos los mercados:.

Ej.:



Registros de Divisas - Registrar transacción

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

IMC's **Clientes**

Clase: Hecho por: Usuario SET-FX JPMB Mi usuario: JOAQUIN Empleados

Clase Id: Id: **Nuevo Id**

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario:

Par de monedas: **Peso Dolar**

Monto: (Unidades)

Tasa de cambio:

Hora: : : (Negociación)

Comitante

Clase Id: Nit

Identificación: . . .

Nombre del comitente:

Código Imc:

Tipo Inversionista:

Tipo Entidad:

Exento IVA: No Autoretenedor: No

Sujeto: No País:

Sector económico:

Aceptar Cancelar

Haciendo clic en el botón **Nuevo Id**; se mostrará la ventana donde se deberá crear el cliente y se diligenciará la información del nuevo comitente.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

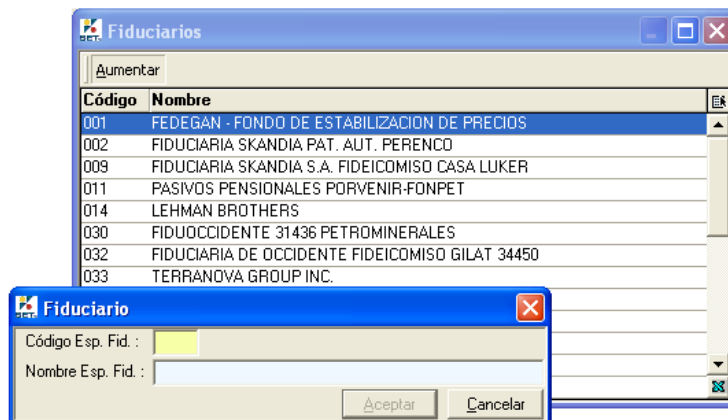
	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 29 de 34

Nota: El Banco de la República en la Circular Reglamentaria Externa DM-317 del 23 de diciembre de 2009, manifiesta que: Para todas las transacciones registradas en los mercados del Sector Real, ahora es obligatorio identificar la contraparte en estas transacciones. En este sentido, los tres campos que identifican a la contraparte ahora van a aparecer en la ventana principal para ingresar un registro:

- Clase Id
Identificación
Nombre del Comitente
- Solo para el mercado Next Day es posible seleccionar cumplimiento hasta de 2 días T+2, este campo se puede seleccionar marcando el checkbox **A dos días**.
 - Este tipo de registros pueden ser realizados el trader o pueden ser registrados a nombre de otra persona autorizada por la entidad.



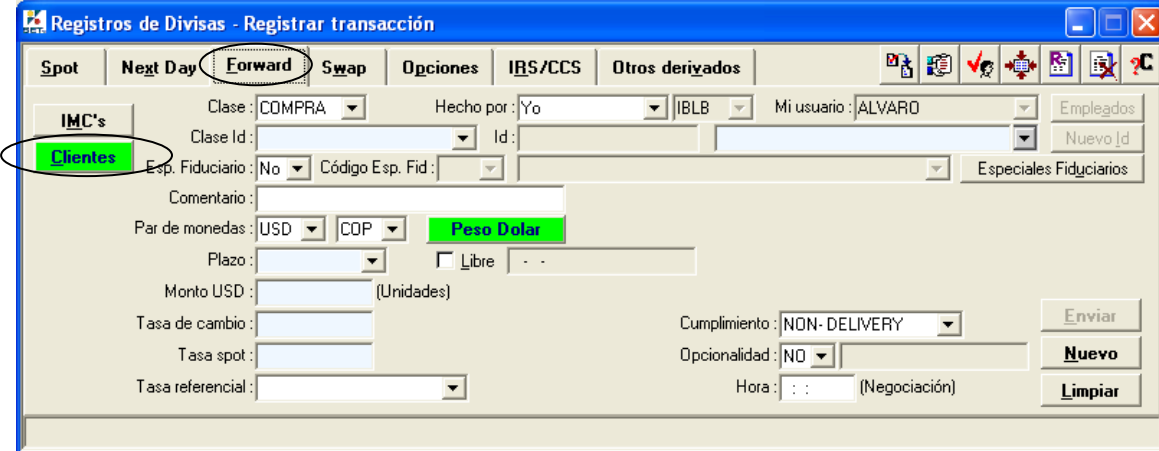
Especiales Fiduciarios: Desde cada uno de los mercados del sector real podrán haciendo clic en el botón **Especiales Fiduciarios** desde donde se podrá listar los actuales y aumentar nuevos especiales fiduciarios:



Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
	Mercado Registro de Divisas	Versión: 1.2
		Página 30 de 34

Sector Real(Clientes) Forward



- Este mercado por ser de Sector Real hará el registro directamente contra el sistema sin esperar una confirmación de contraparte para el calce de la operación una vez se haya completado la información de los campos correctamente se habilitara el botón enviar para terminar el registro de la transacción.
- Las transacciones registradas en el Sector Real podrán ser Anuladas solo hasta 10 minutos después de haber sido enviadas
- Los datos en este formulario son los mismos que para las operaciones Interbancarias con los campos en que se define la identificación del comitente y su respectivo nombre.



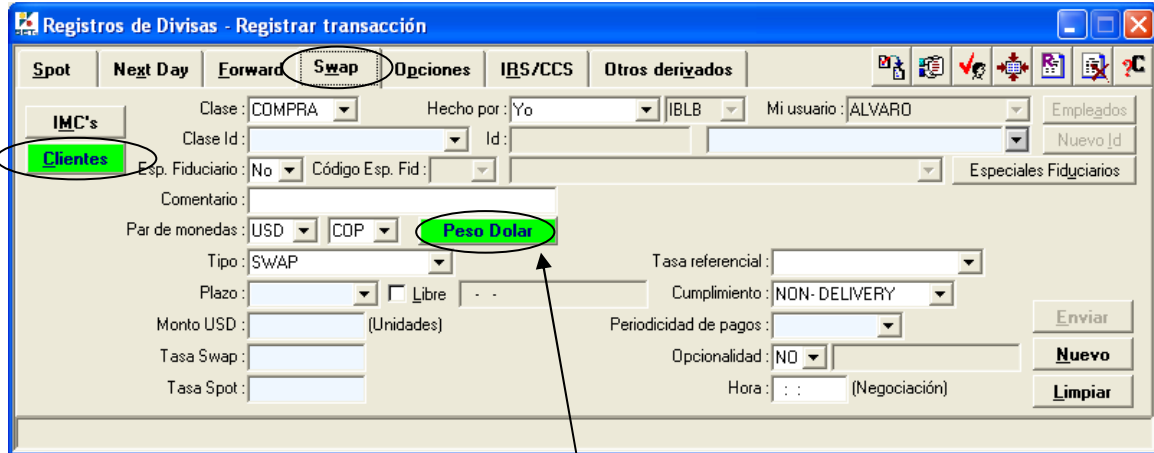
- En este mercado se podrá realizar operaciones Peso/Dólar para las cuales se deberá ingresar la tasa referencial que puede ser el último cierre de Set Fx, la TRM, el promedio de Set Fx u Otra.

Para ingresar este tipo de registros se debe hacer clic en el botón:

Peso Dolar

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

Sector Real(Clientes) Swap



Registros de Divisas - Registrar transacción

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

IMC's **Cientes**

Clase: COMPRA Hecho por: Yo IBLB Mi usuario: ALVARO Empleados

Clase Id: Id: Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario:

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

Tipo: SWAP Tasa referencial:

Plazo: Libre Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto USD: (Unidades) Periodicidad de pagos:

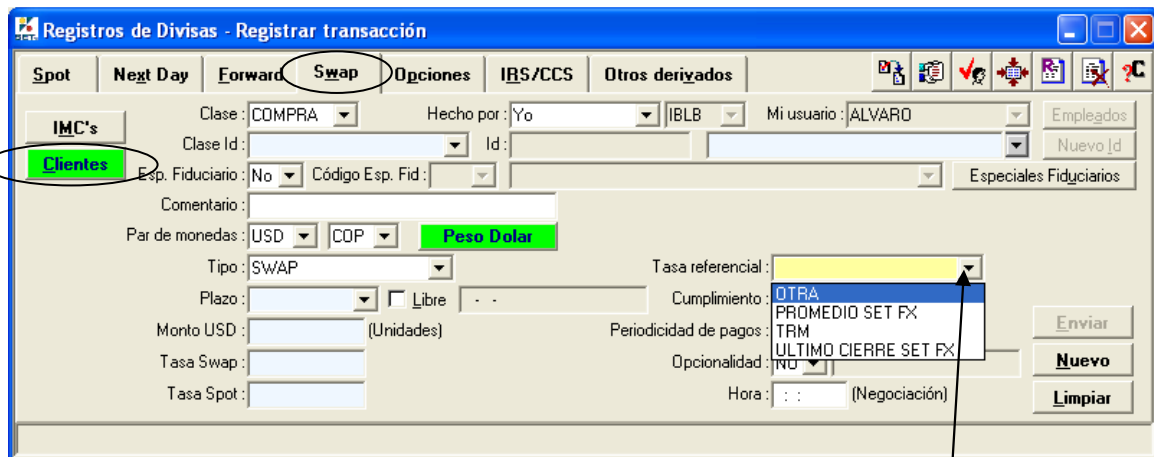
Tasa Swap: Opcionalidad: NO

Tasa Spot: Hora: (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Nos permite ingresar operaciones en monedas Peso / dólar.

Este mercado al contrario que en Interbancario nos permite por esta pantalla realizar el registro de operaciones Peso /Dólar. Al hacer clic en el botón **Peso Dolar** la ventana cambia mostrando los siguientes campos adicionales.



Registros de Divisas - Registrar transacción

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

IMC's **Cientes**

Clase: COMPRA Hecho por: Yo IBLB Mi usuario: ALVARO Empleados

Clase Id: Id: Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario:

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

Tipo: SWAP Tasa referencial:

Plazo: Libre Cumplimiento: OTRA PROMEDIO SET FX TRM ULTIMO CIERRE SET FX

Monto USD: (Unidades) Periodicidad de pagos:

Tasa Swap: Opcionalidad: NO

Tasa Spot: Hora: (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Campo únicamente para peso / dólar.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico

Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico

Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte

Fecha : 06/05/2011

Fecha: 06/05/2011

Fecha: 06/05/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 32 de 34

- Al seleccionar Tipo: **SWAP DIFERIDO** cambia la casilla de Plazo por X .
- Cuando la operación es swap la casilla Plazo cambia a: Plazo: **6 Meses** Libre **Martes 20-Jul-2010** dándonos la opción de tomar uno de los plazos preestablecidos en el sistema o bien, Plazo: **166** Libre **Lunes 05-Jul-2010** que nos permite tomar una fecha libremente.
- La Periodicidad de pagos se seleccionará según definición activa en el sistema

Periodicidad de pagos:

Opcionalidad: **Mensual**

Hora: **Semestral**

Annual

Un solo flujo

Sector Real(Clientes) Opciones



- Las opciones que nos ofrece este mercado está el “Call de Compra”, “Call de Venta”, “Put de Compra” y “Put de venta”, estas opciones son seleccionables en el campo tipo: Tipo:
- El plazo para el cumplimiento de esta operación puede ser uno de los configurados en el sistema o bien, se puede seleccionar una fecha libre indicando el número de días en el que se realizara el cumplimiento de la operación; en esta modalidad el sistema le indicara si la fecha de cumplimiento es un día feriado o un día hábil.

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

- En el campo tipo de opción el sistema nos permite seleccionar si la opción es :

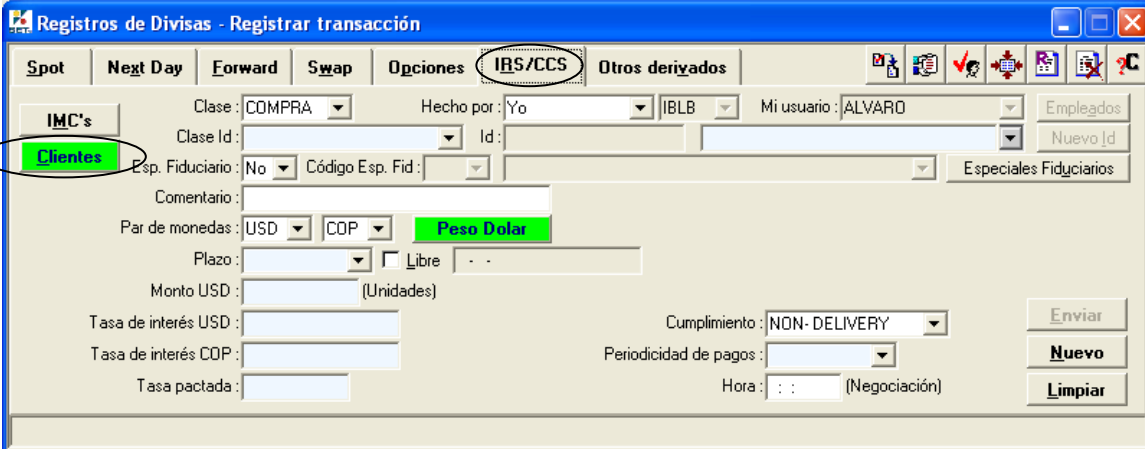
Tipo de opción :

AMERICANA

EUROPEA

OTRAS

Sector Real(Clientes) IRS (Interest Rate Swaps)



- En los campos del grafico siguiente se definirá si el registro es de venta o compra y si será realizado en nombre propio o de una tercera persona.

Clase : Compra Venta Hecho por : Yo Otro

- Los registros IRS tienen la posibilidad en su cumplimiento de ser: DELIVERY o NON-DELIVERY.

Cumplimiento :

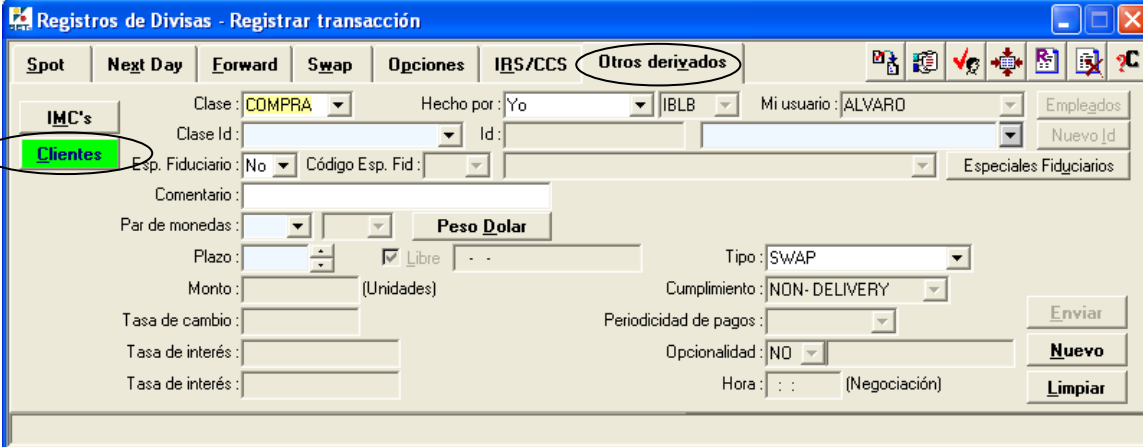
Periodicidad de pagos :

Hora :

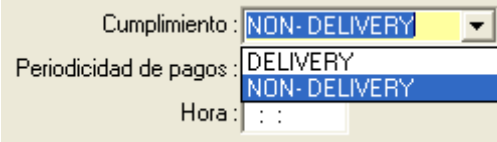
Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011

 SET FX <small>SISTEMA ELECTRONICO DE TRANSACCION DE MONEDA EXTRANJERA</small>	MANUAL DE USUARIO	Código: MO_RDIV_004
		Versión: 1.2
	Mercado Registro de Divisas	Página 34 de 34

Sector Real(Clientes) Otros Derivados



- Los registros en Otros derivados tienen la posibilidad en su cumplimiento de ser: DELIVERY o NON-DELIVERY.



Control de cambios

Versión	Revisado-Responsable	Fecha de revisión	Aprobado	Fecha de aprobación	Razón
1	Director de Operaciones y Soporte Técnico	06/05/2011	Director de Operaciones y Soporte Técnico	06/05/2011	Actualización cambios de nombres
2	Director de Operaciones y Soporte Técnico	04/08/2011	Director de Operaciones y Soporte Técnico	04/08/2011	Actualización CRCC clientes

Elaborado por: Ingenieros de Operaciones y soporte Técnico	Revisado por: Director de Operaciones y Soporte Técnico	Aprobado por: Director de Operaciones y Soporte
Fecha : 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011	Fecha: 06/05/2011