



INSTRUCTIVO – MEJORAS Y NUEVAS FUNCIONALIDADES

Sistema SET-FX Versión 7.13

1. **Resumen Ejecutivo**
2. Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones
3. Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones
4. Extensión de la Duración de las Sesiones Matching
5. Nueva Opción “Marcar No Cumplida”
6. Mejora en el Registro de Opciones

ÍNDICE

En pro de mejorar la experiencia de los usuarios, optimizar los tiempos y simplificar los procesos en el Sistema SET-FX, SET-ICAP implementa un desarrollo que permite que la modificación de operaciones se realice directamente a través de la opción “Modificar” en el Blotter de operaciones, sustituyendo de esta manera la necesidad de anular la operación y generar un registro nuevo.

Este desarrollo no solo permite mejorar el proceso de modificación, sino que también conserva la trazabilidad de la información en los diferentes reportes y en las interfaces de conexión al sistema.

Adicionalmente, se implementan nuevas mejoras tales como la extensión de las sesiones Matching, la opción de marcar las operaciones registradas que no son cumplidas por los clientes y el ajuste en el registro de operaciones del mercado de opciones.

ÍNDICE

1. Resumen Ejecutivo
2. **Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones**
3. Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones
4. Extensión de la Duración de las Sesiones Matching
5. Nueva Opción “Marcar No Cumplida”
6. Mejora en el Registro de Opciones

NUEVO PROCESO DE MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

1. El afiliado interesado en realizar la modificación de un registro de cualquier mercado en el sistema, deberá ubicar la operación en el blotter de operaciones, hacer clic derecho sobre esta y escoger la opción “Modificar”. Posteriormente se abrirá la ventana de modificación, en la que usuario deberá modificar los campos que desee.

Dólar Next Day - Transacciones

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.	
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A R E Ori vC FV I Ca sC sM pA nC M
15:25:00	DANIELP	Compra	3950.00	250	R	N
Total compras sucursal:			250,000	3950.00		
Total ventas sucursal:						
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan		
CTB:	250,000					
Cupo:	8,999,750,000		9,000,250,000			

Detalle
Comentario
Modificar
Historia
Anular transacción
Imprimir Papeleta
Detalle Pérd/Gan

Dólar Next Day - Modificación de transacción

Tipo de transacción: Compra Registrado el: 27/01/22 15:25:28

Mi sucursal: CTBB BANCO CITIBANK

Mi usuario: DANIELP

Por parte de: Emp

Contraparte : Sucursal: SDMM BANCO SUDAMERIS

Usuario: ALBERTO

Por parte de:

Hora (negociación): Fecha anterior 27-Ene-2022 15:25:00

Fecha valor: T+1

Precio: 3955.00

Monto: 500 m (Miles) Efecto cupo CRC: 500,000

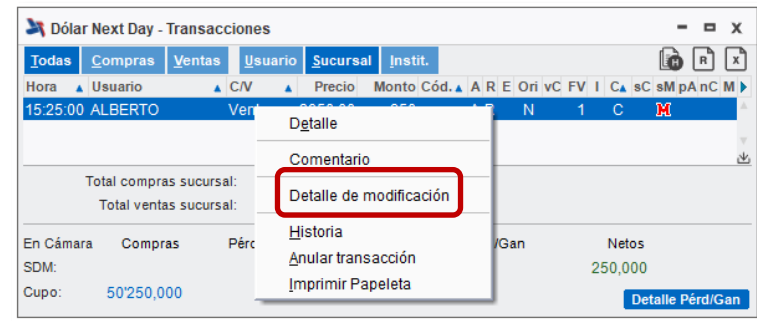
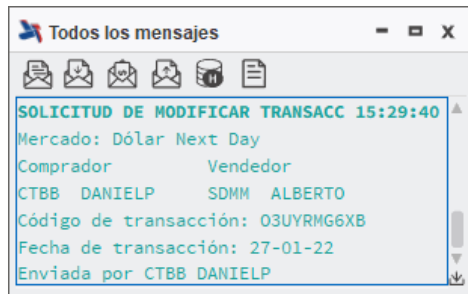
Origen: Next Day

Negociado en: DIRECTO

Aceptar Cancelar

NUEVO PROCESO DE MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

- Posteriormente, la contraparte recibe la solicitud de modificación en la ventana de mensajería. Adicionalmente, la operación aparece en su blotter con la letra “M” de color rojo en el campo “sM” (Solicitud de Modificación). Al hacer clic derecho sobre la operación, se debe seleccionar la opción “Detalle Modificación”.



- Posteriormente, se abre la ventana de modificación con los nuevos valores en los campos para aceptar o rechazar la modificación.

Dólar Next Day - Detalle transacción modificada

Tipo de transacción: Venta Registrado el: 27/01/22 15:25:28

Mi sucursal: SDMM BANCO SUDAMERIS

Mi usuario: ALBERTO

Por parte de:

Contraparte: Sucursal: CTBB BANCO CITIBANK

Usuario: DANIELP

Por parte de:

Hora (negociación): Fecha anterior 27-Ene-2022 15:25:00

Fecha valor: T+1

Precio: 3955.00

Monto: 500 m (Miles) Efecto cupo CRC: 500,000

Origen: Next Day

Negociado en: DIRECTO

Confirmar Rechazar

NUEVO PROCESO DE MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

4. En el caso de las operaciones de contado compensadas por la CRCC, una vez la contraparte acepte la solicitud el sistema enviará la petición a la CRCC para su autorización. En caso de ser autorizada, la operación será modificada tanto en el sistema SET-FX como en la CRCC. Si la contraparte o la CRCC rechazan la solicitud de modificación, la operación quedará vigente en los términos iniciales.
5. Una vez la operación es modificada, la letra “M” cambia de color rojo a azul en el campo “Sc”. Si la solicitud es rechazada, la letra “M” desaparece.

Dólar Next Day - Transacciones					
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto Cód.	A R E Ori vC FV I C sC sM pA nC M
15:25:00	ALBERTO	Venta	3950.00	250	A R N 1 C X
Total compras sucursal:					
Total ventas sucursal:		250,000	3950.00		
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
SDM:			250,000		250,000
Cupo:	50'250,000		49'750,000		
					Detalle Pérd/Gan

Nota: En la modificación de operaciones con clientes no se requiere aceptación de contraparte por lo que únicamente se requieren los pasos 1 y 5. Si la operación aparece con la letra “M” en el blotter, indica que fue modificada.

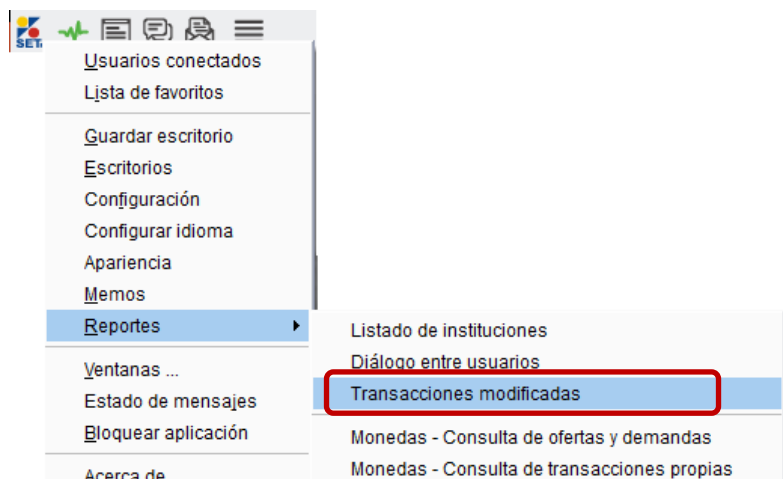
<

NUEVO PROCESO DE MODIFICACIÓN DE OPERACIONES

CONSIDERACIONES

- Operaciones IMC-IMC: Para modificar el Mercado o Contraparte, se deberá anular la operación e ingresar un nuevo registro.
- Operaciones IMC-Cliente: Para modificar el Mercado, se deberá anular la operación e ingresar un nuevo registro.
- No se permite modificar una operación si esta genera cupo cámara negativo.
- Las operaciones conservarán la trazabilidad de la información en los reportes del sistema y en el la historia de la operación.

Reporte de Operaciones Modificadas



Reporte de Operaciones Modificadas

The screenshot shows a window titled 'Dólar Next Day - Historia de transacción'. It contains a table with the following columns: Fecha, Hora, Usuario, Clase, O/D, Precio, Monto, Tr/To, T, and Info adicional. The table lists several transactions, with the 'Clase' column circled in red.

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To	T	Info adicional
27/01/22	15:25:00	CTBB DANIELP	Solicita registro	D	3950.00	250	250		
27/01/22	15:25:28	Motor de calce	Solicitud aceptada	D	3950.00	250	250		
27/01/22	15:25:35	SDMM ALBERTO	Confirmación por Cámara	D	3950.00	250	250		
27/01/22	15:25:00	Motor de calce	Registro	D	3950.00	250	250		
27/01/22	15:29:40	CTBB DANIELP	Solicita modificación	D	3955.00	250	500		
27/01/22	15:42:26	SDMM ALBERTO	Solicita modificación a CRCB	D	3955.00	250	500		

ÍNDICE

1. Resumen Ejecutivo
2. Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones
3. **Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones**
4. Extensión de la Duración de las Sesiones Matching
5. Nueva Opción “Marcar No Cumplida”
6. Mejora en el Registro de Opciones

NUEVO DISEÑO DE LA VENTANA DE MODIFICACIONES

- ✓ Los campos modificados se presentan en color azul para identificarlos más fácilmente.
- ✓ Al acercar el cursor sobre cualquier campo modificado, aparece un tooltip con el dato original del campo.

Dólar Forward - Modificación de transacción

Tipo de transacción: Compra Registrado el: 22/06/21 09:49:54

Mi sucursal: BCLB BANCOLOMBIA

Mi usuario: JANET

Por parte de: Emp

Contraparte: Sucursal: BBVB B.B.V. A BCO BILBAO VISCAYA ARGENTAR

Usuario: FRANCISCOA

Por parte de: BBVB ALEJANDRA RESTREPO

Hora (negociación): Fecha anterior 22-Jun-2021 09:01:23

Origen: Outright

Tasa de referencia: PRECIO FIX SET FX

Inicio: 24/06/2021 Jue 24-Jun-2021

Vencimiento: 22/07/2022 Vie 22-Jul-2022

Fecha asignación: 22/06/2021 Mar 22-Jun-2021

Fecha de pago: 25/07/2022 Lun 25-Jul-2022

Precio Spot: 3769.48

Puntos Forward: 4.00 3.00

Precio Forward: 3773.8

Monto: 700.00 (Unidades)

Modalidad cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: No

Tipo de opcionalidad:

Negociado en: DIRECTO

Aceptar Cancelar

Campos para ID

Otros datos

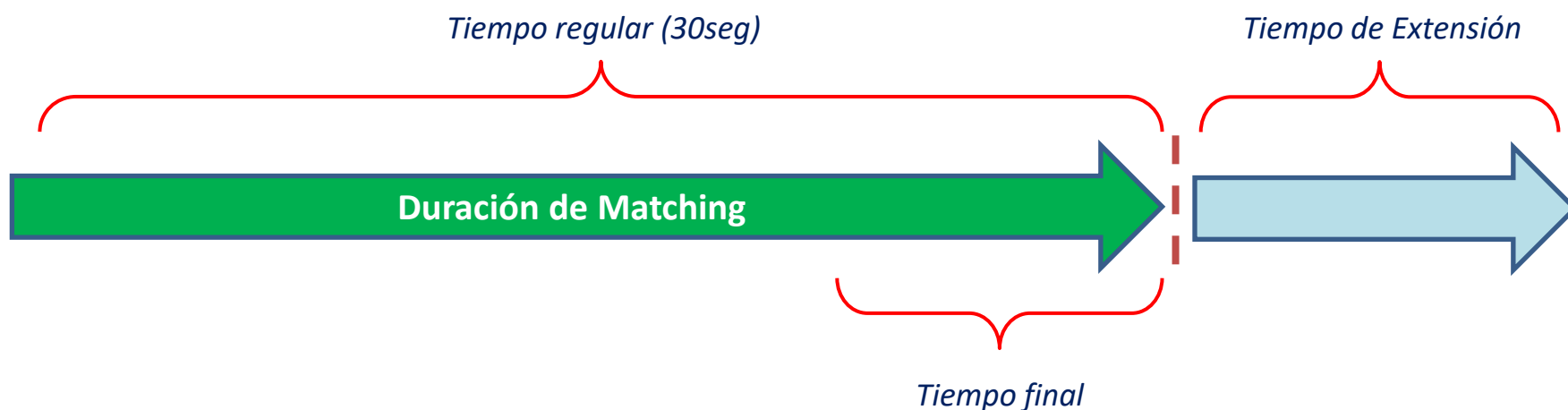
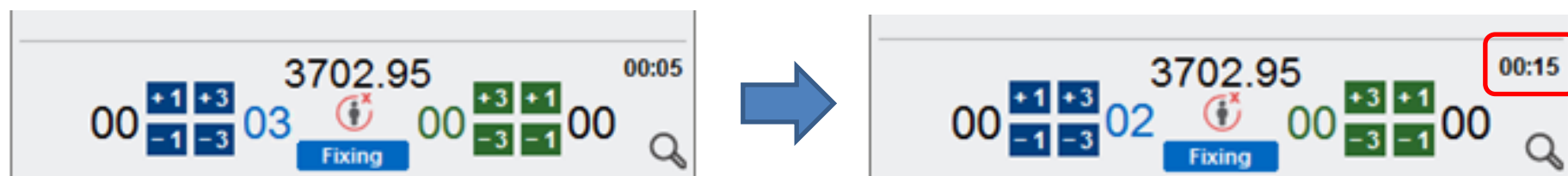
ÍNDICE

1. Resumen Ejecutivo
2. Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones
3. Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones
4. **Extensión de la Duración de las Sesiones Matching**
5. Nueva Opción “Marcar No Cumplida”
6. Mejora en el Registro de Opciones

EXTENSIÓN DE LA DURACIÓN DE LAS SESIONES MATCHING

A partir de la entrada en producción de la nueva versión, será posible que el tiempo de duración de las sesiones Matching pueda extenderse de manera automática en caso de presentarse un calce en los segundos finales.

En caso de presentarse un calce dentro de los últimos X segundos del Matching, la sesión se extenderá por otros X segundos. *(Estos segundos serán definidos mediante Comité Cambiario y serán actualizados la segunda semana de febrero de 2022)*

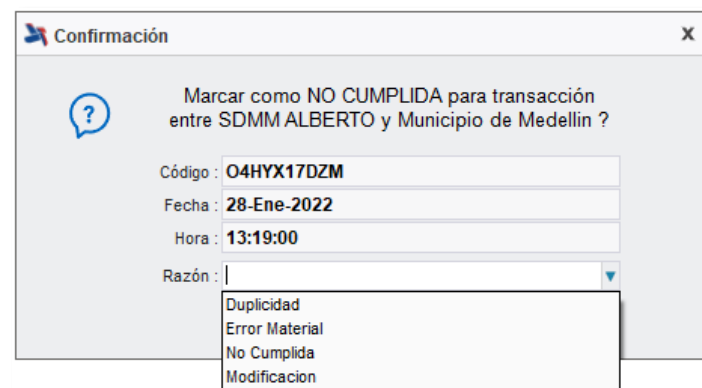
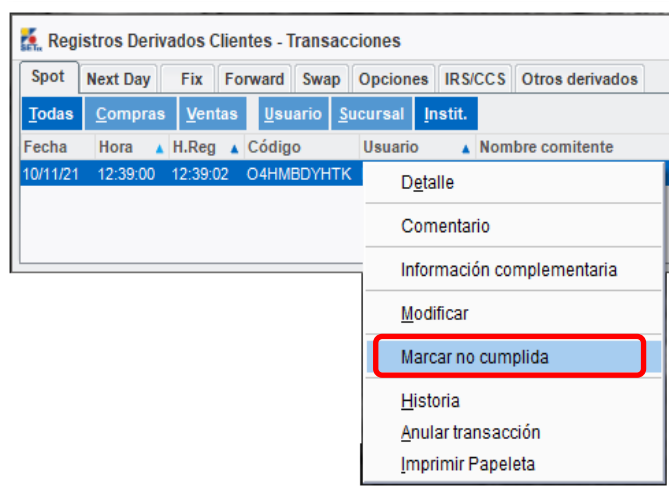


ÍNDICE

1. Resumen Ejecutivo
2. Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones
3. Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones
4. Extensión de la Duración de las Sesiones Matching
5. **Nueva Opción “Marcar No Cumplida”**
6. Mejora en el Registro de Opciones

NUEVA OPCIÓN “MARCAR NO CUMPLIDA”

Al hacer clic derecho sobre una operación con clientes se visualiza la opción “Marcar no cumplida”. Al seleccionar esta opción, se abre la ventana de confirmación en la que se puede especificar la razón por la cual el cliente no cumplió la operación.



Esta marca se visualiza en el blotter de operaciones en el campo *viaja* a través de las interfaces de conexión del Sistema, permitiéndole a las entidades retirar estas operaciones en sus sistemas internos.

Blotter de Operaciones

Par Mnda	Monto	Tasa cambio	B	E	Ori	I	X	p	nC	i
USD / COP	2'000.000.00	3950.0000	S	•					N	

ÍNDICE

1. Resumen Ejecutivo
2. Nuevo Proceso de Modificación de Operaciones
3. Nuevo diseño de la Ventana de Modificaciones
4. Extensión de la Duración de las Sesiones Matching
5. Nueva Opción “Marcar No Cumplida”
6. **Mejora en el Registro de Opciones**

MEJORA EN EL REGISTRO DE OPCIONES

En el registro de operaciones de Opciones, se agrupa “Compra” y “Venta” en el campo “Clase” y se agrupa “Call” y “Put” en el campo “Clase opción”.

Esto reemplaza a los campos:

- Put de compra
- Call de compra
- Put de venta
- Call de venta

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

Clase: COMPRA VENTA Hecho por: Yo CTBB Mi usuario: DANIELP Empleados Nuevo ID

Contraparte Beneficiario Comentario Tercero Offshore

Par de monedas: Peso Dolar

Clase opción: CALL PUT Plazo: Libre Tasa Strike: Tasa pool Strike: Condición del ejercicio: Porcentaje de volatilidad: Negociado en: Fecha anterior: Hora: (Negociación)

Monto: (Unidades) Tasa pactada (Spot): Prima: Tipo de opción: Cumplimiento: NON-DELIVERY

Enviar Nuevo Limpiar

10:23:00 Compra a OTR 1'000,000.00 a 3901.0000 a 1 Semana, Par de monedas USD/COP