

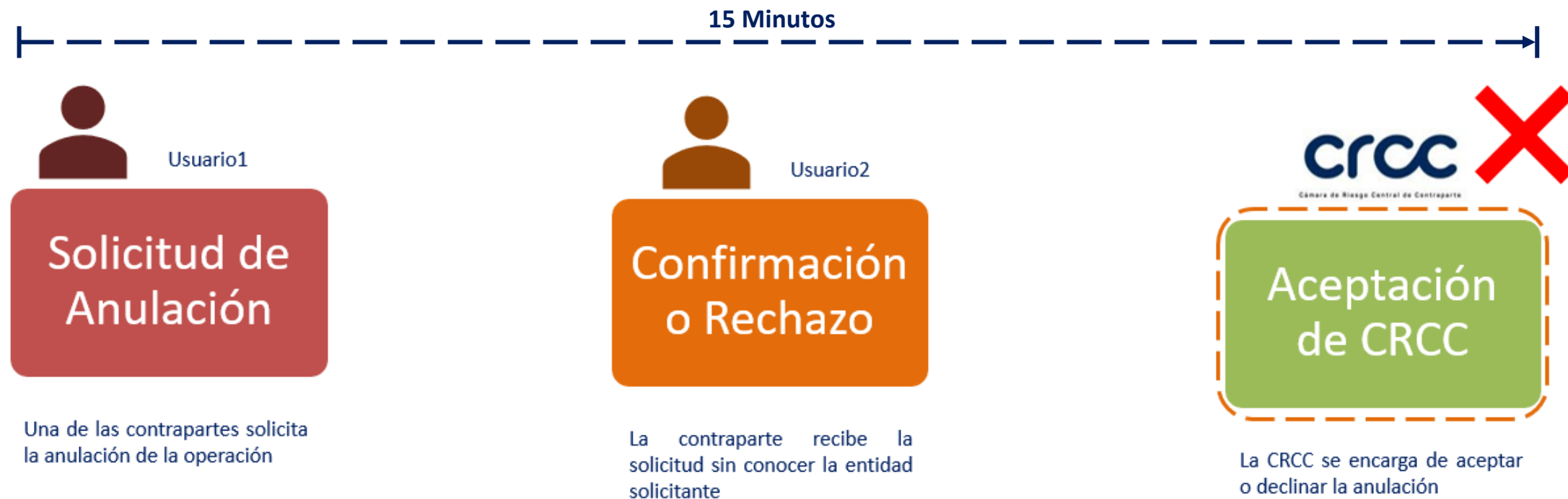
## **MEJORAS Y NUEVAS FUNCIONALIDADES**

Sistema SET-FX  
Versión 7.17



# ACEPTACIÓN AUTOMÁTICA DE CRCC EN MODIFICACIONES Y ANULACIONES

La anulación o modificación de una operación no necesita la aprobación de la CRCC una vez que las contrapartes haya confirmado la solicitud. Este proceso incrementa la eficiencia y reduce los tiempos este proceso.

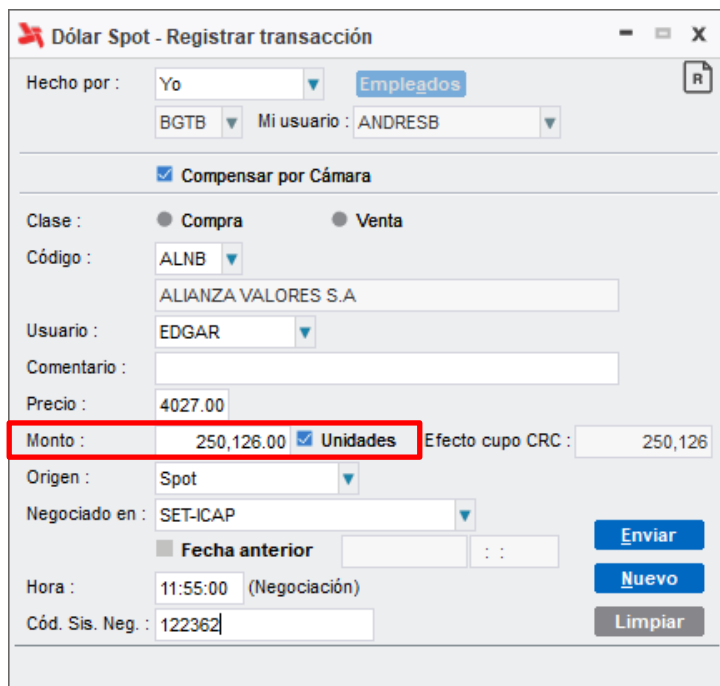


Los procedimientos de anulaciones y modificaciones de operaciones, establecidos en la Circular Reglamentaria Única del Sistema SET-FX, no sufren ningún cambio.

# MEJORAS EN MERCADO SPOT / NEXT DAY / FIX

## REGISTROS CON UNIDADES DECIMALES

Esta mejora permite la inclusión de valores con hasta dos dígitos en el monto de los registros Spot, Next Day y Fix entre IMC. Para habilitarla, se debe seleccionar el checkbox “Unidades” junto al campo “Monto”, con los cual se mostrarán los dos dígitos decimales.



**Dólar Spot - Registrar transacción**

Hecho por : Yo

BGTB

☒ Compensar por Cámara

Clase : ☒ Compra ☐ Venta

Código : ALNB

Usuario : EDGAR

Precio : 4027.00

**Monto : 250,126.00 ☒ Unidades** Efecto cupo CRC : 250,126

Origen : Spot

☐ Fecha anterior

Hora : 11:55:00 (Negociación)

Cód. Sis. Neg. : 122362

## NUEVO MONTO NEGOCIADO PRECIO FIX

En la ventana “Resumen de hoy” del mercado Spot, se incluye el campo “M. Neg. Fix” (Monto negociado precio Fix), el cual muestra el monto total de las operaciones que hacen parte del cálculo del precio FIX.



**Dólar Spot - Resumen de hoy**

Horario : 07:00 - 17:00

**Precios**

Apertura*	4285.00	Promedio :	4210.57	Precio Fix :	4199.93 <input type="button" value="M"/>
Cierre*	4199.93 ↑	Mínimo* :	4199.90	<b>M.Neg.Fix :</b>	<b>1'500</b>
Hora últ. trans*	12:06:29	Máximo* :	4285.00		

**Montos en miles**

Negociado :	2'000	Ultimo* :	1'000	Mínimo :	250
Transacciones :	5	Promedio :	400	Máximo :	1'000

\* No incluye transacciones registradas

# MEJORAS EN MERCADO FIX

## MERCADO TRANSACCIONAL

**Aceptación no dirigida:** Al realizar una orden de compra o venta, el Sistema calza las posturas dando prioridad por orden de llegada. Es decir, cuando el usuario selecciona una postura en la parte inferior de la profundidad, se calzan las posturas en la parte superior, siempre y cuando cuenten con cupo bilateral.

**Eliminación “Total” en agresiones:** La opción “Total” que aparece al intentar agredir una postura será inhabilitada. Esta opción permite ejecutar la operación solo si se calza todo el monto de la postura seleccionada, lo cual ya no será necesario con la nueva metodología del mercado FIX.

**Caso Especial:** En caso de realizar una agresión, el sistema verificará las posturas con la opción “Total” en la profundidad y calzará el monto disponible.

Dolar Fix						
	DEMANDAS			OFERTAS		
	Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód
	12-Jun-2024		250	Hoy		
			255	T		
			260			
			265			
			270			
			275			
			280			
			285			
			290			
			295			
	13-Jun-2024			1 Día		
	14-Jun-2024			2 Días		
	17-Jun-2024			3 Días		

Venta

Dolar Fix

Días : Hoy

Vence : Miércoles 12-Jun-2024

Monto : 500 m

Total : ▼

Aceptar Cancelar

Campo inhabilitado



Dolar Fix						
	DEMANDAS			OFERTAS		
	Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód
	07-Jun-2024		250	Hoy		
			255	T		
			260			
			265			
			270			
			275			
			280			
			285			
			290			
			295			
	11-Jun-2024			1 Día		
	12-Jun-2024			2 Días		
	13-Jun-2024			3 Días		
12:25:51 Compra a				Hoy	300	
SDMB ALVARO de					300	
300 en Hoy						

Montos Calzados

\$250

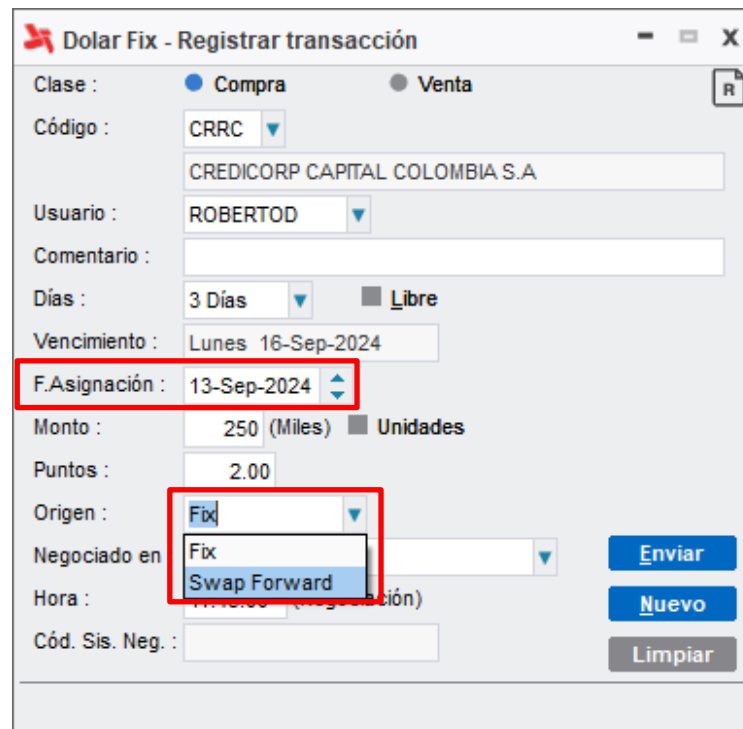
\$250

# MEJORAS EN MERCADO FIX

## VENTANA DE REGISTRO IMC

**Nuevo Campo “Fecha Asignación”:** El usuario puede determinar una fecha de asignación de la tasa de la operación, distinta a la fecha de vencimiento

**Nuevo Campo “Origen”:** A través de este se puede indicar si el origen de la operación es un “FIX” o un “Swap Forward”.

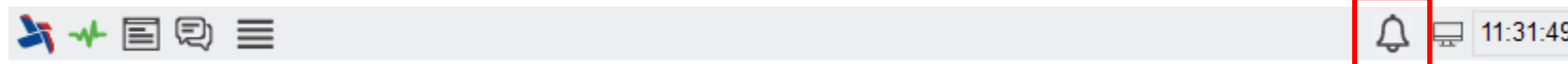



The screenshot shows a web application window titled "Dolar Fix - Registrar transacción". The window contains several form fields for recording a transaction. The "Clase" field has radio buttons for "Compra" (selected) and "Venta". The "Código" field is a dropdown menu showing "CRRC". Below it is a text field containing "CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A.". The "Usuario" field is a dropdown menu showing "ROBERTOD". The "Comentario" field is a text area. The "Días" field is a dropdown menu showing "3 Días", with a checkbox for "Libre" next to it. The "Vencimiento" field shows "Lunes 16-Sep-2024". The "F.Asignación" field is a date picker showing "13-Sep-2024" and is highlighted with a red box. The "Monto" field shows "250 (Miles)" with a checkbox for "Unidades" next to it. The "Puntos" field shows "2.00". The "Origen" field is a dropdown menu showing "Fix" and is highlighted with a red box. Below it is a text field containing "Negociado en". The "Hora" field is a text field containing "11:00 (negociación)". The "Cód. Sis. Neg." field is a text field. At the bottom right, there are three buttons: "Enviar", "Nuevo", and "Limpiar".

# ALERTA DE ACCIONES PENDIENTES

Se implementa una nueva ventana en el Sistema, diseñada para alertar al usuario y generar una lista de notificaciones que requieren atención. Esta lista incluirá elementos como la confirmación de registros, modificaciones, anulaciones, asignaciones de tasas FIX, entre otras acciones de relevancia.



**Acceso:** Barra principal del Sistema



Una vez se recibe una o más alertas que necesiten ser atendida por el usuario, el ícono de acceso se mostrará un indicador intermitente con el número pendientes 

Al hacer clic sobre este ícono, se abre la ventana de Acciones Pendientes

**Ventana:**

Acciones pendientes									
Hora	Operación	Mercado	Transacción			Dirigido a	Contraparte	Estado	X
			Fecha	H. Neg	C/V				
11:38:42	Solicitud de registro	Dólar Spot	17/10/2024	11:38:00	Venta	SDMB ALVARO	SDMB ALVARO	Pendiente	
11:41:38	Solicitud de registro	Dólar Spot	17/10/2024	11:41:00	Venta	SDMB ALVARO	SDMB ALVARO	Pendiente	

Al hacer clic sobre cualquier elemento de la lista, se abre automáticamente la venta o módulo correspondiente, permitiendo al usuario llevar a cabo la acción pendiente de manera directa.

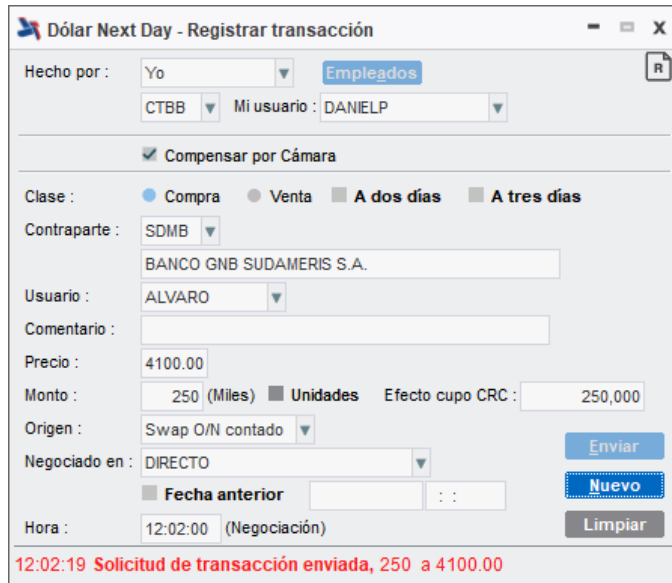
Dólar Spot - Solicitudes de registro									
Todas	Compras	Ventas	Todas	Enviadas	Recibidas	Todas	Expiradas	Confirmadas	Pendientes
H. Neg	Env/Rec	C/V	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	R Estado
11:38:00	Recibida	Venta	SUDAMERIS	BOGOTA	4000.00	250	1,000'000,000	S	R Pendiente
11:41:00	Recibida	Venta	SUDAMERIS	BOGOTA	4000.00	250	1,000'000,000	S	R Pendiente

# OPTIMIZACIÓN DE REGISTROS DE OPERACIONES SWAPS

Esta nueva funcionalidad permite realizar los dos registros una operación Swap Overnight y Swap Forward de una manera más simple y eficiente.

## Pasos para realizar los registros:

1. El usuario debe registrar la operación futura (pata larga), ya sea Next Day o Forward. En ambos casos, se debe indicar que la operación tiene un origen swap:



**Dólar Next Day - Registrar transacción**

Hecho por: Yo

CTBB  Mi usuario: DANIELP

☒ Compensar por Cámara

Clase: ☒ Compra ☐ Venta ☐ A dos días ☐ A tres días

Contraparte:  SDMB

BANCO GNB SUDAMERIS S.A.

Usuario:  ALVARO

Comentario:

Precio:  4100.00

Monto:  250 (Miles) ☐ Unidades Efecto cupo CRC:  250,000

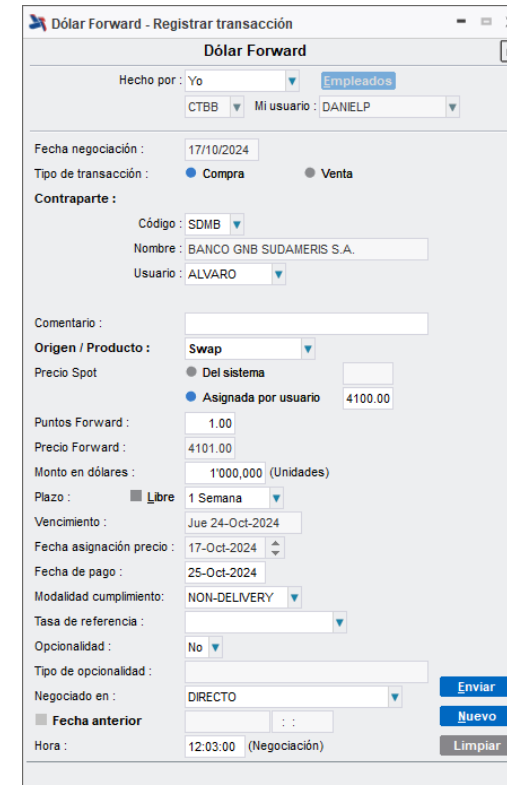
Origen:  Swap O/N contado

Negociado en:  DIRECTO

☐ Fecha anterior  : :

Hora:  12:02:00 (Negociación)

12:02:19 Solicitud de transacción enviada, 250 a 4100.00



**Dólar Forward - Registrar transacción**

Hecho por: Yo

CTBB  Mi usuario: DANIELP

Fecha negociación:  17/10/2024

Tipo de transacción: ☒ Compra ☐ Venta

Contraparte:

Código:  SDMB

Nombre: BANCO GNB SUDAMERIS S.A.

Usuario:  ALVARO

Comentario:

Origen / Producto:  Swap

Precio Spot: ☐ Del sistema ☒ Asignada por usuario  4100.00

Puntos Forward:  1.00

Precio Forward:  4101.00

Monto en dólares:  1'000,000 (Unidades)

Plazo: ☒ Libre  1 Semana

Vencimiento:  Jue 24-Oct-2024

Fecha asignación precio:  17-Oct-2024

Fecha de pago:  25-Oct-2024

Modalidad cumplimiento:  NON-DELIVERY

Tasa de referencia:

Opcionalidad:  No

Tipo de opcionalidad:

Negociado en:  DIRECTO

☐ Fecha anterior  : :

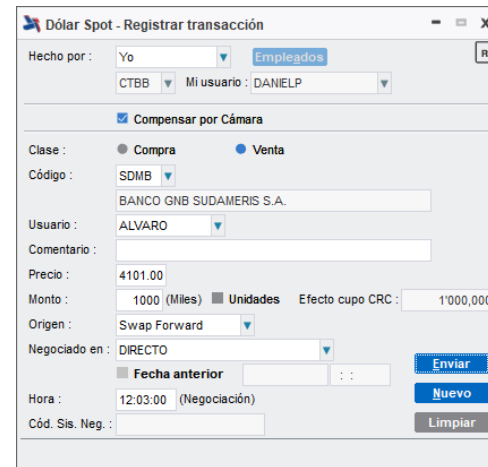
Hora:  12:03:00 (Negociación)

# OPTIMIZACIÓN DE REGISTROS DE OPERACIONES SWAPS

- Una vez confirmada la solicitud de registro por la contraparte, se debe hacer clic derecho sobre la operación en el Blotter de operaciones y seleccionar la opción “Cargar datos Registro Spot”.



- Posteriormente, se abre la ventana de registro Spot con los datos de la operación cargados de manera automática en todos sus campos, incluyendo el lado contrario en el campo clase (Compra/Venta).



The screenshot shows a window titled 'Dólar Spot - Registrar transacción'. It contains a form with the following fields and values: Hecho por: Yo (dropdown), Empleados (button), CTBB (dropdown), Mi usuario: DANIELP (dropdown). There is a checkbox 'Compensar por Cámara' which is checked. Clase: Compra (radio button), Venta (radio button). Código: SDBM (dropdown). Banco: BANCO GNB SUDAMERIS S.A. (text field). Usuario: ALVARO (dropdown). Comentario: (empty text field). Precio: 4101.00 (text field). Monto: 1000 (Miles) (text field), Unidades (checkbox), Efecto cupo CRC: 1'000,000 (text field). Origen: Swap Forward (dropdown). Negociado en: DIRECTO (dropdown). Hora: 12:03:00 (Negociación) (text field). Cód. Sis. Neg.: (empty text field). There are buttons: Enviar, Nuevo, and Limpiar.

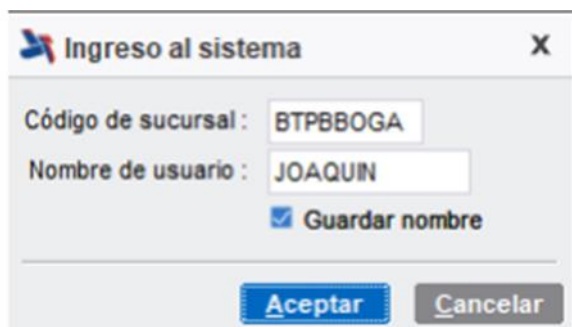
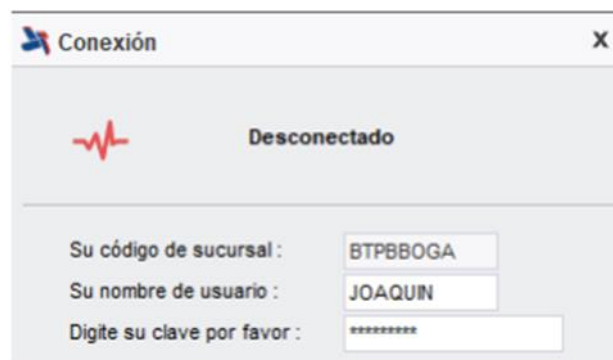
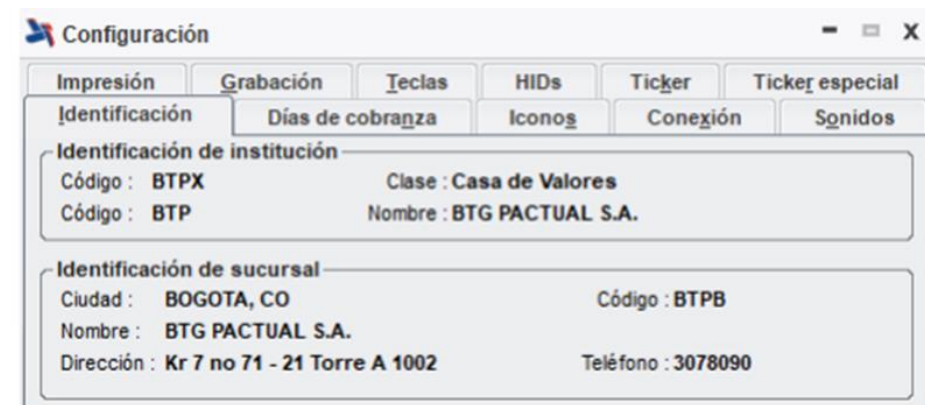
- Finalmente, la contraparte debe confirmar la solicitud de registro y ambas operaciones quedan registradas en sus respectivos Blotters.

# CAMBIO DE NEMOTÉCNICOS – NUEVA VERSIÓN SET-FX

Las entidades afiliadas pueden cambiar el nemotécnico con el que actualmente se identifican siguiendo los siguientes pasos:

1. Solicitar formalmente a SET-ICAP el cambio con el nuevo nemotécnico.
2. Se publicará un Boletín con suficiente antelación para que las entidades afiliadas realicen los ajustes en sus interfaces de conexión y desarrollos.
3. SET-ICAP y la Cámara de Riesgo Central de Contraparte CRCC harán el cambio correspondiente en los tiempos establecidos.

Una vez se realice el ajuste, los usuarios de la entidad que realiza el cambio deberá ajustar cada una de las terminales de sus usuarios mediante una nueva instalación del aplicativo SET-FX, configurando el nuevo código de sucursal.

Hecho el ajuste, las entidades afiliadas deberán identificar el nuevo nemotécnico en la mensajería de las interfaces de conexión del Sistema SET-FX