

BOLETIN INFORMATIVO



Bogotá D.C. Octubre 05 de 2007

No. 032

Asunto:

INFORMACION SOBRE AFILIADOS AL SISTEMA TRANSACCIONAL Y DE REGISTRO DE MONEDA EXTRANJERA ADMINISTRADO POR INTEGRADOS FX S.A

Se informa a todos los afiliados al sistema transaccional y de registro de moneda extranjera Set-FX, que a partir del 08 de octubre del año en curso el sistema Set-FX tendrá en cuenta los festivos de Estados Unidos en su operación. Al respecto se recomienda tener en cuenta las siguientes consideraciones:

Mercado Spot

Las operaciones realizadas en el mercado Spot y/o Dólar Directo cuando en Estados Unidos es un día festivo, deben tener en cuenta lo siguiente:

- 1- Deben realizarse a través del Mercado Spot.
- 2- Validan y afectan los cupos spot del día siguiente hábil colombiano.
- 3- Aparecen en el blotter al día siguiente hábil con una letra "S".
- 4- Afectan las estadísticas del día festivo, pero no afectan las estadísticas del siguiente día hábil.

Mercado Next Day

Las operaciones realizadas en el mercado Next Day cuando en Estados Unidos es un día festivo, deben tener en cuenta lo siguiente:

- 1- El sistema refleja su cumplimiento al día siguiente hábil colombiano.
- 2- Validan y afectan los cupos spot del día siguiente hábil colombiano.
- 3- Aparecen en el blotter al día siguiente hábil con una letra "N", para operaciones Next Day T+2 aparecerá: "NN".
- 4- Afectan las estadísticas del día festivo, pero no afectan las estadísticas del siguiente día hábil.

Mercados Swap y Forward

Las operaciones realizadas en el mercado Swap y Forward cuando en Estados Unidos es un día festivo, deben tener en cuenta lo siguiente:

- 1- La operación Spot que proviene de una operación Swap, funciona de la siguiente manera:
 - a. Validan y afectan los cupos spot del día siguiente hábil colombiano.
 - b. Aparecen en el blotter al día siguiente hábil con una letra "S".

Estaremos disponibles para resolver cualquier inquietud a este respecto.

Sin otro particular,

ANDRES MACAYA DÁVILA
Gerente