

Asunto:

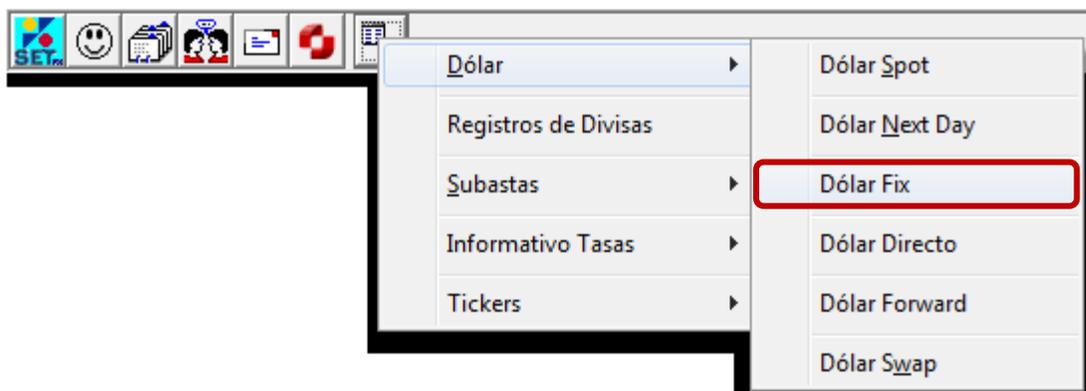
INFORMACIÓN SOBRE EL FUNCIONAMIENTO DEL MODULO FIX

SET ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "Set-FX", se permite recordar a todos sus afiliados que a partir de la versión 6.11 de marzo de 2009 se puso a disponibilidad de todos los afiliados el módulo para negociación y registro de operaciones FIX.

Teniendo en cuenta lo anterior, a continuación nos permitimos recordar los lineamientos generales de funcionamiento del mencionado módulo, por considerarlo de interés y vigencia para todos nuestros afiliados:

1. Ruta de ingreso al módulo

Para ingresar a este módulo, el usuario debe ingresar al Menú Mercados → Dólar → Dólar Fix, como se ilustra a continuación:



La funcionalidad de Dólar FIX puede ser utilizada tanto de manera transaccional, como a través de un registro y permite la negociación de un monto establecido, el cual se pacta a una tasa FIX.

Las operaciones que se cierran a través de esta funcionalidad permanecen en el Blotter del respectivo mercado (Spot o Next Day) pendientes de precio y una vez se genere la tasa FIX, éste será el precio asignado a dichas transacciones.

A continuación se explicarán detalladamente las modalidades transaccional y de registro, el ingreso y agresión de las posturas y la confirmación de los respectivos registros:

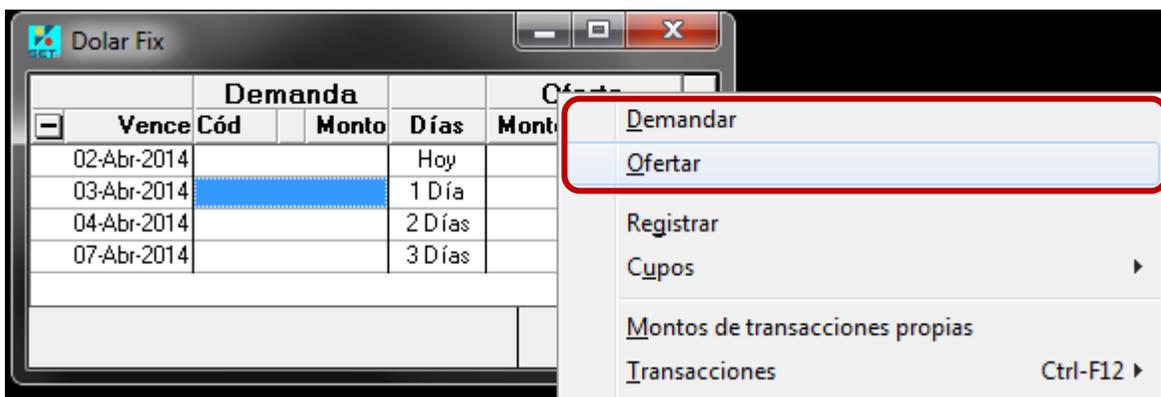
2. Ventana de Posturas (Demanda / Oferta)

La ventana de posturas o ventana transaccional contiene la pila de demanda y de oferta así como las diferentes opciones para cerrar transacciones tanto Spot (t+0), como Next Day (t+1, 2 o 3).



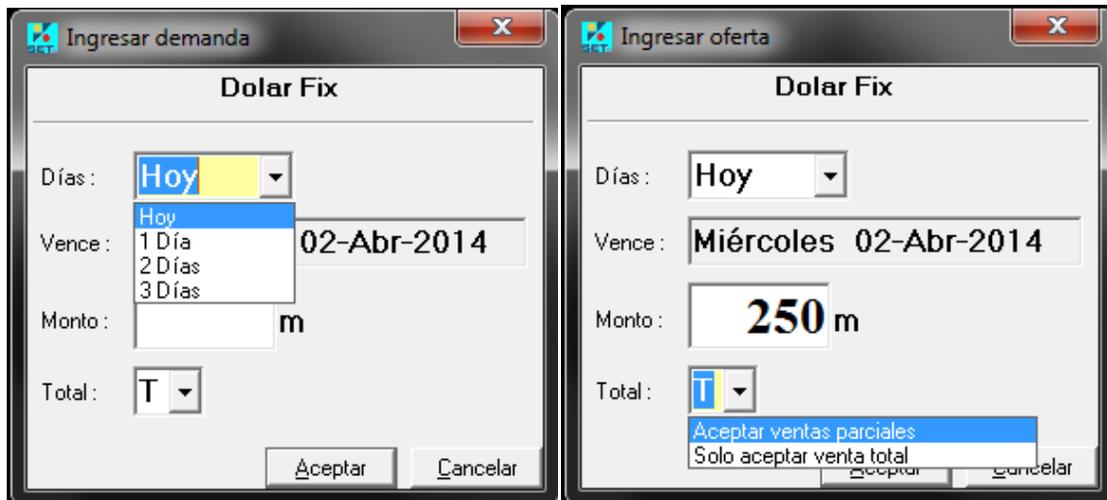
3. Ingresar una Demanda / Oferta

Para ingresar una demanda u oferta el usuario debe hacer clic derecho en él encabezado la ventana de posturas y seleccionar la opción (Demandar/Ofertar) o presionar la tecla F5 para ingresar una demanda o F6 para ingresar una oferta.



Una vez seleccionada la opción, el usuario debe establecer las condiciones del Fix:

- Días: T+0 / T+1 / T+2 / T+3
- Monto: en múltiplos de USD \$250 mil
- Total: (T) Solo acepta venta total / () Acepta venta parciales



Una vez ingresadas las posturas, éstas serán visualizadas por las contrapartes en la ventana transaccional. Si se trata del postulante, éste podrá identificar sus posturas así:

- **Ventana del Postulante**

		Demanda			Oferta	
	Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód
	02-Abr-2014	SCTB	T 250	Hoy		
	03-Abr-2014	SCTB	500	1 Día		
	04-Abr-2014	SCTB	T 1000	2 Días	750 T	SCTB
	07-Abr-2014	SCTB	250	3 Días		

Por otro lado, las contrapartes podrán visualizar las posturas ingresadas, con el correspondiente indicador de disponibilidad de cupo, el cual no sólo tiene en cuenta los cupos bilaterales sino también los cupos multilaterales de Cámara.

- **Ventana de la Contraparte**

Demanda					Oferta	
Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód	
02-Abr-2014	●	T 250	Hoy			
03-Abr-2014	●	500	1 Día			
04-Abr-2014	●	T 1000	2 Días	750 T ●		
07-Abr-2014	●	250	3 Días			

4. Agredir una postura

Para agredir una postura el participante debe hacer clic derecho en la postura deseada y seleccionar comprar o vender según sea el caso.

Demanda					Oferta	
Vence	Cód	Monto	Días	Monto	Cód	
02-Abr-2014	●	T 250	Hoy			
03-Abr-2014	●	500	1 Día			
04-Abr-2014	●	T 1000	2 Días	750 T ●		
07-Abr-2014	●	250	3 Días			

Context menu options: **Vender**, Detalle, Modificar, Retirar

Una vez seleccionada la opción de compra o venta aparecerá una nueva ventana con el detalle de la operación. Si la postura fue configurada con venta parcial se podrá seleccionar el monto a agredir.

Venta

Dolar Fix

Días: Hoy

Vence: Miércoles 02-Abr-2014

Monto: 250 m

Total: [dropdown]

Aceptar Cancelar

Luego de aceptar la transacción, esta aparecerá en el blotter de operaciones del modulo Fix como se muestra a continuación:

Hora	Usuario	C/V	Monto	Días	Vence	Cód.	Ori	A	R
14:37:41	ALEJANDRO	Compra	250	Hoy	02/04/2014	VBCB	X0		
14:38:28	ALEJANDRO	Compra	250	Hoy	02/04/2014	VBCB	X0		
14:41:33	ALEJANDRO	Venta	750	2 Días	04/04/2014	VBCB	X2		

Una vez se determine el precio del Fix del día, la operación aparecerá en el blotter de operaciones del mercado Spot con identificación en la columna "Ori" con los valores: "X0" para spot o "X1, X2 o X3" para Next Day (dependiendo del cumplimiento) y con el respectivo precio ya asignado.

Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	Ori	A	R	E	C
14:37:41	ALEJANDRO	Compra	2000.00	250	VBCB	X0				
14:38:28	ALEJANDRO	Compra	2000.00	250	VBCB	X0				
15:12:00	ALEJANDRO	Compra	2000.00	250	VBCB	X0				

Total compras sucursal:		750,000	2000.00
Total ventas sucursal:			

En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
SCT:					
Cupo:	100'000,000		100'000,000		Detalle Pérd/Gan

Estado de transferencias: Compensación pendiente

5. Registro de una operación en el mercado Fix

Para realizar un registro en el modulo fix el usuario debe seleccionar el botón "registrar" y completar las características de la operación en los siguientes términos:

