

Asunto:**PROCEDIMIENTO PARA LA FRAGMENTACIÓN DE OPERACIONES EN EL SISTEMA SET-FX**

SET ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "Set-FX", se permite informar a todos sus afiliados que de conformidad con lo establecido en la circular reglamentaria DODM-317 del Banco de la República, los intermediarios de mercado cambiario (IMC) están obligados a registrar todas las operaciones de derivados sobre divisas sin importar el monto nominal de la operación así como todas las modificaciones realizadas a las condiciones iniciales de las mismas, durante el tiempo de vigencia de la operación.

En este sentido SET ICAP FX se permite informar el procedimiento provisional habilitado para el fraccionamiento de operaciones de Derivados sobre divisas registradas en el Sistema SET-FX:

Para aquellos casos en los cuales un afiliado requiera fragmentar una operación de derivados Forward o Swap entre IMC y un no afiliado, registrada previamente en el Sistema, se deberá modificar la operación original de modo que esta corresponda a la fracción inicial y realizar tantos registros como fracciones restantes de la operación.

Tanto la fracción inicial como todas las fracciones restantes deberán marcarse en el campo opcionalidad con la letra "F" mayúscula seguida de la fecha de negociación de la operación original siguiendo el formato AAAAMMDD sin espacios.

Ejemplo: F20140806.

Registros Derivados - Registrar transacción

Spot Next Day Forward Swap Opciones IBS/CCS Otros derivados

IMC's Clase: COMFRA Hecho por: Yo VBCB: Mi usuario: SANTIAGO Empleados

Clase Id: Cédula nueva Id: 1.014.859.932 WIGODA JARAMILLO NICOLE Nuevo Id

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

Comentario:

Par de monedas: USD / COP **Peso Dólar**

Plazo: 1 mes Libre Jueves 04-Sep-2014

Fecha de pago: 04-Sep-2014

Monto USD: 1'000.000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 1890.0000

Tasa spot: 1870.0000

Tasa referencial:

Origen:

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: **F20140806**

Enviar

Nue

Empiar

El presente procedimiento provisional entra en vigencia a partir del 1 de Septiembre de 2014. Así mismo SET-ICAP informará oportunamente a los afiliados la fecha a partir de la cual estará disponible la funcionalidad del sistema SET-FX para fragmentar operaciones, reemplazando el procedimiento provisional informado.

Estaremos atentos para resolver cualquier inquietud sobre este procedimiento en nuestras líneas de soporte: 7427777 Ext.: 220, 221 y 222.

Sin otro particular,

(Original firmado)

ANDRÉS MACAYA DÁVILA

Presidente