



MANUAL PARA REGISTRO DE OPERACIONES FIX (IMC-IMC IMC-Clientes)



Con ocasión de la entrada en vigencia de la norma con Circular Externa - DODM – 317 (Boletín No 36 del 26 de Junio de 2015) del Banco de República, SET-ICAP FX S.A. lanzará al mercado una actualización al sistema SET-FX durante la última semana de Septiembre de 2015, de modo que los afiliados puedan dar cumplimiento a los requerimientos establecidos en dicha norma para su entrada en vigencia (1 de Octubre de 2015).

El presente manual tiene como objetivo explicar el procedimiento para el registro de operaciones cuya tasa no se conoce al momento de la negociación.

El documento está dividido en cuatro partes:

1. Operaciones FIX (IMC – IMC)
2. Operaciones FIX Forward (IMC – IMC) (USD/COP)
3. Operaciones FIX (IMC – Clientes) (USD/COP)
4. Operaciones FIX Forward (IMC – Clientes) (Todas las monedas)

En cada sección se explicará el procedimiento detallado de registro de cada tipo de operación así como las herramientas del sistema para tal propósito.

FUNCIONALIDAD DE REGISTRO – OPERACIONES FIX

1

Operaciones FIX
IMC-IMC

3

Operaciones FIX
IMC – Clientes (USD/COP)

2

Operaciones Forward FIX
IMC – IMC (USD/COP)

4

Operaciones FIX Forward
IMC – Clientes (Todas las
Monedas)

FUNCIONALIDAD DE REGISTRO – OPERACIONES FIX

1

Operaciones FIX
IMC-IMC

3

Operaciones FIX
IMC – Clientes (USD/COP)

2

Operaciones Forward FIX
IMC – IMC (USD/COP)

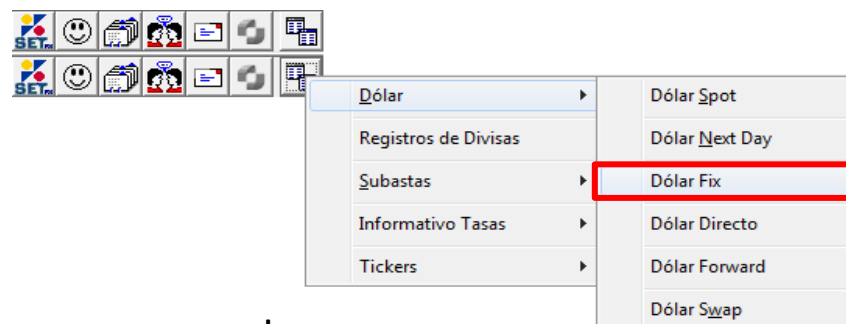
4

Operaciones Forward FIX
IMC – Clientes (Todas las
monedas)

1. Operaciones FIX IMC-IMC

Para registrar las operaciones de Dólar FIX USD/COP entre IMC es necesario seguir los siguientes pasos:

1. Se ingresa a la ventana del mercado Dólar FIX.



2. Se hace click en la pestaña de registro, tal como se muestra a continuación:



3. Se abre la ventana Registrar transacción en donde se realiza el registro en el momento de la negociación. (De T+0 a T+3)

A screenshot of a window titled 'Dolar Fix - Registrar transacción'. The window contains several input fields and buttons. The 'Clase' field has two radio buttons: 'Compra' (selected) and 'Venta'. The 'Código' field has a dropdown menu showing 'AGRB'. Below it is a text field containing 'BANCO AGRARIO'. The 'Usuario' field has a dropdown menu showing 'EDUARDO'. The 'Comentario' field is empty. The 'Días' field has a dropdown menu showing 'Hoy'. The 'Vencimiento' field shows 'Martes 15-Sep-2015'. The 'Monto' field shows '500 m (Miles)'. The 'Negociado en' field has a dropdown menu showing 'ICAPCO'. At the bottom right, there are two buttons: 'Aceptar' and 'Cancelar'.

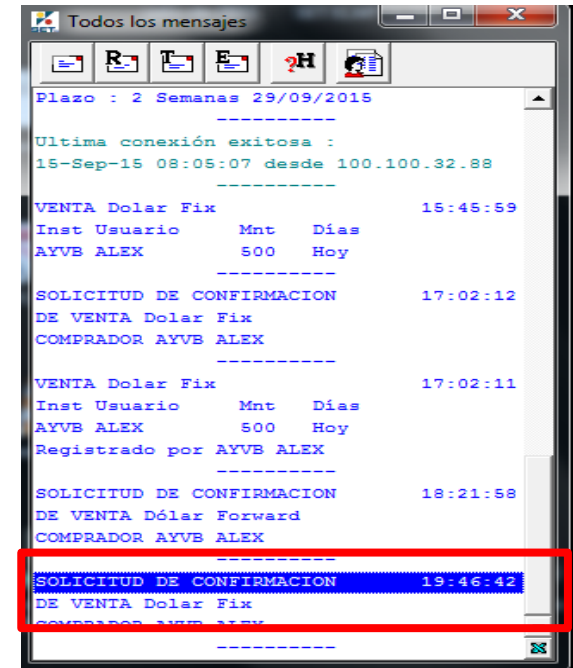
1. Operaciones FIX IMC-IMC

4. Posteriormente llegará un mensaje de chat a la contraparte solicitando la confirmación del registro.



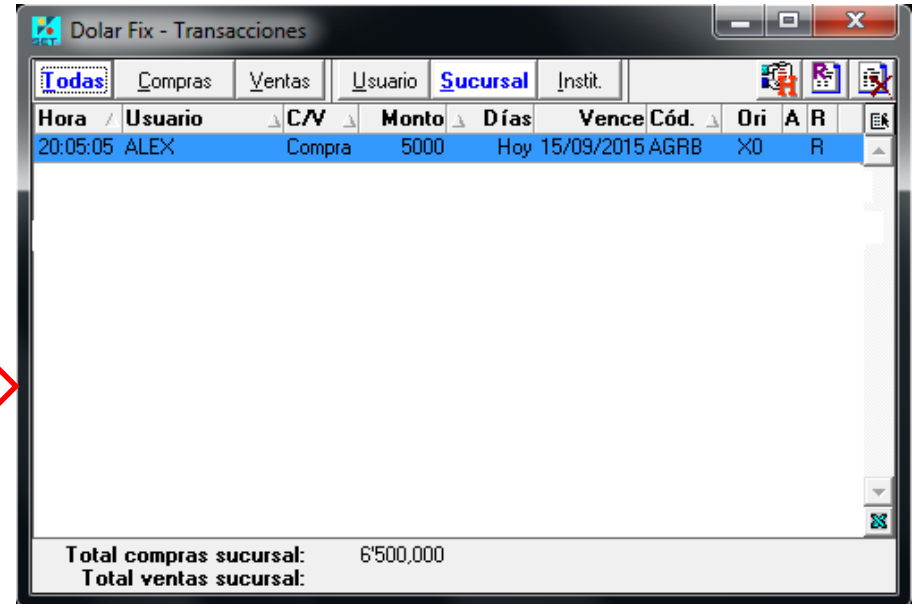
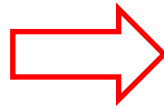
5. Se hace doble clic sobre el mensaje correspondiente a la transacción.

6. Luego aparecerá la ventana de confirmación del registro como se muestra a continuación:



1. Operaciones FIX IMC-IMC

7. Una vez la contraparte confirme el registro, la operación aparecerá en el Blotter o resumen de operaciones FIX.



Hora	Usuario	C/V	Monto	Días	Vence	Cód.	Ori	A	R
20:05:05	ALEX	Compra	5000	Hoy	15/09/2015	AGRB	X0		R

Total compras sucursal: 6'500,000
Total ventas sucursal:

Nota: A la 1:11 PM el sistema asignará automáticamente la tasa promedio del mercado USD/COP Spot y la operación pasará al resumen de operaciones Spot. El registro de operaciones FIX entre IMC estará disponible únicamente para operaciones T+0 hasta T+3.

En el caso de estas operaciones, el sistema controlará los cupos bilaterales al momento de la negociación, de acuerdo con la configuración realizada en el sistema y también serán enviadas a la Cámara de Compensación de Divisas de acuerdo con la configuración realizada para tal envío (obligatorio envío a CCD/ envío opcional).

FUNCIONALIDAD DE REGISTRO – OPERACIONES FIX

1

Operaciones FIX
IMC – IMC

3

Operaciones FIX
IMC – Clientes (USD/COP)

2

Operaciones Forward FIX
IMC-IMC (USD/COP)

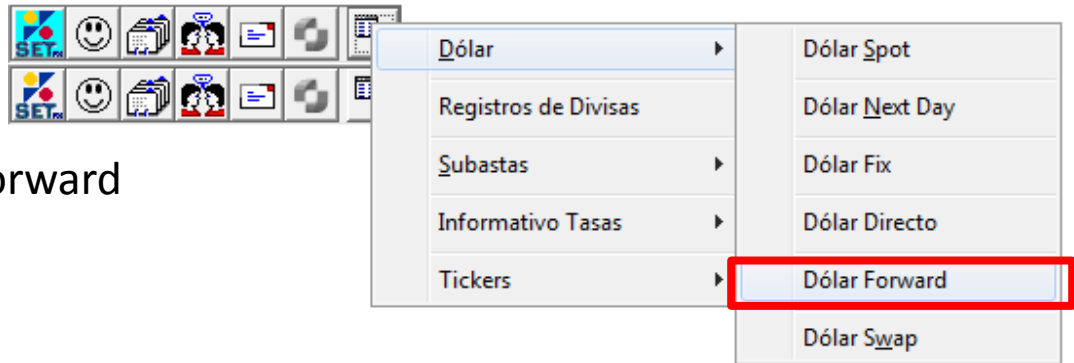
4

Operaciones FIX Forward
IMC – Clientes (Todas las
monedas)

2. Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

Para realizar registros FIX Forward entre IMC, se debe utilizar el módulo de registro de operaciones Forward existente en la actualidad siguiendo los siguientes pasos:

1. Se ingresa a la ventana Dólar Forward



2 Dar click para poder realizar el registro.

2. Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

The screenshot shows a software window titled 'Registrar transacción' with a sub-header 'Dólar Forward'. The form contains the following fields and values:

- Hecho por: Yo (dropdown), Empleados (text)
- AYVB (dropdown), Mi usuario: ALEX (dropdown)
- Fecha negociación: 15/09/2015
- Tipo de transacción: Compra (dropdown)
- Contraparte:
 - Código: AGRB (dropdown)
 - Nombre: BANCO AGRARIO
 - Usuario: EDUARDO (dropdown)
- Comentario: (empty text field)
- Precio Spot: Del sistema (radio button selected)
- Puntos Forward: 7.00 (text field, highlighted with a red box)
- Precio Forward: (empty text field)
- Monto en dólares: 5,000 (Unidades)
- Plazo: Libre (checkbox), 2 Semanas (dropdown)
- Vencimiento: Mar 29-Sep-2015
- Fecha de pago: 30-Sep-2015
- Modalidad cumplimiento: NON-DELIVERY (dropdown)
- Tasa de referencia: (empty dropdown)
- Opcionalidad: (empty dropdown)
- Tipo de opcionalidad: (empty dropdown)
- Origen: Fix (dropdown, highlighted with a red box and showing a list with 'Fix' selected)
- Negociado en: (empty dropdown)
- Hora: (empty dropdown)

At the bottom right are 'Aceptar' and 'Cancelar' buttons. Red arrows point from the 'Puntos Forward' and 'Origen' fields to the corresponding steps in the text on the right.

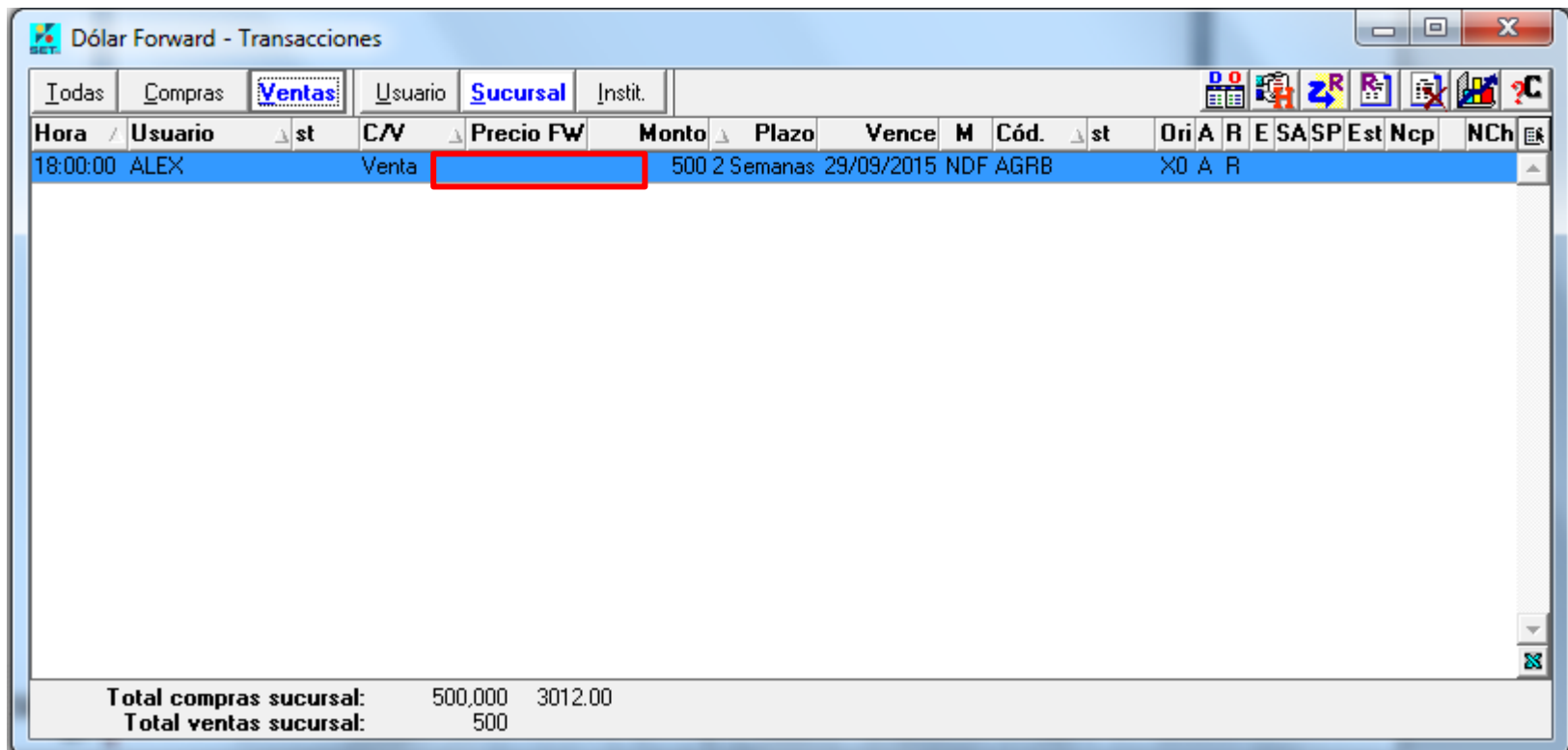
3. Se ingresan los datos generales de la operación pero sin asignar tasa Spot (Dado que en el momento de la negociación no se conoce esta tasa).

4. Se deben asignar los puntos forward.

5. En el campo “origen” se debe seleccionar la opción: “FIX”. **Nota:** si no se selecciona dicha opción, el sistema no permitirá el envío del registro para la confirmación de la contraparte.

2. Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

6. Luego de que la contraparte ha confirmado la operación, esta aparecerá en el resumen de operaciones (Blotter) del mercado Forward, como se muestra a continuación (sin el precio Forward, dado que no se ha ingresado el precio Spot/FIX)



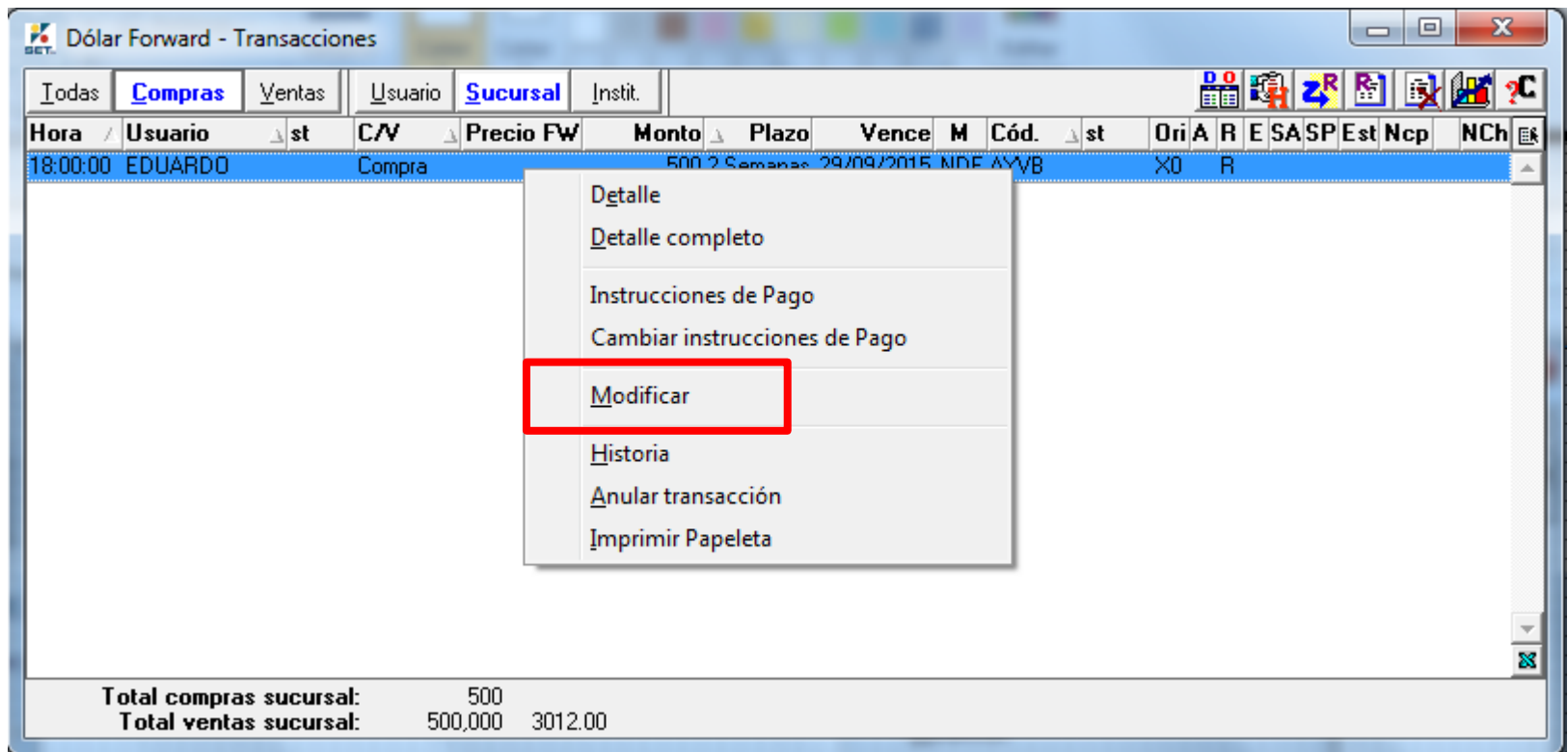
The screenshot shows a software window titled "Dólar Forward - Transacciones". It features a menu bar with "Todas", "Compras", and "Ventas" (the last one is highlighted). Below the menu bar are fields for "Usuario", "Sucursal", and "Instit.". A toolbar with various icons is located to the right of these fields. The main area contains a table with the following columns: Hora, Usuario, st, C/V, Precio FW, Monto, Plazo, Vence, M, Cód., st, Ori, A, R, E, S, A, S, P, Est, Ncp, NCh. A single transaction is listed with the following data: Hora: 18:00:00, Usuario: ALEX, st: (blank), C/V: Venta, Precio FW: (highlighted with a red box), Monto: 500, Plazo: 2 Semanas, Vence: 29/09/2015, M: NDF, Cód.: AGRB, st: (blank), Ori: X0, A: A, R: R. At the bottom of the window, there is a summary section with the following text: "Total compras sucursal: 500,000 3012.00" and "Total ventas sucursal: 500".

Hora	Usuario	st	C/V	Precio FW	Monto	Plazo	Vence	M	Cód.	st	Ori	A	R	E	S	A	S	P	Est	Ncp	NCh
18:00:00	ALEX		Venta		500	2 Semanas	29/09/2015	NDF	AGRB		X0	A	R								

Total compras sucursal: 500,000 3012.00
Total ventas sucursal: 500

2. Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

7. En el momento en que el usuario conozca la tasa, deberá ingresar al blotter de operaciones y dar clic derecho sobre la operación respectiva.



2Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

The screenshot shows a software window titled 'Registrar transacción' with a sub-header 'Dólar Forward'. The window contains various input fields for transaction details. A red rectangle highlights the 'Precio Spot' section, which includes two radio buttons: 'Del sistema' (unselected) and 'Asignada por usuario' (selected). The 'Asignada por usuario' option has a text field next to it containing the value '3020.00'. A red arrow points from this highlighted section to the right, towards the accompanying text.

Hecho por: Yo
AYVB

Fecha negociación: 15/09/2015
Tipo de transacción: Compra

Contraparte:
Código: AGRB
Nombre: BANCO AGRARIO
Usuario: EDUARDO

Comentario:

Precio Spot
☐ Del sistema
☒ Asignada por usuario 3020.00

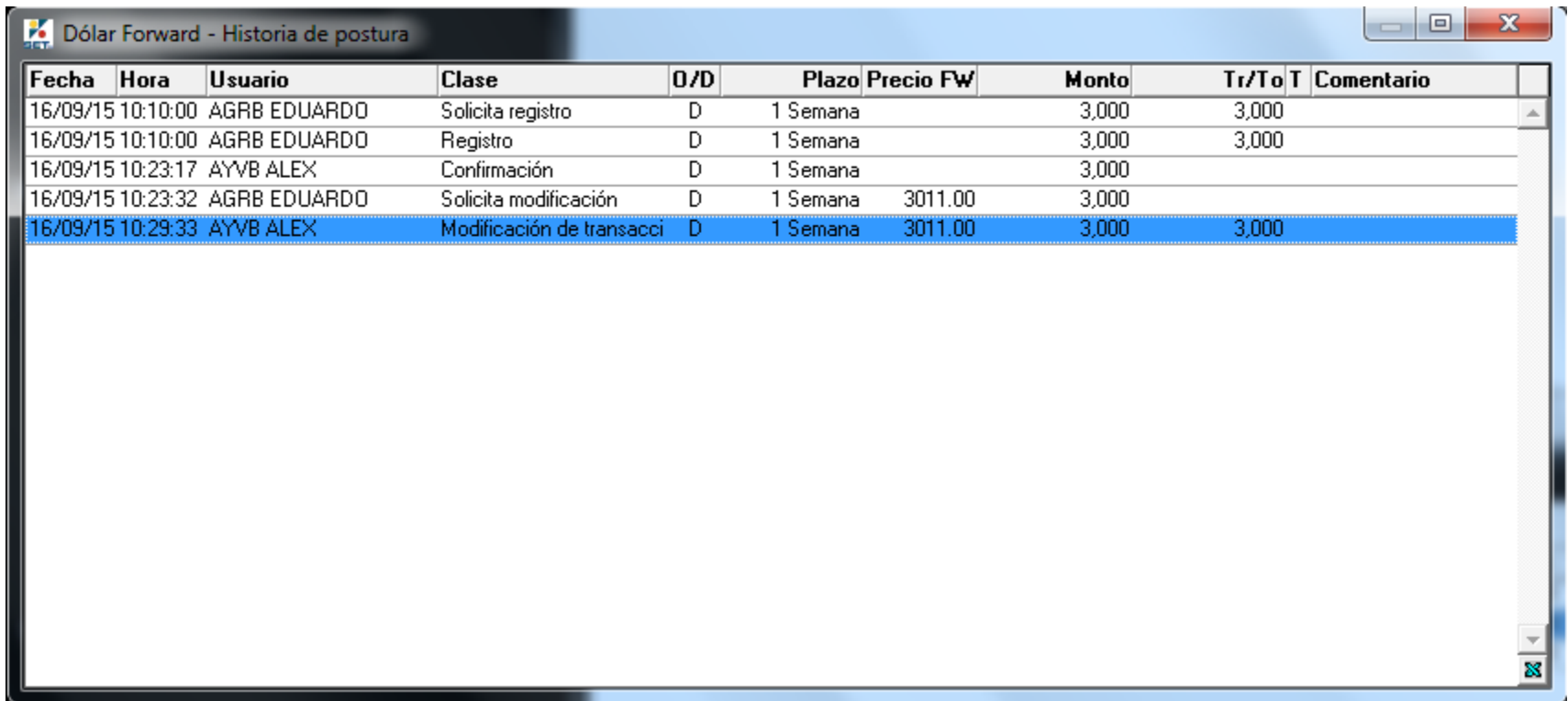
Puntos Forward: 7.00
Precio Forward:
Monto en dólares: 5,000 (Unidades)
Plazo: ☐ Libre 2 Semanas
Vencimiento: Mar 29-Sep-2015
Fecha de pago: 30-Sep-2015
Modalidad cumplimiento: NON-DELIVERY
Tasa de referencia:
Opcionalidad:
Tipo de opcionalidad:
Origen: Fix
Negociado en: ICAPCO
Hora: 18:00:00 (Negociación)

8. En este punto, se abren los detalles de la operación y se asigna la tasa Spot.

Dado que la operación ya quedó con todos los datos completos, quedará disponible también para ser enviada a la CRCC si fuera el caso.

2. Operaciones Forward FIX IMC-IMC (USD/COP)

9. Una vez asignada la tasa, el usuario podrá consultar en el Blotter la historia de la transacción (Click derecho ☐ historia) en donde aparecerán el momento inicial de registro de la operación y el momento en que se asignó la tasa.



The screenshot shows a software window titled "Dólar Forward - Historia de postura". It contains a table with the following columns: Fecha, Hora, Usuario, Clase, O/D, Plazo, Precio FW, Monto, Tr/To, and Comentario. The table lists five transactions from 16/09/15. The last transaction, at 10:29:33, is highlighted in blue and shows a rate change from 3011.00 to 3011.00.

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Plazo	Precio FW	Monto	Tr/To	Comentario
16/09/15	10:10:00	AGRB EDUARDO	Solicita registro	D	1 Semana		3,000	3,000	
16/09/15	10:10:00	AGRB EDUARDO	Registro	D	1 Semana		3,000	3,000	
16/09/15	10:23:17	AYVB ALEX	Confirmación	D	1 Semana		3,000		
16/09/15	10:23:32	AGRB EDUARDO	Solicita modificación	D	1 Semana	3011.00	3,000		
16/09/15	10:29:33	AYVB ALEX	Modificación de transacci	D	1 Semana	3011.00	3,000	3,000	

FUNCIONALIDAD DE REGISTRO – OPERACIONES FIX

1

Operaciones FIX
IMC – IMC

3

Operaciones FIX
IMC – Clientes (USD/COP)

2

Operaciones FIX Forward
IMC – IMC (USD/COP)

4

Operaciones FIX Forward
IMC – Clientes (Todas las
monedas)

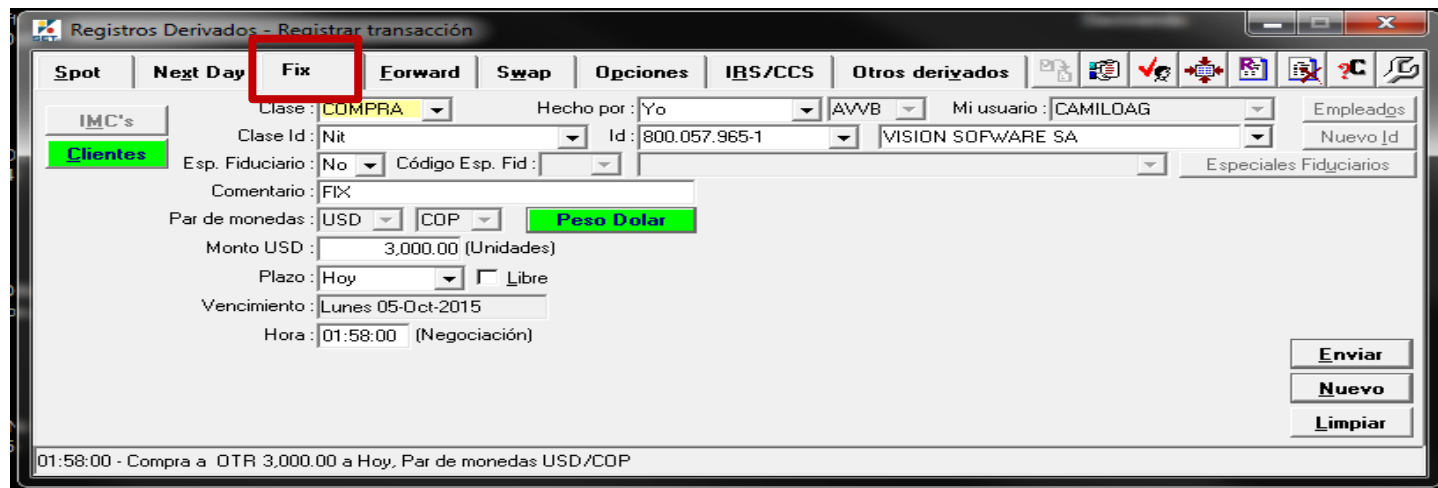
3. Operaciones FIX IMC – Clientes (USD/COP)

Para realizar el registro de operaciones FIX entre un IMC y su cliente, se debe utilizar el módulo de operaciones IMC-Clientes, en el cual se creó una nueva pestaña para las Operaciones FIX, como se muestra a continuación:

1. Ingresar a la ventana “Registro de Divisas”.



2. Al momento de la negociación, se debe realizar el registro en la nueva pestaña “FIX”, ingresando todos los datos de la operación excepto el precio:



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

Clase: COMPRA Hecho por: Yo AWVB Mi usuario: CAMILOAG Empleados
Clase Id: Nit Id: 800.057.965-1 VISION SOFTWARE SA Nuevo Id
Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Especiales Fiduciarios
Comentario: FIX
Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**
Monto USD: 3,000.00 (Unidades)
Plazo: Hoy Libre
Vencimiento: Lunes 05-Oct-2015
Hora: 01:58:00 (Negociación)

Enviar
Nuevo
Limpiar

01:58:00 - Compra a OTR 3,000.00 a Hoy, Par de monedas USD/COP

3. 3. Operaciones FIX IMC – Clientes (USD/COP)

3. Una vez realizado el registro de la operación, este podrá visualizarse en el resumen de operaciones IMC-Clientes:



Ventana de Resumen de Operaciones IMC-Clientes

The screenshot displays the 'Registros Derivados Clientes - Transacciones' window. The 'Spot' tab is selected, and the 'Todas' sub-tab is active. The table below shows a single transaction record.

Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Precio spot	Días	Vence	Ori
18:00:00	ALEX	MIGUEL SAAVEDRA E HIJOS Y CIA	Compra	USD / COP	5.000.00		Hoy 15/09/2015	X0	●

3. Operaciones FIX IMC – Clientes (USD/COP)

4. Una vez finalizada la jornada de negociación Spot, (01:11PM), el usuario debe asignar manualmente el precio spot de cada operación.

Nota: solamente se podrá asignar precio a las operaciones que tengan vencimiento ese mismo día, las cuales estarán resaltadas en color rojo para mejorar su visualización.

The screenshot displays the 'Registros Derivados Clientes - Transacciones' window. The table lists transactions with columns: Hora, Usuario, Nombre comitente, TE C/V, Par Mnda, Monto, Precio spot, Días, Vence, and Ori. A transaction is highlighted with a red date '05/10/2015'. A context menu is open over this transaction, with 'Asignar precio Spot' highlighted. To the right, the 'Registros Derivados - Asignación de precio Spot' dialog box is shown, with the 'Precio spot' field set to '3050.50'.

Para asignar el precio Spot, el usuario deberá dar click derecho sobre la operación correspondiente e ingresar a la opción: “Asignar precio Spot” en cuyo caso aparecerá el detalle de la operación y el usuario digita el precio respectivo.

3. Operaciones FIX IMC – Clientes (USD/COP)

5. Después de haber sido asignado el precio Spot, este podrá visualizarse en la ventana de operaciones (Pestaña FIX) en el campo “Precio spot”, y se elimina el resaltado rojo sobre la columna: “vence”.

Registros Derivados Clientes - Transacciones

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados		
Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Instit.				
Hora	Usuario	Nombre comitente	TE C/V	Par Mnda	Monto	Precio spot	Días	Vence	Or
01:58:00	CAMILOAG	VISION SOFTWARE SA	R Compra	USD / COP	3,000.00	3050.50	Hoy 05/10/2015	0	

6. En cualquier momento, el usuario podrá dar Click derecho ☐ Historia y podrá visualizar tanto el registro de la operación inicial sin tasa así como el momento de asignación de la tasa.



Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Pazo	Vence	Comentario
15/09/15 18:00:00		AYVB ALEX	Registro	D	USD / COP	5,000			Hoy 15/09/2015	
15/09/15 18:40:39		AYVB ALEX	Asignación de precio	D	USD / COP	5,000	3050.0000		Hoy 15/09/2015	

FUNCIONALIDAD DE REGISTRO – OPERACIONES FIX FORWARD IMC-CLIENTE

1

Operaciones FIX
IMC – IMC

3

Operaciones FIX
IMC – Clientes (USD/COP)

2

Operaciones FIX Forward
IMC – IMC (USD/COP)

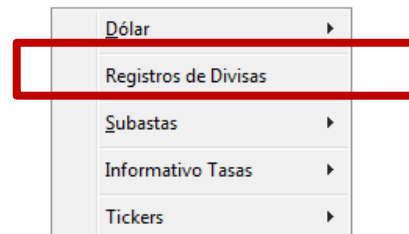
4

Operaciones FIX Forward
IMC – Clientes (Todas las
monedas)

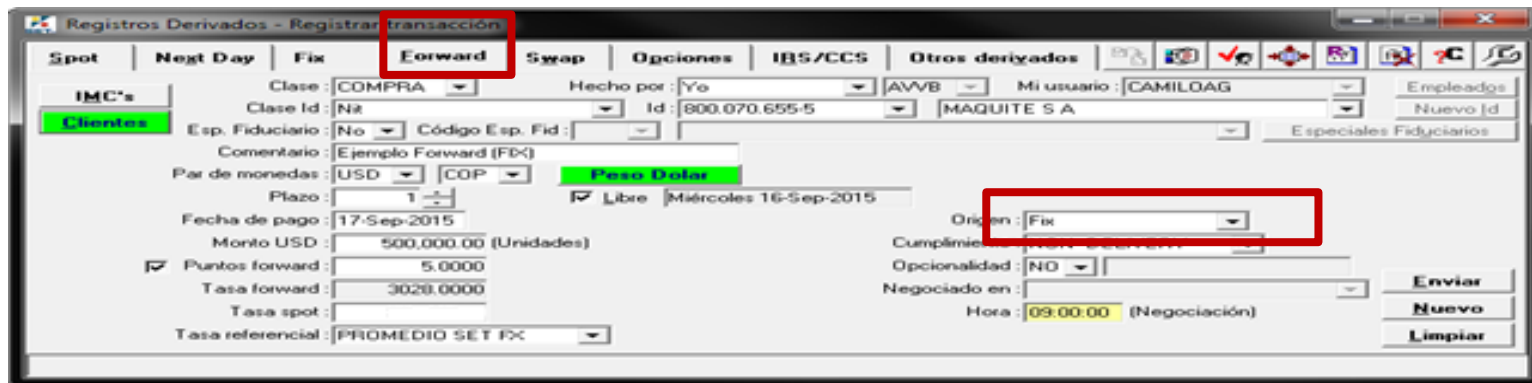
4. Operaciones FIX Forward IMC – Clientes (Todas las monedas)

Para el registro de las operaciones FIX Forward realizadas entre un IMC y su cliente, se deberá usar el módulo de registro de operaciones, mediante la pestaña “Forward” que existe actualmente, siguiendo los pasos que se indican a continuación:

1. Ingresar a la ventana “Registro de Divisas”.



2. Al momento de la negociación, se debe realizar el registro en la pestaña “Forward”, seleccionando la opción “Fix” en el campo “Origen”. Como se trata del registro inicial, sólo se indicarán los datos generales de la operación y los puntos forward pero no se ingresa la tasa Spot.



Nota: si no se selecciona la opción “Fix”, el sistema no permitirá el envío del registro cuando no tiene tasa Spot.

4. Operaciones FIX Forward IMC – Clientes (Todas las monedas)

3. Una vez realizado el registro de la operación, esta se podrá visualizar en el resumen de operaciones (Blotter) bajo la pestaña “Forward” y aparecerá sin tasa Spot.

Registros Derivados Clientes - Transacciones

SpotNext DayFixForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

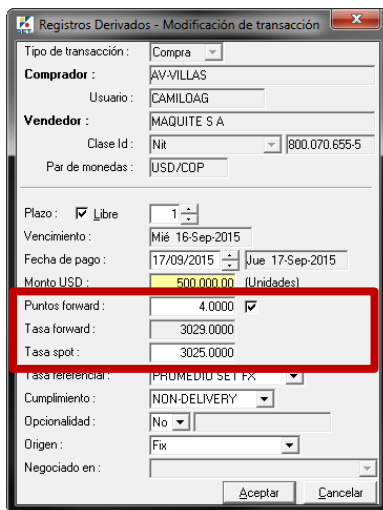
Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	TE	C/V	Par	Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	SA	SP	Est	Ncp	NCh	ER	
09:00:00	CAMILQAG		MAQUITE S A		R	Compra	USD / COP		500,000.00				0/1	16/09/2015			X0						
09:00:00	CAMILQAG		MAQUITE S A		R	Compra	USD / COP		500,000.00	3028.0000	3023.0000												

Detalle

Información complementaria

Modificar

4. Posteriormente, cuando se conozca la tasa, el usuario ingresa al Blotter, da click derecho sobre la operación correspondiente e ingresa a la opción: “modificar”



Registros Derivados - Modificación de transacción

Tipo de transacción: Compra

Comprador: AV-VILLAS

Usuario: CAMILOAG

Vendedor: MAQUITE S A

Clase Id: Nit 800.070.655-5

Par de monedas: USD/COP

Plazo: ☒ Libre 1

Vencimiento: Mié 16-Sep-2015

Fecha de pago: 17/09/2015 Jue 17-Sep-2015

Monto USD: 500,000.00 (Unidades)

Puntos forward: 4.0000 ☒

Tasa forward: 3029.0000

Tasa spot: 3025.0000

Tasa referencial: PROMEDIO SET FX

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: No

Origen: Fix

Negociado en:

Aceptar Cancelar

Por último, se asigna la tasa Spot y el sistema calculará automáticamente la tasa Forward (Tasa Spot+Puntos Forward). Dado que la operación ya quedó con todos los datos completos quedará disponible también para ser enviada a la CRCC.

4. Operaciones FIX Forward IMC – Clientes (Todas las monedas)

5. Una vez asignado el precio, este se verá reflejado el Blotter:

Registros Derivados Clientes - Transacciones

Spot

Next Day

Fix

Forward

Swap

Opciones

IRS/CCS

Otros derivados

Todas

Compras

Ventas

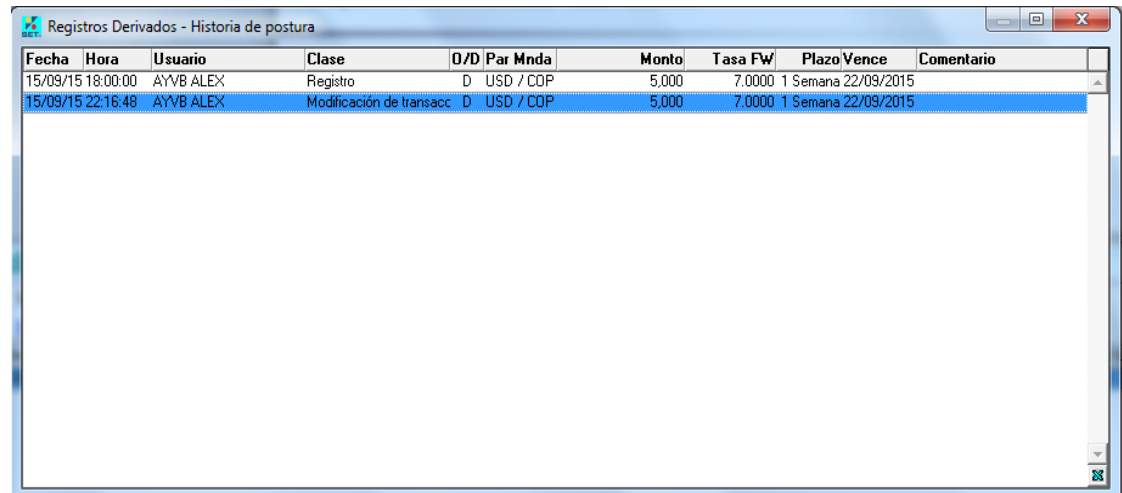
Usuario

Sucursal

Instit.

Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	TE/C/V	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E	Ori	SA	SP	Est	Ncp	NCh	Ex
09:00:00	CAMILQAG		MAQUITE S A		R Compra	USD / COP	500,000.00	3028.0000	3023.0000	0/1	16/09/2015			X0						
09:00:00	CAMILQAG		MAQUITE S A		R Compra	USD / COP	500,000.00	3029.0000	3025.0000	0/1	16/09/2015			X0						

6. Así mismo, al dar click derecho sobre la operación, en la opción “historia”, el usuario podrá visualizar tanto el momento en que se registró la operación inicial así como cuando se asignó el precio FIX.



Registros Derivados - Historia de postura

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa FW	Plazo/Vence	Comentario
15/09/15	18:00:00	AYVB ALEX	Registro	D	USD / COP	5,000	7.0000	1 Semana 22/09/2015	
15/09/15	22:16:48	AYVB ALEX	Modificación de transacc	D	USD / COP	5,000	7.0000	1 Semana 22/09/2015	