



NUEVAS FUNCIONALIDADES DEL SISTEMA SET-FX

Versión 6.40



Campos Fecha /Hora día anterior

- La ventana de registros entre IMC's incluirá el checkbox "Fecha anterior" y el campo "Hora" para indicar si la operación fue negociada el día hábil inmediatamente anterior.
- Los campos mencionados se habilitarán únicamente los primeros quince (15) minutos de la jornada de negociación de cada mercado, de la siguiente manera:

Dólar Spot - Registrar transacción

Hecho por : Yo [dropdown] Empleados [button]
BBVB [dropdown] Mi usuario : ANAMARIA [dropdown]

☐ Compensar por Cámara

Clase : ☒ Compra ☐ Venta

Código : BGTB [dropdown]
BANCO DE BOGOTA [text field]

Usuario : AVIVES [dropdown]

Comentario : [text field]

Precio : 3001.00

Monto : 500 (Miles)

Origen : Spot [dropdown]

Negociado en : DIRECTO [dropdown]

☒ Fecha anterior 26-Abr-2016 10:30:00

Hora : 09:00:31 (Negociación) [button] Aceptar [button] Cancelar [button]

Mercado	Apertura	Hora límite de registros "Fecha anterior"
Spot	08:00 a.m.	08:15 a.m.
Next Day	08:00 a.m.	08:15 a.m.
Forward	07:00 a.m.	07:15 a.m.
Swap	08:00 a.m.	08:15 a.m.
Fix	08:00 a.m.	08:15 a.m.
Registros con clientes	07:00 a.m.	07:15 a.m.

Campos Fecha /Hora día anterior

- Una vez el registro se encuentre en el sistema SET-FX, se podrá revisar e identificar si este fue un registro de un día anterior.
- Este identificador se encuentra en la opción “Detalle”, al hacer clic derecho sobre la respectiva operación en el Blotter.

Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 27/04/2016 Código: 00B3H6A0IM Hora de registro: 09:00:51 Hora: 09:00:31

Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	BOGOTA	Ana Maria Cardozo	
Por parte de :			
Vendedor	Sucursal	Persona	
BANCO DE BOGOTA	BOGOTA	Alejandro Vives Gutierrez	
Por parte de :			

Precio : 3001.00 Monto US\$: 500,000.00

Negociado en : DIRECTO

Origen de transacción : Registrado por ANAMARIA Monto Pesos : 1,500'500,000.00

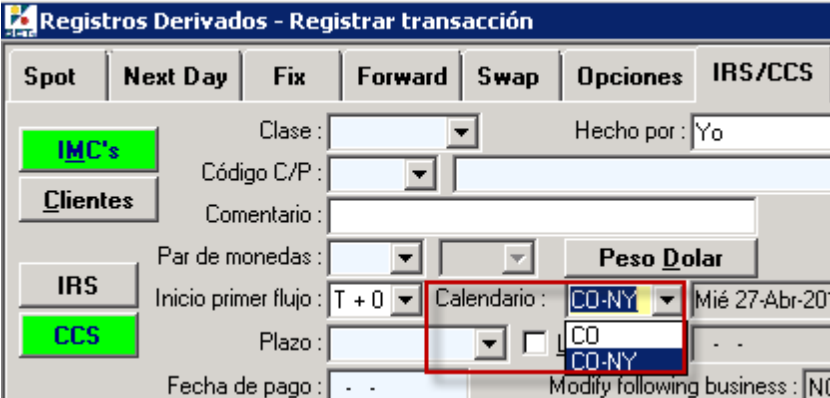
Comentario :

Origen : Spot

☒ **Fecha anterior** 26-Abr-2016 10:30:00

Aumentar Calendario CO (Colombiano) para operaciones CCS

- Las operaciones de registro “CCS” ahora tendrán la opción de seleccionar el calendario CO (Colombiano) además del calendario CO-NY (Colombia y USA), esto aplica para operaciones de registro entre IMC’s y entre un IMC’s y un cliente.



Registros Derivados - Registrar transacción

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS
IMC's						
Cientes						
IRS						
CCS						
Clase :		Hecho por :		Yo		
Código C/P :						
Comentario :						
Par de monedas :		Peso Dolar				
Inicio primer flujo :		T + 0		Calendario :		CO-NY
Plazo :						CO
Fecha de pago :		- -				CO-NY
Modify following business : NC						

Campo “Negociado en”

- Se establecerá obligatoriedad de ingresar el campo “Negociado en” en la ventana de registro de divisas entre IMC.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's

Clase: COMPRA Hecho por: Yo AYVB Mi usuario: ALEX Empleados

Clase Id: Nit Id: 800.000.750-8 PETROSANTANDER COLOMBIA INC Nuevo Id

Cientes

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

Comentario:

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Monto USD: (Unidades)

Tasa de cambio: Tasa pool:

Origen:

Negociado en:

Fecha anterior: ICAPCO
DIRECTO
BLOOMBERG
BANCO DE LA REPUBLICA
ENLACE
GFI EXCHANGE
TRADITION
OTRD - OTC
REUTERS

Enviar

Nuevo

Limpiar

- La opción “Enviar” solo se habilitará cuando el campo se encuentre debidamente diligenciado.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's

Clase: COMPRA Hecho por: Yo AYVB Mi usuario: ALEX Empleados

Clase Id: Nit Id: 800.000.750-8 PETROSANTANDER COLOMBIA INC Nuevo Id

Cientes

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

Comentario:

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Monto USD: 5,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 300.0000 Tasa pool:

Origen: Spot

Negociado en: DIRECTO

Fecha anterior: Hora: 12:30:00 (Negociación)

Enviar

Nuevo

Limpiar

Nuevo campo informativo: Tercero Offshore

- En la ventana de registro de divisas, se permitirá a los usuarios indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad de exterior de la cual aún no se conoce el nombre.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes

Clase: [] Hecho por: Yo AYVB Mi usuario: ALEX Empleados

Clase Id: [] Id: [] Nuevo Id

Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: [] Especiales Fiduciarios

Comentario: []

Par de monedas: [] [] Peso Dolar

Origen: []

Plazo: [] Libre []

Fecha asignación precio: 17-Ago-2016

Fecha de pago: []

Monto: [] (Unidades)

Puntos forward: []

Tasa forward: []

Tasa spot: [] Tasa pool: []

Tasa referencial: MANUAL

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: []

Negociado en: []

Fecha anterior: [] [] []

Hora: [] [] [] (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

☒ Tercero Offshore

Nota: Este campo no es obligatorio.

Nuevo campo Tasa Pool

- En el registro de divisas se agrega el campo informativo Tasa Pool, cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Algunas entidades lo requieren para propósitos internos. Dicha tasa se habilita para los mercados de registro de derivados, (forward, swap, opciones e IRS)

The screenshot shows a software window titled "Registros Derivados - Registrar transacción". It features a tabbed interface with tabs for "Spot", "Next Day", "Fix", "Forward", "Swap", "Opciones", "IRS/CCS", and "Otros derivados". The "Opciones" tab is currently selected. On the left, there are buttons for "IMC's" and "Clientes", with "Clientes" being highlighted in green. The main form area contains various input fields: "Clase" (dropdown), "Hecho por" (dropdown with "Yo" selected), "AYVB" (dropdown), "Mi usuario" (text field with "ALEX"), "Empleados" (dropdown), "Clase Id" (dropdown), "Id" (text field), "Nuevo Id" (dropdown), "Esp. Fiduciario" (dropdown with "No" selected), "Código Esp. Fid" (dropdown), "Especiales Fiduciarios" (dropdown), "Comentario" (text area), "Par de monedas" (two dropdowns showing "USD" and "COP"), "Monto USD" (text field), "Tasa de cambio" (text field), "Origen" (dropdown), "Negociado en" (dropdown), "Fecha anterior" (checkbox), and "Hora" (text field with "(Negociación)"). A red rectangular box highlights the "Tasa pool" field, which contains the value ".0000". At the bottom right, there are three buttons: "Enviar", "Nuevo", and "Limpiar".

Nota: Este campo NO es obligatorio.

Ingreso Tasas Negativas IRS/CCS

- En el registro de divisas de IRS/CCS se permitirá el ingreso tasas Fijas o Variables con signo negativo, esto aplica para transacciones entre dos IMC o entre un IMC y un cliente.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's
Cientes

Clase: COMPRA Hecho por: Yo OCCC Mi usuario: JIMMY Empleados
Clase Id: Nit Id: 112.578.731-3 VALENCIA CADENA PAOLA ANDREA Nuevo Id
Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario: ☐ Tercero Offshore

IRS
CCS

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar** Cumplimiento: NON-DELIVERY
Inicio primer flujo: T + 0 Calendario: CO-NY Jue 23-Jun-2016 Opcionalidad: NO
Plazo: 2 Meses Libre Mar 23-Ago-2016 Fecha primera amortización: 23-Ago-2016
Fecha de pago: 23-Ago-2016 Modify following business: NO Valor amortización: 7,260'000,000.00 COP
Monto USD: 2'500,000.00 (Unidades)

Tasa de interés USD: F -2.500000%
Tasa de interés COP: V FED + -1.5000
Tasa de cambio: 2904.0000
Tasa pool:

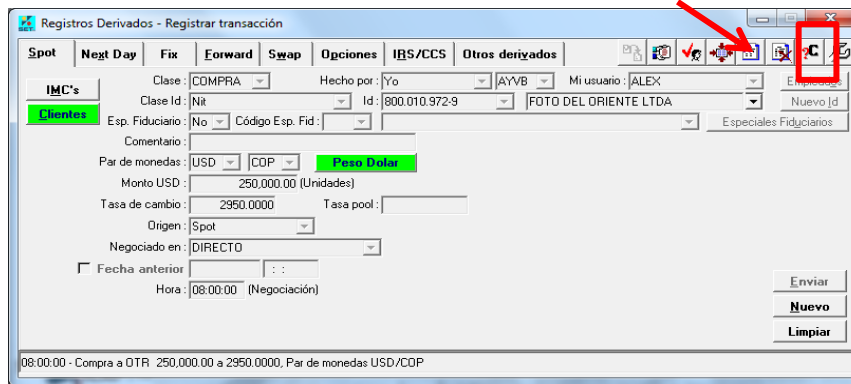
Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET
30/360 Trimestral Negociado en: BLOOMBERG
30/365 Trimestral ☐ Fecha anterior
Hora: 10:45:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Detalle e historia de anulaciones de operaciones

En la nueva versión se puede ver el historial o detalle de transacciones anuladas. De la siguiente forma:

click en el boton de "Consultas"



Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo AYYVB Mi usuario: ALEX

Clase Id: Nit Id: 800.010.972-9 FOTO DEL ORIENTE LTDA Nuevo Id

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

Comentario:

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Monto USD: 250.000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 2950.0000 Tasa pool:

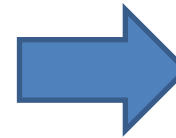
Origen: Spot

Negociado en: DIRECTO

☐ Fecha anterior Hora: 08:00:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

08:00:00 - Compra a OTR 250.000.00 a 2950.0000, Par de monedas USD/COP



Parámetros de consulta

Registros Derivados

Período: 18-Ago-2016

Clase mensaje

☐ Transacción

☒ **Anulación**

☐ Hoy

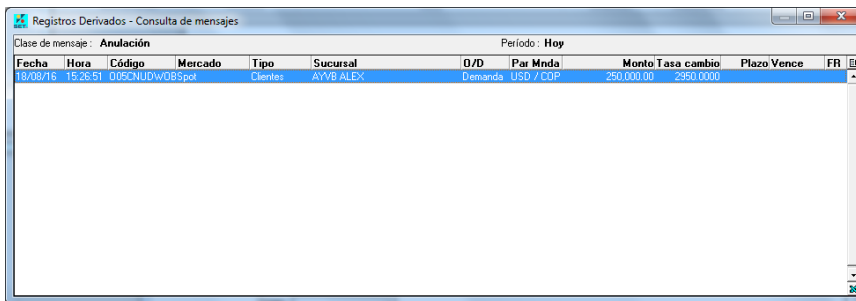
☐ Una fecha

☐ Un mes

Sucursal: AYYVB

Consultar Cancelar

Escogemos la opción Anulación, ingresamos la fecha de la cual deseamos ver la(s) anulación(es)



Registros Derivados - Consulta de mensajes

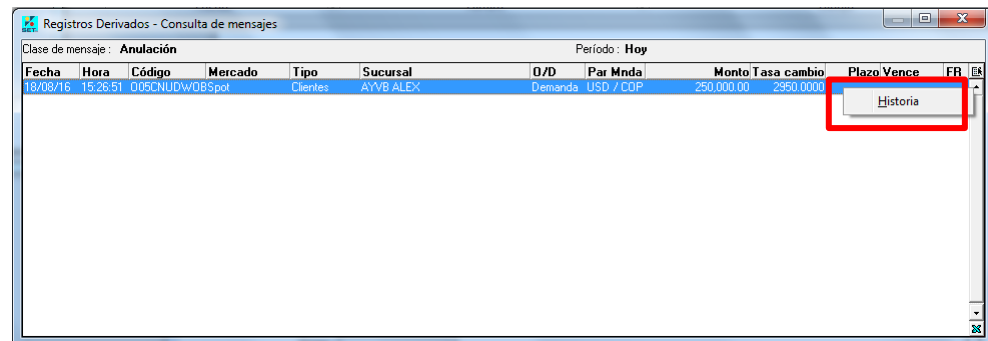
Clase de mensaje: Anulación Período: Hoy

Fecha	Hora	Código	Mercado	Tipo	Sucursal	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo Vence	FR	EB
18/08/16	15:36:51	005CNLDWOBSpot	Cuentas	AYVB ALEX	Demanda	USD / COP	250.000.00	2950.0000				

Luego nos aparece la ventana de la lista de la(s) transacción(es) que Anulamos en el periodo escogido anteriormente.

Detalle e historia de anulaciones de operaciones

Para ver la historia de la Anulación damos click derecho donde se abre la opción Historia como se muestra en la imagen.



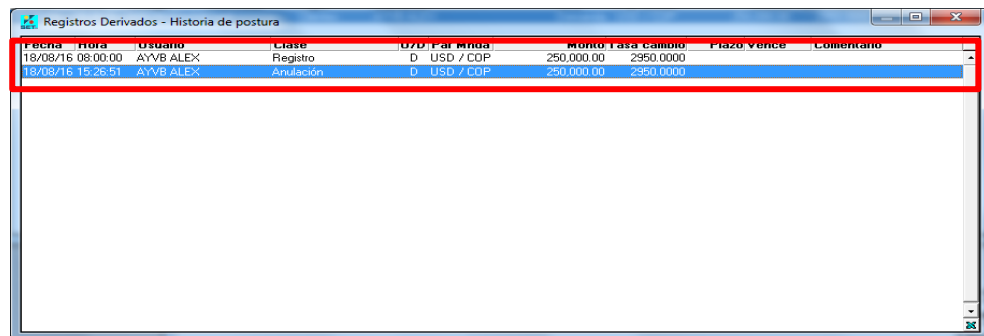
Registros Derivados - Consulta de mensajes

Clase de mensaje: **Anulación** Período: Hoy

Fecha	Hora	Código	Mercado	Tipo	Sucursal	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo/Vence	FR
18/08/16	15:26:51	005CNU0W08Spot		Clientes	AYVB ALEX	Demanda	USD / COP	250.000.00	2950.0000		

Historia

Luego de esto obtenemos el historia de la(s) operación(es) anulada(s).



Registros Derivados - Historia de postura

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo/Vence	Comentario
18/08/16	08:00:00	AYVB ALEX	Registro	D	USD / COP	250.000.00	2950.0000		
18/08/16	15:26:51	AYVB ALEX	Anulación	D	USD / COP	250.000.00	2950.0000		

Mejoras mercado FIX

- Los usuarios podrán asignar una tasa de referencia (Promedio SET-FX, TRM o Manual) en las ventanas de registros, para las operaciones cuya tasa no se conozca en el momento de la negociación.
- La asignación de la tasa seleccionada en estas operaciones se realizará de manera automática, para el caso de tasa Promedio Set-FX y TRM.

Comentario :
Origen : Fix
Precio Spot : Del sistema
Precio Forward : Asignada por usuario
Puntos Forward : 4.00
Precio Forward :
Monto en dólares : 500,000 (Unidades)
Plazo : ☒ Libre 7
Vencimiento : Lun 18-Jul-2016
Fecha asignación precio : 13-Jul-2016
Fecha de pago : 19-Jul-2016
Modalidad cumplimiento : NON-DELIVERY
Tasa de referencia : **PROMEDIO SET FX**
Opcionalidad : PROMEDIO SET FX
Tipo de opcionalidad : TRM
Negociado en : MANUAL

Ventana FIX forward Interbancario

Ventana FIX forward Clientes

Registros Derivados - Registrar transacción
Spot Next Day Fix **Forward** Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados
IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: JPBARNEY Empleados
Clase Id: Nit Id: 800.006.332-1 ARQUIMUEBLES Nuevo Id
Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Especiales Fiduciarios
Comentario: Tercero Offshore
Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**
Origen: Fix
Plazo: 1 Libre Jueves 14-Jul-2016
Fecha asignación precio: 14-Jul-2016 Tasa referencial: **PROMEDIO SET FX**
Fecha de pago: 15-Jul-2016 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Ventana FIX Spot Clientes

Registros de Divisas - Registrar transacción
Spot Next Day Fix **Forward** Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados
IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: ANDREA Empleados
Clase Id: Nit Id: 860.003.020-1 B.B.V.A BCO BILBAO VISCAYA ARGENT Nuevo Id
Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid.: Especiales Fiduciarios
Comentario:
Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**
Plazo: 2 Días Libre Lunes 18-Jul-2016
Fecha asignación precio: 18-Jul-2016
Monto USD: 2,000,000.00 (Unidades) USD
Puntos: 3.5000
Tasa referencial: **PROMEDIO SET FX**
Negociado en: ICAPCO **Enviar**

Mejoras mercado FIX

- Las ventanas de registro de operaciones FIX tanto IMC-IMC como IMC-Clientes, tendrán el campo “Puntos”, en el cual se indicaran los puntos que se deseen adicionar o restar a la tasa de referencia seleccionada.
- Se incluyeron los campos ***Fecha asignación precio*** y ***Tasa referencial*** en la ventana de registros para las operaciones FIX de contado entre IMC-Clientes y FIX Forward tanto para las operaciones IMC-IMC como IMC-Clientes.

Dolar Fix - Registrar transacción

Clase: ☒ Compra ☐ Venta

Código: BCXB

BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA

Usuario: LORENA

Comentario:

Días: 0 ☒ Libre

Vencimiento: Jueves 14-Jul-2016

Monto: 500 m (Miles)

Puntos: 3.00

Negociado en: ICAPCO

Hora: 08:12:27 (Negociación)

Aceptar Cancelar

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's

Clase: COMPRA Hecho por: Yo BBVB Mi usuario: JPBARNY Empleados

Clase Id: NR Id: 800.006.332-1 ARQUIMUEBLES Nuevo Id

Exp. Fiduciario: No Código Exp. Fid. Especiales Fiduciarios

Comentario: ☐ Tercero Offshore

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Origen: Fix

Plazo: 1 ☒ Libre Jueves 14-Jul-2016

Fecha asignación precio: 14-Jul-2016 **Tasa referencial: PROMEDIO SET FX**

Fecha de pago: 15-Jul-2016

Monto USD: 2000,000.00 (Unidades)

☒ Puntos forward: 2.8000

Tasa forward:

Tasa spot: Tasa pool:

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad:

Negociado en: ICAPCO

☐ Fecha anterior

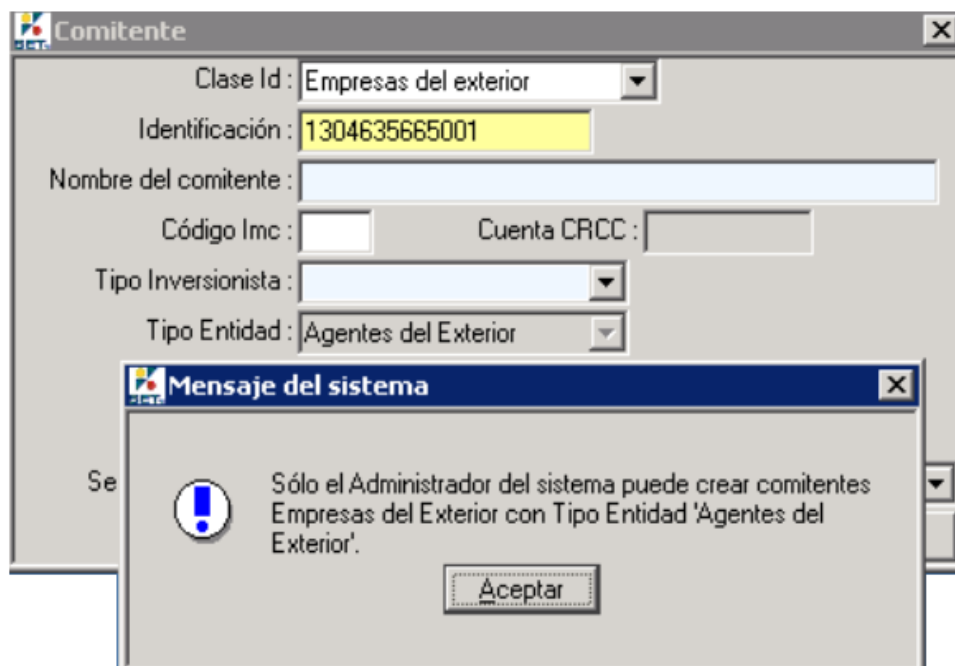
Hora: 17:45:00 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

17:45:00 - Compra a OTR 2'000,000.00 a 0.0000 a 0/1, Par de monedas USD/COP

Otras mejoras de la versión 6.40

- La creación de comitentes del exterior sólo estará permitida para el administrador del sistema.



- Al iniciar el sistema se mostrará el último memo NO leído.
- En la consulta de chats de días anteriores se incluyó la columna hora.

Otras mejoras de la versión 6.40

- Se aumenta el tamaño del campo “Monto” en el módulo de registro de divisas, pasando ahora a doce (12) enteros y dos (2) decimales

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's

Clientes

Clase: Hecho por: Yo AYVB Mi usuario: ALEX Empleados

Clase Id: Id: Nuevo Id

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

Comentario:

Par de monedas: USD COP Pes. Dolar

Monto USD: 999,999,999.00 (Unidades)

Tasa de cambio: Tasa pool:

Origen:

Negociado en:

☐ Fecha anterior : : Hora: : : (Negociación)

Enviar

Nuevo

Limpiar

Otras mejoras de la versión 6.40

- Los plazos para el registro pueden ser desde 0 hasta 999 días para las operaciones FIX.
- Se permite el registro de operaciones FIX sobre cualquier par de monedas para operaciones IMC-Clientes.
- En la pestaña del mercado FIX del módulo “Registro de Divisas” se permite especificar la moneda en la que está expresado el monto de la operación.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Cientes

Clase: Clase Id: Id: Hecho por: Yo PRYB Mi usuario: CARLOS Empleados Nuevo Id

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

Comentario:

Par de monedas: EUR USD Peso Dolar

Plazo: 999 Libre Martes 21-May-2019

Fecha asignación precio: 21-May-2019

Monto EUR: (Unidades) EUR

Puntos: 0.0000

Tasa referencial: MANUAL

Negociado en:

Hora: (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar