
Septiembre 30 de 2016

No 013

Asunto:

**INFORMACIÓN RELACIONADA CON LOS MERCADOS INTEREST RATE
SWAP (IRS) Y CROSS CURRENCY SWAP (CCS)**

SET-ICAP FX S.A., Sociedad Administradora del Sistema de Negociación y Registro ICAP-CO, se permite informar que a partir del día, 23 de Septiembre de 2016, ha sido instalada en los Proveedores de Precios debidamente autorizados por la Superintendencia Financiera de Colombia (Infovalmer S.A. y PIP Colombia S.A.), una pantalla observadora del Sistema ICAP CO (ETC) donde podrán visualizar en línea todas las ofertas/demandas, intenciones y cierres de los mercados Interest Rate Swap (IRS) y Cross Currency Swap (CCS).

Lo anterior, atendiendo la solicitud realizada por dichos Proveedores de Infraestructura y al mismo tiempo, dando cumplimiento a nuestra obligación en calidad de Sistema de Negociación y Registro de suministrar la información que soliciten tales proveedores, al tenor de lo expuesto en el artículo 2.16.1.2.13 del Decreto 2555 de 2010.

En este sentido, aprovechamos la oportunidad para realizar las siguientes aclaraciones:

- (i) En primer lugar, compete **exclusivamente** a los Proveedores de Precio expedir las metodologías de valoración y prestar los servicios de cálculo, determinación y proveeduría o suministro de información actualizada para la valoración de las inversiones de las entidades del Sistema Financiero Colombiano, de conformidad con lo expuesto en el artículo 2.16.1.2.4. del Decreto 2555 de 2010.
- (ii) SET-ICAP FX S.A. ha otorgado a los Proveedores de Precios autorizados **toda la información que ellos han requerido de manera clara, transparente y oportuna desde Octubre de 2012.**
- (iii) Los Proveedores de Precios autorizados reciben información de todos los Sistemas de Negociación y de Registro autorizados por la Superintendencia Financiera de Colombia, con el fin de analizar, consolidar y aplicar sus propias metodologías de valoración.

- (iv) Dentro de las actividades propias de SET-ICAP FX S.A. y atendiendo los requerimientos de los clientes locales e internacionales, hemos creado curvas netamente informativas, atendiendo las metodologías que definen los interesados de esta información. Dichas curvas sirven como referencia para algunos clientes y cabe resaltar, las mismas no son utilizadas por los Proveedores de Precios autorizados.
- (v) Atendiendo el alcance de nuestra actividad, SET ICAP FX S.A. es completamente ajeno a las metodologías de valoración utilizadas por los clientes locales e internacionales, y entendemos, que dicha responsabilidad y cumplimiento regulatorio compete a cada entidad. Reiteramos, que la definición y creación de dichas metodologías es propia de cada uno de los Proveedores de Precios autorizados, así como la de definir y solicitar la información requerida a los Sistemas de Negociación y de Registro.
- (vi) SET ICAP FX S.A. siempre ha estado y estará dispuesto a atender cualquier requerimiento de información propio de los Proveedores de Precios, para que dichas entidades desarrollen de manera adecuada su objeto social y así, estimular la armonía e integración del mercado de divisas colombiano.

Esperamos con esto aclarar cualquier inquietud o mensaje equivoco que se haya podido tener sobre el particular. Como aliados estratégicos de los Establecimientos Bancarios locales, estamos dispuestos a recibir todas las sugerencias que permitan fomentar el desarrollo del mercado en general.

Cordialmente.

(Original firmado)

ANDRÉS MACAYA DÁVILA
CEO