



RESUMEN NUEVAS FUNCIONALIDADES

Sistema SET-FX

Actualización 7.12J

Julio 2021

NUEVAS FUNCIONALIDADES SET-FX VERSIÓN 7.12J

- 1. Envío de operaciones con diferentes cuentas de clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.**
2. Envío de IRS/CCS con Clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
3. Mark-to-market para el cálculo del Cupo Cámara en operaciones USD/COP Spot y Next Day.

OPERACIONES CON DIFERENTES CUENTAS CON CLIENTES A CRCC

PASOS PARA LA CREACIÓN DE CUENTAS DE CLIENTES

- a) El IMC solicita a la CRCC la creación de la cuenta para un cliente específico.
- b) La CRCC crea la cuenta e informa a SET-ICAP.
- c) El administrador del Sistema SET-FX configura la cuenta en el Sistema

OPERACIONES CON DIFERENTES CUENTAS CON CLIENTES A CRCC

PASOS PARA LA COMPENSACIÓN EN CRCC CON DIFERENTES CUENTAS

- Después de registrar una operación Forward o IRS/CCS con un cliente, se debe hacer clic derecho sobre esta en el Blotter de operaciones.
- Al ingresar a la opción “Compensar por CRCC”, se muestran las diferentes cuentas que el cliente tiene asociadas.
- Se debe hacer clic sobre la cuenta deseada para enviar la operación a la CRCC

The screenshot displays a financial trading system interface. At the top, there are tabs for different transaction types: Spot, Next Day, Fix, Forward, Swap, Opciones, IRS/CCS, and Otros derivados. Below these, there are sub-tabs: Todas, Compras, Ventas, Usuario, Sucursal, and Instit. The main area shows a table of transactions with columns for Fecha, Hora, H.Reg, Código, Usuario, St, Nombre comitente, St TE B C/V, Par Mnda, and M. A transaction is highlighted in blue: 07/07/21, 11:04:00, 11:04:31, O4HM7QMK5X, DANIELP, Colfondos S.A. Pensiones y C..., T, Compra, USD / COP, 1'000,00. A right-click context menu is open over this transaction, listing options: Detalle, Comentario, Información complementaria, Compensar por CRCC (highlighted), Modificar, Fraccionar, Historia, Anular transacción, and Imprimir Papeleta. A red box highlights the 'Compensar por CRCC' option, which has opened a sub-menu showing two accounts: AFR01 AFR01 and AFR02 Moderado.

Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	St	Nombre comitente	St TE B C/V	Par Mnda	M
07/07/21	11:04:00	11:04:31	O4HM7QMK5X	DANIELP		Colfondos S.A. Pensiones y C...	T	Compra	USD / COP

OPERACIONES CON DIFERENTES CUENTAS CON CLIENTES A CRCC

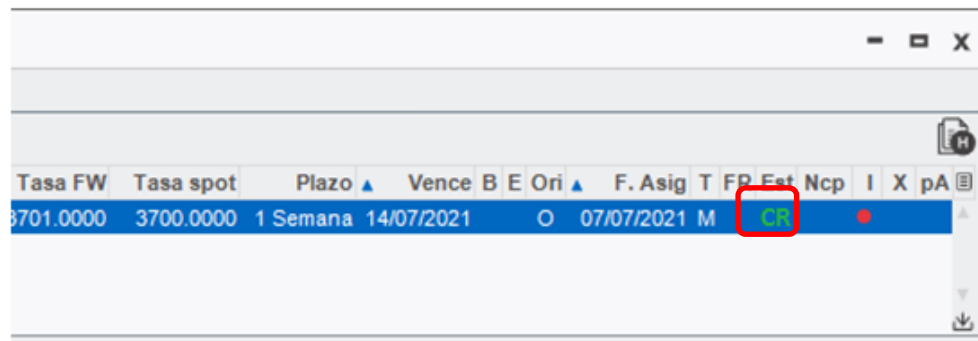
- Una vez enviada la operación a la CRCC, el Blotter de operaciones mostrará el estado de compensación de la misma con las siguientes iniciales:

PR – Pendiente Cámara: la operación se encuentra en Cámara pero está pendiente de valoración de garantías

PA – Pendiente de Aprobación: La operación ya fue recibida por la CRCC pero se encuentra pendiente de aprobación para compensar

CR – Compensada Cámara: La operación fue aprobada por la CRCC para su compensación

NC – No Compensada: La CRCC rechaza la compensación de la operación



Tasa FW	Tasa spot	Plazo ▲	Vence	B	E	Ori ▲	F. Asig	T	FR	Est	Ncp	I	X	pA	
3701.0000	3700.0000	1 Semana	14/07/2021			O	07/07/2021	M		CR					

OPERACIONES CON DIFERENTES CUENTAS CON CLIENTES A CRCC

- En el detalle de la operación se identifica la cuenta por la cual fue compensada por la CRCC

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 07/07/2021 Código: 04HM7QMK5X Hora de registro: 11:04:31 Hora: 11:04:00

Comprador	Sucursal	Persona
CITIBANK S.A.	BOGOTA	Daniel Perez Ortega
Por parte de :		

Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación	Vigilado TRM
Colfondos S.A. Pensiones y Cesantia	Nit	800.149.496-2	
Por parte de :			

Par de monedas : USD / COP ☐ Tercero Offshore

Plazo : 1 Semana 14-Jul-2021 Origen : Outright

Fecha asignación tasa : Miércoles 07-Jul-2021 Tasa referencial : MANUAL

Fecha de pago : 15-Jul-2021 Cumplimiento : NON-DELIVERY

Monto : 10,000.00 Opcionalidad : NO

Puntos forward : 1.0000 SEFable :

Tasa forward : 3701.0000

Tasa spot : 3700.0000 Tasa pool : 0.0000

Negociado en : DIRECTO

Origen de transacción : Registrado por DANIELP

Comentarios :

Estado CRCC : **Compensada por Cámara de Riesgo (Cuenta AFRM002 Moderado)**

☐ Fecha anterior

Nota: Esta información también puede ser visualizada en el archivo que se exporta en formato Excel desde el Blotter de operaciones

NUEVAS FUNCIONALIDADES SET-FX VERSIÓN 7.12J

1. Envío de operaciones con diferentes cuentas de clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
2. **Envío de IRS/CCS con Clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.**
3. Mark-to-market para el cálculo del Cupo Cámara en operaciones USD/COP Spot y Next Day.

OPERACIONES IRS/CCS CON CLIENTES A CRCC

CONDICIONES GENERALES

- El monto de la operación debe ser un múltiplo de 500'000.000 COP
- Solo las operaciones COP/COP y USD/COP serán compensadas
- Dentro del campo de “Modify Following Business” siempre debe estar marcada la opción: “Si”

OPERACIONES IRS/CCS CON CLIENTES A CRCC

COMBINACIONES POR OPERACIÓN

Plain Vanilla Swaps (IRS)

- Plazos IBR1M, IBR3M, IBR6M

Tasa Fija	
Conteo de días	30/360 ACT/360 ACT/365 ACT/ACT
Periodicidad	Mensual Trimestral Semestral
Tasa Variable	
Tasa de referencia	IBR1M IBR3M IBR6M
Spread	Cualquier Valor
Conteo de días	ACT/360
Periodicidad	Debe ser igual a periodicidad tasa de referencia IBR1M = Mensual IBR3M = Trimestral IBR6M = Semestral

Overnight Index Swaps (OIS)

- Tasa de referencia IBRON

Tasa Fija	
Conteo de días	30/360 ACT/360 ACT/365 ACT/ACT
Periodicidad	Mensual Trimestral Semestral Un solo flujo (Misma periodicidad en tasas)

Tasa Variable	
Tasa de referencia	IBRON
Spread	0.00
Conteo de días	ACT/360
Periodicidad	Mensual Trimestral Semestral Un solo flujo (Misma periodicidad en tasas)

OPERACIONES IRS/CCS CON CLIENTES A CRCC

COMBINACIONES POR OPERACIÓN

Cross Currency Swap (CCS)

Campo Registro SET-FX	CCS entre IMCs (Valores permitidos)
Fecha Vencimiento	> Fecha_Sistema (Transacción vigente en SET-FX. Controles en CRCC)
Par de monedas	USD/COP
Calendario	CO-NY, CO (En CRCC se admiten los 2 calendarios SET-FX)
Cumplimiento	NON-DELIVERY
Modify following business	SI
Inicio primer flujo	T+0, T+1, T+2, FRA
Plazo	Estándar, Libre
Tasa de cambio	<9999.9999> (Cualquier valor)

Campo Registro SET-FX		CCS entre IMCs (Valores permitidos)
Tasa de interés USD	Tipo	VARIABLE
	Tasa referencial	LBR1M LBR3M LBR6M LBR1Y
	Spread	<-9999.9999> (Cualquier valor. Positivo o negativo)
	Conteo de días	30/360 30/365 ACT/360 ACT/365 ACT/ACT
	Periodicidad	LBR1M = Mensual LBR3M = Trimestral LBR6M = Semestral LBR1Y = Anual Un solo flujo (Periodicidad = Periodicidad tasa USD)
Tasa de interés COP	Tipo	VARIABLE
	Tasa referencial	IBRON
	Spread	0.0000
	Conteo de días	30/360 30/365 ACT/360 ACT/365 ACT/ACT
	Periodicidad	Mensual Trimestral Semestral Anual Un solo flujo

NUEVAS FUNCIONALIDADES SET-FX VERSIÓN 7.12J

1. Envío de operaciones con diferentes cuentas de clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
2. Envío de IRS/CCS con Clientes a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
3. **Mark-to-market para el cálculo del Cupo Cámara en operaciones USD/COP Spot y Next Day.**

MARK TO MARKET – CUPO CÁMARA EN SPOT Y NEXT DAY

Dólar Spot

DEMANDAS ↓		↑ OFERTAS	
3600.00	3605.00		
Vender	250	250	Comprar
64'750	65'250		

Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
	250	3600.00	3605.00	250	
	500	3559.50	3605.50	500	
	2000	3559.00	3606.00	2000	
	500	3558.50	3606.50	7000	
	10000	3558.00	3607.00	5000	
	20000	3557.50	3607.50	750	
	750	3557.00	3608.00	10000	



El cálculo de cupos cámara para los mercados Spot y Next Day USD/COP van a incluir el cálculo de mark-to-market para unificar la metodología de cálculo de la CRCC.