

ASUNTO:


NOVEDADES – ACTUALIZACIÓN SISTEMA SET-FX

SET-ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico y de Información del Mercado de Divisas "SET-FX", se permite informar a todos sus afiliados que el próximo 28 de julio de 2022 se instalará de manera automática una actualización en el sistema la cual incluye las siguientes mejoras:

1. Inclusión del campo denominado "nota/usuario" en el blotter de operaciones y descarga en archivo Excel.

En la ventana de administración de posturas para los mercados Spot y Next Day, se permite agregar un comentario, o nota local, para identificar cada postura. A partir de la actualización, esta nota local será visible en el blotter de operaciones y en su respectiva la descarga a Excel.

Ventana de Administración de posturas



Nota / Usuario	M.Comp.	Monto	Precio	Precio	Monto	M.Comp.	Nota / Usuario
	250	×	3904.90	9003.00	×	250	Global
	250	×	3904.85	9003.45	×	250	
	250	×	3904.80				
	250	×	3904.75				

Blotter de operaciones

Dólar Spot - Transacciones

TodasComprasVentasUsuarioSucursalInstit.

Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	V	C	A	s	C	M	p	A	N	C	M	Comentario
01/07/22	08:51:32		O3UYV7X9AW	FELIPEI	Compra	9003.00	250		A															
01/07/22	08:51:51		O3UYV7X9AY	FELIPEI	Venta	9003.00	250																	Global
Total compras sucursal:			250,000	9003.00																				
Total ventas sucursal:			250,000	9003.00																				
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos																			
ALN:	250,000		250,000																					
Cupo:	503'786,000		503'786,000																					
Estado de transferencias: Compensación pendiente																								

<

Descarga a Excel

Fecha	Hora	Hora Registro	Código	Usuario	Total pesos	Negociado en	*****	nC	M	Comentario
01/07/22	08:51:32		03UYV7X9AW	FELIPEI	2.250.750.000,00					
01/07/22	08:51:51		03UYV7X9AY	FELIPEI	2.250.750.000,00					Global

2. Aumento de la longitud del campo monto en el mercado IRS/CCS

Los usuarios podrán registrar operaciones en billones de pesos (13 enteros y dos decimales) en el mercado IRS/CCS.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: COMPRA Hecho por: Yo ALNB Mi usuario: FELIPEI Empleados

Contraparte: Empresas del exterior ID: 045 CITIBANK N.A. LONDON BRANCH Nuevo ID

Beneficiario: ID:

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dolar

IRS

CCS

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO-NY Mié 06-Jul-2022

Plazo: 2 Meses Libre Mar 06-Sep-2022

Fecha de pago: 06-Sep-2022 Modify following business: SI

Monto COP: 1234,567'890,123.00 (Unidades)

Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F 2.300000% ACT/360 Un solo flujo Negociado en: SET-ICAP

Tasa de interés COP: V IBRON + ACT/360 Un solo flujo

P. Rotos/Amortizaciones Editar

Segundo monto: 1234,567'890,123.00 COP

Cumplimiento: NON-DELIVERY

Opcionalidad: NO

Vencimiento sin ajustar: 06-Sep-2022

Fecha anterior

Hora: 10:00:00 (Negociación) Limpiar

3. Nuevo calendario COP-EUR para operaciones con tasas EUR.

Se incluirá el calendario COP-EUR en el sistema, con la finalidad de que las operaciones con tasas de referencia en euros, cumplan con las fechas de vencimiento establecidas por el Banco Central Europeo (Calendario Target).

Registros Derivados - Registrar transacción

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

IMC's Clientes IRS CCS

Clase: COMPRA Hecho por: Yo ALNB Mi usuario: FELIPEI Empleados

Contraparte: Empresas del exterior ID: 045 CITIBANK N.A. LONDON BRANCH Nuevo ID

Beneficiario: ID:

Comentario:

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Tercero Offshore

Inicio primer flujo: T + 2 Calendario: CO-EU Mié 06-Jul-2022 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Plazo: 3 Años Libre Lun 07-Jul-2025 Opcionalidad: NO

Fecha de pago: 07-Jul-2025 Modify following business: SI Vencimiento sin ajustar: 06-Jul-2025

Monto COP: 10,000'000,000.00 (Unidades) Segundo monto: 10,000'000,000.00 COP

Tasa de interés COP: F 3.200000% ACT/360 Trimestral Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: V EUR3M ACT/360 Trimestral Negociado en:

P. Rotos/Amortizaciones Editar

Fecha anterior

Hora: 10:00:00 (Negociación) Enviar Nuevo Limpiar

4. Fraccionamiento de operaciones Forward por usuarios de la misma sucursal.

Los usuarios podrán fraccionar y aceptar fraccionamientos de operaciones registradas por otros usuarios de su misma sucursal.

Ingresar Fracciones de transacción

Clase: COMPRA Hecho por: Yo BCLB Mi usuario: WILLIAM

Clase ID: Empresas del exterior ID: 019 BANK OF AMERICA N.A. SAN FRANCISCO

Beneficiario: ID:

Comentario:

Par de monedas: USD COP

Origen: Outright

Plazo: 6 Meses Libre Miércoles 04-Ene-2023 Tasa referencial: MANUAL

Fecha asignación: 01-Jul-2022 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Fecha de pago: 06-Ene-2023 Opcionalidad:

Monto USD: 1'000,000.00 (Unidades) Negociado en: SET-ICAP

Puntos forward: 4.0000 Hora: : : (Negociación)

Tasa forward: 4000.0000 FR

Tasa spot: 3996.0000

Fecha anterior

Aceptar Cancelar

5. Creación y actualización de comitentes de forma automática

Los afiliados del sistema SET-FX podrán crear comitentes de forma masiva y automática por medio de la importación de un archivo de formato “.CSV”. Para realizar este proceso, es necesario que las entidades interesadas se pongan en contacto con el Administrador del sistema, soliciten la estructura del archivo y posteriormente envíen la información de los comitentes a crear o actualizar.

Una vez realizado el proceso de creación por parte del administrador, se enviará un reporte informando cuales comitentes fueron creados y cuales presentan inconvenientes.

En el Anexo 1 de este documento encontrarán el instructivo y la estructura del archivo de importación.

Estamos en disposición de resolver cualquier inquietud.

Cordialmente,

(Original Firmado)

JUAN DAVID BENAVIDES MONTEALEGRE

Director Comercial