

MERCADO DÓLAR SPOT

Manual de usuario



	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 2 / 99

Contenido

OBJETIVO	57
1. GENERALIDADES DEL MERCADO DÓLAR SPOT	68
2. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO SPOT	79
2.1. FUNCIONES DE NEGOCIACIÓN	79
2.2. ADMINISTRADOR DE POSTURAS	2123
2.2.1. Descripción De La Ventana “Dólar Spot Administración De Posturas”	2224
2.2.2. Barra De Modificación Rápida	2325
2.2.3. Descripción Columnas “Dólar Spot – Administración De Posturas”	2426
2.2.4. Ingresar Una Nota	2527
2.3. ÓRDENES MERCADO SPOT	2628
2.3.1. Descripción Ventana “Dólar Spot – Ordenes”	2729
2.3.2. Ingreso De Una Orden De Compra/Venta	2729
2.3.3. Notificaciones Blotter De Mensajes	2931
2.4. REGISTRO DE TRANSACCIONES	2931
2.4.1. Creación De Empleados	3234
2.4.2. Envío De Registros	3335
2.5. STOP LOSS	3638
2.5.1. Estados Ventana Stop Loss	3840
2.6. FIXING (MATCHING)	4143
2.7. CUPOS	4547
2.7.1. Cupos Bilaterales	4749
2.8. PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES PROPIAS	5658
2.9. TRANSACCIONES Y POSICIÓN	6264

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 3 / 99

2.9.1.	Compras	<u>6264</u>
2.9.2.	Ventas	<u>6365</u>
2.10.	GRÁFICOS Y PRECIOS	<u>6668</u>
2.10.1.	Gráfico De Precios De Transacciones Cerradas Hoy	<u>6668</u>
2.10.2.	Gráficos De Precios De Mejor Demanda/Oferata De Hoy	<u>6668</u>
2.10.3.	Gráficos De Resúmenes Por Día	<u>6769</u>
2.10.4.	Gráfico De Resúmenes Por Intervalo	<u>6870</u>
2.10.5.	Precios/Montos Transacciones De Hoy	<u>7072</u>
2.10.6.	Historia De Precios/Montos De Transacciones	<u>7274</u>
2.10.7.	Precios De Mejor Demanda/Oferata De Hoy	<u>7476</u>
2.10.8.	Historia De Precios Mejor Demanda/Oferata	<u>7577</u>
2.11.	RESUMEN DE PRECIOS/MONTOS TRANSADOS HOY	<u>7678</u>
2.11.1.	Resumen De Hoy.....	<u>7678</u>
2.11.2.	Resumen IMCs Y Sector Real	<u>7880</u>
2.12.	CONSULTAS	<u>7981</u>
2.13.	Configuración Del Mercado	<u>8082</u>
3.	VENTANA DÓLAR SPOT.....	<u>8284</u>
4.	BARRIDOS NETOS	<u>8385</u>
5.	BARRA DE MODIFICACIÓN RÁPIDA.....	<u>8890</u>
6.	ANULACIÓN DE OPERACIONES	<u>8991</u>
7.	MODIFICACION DE OPERACIONES	<u>9193</u>
7.1.	Modificación De Operaciones Transaccionales	<u>9193</u>
7.2.	Modificación De Operaciones De Registro	<u>9193</u>
7.2.1.	Compensación por cámara.....	<u>9294</u>
7.2.2.	Operaciones Sin Sin Compensación por CRCC (Bilateral)	<u>98100</u>

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 4 / 99

8. INFORMACIÓN ADICIONAL.....99101

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 5 / 99

OBJETIVO

Este manual tiene como objetivo explicar detalladamente el funcionamiento del Mercado Dólar Spot en el Sistema SET-FX, los procesos que se llevan a cabo para realizar operaciones durante la jornada de negociación del mercado Spot y el envío de operaciones a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 6 / 99

1. GENERALIDADES DEL MERCADO DÓLAR SPOT

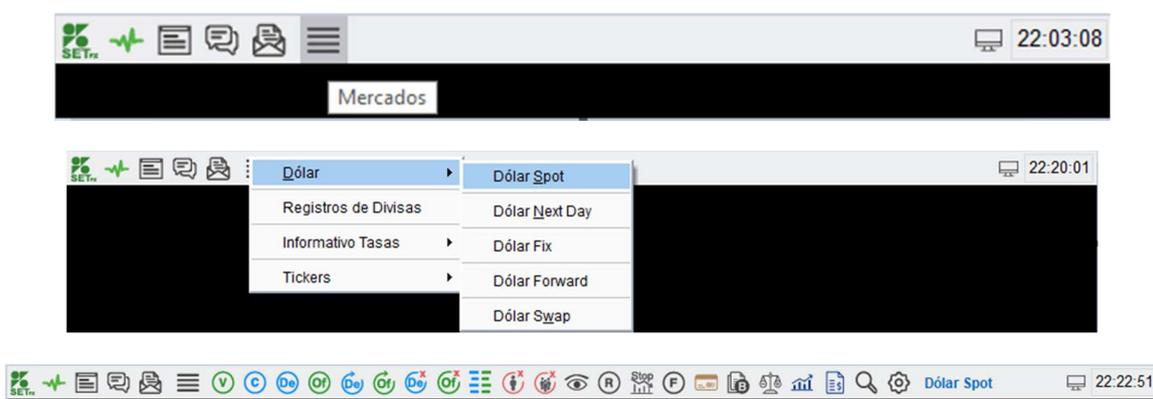
- Las operaciones de contado que se celebren o registren, automáticamente asumirán como plazo para su cumplimiento la fecha de ingreso de la operación (de hoy para hoy).
- Ingreso de ofertas y/o demandas: Corresponde al período de ingreso de ofertas y/o demandas en el sistema SET-FX, desde la hora de inicio de la sesión de negociación hasta el cierre de la misma. Si una entidad no cuenta con Cupo Cámara en las sesiones de negociación Spot, no podrá ingresar ofertas/demandas. Las condiciones particulares para el ingreso de ofertas y/o demandas serán informadas por el Administrador del sistema SET-FX a través de Circular.
- Permanencia de ofertas y/o demandas: Las ofertas y demandas que ingresen tendrán vigencia hasta su calce o el retiro de la misma por parte del Afiliado. Igualmente, si al cierre de la sesión de negociación las posturas ingresadas no hubieren sido calzadas, estas se retirarán del Sistema. Cuando a un afiliado se le agote el Cupo Cámara durante las sesiones de negociación Spot, sus ofertas y/o demandas serán retiradas automáticamente del sistema y el afiliado solamente podrá ingresarlas una vez tenga Cupo Cámara suficiente. Las condiciones particulares para el ingreso de ofertas y/o demandas serán informadas por el Administrador del sistema SET-FX a través de Circular.
- El Sistema calzará el mejor precio disponible para el monto agredido por el afiliado y el saldo, en caso de existir, permanecerá en el sistema como una postura de demanda u oferta según sea el caso.
- Si el calce es por el total de la oferta o demanda, ésta desaparecerá de la pantalla de ofertas y/o demandas según corresponda y se generará de forma automática el registro y difusión de la transacción en el blotter del afiliado y actualizará las estadísticas del sistema.
- El monto mínimo para el ingreso de posturas es 250 mil dólares.
- El monto máximo es 20.000.0000 millones de dólares.
- Ingreso de oferta y/o demandas deben ser múltiplos de 250 mil dólares.
- Los mejores precios de demanda y oferta se identificarán con color azul y verde respectivamente.
- El sistema calza automáticamente las posturas al mismo precio (siempre que haya disponibilidad de cupos cámara) y por el monto compatible. En caso de que haya un saldo el sistema lo conserva como una postura al precio respectivo.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 7 / 99

2. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO SPOT

Desde la barra principal del Sistema SET-FX se encuentra el botón “Mercados” , el cual permite ingresar a los diferentes mercados activos para el usuario. Seleccioné el menú “Dólar” y elija la opción “Dólar Spot”, de acuerdo a la imagen:



2.1. FUNCIONES DE NEGOCIACIÓN

A continuación, se explican las funciones de negociación del Sistema SET-FX por medio de los botones de la barra de acceso, mouse y del teclado del usuario.

Realizar una venta

Una venta en el mercado spot del sistema SET-FX se puede realizar de varias formas a saber:

- Seleccionando la demanda en la pantalla y haciendo clic sobre el botón “Vender”  en la barra principal del Sistema SET-FX.

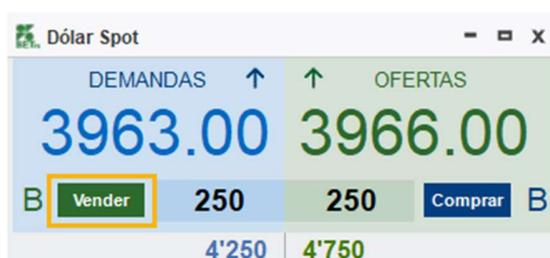


- Seleccionando la demanda y oprimiendo la tecla F3.

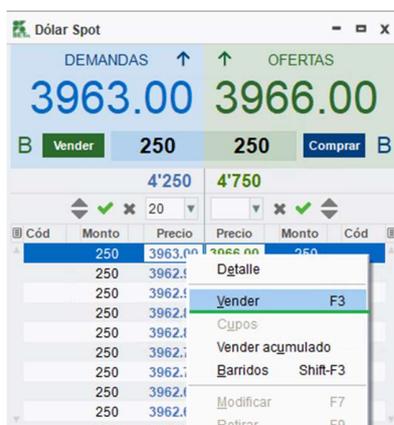
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 8 / 99

- Seleccionando la demanda y haciendo clic sobre el botón “Vender” de la pantalla demandas/ ofertas



- Seleccionando la demanda, dando clic derecho sobre esta y seleccionando la opción “Vender”

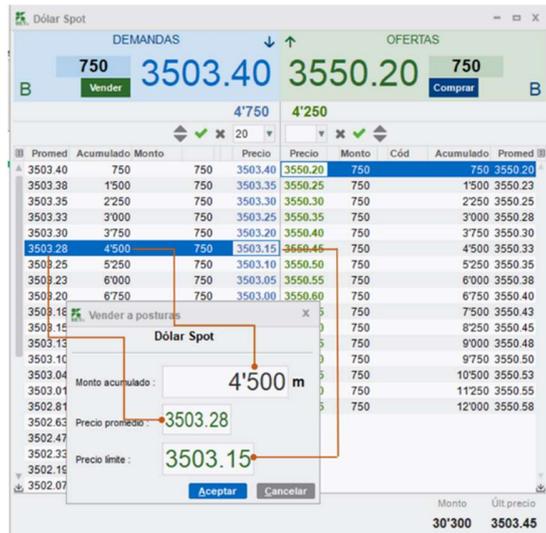


Las acciones descritas ejecutan la misma acción sobre la mejor postura o intención seleccionada.

La opción “Vender acumulado” ejecuta la venta de posturas/intenciones del monto acumulado seleccionado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 9 / 99



Realizar una compra

Una compra en el mercado spot del sistema SET-FX se puede realizar de varias formas que se describen a continuación:

- Seleccionando la oferta en la pantalla y haciendo clic sobre el botón “Comprar”  en la barra principal del Sistema SET-FX.



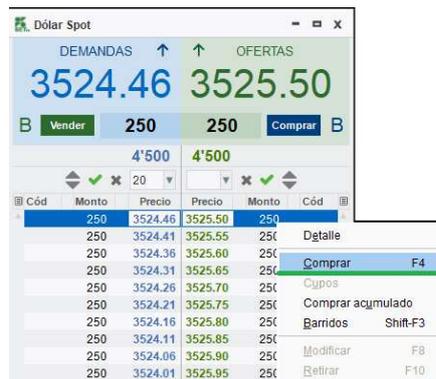
- Seleccionando la oferta y oprimiendo la tecla F4 en la postura seleccionada
- Seleccionando la oferta y haciendo clic sobre el botón “Comprar”



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

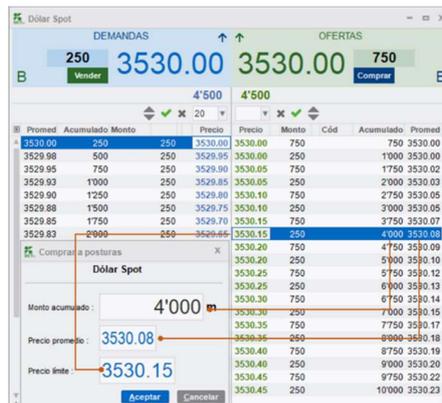
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 10 / 99

- Seleccionar la oferta, dando clic derecho sobre esta y seleccionando la opción “Comprar”



Las acciones descritas ejecutan la misma acción sobre la mejor postura o intención seleccionada.

La opción “Comprar acumulado” ejecuta la venta de posturas/intenciones del monto acumulado seleccionado.



Ingreso de una Demanda

Para ingresar una demanda en el mercado spot del sistema SET-FX existen varias maneras que se describen a continuación:

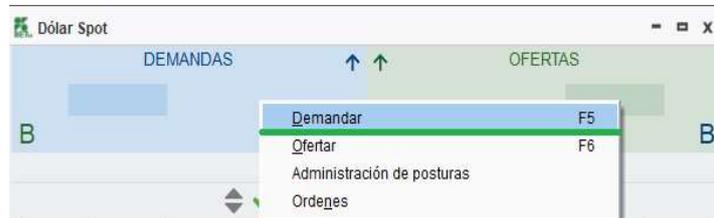
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 11 / 99

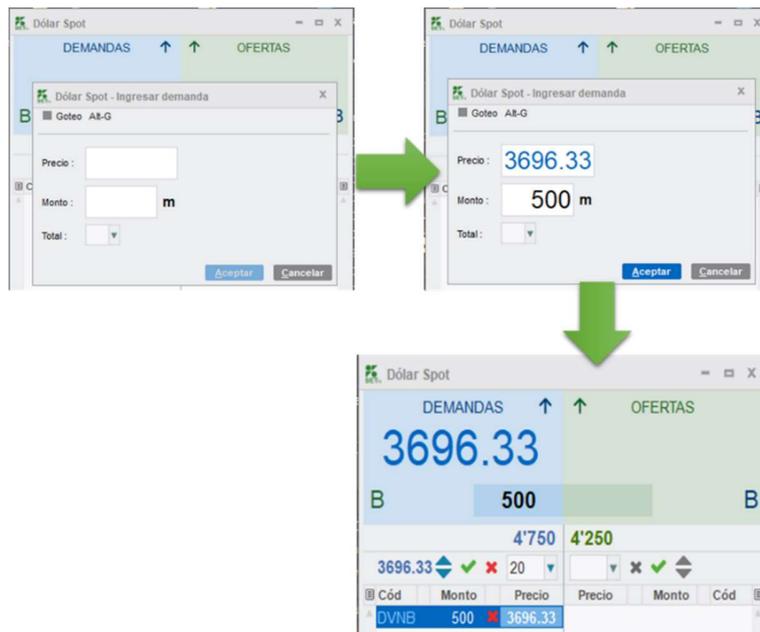
- Haciendo clic sobre el botón “Demandar”  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX



- Oprimiendo la tecla F5
- Desde la ventana “Dólar Spot”, haciendo clic derecho y escogiendo la opción “Demandar”



Las acciones descritas anteriormente despliegan una nueva ventana la cual permitirá el ingreso de la información relacionada a la demanda.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 12 / 99

Ingreso de una Oferta

Para ingresar una oferta en el mercado spot del sistema SET-FX existen varias maneras que se describen a continuación:

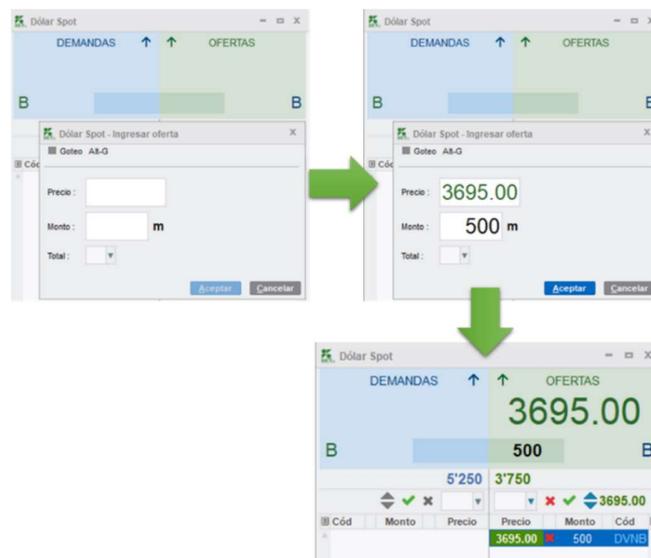
- Haciendo clic sobre el botón “Ofertar”  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX



- Oprimiendo la tecla F6
- Desde la ventana “Dólar Spot”, dando clic derecho y seleccionando la opción “Ofertar”



Las acciones descritas despliegan una nueva ventana la cual permitirá el ingreso de la demanda.

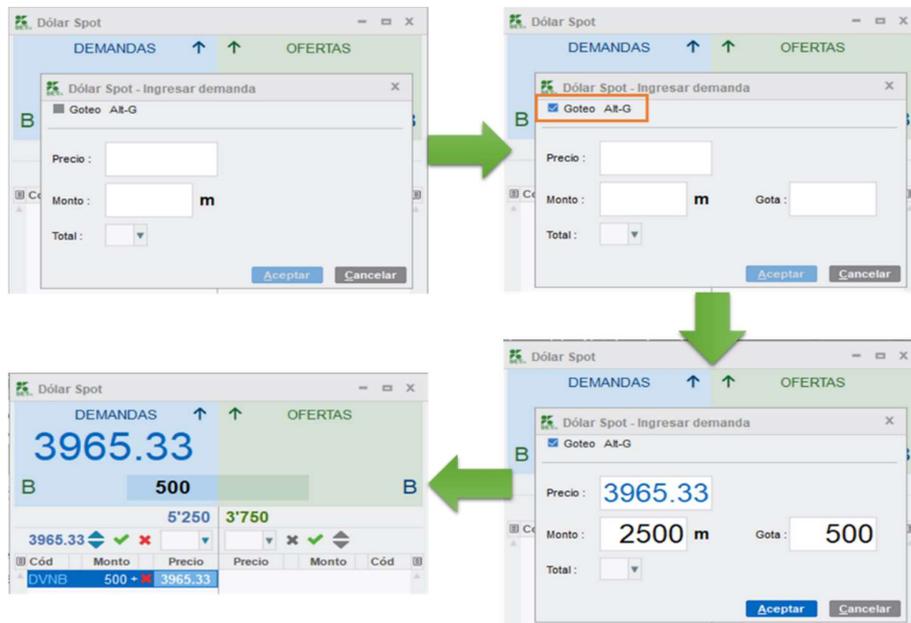


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 13 / 99

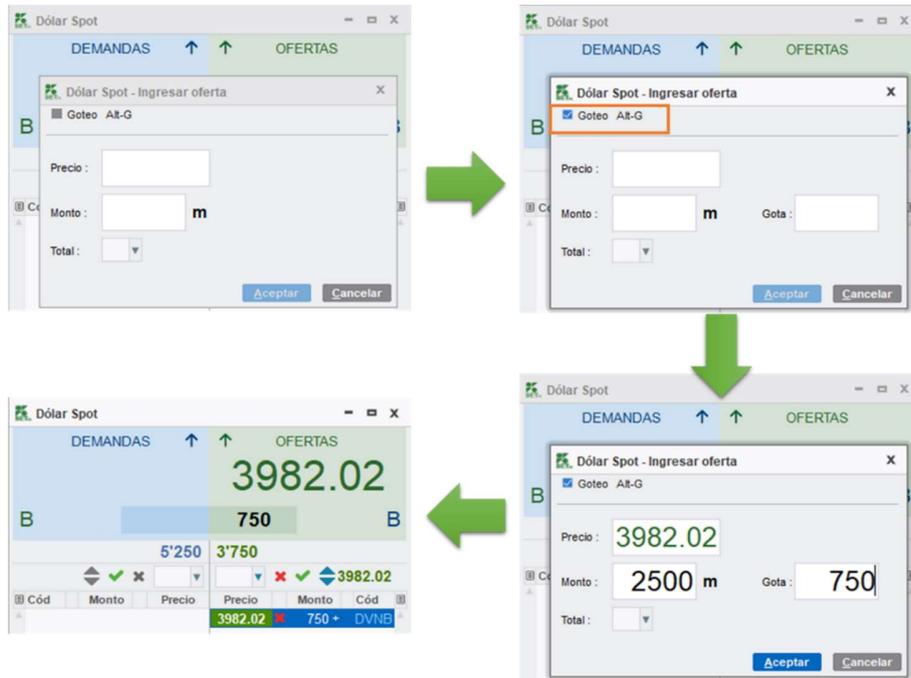
Ingreso de posturas bajo la modalidad de Goteo

Para ingresar una postura bajo esta modalidad, primero se debe realizar el proceso descrito anteriormente (ingreso demanda o ingreso oferta) y en la nueva ventana desplegada se debe seleccionar la opción “Goteo”. Una vez seleccionada esta opción, la ventana permitirá ingresar el monto total de la postura y el monto de cada gota.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 14 / 99



Las siguientes son unas aclaraciones con respecto a la agresión de una “gota” en el sistema SET-FX para ser tomadas en cuenta:

- Si la agresión se realiza por un monto igual o superior de la “gota” visible (de una postura con la condición de gota), y en ese momento existe una o más posturas al mismo precio, inmediatamente la postura agredida (la “gota”) perderá su prioridad y se ubicará al final de las demás posturas que tengan el mismo precio.
- Si la agresión se realiza por un monto inferior a la gota, la postura no pierde la prioridad, ni la posición.
- Cuando se realiza un barrido por un monto que implica varias posturas y una de ellas está por goteo, el sistema calza la primera gota, luego ejecuta las demás posturas visibles en el mismo nivel de precio y posteriormente continúa con las siguientes gotas ocultas.

Nota: el sistema únicamente permite el ingreso de demandas u ofertas cuando se tiene disponible cupo de cámara.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 15 / 99

De la misma forma en el momento en que a una entidad se le agote el cupo de cámara bien sea en la demanda o en la oferta, el sistema retirará todas sus posturas del lado en que se haya agotado el cupo (demanda u oferta) y sólo será posible su reingreso cuando en el momento en que cuente con cupo suficiente.

Las posturas retiradas se almacenarán en el módulo de administración de posturas para aquellas entidades que lo tengan activo y desde allí podrán modificar los precios o montos de las mismas antes de su reingreso.

Modificación de una Demanda

Para modificar una demanda del mercado Spot en el sistema SET-FX se pueden utilizar los siguientes métodos:

- Seleccionando la demanda y presionando el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.

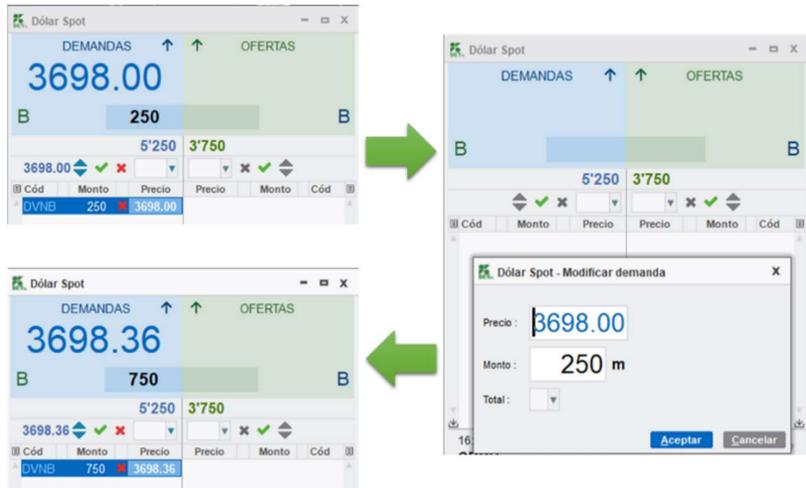


- Seleccionando la demanda y oprimiendo la tecla F7.
- Seleccionando la demanda, dando clic derecho sobre esta y seleccionar la opción "Modificar"

Cualquiera de las opciones mencionadas anteriormente retirará la postura del mercado mientras se realiza la modificación. Una vez se modifique la postura (en precio, monto), se debe hacer clic en el botón "Aceptar" para volver a ingresar la postura en la ventana de negociación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 16 / 99



Modificación de una Oferta

Para modificar una oferta del mercado spot en el sistema SET-FX se pueden utilizar los siguientes métodos:

- Seleccionando la oferta y presionando el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX

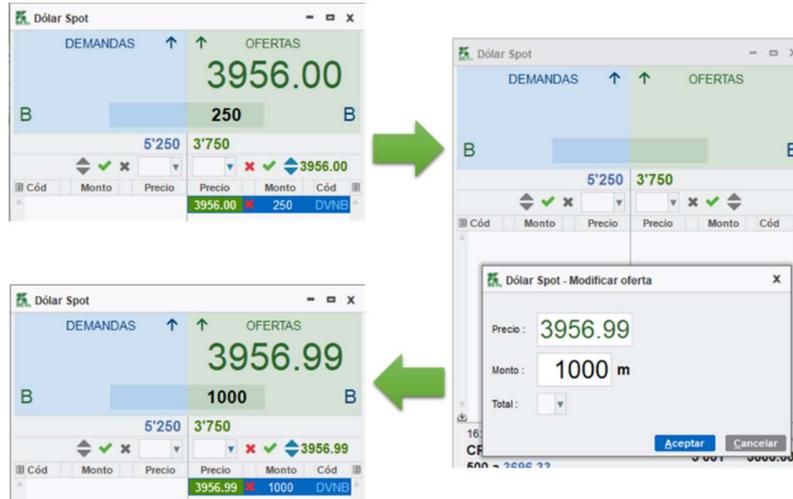


- Seleccionando la oferta y oprimiendo la tecla F8
- Seleccionando la oferta, dando clic derecho sobre ella y escogiendo la opción "Modificar"

En cualquiera de los casos anteriores se retirará la postura del mercado mientras se finaliza el proceso de modificación. Una vez se modifique la postura (en precio, monto), se debe hacer clic en el botón "Aceptar" para volver a ingresar la postura en la ventana de negociación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 17 / 99



Retiro de una Demanda

Para retirar una demanda del mercado spot en el sistema SET-FX se pueden utilizar los siguientes métodos:

- Seleccionando la demanda a retirar y hacer clic sobre el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.



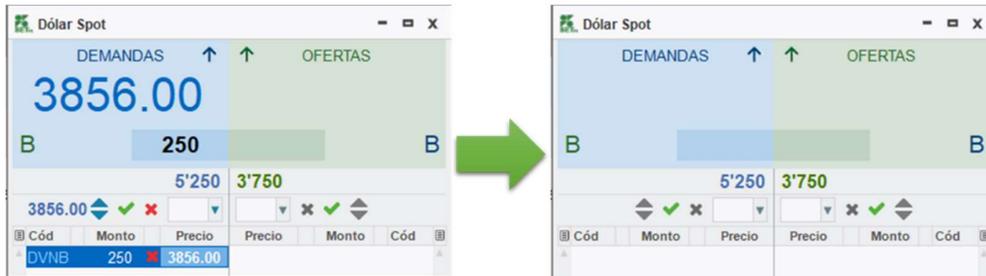
- Seleccionando la demanda a retirar y oprimiendo la tecla F9
- Seleccionando la demanda a retirar y dando Clic sobre la "X" que se antepone al precio

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 18 / 99



- Seleccionando la demanda a retirar, dar clic derecho sobre esta y escoger la opción “Retirar”



Retiro de una Oferta

Para retirar una oferta del mercado spot en el sistema SET-FX se pueden utilizar los siguientes métodos:

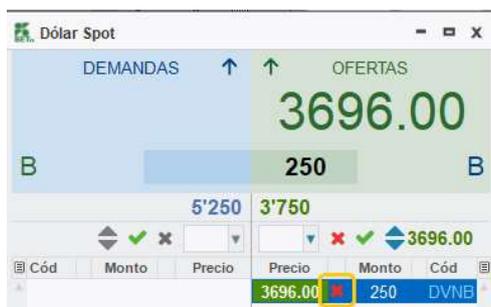
- Seleccionando la oferta a retirar y dar clic sobre el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.



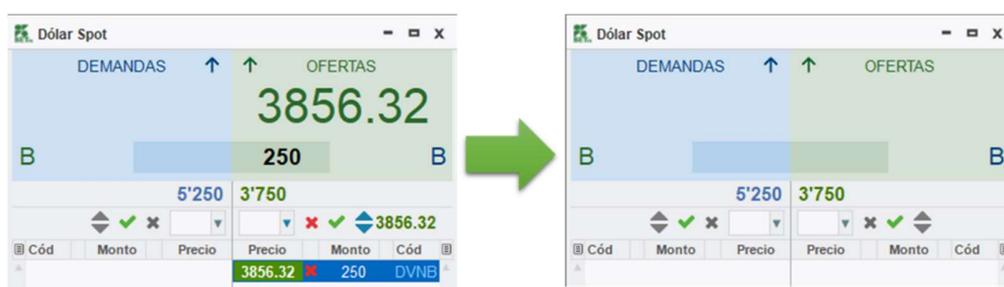
- Seleccionando la oferta a retirar y luego oprimiendo la tecla F10.
- Seleccionando la oferta a retirar y dar Clic sobre la “X” que esta posterior al precio.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 19 / 99



- Seleccionando la oferta a retirar, clic derecho sobre esta y escoger la opción “Retirar”



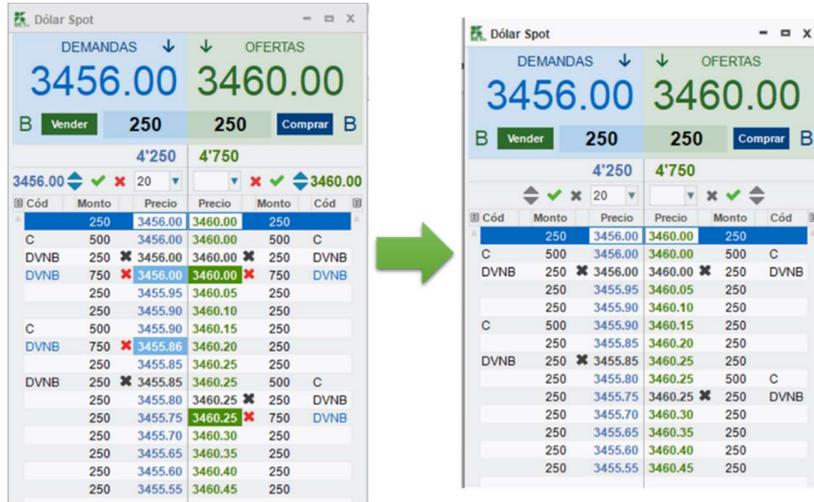
Retiro de Todas mis Posturas

Para retirar todas las posturas (demandas y ofertas) ingresadas por el usuario en el sistema SET-FX, se debe dar clic sobre el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 20 / 99



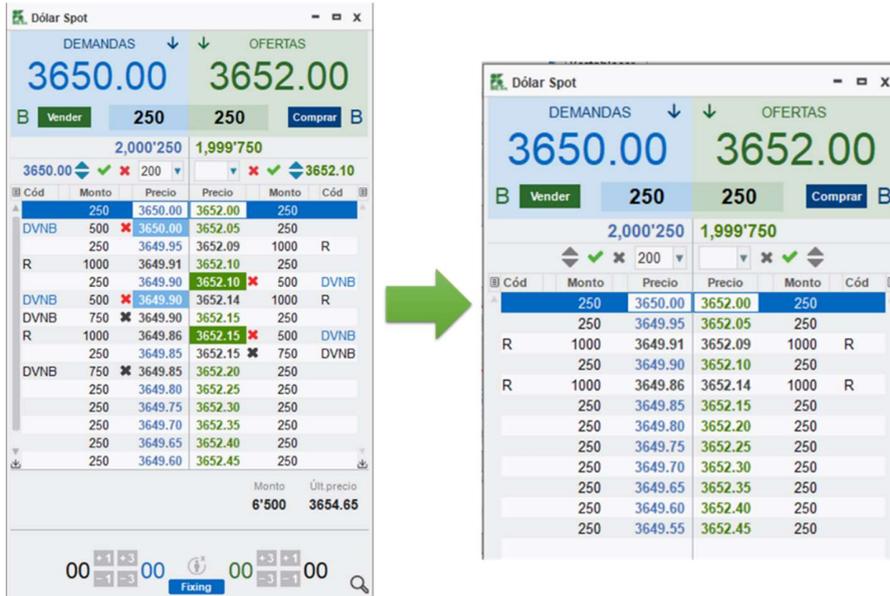
Retirar Todas las Posturas de mi Sucursal

Para retirar las posturas (demandas y ofertas) ingresadas por un usuario y las de otros usuarios que pertenezcan a la misma sucursal se debe dar clic en el botón  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 21 / 99



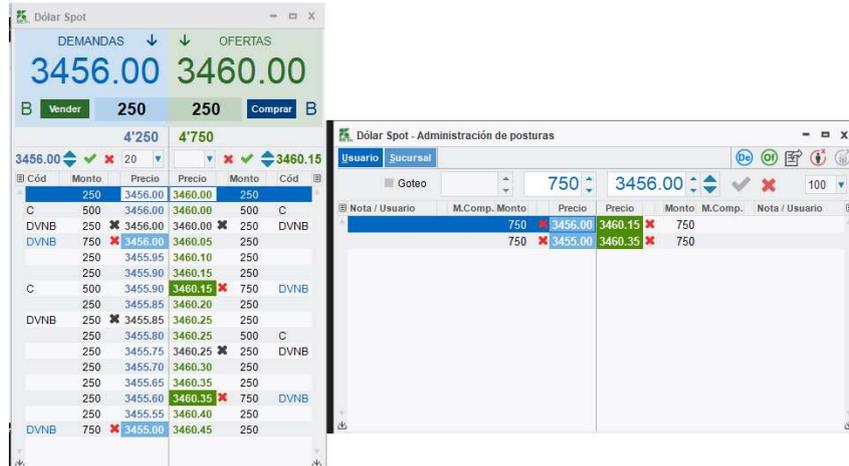
2.2. ADMINISTRADOR DE POSTURAS

Para acceder al administrador de posturas del sistema SET-FX, es necesario dar clic en el botón  "Administración de posturas", una vez hecho esto se despliega una nueva ventana donde se pueden ingresar, modificar y eliminar las posturas propias del usuario y de la misma sucursal.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 22 / 99



2.2.1. Descripción De La Ventana “Dólar Spot Administración De Posturas”

A continuación se describe los campos y funciones contenidas en la pantalla “Dólar spot administración de posturas:



Ítem	Nombre	Descripción
1	Visualizar posturas del usuario	Filtro de visualización de posturas (mis posturas)
2	Visualizar posturas de la sucursal	Filtro de visualización de posturas (mis posturas y las de mi sucursal)

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 23 / 99

3	Ingresar Demanda	Permite el ingreso de posturas las cuales se verán reflejadas en la ventana de “Dólar Spot”
4	Ingresar Oferta	Permite el ingreso de posturas las cuales se verán reflejadas en la ventana transaccional
5	Enviar al mercado posturas grises	Permite al usuario ingresar las posturas que fueron retiradas de la ventana por cupo CRCC insuficiente
6	Retirar todas mis posturas	Retira las posturas ingresadas por el usuario
7	Retirar todas las posturas de mi sucursal	Retira las posturas propias y de otros usuarios que pertenezcan a la misma sucursal
8	Barra de modificación rápida	Herramienta para la modificación de posturas
9	Visualizador de posturas	Espacio en el cual se visualizarán las posturas ingresadas desde la ventana transaccional

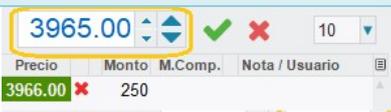
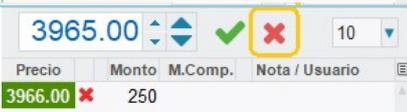
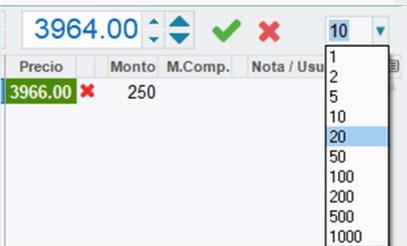
2.2.2. Barra De Modificación Rápida



Ítem	Icono	Nombre	Descripción
1		Campo informativo	Indica si la postura tiene la condición de gota (Goteo)
2		Modificación de monto oculto (gotas)	Este campo se activa si la postura tiene condición de gota y permite modificar el monto oculto de esta. Al hacer clic en la flecha ascendente/descendente el monto aumenta o disminuye en USD\$250.000 por cada clic. También es posible modificar la postura digitando el monto en el campo.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 24 / 99

3		Modificación de monto (visible)	Permite modificar el monto visible de la postura. Al hacer clic en la flecha superior el monto aumenta en USD\$250.000 y al hacer clic en la flecha inferior el monto disminuye en la misma cantidad. También es posible modificar la postura digitando el monto en el campo
4		Modificación del precio	En este campo se permite modificar el precio de la postura. Al hacer clic sobre las flechas más pequeñas el precio aumenta o disminuye en un centavo, mientras que al hacer clic en las flechas grandes el precio aumenta o disminuye de acuerdo con la cantidad en centavos definida en el campo 7
5		Aceptar modificación	Aplica los cambios realizados en la postura
6		Retira postura	Retira las posturas seleccionada
7		Valores preestablecidos	Cantidad en centavos que permite la modificación del precio de la postura

2.2.3. Descripción Columnas “Dólar Spot – Administración De Posturas”



Nota / Usuario	M.Comp.	Monto	Precio	Precio	Monto	M.Comp.	Nota / Usuario
▲ Cliente A	250	✘ 3964.00	3966.00	✘	250		
ALFONSO	500	✘ 3964.00	3966.00	✘	500	4000	ALFONSO

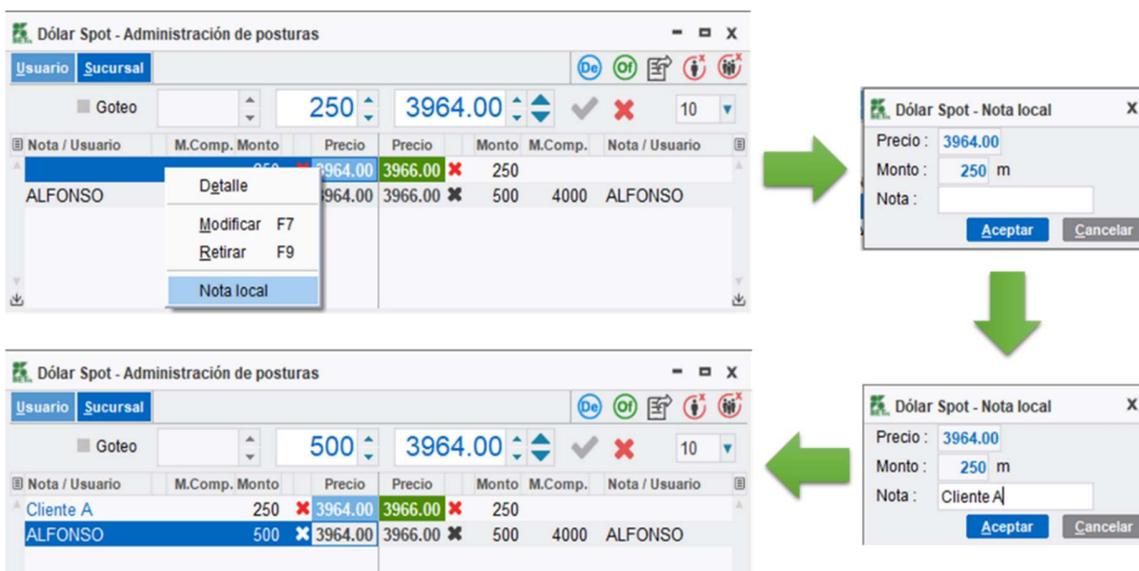
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 25 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Nota/Usuario	En este campo, el usuario puede ingresar una nota personalizada a cada postura con el fin de identificarla fácilmente o facilitar su seguimiento.
2	Monto	Es el monto visible de la postura en la ventana transaccional. Si la postura tiene la calidad de gota, este campo muestra el tamaño de esta.
3	Precio	Es el precio de la postura.
4	M.Comp. (Monto Completo)	Si la postura tiene la calidad de "Gota", en este campo se visualiza el monto total de la misma; de lo contrario el campo aparece vacío.

2.2.4. Ingresar Una Nota

Para ingresar una nota es necesario hacer clic derecho sobre la postura y seleccionar la opción "Nota local" e ingresar el dato o la nota en el espacio correspondiente.



The screenshot illustrates the process of adding a local note to a trade in the 'Dólar Spot - Administración de posturas' application. The main window shows a table of trades with columns for 'Nota / Usuario', 'M.Comp.', 'Monto', and 'Precio'. A right-click context menu is open over the 'ALFONSO' trade, with 'Nota local' selected. A dialog box 'Dólar Spot - Nota local' is shown, where the 'Precio' is 3964.00, 'Monto' is 250 m, and 'Nota' is empty. A second dialog box shows the 'Nota' field populated with 'Cliente A'.

Es importante tener en cuenta que en el momento en que las posturas de una entidad sean retiradas por el sistema debido a la falta de cupo de cámara, estas serán almacenadas en el módulo de administración de posturas (para aquellas entidades que tengan activo este módulo), desde donde

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 26 / 99

se podrán modificar, retirar o reingresar una vez la entidad cuente nuevamente con cupo de Cámara suficiente.

Las posturas que hayan sido retiradas en el sistema aparecerán resaltadas en color gris en el módulo de administración de posturas.

2.3. ÓRDENES MERCADO SPOT



Para ingresar una orden en el mercado spot del sistema SET-FX, ubique el botón  en la barra principal del Sistema SET-FX y haga clic sobre él. Posteriormente se mostrará una ventana con el nombre “Dólar Spot – Órdenes” la cual permite el ingreso de órdenes al sistema. El acceso a esta opción también se puede hacer desde la ventana transaccional, haciendo clic derecho y escogiendo la opción “Órdenes.” Sobre el menú que se despliega.

Si una entidad no cuenta con Cupo Cámara suficiente, no podrá ingresar una orden de mercado Spot.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 27 / 99

2.3.1. Descripción Ventana “Dólar Spot – Ordenes”

A continuación, se describen los botones y funciones de la pantalla “Dólar Spot – Ordenes”



Ítem	Nombre	Descripción
1	Ingresar	Despliega un menú para escoger el tipo de orden a ingresar compra y/o venta
2	Precio	Precio de la orden ingresada
3	Cantidad	Monto ingresado en la orden
4	Operado	Cantidad del monto agredido u operado
5	Promedio	Promedio del precio operado
6	Saldo	Si la orden es calzada parcialmente se mostrará el monto pendiente por calzar
7	Expira	Hora del sistema en la que expira la orden.
8	Grilla de órdenes de compra	Visualiza las órdenes de compra ingresadas
9	Grilla de órdenes de venta	Visualiza las órdenes de venta ingresadas

2.3.2. Ingreso De Una Orden De Compra/Venta

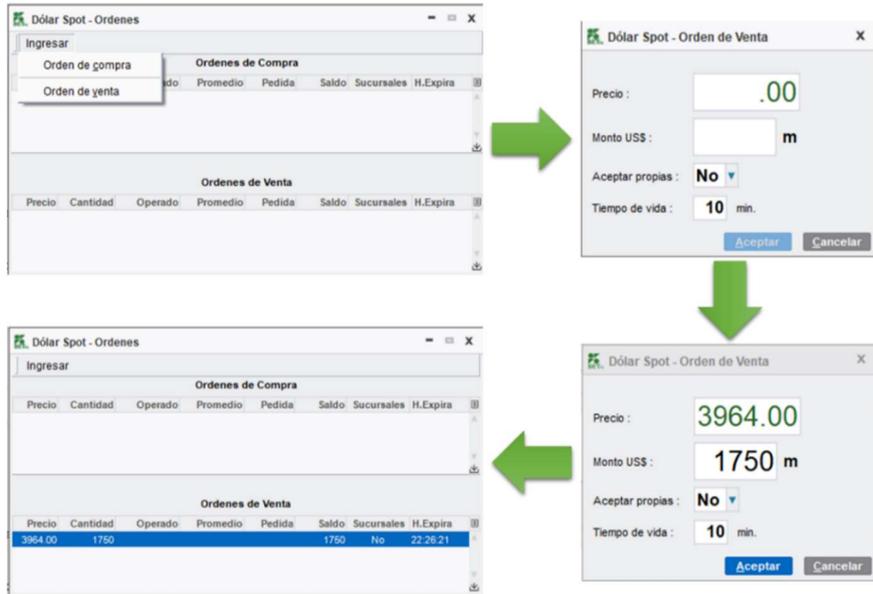
Este es el proceso para ingresar una orden en el sistema SET-FX:

- En la ventana “Dólar Spot – Ordenes” dar clic en botón “Ingresar”
- Luego Seleccionar si es “Orden de compra” u “Orden de venta”
- Ingresar datos de la orden

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 28 / 99

- Y finalmente dar clic en el botón “Aceptar”



Al activar una orden, en la ventana “Dólar Spot” se mostrará en la parte superior el botón  indicando que la orden está activa en el sistema. Al finalizar el tiempo de vigencia de la orden esta desaparece de la ventana “Dólar Spot”.

Cód	Monto	Precio	Precio	Monto	Cód
500	3399.90	3500.25	250		
500	3399.85	3500.30	250		
500	3399.80	3500.35	250		
500	3399.75	3500.40	250		
500	3399.70	3500.45	250		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 29 / 99

Es importante tener en cuenta que sólo se pueden ingresar órdenes en el sistema cuando se tiene cupo de cámara suficiente. Así mismo, en caso de que el cupo cámara se agote, el sistema retirará la orden ingresada.

2.3.3. Notificaciones Blotter De Mensajes

El ingreso, retiro y expiración de una orden es informado al sistema a través del sistema de mensajería o “chat”.



2.4. REGISTRO DE TRANSACCIONES

El Sistema SET-FX permite registrar operaciones que fueron negociadas en el mercado OTC o en otro Sistema de Negociación y Registro de Divisas.

Para registrar una transacción, debe ubicar el botón  en la barra principal del Sistema SET-FX.



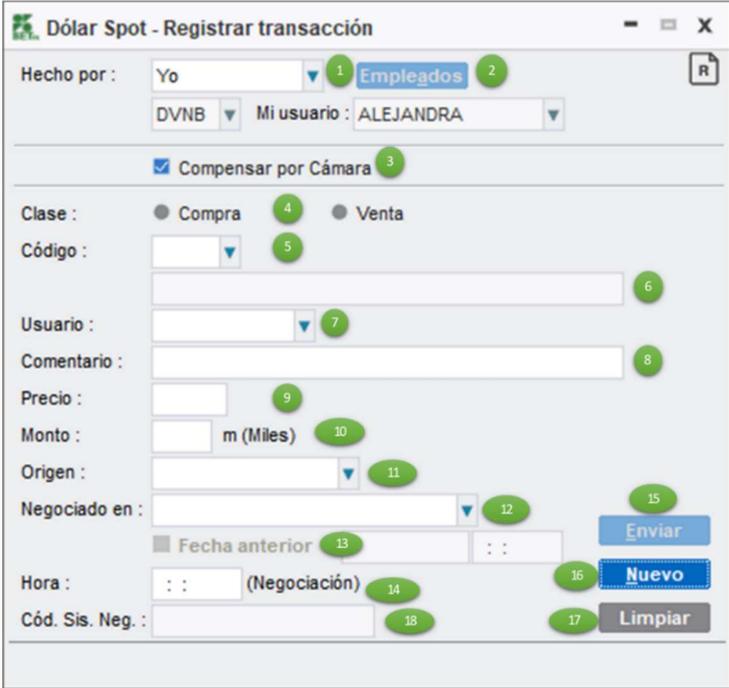
- Las entidades que solo permitan registros por cámara, únicamente pueden registrar operaciones si existe cupo Cámara suficiente.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 30 / 99

- Las entidades que permitan registros sin compensación, deben crear en el sistema cupos bilaterales con las contrapartes y el sistema solo permitirá registros si existe cupo bilateral suficiente con dicha contraparte.
- Los registros bilaterales pueden ser enviados directamente a compensación si existe cupo cámara o pueden quedar por fuera de la cámara y ser enviados en el transcurso de la jornada, lo cual es responsabilidad del afiliado. Una vez se compensen las operaciones en la CRCC, se libera el cupo bilateral para consumir el cupo Cámara.
- Una vez la operación pasa a la CRCC para compensación, esta será la contraparte de la misma.

A continuación, se describen los botones y funciones de la ventana “Registrar Transacción”



Ítem	Nombre	Descripción
1	Hecho por	El usuario puede realizar registros a nombre propio, a nombre de un usuario de la misma entidad que se

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 31 / 99

		<p>encuentre vinculado en el sistema SET-FX o a nombre de un funcionario de la entidad y que no tenga un usuario registrado en el sistema SET-FX. Al desplegar el listado se dan estas 3 opciones:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Yo, • Usuario SET-FX • Otro
2	Empleados	Permite crear usuarios que pertenecen a la entidad, pero no tienen un usuario creado en el sistema SET-FX
3	Compensar por Cámara	Indica si el registro a enviar es compensación por Cámara
4	Compra/Venta	Indica si el registro es una compra o venta. Campo obligatorio
5	Código	Nemotécnico de la entidad contraparte. Campo obligatorio
6	Nombre Entidad Contraparte	Indica el nombre completo de la entidad contraparte, campo no editable.
7	Usuario	Nombre del usuario contraparte. Campo obligatorio.
8	Comentario	Permite el ingreso de un comentario, campo opcional.
9	Precio	Precio del registro, campo obligatorio.
10	Monto	Monto del registro, expresado en miles, campo obligatorio
11	Origen	Origen del registro, Spot, Swap O/N contado, Swap Forward, Swap Futuro. Campo obligatorio.
12	Negociado en	Sistema de negociación del registro, Directo, SET-ICAP, Bloomberg, Banco de la Republica, GFI Exchange, Tradition, OTC, Refinitiv, Dirección Tesoro Nacional. Campo obligatorio.
13	Fecha anterior	Campo para indicar que el registro es del día anterior. Solo se activa durante los primeros 15 minutos de apertura del mercado, de acuerdo a la norma DOAM-317 del Banco de la Republica.
14	Hora	Hora de negociación del registro. Formato de hora militar. No se permite el ingreso de una hora superior a la hora actual del sistema. Campo obligatorio.
15	Enviar	Permite el envío de la solicitud de registro a la contraparte. Se activa en el momento que sean diligenciados todos los campos obligatorios.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 32 / 99

16	Nuevo	Permite realizar un nuevo registro con los datos del anterior registro.
17	Limpiar	Borra todos los datos ingresados y genera un nuevo registro.
18	Cód. Sis. Neg	<p>Código Sistema de Negociación. Este campo será solicitado para aquellas operaciones celebradas en otro sistema de negociación y que sean registradas en el sistema SET-FX. Aplica para los registros que hacen parte del cálculo de la TRM.</p> <p>Este campo tiene como características ser alfanumérico con una longitud de 16 caracteres y es obligatorio para los siguientes sistemas de negociación:</p> <ul style="list-style-type: none"> • SET-ICAP • GFI • TRADITION • Banco de la República • Dirección del Tesoro Nacional

2.4.1. Creación De Empleados

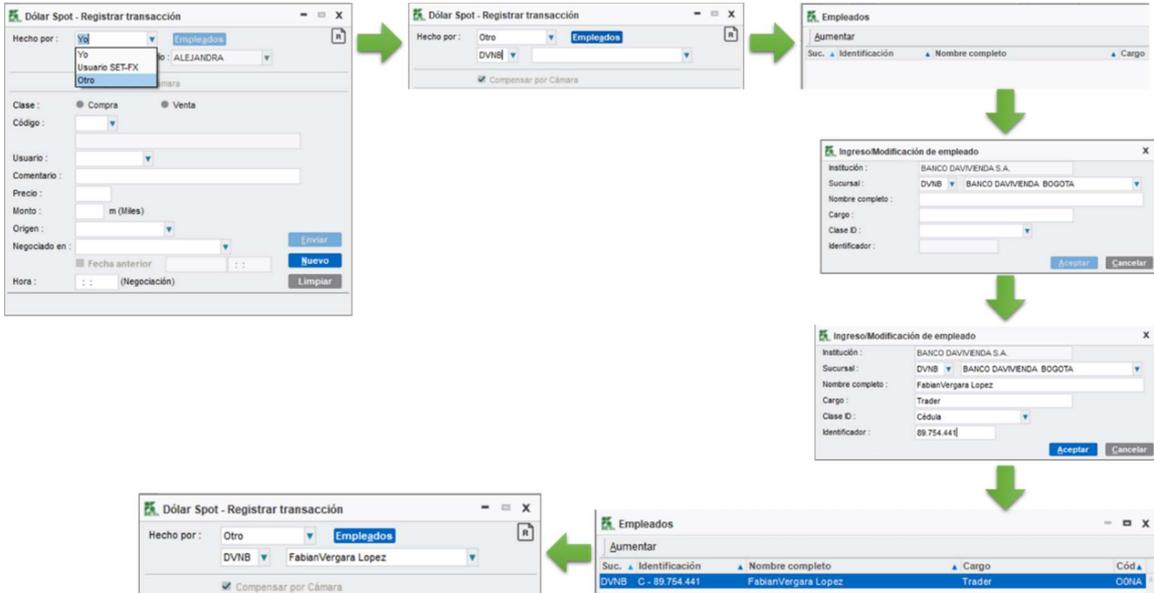
El usuario puede crear una lista de empleados el cual pertenece a la entidad, pero no tienen un perfil creado en el sistema SET-FX.

Para crear un empleado debe seguir los siguientes pasos:

- En la Ventana “Dólar Spot –Registrar transacción” seleccionar el campo “Hecho por” y desplegar el listado
- Escoger la opción “Otro”
- Ubicar el botón “Empleados” y hacer clic sobre este botón.
- Se abre una nueva ventana “empleados”, sobre la cual se selecciona la opción “Aumentar”.
- Ingresar la información del empleado a crear
- Dar Clic en el botón “Aceptar”

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 33 / 99



2.4.2. Envío De Registros

Una vez realizado el procedimiento de ingreso de la información para registrar una transacción en el sistema SET-FX deben surtirse unos procesos posteriores para que el registro quede en el sistema como una operación válida o en caso contrario no sea tomada en cuenta.

Confirmación de registros

Posterior al diligenciamiento de los campos correspondientes al registro por parte del usuario, el sistema envía una solicitud a la contraparte del mismo. Esta contraparte podrá visualizar previamente en detalle la información del registro y podrá confirmar o rechazar dicha solicitud.

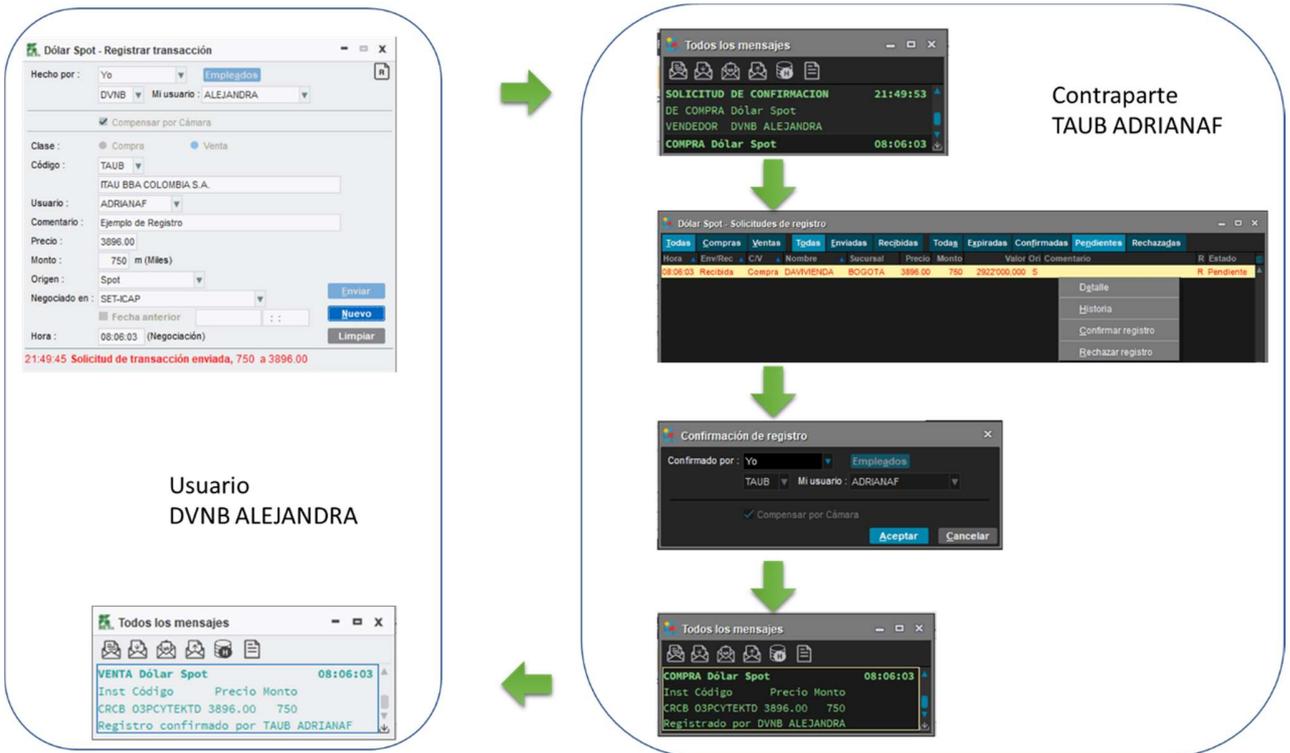
Para el ejemplo:

- DVNB Alejandra envía una solicitud de registro al usuario TAUB ADRIANAF

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 34 / 99

- TAUB ADRIANAF le llega un mensaje de “Solicitud de confirmación” en el blotter de mensajes
- TAUB ADRIANAF, al hacer doble clic sobre la solicitud se despliega la ventana “Dólar Spot – Solicitud de registro”
- Clic derecho sobre la solicitud, confirmar registro
- Posteriormente se abrirá una ventana de confirmación de registro, la cual permite elegir el usuario que confirma la operación.
- Al hacer clic en el botón de *Aceptar*, se envía un mensaje a las partes involucradas informándoles que la operación se encuentra en firme.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 35 / 99

Rechazo de registro

Cuando la solicitud de registro es rechazada por la contraparte, el sistema SET-FX enviará un mensaje informando el rechazo al usuario que envió el registro.



Es importante tener en cuenta que los registros siguen la definición realizada por el administrador de cupos en lo respectivo a la obligatoriedad o no de que los registros vayan compensados por CRCC desde su ejecución.

En este sentido, cuando la entidad que envía el registro obliga que todas las operaciones vayan por cámara, la marca "compensar por cámara" aparecerá siempre marcada por defecto y no podrá modificarse.

Por otra parte, si la entidad receptora no obliga que todos los registros vayan por Cámara, estos siempre aparecerán marcados en la opción "Compensar por Cámara", sin embargo, el trader que envía el registro puede retirar esta marca. Si en este caso el registro es enviado sin marcar la opción "compensar por cámara" pero la contraparte obliga todos sus registros por cámara entonces el

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 36 / 99

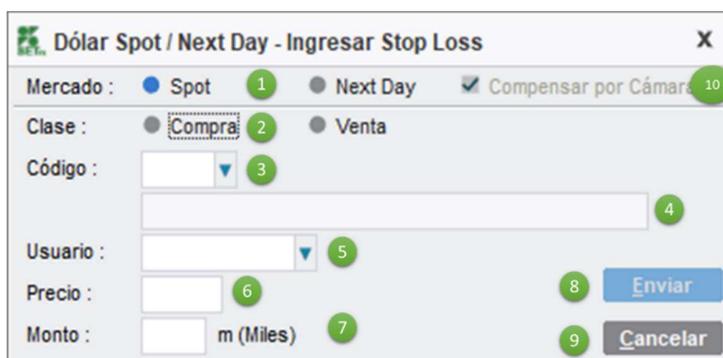
sistema le enviará un nuevo mensaje al remitente de la solicitud, para que confirme que la operación debe ir por cámara y en consecuencia queda marcada nuevamente la opción “Compensar por Cámara”.

2.5. STOP LOSS

El Stop Loss es un acuerdo de compra o de venta entre una contraparte inicial denominada “solicitante” y una contraparte receptora, denominada “aceptante” que definen con anticipación unas condiciones en monto y precio, que en caso de alcanzarse se ejecutan y dan lugar a una operación registrada en el sistema SET-FX.

El botón  da acceso para ingresar una orden de *Stop Loss* se encuentra en la barra principal del Sistema SET-FX.





Mercado : Spot ¹ Next Day Compensar por Cámara ¹⁰
 Clase : Compra ² Venta
 Código : ³
 Usuario : ⁵
 Precio : ⁶ ⁸
 Monto : m (Miles) ⁷ ⁹

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 37 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Mercado	Permite escoger el mercado a ingresar la orden Stop Loss. Campo obligatorio
2	Clase	Tipo de Stop Loss compra o venta. Campo obligatorio.
3	Código	Nemotécnico de la entidad contraparte. Campo obligatorio
4	Nombre Entidad	Nombre completo entidad contraparte. Campo no editable.
5	Usuario	Nombre del usuario contraparte. Campo obligatorio.
6	Precio	Precio del registro, campo obligatorio.
7	Monto	Monto del registro, expresado en miles, campo obligatorio.
8	Enviar	Permite el envío de la solicitud de Stop Loss a la contraparte. Se activa en el momento que sean diligenciados todos los campos obligatorios.
9	Cancelar	Cancela la solicitud de envío.

Es importante tener en cuenta los siguientes aspectos con respecto a la interacción de las órdenes Stop Loss con los cupos de cámara.

- Las órdenes Stop Loss reservan cupo Cámara.
- No se permite pactar un Stop Loss si no se tiene cupo cámara suficiente.
- Una vez se concrete la operación Stop Loss, el cupo reservado se consume y la CRCC pasa a ser contraparte de dicha operación.

Condiciones de envío

- Si es una compra, el precio ingresado debe ser mayor que el precio de cierre Spot.
- Si es una venta, que el precio especificado sea menor al último precio cerrado en el mercado.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 38 / 99



Dólar Spot - Resumen de hoy Horario : 07:00 - 23:00

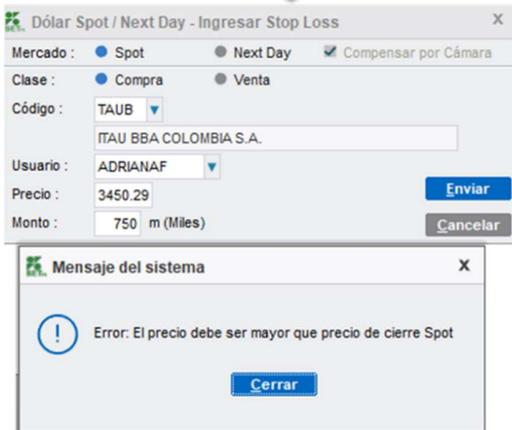
Precios

Apertura*: 3550.00 Precio Fix: 3496.35 Mínimo*: 3450.30
 Cierre*: 3450.30 ↓ Promedio: 3491.35 Máximo*: 3963.00
 Hora últ. trans*: 14:28:21

Montos en miles

Negociado: 20'250 Último*: 250 Mínimo: 250
 Transacciones: 38 Promedio: 533 Máximo: 5'000

* No incluye transacciones registradas [Imprimir](#) [Detalle](#) [Anteriores](#)



Dólar Spot / Next Day - Ingresar Stop Loss

Mercado: Spot Next Day Compensar por Cámara

Clase: Compra Venta

Código: TAUB
 ITAU BBA COLOMBIA S.A.

Usuario: ADRIANAF

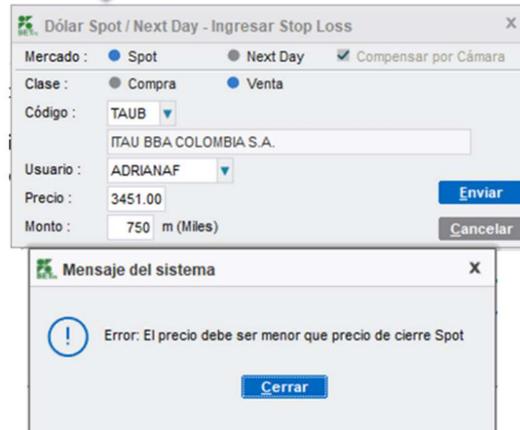
Precio: 3450.29 [Enviar](#)

Monto: 750 m (Miles) [Cancelar](#)

Mensaje del sistema

! Error: El precio debe ser mayor que precio de cierre Spot

[Cerrar](#)



Dólar Spot / Next Day - Ingresar Stop Loss

Mercado: Spot Next Day Compensar por Cámara

Clase: Compra Venta

Código: TAUB
 ITAU BBA COLOMBIA S.A.

Usuario: ADRIANAF

Precio: 3451.00 [Enviar](#)

Monto: 750 m (Miles) [Cancelar](#)

Mensaje del sistema

! Error: El precio debe ser menor que precio de cierre Spot

[Cerrar](#)

2.5.1. Estados Ventana Stop Loss

Todas las ordenes Stop Loss pueden ser visualizadas en la ventana “Dólar Spot/ Next Day – Stop Loss”. Allí podrá visualizarse el estado de cada orden en el sistema SET-FX. Las diferentes partes de la ventana se describen a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 39 / 99

Hora	▲ Mercado	▲ C/V	▲ Precio	▲ Strike	▲ Monto	Cód.	P	Estado	C
14:57:41	Spot	Compra	3452.00	3452.00	500	TAUB ADRIANAF	P	● Vigente	C
14:55:20	Spot	Compra	3451.00	3451.00	750	TAUB ADRIANAF	P	Transado	C
14:59:24	Spot	Venta	3450.29		500	TAUB ADRIANAF	P	● Solicitado	C
14:34:49	Spot	Venta	3450.00		500	TAUB ADRIANAF	P	Rechazado	C
14:36:16	Spot	Venta	3450.29	3450.29	750	TAUB ADRIANAF	P	Desconectó	C
14:56:29	Spot	Venta	3450.28	3450.28	750	TAUB ADRIANAF	P	● Desactivar Stop Loss	C D
14:55:45	Spot	Venta	3449.30	3449.30	500	TAUB ADRIANAF	P	Desactivado	C
15:16:03	Spot	Compra	3452.05	3452.05	750	TAUB ADRIANAF	P	● Confirmar desactivación	C D

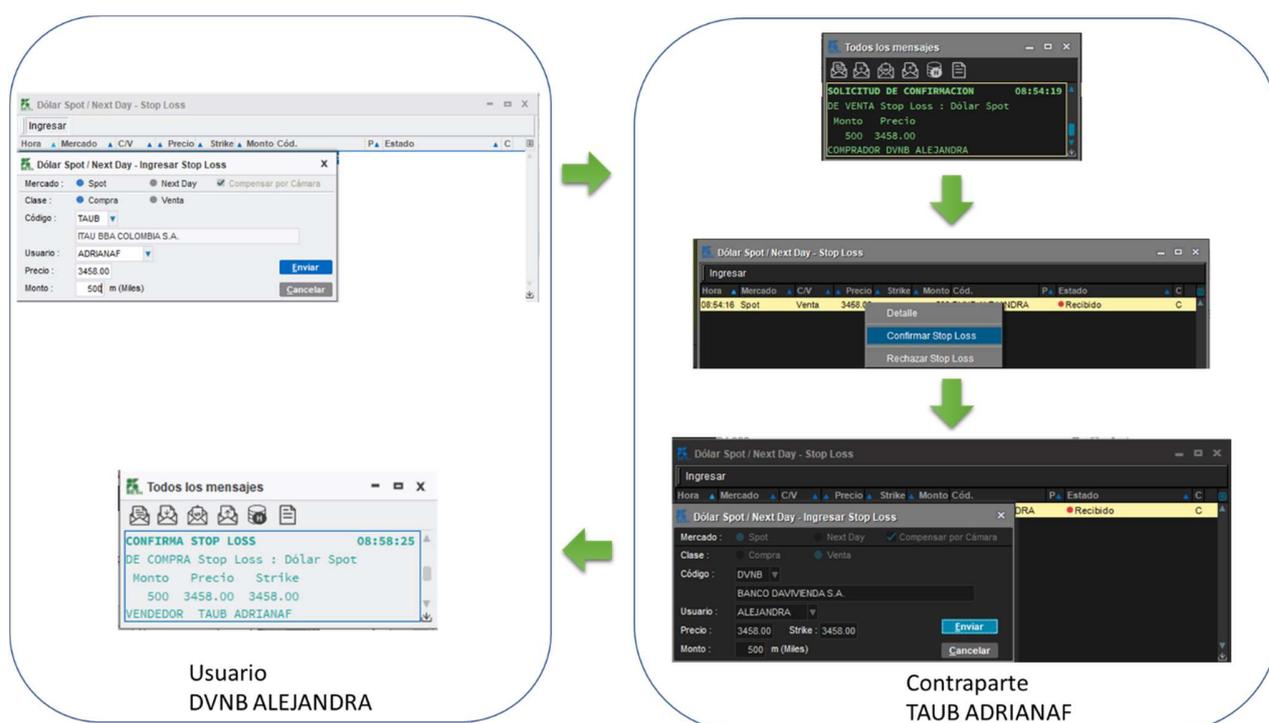
Estado	Nombre	Descripción
1	Vigente	Corresponde a aquellas órdenes Stop Loss que se encuentran confirmadas por ambas contrapartes y vigentes.
2	Transado	Corresponde a una orden Stop Loss que ya fue ejecutada porque se cumplió la condición.
3	Solicitado	Este estado aparece con un indicador de color rojo y corresponde a aquellas solicitudes de confirmación de Stop Loss que le llegaron a la entidad aceptante, pero que no han sido confirmadas por esta.
4	Rechazado	Corresponde a aquellas órdenes Stop Loss que fueron enviadas por el solicitante, pero rechazadas por el aceptante.
6	Recibido	Corresponde al estado de solicitud antes de confirmar una orden de Stop Loss
5	Desconectó	Este estado aparece cuando alguno de los dos usuarios se desconecta del sistema SET-FX.
6	Desactivar Stop Loss	Corresponde al estado cuando se solicita desactivar Stop Loss, pero la contraparte no ha confirmado la solicitud.
7	Desactivado	Estado el cual indica la desactivación del Stop Loss
8	Confirmar desactivación	Estado cuando la contraparte solicita desactivar Stop Loss, pero el usuario no ha confirmado la solicitud.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 40 / 99

Envío Stop Loss

A continuación, se expone un ejemplo del envío de una operación por medio de la funcionalidad Stop Loss:

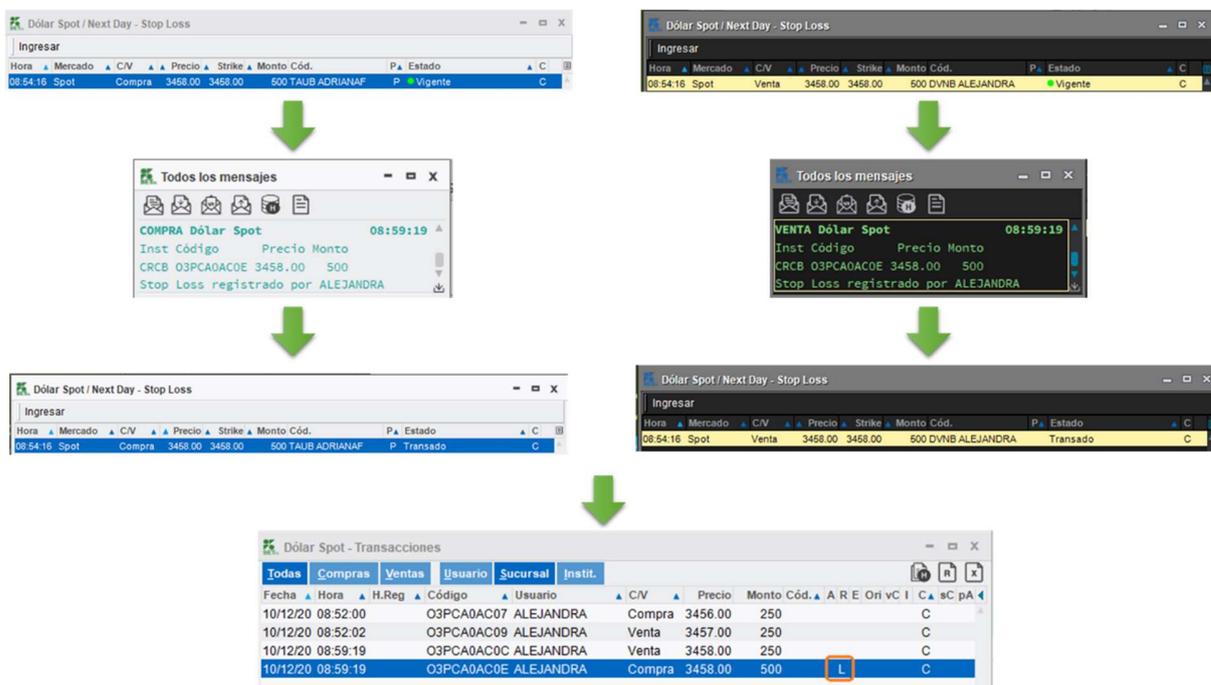


Ejecución Stop Loss

A continuación, se expone un ejemplo en la ejecución y visualización en el blotter de transacciones:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 41 / 99



2.6. FIXING (MATCHING)

La herramienta Matching o Fixing en el sistema SET-FX, es un mecanismo de negociación entre IMC's, que permite a un usuario transaccional lanzar posturas de demanda u oferta sobre un precio determinado, de tal manera que otras contrapartes puedan tomar posición de compra o venta sobre ese mismo precio.

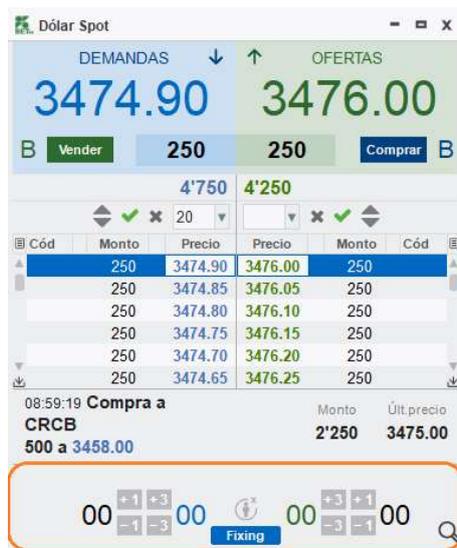
El calce de las operaciones mediante la herramienta Fixing, está sujeta a la disponibilidad de cupos Cámara.

De acuerdo a lo establecido cada entidad podrá lanzar como máximo ocho 12 sesiones de Fixing al día (susceptible a ser modificado por decisión del Comité Cambiario).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 42 / 99

Las entidades con acceso a esta herramienta la podrán visualizar en la parte inferior de la tabla de negociación Spot como se muestra a continuación:



Para lanzar una postura utilizando esta herramienta, los usuarios con acceso a esta deberán hacer clic sobre el botón Fixing  de la barra de herramientas del Sistema:



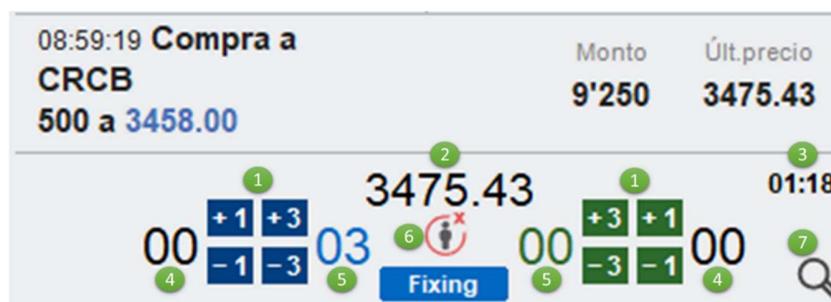
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 43 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Intención	Permite escoger si la postura Matching es compra o venta
2	Monto	Monto expresado en millones
3	Precio medio	El precio por defecto del Fixing es el precio medio de mercado (entre la mejor postura de demanda y la mejor postura de oferta).
4	Precio Fixing	El precio definitivo de la sesión Fixing puede ser configurado por el usuario.
5	Duración Fixing	Duración de cada sesión Fixing lanzada (Campo predefinido por el administrador).
6	Tiempo min. Convocante	Tiempo mínimo que la postura debe permanecer expuesta (campo predefinido por el administrador).

Una vez lanzado el precio, este aparece en la parte inferior de la ventana "Dólar Spot"

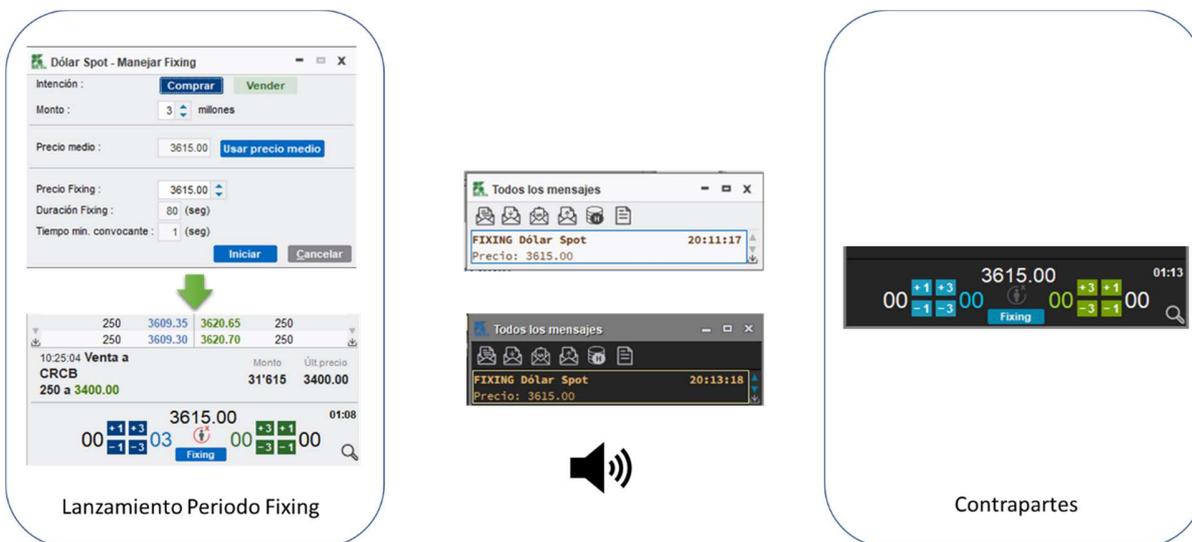


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 44 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Botones de Demanda/Oferata	Botones para aumentar o disminuir el monto cuando el usuario lanza el Fixing o para agredir durante el periodo Fixing, expresado en millones
2	Precio	Precio al cual se lanzó la sesión de Fixing
3	Tiempo	Tiempo restante del periodo Fixing lanzado
4	Monto negociado	Monto negociado durante el Fixing lanzado, expresado en millones
5	Duración Fixing	Tiempo restante del periodo Fixing
6	Retiro Fixing	Permite retirar el monto del periodo Fixing previamente lanzado
7	Consulta	Permite visualizar la historia de periodos Fixing lanzados (resumen por día o por mes).

Lanzamiento de un Fixing

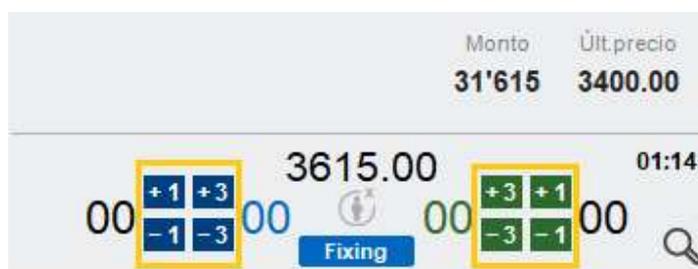


El sistema SET-FX enviará un mensaje a todos los usuarios y emitirá una alerta sonora indicando el inicio del Fixing.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 45 / 99

Las contrapartes interesadas en participar en el periodo Fixing deberán utilizar los botones de demanda/oferta, estableciendo el monto con el cual desea participar sobre el precio resaltado. El monto puede ser configurado hacia arriba o hacia abajo en múltiplos de 1 millón o de 3 millones de acuerdo con los botones de la herramienta.



2.7. CUPOS

El sistema SET-FX cuenta con un mecanismo de cupos de contraparte, los cuales permiten realizar las diferentes configuraciones con sus contrapartes para el mercado Spot y Next Day.

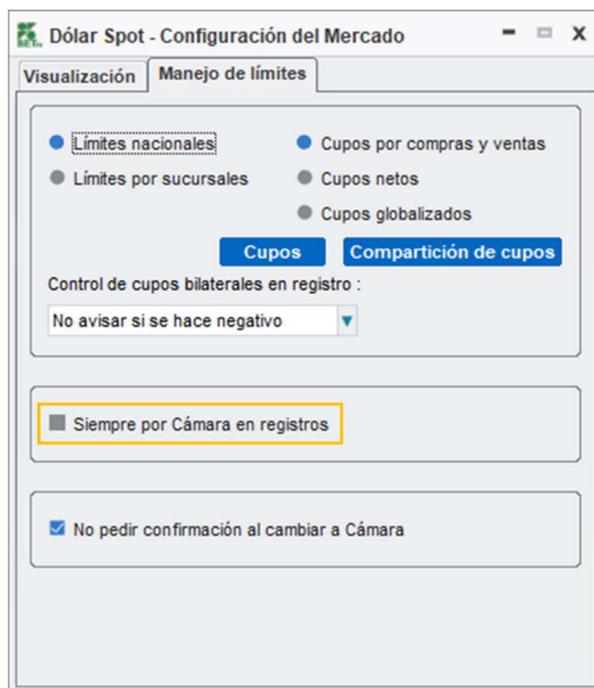
Existen dos clases:

- ✓ Los cupos bilaterales
- ✓ Los cupos Cámara, los cuales son configurados y administrados por la Cámara de Compensación.

En primer lugar, cada entidad debe establecer si desea obligar que todos sus registros se realicen exclusivamente a través de la Cámara de Riesgo Central de contraparte (CRCC). Esta configuración se realiza desde la ventana principal de configuración como se muestra a continuación:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 46 / 99



Cuando el afiliado marca esta opción, todos sus registros serán enviados por defecto a la CRCC y no harán uso de los cupos bilaterales del sistema sino de los cupos de cámara, los cuales son establecidos en el sistema por la CRCC de acuerdo con el nivel de garantías aportado por cada afiliado.

Es importante tener en cuenta que, si la entidad marca esta opción, pero en medio de la jornada de negociación se le agota el cupo de cámara entonces no podrá realizar ni transacciones electrónicas ni registros de operaciones. Así mismo el hecho de marcar esta opción implica que si alguna contraparte le envía un registro a esta entidad, pero dicha contraparte no cuenta con cupo entonces el registro no podrá realizarse.

Por otra parte, si el afiliado no marca esta opción, indica que este permitirá la realización de registros basándose en los cupos bilaterales, para los cuales deberá definir a través del sistema con qué contrapartes pueden realizar operaciones de registro y el monto máximo permitido para estos. La descripción del funcionamiento de los cupos bilaterales se incluye en el siguiente numeral.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 47 / 99

Es importante indicar que a medida que las entidades van enviando sus operaciones a compensación a través de la CRCC, el cupo bilateral consumido de los registros va a irse liberando.

Por otra parte, las condiciones de los cupos bilaterales solo podrán ser modificadas por fuera de los horarios de negociación del mercado Spot.

2.7.1. Cupos Bilaterales

Los Cupos Bilaterales son administrados y configurados por cada entidad, y corresponden al volumen total de negociación permitido con cada contraparte afiliada al Sistema SET-FX para el registro de operaciones.

La configuración de los cupos y límites es responsabilidad de cada afiliado y sólo puede ser modificada por el funcionario que cuente con los privilegios y las autorizaciones necesarias.

El sistema SET-FX cuenta con dos opciones para la administración de los cupos bilaterales, las cuales se ubican en el botón “Configuración de Mercado”  y el botón “Cupos”  :

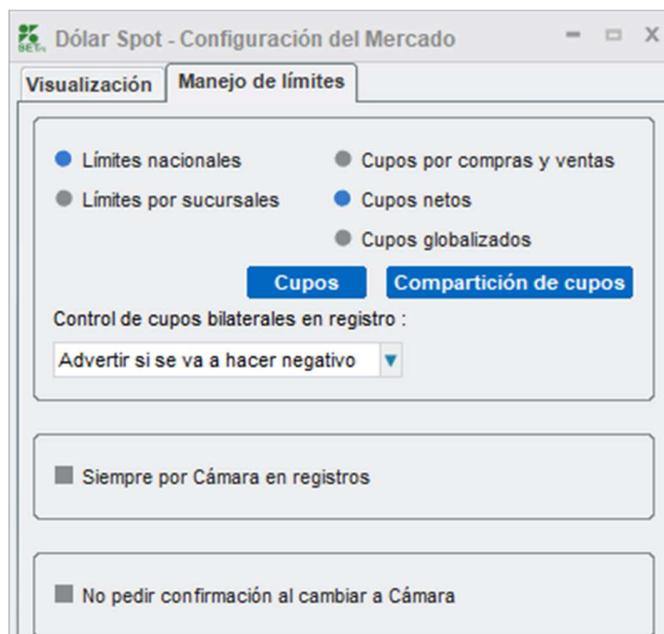


Configuración de administración de cupos

Desde el botón “Configuración de Mercado” , opción “Manejo de Límites”

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 48 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Configuración de límites	<p>El perfil administrador de cupos, tendrá la opción de escoger entre:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Límites nacionales: Es el valor asignado a una sola sucursal (Nacional) de la entidad y las demás sucursales trabajarán sobre el mismo valor de la sucursal Nacional. • Límites por sucursal: Por cada sucursal existente en la entidad podrá configurar un valor independiente.
2	Configuración de Cupos	<p>El sistema SET-FX tiene 3 opciones de configuración los cupos bilaterales:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cupos por compras y ventas: Permite ingresar un monto de cupo para compras y uno para ventas de manera independiente. • Cupos netos: Permite el ingreso de un cupo para compras y para ventas y estos

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 49 / 99

		<p>actuaran de forma neteada entre los dos valores.</p> <ul style="list-style-type: none"> Cupos globalizados: Permite ingresar un único monto global de cupos.
3	Cupos	Permite acceder a la tabla global de cupos desde la cual podrá ingresar, modificar, eliminar los valores asignados a los cupos por entidad.
4	Compartición de Cupos	El administrador de cupos, por medio de esta opción podrá compartir el cupo entre dos mercados diferentes y estos se verán afectados simultáneamente.
5	Control de cupos bilaterales en registros	<p>Opción para determinar el comportamiento de los cupos bilaterales para los registros.</p> <ul style="list-style-type: none"> No avisar si se hace negativo: Bajo esta opción, cuando se haya agotado el cupo bilateral con alguna contraparte, se podrá seguir enviando y confirmando registros y el cupo se podrá volver negativo sin generar notificación alguna. Advertir si se hace negativo: Esta opción permite generar una notificación de alerta al usuario en el momento de realizar el registro, avisando que los cupos se van a volver negativos. No registrar si se hace negativo: Bajo esta opción el Sistema no permitirá registrar operaciones si el cupo bilateral es negativo.
6	Siempre por Cámara en registro	Al seleccionar esta opción, se indica al Sistema que todas las operaciones por registro se aceptaran o enviaran por defecto a compensar.
7	No pedir confirmación al cambiar a Cámara	Al seleccionar esta opción, se le indica al sistema no generar un mensaje de advertencia al enviar registros a compensar.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 50 / 99

Ingreso, modificación, eliminación de cupos bilaterales

Desde el botón “Cupos”  tendrá acceso a dos opciones:

- Cupos en Cámara

Abre una ventana informativa acerca del estado de los cupos cámara en tiempo real.



		Por Neteo	
		Compra	Venta
Límite :	<input type="text" value="500'000,000"/>	1	<input type="text" value="500'000,000"/>
Transacciones :	<input type="text"/>	2	<input type="text"/>
Cupo :	<input type="text" value="500'000,000"/>	3	<input type="text" value="500'000,000"/>
Reservado SL :	<input type="text"/>	4	<input type="text"/>
Cupo disponible :	<input type="text" value="500'000,000"/>	5	<input type="text" value="500'000,000"/>

Ítem	Nombre	Descripción
1	Limite Compra/Venta	Limite asignado por cámara a la entidad
2	Transacciones	Visualiza el consumo de cupos cámara
3	Cupos	Cupo asignado por cámara
4	Reservado SL	Visualiza la reserva de operación Stop Loss
5	Cupo Disponible	Visualiza el cupo disponible

- Cupos Bilaterales

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 51 / 99



Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
AGR	BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A.	100,000'000,000	100,000'000,000	100,000'000,000	100,000'000,000
ALN	ALIANZA VALORES S.A.	9'000,000	9'000,000	9'000,000	9'000,000
AVV	AV-VILLAS	560'000,000	560'000,000	5,600'000,000	5,600'000,000
AYV	ACCIONES Y VALORES S.A.	6'000,000	6'000,000	6'000,000	6'000,000
BBV	B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA	60'000,000	60'000,000	60'000,000	60'000,000
BCL	BANCOLOMBIA S.A.	70'000,000	70'000,000	70'000,000	70'000,000
BCX	BCO COMERCIO EXTERIOR COLOMBIA	30'000,000	30'000,000	30'000,000	30'000,000
BGT	BANCO DE BOGOTA S.A.	60'000,000	60'000,000	60'000,000	60'000,000

Ítem	Nombre	Descripción
1	Configuración	Indica la configuración actual de los cupos bilaterales
2	Límite de Compra/Venta	Visualiza el límite bilateral ingresado de acuerdo a la entidad contraparte seleccionada
3	Cupo de Compra/Venta	Visualiza el cupo bilateral ingresado de acuerdo a la entidad contraparte seleccionada
4	Institución	Visualiza las entidades contraparte configuradas en el blotter de cupos bilaterales contrapartes
5	Aumentar	Permite aumentar entidades contraparte cuando no se encuentre visualizadas en el blotter de cupos bilaterales contraparte

- Aumentar entidad contraparte

Para aumenta una entidad contraparte que no se encuentre en la lista de entidades contraparte del blotter de cupos bilaterales, el perfil administrador de cupos debe realizar los siguientes pasos:

- Botón aumentar
- Seleccionar entidad contraparte
- Botón Aceptar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 52 / 99

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000
SAN	BANCO SANTANDER COLOMBIA	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000
SDM	BANCO GNB SUDAMERIS S.A.	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
TAU	ITAU BBA COLOMBIA S.A.	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000
ULT	ULTRASERFINCO S.A.	560'000,000	560'000,000	560'000,000	560'000,000
VBC	VALORES BANCOLOMBIA S.A.	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000

Aumentar

Dólar Spot - Límites/Cupos - Aumentar contraparte

Institución contraparte: OCC | BANCO DE OCCIDENTE S.A.

Aceptar Cancelar

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales
Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.				
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000
SAN	BANCO SANTANDER COLOMBIA	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000
SDM	BANCO GNB SUDAMERIS S.A.	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
TAU	ITAU BBA COLOMBIA S.A.	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000
ULT	ULTRASERFINCO S.A.	560'000,000	560'000,000	560'000,000	560'000,000

Aumentar

- Eliminar entidad contraparte

Para eliminar una entidad contraparte, el perfil administrador de cupos debe realizar los siguientes pasos:

- Seleccionar la entidad contraparte en la ventana de cupos
- Hacer Clic derecho y escoger la opción "Eliminar"
- Confirmar el mensaje de advertencia

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 53 / 99

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.				
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000

Confirmación

Está seguro que desea eliminar límite con BANCO DE OCCIDENTE S.A. ?

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000

- Ingreso/Modificación de Límites y Cupos Bilaterales

El perfil administrador de cupos bilaterales debe realizar los siguientes pasos para ingresar o modificar cupos a una contraparte:

- Ubicar la entidad contraparte que se quiere modificar
- Seleccione la columna límite de comprar/venta o cupo de compra/venta
- Clic derecho modificar cupo o límite

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 54 / 99

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales

Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000

Modificar límite nacional

Institución: OCC BANCO DE OCCIDENTE S.A.

Compra/Venta: Compra

Límite: 10'000,000

Aceptar Cancelar

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales

Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.	10'000,000	10'000,000	18'050,000	18'050,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000
SAN	BANCO SANTANDER COLOMBIA	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000
SDM	BANCO GNB SUDAMERIS S.A.	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
TAU	ITAU BBA COLOMBIA S.A.	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000
ULT	ULTRASERFINCO S.A.	560'000,000	560'000,000	560'000,000	560'000,000

Aumentar

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales

Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.	10'000,000	10'000,000	18'050,000	18'050,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000
SAN	BANCO SANTANDER COLOMBIA	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000
SDM	BANCO GNB SUDAMERIS S.A.	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
TAU	ITAU BBA COLOMBIA S.A.	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000
ULT	ULTRASERFINCO S.A.	560'000,000	560'000,000	560'000,000	560'000,000

Aumentar

Modificar cupo nacional

Institución: OCC BANCO DE OCCIDENTE S.A.

Compra/Venta: Compra

Límite: 10'000,000

Transacciones:

Cupo máximo: 10'000,000

Cupo: 9'000,000

Aceptar Cancelar

Dólar Spot - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Límites/Cupos

Configuración: Límites nacionales

Para compras y ventas.

Cód	Institución	Límite de compra	Cupo de compra	Límite de venta	Cupo de venta
MCR	BANCO MULTIBANK S.A.	3'000,000	3'000,000	3'000,000	3'000,000
OCC	BANCO DE OCCIDENTE S.A.	10'000,000	9'000,000	18'050,000	18'050,000
PPL	BANCO POPULAR S.A.	18'050,000	18'050,000	18'050,000	18'050,000
RPB	BANCO DE LA REPUBLICA	20'000,000	20'000,000	20'000,000	20'000,000
SAN	BANCO SANTANDER COLOMBIA	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000	50,000'000,000
SDM	BANCO GNB SUDAMERIS S.A.	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000	1,000'000,000
TAU	ITAU BBA COLOMBIA S.A.	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000	56,000'000,000
ULT	ULTRASERFINCO S.A.	560'000,000	560'000,000	560'000,000	560'000,000

Aumentar

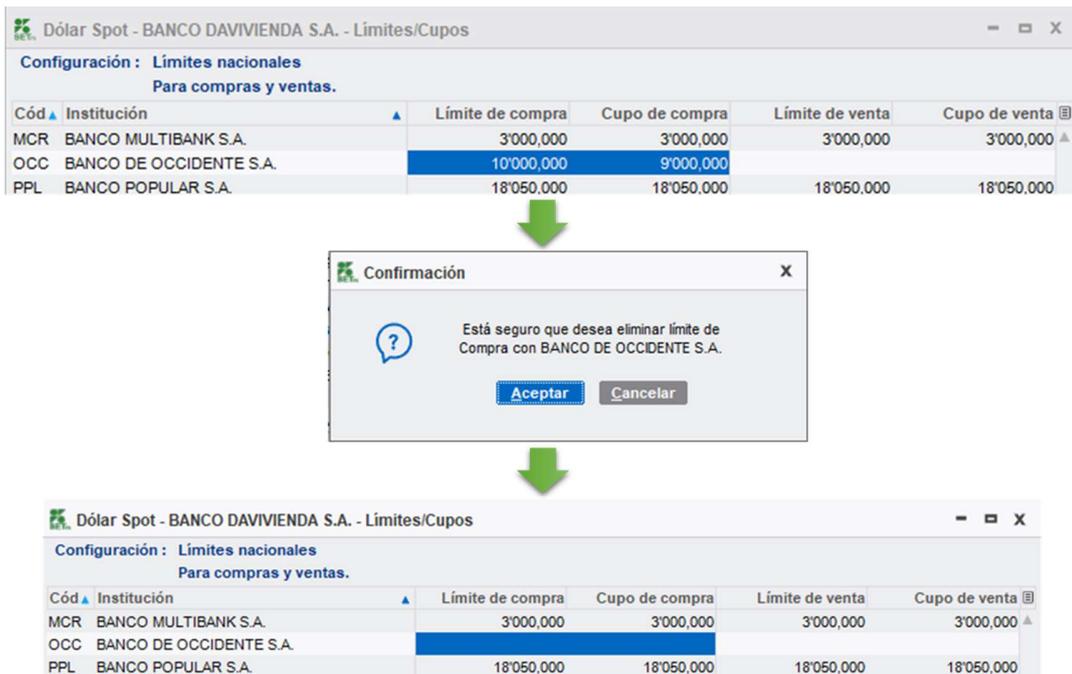
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 55 / 99

- Eliminar límites y cupos bilaterales

El perfil administrador de cupos bilaterales podrá eliminar el valor de los cupos ingresados de la siguiente manera:

- Ubicar la entidad contraparte
- Seleccionar la columna límite de compra/venta o cupo de compra/venta
- Clic derecho eliminar



The image shows a sequence of three screenshots illustrating the process of deleting a limit. The first screenshot shows a table with columns for 'Cód', 'Institución', 'Límite de compra', 'Cupo de compra', 'Límite de venta', and 'Cupo de venta'. The row for 'OCC BANCO DE OCCIDENTE S.A.' is highlighted, and its 'Cupo de compra' value of 9'000,000 is selected. A green arrow points down to the second screenshot, which is a 'Confirmación' dialog box with the text: 'Está seguro que desea eliminar límite de Compra con BANCO DE OCCIDENTE S.A.' and buttons for 'Aceptar' and 'Cancelar'. A second green arrow points down to the third screenshot, which shows the same table as the first, but the 'Cupo de compra' for 'OCC BANCO DE OCCIDENTE S.A.' is now empty, indicating it has been successfully deleted.

- Suspender entidad contraparte

El perfil administrador de cupos tiene la potestad de suspender el uso de cupos bilaterales durante la jornada de negociación, para ello, el administrador de cupos podrá escoger entre dos opciones:

- Suspender: Detiene el uso de cupos hasta finalizar la jornada de negociación y se reactiva de forma automática al siguiente día hábil.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 56 / 99

- Suspende hasta reactivar: Detiene el uso de cupos de manera permanente con esa contraparte y solo se reactivará hasta cuando el usuario lo vuelva a activar manualmente.

2.8. PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES PROPIAS

Todas las transacciones que se celebren en el mercado, se visualizan en el *Blotter* de operaciones o ventana “Dólar Spot – Transacciones”, ubicado en la barra principal del sistema SET-FX .



Partes principales del Blotter de operaciones:

Dólar Spot - Transacciones												
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit. 1												
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori v C I C A sC pA
09/01/21	08:05:02	19:43:30	O3PCAG4JQD	ALEJANDRA	Venta	3696.00	750		A	R	S	V C
09/01/21	08:06:03	19:10:41	O3PCAG4JQB	ALEJANDRA	Venta	3630.00	500		R	O		C
09/01/21	08:06:03	19:49:29	O3PCAG4JQG	ALEJANDRA	Venta	3656.36	750		B	U		C
09/01/21	10:23:00	19:45:23	O3PCAG4JQE	ALEJANDRA	Compra	3650.00	500	TAUB	R	F		
09/01/21	11:45:00	19:46:14	O3PCAG4JQF	ALEJANDRA	Compra	3650.00	500	TAUB	R	U		
09/01/21	17:18:29		O3PCAG4JQ5	ALEJANDRA	Venta	3630.00	250		A			C
09/01/21	17:18:32		O3PCAG4JQ7	ALEJANDRA	Compra	3635.00	250		A			C
09/01/21	17:24:54		O3PCAG4JQ9	ALEJANDRA	Venta	3629.95	250		A			C
09/01/21	19:11:26		O3PCAG4JQC	ALEJANDRA	Compra	3632.48	3000		A	FP		C
09/01/21	19:51:18		O3PCAG4JQL	ALEJANDRA	Compra	3629.85	500		A	L		C
Total compras sucursal:				4'750,000	3636.02							
Total ventas sucursal:				2'500,000	3657.70							
En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos							
DVN:	3'750,000		2'500,000		1'250,000							
Cupo:	43'750,000		46'250,000									
Estado de transferencias: Compensación pendiente												

Ítem	Nombre	Descripción
1	Filtro de visualización	Permite visualizar las operaciones de acuerdo a los filtros (todas, compras/ventas, usuarios, sucursales o instituciones)
2	Días Anteriores	Permite realizar una consulta histórica de las transacciones realizadas en días anteriores

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 57 / 99

3	Solicitudes de Registro	Visualiza los estados de las solicitudes de registro
4	Anulaciones y Solicitudes de Anulación	Permite visualizar los estados de las solicitudes de anulaciones
5	Operaciones realizadas	En esta zona de la ventana se visualizan todas las operaciones de acuerdo con los filtros seleccionados se visualizarán las operaciones celebradas
6	Resumen Cupos Cámara	En la parte inferior de la ventana se visualiza un resumen del consumo de cupos cámara de acuerdo con los filtros aplicados.
7	Detalle Pérd/Gan	Detalle de pérdidas y ganancias de las operaciones realizadas del día: esta opción despliega una ventana que muestra las compras y ventas de manera separada. Adicionalmente, para cada una de ellas muestra el detalle de la pérdida o ganancia de cada operación según la tasa negociada vs. la tasa de referencia determinada por la Cámara de Riesgo. Esta opción sirve para calcular el posible impacto de las pérdidas sobre los cupos de cámara y las necesidades de garantías adicionales.

Los filtros de visualización están definidos de la siguiente manera:

- **Todas:** Muestra todas las operaciones de compra y venta.
- **Compras:** Refleja las operaciones de compra.
- **Ventas:** Muestra las operaciones de venta.
- **Usuario:** Operaciones realizadas por el usuario.
- **Sucursal:** Refleja las operaciones realizadas por la sucursal al cual pertenece el usuario.
- **Instit.:** Muestra las operaciones realizadas por la Entidad.

El blotter de operaciones está compuesto por las siguientes columnas:

- **Fecha:** Fecha de la operación celebrada.
- **Hora:** Para operaciones transaccionales hace referencia a la hora de calce de la operación, en los registros corresponde a la hora de negociación ingresada por el usuario al momento de registrar la operación.
- **H. Reg:** Hora en la que fue pactado o aceptado el registro.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 58 / 99

- **Código:** Código de la operación.
- **Usuario:** Es el usuario que realizó la operación.
- **C/V:** Indica si la operación es compra o venta.
- **Precio:** Se refiere al precio de la operación.
- **Monto:** Volumen operado.
- **Cód.:** Código de Contraparte, visualiza el nemotécnico de la entidad contraparte para los registros que se encuentren sin compensación.
- **A:** Se refiere a si fue el agresor de la postura o quien confirmó el registro.
- **R:** Registrador, indica que la operación fue un registro.
 - **R:** Registro
 - **B:** Bróker
 - **D:** Directo
 - **L:** Stop Loss
- **E:** indica la procedencia del registro, es decir cuando el registro es realizado a nombre de un empleado de la entidad pero que tiene un usuario en el sistema SET-FX.
- **Ori:** este campo representa el origen de la operación.
 - **N1, N2, N3** significan que la operación spot proviene de un mercado Next Day (según sea su plazo T+1, T+2 y T+3 respectivamente) y que se dio cumplimiento a la misma.
 - **X0, X2, X3** representan operaciones que dieron cumplimiento y provienen de un mercado FIX (según sea su plazo).
 - **FP,** FIX Price, operaciones realizadas por la herramienta Fixing.
 - **L:** Stop Loss, operación realizada por Stop Loss.
 - **S:** origen es Spot.
 - **O:** origen Swap O/N Contado.
 - **F:** origen Swap Forward.
 - **U:** origen de una operación de Futuro.
 - **W:** origen Swap. Indica que la operación proviene de un registro realizado en el mercado Swap (un Swap de divisas compuesto por la operación futura y la operación de contado se representa por esta operación Spot).
- **vC,** Vigilada con Cámara, identifica los registros realizados con contraparte FOGAFÍN.
- **C,** Compensación, Indica que la operación se encuentra compensada.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 59 / 99

- **sC:** En esta opción se visualiza el estado de una solicitud para enviar a Cámara una operación. Amarillo indica que se solicitó compensar un registro, Rojo indica que la entidad contraparte solicita confirmar compensación.
- **pA** (Permiso de Anulación: visualiza el permiso de anulación otorgado por el administrador del sistema SET-FX.

Al seleccionar una operación del blotter de operaciones mediante clic derecho, el usuario visualiza las siguientes opciones:

Detalle

Muestra los datos completos de la operación.



Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 09/01/2021 Código: 03PCAG4JQ5 Hora: 17:18:29

Comprador: CAMARA DE RIESGO CENTRAL Sucursal: BOGOTA Por Cámara

Vendedor: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Maria Alejandra Montealegre M

Precio : 3630.00 Monto USS : 250,000.00

Origen transacción : Demanda aceptada por ALEJANDRA

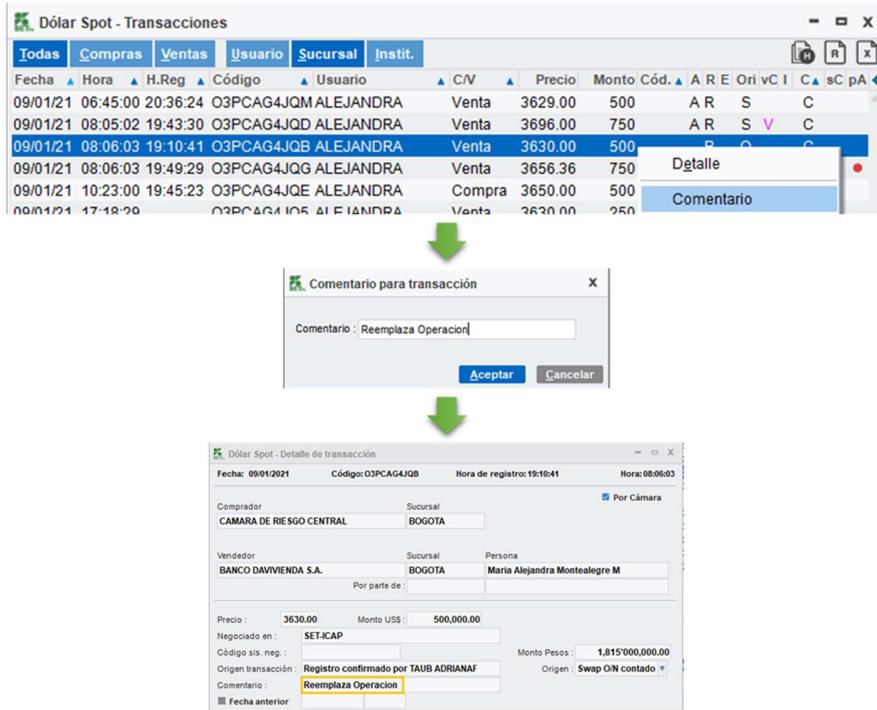
Comentario : Monto Pesos : 907'500,000.00

Comentario

Después de celebrada una operación el usuario puede agregar un comentario.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 60 / 99



Dólar Spot - Transacciones

Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	v	C	I	C	s	C	p	A
09/01/21	06:45:00	20:36:24	O3PCAG4JQM	ALEJANDRA	Venta	3629.00	500		A	R	S									
09/01/21	08:05:02	19:43:30	O3PCAG4JQD	ALEJANDRA	Venta	3696.00	750		A	R	S	V								
09/01/21	08:06:03	19:10:41	O3PCAG4JQB	ALEJANDRA	Venta	3630.00	500													
09/01/21	08:06:03	19:49:29	O3PCAG4JQG	ALEJANDRA	Venta	3656.36	750													
09/01/21	10:23:00	19:45:23	O3PCAG4JQE	ALEJANDRA	Compra	3650.00	500													
09/01/21	17:18:00		O3PCAG4JQF	ALEJANDRA	Venta	3630.00	750													

Comentario para transacción

Comentario: Reemplaza Operacion

Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 09/01/2021 Código: O3PCAG4JQB Hora de registro: 19:10:41 Hora: 08:06:03

Comprador: CAMARA DE RIESGO CENTRAL Sucursal: BOGOTA

Vendedor: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Maria Alejandra Montealegre M

Precio: 3630.00 Monto US\$: 500,000.00

Negociado en: SET-ICAP

Código sis. neg.: Monto Pesos: 1,815,000,000.00

Origen transacción: Registro confirmado por TAUB ADRIANAF Origen: Swap O/N contado

Comentario: Reemplaza Operacion

Historia

Muestra los eventos que ha tenido una operación en el sistema SET-FX.



Dólar Spot - Historia de postura

Fecha	Hora	Usuario	Clase	O/D	Precio	Monto	Tr/To	T	Info adicional
09/01/21	10:23:00	DVNB ALEJANDRA	Solicita registro	D	3650.00	500	500		
09/01/21	19:45:23		Motor de calce	D	3650.00	500	500		
09/01/21	19:45:39	TAUB ADRIANAF	Confirmación	D	3650.00	500			
09/01/21	10:23:00		Motor de calce	D	3650.00	500	500		
09/01/21	21:43:50	DVNB ALEJANDRA	Solicita cambio a Cámara	D	3650.00	500			

Imprimir papeleta

Esta funcionalidad permite al usuario imprimir la papeleta de una operación en forma física o archivo PDF (Consulte el manual de impresión a PDF <https://cutt.ly/SjW4T5y>).

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 61 / 99



Sistema Electrónico de transacción y registro de moneda extranjera SET-FX

PAPELETA DE NEGOCIACION PARA MERCADO DOLAR SPOT

Fecha: 09/01/2021
Hora: 22:25:12

Fecha :	09/01/2021
Código :	O3PCAG4JQL
Hora :	19:51:18
Nro Liquidación :	12
Compra/Venta :	COMPRA
Compensación :	Con Cámara
Comprador :	BANCO DAVIVIENDA S.A.
Ciudad :	BOGOTA
Nombre :	ALEJANDRA - Maria Alejandra Montealegre M
NIT :	860.034.313-7
Vendedor :	CAMARA DE RIESGO CENTRAL
Ciudad :	BOGOTA
NIT :	900.182.389-4
Precio :	3629.85
Monto US\$:	500,000.00
Monto \$:	1,814*925,000.00
Comentario :	

Envío de una operación de Registro a Compensar por Cámara

Permite al usuario enviar a compensar las operaciones de registro en los horarios establecidos por la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (8:00 – 13:25).

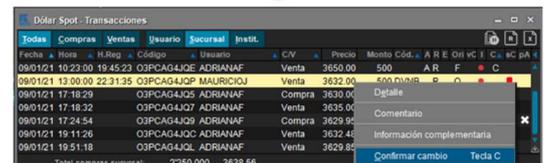
En este caso una de las contrapartes hace clic derecho sobre la operación en el blotter y escoge la opción “Compensar por Cámara”.

Acto seguido el sistema envía a la contraparte un mensaje a través del chat, mediante el cual se solicita confirmar el cambio a cámara.

Para aceptar la solicitud, la entidad receptora del mensaje da doble clic sobre el mismo, luego el sistema muestra el blotter de operaciones y la entidad debe dar clic derecho sobre la operación señalada y elegir la opción “Confirmar cámara”. Acto seguido el sistema envía la operación a compensar a través de la CRCC y para dicha operación aparece una letra “C”, bajo la columna C del Blotter, para indicar que fue compensada exitosamente.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO02024
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO02024 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 62 / 99



2.9. TRANSACCIONES Y POSICIÓN



El botón  muestra varias opciones de resumen de operaciones por compras y/o ventas.



2.9.1. Compras

En la ventana “Dólar Spot – Compras” se observa en detalle todas las operaciones de compras realizadas por la sucursal de la entidad de acuerdo con la siguiente descripción:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 63 / 99

Dólar Spot - Compras									
Fecha: 09/01/2021									
Sucursal: BOGOTA									
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	R	C	
10:23:00	CRCC	BOGOTA	3650.00	500	1825'000,000	F	R	C	
13:00:00	CRCC	BOGOTA	3632.00	500	1816'000,000	O	R	C	
17:18:32	CRCC	BOGOTA	3635.00	250	908'750,000			C	
19:11:26	CRCC	BOGOTA	3632.48	3000	10897'440,000	FP		C	
19:51:18	CRCC	BOGOTA	3629.85	500	1814'925,000		L	C	
Total compras :		4750,000.00					Promedio : 3634.13		

Ítem	Nombre	Descripción
1	Sucursal	El usuario puede ver las compras de una o todas las sucursales de la entidad
2	Solicitudes de Registro	Visualiza los estados de las solicitudes de registro
3	Anulaciones y Solicitudes de Anulación	Permite visualizar los estados de las solicitudes de anulaciones
4	Operaciones realizadas	En este espacio se visualizan las operaciones celebradas
5	Total de compras	Muestra el valor total de las compras
6	Promedio	Promedio ponderado de compras

2.9.2. Ventas

Dólar Spot - Ventas									
Fecha: 09/01/2021									
Sucursal: BOGOTA									
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor Ori	Comentario	R	C	
06:45:00	CRCC	BOGOTA	3629.00	500	1814'500,000	S	R	C	
08:05:02	CRCC	BOGOTA	3696.00	750	2772'000,000	S	R	C	
08:06:03	CRCC	BOGOTA	3630.00	500	1815'000,000	O Reemplaza Operacion	R	C	
08:06:03	CRCC	BOGOTA	3656.36	750	2742'270,000	U	B	C	
17:18:29	CRCC	BOGOTA	3630.00	250	907'500,000			C	
17:24:54	CRCC	BOGOTA	3629.95	250	907'487,500			C	
Total ventas :		3'000,000.00					Promedio : 3652.92		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 64 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Sucursal	El usuario puede ver las ventas de una o todas las sucursales de la entidad
2	Solicitudes de Registro	Visualiza los estados de las solicitudes de registro
3	Anulaciones y Solicitudes de Anulación	Permite visualizar los estados de las solicitudes de anulaciones
4	Operaciones realizadas	En este espacio se visualizan las operaciones realizadas de acuerdo con la sucursal seleccionada
5	Total de Ventas	Muestra el valor total de las ventas
6	Promedio	Promedio ponderado de ventas

Resumido por Sucursales Propias

En esta ventana se podrá ver el resumen de operaciones agrupadas por cada una de las sucursales.

Si se hace “doble clic” sobre una sucursal, se abre una ventana que muestra el detalle de las operaciones por sucursal:



Sucursal	COMPRAS		VENTAS		Monto Neto
	Monto	Promedio	Monto	Promedio	
BOGOTA	4750	3634.13	3'000	3652.92	1750
Nacional	4750	3634.13	3'000	3652.92	1750

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 65 / 99

Dólar Spot - Transacciones										
Fecha: 09/01/2021 Sucursal: BOGOTA										
Hora	Nombre	Sucursal	Precio	Monto	Valor	Ori	Comentario	R	C/V	C
06:45:00	CRCC	BOGOTA	3629.00	500	1814'500,000	S		R	Venta	C
08:05:02	CRCC	BOGOTA	3696.00	750	2772'000,000	S		R	Venta	C
08:06:03	CRCC	BOGOTA	3630.00	500	1815'000,000	O	Reemplaza Operacion	R	Venta	C
08:06:03	CRCC	BOGOTA	3666.36	750	2742'270,000	U		B	Venta	C
10:23:00	CRCC	BOGOTA	3650.00	500	1825'000,000	F		R	Compra	C
13:00:00	CRCC	BOGOTA	3632.00	500	1816'000,000	O		R	Compra	C
17:18:29	CRCC	BOGOTA	3630.00	250	907'500,000				Venta	C
17:18:32	CRCC	BOGOTA	3635.00	250	908'750,000				Compra	C
17:24:54	CRCC	BOGOTA	3629.95	250	907'487,500				Venta	C
19:11:26	CRCC	BOGOTA	3632.48	3000	10897'440,000	FP			Compra	C
19:51:18	CRCC	BOGOTA	3629.85	500	1814'925,000			L	Compra	C
Total compras :		4750,000.00		Total ventas :		3'000,000.00				

Resumido por Institución Contraparte

Se encuentra el resumen de operaciones agrupadas por entidad contraparte.

Dólar Spot - Transacciones por banco									
Sucursal: NACIONAL									
Contraparte	COMPRAS				VENTAS				Monto Neto
	Monto	Promed	Valor	Total	Monto	Promed	Valor	Total	
CRCC	4750	3634.13	17262'115,000	17262'115,000.00	3'000	3652.92	10958'757,500	10958'757,500.00	1'750
ITAU									

Ítem	Nombre	Descripción
1	Sucursal	El usuario puede seleccionar las diferentes sucursales de la entidad
2	Días anteriores	Permite visualizar las operaciones realizadas de días anteriores
3	Detalle de transacciones	Permite realizar la consulta de transacciones realizadas, de acuerdo a la opción que se escoja: <ul style="list-style-type: none"> Detalle de transacciones Detalle de compras Detalle de ventas
4	Reporte de transacciones	Permite la impresión (físico, PDF) del reporte de transacciones realizadas, de acuerdo a la opción que se escoja:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 66 / 99

- Cronológico
- Por banco
- Detallado con comentario
- Detallado con usuario
- Resumido

2.10. GRÁFICOS Y PRECIOS

El botón de gráficos  permite acceder a los diferentes gráficos del sistema SET-FX.



2.10.1. Gráfico De Precios De Transacciones Cerradas Hoy

Permite ver la gráfica tipo lineal o escalonado de las operaciones Spot del día con información de precios cierres y/o promedio.



2.10.2. Gráficos De Precios De Mejor Demanda/Oferta De Hoy

Permite ver la gráfica tipo lineal o escalonado de las operaciones Spot del día, formada con información de la mejor demanda/oferta.

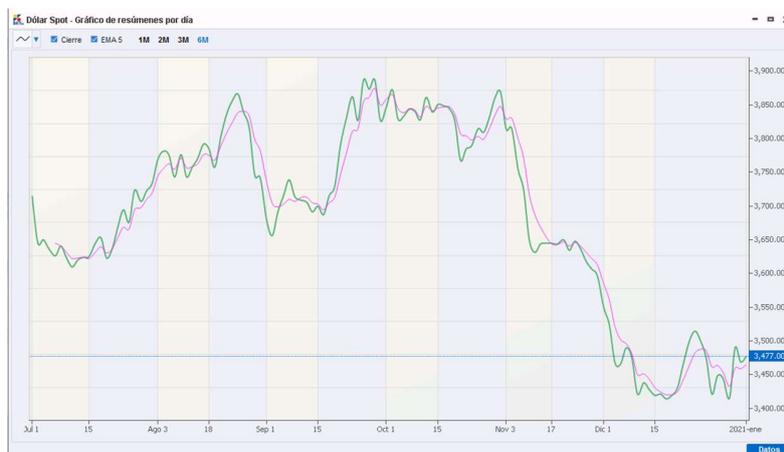
Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 67 / 99



2.10.3. Gráficos De Resúmenes Por Día

Muestra un resumen de las operaciones con intervalos de un (1) mes, dos (2) meses, tres (3) meses y seis (6) meses. Contiene opciones de visualización como: Barras, velas, curvas, línea de precio de cierre y EMA5.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 68 / 99



2.10.4. Gráfico De Resúmenes Por Intervalo

Permite ver los resúmenes por intervalos de un (1) día, cinco (5) días, quince (15) días y un (1) mes cada quince (15). Contiene opciones de visualización como: barras, velas, curvas, línea de precio de cierre y/o EMA5.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---



MANUAL DE USUARIO

Código: IGO020204

Archivo: IGO020204
Administrar SET-FX

MERCADO DÓLAR SPOT

Versión: 03

Página: 69 / 99



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 70 / 99



2.10.5. Precios/Montos Transacciones De Hoy

Muestra los precios y montos de las operaciones realizadas en el día.

Precios/Montos transados...				
Dólar Spot				
Domingo 10-Ene-2021				
Hora	Precio	Monto R	Ori	
10:26:55	3629.90	250,000	P	
10:26:54	3635.05	250,000	T	
10:26:54	3629.95	250,000	P	
10:26:53	3635.00	250,000	T	
10:26:52	3630.00	250,000	P	
10:26:44	3632.50	3'000,000	F FP	
08:06:03	3630.00	500,000	R S	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

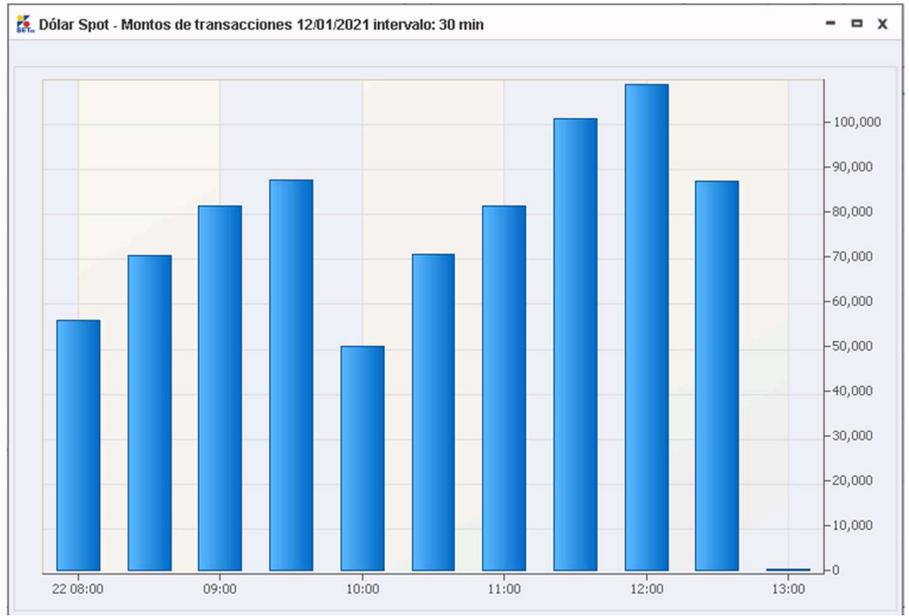
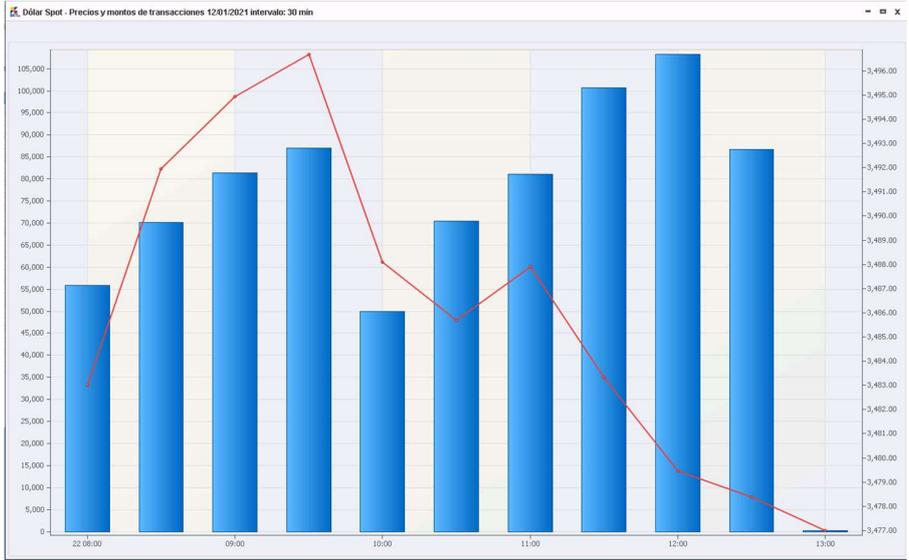
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 71 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Otras vistas	Permite escoger varias opciones de vistas como lo son: <ul style="list-style-type: none"> • Precios/Montos de transacciones por tabla • Precios/Montos de transacciones registradas • Precios/Montos de transacciones anuladas
2	Días anteriores	Permite visualizar los precios/montos transados de días anteriores
3	Graficar	Permite graficar las operaciones del blotter de precios/montos transados
4	Registrado	Tipo de operación realizada: <ul style="list-style-type: none"> • R: Registro • W: Swap • F: Fixing • P: (pegada) agresión sobre demandas • T: (Tomada) agresión sobre las ofertas
5	Ori	Origen de la operación, la columna presenta los siguientes valores: <ul style="list-style-type: none"> • W: Swap • S: Spot • O: origen Swap O/N Contado • F: origen Swap Forward • U: origen swap Futuro • FP: FIX Price



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 72 / 99



2.10.6. Historia De Precios/Montos De Transacciones

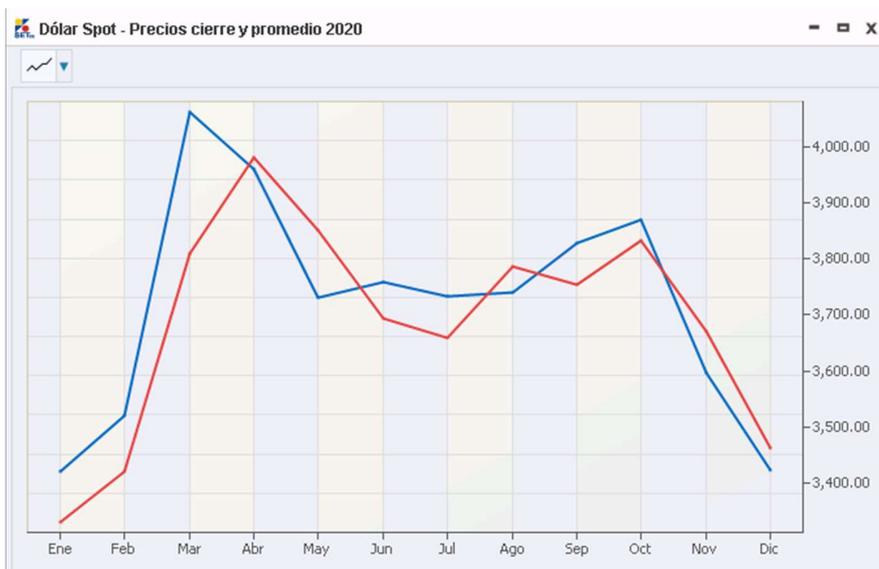
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 73 / 99

El usuario puede ver las estadísticas del mercado por año, adicionalmente puede graficar la información de acuerdo a los diferentes filtros.

Dólar Spot - Precios/Montos transados por mes										
Año: 2020										
Año Mes	Precio Apertura	Precio Cierre	Precio Promedio	Precio Mínimo	Precio Máximo	Monto Negociado	Monto Mínimo	Monto Máximo	Monto Promedio	Número Trans
2020 Enero	32									
2020 Febrero	32									
2020 Marzo	34									
2020 Abril	33									
2020 Mayo	33									
2020 Junio	35									
2020 Julio	37									
2020 Agosto	34									
2020 Septiembre	38									
2020 Octubre	3800.00	3803.00	3481.09	234.00	9800.00			2,158'04		
2020 Noviembre	3555.00	3499.69	3778.93	3450.00	9000.00			337'34		
2020 Diciembre	3800.00	3400.00	3474.90	250.00	4500.00			881'77		

Dólar Spot - Precios/Montos transados por día Junio 2020											
Fecha	Nombre Día	Precio Apertura	Precio Cierre	Precio Promedio	Precio Mínimo	Precio Máximo	Precio Fix	Monto R	Or	Monto Promedio	Número Trans
01	Lunes	3520.00	3520.00	3573.33	3520.00	3520.00	3520.00			375,000	2
02	Martes	3650.00	3677.75	3654.30	3631.25	3677.75	3654.30			250,000	1,012
03	Miércoles	3620.00	3600.25	3621.31	3597.25	3645.75	3621.31			285,479	1,825
04	Jueves	3350.00	3447.75	3431.64	3300.00	3472.75	3431.64			312,167	1,826
05	Viernes	3650.00	3627.25	3649.73	3627.25	3677.75	3649.73			312,500	1,824
08	Lunes	3619.00	3703.00	3623.51	3577.80	3703.00	3601.93			558,089	921
										434,738	4,964
										655,040	515
										413,203	2,134



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	MERCADO DÓLAR SPOT	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 03
		Página: 74 / 99



2.10.7. Precios De Mejor Demanda/Oferta De Hoy

Muestra las mejores demandas/ofertas ingresadas durante el mercado en la fecha sobre la cual se realiza la consulta .



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

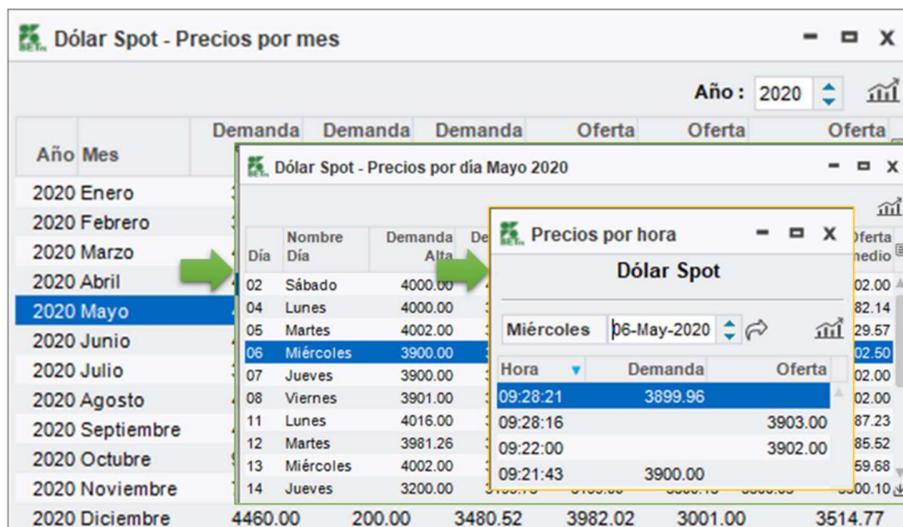
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 75 / 99



Hora	Precio	Monto R	Ori
12:30:00	3714.00	15'000,000	R O
12:26:54	3710.70	250,000	P
12:26:54	3711.90	250,000	P
12:26:54	3713.00	250,000	P
12:26:54	3713.10	250,000	P
12:26:54	3713.30	250,000	P
12:26:44	3715.00	750,000	P
12:26:42	3715.00	1'500,000	P
12:24:57	3717.00	110,000	R S
12:24:52	3717.00	250,000	T
12:24:51	3716.90	500,000	T
12:24:50	3715.75	1'000,000	F FP
12:24:50	3716.90	500,000	T
12:24:50	3716.90	500,000	T
12:24:49	3715.75	1'000,000	F FP
12:24:49	3716.45	250,000	T
12:24:46	3716.90	500,000	T
12:24:44	3716.50	250,000	T
12:24:43	3715.75	1'000,000	F FP
12:24:24	3716.50	500,000	T

2.10.8. Historia De Precios Mejor Demanda/Oferta

El usuario puede consultar la historia de mejores precios demanda/oferta con opción de gráficos.



Año	Mes	Demanda	Demanda	Demanda	Oferta	Oferta	Oferta
2020	Enero						
2020	Febrero						
2020	Marzo						
2020	Abril						
2020	Mayo						
2020	Junio						
2020	Julio						
2020	Agosto						
2020	Septiembre						
2020	Octubre						
2020	Noviembre						
2020	Diciembre	4460.00	200.00	3480.52	3982.02	3001.00	3514.77

Día	Nombre	Demanda	De
02	Sábado	4000.00	
04	Lunes	4000.00	
05	Martes	4002.00	
06	Miércoles	3900.00	
07	Jueves	3900.00	
08	Viernes	3901.00	
11	Lunes	4016.00	
12	Martes	3981.26	
13	Miércoles	4002.00	
14	Jueves	3200.00	

Fecha	Demanda	Oferta
Miércoles 06-May-2020		
09:28:21	3899.96	
09:28:16		3903.00
09:22:00		3902.00
09:21:43	3900.00	

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 76 / 99



2.11. RESUMEN DE PRECIOS/MONTOS TRANSADOS HOY

el botón  permite desplegar tres (3) tipos de resúmenes que se describen a continuación:



2.11.1. Resumen De Hoy

Comprende las estadísticas de operaciones entre las 8:00 y 13:00 para el mercado Spot.

Dólar Spot - Resumen de hoy			Horario : 08:00 - 13:00		
Precios					
Apertura*	3557.00	Precio Fix :	3543.29	Mínimo* :	3530.10
Cierre*	3555.50 ↓	Promedio :	3544.01	Máximo* :	3559.00
Hora últ. trans* : 13:00:00					
Montos en miles					
Negociado :	719'811	Ultimo* :	250	Mínimo :	10
Transacciones :	1,252	Promedio :	575	Máximo :	35'000
* No incluye transacciones registradas					
Imprimir Detalle Anteriores					

Estadísticas de Precios

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 77 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Apertura	Precio de la primera operación transaccional
2	Cierre	Precio de la última operación transaccional
3	Hora últ. Trans	Ultima operación operada
4	Fecha de tendencia	Indicador de tendencia con referencia al último precio operado
5	Precio FIX	Precio promedio ponderado por monto de las operaciones transaccionales y operaciones de registro del mercado USD/COP Spot. Se excluyen del cálculo aquellas operaciones que provienen de otros mercados.
6	Precio Promedio	Precio promedio ponderado de todas las operaciones transaccionales y de registro con cualquier origen.
7	Historia Precio FIX	Permite visualizar el precio FIX de días anteriores
8	Mínimo	Precio mínimo operado en la ventana transaccional
9	Máximo	Precio máximo operado en la ventana transaccional

Estadísticas de Montos

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 78 / 99

 **Dólar Spot - Resumen de hoy** - □ X

Horario : 07:00 - 23:00

Precios

Apertura* : 3632.50 Precio Fix : 3632.39  Mínimo* : 3629.60

Cierre* : 3634.00 ↑ Promedio : 3632.39 Máximo* : 3635.40

Hora últ. trans* : 10:47:07

Montos en miles

1 Negociado : 8'250 3 Ultimo* : 250 5 Mínimo : 250

2 Transacciones : 21 4 Promedio : 393 6 Máximo : 3'000

* No incluye transacciones registradas [Imprimir](#) [Detalle](#) [Anteriores](#)

Ítem	Nombre	Descripción
1	Negociado	Monto total negociado en la jornada (incluye operaciones transaccionales y de registro).
2	Transacciones cierre	Número total de operaciones transaccionales y de registro.
3	Ultimo	Monto de la última operación transaccional.
4	Promedio	Monto promedio de todas las operaciones realizadas (incluye operaciones transaccionales y de registro).
5	Mínimo	Monto de menor valor operado en operaciones transaccionales y de registro
6	Máximo	Monto de mayor valor operado, (incluye operaciones transaccionales y de registro).
7	Imprimir	Permite imprimir (físico o PDF) el resumen del mercado
8	Detalle	Muestra el desglose de las operaciones que hacen parte de las estadísticas
9	Anteriores	Podrá visualizar el resumen de días anteriores

2.11.2. Resumen IMCs Y Sector Real

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 79 / 99

En esta ventana se muestra el resumen de operaciones entre IMC de toda la jornada de negociación (incluyendo operaciones realizadas antes de las 8:00 y después de las 13:00) y también muestra el precio promedio y monto negociado de las operaciones combinadas de IMC y del sector real.



Ítem	Nombre	Descripción
1	Precio Promedio	Precio promedio de las operaciones del mercado Spot entre IMCs incluyendo las realizadas antes de las 8:00 y después de las 13:00.
2	Monto negociado	Monto negociado de las operaciones realizadas en el mercado Spot entre IMCs incluyendo las realizadas antes de las 8:00 y después de las 13:00.
3	Precio promedio	Precio promedio de las operaciones del mercado Spot y mercado registro de derivados con clientes sector real
4	Monto negociado	Monto negociado de las operaciones del mercado Spot y mercado registro de derivados con clientes sector real
5	Detalle IMCs	Muestra el desglose de las operaciones que hacen parte de las estadísticas
6	Imprimir	Permite imprimir (físico o PDF) el resumen del mercado
7	Historia	Podrá consulta la historia del resumen IMCs y Sector real

2.12. CONSULTAS

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 80 / 99

El botón  abre una ventana en la que el usuario puede realizar consultas sobre ingresos de posturas, transacciones y anulaciones, filtradas por fechas, por sucursales y dependiendo si fueron demandas u ofertas.



Parámetros de consulta X

Dólar Spot

Periodo

10-Ene-2021

Hoy

Una fecha

Un mes

Clase mensaje

Ingreso

Transacción

Anulación

Posturas

Demandas

Ofertas

Sucursal: DVNB

Incluir hechas por Broker



Dólar Spot - Consulta de mensajes - □ X

Clase de mensaje: **Ingreso** Periodo: **Hoy**

Fecha	Hora	Suc.	Usuario	O/D	Precio	Monto T	Monto Total	C
10/01/2021	10:26:44	DVNB	ALEJANDRA	D	3632.50	+3000		
10/01/2021	10:46:44	DVNB	ALEJANDRA	D	3630.00	250		
10/01/2021	10:46:56	DVNB	ALEJANDRA	O	3634.00	250		

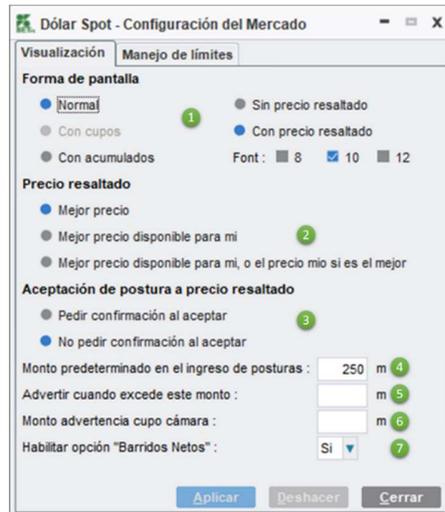
2.13. Configuración Del Mercado

El botón  abre la ventana de configuración del mercado spot, en la cual el usuario tendrá acceso a algunas opciones que afectarán la visualización de la ventana "Dólar Spot" y podrá establecer otras configuraciones de mercado.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 81 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Forma de pantalla	<ul style="list-style-type: none"> Normal: Permite visualizar las posturas en la ventana de "Dólar Spot" con precio y monto Con acumulados: Permite visualizar las posturas en la ventana de "Dólar Spot" con precio, monto, monto acumulado, precio promedio en cada línea Sin precio resaltado: en la ventana de "Dólar Spot" no resaltara los mejores precios Con precio resaltado: permite visualizar el mejor precio de forma resaltada Font: el usuario puede seleccionar un tamaño de ventadas
2	Precio resaltado	<p>Dependiendo de las 3 opciones presentadas se verá reflejado en el precio resaltado en la ventana de "Dólar Spot"</p> <ul style="list-style-type: none"> Mejor precio Mejor precio disponible para mi Mejor precio disponible para mí, o el precio mío si es el mejor
3	Aceptación de postura a precio resaltado	Sirve para configurar si el sistema pide o no una doble confirmación cuando se agreda una postura.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 82 / 99

4	Monto predeterminado en el ingreso de posturas	Establece un monto predeterminado al momento en el que el usuario ingrese una postura
5	Advertir cuando excede este monto	El sistema podrá advertir cuando se excede el monto configurado en el ingreso de posturas
6	Monto advertencia cupo cámara	El usuario podrá configurar una alerta visual, para indicarle que su Cupo Cámara se está agotando. El monto del cupo para esta alerta puede ser configurado por cada trader. Esta alerta se activa cuando el Cupo Cámara disponible sea igual o menor al monto configurado bien sea sobre las demandas o sobre las ofertas.
7	Habilitar opción "Barridos Netos"	Permite activar la opción de barridos netos en la ventana de "Dólar Spot"

3. VENTANA DÓLAR SPOT



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

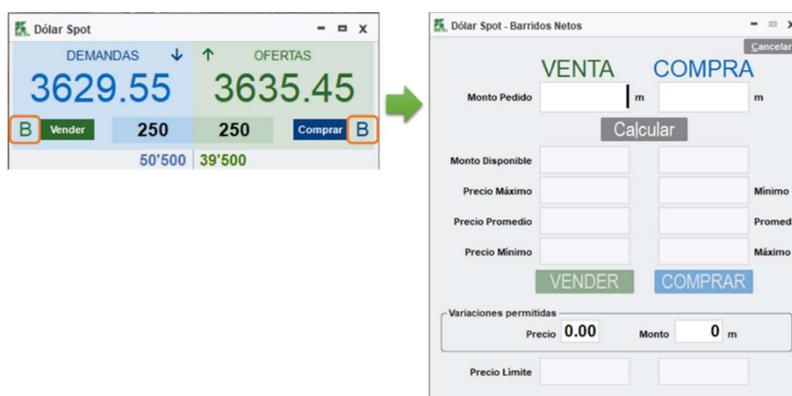
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 83 / 99

Ítem	Nombre	Descripción
1	Flechas de tendencia	Indicador de tendencia de la mejor demanda/oferta con respecto a la anterior mejor postura de demanda u oferta
2	Mejor demanda/oferta	Precio resaltado de la mejor demanda/oferta
3	Barridos netos	Botón para abrir la ventana de barridos netos
4	Botones de agresión	Botón para agredir una postura de demanda/oferta
5	Cupos cámara	Indicador del monto disponible en cupos cámara
6	Barra de modificación rápida	Funcionalidad para la modificación de posturas
7	Blotter de posturas	En este espacio se visualizan todas las posturas del mercado
8	Ultima transacción	Visualiza la última transacción realizada por la entidad
9	Monto – Últ. Precio	Monto total y último precio negociado en el mercado
10	Fixing	Funcionalidad de negociación Fixing

4. BARRIDOS NETOS

Esta funcionalidad está diseñada para que a partir de un monto solicitado y validando los cupos cámara de la entidad, el sistema muestre los precios y posturas disponibles para calzar y ejecutar un barrido en la pantalla de demandas /ofertas.

La pantalla de barridos netos cuenta con parámetros de variación tanto en precio como en monto, permitiendo cierto grado de flexibilidad en la ejecución de los barridos, teniendo en cuenta la dinámica de entrada y salida de posturas propia de los mercados transaccionales.



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 84 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Monto Pedido	Monto por el cual se requiere el barrido neto. Debe ser expresado en miles y el monto máximo a ser ingresado 20.000 millones de dólares.
2	Calcular	Botón que realiza el cálculo de posturas a ser agredidas de acuerdo al monto ingresado
3	Monto Disponible	Monto disponible para el barrido en base a la cantidad de cupo cámara disponible
4	Precio Máximo/Mínimo	Precio máximo/mínimo si es venta/compra
5	Precio promedio	Precio promedio de las posturas si es venta/compra
6	Precio Mínimo/Máximo	Precio mínimo/máximo agredidle si es venta/compra
7	Vender/Comprar	Botón el cual ejecutara el barrido
8	Variaciones permitidas precios	Hace referencia a los rangos máximos de variación en precio que puede tolerar el sistema al momento de ejecutar el barrido. En caso de que al momento de dar clic en comprar/vender se haya presentado una variación superior al rango elegido, el sistema pedirá

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 85 / 99

		una confirmación de barrido con la información recalculada.
9	Variaciones permitidas montos	Hace referencia a los rangos máximos de variación en monto que puede tolerar el sistema (entre el último instante que se dio clic en <calcular> y el instante de presionar el botón <comprar> o <vender>) para ejecutar el barrido. En caso de que al momento de dar clic en comprar/vender se haya presentado una variación superior al rango elegido, el sistema pedirá una confirmación de barrido con la información recalculada.
10	Precio limite	Este es el precio máximo hasta el cual se permite que llegue el barrido en caso de que las posturas inicialmente contempladas para el barrido ya no estén disponibles.

En el barrido neto el sistema SET-FX calcula, tanto para la compra como para la venta, el precio promedio disponible para los montos especificados y adicionalmente identificará el precio máximo y mínimo para el posible barrido. Este cálculo se hace sobre la profundidad de posturas en el mercado y con base al cupo cámara disponible, tanto del postulante como del aceptante.

Una vez que el sistema SET-FX calcula y muestre los montos y precios disponibles en la ventana, los valores se recalculan cada dos (2) segundos, previendo cualquier posible cambio en las posturas del mercado. Si los montos o precios cambiaron antes de tres segundos y el usuario da "clic" en comprar/ vender para ejecutar su barrido, el sistema le mostrará una advertencia sobre el cambio (siempre que dichas variaciones superen los rangos de variación permitida) y mostrará los nuevos precios/montos previos a la ejecución del barrido para asegurarse que el usuario cuente con información actualizada.

Si el usuario desea configurar ciertos márgenes de cambio (en precio y en monto) para que su barrido no sea interrumpido ante cualquier cambio, deberá configurarlo en las opciones de "Variación Permitida" ubicadas en la parte inferior de la ventana.

Con base en la información que se muestra en la ventana de *Barridos Netos*, el usuario ejecuta el barrido haciendo "clic" en los botones de *Comprar* o *Vender* según sea el caso. La ventana se cerrará automáticamente una vez termine el proceso.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 86 / 99

Si hay cambios en la profundidad del mercado, desde la orden de Venta/Compra hasta que la orden es procesada por el sistema, este buscará las posturas que se encuentren en los rangos permitidos para completar el barrido hasta el **precio límite**. En este sentido, el sistema siempre buscará las mejores posturas disponibles respetando el precio límite para cumplir el monto requerido.

En caso de que el sistema no encuentre el monto solicitado sino uno menor, lo informará al usuario cambiando los valores del monto disponible.

Barridos con posturas en goteo – cantidad visible

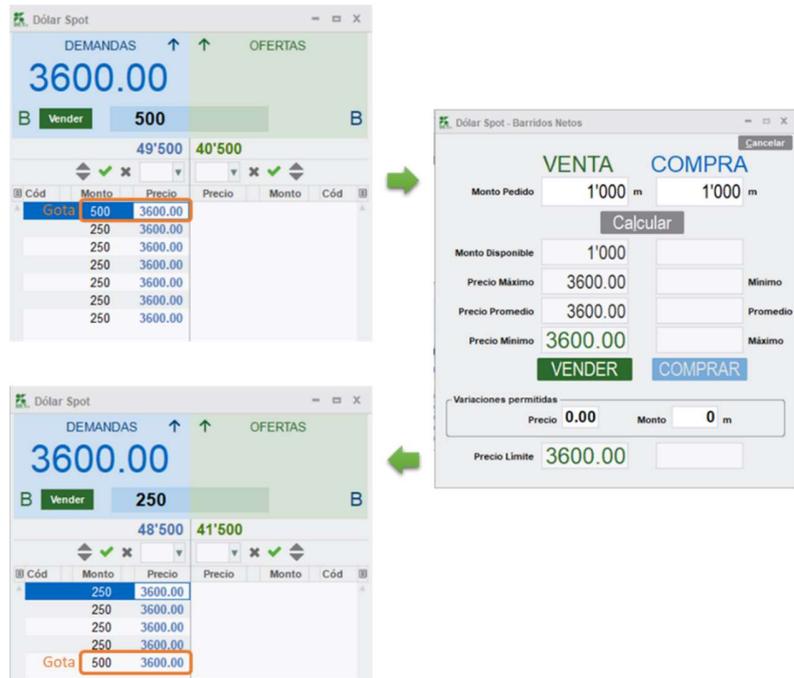
Si dentro de los límites del barrido neto se encuentra una postura en modalidad GOTEIO (cantidad visible), el sistema dará prioridad a las posturas visibles al mismo precio de la gota de acuerdo a los siguientes aspectos:

En el caso en el que se realice una agresión sobre una postura con la condición de gota y el monto solicitado supere el monto visible de la gota, el sistema calzará solamente la primera cantidad visible de la postura, posteriormente buscará las posturas siguientes al mismo precio. Una vez agrede las posturas visibles al mismo precio, agrede nuevamente la siguiente gota de la postura con monto oculto.

Es decir que, durante un barrido neto, si el monto total visible de una postura con condición gota, es calzado y en ese momento existen una o más posturas al mismo precio, la postura con gota perderá su prioridad y se ubicará al final de las demás posturas que tengan mismo precio.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 87 / 99

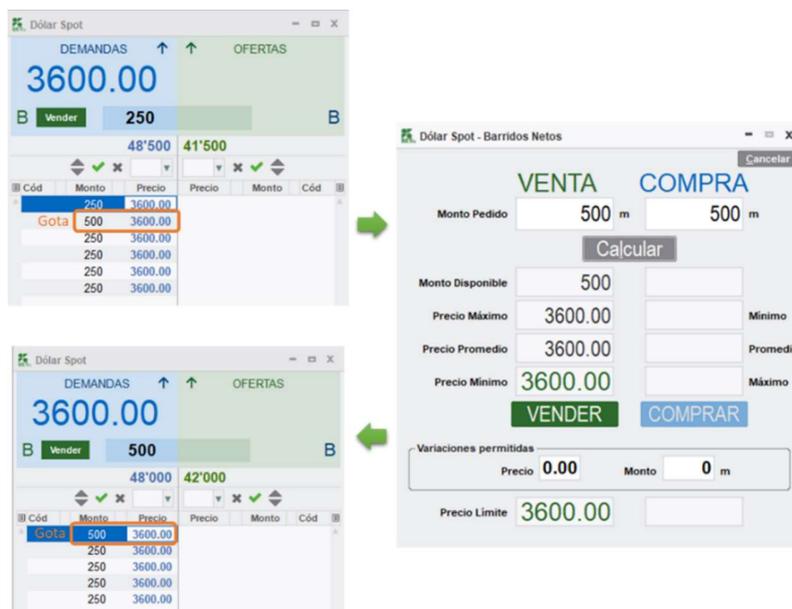


The image shows two screenshots of the 'Dólar Spot' application. The top-left screenshot shows a market order with a 'Gota' (iceberg) condition. The order is for 500 units at a price of 3600.00. The market depth shows a bid of 49'500 and an offer of 40'500. The 'Gota' is highlighted in orange. The bottom-left screenshot shows the same market order, but the 'Gota' is now 250 units, and the bid has moved to 48'500 and the offer to 41'500. The 'Gota' is still highlighted in orange. The right screenshot shows the 'Dólar Spot - Barridos Netos' window, which is used for calculating and executing orders. It shows a 'VENTA' order for 1'000 m at 3600.00. The 'Calcular' button is highlighted, and the 'VENDER' button is active.

En el caso en el que la agresión de la postura visible con la condición de gota sea parcial, esta mantendrá su posición frente a las demás posturas del mismo precio, y no perderá su prioridad.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 88 / 99

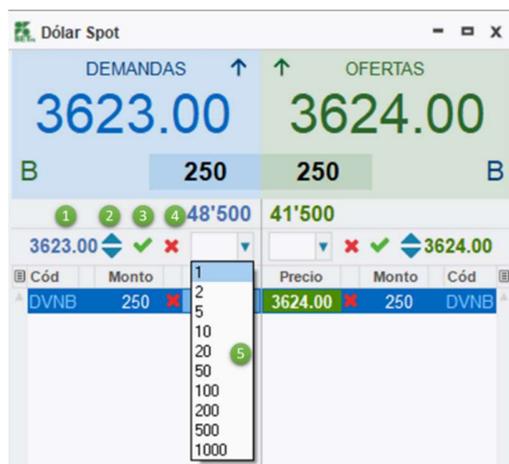


5. BARRA DE MODIFICACIÓN RÁPIDA

Esta barra actúa sobre la mejor postura propia tanto para demanda como para oferta y permite modificar la postura sin necesidad de retirarla momentáneamente. Este tipo de modificación sólo aplica para el precio en la postura y no se pueden modificar el monto u otras características.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 89 / 99



Ítem	Nombre	Descripción
1	Precio	Precio de la postura con modificación
2	Spin de modificación	Spin el cual permite incrementar o disminuir el precio de la postura en base a los centavos escogidos en el box de precios
3	Ingresar postura	Permite el ingreso de la postura modificada
4	Retiro postura	Retira la postura seleccionada
5	Indicador de centavos	Box desplegable con los valores representados en centavos para la modificación del precio de la postura

6. ANULACIÓN DE OPERACIONES

Cuando una operación está dentro los parámetros establecidos por la normatividad del Banco de la República en la circular DOAM-317, cualquiera de las contrapartes iniciales podrá solicitar la anulación de una operación desde la ventana “Dólar Spot -Transacciones” (Blotter de operaciones).

El sistema envía la solicitud de anulación a todos los usuarios transaccionales o de registro de la entidad contraparte, sin revelar quien solicitó la anulación. Cualquiera de estos usuarios a quienes les llegó el mensaje podrá aceptar o rechazar la solicitud.

En caso de que la solicitud de anulación sea confirmada por algún usuario y que la operación haya sido realizada de manera bilateral, esta es anulada y retirada del blotter. Por otra parte, si la

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 91 / 99

7. MODIFICACION DE OPERACIONES

La modificación de operaciones de contado sólo podrá realizarse en atención a lo expuesto por la Circular Externa Reglamentaria DOAM-317 expedida por el Banco de la República, así como las normas que lo modifiquen, deroguen o complementen.

Para proceder con una modificación de operaciones en el mercado SPOT hay que tener en cuenta lo siguiente:

- La modificación de una operación Spot puede realizarse únicamente en el caso que se haga a través de un registro.
- Cuando se cierra una operación por registro en el mercado spot entre dos IMCs, la operación solo puede ser modificada dentro del tiempo autorizado que especifica la norma vigente.
- En el caso que las contrapartes que intervienen en el registro tienen configurada la opción *Siempre por cámara en registros* el proceso de modificación tiene que ser autorizado por la Cámara de Riesgo Central de Contraparte .

7.1. Modificación De Operaciones Transaccionales

Las operaciones realizadas a través de la ventana transaccional son automáticamente enviadas a la Cámara central de Riesgo de Contraparte para su compensación y liquidación, por esta razón no existe la posibilidad de modificación y lo único que procede es la anulación de la misma. (Ver capítulo 7. Anulación operaciones).

7.2. Modificación De Operaciones De Registro

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 92 / 99

7.2.1. Compensación por cámara

Cuando se hace un registro de una operación Spot entre dos afiliados utilizando la opción compensación a través de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC), el sistema SET-FX permite la modificación de la operación de la siguiente manera.



Dólar Spot - Registrar transacción

Hecho por : Yo Empleado:

BYRN Mi usuario : JUANF

Compensar por Cámara

Clase : Compra Venta

Código :

Se ubica la operación que se desea modificar en el blotter de operaciones



Dólar Spot - Transacciones														
		Compras		Ventas		Usuario	Sucursal	Instit.						
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	vC	I	C	sC	
08:06:18	JUANF	Venta	3900.00	250										
11:28:43	JUANF	Venta	3850.50	500		A								
11:12:00	JUANF	Compra	3835.00	2000			R		S					
12:00:00	JUANF	Venta	3834.00	1000			R		S					

Una vez ubicada, se presiona botón derecho sobre la operación y aparece un menú donde está la opción "Modificar"

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 93 / 99



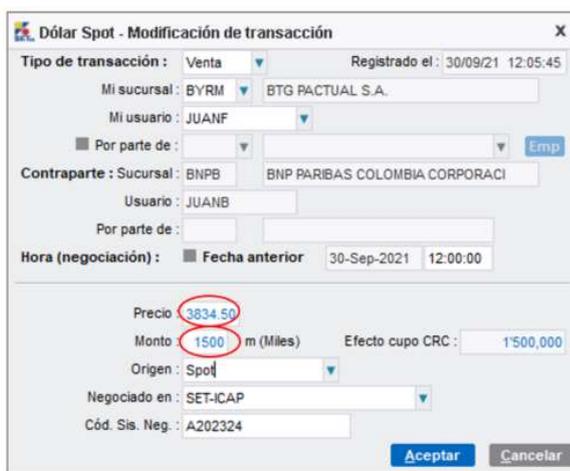
El seleccionar esta opción aparece una nueva ventana con los detalles de la operación y con los campos habilitados para modificación



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 94 / 99

A medida que los datos sean modificados, el sistema SET-FX muestra en color azul cada campo o campos modificados en la operación, para su identificación.



Una vez modificados los datos de la operación se presiona el botón aceptar y el sistema SET-FX envía en la pantalla de mensajes una solicitud de modificación a la contraparte de la operación.

```

30-Sep-21 11:56:15 desde 100.100.32.133
SOLICITUD DE CONFIRMACION 12:05:45
DE COMPRA Dólar Spot
VENDEDOR BYRM JUANF
COMPRA Dólar Spot 12:00:00
Inst Código Precio Monto
CRCB 03UYV7XQ56 3834.00 1000
Registrado por BYRM JUANE
SOLICITUD DE MODIFICAR TRANSACC 12:23:13
Mercado: Dólar Spot
Comprador Vendedor
BNPB JUANB BYRM JUANF
Código de transacción: 03UYV7XQ56
Fecha de transacción: 30-09-21
Enviada por BYRM JUANF

```

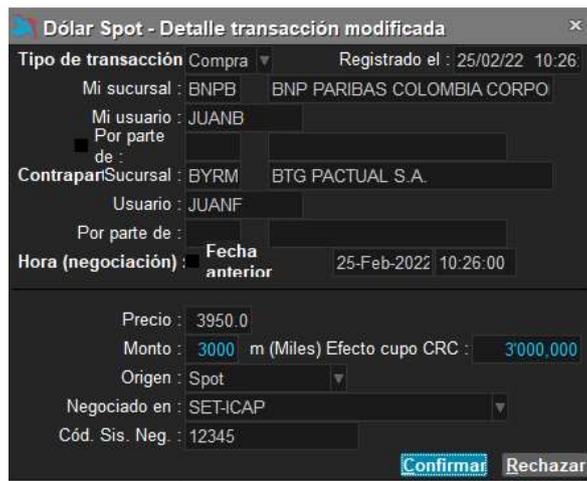
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03 Página: 96 / 99

Para saber qué información se solicita modificar, el usuario deberá hacer click de derecho sobre la operación y seleccionar la opción "Detalle de Modificación".



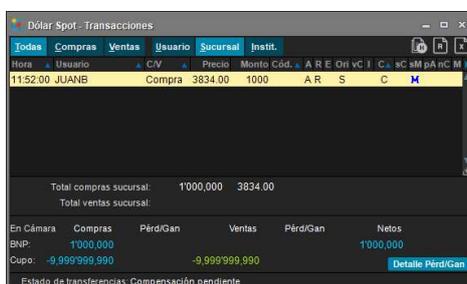
Se abre una nueva ventana con los datos de la operación y podrá identificar los campos que fueron modificados en color azul



Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 97 / 99

Nota: Si la contraparte rechaza la solicitud, la operación quedará en firme con las condiciones iniciales. Una vez la contraparte confirme la solicitud de modificación, en la ventana de operaciones aparece la letra “M” del campo “sM” en color azul, indicando que la modificación de la operación fue aceptada.



En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
BNP:	1'000,000				1'000,000
Cupo:	-9,999'999,990				

Dado que la operación fue creada para ser compensada en la CRCC una solicitud de modificación será enviada a esta entidad para realizar las validaciones correspondientes y aprobar o rechazar la modificación.

Si la CRCC acepta la modificación, la operación queda modificada y se visualiza la letra M en el blotter de operaciones en la columna M.



En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
BNP:	3'000,000		5'000,000	-47,269	2'000,000
Cupo:	66'314,946		62'314,946		



En Cámara	Compras	Pérd/Gan	Ventas	Pérd/Gan	Netos
BYR:			3'000,000		3'000,000
Cupo:	52'064,549		46'064,549		

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 98 / 99

De igual manera en el chat del sistema aparecerá un mensaje haciendo referencia a la aceptación de la modificación.

```

MODIFICACION DE COMPRA
Mercado: Dólar Spot
Comprador      Vendedor
BNPB JUANB     BYRM JUANF
Código de transacción: 03UY00Z0
Fecha de transacción: 25-02-22
Modificada por BYRM JUANF
Confirmada por CRCB FRANZ

```

```

MODIFICACION DE VENTA
Mercado: Dólar Spot
Comprador      Vendedor
BNPB JUANB     BYRM JUANF
Código de transacción: 03UY00Z0
Fecha de transacción: 25-02-22
Modificada por BYRM JUANF
Confirmada por CRCB FRANZ

```

En caso de que la CRCC rechace la modificación de la operación, esta quedará en firme con las condiciones iniciales.

7.2.2. Operaciones Sin Sin Compensación por CRCC (Bilateral)

Cuando se hace un registro de una operación Spot entre dos afiliados sin utilizar la opción compensación a través de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC), El sistema SET-FX la modificación de la operación procede de igual manera al proceso anterior, con la diferencia de que no hay intervención de la Cámara de riesgo central de contraparte.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 01/01/2021	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	MERCADO DÓLAR SPOT	Versión: 03
		Página: 99 / 99

8. INFORMACIÓN ADICIONAL

En caso de tener alguna duda o comentario sobre el contenido de este manual, puede comunicarse con las líneas de soporte de SET-ICAP FX S.A. Tel.: 742 77 78, 742 77 77 Ext 220, 221, 223 o al correo soportesetfx@set-fx.com.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 01/01/2021	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018