

IMPORTACIÓN XML

Manual de usuario




	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 2 / 40

Contenido

INTRODUCCIÓN	3
OBJETIVO	3
1. GENERALIDADES EN LA IMPORTACIÓN DE OPERACIÓN POR EL MECANISMO DE XML	4
2. XML	6
2.1. Importación Manual	7
2.2. Importación Automática.....	8
3. VENTANA REGISTRO DE DIVISAS CLIENTES- IMPORTACIÓN DE TRANSACCIONES XML	9
3.1. Importar XML	11
3.1.1. Operaciones con estado “Errónea”	12
3.2. Última Importación	13
4. ESTRUCTURA DEL ARCHIVO DE IMPORTACIÓN XML	14
5. EJEMPLOS DE IMPORTACIÓN XML	25
6. MODIFICACIÓN AUTOMÁTICA VÍA XML	36
7. ANULACIÓN DE OPERACIONES	38
INFORMACIÓN ADICIONAL	40

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 3 / 40

INTRODUCCIÓN


El Servicio XML permite la carga automática de operaciones por lotes desde los sistemas internos de los afiliados “IMC” (Intermediarios del Mercado Cambiario) hacia la plataforma SET-FX. Dichas operaciones son realizadas entre los IMCs y sus contrapartes (sectores reales, vigilados y agentes del exterior, personas naturales).

Con el uso del servicio XML, los afiliados “IMC” podrán consolidar todas sus operaciones en un sistema de registro autorizado por la Superintendencia Financiera de Colombia, dando cumplimiento a lo establecido en la Resolución 4 de 2009 del Banco de la República así como la Circular DODM-317 del 2010 y sus posteriores actualizaciones.

OBJETIVO

Ofrecer una interfaz entre la plataforma SET-FX y los sistemas internos de los afiliados “IMC”, que permita integrar y registrar eficientemente de manera masiva las operaciones realizadas con sus clientes.


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 4 / 40

1. GENERALIDADES EN LA IMPORTACIÓN DE OPERACIÓN POR EL MECANISMO DE XML

- XML (*eXtensible Markup Language*) es un formato estándar que permitirá al afiliado enviar al Sistema SET-FX los datos de las operaciones realizadas con sus clientes y que reposan en sus sistemas internos.
- La opción de importación por XML es una configuración por usuario.
- El afiliado deberá generar un archivo con nombre **“trades.xml”**, para importación tipo manual, el cual debe estar ubicado en la ruta de instalación del sistema SET-FX dentro de la carpeta **“intercmb”**.
- En el archivo **“trades.xml”** puede incluir una o varias operaciones de registro dentro del mismo archivo XML, las cuales deben ser identificadas por medio del TAG **<transaccion id="#">** con un id diferente entre cada operación a importar.
- En la estructura del archivo XML cada operación inicia con el TAG **<transaccion>** y termina con el TAG **</transaccion>**.
- **Importación Manual:** En esta opción, hay una intervención por parte del usuario, es decir, cada vez que se generen nuevos registros en el formato **“XML”** y estén puestos bajo el directorio **/intercmb**, el usuario deberá importar de forma manual.
- **Importación Automática:** Al activar esta opción, el sistema automáticamente cada minuto realizará la importación desde la ruta **/intercmb** del archivo **“trade#.xml”** que se encuentre en dicha ubicación, es importante y obligatorio que en el cargue automático, cada archivo XML posea un consecutivo, ejemplo: **trade1.xml**, **trade2.xml**, etc.
- Los registros una vez se encuentren en el sistema SET-FX, podrán ser grabados en un archivo plano, recibirlas mediante la interfaz API (en el caso de no tener un BackOffice automatizado), o descárgalas a Excel desde la pantalla del aplicativo.
- La implementación de dicha interfaz debe ser realizada mediante un desarrollo de software por parte de los afiliados.
- A través de dicha interfaz se permite la carga masiva de operaciones, así como la modificación o anulación de las mismas.
- La modificación al registro de operaciones solamente procederá por errores de digitación, los cuales deberán ser acreditados por el afiliado ante los organismos de vigilancia y control.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 5 / 40


- El afiliado será responsable de garantizar que se modifiquen solamente aquellos campos permitidos de acuerdo con las normas aplicables.
- Es responsabilidad de los afiliados cumplir con dichos tiempos de anulación, y soportar a las entidades de vigilancia y control los motivos de la misma.
- La anulación y/o modificación de operaciones vía XML podrán ser realizadas por los afiliados con anterioridad a la hora del cierre del sistema SET-FX y en todo caso los afiliados deberán dar cumplimiento a lo establecido en la Circular DODM-317 del Banco de la República y conservar la información soporte para cada una.
- El archivo XML está constituido por TAGs definidos de acuerdo al tipo de operación a importar.
- Ejemplo de la estructura de un archivo XML:

```

<transacciones>
  <transaccion>
    <id>20100</id>
    <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
    <mercado>174</mercado>
    <origen>CLIENTES</origen>
    <sub_mercado>FORWARD</sub_mercado>
    <operacion>VENTA</operacion>
    <id_usuario>79785258</id_usuario>
    <codigo_especial_fiduciario></codigo_especial_fiduciario>
    <fecha_transaccion>2014-09-30</fecha_transaccion>
    <hora_transaccion>08:01:09</hora_transaccion>
    <fecha_valor></fecha_valor>
    <fecha_inicio_contrato>2014-09-30</fecha_inicio_contrato>
    <fecha_fin_contrato>2014-12-30</fecha_fin_contrato>
    <fecha_pago>2014-09-30</fecha_pago>
    <tipo_registro></tipo_registro>
    <inicio_primer_flujo></inicio_primer_flujo>
    <calendario></calendario>
    <fecha_primera_amortizacion></fecha_primera_amortizacion>
    <modfiy_following_business></modfiy_following_business>
    <valor_amortización></valor_amortización>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

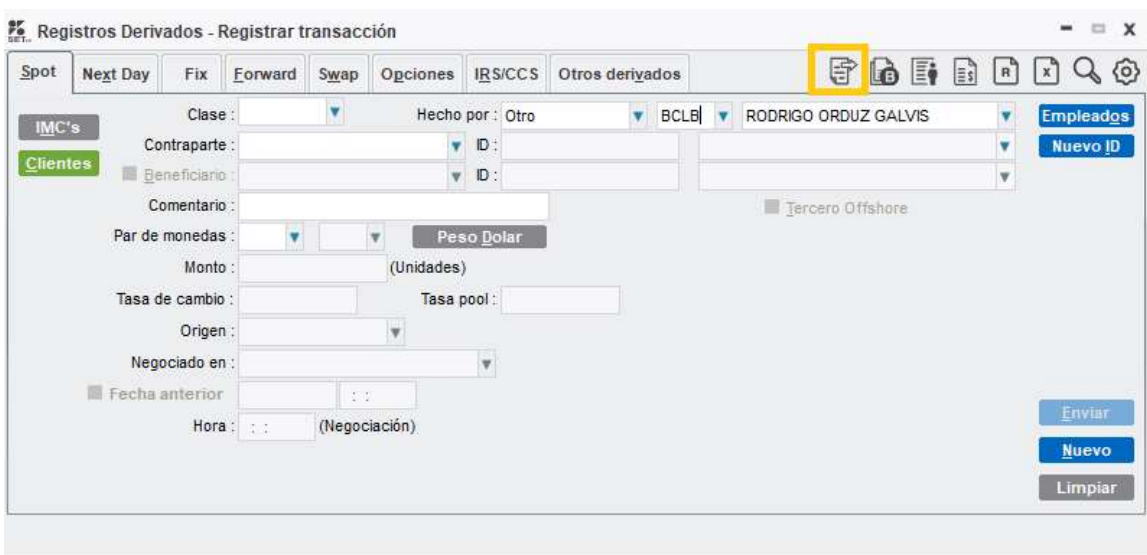
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 6 / 40

2. XML

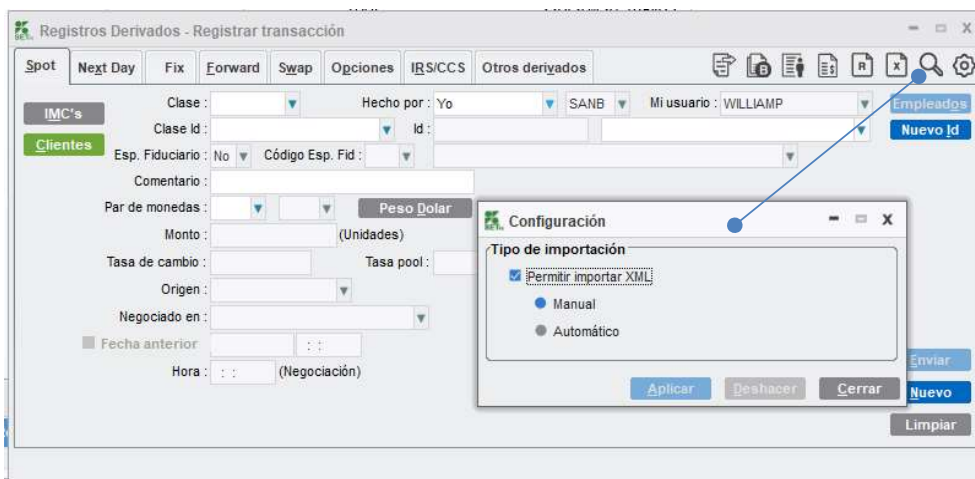
Si el usuario está autorizado para la importación de archivos XML, el botón de “Importar XML”




se verá activo en la ventana registros derivados.



La entidad podrá definir el tipo de importación a usar, manual o automática.




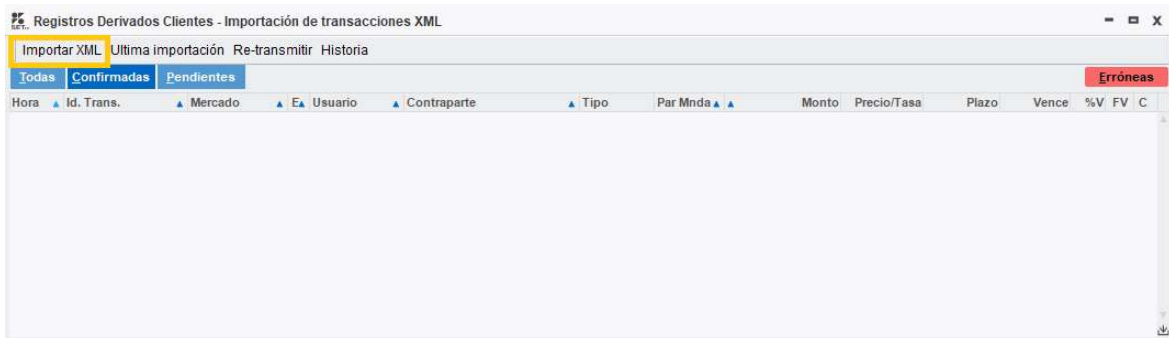
Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 7 / 40

2.1. Importación Manual

Para hacer uso de la importación manual el usuario debe seguir los siguientes pasos:

- En la ventana de “Registros Derivados – Registrar transacción”, ubicar el botón “Importar XML” .
- A continuación seleccionar la opción “Importar XML”




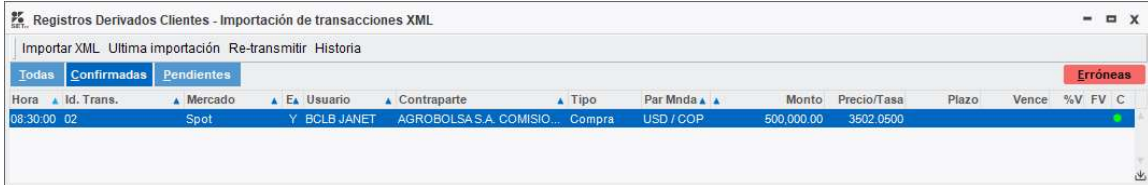
- El sistema ubica la ruta donde se encuentra el archivo .xml y se visualizarán las operaciones a importar.



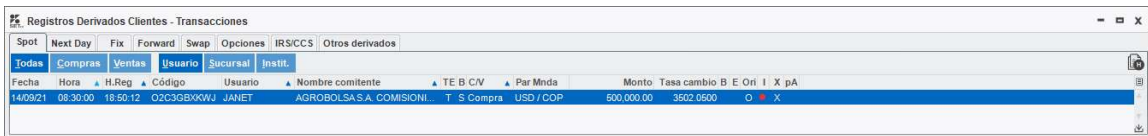
- Finalmente se debe presionar el botón “enviar” para su registro en el sistema SET-FX las operaciones con estado “Por enviar”.
- Las operaciones una vez registradas aparecerán en la ventana principal de “Registro de Divisas Clientes – Importación de Transacciones XML”, seleccionando el botón “Confirmadas”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 8 / 40



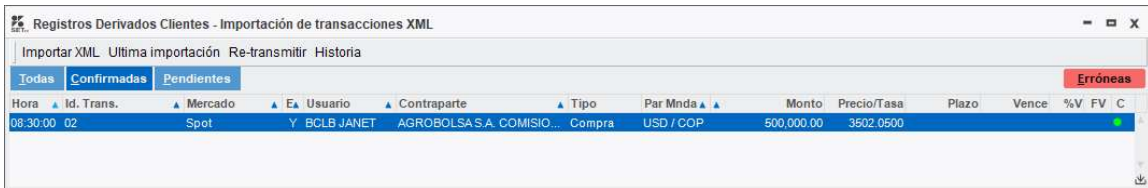
- Las operaciones registradas se ubicarán en el blotter de operaciones con clientes. “Registro de Divisas Clientes - Transacciones”.



2.2. Importación Automática


Al utilizar esta opción, el sistema de manera automática realizará cada minuto la importación desde la ruta /intercmb del archivo “trade#.xml”, es importante y obligatorio para el cargue automático que cada archivo XML posea un consecutivo; ejemplo: trade1.xml, trade2.xml,.....etc.

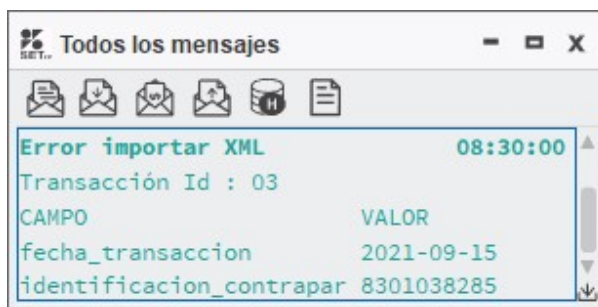
Las operaciones contenidas en el XML y que cumplan con la estructura de cada operación de forma correcta aparecerán en la ventana principal de “Registro de Divisas Clientes – Importación de Transacciones XML”.



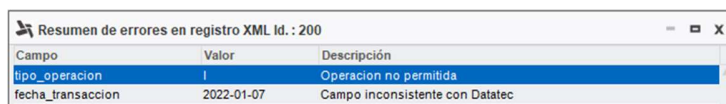
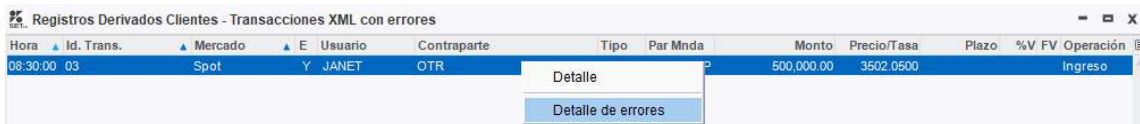
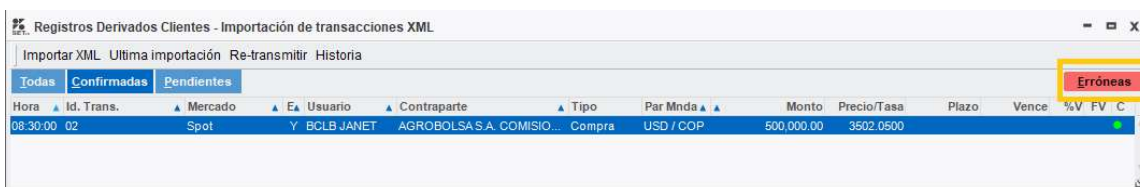
Las operaciones en estado de error por inconsistencia y comprobación de campos aparecerá un mensaje en la ventana “Todos los mensajes”, con el ID de la operación y los campos errados de la operación.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

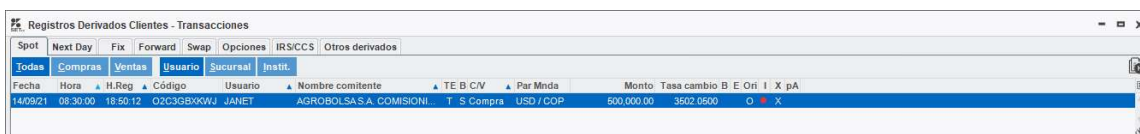
	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 9 / 40



Adicional puede consultar las operaciones con errores de importación desde el botón “Erróneas”:




Las operaciones importadas se ubicarán en el blotter de operaciones de clientes



3. VENTANA REGISTRO DE DIVISAS CLIENTES- IMPORTACIÓN DE TRANSACCIONES XML

A continuación se describe la composición de la ventana de importación de transacciones XML


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 10 / 40



Ítem	Nombre	Descripción
1	Importar XML	Se utiliza para la importación XML por el método manual. Muestra los estados y errores de la importación.
2	Ultima Importación	Visualiza las importaciones realizadas durante el día.
3	Re-transmitir	En caso de fallas o errores a nivel de comunicaciones permitirá volver a enviar el archivo XML
4	Historia	Permite consultar la historia de importaciones exitosas de días anteriores
5	Filtros de Visualización	Permite aplicar filtros de visualización de acuerdo al botón seleccionado: <ul style="list-style-type: none"> • Todas • Confirmadas • Pendientes
6	Operaciones Importadas	Visualiza las operaciones importadas por XML (automático, Manual)
7	Erróneas	Muestra la información de las operaciones con errores cuando se usa la importación automática

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 11 / 40

Registros Derivados Clientes - Importación de transacciones XML

Importar XML Última importación Re-transmitir Historia

Todas Cor 1 nadas Pendie 2 3 Errón 4

Hora	Id. Trans.	Mercado	E	Usuario	Contraparte	Tipo	Par Mnda	Monto	Precio/Tasa	Plazo	Vence	%V	FV	C
08:30:00	11	Next Day	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3012.5600				2	
08:30:00	116	Spot	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500					
08:30:00	266	Fix	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	5'000,000.00		0/14	29/09/2021			
08:30:00	3	Forward	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3200.0000	0/1339	16/05/2025			
08:30:00	4	Swap	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3245.3200	0/310	22/07/2022			
08:30:00	5	Opciones	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	24/03/2025	1.20		
08:30:00	51	Opciones	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	24/03/2025	1.20		
08:30:00	6	IRS/CCS	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	COP / COP	500,000.00		0/1378	24/06/2025			
08:30:00	60	IRS/CCS	Y	BCLB JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3200.0000	0/1378	24/06/2025			

Ítem	Nombre	Descripción
1	Id. Trans.	Muestra el ID que identifica a la operación importada por XML
2	Mercado	Permite visualizar el mercado de cada operación importada
3	Y	Indica si el registro realizado está a nombre propio, a nombre de un usuario de la misma entidad y que cuenta con un perfil en el sistema SET-FX; a nombre de un funcionario de la entidad y que no tiene perfil registrado en el sistema SET-FX
4	C	Circunferencia verde, indicara que el registro fue importado correctamente. De lo contrario mostrara una circunferencia de color rojo.

3.1. Importar XML


Registros Derivados Clientes Transacciones XML

Hora	Id. Trans.	Mercado	E	Usuario	Contraparte	Tipo	Par Mnda	Monto	Precio/Tasa	Plazo	%V	FV	Operación	Estado
08:30:00	11	Next Day	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3012.5600			2	Ingreso	Duplicada
08:30:00	116	Spot	O	BRIANL	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500				Ingreso	Duplicada
08:30:00	266	Fix	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	5'000,000.00		0/14			Anulación	Por enviar
08:30:00	3	Forward	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3200.0000	0/1339			Modificación	Por enviar
08:30:00	45	Swap	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3245.3200	0/310			Ingreso	Por enviar
08:30:00	5	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	1.20		Ingreso	Duplicada
08:30:00	51	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	1.20		Ingreso	Duplicada
08:30:00	6	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	COP / COP	500,000.00		0/1378			Ingreso	Duplicada
08:30:00	61	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3200.0000	0/0			Ingreso	Errónea

Spot : 1 Forward : 1 Opciones : 2 Otros Derivados : 0 Por enviar : 3 Duplicadas : 5
Next Day : 1 Swap : 1 IRS/CCS : 2 Fx : 1 Errónea : 1

Enviar Cancelar

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018


	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 12 / 40

Ítem	Nombre	Descripción
1	Id. Trans.	Muestra el ID que identifica a la operación importada por XML
2	Mercado	Permite visualizar el mercado de cada operación importada
3	Operaciones contenidas en el XML	Visualiza las operaciones contenidas en el archivo XML.
4	Operación	Indica la acción a realizar en la operación: <ul style="list-style-type: none"> • Ingreso • Modificación • Anulación
5	Estado	Visualiza los estados por operación a importar: <ul style="list-style-type: none"> • Duplicada, ID de transacción ya ha sido importada con anterioridad o se encuentra duplicado en las operaciones a importar • Por Enviar, la operaciones no presenta novedades para su posterior registro • Errónea, la operación contiene errores en su estructura o no está cumpliendo con los requerimientos mínimos para realizar el registro.
6	Operaciones Importadas	Visualiza las operaciones importadas por XML (automático, Manual)
7	Erróneas	Muestra los errores generados por cada operación a importar

3.1.1. Operaciones con estado “Errónea”

El usuario puede visualizar los errores en la composición de cada operación desde la ventana “Registros Derivados Clientes – Transacciones XML”, seleccionando la operación, clic derecho “detalles de errores”.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 13 / 40

Hora	Id. Trans.	Mercado	E	Usuario	Contraparte	Tipo	Par Mnda	Monto	Precio/Tasa	Plazo	%V FV	Operación	Estado
08:30:00	266	Fix	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	5'000,000.00				Anulación	Por enviar
08:30:00	3	Forward	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3200.0000	0/1339		Modificación	Por enviar
08:30:00	6	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	COP / COP	500,000.00		0/1378		Ingreso	Duplicada
08:30:00	61	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00		0/0		Ingreso	Duplicada
08:30:00	11	Next Day	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3012.5600			Ingreso	Duplicada
08:30:00	5	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	1.20	Ingreso	Duplicada
08:30:00	51	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Compra	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1286	1.20	Ingreso	Duplicada
08:30:00	115	Spot	O	BRIANL	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500			Ingreso	Duplicada
08:30:00	46	Swap	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3245.3200	0/310		Ingreso	Por enviar

Spot : 1 Forward : 1 Opciones : 2 Otros Derivados : 0 Por enviar : 3 Duplicadas : 5
Next Day : 1 Swap : 1 IRS/CCS : 2 Fix : 1 Errónea : 1

Campo	Valor	Descripción
id_usuario	88787114	Campo requerido
fecha_fin_contrato	2020-06-24	Campo inconsistente con Datatec
precio		Campo requerido


3.2. Ultima Importación

Permite visualizar las importaciones realizadas durante el día.

Importación Nro. 1	Hora	Id. Trans.	Mercado	E	Usuario	Contraparte	Tipo	Par Mnda	Monto	Precio/Tasa	Plazo	%V FV	Operación	Estado
1	08:30:00	11	Next Day	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3012.5600		2	Ingreso	Enviada
2	08:30:00	115	Spot	O	BRIANL	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	500,000.00	3202.0500			Ingreso	Enviada
3	08:30:00	265	Fix	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Compra	USD / COP	5'000,000.00		0/9		Ingreso	Enviada
4	08:30:00	3	Forward	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3800.0000	0/1339		Modificación	Enviada
5	08:30:00	45	Swap	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3245.3200	0/305		Ingreso	Enviada
6	08:30:00	5	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Comp	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1281	1.20	Ingreso	Enviada
7	08:30:00	51	Opciones	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Put Comp	USD / COP	500,000.00	3000.3200	0/1281	1.20	Ingreso	Enviada
8	08:30:00	6	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	COP / COP	500,000.00		0/1373		Ingreso	Enviada
9	08:30:00	61	IRS/CCS	Y	JANET	Administradora de Fondos ...	Venta	USD / COP	500,000.00	3855.8000	0/4		Ingreso	Enviada

Ítem	Nombre	Descripción
1	Importación Nro	Cantidad de importaciones realizadas
2	Botones de navegación	Permite visualizar las importaciones realizadas durante el día.
3	Re-transmitir	En caso de fallas o errores a nivel de comunicaciones permitirá volver a enviar el archivo XML
4	Historia	Puede consultar la historia de importaciones exitosas de días anteriores
5	Filtros de Visualización	Permite aplicar filtros de visualización de acuerdo al botón seleccionado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018


	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 14 / 40

6	Operaciones Importadas	Visualiza las operaciones importadas por XML (automático, Manual)
7	Erróneas	Muestra la información de las operaciones con errores cuando se usa la importación automática

4. ESTRUCTURA DEL ARCHIVO DE IMPORTACIÓN XML


- 4.1. **ID:** es un identificador único de la transacción alfanumérico de hasta 15 caracteres requerido para todos los mercados. Codificación interna realizada por el afiliado.
<id></id>
- 4.2. **Tipo operación:** se refiere al tipo de acción a realizar; I = ingreso; M = modificación; A = anulación. Requerido para todos los mercados. <tipo_operacion></tipo_operacion>
- 4.3. **Mercado:** el mercado siempre va ser 174 que es el mercado de Registros derivados. El sistema tomará como error otro valor. Requerido para todos los mercados.
<mercado></mercado>
- 4.4. **Origen:** Solo acepta el registro con CLIENTES <origen></origen>
- 4.5. **Sub Mercado:** tipo de registro a ingresar Spot; Next Day; Forward; Swap; Opciones; IRS/CCS; Otros derivados requerido para todos los mercados.
<sub_mercado></sub_mercado>
- 4.6. **Operación:** tipo de operación de COMPRA o VENTA para todos los submercados. Valor requerido para todos los mercados. <operacion> </operacion>
- 4.7. **Clase de Opción:** Indicador (PUT/CALL) de tipo de opción para operaciones del submercado de opciones. <clase_opcion></clase_opcion>
- 4.8. **Id Usuario:** identificación única del usuario que hizo la transacción (propietario de la transacción), valor requerido para todos los mercados. <id_usuario></id_usuario>

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 15 / 40

- 4.9. **Fecha Transacción:** formato YYYY-MM-DD es la fecha actual del Sistema SET-FX. Otra fecha será tomada como error, requerido para todos los mercados.
<fecha_transaccion></fecha_transaccion>
- 4.10. **Hora Transacción:** formato hh:mm:ss. Hora de negociación del registro. No puede ser superior a la hora actual del sistema o anterior a la apertura del mercado de registros de derivados. Requerido para todos los mercados.
<hora_transaccion></hora_transaccion>
- 4.11. **Fecha Valor:** solo para registros Next Day. Valores a usar 1 o 2 o 3, de acuerdo al tipo de operación. <fecha_valor></fecha_valor>
- 4.12. **Fecha Inicio Contrato:** Fecha de inicio del registro en formato YYYY-MM-DD indispensable para los mercados Forward; Swap; Opciones; IRS/CCS; Otros derivados.
<fecha_inicio_contrato></fecha_inicio_contrato>
- 4.13. **Fecha Final Contrato:** Fecha de vencimiento del registro. En formato YYYY-MM-DD indispensable para los mercados Forward; Swap; Opciones; IRS/CCS; Otros derivados.
<fecha_fin_contrato></fecha_fin_contrato>
- 4.14. **Fecha Pago:** Fecha de Pago de un registro. Formato YYYY-MM-DD. Indispensable para los mercados Forward; Swap; Opciones; IRS/CCS; Otros derivados, esta fecha debe Ser mayor o igual a la fecha de vencimiento. <fecha_pago></fecha_pago>
- 4.15. **Tipo Registro:** Requerido solo para el submercado IRS/CCS. S para registro IRS y una C para registros CCS. <tipo_registro></tipo_registro>
- 4.16. **Inicio Primer Flujo:** Con valores desde 0 hasta 2, o 99 para tipo FRA. Tomado en cuenta para el cálculo de la fecha de vencimiento, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. <inicio_primer_flujo></inicio_primer_flujo>
- 4.17. **Calendario:** Contiene dos valores: CO y CO-NY, usado para cálculo de la fecha de vencimiento. Campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS.
<calendario></calendario>

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 16 / 40

- 4.18. **Vencimiento sin Ajustar:** En formato YYYY-MM-DD. Por defecto es la misma fecha de pago, debe ser mayor o igual a fecha de pago. Campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. `<vencimiento_sin_ajustar></vencimiento_sin_ajustar>`
- 4.19. **Mofiy Following Business:** Campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS, contiene una S o N. Usado como una convención internacional para el pago de los flujos y del vencimiento. `<modfiy_following_business></modfiy_following_business>`
- 4.20. **Segundo Monto:** Para registros CCS corresponde al monto de la segunda moneda. Con formato 999999999.99. Por defecto mantiene el mismo valor del monto, puede ser menor a este. Campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. `<segundo_monto></segundo_monto>`
- 4.21. **Tipo Amortización:** campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS, con valores BULLET e IGUALES. `<tipo_amortizacion></tipo_amortizacion>`
- 4.22. **Tipo de Tasa 1:** Contiene los valores de V (para tasa Variable) y F (para tasa Fija). Campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS, este tipo de Tasa puede ser igual al tipo de tasa 2. `<tipo_tasa_1></tipo_tasa_1>`
- 4.23. **Tasa Interés:** Valor de interés para el tipo de tasa Fija, con el formato de 99.999999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. `<tasa_interes></tasa_interes>`
- 4.24. **Base Días 1:** Contiene la base días usada para el cálculo de la tasa de interés, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. `<base_dias_1></base_dias_1>`
Posibles valores:
- M: ACT/360
 - C: ACT/365
 - T: 30/360
 - S: 30/365
 - A: ACT/ACT

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 17 / 40

4.25. **Código Tasa Referencial Extendido:** Contiene el código de la tasa referencial para tasa de interés variable.

`<codigo_tasa_referencial_extendido></codigo_tasa_referencial_extendido>`

Posibles valores:

- DTF90: DTF 90 días
- EUR3M: EURIBOR 3 meses
- EUR6M: EURIBOR 6 meses
- FBIL: FBIL reference Price
- FED: FEDFUNDS
- FFON: Fed Funds Overnight
- IBR1M: IBR 1 mes
- IBR3M: IBR 3 meses
- IBRON: IBR Overnight
- IPC
- LBR1M: LIBOR 1 mes
- LBR1Y: LIBOR 1 año
- LBR3M: LIBOR 3 meses
- LBR6M: LIBOR 6 meses
- SFR1M: SOFR 1 mes
- SFR3M: SOFR 3 meses
- SFR3M: SOFR 6 meses
- SFRON: SOFR Overnight
- VAC: Índices VAC BCR

4.26. **Spread Tasa:** Valor de spread para la tasa de interés "Variable". Con formato 99.9999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS `<spread_tasa></spread_tasa>`

4.27. **Tipo Tasa 2:** Contiene los valores de V - Variable y F - Fijo, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS, este tipo de Tasa puede ser igual al tipo de tasa 1

`<tipo_tasa_2></tipo_tasa_2>`

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 18 / 40

4.28. **Tasa Interés 2:** Valor de interés para tipo de tasa “Fijo” para la segunda moneda, con el formato de 99.999999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS.

`<tasa_interes_2></tasa_interes_2>`

4.29. **Código Tasa Referencial Extendido 2:** Contiene el código de la tasa referencial para la segunda moneda.

`<codigo_tasa_referencial_extendido_2></codigo_tasa_referencial_extendido_2>`


Posibles valores:

- DTF90: DTF 90 días
- EUR3M: EURIBOR 3 meses
- EUR6M: EURIBOR 6 meses
- FBIL: FBIL reference Price
- FED: FEDFUNDS
- FFON: Fed Funds Overnight
- IBR1M: IBR 1 mes
- IBR3M: IBR 3 meses
- IBRON: IBR Overnight
- IPC
- LBR1M: LIBOR 1 mes
- LBR1Y: LIBOR 1 año
- LBR3M: LIBOR 3 meses
- LBR6M: LIBOR 6 meses
- SFR1M: SOFR 1 mes
- SFR3M: SOFR 3 meses
- SFR3M: SOFR 6 meses
- SFRON: SOFR Overnight
- VAC: Índices VAC BCR

4.30. **Spread Tasa 2:** Valor de spread para la tasa de interés “Variable” para la segunda moneda, con el formato de 99.9999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS.

`<spread_tasa_2></spread_tasa_2>`

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 19 / 40

4.31. **Base Días 2:** Contiene la base días usada para el cálculo de la tasa de interés, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS. `<base_dias_2></base_dias_2>`

Posibles valores:

- M: ACT/360
- C: ACT/365
- T: 30/360
- S: 30/365
- A: ACT/ACT

4.32. **Periodo Interés 2:** Usado para IRS/CCS campo obligatorio, bandera que indica la periodicidad de pagos Mensual; Trimestral; Semestral, Anual; Un solo flujo. Solo para la segunda tasa de interés. `<periodo_interes_2></periodo_interes_2>`

4.33. **Precio:** Formato 9999.9999 o el formato correspondiente al par de monedas requerido para todos los mercado `<precio></precio>`


4.34. **Monto Transado:** Formato 99999999.99 requerido para todos los mercados `<monto_transado></monto_transado>`

4.35. **Moneda Monto:** Es la expresión de la moneda en la cual está dado el monto de la operación. Requerido para todos los mercados. `<moneda_monto></moneda_monto>`

4.36. **Moneda Contraparte:** Expresión de la segunda moneda. Requerido para todos los mercados. `<moneda_contraparte></moneda_contraparte>`

4.37. **Descripción Opcionalidad:** Si la transacción tiene opcionalidad, debe venir la descripción de la opcionalidad. Para entidades No-IMCS viene el tipo de opción como Mandatory, Easy Termination, si viene un texto libre se lo tomara como la opción Other. Aplica para los submercados Forward, Swap, Otros derivados. `<descripcion_opcionalidad></descripcion_opcionalidad>`

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 20 / 40

4.38. **Tasa Referencial:** Aplica para el par de monedas USD/COP y para los mercados FIX, Forward, Swap; los valores permitidos son Manual, Precio FIX SET-FX, TRM.

[<tasa_referencial></tasa_referencial>](#)

4.39. **Tipo de Identificación:** Tipo de identificación de la contraparte. Requerido para todos los mercados [<tipo_identificacion></tipo_identificacion>](#)

Posibles valores:

- C = Cédula
- D = Cédula nueva
- N = NIT
- P = Pasaporte
- T = Tarjeta de identidad
- I = Tarjeta de identidad nueva
- E = Cédula de extranjero
- R = Registro civil
- X = Empresas del exterior
- S = código Swift

4.40. **Identificación Contraparte:** código de identificación único solo valores, sin formato. El formato dependerá del tipo de identificación de la contraparte. Requerido para todos los mercados [<identificacion_contraparte></identificacion_contraparte>](#)

4.41. **Tipo de identificación Beneficiario:** Clase de identificación del comitente propio.

Usado solo para entidades No-IMCS.

[<clase_id_comitente_propio></clase_id_comitente_propio>](#)

Posibles valores:

- C = Cédula
- D = Cédula nueva
- N = NIT
- P = Pasaporte
- T = Tarjeta de identidad
- I = Tarjeta de identidad nueva
- E = Cédula de extranjero
- R = Registro civil


Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 21 / 40

- X = Empresas del exterior
- S = código Swift


- 4.42. **Identificación Beneficiario:** código de identificación único solo valores sin formato (Dato de Comitente PROPIO) Usado solo para entidades No-IMCS.
<id_comitente_propio></id_comitente_propio>
- 4.43. **Periodo Interés:** Usado para Swap, IRS/CCS, Otros derivados. Campo obligatorio, bandera que indica la periodicidad de pagos Mensual; Trimestral; Semestral, Anual; Un solo flujo para la primera tasa de interés. **<periodo_interes></periodo_interes>**
- 4.44. **Comentario:** Texto de hasta 30 caracteres (opcional). **<comentario></comentario>**
- 4.45. **Cumplimiento:** El tipo de cumplimiento DELIVERY o NON-DELIVERY; usados para los mercados: Forward, Swap, Opciones, IRS/CCS, y Otros derivados.
<cumplimiento></cumplimiento>
- 4.46. **Tasa Interés Moneda Monto:** nombres de las tasas de acuerdo a los pares de monedas necesarias para el mercado Otros derivados. Texto libre de 15 caracteres
<tasa_interes_moneda_monto></tasa_interes_moneda_monto>
<tasa_interes_moneda_contraparte></tasa_interes_moneda_contraparte>
- 4.47. **Condición del Ejercicio:** Texto libre de 15 caracteres requerido para mercado de opciones. **<condicion_ejercicio></condicion_ejercicio>**
- 4.48. **Precio Ejerció:** precio del ejercicio (Strike) formato 9999.9999 de acuerdo al par de monedas, requerido en el mercado de opciones **<precio_ejercicio></precio_ejercicio>**
- 4.49. **Volatilidad:** valor de la volatilidad formato 99.99; campo requerido para el mercado de Opciones **<volatilidad></volatilidad>**
- 4.50. **Precio Spot:** Campo requerido para los mercados: Forward, Swap. El formato dependerá dl par de monedas escogido. **<precio_spot></precio_spot>**

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 22 / 40

- 4.51. **Prima:** formato 999.99999. Campo obligatorio para el registro de Opciones.
<prima></prima>
- 4.52. **Tipo Opción:** Valores permitidos; AME=Americana; EUR=Europea; OTR=Otras. Obligatorio para el mercado de Opciones <tipo_opcion></tipo_opcion>
- 4.53. **Tipo Swap:** Valores permitidos; SWAP; FORWARD FORWARD obligatorio para los mercados Swap y Otros derivados. Cuando es FORWARD FORWARD la “fecha inicio contrato” debe ser mayor a la fecha de la transacción. <tipo_swap></tipo_swap>
- 4.54. **Numeral Cambiario:** Código numérico de 4. Campo opcional.
<numeral_cambiario></numeral_cambiario>
- 4.55. **Forma de Pago:** Valores permitidos; CHEQUE; EFECTIVO; TRANSFERENCIA. Campo opcional. <forma_de_pago></forma_de_pago>
- 4.56. **Tipo de Operación Complementaria:** Valores permitidos; POSICION PROPIA; CONTRATO DE COMISION. Campo opcional.
<tipo_de_operacion_complementaria></tipo_de_operacion_complementaria>
- 4.57. **Porcentaje Comisión:** Si tipo de operación complementarias es “CONTRATO DE COMISION” es necesario llenar porcentaje comisión su formato es 90.0000
<porcentaje_comision></porcentaje_comision>
- 4.58. **Sistema Origen:** D Indica que sistema ya subió la transacción por digitación en el SISTEMA DATATEC y no se importa. X Indica que se debe importar vía XML; si está vacío o dice otra cosa distinta a "D" o "X" se reporta como error
<origen_sistema></origen_sistema>
- 4.59. **Texto Origen:** Indica el origen de la transacción dependiendo del tipo de mercado.
<texto_origen></texto_origen>
- Posibles valores para el mercado Spot:
- X0 – Fix

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 23 / 40

- S – Spot
- F - Swap Forward
- O - Swap O/N contado
- U - Swap Futuro

Posibles valores para el mercado Next Day:

- N - Next Day
- F - Swap Forward
- O - Swap O/N contado
- U - Swap Futuro

Posibles valores para el mercado Forward, permite valores vacíos:


- X0 – Fix
- S – Swap
- F - Forward-Forward
- O - Outright

4.60. **Sistema Negociación:** Código único identificado por un carácter que equivale al sistema de negociación. `< sistema_negociacion >`

Posibles valores:

- I=SET-ICAP
- G=GFI Exchange
- T=Tradition
- O=OTC
- D=DIRECTO
- B=BLOOMBERG
- R=Refinitiv
- P=BANCO DE LA REPUBLICA
- N=Dirección Tesoro Nacional

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 24 / 40

4.61. **Tipo de identificación Beneficiario:** ES PERMITIDO SOLO si el comitente es NIT Entidad Vigilada, Empresa del Exterior o Código Swift.

`<clase_id_comitente_contraparte></clase_id_comitente_contraparte>`

Posibles valores:

- C = Cédula
- D = Cédula nueva
- N = NIT
- P = Pasaporte
- T = Tarjeta de identidad
- I = Tarjeta de identidad nueva
- E = Cédula de extranjero
- R = Registro civil
- X = Empresas del exterior
- S = código Swift

4.62. **Identificación Beneficiario:** Código de identificación único solo valores sin formato.

Aplica para perfiles IMC's. `<id_comitente_contraparte></id_comitente_contraparte>`

4.63. **Tercer offshore:** Si el registro es con Tercero OffShore, el valor permitido será "S" permitido. No aplica para entidades NO-IMCS.

`<bandera_tercer_offshore></bandera_tercer_offshore>`


4.64. **Tasa pool:** El formato de precio dependerá del par de monedas seleccionado, para el caso registros CCS tiene un de formato "990.0000". `<tasa_pool></tasa_pool>`

4.65. **Par de monedas:** Tag para indicar la expresión del monto de acuerdo al par de monedas seleccionado, solo aplica para el mercado FIX.

`<par_monedas></par_monedas>`

4.66. **Puntos:** Los puntos son sumados o restados de acuerdo a la tasa asignada. Aplica para el mercado FIX Y forward en formato "-9990.0000". `<puntos></puntos>`

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 25 / 40

4.67. **Fecha asignación:** Aplica para submercado FIX y FRW con origen FIX. Hace referencia a la fecha de asignación de la tasa. En formato YYYY-MM-DD.

`<fecha_asignacion></fecha_asignacion>`

5. EJEMPLOS DE IMPORTACIÓN XML

En los siguientes ejemplos podrán visualizar la importación XML por sub-mercados:


5.1. SPOT

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
  <transaccion>
    <id>001</id>
    <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
    <mercado>174</mercado>
    <origen>CLIENTES</origen>
    <sub_mercado>SPOT</sub_mercado>
    <operacion>COMPRA</operacion>
    <id_usuario>88787115</id_usuario>
    <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
    <hora_transaccion>08:30:00</hora_transaccion>
    <precio>4202.0500</precio>
    <monto_transado>500000.00</monto_transado>
    <moneda_monto>USD</moneda_monto>
    <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
    <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
    <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
    <comentario>Submercado Spot</comentario>
    <origen_sistema>X</origen_sistema>
    <texto_origen>O</texto_origen>
    <negociacion_sistema>I</negociacion_sistema>
    <tasa_pool>4232.0000</tasa_pool>
    <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
    <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
    <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
  </transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 26 / 40

Registros Derivados - Spot - Detalle de transacción

Fecha: 09/02/2022 Código: O2C3A4SUZ6 Hora de registro: 10:55:44 Hora: 08:30:00

Comprador: **BANCOLOMBIA S.A.** Sucursal: **BOGOTA** Persona: **Janet Patricia Aguilera Roldan**

Por parte de: _____

Vendedor - Nombre comitente: **Administradora de Fondos de Pensiones y C** Clase ID: **Nit** Identificación: **800.138.188-1** Vigilado: **TRM**

Beneficiario: **CITIBANK N.A. LONDON BRANCH** Por parte de: _____ Empresas del exterior: **045**

Par de monedas: **USD / COP** Tercero Offshore Cod. importación: **001**

Monto: **500,000.00**

Tasa de cambio: **4202.0500** Tasa pool: **4232.0000**

Monto COP: **2,101'025,000.00**

Negociado en: **SET-ICAP**

Origen de transacción: **Registrado por JANET**

Comentario: **Submercado Spot**

Origen: **Swap O/N contado**

Fecha anterior


5.2. NEXT DAY

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>002</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>NEXT DAY</sub_mercado>
  <operacion>VENTA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>09:30:00</hora_transaccion>
  <fecha_valor>3</fecha_valor>
  <precio>2.5642000</precio>
  <monto_transado>600000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>JPY</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>USD</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <comentario>Operación Next Day</comentario>
  <origen_sistema>X</origen_sistema>
  <origen_negociacion_sistema>I</origen_negociacion_sistema>
  <tasa_pool>2.6642000</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 27 / 40

Registros Derivados - Next Day - Detalle de transacción

Fecha: 09/02/2022 Código: O2C3A4SUZ8 Hora de registro: 11:01:38 Hora: 09:30:00

Comprador - Nombre comitente: Administradora de Fondos de Pensiones y C Clase ID: Nit Identificación: 800.138.188-1 Vigilado TRM

Beneficiario: CITIBANK N.A. LONDON BRANCH Por parte de: Empresas del exterior 045

Vendedor: BANCOLOMBIA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Janet Patricia Aguilera Roldan

Par de monedas: JPY / USD Tercero Offshore Cod. importación: 002

Monto: 600,000.00 Tasa de cambio: 2.5642000 Tasa pool: 2.6642000

Monto USD: 1'538,520.00 Fecha valor: 3 Días

Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario: Operación Next Day

Origen: Next Day

Fecha anterior


5.3. FIX

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>003</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>FIX</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
  <fecha_fin_contrato>2022-04-29</fecha_fin_contrato>
  <hora_transaccion>10:30:00</hora_transaccion>
  <monto_transado>3000000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <tasa_referencial>PROMEDIO SET FX</tasa_referencial>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <comentario>Operación FIX</comentario>
  <origen_sistema>X</origen_sistema>
  <texto_origen>O</texto_origen>
  <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
  <fecha_asignacion>2022-02-10</fecha_asignacion>
  <puntos>-2.0000</puntos>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
  <tasa_pool>4200</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
<par_monedas>USD/COP</par_monedas>
</transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 28 / 40

Registros Derivados - Fix - Detalle de transacción

Fecha: 09/02/2022 Código: O2C3A4SUZA Hora de registro: 11:13:42 Hora: 10:30:00

Comprador	Sucursal	Persona
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan
Por parte de:		
Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación
Administradora de Fondos de Pensiones y C	Nit	800.138.188-1
Vigilado TRM		
Beneficiario	Por parte de:	
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH	Empresas del exterior	045

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore Cod. importación: 003

Plazo: 79 Viernes 29-Abr-2022 Origen: X79

Fecha asignación tasa: Jueves 10-Feb-2022

Monto: 3'000,000.00 USD Tasa de cambio:

Puntos: -2.0000 Tasa spot: PRECIO FIX SET FX


Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario: Operación FIX

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
  <transaccion>
    <id>004</id>
    <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
    <mercado>174</mercado>
    <origen>CLIENTES</origen>
    <sub_mercado>FIX</sub_mercado>
    <operacion>COMPRA</operacion>
    <id_usuario>88787115</id_usuario>
    <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
    <fecha_fin_contrato>2022-06-29</fecha_fin_contrato>
    <hora_transaccion>10:30:00</hora_transaccion>
    <monto_transado>5510000.00</monto_transado>
    <moneda_monto>COP</moneda_monto>
    <moneda_contraparte>USD</moneda_contraparte>
    <tasa_referencial>PROMEDIO SET FX</tasa_referencial>
    <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
    <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
    <comentario>Operación FIX</comentario>
    <origen_sistema>X</origen_sistema>
    <texto_origen>O</texto_origen>
    <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
    <fecha_asignacion>2022-02-10</fecha_asignacion>
    <puntos>-2.0000</puntos>
    <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
    <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
    <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
    <tasa_pool>4200</tasa_pool>
    <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
    <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
    <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
  </transaccion>
</transacciones>
```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204 Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 29 / 40

Registros Derivados - Fix - Detalle de transacción

Fecha: 09/02/2022 Código: 02C3A4SUZC Hora de registro: 11:19:07 Hora: 10:30:00

Comprador	Sucursal	Persona
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan
Por parte de :		
Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación
Administradora de Fondos de Pensiones y C	Nit	800.138.188-1
Vigilado TRM		
Por parte de :		
Beneficiario	Clase ID	Identificación
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH	Empresas del exterior	045

Par de monedas : COP / USD Tercero Offshore Cod. importación : 004

Plazo : 140 Miércoles 29-Jun-2022 Origen : X140

Fecha asignación tasa : Jueves 10-Feb-2022

Monto : 5'510,000.00 COP Tasa de cambio :

Puntos : -2.0000 Tasa spot : PRECIO FIX SET FX


Negociado en : SET-ICAP

Origen de transacción : Registrado por JANET

Comentario : Operación FIX

5.4. FORWARD

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 30 / 40

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>005</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>FORWARD</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>11:02:35</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-09</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2027-05-17</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2027-05-17</fecha_pago>
  <precio>4322.4500</precio>
  <monto_transado>75000000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <comentario>Operación Forward</comentario>
  <tasa_referencial>MANUAL</tasa_referencial>
  <cumplimiento>NON-DELIVERY</cumplimiento>
  <precio_spot>4200.0000</precio_spot>
  <sistema_origen>X</sistema_origen>
  <texto_origen>F</texto_origen>
  <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
  <tasa_pool>4300.5600</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>

```

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 09/02/2022 Código: O2C3A4SUZE Hora de registro: 11:26:36 Hora: 11:02:35

Comprador	Sucursal	Persona
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan
Por parte de:		
Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación
Administradora de Fondos de Pensiones y C. Nit		800.138.188-1
Vigilado: TRM		
Beneficiario	Por parte de:	
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH	Empresas del exterior	045

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore Cod. importación: 005

Plazo: 1923 Días 17-May-2027 Origen: Forward-Forward

Fecha asignación tasa: Miércoles 09-Feb-2022 Tasa referencial: MANUAL

Fecha de pago: 17-May-2027 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 75'000,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 122.4500 SEFable:

Tasa forward: 4322.4500

Tasa spot: 4200.0000 Tasa pool: 4300.5600

Negociado en: SET-ICAP


Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario: Operación Forward

Estado CRCC:

Fecha anterior

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 31 / 40

5.5. SWAP


```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>006</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>SWAP</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-09</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>09:45:45</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-09</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2023-07-24</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2023-07-27</fecha_pago>
  <precio>5.3232050</precio>
  <monto_transado>585000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>EUR</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>SEK</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <periodo_interes>MENSUAL</periodo_interes>
  <comentario>Operaciones Swap</comentario>
  <cumplimiento>DELIVERY</cumplimiento>
  <precio_spot>5.9456500</precio_spot>
  <tipo_swap>SWAP</tipo_swap>
  <sistema_origen>X</sistema_origen>
  <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
  <tasa_pool>5.9955448</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>

```

Registros Derivados - Swap - Detalle de transacción			
Fecha:	09/02/2022	Código:	O2C3A4SUZG
Hora de registro:	11:58:03	Hora:	09:45:45
Comprador	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan	
Por parte de:			
Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación	Vigilado
Administradora de Fondos de Pensiones y C Nit		800.138.188-1	TRM
Beneficiario			
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH	Empresas del exterior	045	
Par de monedas: EUR / SEK <input checked="" type="checkbox"/> Tercero Offshore Cod. importación: 006			
Tipo: SWAP			
Plazo:	530 Días	24-Jul-2023	
Fecha de pago:	27-Jul-2023		
Monto:	585,000.00	Cumplimiento:	DELIVERY
Tasa Swap:	5.3232050	Opcionalidad:	
Tasa Spot:	5.9456500	Tasa pool:	5.9955448
Períodos de pago:		Mensual	
Negociado en: SET-ICAP			
Origen de transacción: Registrado por JANET			
Comentario: Operaciones Swap			
Estado CRCC:			
<input type="checkbox"/> Fecha anterior			

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018


	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 32 / 40

5.6. OPCIONES

```
<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252" ?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>008</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>OPCIONES</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <codigo_especial_fiduciario></codigo_especial_fiduciario>
  <fecha_transaccion>2022-02-10</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>08:30:00</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-10</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2025-03-24</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2025-03-26</fecha_pago>
  <precio>4562.3200</precio>
  <monto_transado>50000000.00</monto_transado>
  <clase_opcion>PUT</clase_opcion>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <periodo_interes>MENSUAL</periodo_interes>
  <comentario>Operación opcion</comentario>
  <cumplimiento>DELIVERY</cumplimiento>
  <condicion_ejercicio>N</condicion_ejercicio>
  <precio_ejercicio>5120.2300</precio_ejercicio>
  <volatilidad>01.20</volatilidad>
  <prima>1.00</prima>
  <tipo_opcion>EUR</tipo_opcion>
  <sistema_origen>X</sistema_origen>
  <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>
```

Registros Derivados - Opciones - Detalle de transacción			
Fecha:	10/02/2022	Código:	O2C3A4SV26
Hora de registro:	09:54:05	Hora:	08:30:00
Comprador	Sucursal	Persona	
BANCOLOMBIA S.A.	BOGOTA	Janet Patricia Aguilera Roldan	
Por parte de:			
Vendedor - Nombre comitente	Clase ID	Identificación	Vigilado TRM
Administradora de Fondos de Pensiones y C	Nit	800.138.188-1	
Beneficiario			
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH	Empresas del exterior	045	
Par de monedas: USD / COP <input checked="" type="checkbox"/> Tercero Offshore Cod. importación: 008			
Plazo:	1138 Dias	24-Mar-2025	
Fecha de pago:	26-Mar-2025	Clase opción:	PUT
Monto:	50'000,000.00	Cumplimiento:	DELIVERY
Tasa pactada (Spot):	4562.3200	Tasa pool Strike:	0.0000
Prima:	1.00000	Tasa Strike:	5120.2300
Tipo de opción:	EUROPEA	Condición del ejercicio:	N
Negociado en:	SET-ICAP	Porcentaje de volatilidad:	1.20
Origen de transacción:	Registrado por JANET		
Comentario:	Operación opcion		
Fecha anterior			

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 33 / 40


5.7. IRS

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252" ?>
<transacciones>
  <transaccion>
    <id>009</id>
    <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
    <mercado>174</mercado>
    <origen>CLIENTES</origen>
    <sub_mercado>IRS/CCS</sub_mercado>
    <operacion>VENTA</operacion>
    <id_usuario>88787115</id_usuario>
    <fecha_transaccion>2022-02-11</fecha_transaccion>
    <hora_transaccion>10:10:00</hora_transaccion>
    <fecha_inicio_contrato>2022-02-11</fecha_inicio_contrato>
    <fecha_fin_contrato>2028-06-27</fecha_fin_contrato>
    <fecha_pago>2028-06-27</fecha_pago>
    <tipo_registro>S</tipo_registro>
    <calendario>CO</calendario>
    <vencimiento_sin_ajustar></vencimiento_sin_ajustar>
    <modfiy_following_business>S</modfiy_following_business>
    <segundo_monto></segundo_monto>
    <tipo_amortizacion>BULLET</tipo_amortizacion>
    <tipo_tasa_1>F</tipo_tasa_1>
    <tasa_interes_1>23.259800</tasa_interes_1>
    <base_dias_1>M</base_dias_1>
    <codigo_tasa_referencial_extendido></codigo_tasa_referencial_extendido>
    <spread_tasa></spread_tasa>
    <tipo_tasa_2>V</tipo_tasa_2>
    <tasa_interes_2></tasa_interes_2>
    <codigo_tasa_referencial_extendido_2>IBRON</codigo_tasa_referencial_extendido_2>
    <spread_tasa_2></spread_tasa_2>
    <base_dias_2>M</base_dias_2>
    <periodo_interes_2>MENSUAL</periodo_interes_2>
    <monto_transado>500000000.00</monto_transado>
    <moneda_monto>COP</moneda_monto>
    <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
    <descripcion_opcionalidad></descripcion_opcionalidad>
    <tasa_referencial></tasa_referencial>
    <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
    <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
    <periodo_interes>MENSUAL</periodo_interes>
    <comentario>Operación IRS</comentario>
    <cumplimiento>NON-DELIVERY</cumplimiento>
    <precio_ejercicio>3212.0000</precio_ejercicio>
    <sistema_origen>X</sistema_origen>
    <texto_origen>O</texto_origen>
    <sistema_negociacion>I</sistema_negociacion>
    <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
    <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
    <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
  </transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	Revisado por: Gerente de TI Fecha: 14/01/2021	Aprobado por: Gerencia Comercial Fecha: 16/02/2018
--	--	---

	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
	IMPORTACIÓN XML	Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
		Versión: 04
		Página: 34 / 40

Registros Derivados - IRS/CCS - Detalle de transacción

Fecha: 11/02/2022 Código: O2C3CHI9W Hora de registro: 10:24:50 Hora: 10:10:00

Comprador - Nombre comitente Clase ID Identificación Vigilado
Administradora de Fondos de Pensiones y C Nit 800.138.188-1 TRM

Beneficiario Por parte de:
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH Empresas del exterior 045

Vendedor Sucursal Persona
BANCOLOMBIA S.A. BOGOTA Janet Patricia Aguilera Roldan

Par de monedas: COP / COP IRS Tercero Offshore Cod. importación: 009

Inicio primer flujo: T + 0 11-Feb-2022 Calendario: CO

Plazo: 2328 Dias 27-Jun-2028 Vencimiento sin ajustar: 27-Jun-2028

Fecha de pago: 27-Jun-2028 Segundo monto: 500'000,000.00 COP

Monto COP: 500'000,000.00 Modify following business: SI

Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: F 23.259800% ACT/360 Mensual

Tasa de interés COP: V IBRON + ACT/360 Mensual

Cumplimiento: NON-DELIVERY Opcionalidad: NO

Tasa cambio: Tasa pool: 0.0000 P. Rotos/ Amortizaciones

Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por JANET


Comentario: Operación IRS

Estado CRCC:

Fecha anterior

5.8. CCS

Elaborado por: Administrador sistema SET FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Gerencia Comercial
Fecha: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018


	MANUAL DE USUARIO	Código: IGO020204
		Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 35 / 40

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>011</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>IRS/CCS</sub_mercado>
  <operacion>VENTA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-11</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>10:02:45</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-15</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2037-02-17</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2037-02-17</fecha_pago>
  <tipo_registro>C</tipo_registro>
  <inicio_primer_flujo>2</inicio_primer_flujo>
  <calendario>CO-NY</calendario>
  <vencimiento_sin_ajustar></vencimiento_sin_ajustar>
  <modifiy_following_business>S</modifiy_following_business>
  <segundo_monto></segundo_monto>
  <tipo_amortizacion>BULLET</tipo_amortizacion>
  <tipo_tasa_1>V</tipo_tasa_1>
  <tasa_interes>2.0000</tasa_interes>
  <base_dias_1>M</base_dias_1>
  <codigo_tasa_referencial_extendido>LBR6M</codigo_tasa_referencial_extendido>
  <spread_tasa>2.00</spread_tasa>
  <tipo_tasa_2>V</tipo_tasa_2>
  <tasa_interes_2></tasa_interes_2>
  <codigo_tasa_referencial_extendido_2>IBRON</codigo_tasa_referencial_extendido_2>
  <spread_tasa_2></spread_tasa_2>
  <base_dias_2>M</base_dias_2>
  <periodo_interes_2>TRIMESTRAL</periodo_interes_2>
  <precio>3956.4500</precio>
  <monto_transado>500000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <descripcion_opcionalidad></descripcion_opcionalidad>
  <tasa_referencial></tasa_referencial>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <periodo_interes>SEMESTRAL</periodo_interes>
  <comentario>Operación CCS</comentario>
  <cumplimiento>NON-DELIVERY</cumplimiento>
  <precio_ejercicio>3212.0000</precio_ejercicio>
  <origen_sistema>X</origen_sistema>
  <texto_origen>O</texto_origen>
  <origen_negociacion>I</origen_negociacion>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
  <tasa_pool>452.3300</tasa_pool>
</transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 36 / 40

Registros Derivados - IRS/CCS - Detalle de transacción

Fecha: 11/02/2022 Código: O2C3CHIA7 Hora de registro: 10:52:53 Hora: 10:02:45

Comprador - Nombre comitente Clase ID Identificación Vigilado
Administradora de Fondos de Pensiones y C Nit 800.138.188-1 TRM

Beneficiario Por parte de:
CITIBANK N.A. LONDON BRANCH Empresas del exterior 045

Vendedor Sucursal Persona
BANCOLOMBIA S.A. BOGOTA Janet Patricia Aguilera Roldan

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP CCS Tercero Offshore Cod. importación: 011

Inicio primer flujo: T + 2 15-Feb-2022 Calendario: CO-NY

Plazo: 15 Años 17-Feb-2037 Vencimiento sin ajustar: 17-Feb-2037

Fecha de pago: 17-Feb-2037 Monto COP: 1,978'225,000.00

Monto USD: 500,000.00 Modify following business: SI

Tipo: BULLET

Tasa de interés USD: V LBR6M + 2.0000 ACT/360 Semestral

Tasa de interés COP: V IBRON + ACT/360 Trimestral

Cumplimiento: NON-DELIVERY Opcionalidad: NO

Tasa cambio: 3956.4500 Tasa pool: 452.3300

Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por JANET

Comentario: Operación CCS

Estado CRCC:


Fecha anterior

6. MODIFICACIÓN AUTOMÁTICA VÍA XML

Para realizar el proceso de modificación de operaciones vía XML el afiliado debe tener en cuenta las siguientes consideraciones:

- La modificación automática de operaciones vía XML únicamente aplica para operaciones IMC-Cliente.
- No podrán ser modificadas operaciones que se encuentren compensadas por la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) o que hayan iniciado el proceso de compensación.
- En caso de que la operación haya sido enviada a la CRCC, el afiliado deberá realizar el proceso respectivo de "desmarque" de la operación ante CRCC.
- Las operaciones de derivados que hayan dado cumplimiento no podrán ser modificadas.
- Las operaciones de contado no podrán ser modificadas al siguiente día de su registro.
- Una operación importada por XML puede ser modificada por este mismo mecanismo y por FrontEnd.
- Las operaciones registradas por FrontEnd no pueden ser modificadas por XML.

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 37 / 40

- El afiliado debe colocar la letra “M” en el TAG <Tipo de operación>, el cual indica que se trata de una modificación.

Para poder realizar la modificación de operaciones, en el archivo XML debe incluir los TAG <tipo_operacion> </tipo_operacion> con la letra “M”, <id></id> (numero ID que identifica a la operación), <fecha_transaccion></fecha_transaccion> (fecha actual). En el caso de operaciones de derivados de días anteriores deben utilizar los siguientes TAG; <tipo_operacion> </tipo_operacion> letra “M” (modificación), <id></id> (numero ID que identifica a la operación), <fecha_transaccion></fecha_transaccion> (fecha de realizado el registro).

Ejemplo:

Operación inicial registrada el día 10/02/2022


```

<transacciones>
<transaccion>
  <id>008</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>OPCIONES</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <codigo_especial_fiduciario></codigo_especial_fiduciario>
  <fecha_transaccion>2022-02-10</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>08:30:00</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-10</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2025-03-24</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2025-03-26</fecha_pago>
  <precio>4562.3200</precio>
  <monto_transado>50000000.00</monto_transado>
  <clase_opcion>PUT</clase_opcion>

```

Modificación realizada el día 13/02/2022:

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04 Página: 38 / 40

```

<transacciones>
<transaccion>
  <id>008</id>
  <tipo_operacion>M</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>OPCIONES</sub_mercado>
  <operacion>VENTA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <codigo_especial_fiduciario></codigo_especial_fiduciario>
  <fecha_transaccion>2022-02-10</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>08:30:00</hora_transaccion>
  <fecha_inicio_contrato>2022-02-10</fecha_inicio_contrato>
  <fecha_fin_contrato>2025-03-24</fecha_fin_contrato>
  <fecha_pago>2025-03-26</fecha_pago>
  <precio>4562.3200</precio>
  <monto_transado>50000000.00</monto_transado>
  <clase_opcion>PUT</clase_opcion>

```

7. ANULACIÓN DE OPERACIONES


La anulación de operaciones deberá realizarse, de conformidad a lo establecido por la normatividad del Banco de la República en la circular DODM-317 y que actualmente establece máximo quince (15) minutos posterior a la hora del registro.

El proceso de anulación de operaciones por medio de la importación XML, se podrá realizar enviando los TAG **<tipo_operacion> </tipo_operacion>** letra "A" (anulación), **<id></id>** (numero ID que identifica a la operación), **<fecha_transaccion></fecha_transaccion>** (fecha actual del registro).

Ejemplo:

Registro ingresado

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 39 / 40

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>001</id>
  <tipo_operacion>I</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>SPOT</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-14</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>08:00:00</hora_transaccion>
  <precio>4202.0500</precio>
  <monto_transado>500000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <comentario>Submercado Spot</comentario>
  <origen_sistema>X</origen_sistema>
  <texto_origen>O</texto_origen>
  <origen_negociacion>I</origen_negociacion>
  <tasa_pool>4232.0000</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>

```


Anulación

```

<?xml version="1.0" encoding="Windows-1252"?>
<transacciones>
<transaccion>
  <id>001</id>
  <tipo_operacion>A</tipo_operacion>
  <mercado>174</mercado>
  <origen>CLIENTES</origen>
  <sub_mercado>SPOT</sub_mercado>
  <operacion>COMPRA</operacion>
  <id_usuario>88787115</id_usuario>
  <fecha_transaccion>2022-02-14</fecha_transaccion>
  <hora_transaccion>08:00:00</hora_transaccion>
  <precio>4202.0500</precio>
  <monto_transado>500000.00</monto_transado>
  <moneda_monto>USD</moneda_monto>
  <moneda_contraparte>COP</moneda_contraparte>
  <tipo_identificacion>N</tipo_identificacion>
  <identificacion_contraparte>8001381881</identificacion_contraparte>
  <comentario>Submercado Spot</comentario>
  <origen_sistema>X</origen_sistema>
  <texto_origen>O</texto_origen>
  <origen_negociacion>I</origen_negociacion>
  <tasa_pool>4232.0000</tasa_pool>
  <clase_id_comitente_contraparte>X</clase_id_comitente_contraparte>
  <id_comitente_contraparte>045</id_comitente_contraparte>
  <bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>
</transaccion>
</transacciones>

```

Elaborado por: Administrador sistema SET FX Fecha: 14/02/2022	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
	IMPORTACIÓN XML	Versión: 04
		Página: 40 / 40

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: 14/02/2022	Fecha: 14/01/2021	Fecha: 16/02/2018