


MERCADO DÓLAR NEXT DAY

Manual de usuario




| | | |
|---|-------------------------------|--|
|  | MANUAL DE USUARIO | Código: IGO020204 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 2 / 98 |

Contenido


| | |
|---|----|
| OBJETIVO | 4 |
| 1. GENERALIDADES DEL MERCADO DÓLAR NEXT DAY | 5 |
| 2. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO NEXT DAY | 6 |
| 2.1. FUNCIONES DE NEGOCIACIÓN | 7 |
| 2.2. ADMINISTRADOR DE POSTURAS..... | 22 |
| 2.2.1. Descripción De La Ventana “dólar Next Day Administración De Posturas” | 23 |
| 2.2.2. Barra De Modificación Rápida | 25 |
| 2.2.3. Descripción de Columnas en la ventana: “dólar Next Day – Administración De Posturas” | 26 |
| 2.2.4. Ingresar Una Nota..... | 27 |
| 2.3. ÓRDENES MERCADO NEXT DAY | 28 |
| 2.3.1. Descripción Ventana “dólar Next Day – Ordenes” | 29 |
| 2.3.2. Ingreso De Una Orden De Compra/Venta..... | 30 |
| 2.3.3. Notificaciones Blotter De Mensajes..... | 32 |
| 2.4. REGISTRO DE TRANSACCIONES..... | 32 |
| 2.4.1. Creación de Empleados..... | 35 |
| 2.4.2. Envío de Registros..... | 36 |
| 2.5. STOP LOSS..... | 39 |
| 2.5.1. Estados Ventana Stop Loss..... | 41 |
| 2.6. FIXING (MATCHING) | 44 |
| 2.7. CUPOS..... | 49 |
| 2.7.1. Cupos Bilaterales | 51 |
| 2.8. PRECIOS/MONTOS DE TRANSACCIONES PROPIAS | 60 |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 3 / 98 |

| | | |
|-----------|--|-----------|
| 2.9. | TRANSACCIONES Y POSICIÓN..... | 66 |
| 2.9.1. | Compras | 66 |
| 2.9.2. | Ventas | 68 |
| 2.10. | GRÁFICOS Y PRECIOS | 70 |
| 2.10.1. | Gráfico De Precios De Transacciones Cerradas Hoy | 70 |
| 2.10.2. | Gráficos De Precios De Mejor Demanda/Oferata De Hoy | 71 |
| 2.10.3. | Gráficos De Resúmenes Por Día | 72 |
| 2.10.4. | Gráfico De Resúmenes Por Intervalo | 73 |
| 2.10.5. | Precios/Montos Transacciones De Hoy | 75 |
| 2.10.6. | Historia De Precios/Montos De Transacciones | 78 |
| 2.10.7. | Precios De Mejor Demanda/Oferata De Hoy | 79 |
| 2.10.8. | Historia De Precios Mejor Demanda/Oferata | 80 |
| 2.11. | RESUMEN DE PRECIOS/MONTOS TRANSADOS HOY | 81 |
| 2.11.1. | Resumen De Hoy..... | 81 |
| 2.12. | CONSULTAS | 83 |
| 2.13. | Configuración Del Mercado | 84 |
| 3. | VENTANA DÓLAR NEXT DAY | 87 |
| 4. | BARRIDOS NETOS | 88 |
| 5. | BARRA DE MODIFICACIÓN RÁPIDA..... | 93 |
| 6. | PROCEDIMIENTO PARA LA MODIFICACIÓN DE OPERACIONES | 94 |
| 7. | ANULACIÓN DE OPERACIONES | 96 |
| 8. | INFORMACIÓN ADICIONAL..... | 98 |


| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 4 / 98 |

OBJETIVO

Este manual tiene como objetivo explicar detalladamente el funcionamiento del Mercado dólar Next Day en el Sistema SET-FX, los procesos que se llevan a cabo para realizar operaciones durante la jornada de negociación del mercado Next Day 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 5 / 98 |


1. GENERALIDADES DEL MERCADO DÓLAR NEXT DAY

A continuación, se enuncian las generalidades sobre el funcionamiento del mercado dólar Next Day del sistema SET-FX.

En los siguientes capítulos se presenta detalladamente el funcionamiento de cada una de las herramientas de este mercado.


- Las operaciones de Next Day t+1 que se celebren o registren, automáticamente asumirán como plazo para su cumplimiento el día siguiente a la fecha de ingreso de la operación (de hoy para mañana). En caso de que este día no sea hábil se trasladará al día hábil siguiente, a menos. En el caso de las operaciones t+2 y t+3 asumirán para su cumplimiento el segundo, o tercer día hábil respectivamente, desde la fecha de ingreso de la operación.
- Negociación Next Day: será ciega, estará sujeta al Cupo Cámara y su compensación siempre se realizará a través de una Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
- 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 Next Day, 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, el retiro de la misma por parte del Afiliado o el retiro automático por parte del sistema en caso de que no haya cupo de cámara suficiente. 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 Next Day, 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.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 6 / 98 |

- 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.
- Los montos máximos y mínimos para el ingreso de posturas en el sistema serán definidos por el administrador del sistema a través de circular.
- 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.

2. BARRA HERRAMIENTAS MERCADO NEXT DAY

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 Next Day”, de acuerdo a la imagen:

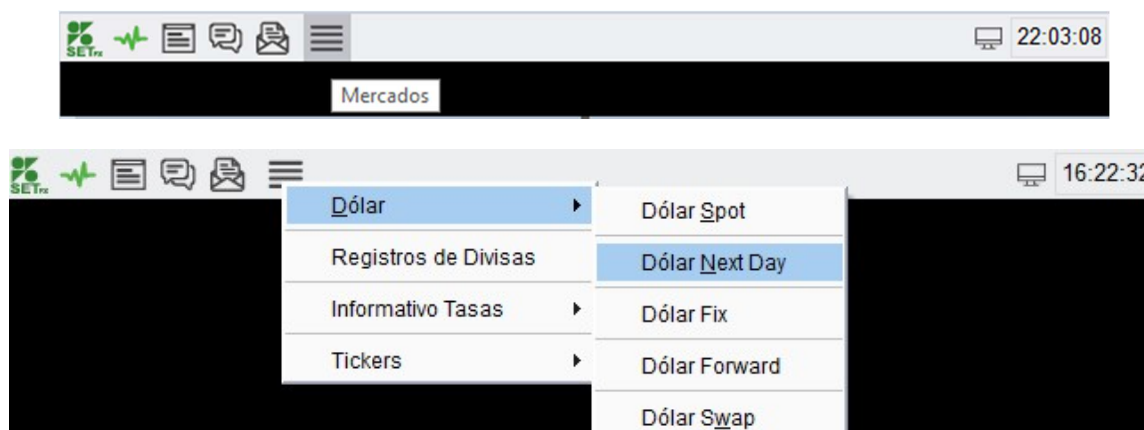



Ilustración 1- Ingresar al mercado Next Day



| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 7 / 98 |

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.

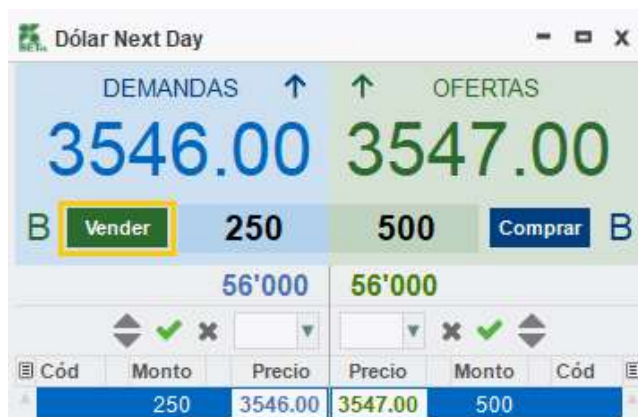
Realizar una venta

Una venta en el mercado Next Day 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.




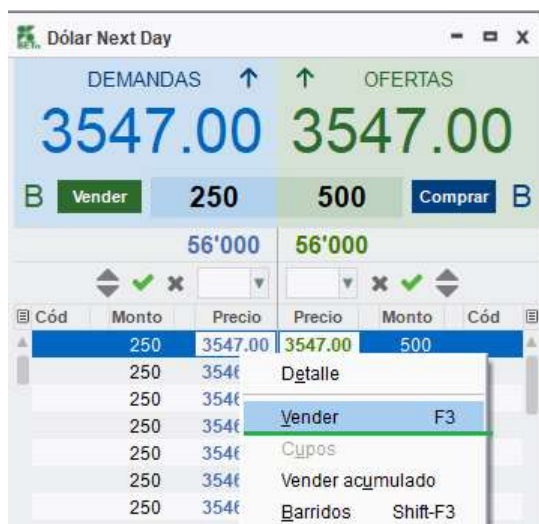
- Seleccionando la postura de demanda y oprimiendo la tecla F3.
- Seleccionar la postura de demanda y haciendo clic sobre el botón “Vender” de la pantalla demandas/ ofertas



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

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 8 / 98 |



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.

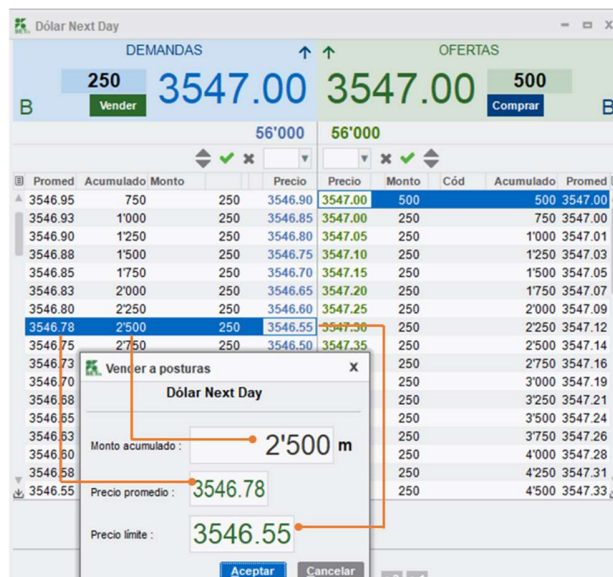




Ilustración 2- Ejemplo vender acumulado

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 9 / 98 |

Realizar una compra

Una compra en el mercado Next Day 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.




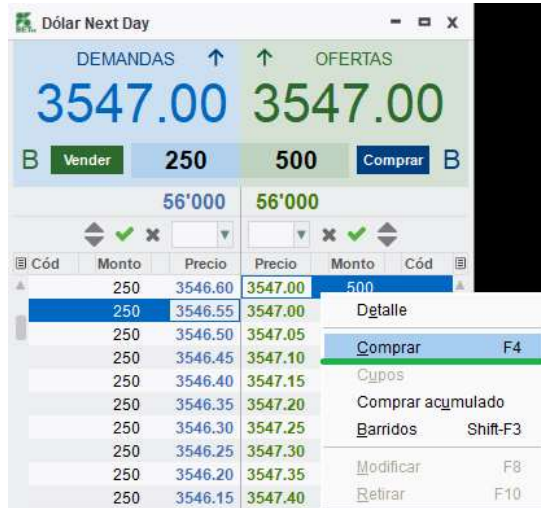
- Seleccionando la postura de oferta y oprimiendo la tecla F4 en la postura seleccionada
- Seleccionando la postura de oferta y haciendo clic sobre el botón “Comprar”



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

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 10 / 98 |



Las acciones descritas se ejecutan sobre la mejor postura disponible en el mercado.

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

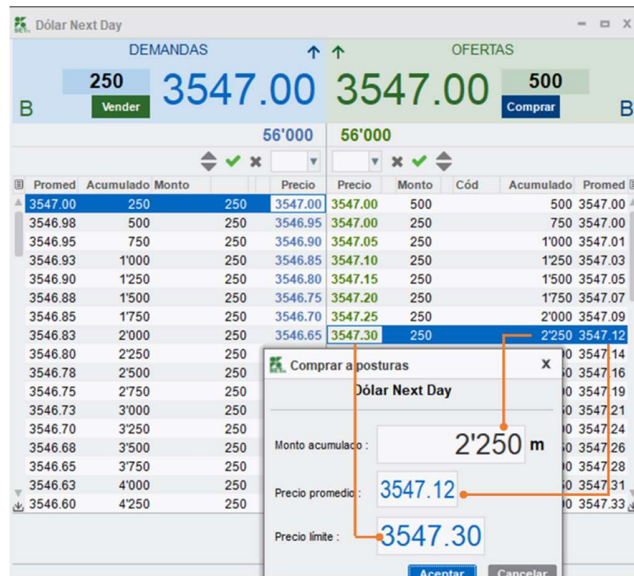



Ilustración 3-Ejemplo compra acumulado

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 11 / 98 |

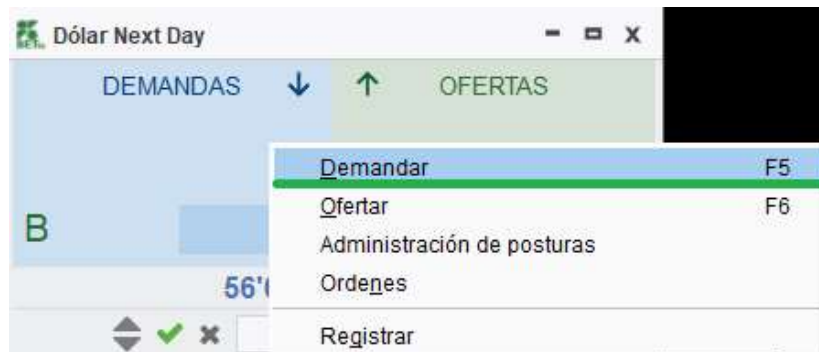
Ingreso de una Demanda

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

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




- Oprimiendo la tecla F5
- Desde la ventana “dólar Next Day”, 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 nueva postura de 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 12 / 98 |

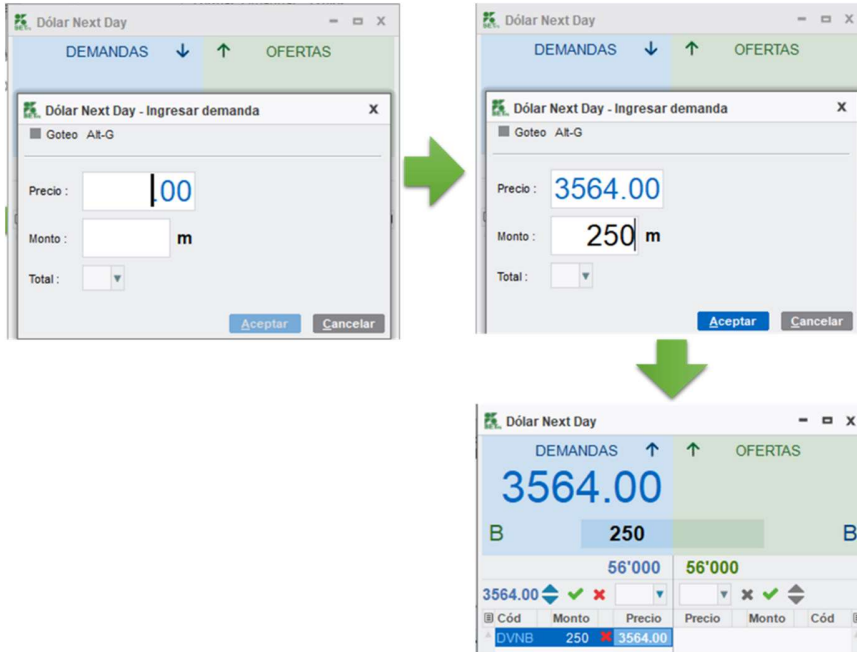


Ilustración 4- Ingresar demanda

Ingreso de una Oferta


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

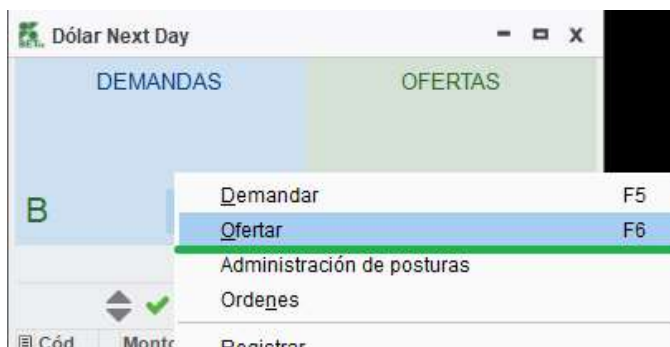
- Haciendo clic sobre el botón “Ofertar”  ubicado en la barra principal del Sistema SET-FX



- Oprimiendo la tecla F6
- Desde la ventana “dólar Next Day”, dando clic derecho y seleccionando la opción “Ofertar”

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 13 / 98 |



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

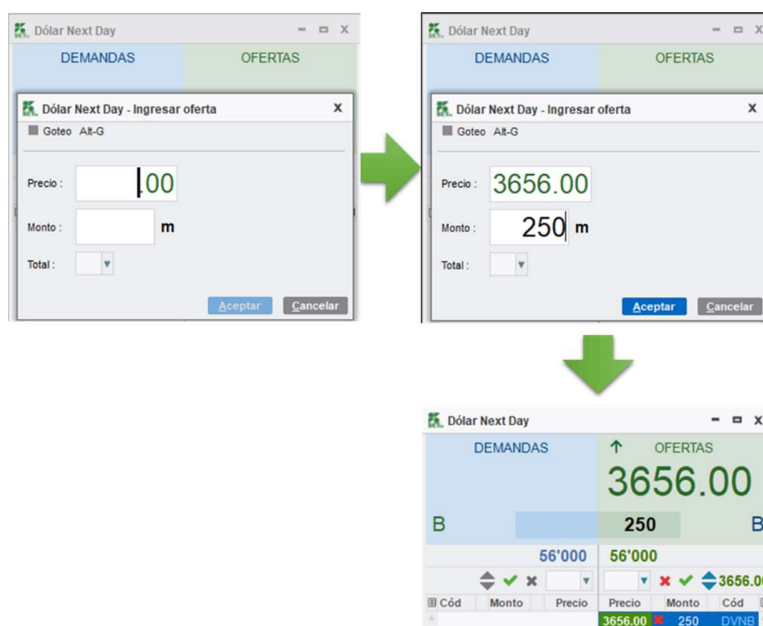



Ilustración 5- Ingresar oferta

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 14 / 98 |

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.

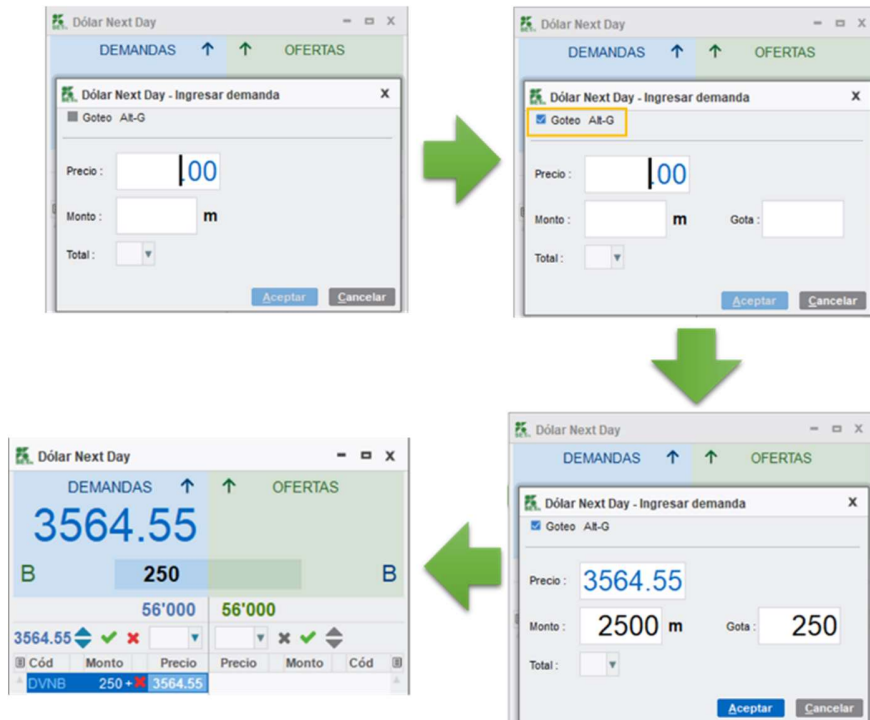



Ilustración 6- Ingresar demanda con goteo

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 15 / 98 |

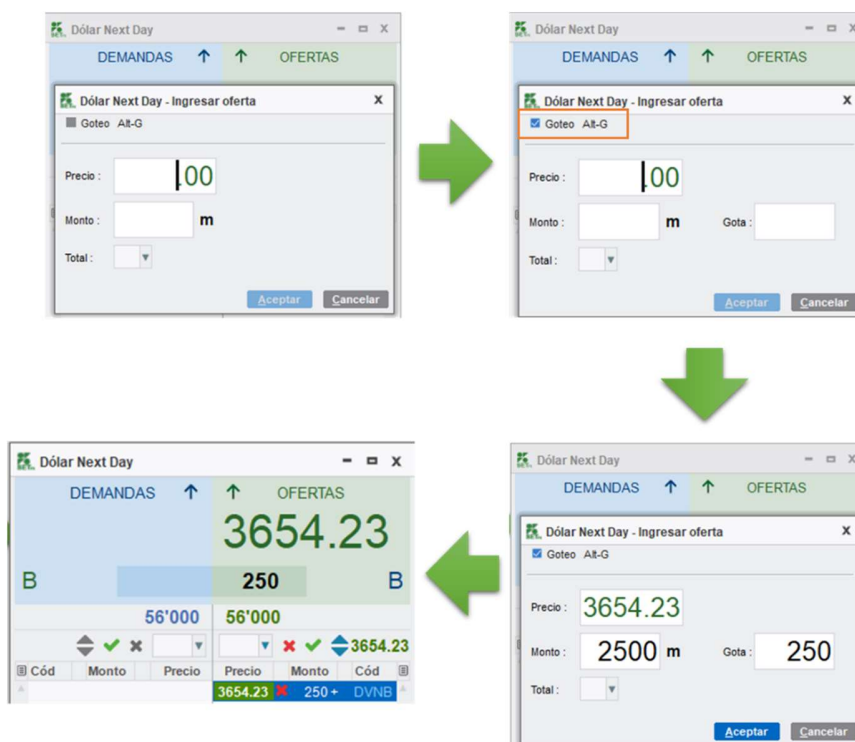



Ilustración 7- ingresar oferta con goteo

Las siguientes son 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 goteo), 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 goteo, 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 goteo, luego ejecuta las demás posturas visibles en el mismo nivel de precio y posteriormente continúa con las siguientes gotas ocultas antes de pasar a agredir los siguientes 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 16 / 98 |


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

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 de cámara (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 Next Day 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 17 / 98 |

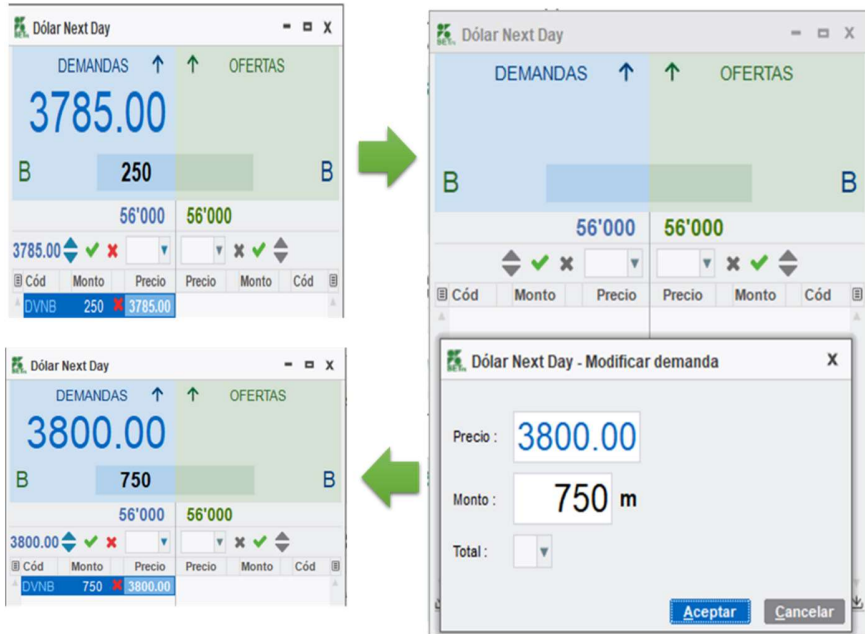



Ilustración 8- Modificar demanda

Modificación de una Oferta


Para modificar una oferta del mercado Next Day 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"

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 18 / 98 |

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.

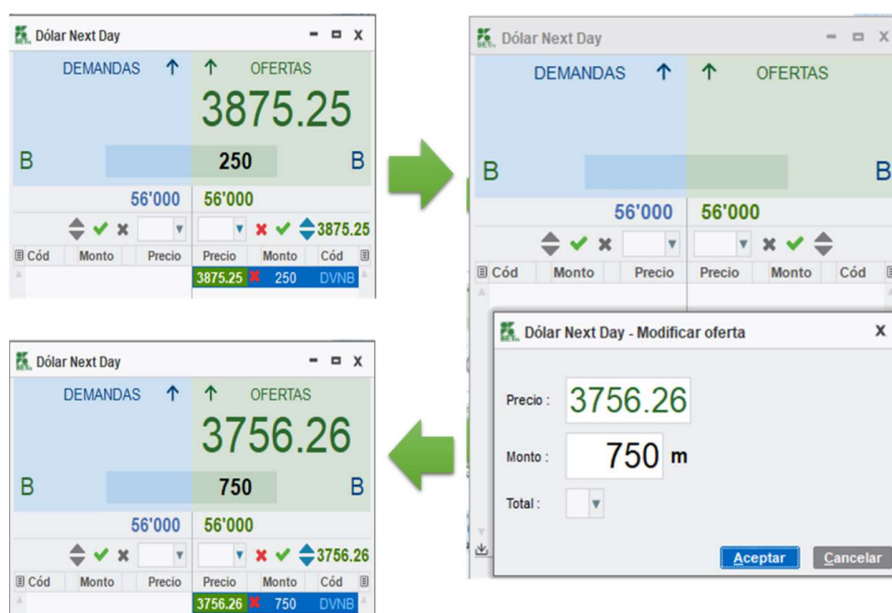



Ilustración 9- Modificar oferta

Retiro de una Demanda


Para retirar una demanda del mercado Next Day 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

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 19 / 98 |

- Seleccionando la demanda a retirar y dando Clic sobre la “X” que se antepone al precio

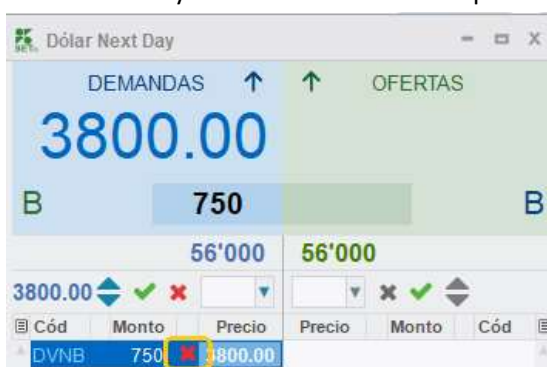


Ilustración 10- Retirar demanda

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

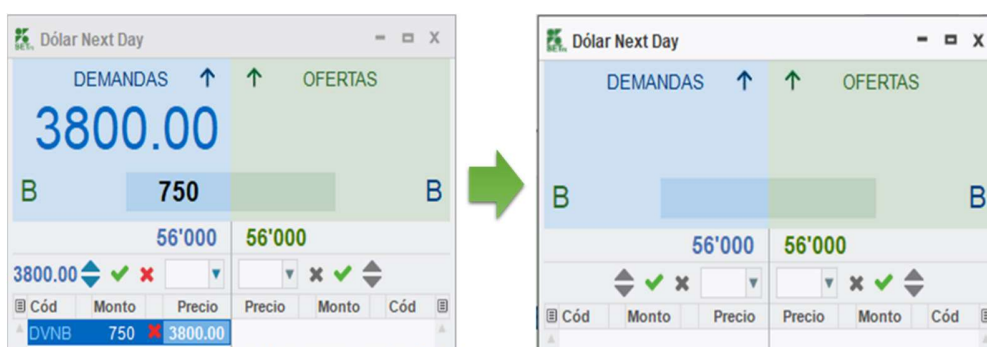



Ilustración 11- Retirar demanda


Retiro de una Oferta

Para retirar una oferta del mercado Next Day 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.



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 Página: 20 / 98 |

- 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.

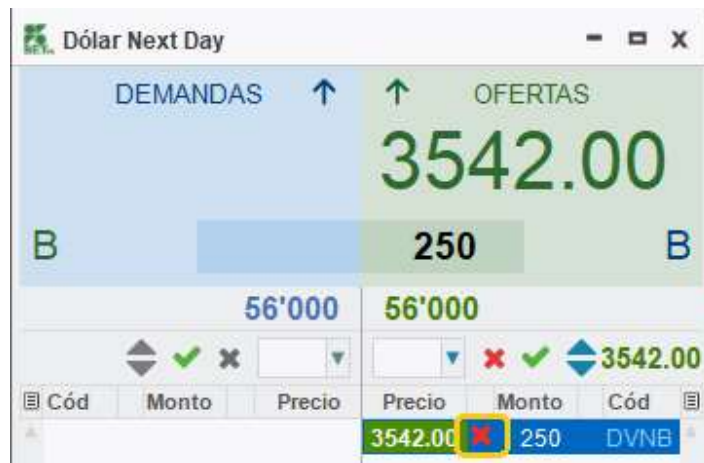


Ilustración 12- Retirar oferta

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

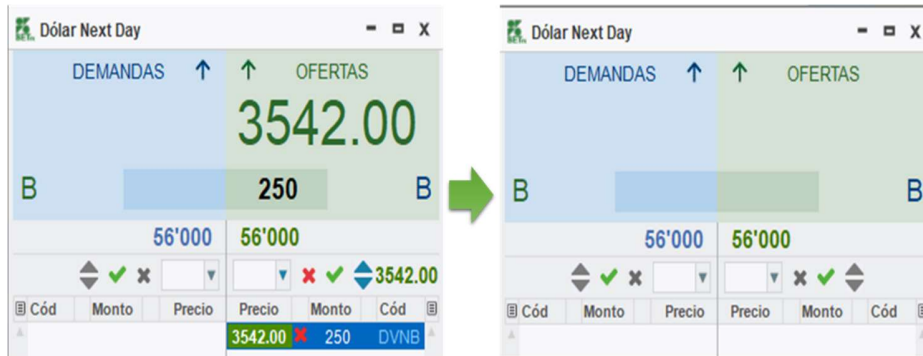




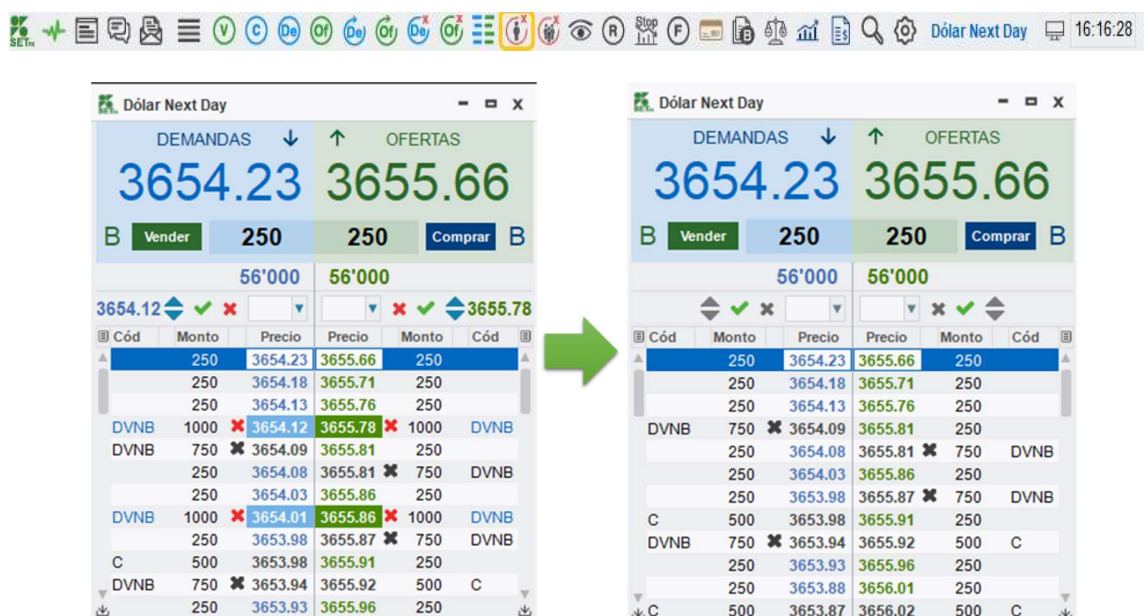
Ilustración 13- Retirar oferta

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 21 / 98 |

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.



La imagen muestra una barra de herramientas del sistema SET-FX con un botón de retiro de todas las posturas (un ícono de una persona con una X roja). Debajo se muestran dos capturas de pantalla de la interfaz de usuario. La primera captura muestra un botón de retiro desactivado (gris) y una lista de posturas. La segunda captura muestra el mismo botón ahora activado (verde) y la lista de posturas vacía, lo que indica que todas las posturas han sido retiradas exitosamente.

Ilustración 14- Retirar posturas

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 | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 22 / 98 |




Ilustración 15-Retirar posturas

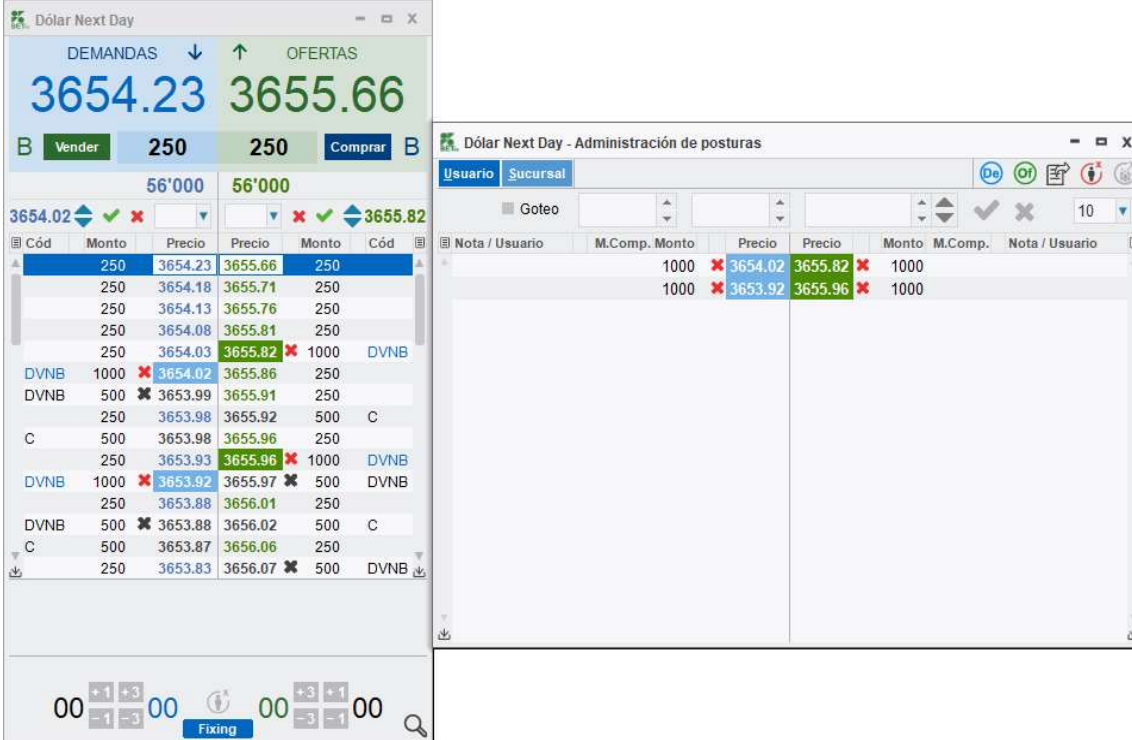
2.2. ADMINISTRADOR DE POSTURAS

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 | 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 23 / 98 |




| Cód | Monto | Precio | Precio | Monto | Cód |
|------|---------|---------|---------|-------|------|
| 250 | 3654.23 | 3655.66 | 250 | | |
| 250 | 3654.18 | 3655.71 | 250 | | |
| 250 | 3654.13 | 3655.76 | 250 | | |
| 250 | 3654.08 | 3655.81 | 250 | | |
| 250 | 3654.03 | 3655.82 | 1000 | DVNB | |
| DVNB | 1000 | 3654.02 | 3655.86 | 250 | |
| DVNB | 500 | 3653.99 | 3655.91 | 250 | |
| 250 | 3653.98 | 3655.92 | 500 | C | |
| C | 500 | 3653.98 | 3655.96 | 250 | |
| 250 | 3653.93 | 3655.96 | 1000 | DVNB | |
| DVNB | 1000 | 3653.92 | 3655.97 | 500 | DVNB |
| 250 | 3653.88 | 3656.01 | 250 | | |
| DVNB | 500 | 3653.88 | 3656.02 | 500 | C |
| C | 500 | 3653.87 | 3656.06 | 250 | |
| 250 | 3653.83 | 3656.07 | 500 | DVNB | |

Ilustración 16- Administrador de posturas

2.2.1. Descripción De La Ventana “dólar Next Day Administración De Posturas”

A continuación, se describe los campos y funciones contenidas en la pantalla “dólar Next Day administración de posturas:

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 24 / 98 |



| Nota / Usuario | M.Comp. | Monto | Precio | Precio | Monto | M.Comp. | Nota / Usuario |
|----------------|---------|---------|---------|---------|-------|---------|----------------|
| | | 1000 | 3654.02 | 3655.82 | 1000 | | |
| ALFONSO | 500 | 3653.99 | 3655.96 | 1000 | | | |
| | | 1000 | 3653.92 | 3655.97 | 500 | | ALFONSO |
| ALFONSO | 500 | 3653.8 | 3656.07 | 500 | | | ALFONSO |

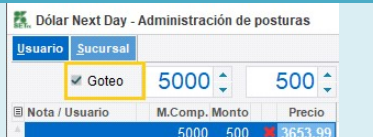
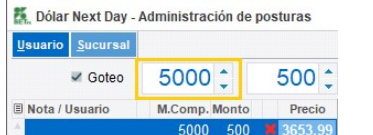
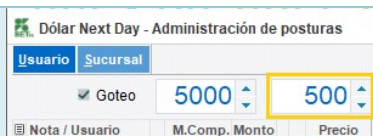
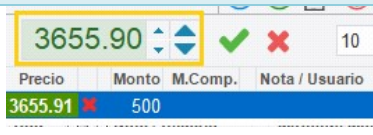
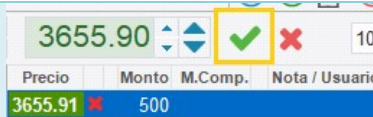
| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|---|--|
| 1 | Visualizar posturas del usuario | Filtro de visualización de posturas (mis posturas) |
| 2 | Visualizar posturas de la sucursal | Filtro de visualización de posturas (mis posturas y las de mi sucursal) |
| 3 | Ingresar Demanda | Permite el ingreso de posturas las cuales se verán reflejadas en la ventana de "dólar Next Day" |
| 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 |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 25 / 98 |

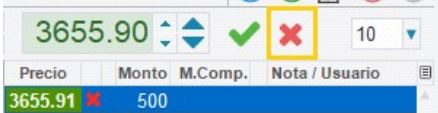
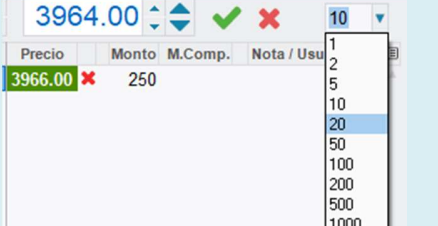
2.2.2. Barra De Modificación Rápida



| 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. |
| 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. |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 26 / 98 |

| | | | |
|---|---|-------------------------|---|
| 6 |  | Retira postura | Retira las posturas seleccionadas |
| 7 |  | Valores preestablecidos | Cantidad en centavos que permite la modificación del precio de la postura |


2.2.3. Descripción de Columnas en la ventana: “dólar Next Day – Administración De Posturas”



| Nota / Usuario | M.Comp. | Monto | Precio | Precio | Monto | M.Comp. | Nota / Usuario |
|----------------|---------|-------|---------|---------|-------|---------|----------------|
| ALFONSO | 500 | 500 | 3653.99 | 3655.91 | 500 | | |
| Cliente A | 5000 | 500 | 3653.99 | 3655.97 | 500 | | ALFONSO |
| ALFONSO | 500 | 500 | 3653.88 | 3656.07 | 500 | | ALFONSO |

| 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. |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 27 / 98 |

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.

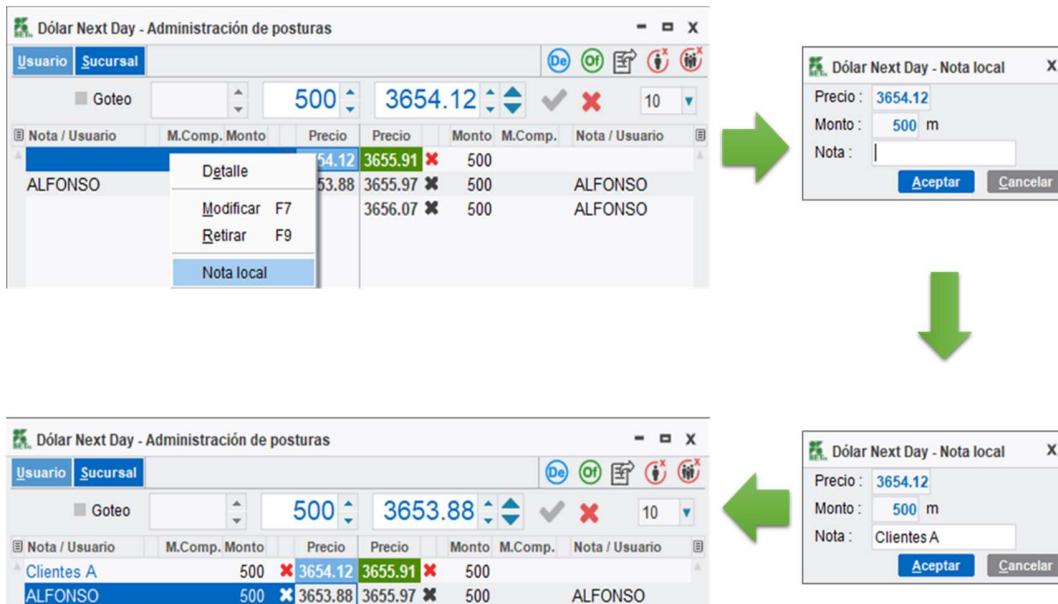



Ilustración 17- Ingresar nota en posturas

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


| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 28 / 98 |

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 NEXT DAY



Para ingresar una orden en el mercado Next Day 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 Next Day – Ordenes” 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 “Ordenes.” Sobre el menú que se despliega.

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



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 29 / 98 |




Ilustración 18 - Ventana de ordenes

2.3.1. Descripción Ventana “dólar Next Day – Ordenes”

A continuación, se describen los botones y funciones de la pantalla “dólar Next Day – Ordenes”



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 30 / 98 |


| 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 Next Day – Ordenes” dar clic en botón “Ingresar”
- Luego Seleccionar si es “Orden de compra” u “Orden de venta”
- Ingresar datos de la orden
- Y finalmente 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 31 / 98 |

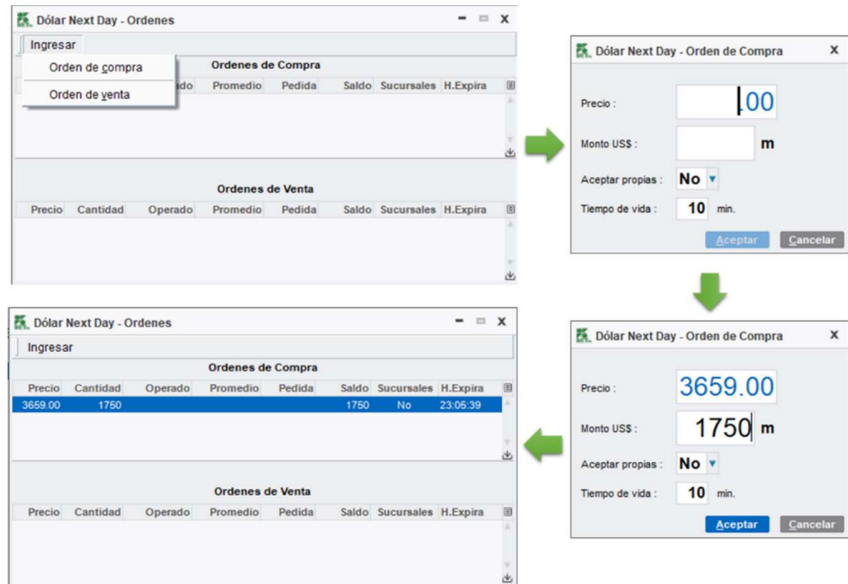




Ilustración 19 - Ingresar una orden

Al activar una orden, en la ventana “dólar Next Day” 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 Next Day”.



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 32 / 98 |

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”.

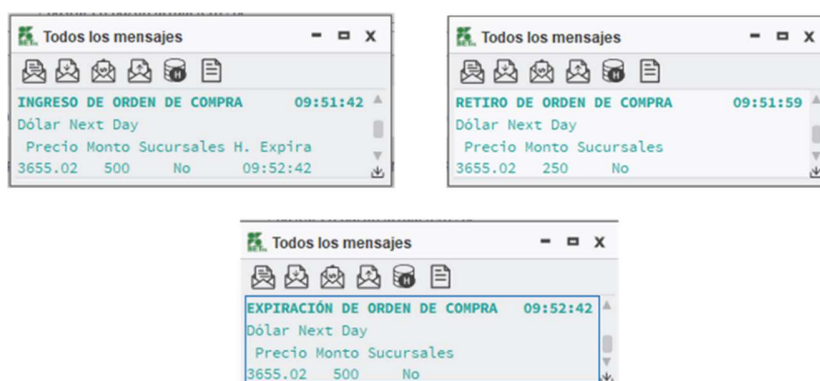


Ilustración 20 - Ingreso, retiro, expirar ordenes

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.



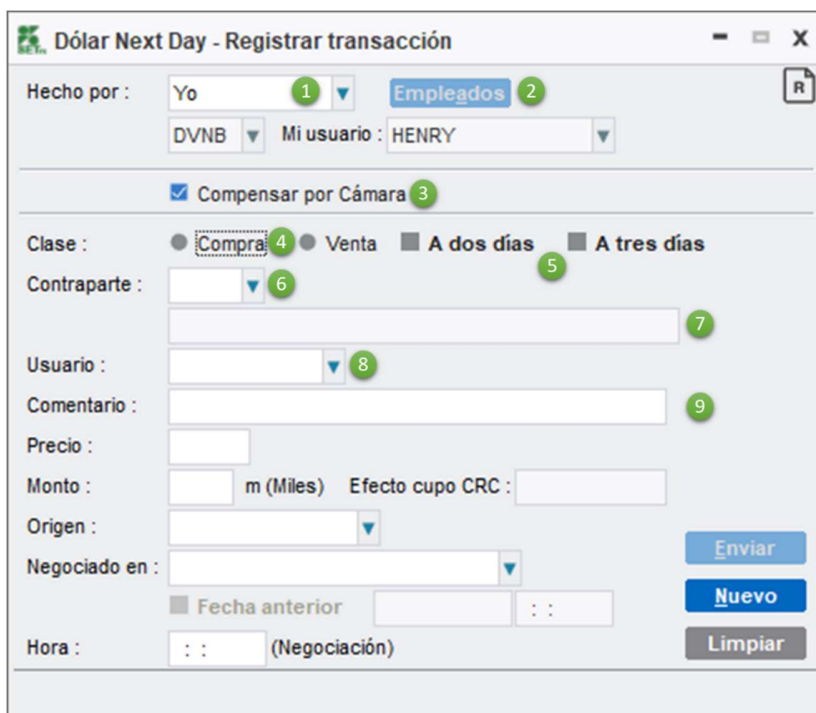
- Las entidades que sólo permitan registros por cámara, únicamente pueden registrar operaciones si existe cupo Cámara suficiente.
- Las entidades que permitan registros sin compensación, deben crear en el sistema cupos bilaterales con las contrapartes y el sistema solo permitirá registros si existe cupo bilateral suficiente con dicha contraparte.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 33 / 98 |


- 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”

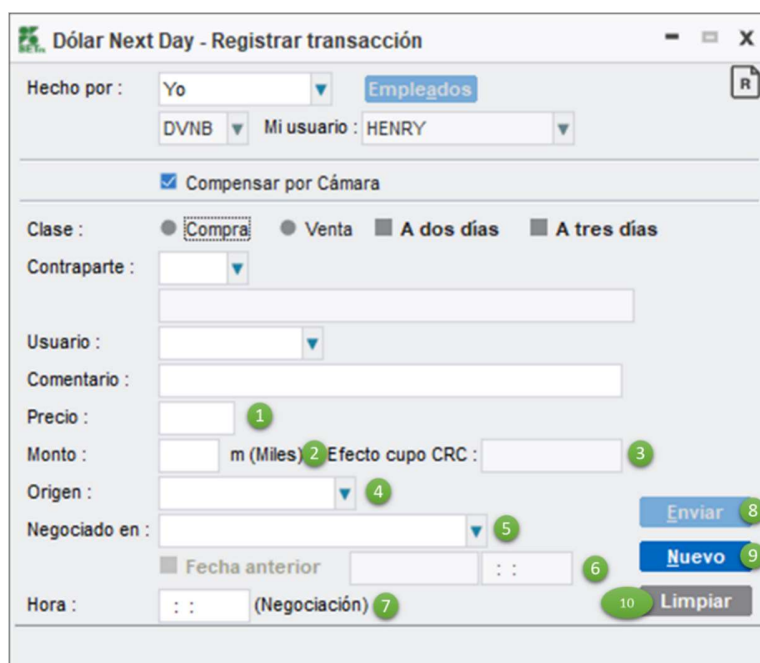


| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|-----------|--|
| 1 | Hecho por | El usuario puede realizar registros a nombre propio, a nombre de un usuario de la misma entidad que se encuentre vinculado en el sistema SET-FX o a nombre de un funcionario de la entidad y que no tenga un usuario registrado en el sistema SET-FX. Al desplegar el listado se dan estas 3 opciones: |


| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 34 / 98 |

| | | |
|---|---------------------------------|---|
| | | <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 | Plazo | Permite escoger el plazo del registro Next Day. Si el usuario no marca ninguna de las dos opciones se da por entendido que el registro es a T+1 |
| 6 | Nemotécnico Entidad Contraparte | Nemotécnico de la entidad contraparte. Campo obligatorio |
| 7 | Nombre Entidad Contraparte | Indica el nombre completo de la entidad contraparte, campo no editable. |
| 8 | Usuario | Nombre del usuario contraparte. Campo obligatorio. |
| 9 | Comentario | Permite el ingreso de un comentario, campo opcional. |



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 35 / 98 |

| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|------------------|---|
| 1 | Precio | Precio del registro, campo obligatorio. |
| 2 | Monto | Monto del registro, expresado en miles, campo obligatorio |
| 3 | Efecto cupo CRCC | Visualiza el efecto de consumo de cupos CRCC en base al monto ingresado |
| 4 | Origen | Origen del registro, Next Day, Swap O/N contado, Swap Forward, Swap Futuro. Campo obligatorio. |
| 5 | 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. |
| 6 | 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. |
| 7 | 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. |
| 8 | Enviar | Permite el envío de la solicitud de registro a la contraparte. Se activa en el momento que sean diligenciados todos los campos obligatorios. |
| 9 | Nuevo | Permite realizar un nuevo registro con los datos del anterior registro. |
| 10 | Limpiar | Borra todos los datos ingresados y genera un nuevo registro. |


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 Next Day –Registrar transacción” seleccionar el campo “Hecho por” y desplegar el listado
- Escoger la opción “Otro”

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 36 / 98 |

- Ubicar el botón “Empleados” y hacer clic sobre este botón.
- Se abre una nueva ventana “empleados” y en ella seleccionar la opción “Aumentar”.
- Ingresar la información del empleado a crear
- Dar Clic en el botón “Aceptar”

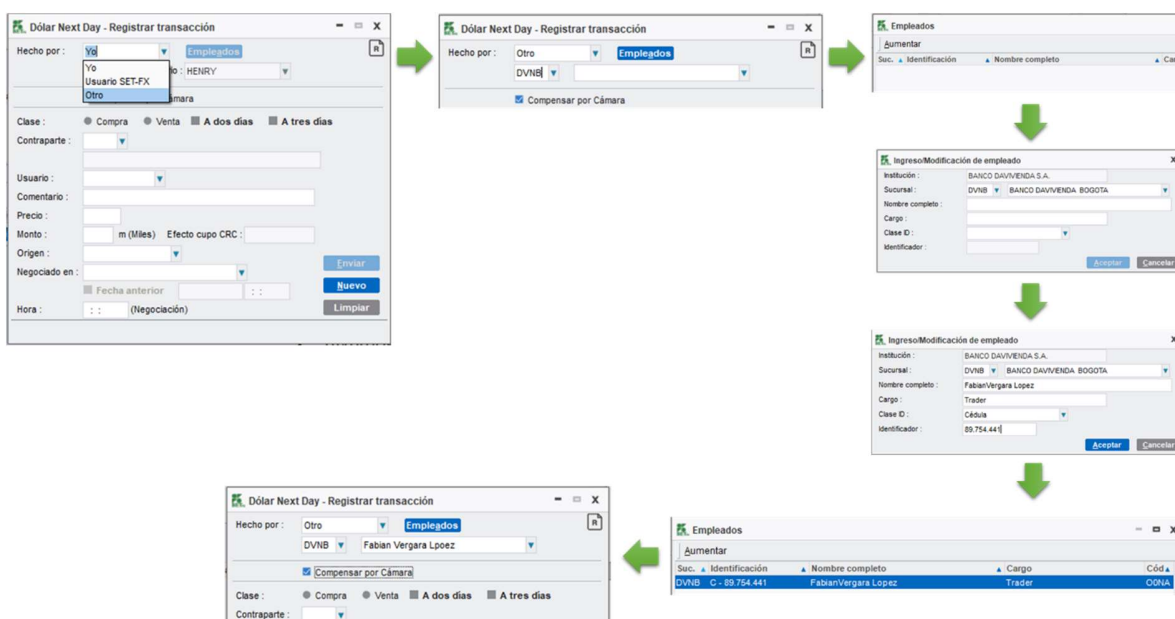


Ilustración 21- Crear un empleado

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 la solicitud.

Para el ejemplo:

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 37 / 98 |

- DVNB HENRY envía una solicitud de registro al usuario BCLB JANET
- BCLB JANET le llega un mensaje de “Solicitud de confirmación” en el blotter de mensajes
- BCLB JANET, al hacer doble clic sobre la solicitud se despliega la ventana “dólar Next Day – Solicitud de registro”
- Clic derecho sobre la solicitud, confirmar registro
- Posterior 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.

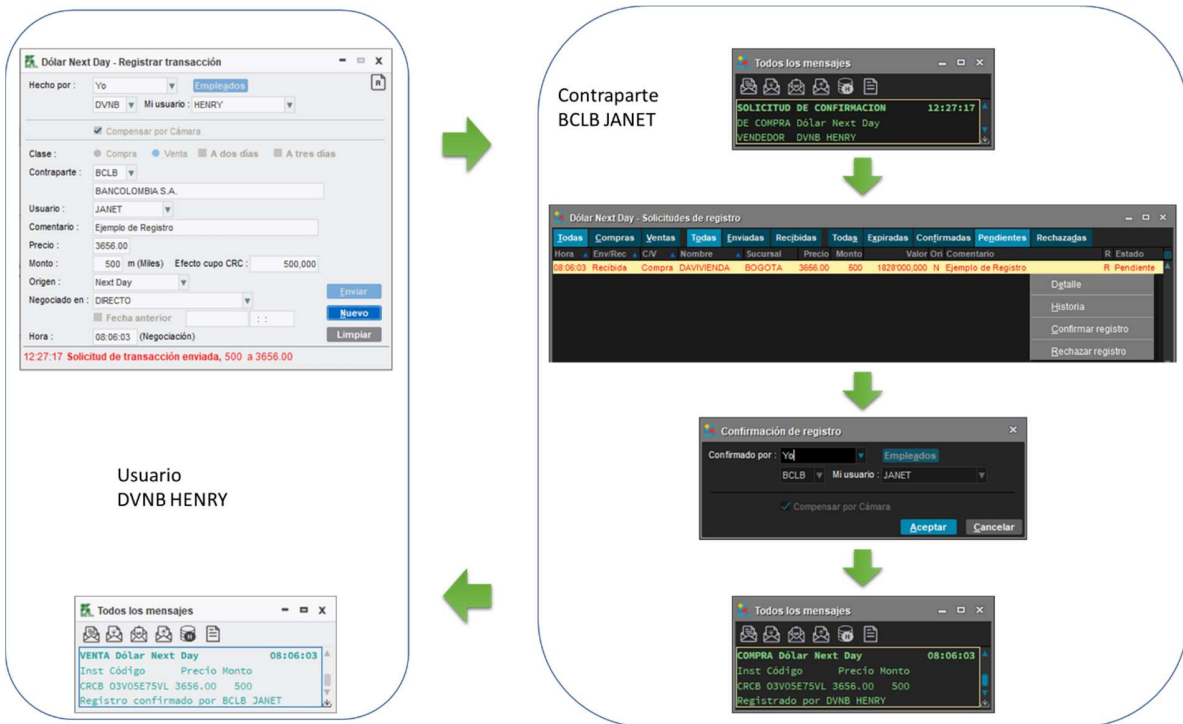



Ilustración 22 - Registrar operación

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 38 / 98 |

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.

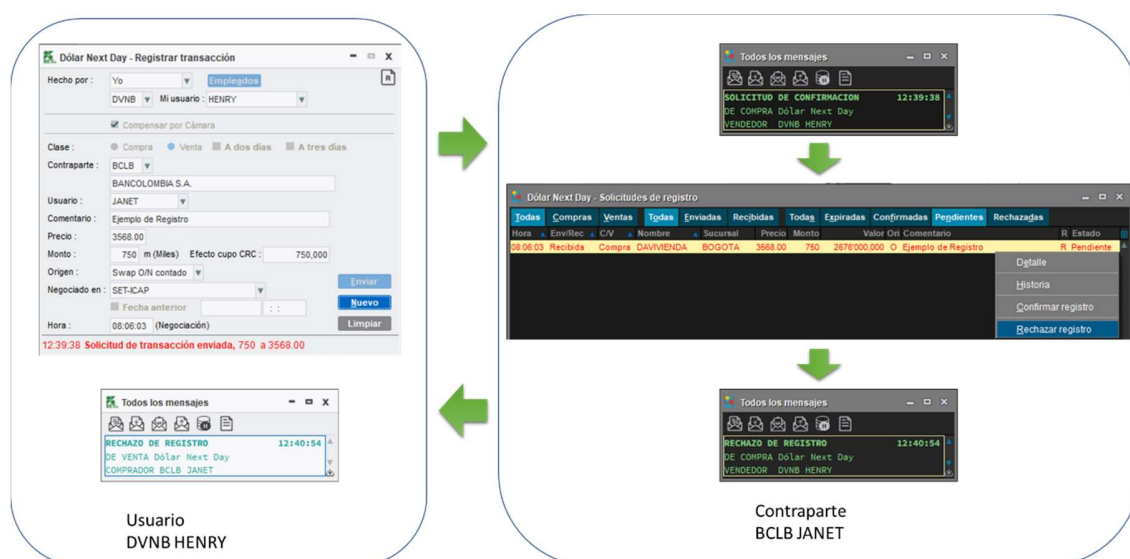



Ilustración 23 - Rechazo solicitud de registro

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 el registro es enviado sin marcar la opción “compensar por cámara” pero la contraparte obliga todos sus registros por cámara entonces el 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”.

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 39 / 98 |

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.

Una vez establecido el Stop Loss este actuara bajo el plazo de T+1 durante su vigencia.


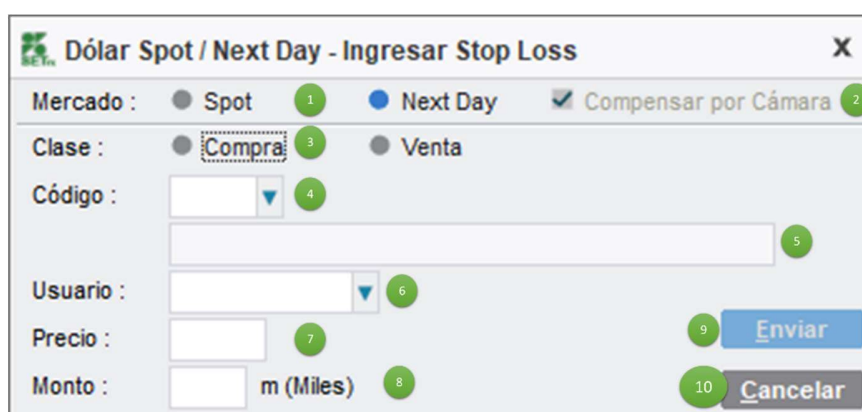
El botón  da acceso para ingresar una orden de *Stop Loss* se encuentra en la barra principal del Sistema SET-FX.



Ilustración 24 - Ventana Stop Loss



Dólar Spot / Next Day - Ingresar Stop Loss

Mercado : Spot ¹ Next Day ² Compensar por Cámara ²

Clase : Compra ³ Venta

Código : ⁴


⁵

Usuario : ⁶

Precio : ⁷ 9

Monto : m (Miles) ⁸ 10

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 40 / 98 |

| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|----------------------|---|
| 1 | Mercado | Permite escoger el mercado a ingresar la orden Stop Loss. Campo obligatorio |
| 2 | Compensar por Cámara | Indica si el registro a enviar es compensación por Cámara |
| 3 | Clase | Tipo de Stop Loss compra o venta. Campo obligatorio. |
| 4 | Código | Nemotécnico de la entidad contraparte. Campo obligatorio |
| 5 | Nombre Entidad | Nombre completo entidad contraparte. Campo no editable. |
| 6 | Usuario | Nombre del usuario contraparte. Campo obligatorio. |
| 7 | Precio | Precio del registro, campo obligatorio. |
| 8 | Monto | Monto del registro, expresado en miles, campo obligatorio. |
| 9 | 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. |
| 10 | 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 Next Day.
- 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 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 41 / 98 |

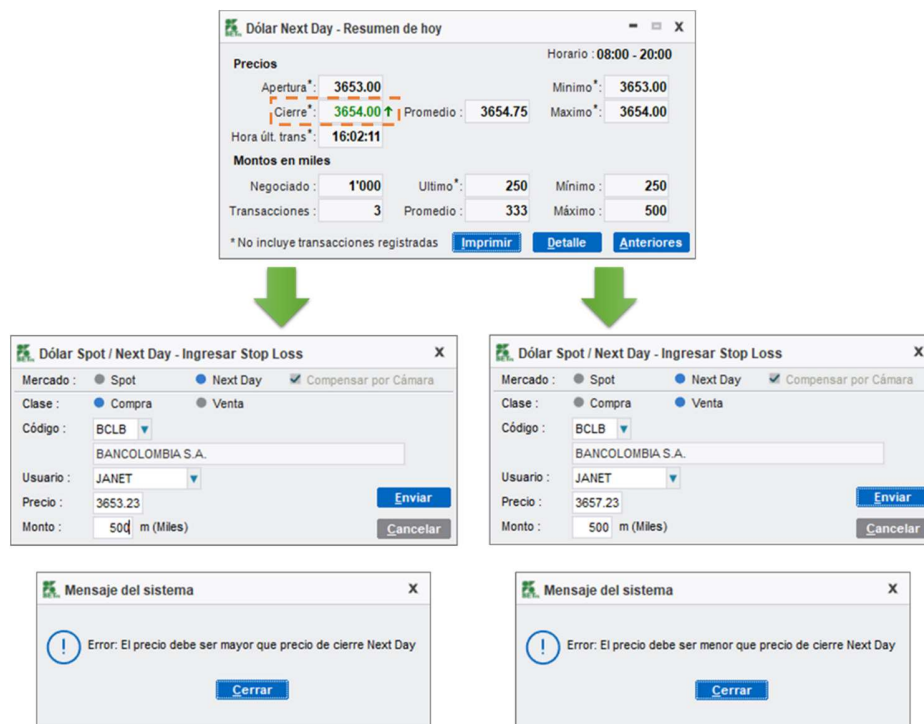



Ilustración 25 - Condiciones envío Stop Loss

2.5.1. Estados Ventana Stop Loss

Todas las ordenes Stop Loss pueden ser visualizadas en la ventana “dólar Next Day/ 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 42 / 98 |

| Dólar Spot / Next Day - Stop Loss | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|----------|--------|---------|---------|-------|--------------|---|-------------------------|-----|
| Ingresar | | | | | | | | | |
| Hora | Mercado | C/V | Precio | Strike | Monto | Cód. | P | Estado | C |
| 11:37:02 | Next Day | Compra | 3658.02 | 3658.02 | 250 | BCLB JANET | P | Transado | C |
| 11:54:09 | Next Day | Compra | 3659.00 | 3659.00 | 500 | BCLB JANET | P | Vigente | C |
| 11:39:48 | Next Day | Venta | 3640.05 | | 750 | BCLB JANET | P | Solicitado | C |
| 11:40:44 | Next Day | Compra | 3640.05 | | 750 | BCLB JANET | | Recibido | C |
| 11:41:43 | Next Day | Venta | 3650.02 | | 500 | BCLM SERGIOM | P | Rechazado | C |
| 11:42:45 | Next Day | Compra | 3658.00 | 3658.00 | 500 | BCLM SERGIOM | P | Desconectó | C |
| 11:46:00 | Next Day | Venta | 3656.00 | 3656.00 | 500 | BCLB JANET | P | Desactivar Stop Loss | C D |
| 11:46:43 | Next Day | Compra | 3658.00 | 3658.00 | 500 | BCLB JANET | P | Desactivado | C |
| 11:47:36 | Next Day | Compra | 3658.00 | 3658.00 | 500 | BCLM SERGIOM | P | Transado | C |
| 11:54:09 | Next Day | Compra | 3659.00 | 3659.00 | 500 | BCLB JANET | P | Confirmar desactivación | C D |

| Estado | Nombre | Estado |
|--------|-------------------------|---|
| 1 | Transado | Corresponde a una orden Stop Loss que ya fue ejecutada porque se cumplió la condición. |
| 2 | Vigente | Corresponde a aquellas órdenes Stop Loss que se encuentran confirmadas por ambas contrapartes y vigentes. |
| 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 | Recibido | Corresponde al estado de solicitud de un Stop Loss |
| 5 | Rechazado | Corresponde a aquellas órdenes Stop Loss que fueron enviadas por el solicitante, pero rechazadas por el aceptante. |
| 6 | Desconectó | Este estado aparece cuando alguno de los dos usuarios se desconecta del sistema SET-FX. |
| 7 | Desactivar Stop Loss | Corresponde al estado cuando se solicita desactivar Stop Loss, pero la contraparte no ha confirmado la solicitud. |
| 8 | Desactivado | Estado el cual indica la desactivación del Stop Loss |
| 9 | Confirmar desactivación | Estado cuando la contraparte solicita desactivar Stop Loss, pero el usuario no ha confirmado la solicitud. |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 43 / 98 |

Envío Stop Loss

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

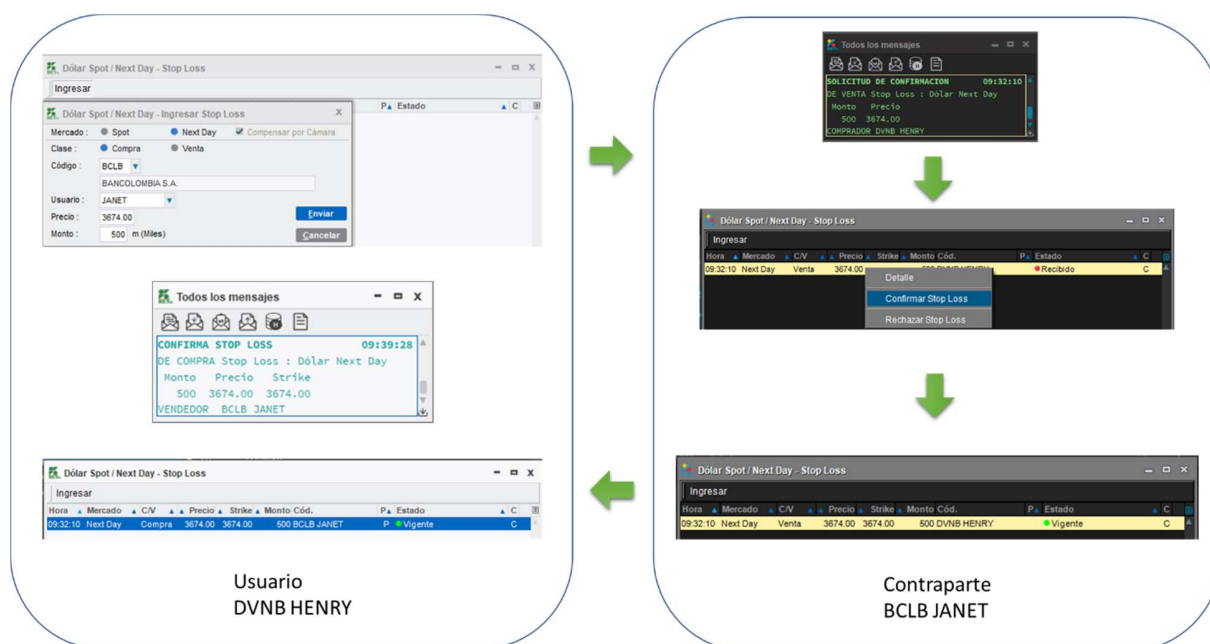



Ilustración 26 - Envío Stop Loss

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 | 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 44 / 98 |

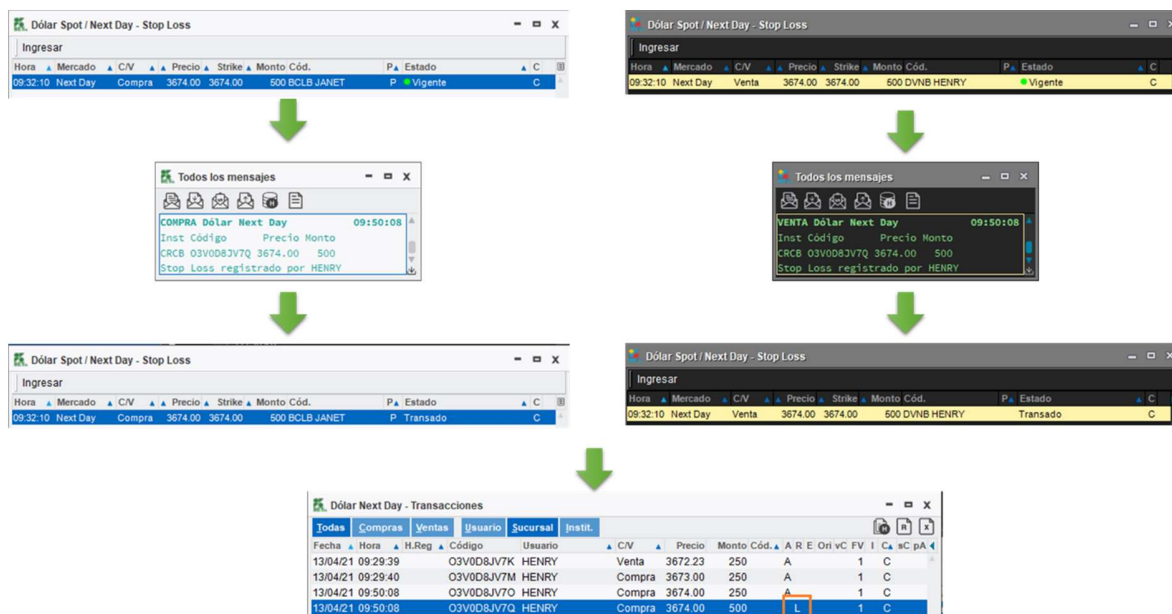


Ilustración 27- Ejecución Stop Loss

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.

Cada entidad podrá lanzar como máximo doce 12 sesiones de Fixing al día (susceptible a ser modificado por decisión del Comité Cambiario).

Las entidades con acceso a esta herramienta la podrán visualizar en la parte inferior de la tabla de negociación Next Day como se muestra 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 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 45 / 98 |



DEMANDAS ↑ 3672.13 OFERTAS ↑ 3673.55


B Vender 250 250 Comprar B

50'460 49'540

| Cód | Monto | Precio | Precio | Monto | Cód |
|-----|---------|---------|--------|-------|-----|
| 250 | 3672.13 | 3673.55 | 250 | 250 | |
| 250 | 3672.12 | 3673.60 | 250 | 250 | |
| 250 | 3672.08 | 3673.65 | 250 | 250 | |
| 250 | 3672.03 | 3673.70 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.98 | 3673.75 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.93 | 3673.80 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.88 | 3673.85 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.83 | 3673.90 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.78 | 3673.95 | 250 | 250 | |
| 250 | 3671.73 | 3674.00 | 250 | 250 | |


09:50:08 **Compra a** Monto Últ.precio
CRCB 1'250 3674.00
500 a 3674.00

00 +1 +3 00 Fixing 00 +3 +1 00

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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 46 / 98 |



| 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 Next Day”


| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 47 / 98 |



| 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). |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 48 / 98 |

Lanzamiento de un Fixing

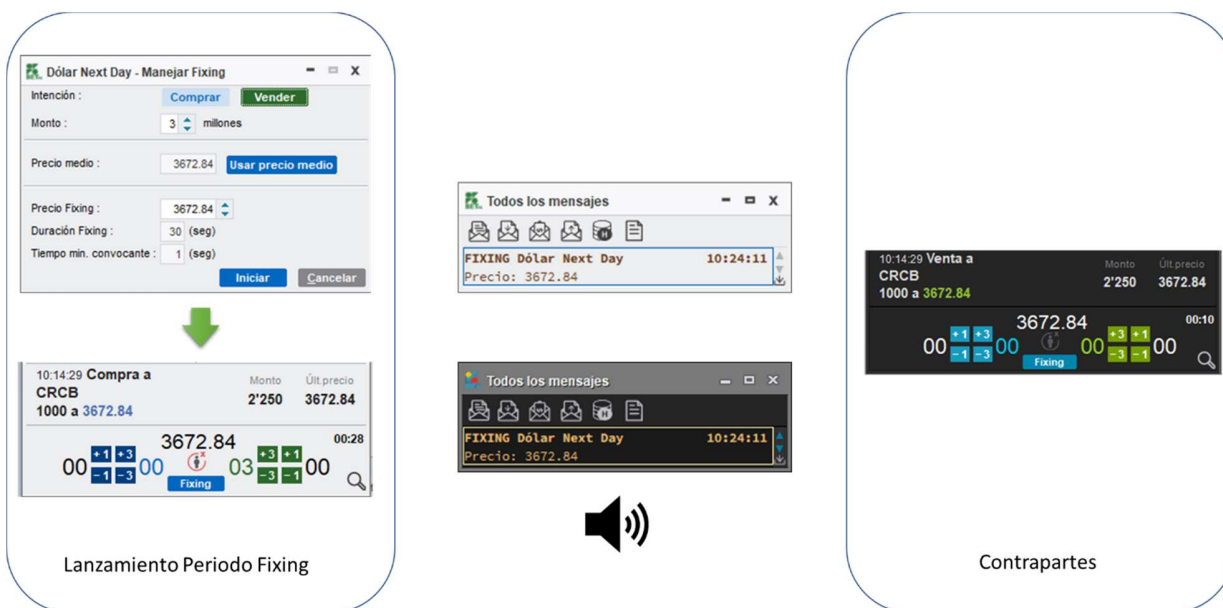



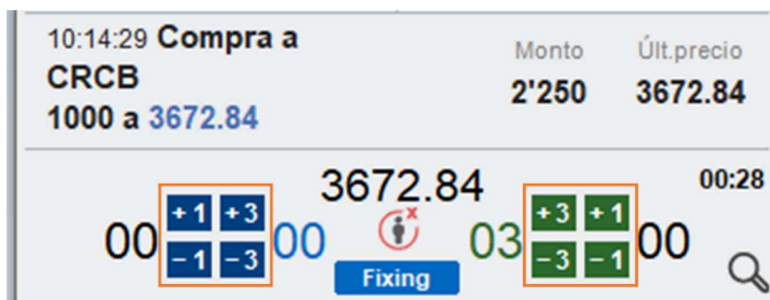
Ilustración 28 - Iniciar Periodo Fixing

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

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.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 49 / 98 |



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 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 | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 50 / 98 |

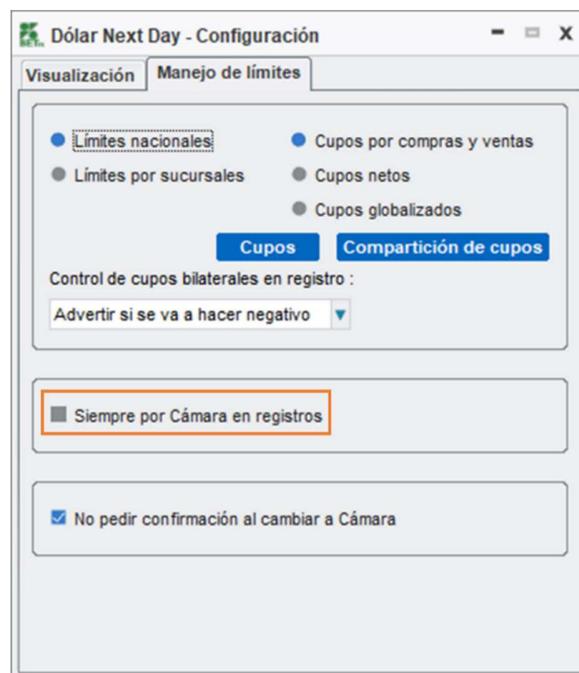



Ilustración 29- Siempre por cámara registros

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 él 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 51 / 98 |



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 Next Day.

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”  :

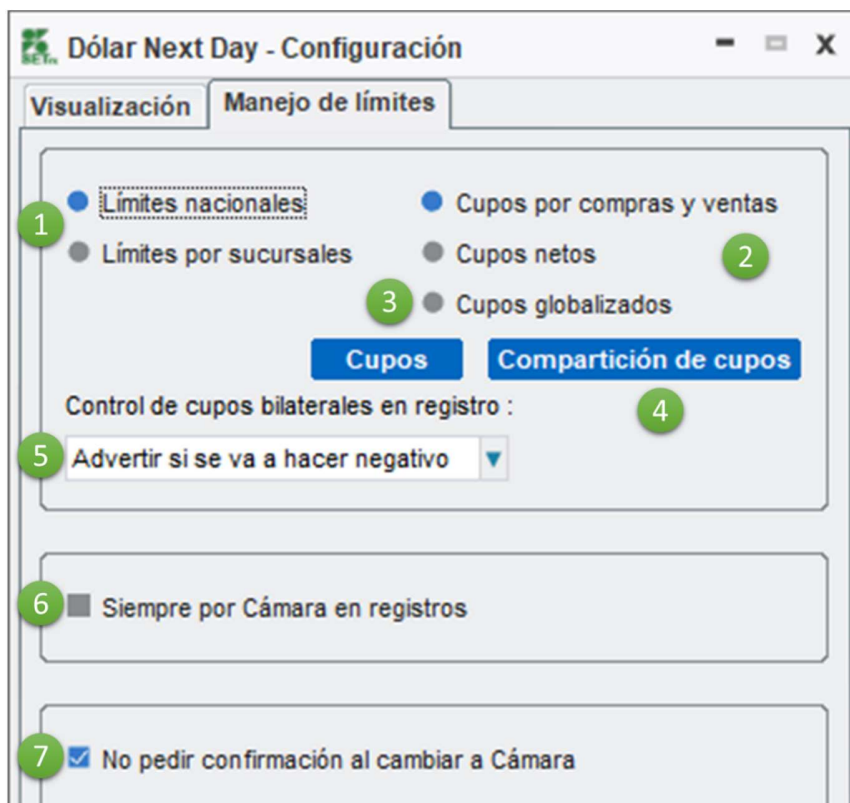


Configuración de administración de cupos

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


| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 52 / 98 |




| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|--------------------------|--|
| 1 | Configuración de límites | El perfil administrador de cupos, tendrá la opción de escoger entre: <ul style="list-style-type: none"> Límites nacionales: Es el valor asignado a una sola sucursal (Nacional) de la entidad y las demás sucursales trabajaran 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 | El sistema SET-FX tiene 3 opciones de configuración los cupos bilaterales: <ul style="list-style-type: none"> Cupos por compras y ventas: Permite ingresar un monto de cupo para compras |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 53 / 98 |


| | | |
|----------|---|--|
| | | <p>y uno para ventas de manera independiente.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cupos netos: Permite el ingreso de un cupo para compras y para ventas y estos actuaran de forma neteada entre los dos valores. • 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. |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 54 / 98 |

- | | | |
|----------|---|---|
| 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. |
|----------|---|---|

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 : | 50'000,000 | 1 | 50'000,000 |
| Transacciones : | 2'250,000 | 2 | 790,000 |
| Cupo : | 48'540,000 | 3 | 51'460,000 |
| Reservado SL : | | 4 | |
| Cupo disponible : | 48'540,000 | 5 | 51'460,000 |

| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|---------------------|---|
| 1 | Límite Compra/Venta | Límite 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 55 / 98 |

| Dólar Next Day - 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 |
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7'800,000 | 7'800,000 | 7'800,000 | 7'800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A. | 4'300,000 | 4'300,000 | 4'300,000 | 4'300,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56'000,000 | 56'000,000 | 56'000,000 | 56'000,000 |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7'560,000 | 7'560,000 | 7'560,000 | 7'560,000 |
| BCL | BANCOLOMBIA S.A. | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 |
| BGT | BANCO DE BOGOTA S.A. | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 |
| CFC | CORP FINANCIERA COLOMBIANA | 6'300,000 | 6'300,000 | 6'300,000 | 6'300,000 |
| CLP | SCOTIABANK COLPATRIA S.A. | 5'600,000 | 5'600,000 | 5'600,000 | 5'600,000 |
| CRR | CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A. | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 |
| SNT | ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A. | | | | |


| 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 | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 56 / 98 |

Dólar Next Day - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Limites/Cupos

Configuración: **Limites nacionales**
Para compras y ventas.

| Cód | Institución | Limite de compra | Cupo de compra | Limite de venta | Cupo de venta |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 |
| BCL | BANCOLOMBIA S.A. | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 |
| BGT | BANCO DE BOGOTA S.A. | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 |
| CFC | CORP FINANCIERA COLOMBIANA | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 |
| CLP | SCOTIABANK COLPATRIA S.A. | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 |
| CRR | CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 |
| SNT | ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A. | | | | |

Aumentar



Dólar Next Day - Limites/Cupos - Aumentar contraparte

Institución contraparte: AVV ACCIONES Y VALORES S.A.]

Aceptar **Cancelar**



Dólar Next Day - BANCO DAVIVIENDA S.A. - Limites/Cupos

Configuración: **Limites nacionales**
Para compras y ventas.

| Cód | Institución | Limite de compra | Cupo de compra | Limite de venta | Cupo de venta |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 |
| AVV | ACCIONES Y VALORES S.A. | | | | |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 |
| BCL | BANCOLOMBIA S.A. | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 |
| BGT | BANCO DE BOGOTA S.A. | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 |
| CFC | CORP FINANCIERA COLOMBIANA | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 |
| CLP | SCOTIABANK COLPATRIA S.A. | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 |
| CRR | CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 |

Aumentar


Ilustración 30 - Aumentar entidad contraparte

- 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 | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 57 / 98 |

Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 |
| AVV | ACCIONES Y VALORES S.A. | | | | |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 |
| BCL | BANCOLOMBIA S.A. | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 |
| BGT | BANCO DE BOGOTÁ S.A. | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 |
| CFC | CORP FINANCIERA COLOMBIANA | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 |
| CLP | SCOTIABANK COLPATRIA S.A. | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 |
| CRR | CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 |

Aumentar



Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 | 7800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 | 4300,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 | 56000,000 |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 | 7560,000 |
| BCL | BANCOLOMBIA S.A. | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 | 10,000'000,000 |
| BGT | BANCO DE BOGOTÁ S.A. | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 | 15,000'000,000 |
| CFC | CORP FINANCIERA COLOMBIANA | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 | 6300,000 |
| CLP | SCOTIABANK COLPATRIA S.A. | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 | 5600,000 |
| CRR | CREDICORP CAPITAL COLOMBIA S.A | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 | 568'000,000 |
| SNT | ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A. | | | | |

Aumentar

Ilustración 31- Eliminar entidad contraparte

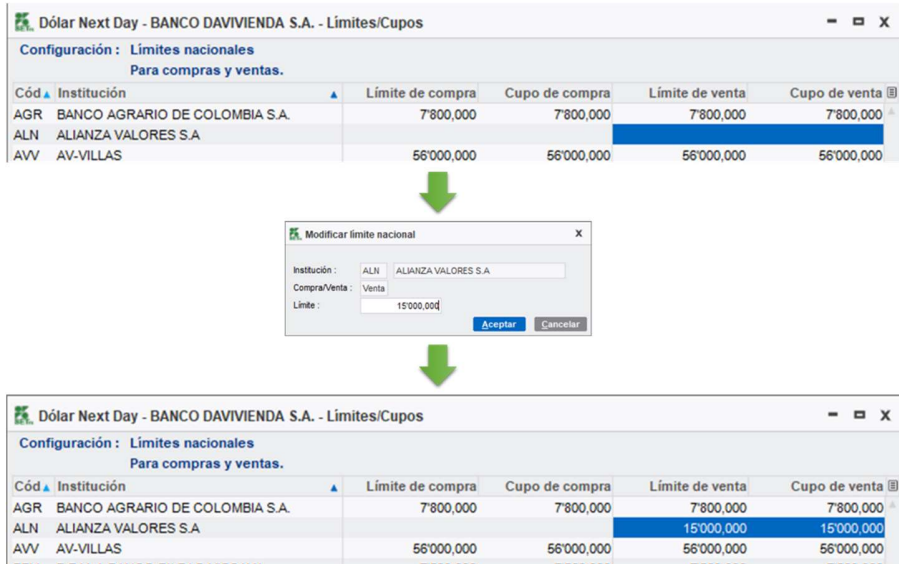
- Ingreso/Modificación de Límites y Cupos Bilaterales

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 |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 58 / 98 |



Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A. | | | | |
| AVV | AV-VILLAS | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 |

Modificar limite nacional

Institución: ALN ALIANZA VALORES S.A.
 Compra/Venta: Venta
 Límite: 15.000,000

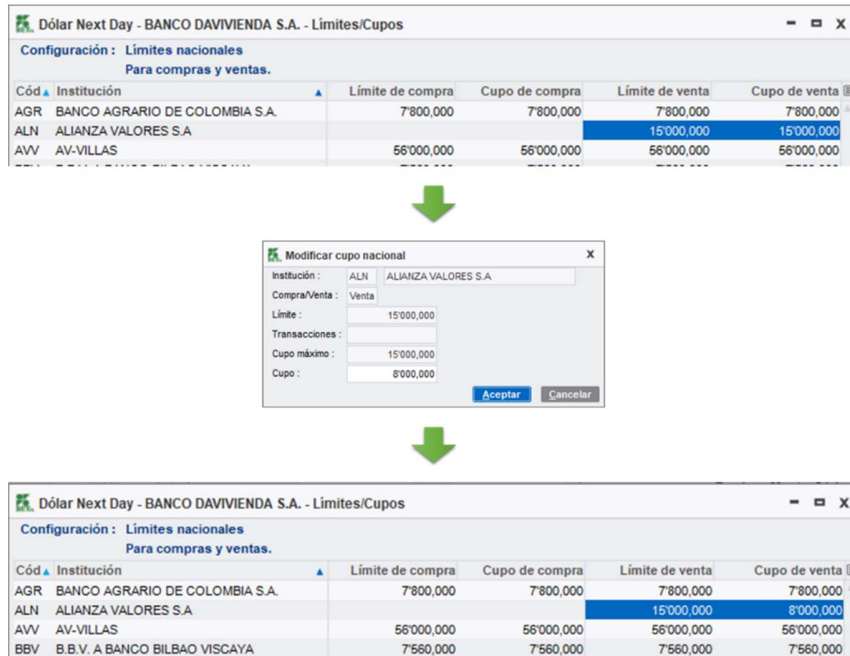
Aceptar Cancelar

Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A. | | | 15.000,000 | 15.000,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 |

Ilustración 32- Ingreso de límites y cupos bilaterales



Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A. | | | 15.000,000 | 15.000,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 |

Modificar cupo nacional

Institución: ALN ALIANZA VALORES S.A.
 Compra/Venta: Venta
 Límite: 15.000,000
 Transacciones:
 Cupo máximo: 15.000,000
 Cupo: 8.000,000

Aceptar Cancelar


Dólar Next Day - 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 |
|-----|--------------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|
| AGR | BANCO AGRARIO DE COLOMBIA S.A. | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 | 7.800,000 |
| ALN | ALIANZA VALORES S.A. | | | 15.000,000 | 8.000,000 |
| AVV | AV-VILLAS | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 | 56.000,000 |
| BBV | B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA | 7.560,000 | 7.560,000 | 7.560,000 | 7.560,000 |

Ilustración 33 - Modificación de límites y 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 |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 59 / 98 |

- 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

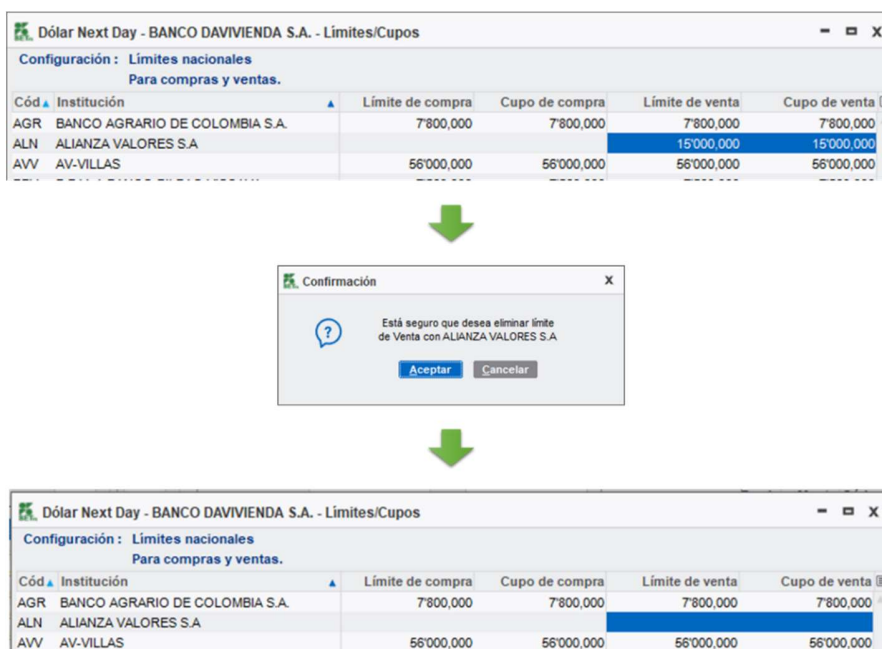



Ilustración 34 - Eliminar límites y cupos bilaterales

- 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 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 60 / 98 |

- 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 Next Day – Transacciones”, ubicado en la barra principal del sistema SET-FX .




Partes principales del Blotter de operaciones:

| Dólar Next Day - Transacciones 2 3 4 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|------------|----------|------------|-----------|-----------|---------|-------|------|---|---|---|---------|----|---|---|----|----|
| 1 f R X | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Todas | Compras | Ventas | Usuario | Sucursal | Instit. | | | | | | | | | | | | |
| Fecha | Hora | H.Reg | Código | Usuario | C/V | Precio | Monto | Cód. | A | R | E | Ori v C | FV | I | C | sC | pA |
| 13/04/21 | 08:05:06 | 12:00:07 | O3V0D8JV98 | HENRY | Compra | 3652.00 | 500 | | A | R | | N | V | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 08:06:03 | 11:50:03 | O3V0D8JV97 | HENRY | Compra | 3675.00 | 500 | BCLB | A | R | | O | | 1 | | | |
| 13/04/21 | 08:06:03 | 12:00:42 | O3V0D8JV99 | HENRY | Compra | 3675.00 | 500 | | A | R | | F | | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 08:07:06 | 12:02:10 | O3V0D8JV9A | HENRY | Compra | 3675.00 | 250 | | | B | | O | | 3 | | C | |
| 13/04/21 | 08:07:06 | 12:02:18 | O3V0D8JV9B | HENRY | Compra | 3675.00 | 250 | | | B | | N | | 2 | | C | |
| 13/04/21 | 09:29:39 | | O3V0D8JV7K | HENRY | Venta | 3672.23 | 250 | | A | | | | | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 09:29:40 | | O3V0D8JV7M | HENRY | Compra | 3673.00 | 250 | | A | | | | | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 09:50:08 | | O3V0D8JV7O | HENRY | Compra | 3674.00 | 250 | | A | | | | | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 09:50:08 | | O3V0D8JV7Q | HENRY | Compra | 3674.00 | 500 | | | L | | | | 1 | | C | |
| 13/04/21 | 10:14:29 | | O3V0D8JV95 | HENRY | Compra | 3672.84 | 1000 | | | | | FP | | 1 | | C | |
| Total compras sucursal: | | | | 4'000,000 | 3671.27 | | | | | | | | | | | | |
| Total ventas sucursal: | | | | 250,000 | 3672.23 | | | | | | | | | | | | |
| En Cámara | Compras | Pérd/Gan | Ventas | Pérd/Gan | Netos | | | | | | | | | | | | |
| DVN: | 3'750,000 | | 790,000 | | 2'960,000 | | | | | | | | | | | | |
| Cupo: | 47'040,000 | | 52'960,000 | | | | | | | | | | | | | | |
| 6 7 Detalle Pérd/Gan | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|-------------------------|---|
| 1 | Filtro de visualización | Permite visualizar las operaciones de acuerdo a los filtros (todas, compras/ventas, usuarios, sucursales o instituciones) |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 61 / 98 |

| | | |
|----------|--|---|
| 2 | Días Anteriores | Permite realizar una consulta histórica de las transacciones realizadas en días anteriores |
| 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.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 62 / 98 |

- **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.
- **Código:** Código de la operación.
- **Usuario:** Es el usuario que realizó la operación.
- **C/V:** Indica si la operación es de 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.
 - **N:** origen Next Day.
 - **O:** origen Swap O/N Contado.
 - **F:** origen Swap Forward.
 - **U:** origen de una operación de Futuro.
 - **FP:** FIX Price, operaciones realizadas por la herramienta Fixing.
- **vC:** Vigilada con Cámara, identifica los registros realizados con contraparte FOGAFÍN.
- **FV:** Fecha Valor (1,2,3), plazo del registro Next Day.
- **C,** Compensación, Indica que la operación se encuentra compensada.
- **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.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 63 / 98 |

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 Next Day - Detalle de transacción

Fecha: 13/04/2021 Código: 03V0D8JV7K Hora: 09:29:39

Comprador: CAMARA DE RIESGO CENTRAL Sucursal: BOGOTA Por Cámara

Vendedor: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Henry Giovanni Bojaca Verdugo

Precio: 3672.23 Monto USS: 250,000.00 Efecto cupo CRC: 250,000

Origen transacción: Demanda aceptada por HENRY

Comentario: Monto Pesos: 918'057,500.00


Fecha valor: 1 Origen:

Ilustración 35 - Detalle de transacción

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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 64 / 98 |

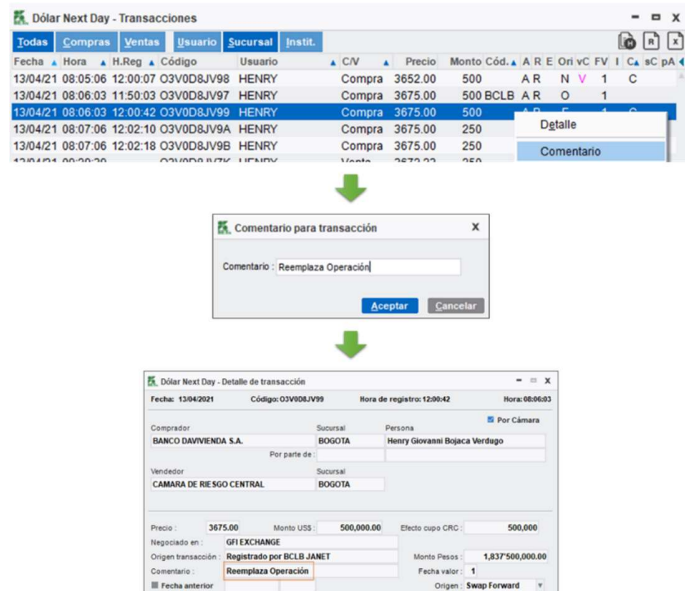


Ilustración 36 - Ingreso comentario

Historia

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


| Fecha | Hora | Usuario | Clase | O/D | Precio | Monto | Tr/To T | Info adicional |
|----------|----------|----------------|--------------------------|-----|---------|-------|---------|----------------|
| 13/04/21 | 08:06:03 | BCLB JANET | Solicita registro | O | 3675.00 | 500 | 500 | |
| 13/04/21 | 12:00:21 | Motor de calce | Solicitud aceptada | O | 3675.00 | 500 | 500 | |
| 13/04/21 | 12:00:52 | DVNB HENRY | Solicita cambio a Cámara | O | 3675.00 | 500 | | |
| 13/04/21 | 12:01:17 | BCLB JANET | Confirmación | O | 3675.00 | 500 | | |
| 13/04/21 | 08:06:03 | Motor de calce | Registro | O | 3675.00 | 500 | 500 | |
| 13/04/21 | 12:53:25 | DVNB HENRY | Solicita anulación | O | 3675.00 | 500 | | |

Ilustración 37- Historia de operación

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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 65 / 98 |



Fecha: 13/04/2021
Hora: 12:54:20

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

PAPELETA DE NEGOCIACION PARA MERCADO DOLAR NEXT DAY

| | |
|-----------------------|---------------------------------------|
| Fecha : | 13/04/2021 |
| Código : | O3V0D8JV99 |
| Hora : | 08:06:03 |
| Nro Liquidación : | 11 |
| Compensación : | Con Cámara |
| Compra/Venta : | COMPRA |
| Comprador : | BANCO DAVIVIENDA S.A. |
| Ciudad : | BOGOTA |
| Nombre : | HENRY - Henry Giovanni Bojaca Verdugo |
| NIT : | 860.034.313-7 |
| Por parte de : | |
| Vendedor : | CAMARA DE RIESGO CENTRAL |
| Ciudad : | BOGOTA |
| NIT : | 900.182.389-4 |
| Por parte de : | |
| Fecha valor : | 1 |
| Fecha entrega : | 14-Abr-2021 |
| Precio : | 3675.00 |
| Monto US\$: | 500,000.00 |
| Monto \$: | 1,837'500,000.00 |
| Comentario : | Reemplaza Operación |
| Origen : | Swap Forward |
| Negociado en : | GFI EXCHANGE |

Ilustración 38 - Papeleta impresa

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 – 16:30).

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: IGO020204 |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 66 / 98 |

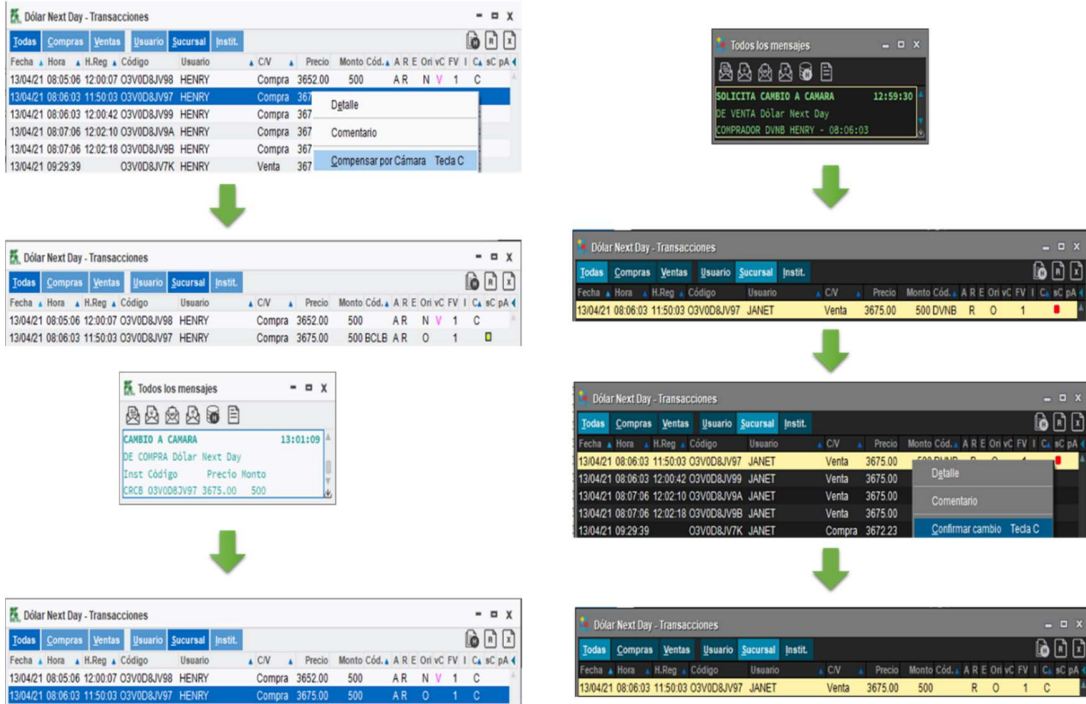



Ilustración 39 - Ejemplo, envío registro a compensar

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 Next Day – 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 67 / 98 |

| Dólar Next Day - Compras | | | | | | | | | |
|--------------------------|--------|---------------------|---------|-------|--------------|-----|---------------------|----------|---------------------------|
| Fecha: 13/04/2021 | | | | | | | | | |
| Sucursal: BOGOTA | | | | | | | | | |
| Hora | Nombre | Sucursal | Precio | Monto | Valor | Ori | Comentario | R | C |
| 08:05:06 | CRCC | BOGOTA | 3652.00 | 500 | 1826'000,000 | N | | R | C |
| 08:06:03 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | O | | R | C |
| 08:06:03 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | F | Reemplaza Operación | R | C |
| 08:07:06 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 250 | 918'750,000 | O | | B | C |
| 08:07:06 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 250 | 918'750,000 | N | | B | C |
| 09:29:40 | CRCC | BOGOTA | 3673.00 | 250 | 918'250,000 | | | | C |
| 09:50:08 | CRCC | BOGOTA | 3674.00 | 250 | 918'500,000 | | | | C |
| 09:50:08 | CRCC | BOGOTA | 3674.00 | 500 | 1837'000,000 | | | L | C |
| 10:14:29 | CRCC | BOGOTA | 3672.84 | 1000 | 3672'840,000 | FP | | | C |
| Total compras : | | 4'000,000.00 | | | | | | | |
| | | | | | | | | 6 | Promedio : 3671.27 |

| 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 |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 68 / 98 |

2.9.2. Ventas

| Dólar Next Day - Ventas | | | | | | | | 2 | 3 | |
|-------------------------|-----------|------------------|---------|-------|--------------|-----|------------|---|-----------------------------|---|
| Fecha: 13/04/2021 | | Sucursal: BOGOTA | | | | | | 1 | R | X |
| Hora | Nombre | Sucursal | Precio | Monto | Valor | Ori | Comentario | R | C | |
| 08:06:03 | BCOLOMBIA | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | N | | R | | |
| 08:06:03 | BCOLOMBIA | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | O | | R | | |
| 09:29:39 | CRCC | BOGOTA | 3672.23 | 250 | 918'057,500 | | | | C | |
| 14:25:16 | CRCC | BOGOTA | 3672.13 | 250 | 918'032,500 | | | | C | |
| 14:25:17 | CRCC | BOGOTA | 3672.12 | 250 | 918'030,000 | | | | C | |
| 14:25:18 | CRCC | BOGOTA | 3672.08 | 250 | 918'020,000 | | | | C | |
| 14:25:19 | CRCC | BOGOTA | 3672.03 | 250 | 918'007,500 | | | | C | |
| Total ventas : | | 2'250,000.00 | | | | | | | 6 Promedio : 3673.40 | |


| 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:

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 69 / 98 |



| Sucursal | COMPRAS | | VENTAS | | Monto Neto |
|----------|---------|----------|--------|----------|------------|
| | Monto | Promedio | Monto | Promedio | |
| BOGOTA | 4'750 | 3671.78 | 2'250 | 3673.40 | 2'500 |
| MEDELLIN | 250 | 3451.00 | 540 | 3452.00 | -290 |
| Nacional | 5'000 | 3660.75 | 2'790 | 3630.55 | 2'210 |



| Hora | Nombre | Sucursal | Precio | Monto | Valor Ori | Comentario | R | C/V | C |
|-----------------|-----------|--------------|---------|----------------|--------------|--------------|---|---------------------|---|
| 08:05:06 | CRCC | BOGOTA | 3652.00 | 500 | 1826'000,000 | N | R | Compra | C |
| 08:06:03 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | O | R | Compra | C |
| 08:06:03 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | F | R | Reemplaza Operación | C |
| 08:06:03 | BCOLOMBIA | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | F | R | Compra | C |
| 08:06:03 | BCOLOMBIA | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | N | R | Venta | C |
| 08:06:03 | BCOLOMBIA | BOGOTA | 3675.00 | 500 | 1837'500,000 | O | R | Venta | C |
| 08:07:06 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 250 | 918'750,000 | O | B | Compra | C |
| 08:07:06 | CRCC | BOGOTA | 3675.00 | 250 | 918'750,000 | N | B | Compra | C |
| 09:29:39 | CRCC | BOGOTA | 3672.23 | 250 | 918'057,500 | | | Venta | C |
| 09:29:40 | CRCC | BOGOTA | 3673.00 | 250 | 918'250,000 | | | Compra | C |
| 09:50:08 | CRCC | BOGOTA | 3674.00 | 250 | 918'500,000 | | | Compra | C |
| 09:50:08 | CRCC | BOGOTA | 3674.00 | 500 | 1837'000,000 | | L | Compra | C |
| 10:14:29 | CRCC | BOGOTA | 3672.84 | 1000 | 3672'840,000 | FP | | Compra | C |
| 14:24:49 | CRCC | BOGOTA | 3673.55 | 250 | 918'387,500 | | | Compra | C |
| 14:25:16 | CRCC | BOGOTA | 3672.13 | 250 | 918'032,500 | | | Venta | C |
| 14:25:17 | CRCC | BOGOTA | 3672.12 | 250 | 918'030,000 | | | Venta | C |
| 14:25:18 | CRCC | BOGOTA | 3672.08 | 250 | 918'020,000 | | | Venta | C |
| 14:25:19 | CRCC | BOGOTA | 3672.03 | 250 | 918'007,500 | | | Venta | C |
| Total compras : | | 4'750,000.00 | | Total ventas : | | 2'250,000.00 | | | |

Ilustración 40 - dólar Next Day -Transacciones

Resumido por Institución Contraparte


Se encuentra el resumen de operaciones agrupadas por entidad contraparte.



| Contraparte | COMPRAS | | | VENTAS | | | Monto Neto | | |
|-------------|---------|---------|---------------|------------------|-------|---------|--------------|-----------------|-------|
| | Monto | Promed | Valor | Total | Monto | Promed | | Valor | Total |
| BCOLOMBIA | 500 | 3675.00 | 1837'500,000 | 1837'500,000.00 | 1'000 | 3675.00 | 3675'000,000 | 3675'000,000.00 | -500 |
| CRCC | 4'500 | 3659.16 | 16466'227,500 | 16466'227,500.00 | 1'790 | 3605.71 | 6454'227,500 | 6454'227,500.00 | 2'710 |


| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|--------|-------------|
|------|--------|-------------|

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 70 / 98 |

| | | |
|----------|--------------------------|---|
| 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: <ul style="list-style-type: none"> • 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 Next Day del día con información de precios cierres y/o promedio.

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 71 / 98 |



Ilustración 41 - Grafico de precios de transacciones

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

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

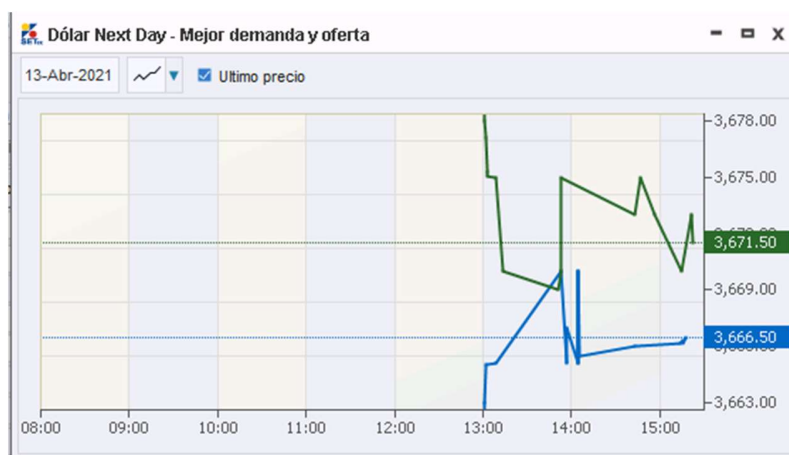



Ilustración 42 - Grafico mejor demanda y oferta

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 72 / 98 |

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.

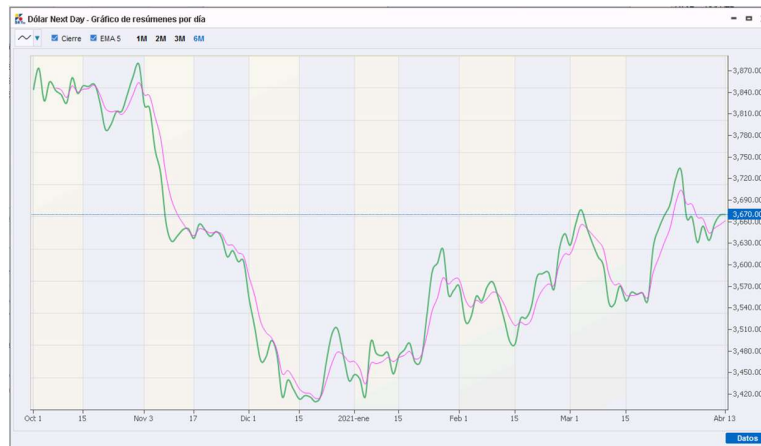


Ilustración 43 - Grafico de resumen de transacciones por día

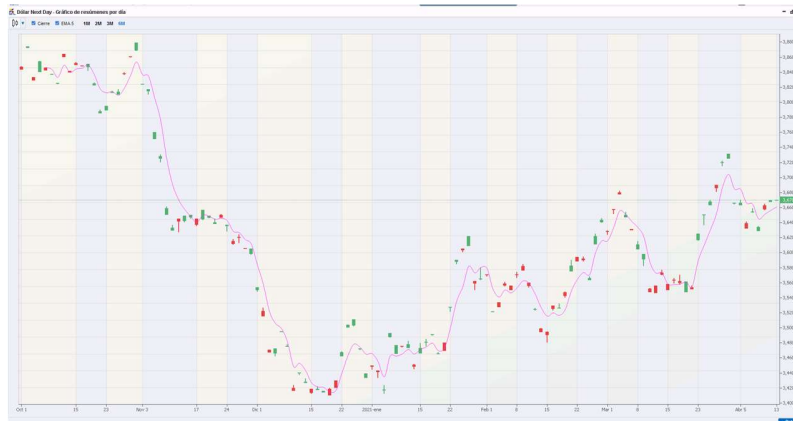



Ilustración 44 - Grafico de resumen de transacciones por día

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 73 / 98 |

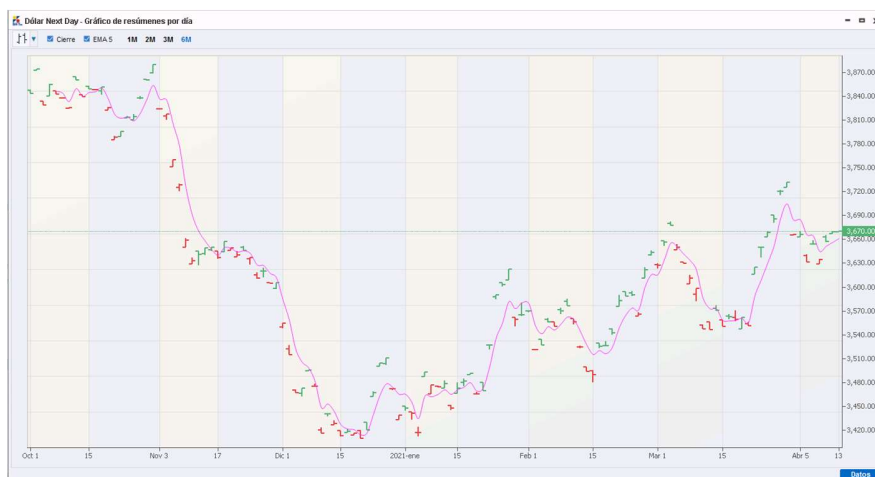


Ilustración 45 - Grafico de resumen de transacciones por día


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.



Ilustración 46 - Grafico de resumen de transacciones por intervalo

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 74 / 98 |

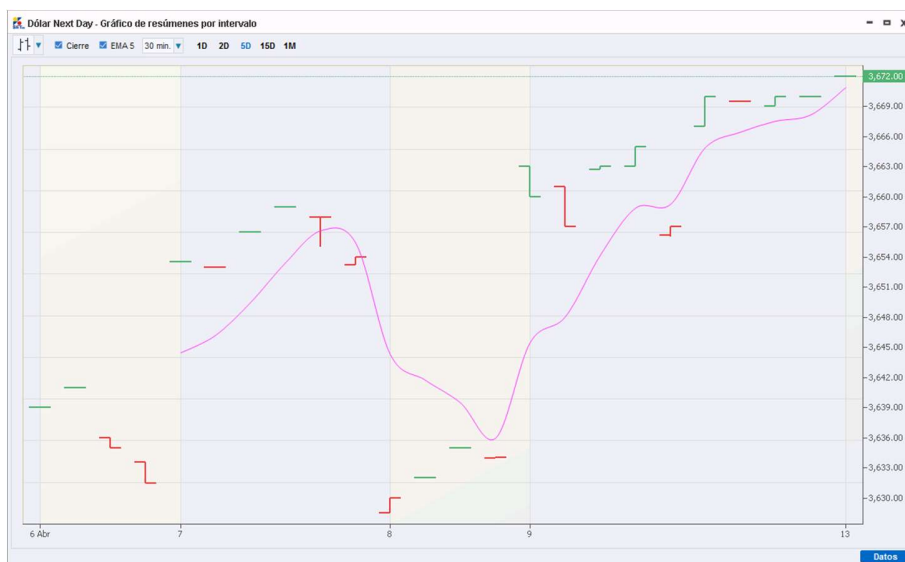


Ilustración 47 - Grafico de resumen de transacciones por intervalo

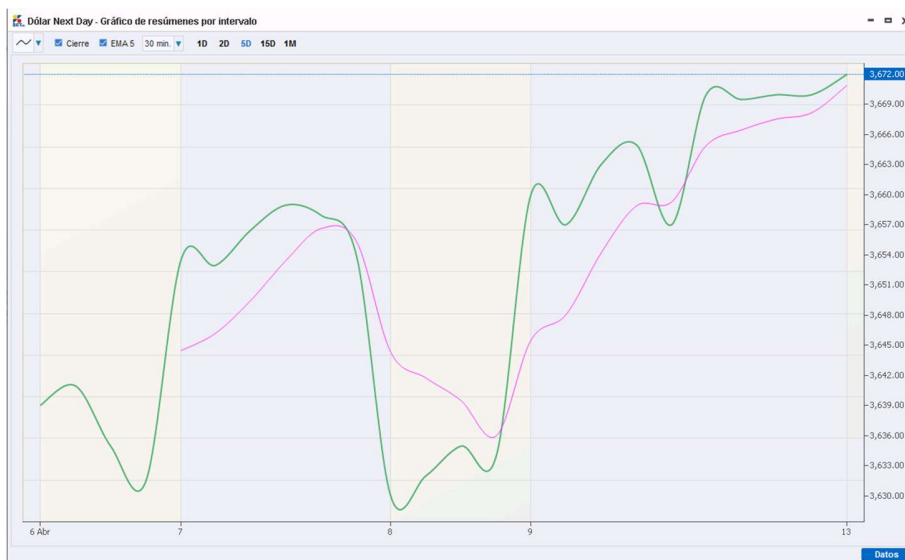



Ilustración 48 - Grafico de resumen de transacciones por intervalo

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 75 / 98 |

2.10.5. Precios/Montos Transacciones De Hoy


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



| Hora | Precio | Monto | R | FV | Ori |
|----------|---------|-----------|---|----|-----|
| 14:25:19 | 3672.03 | 250,000 | P | 1 | |
| 14:25:18 | 3672.08 | 250,000 | P | 1 | |
| 14:25:17 | 3672.12 | 250,000 | P | 1 | |
| 14:25:16 | 3672.13 | 250,000 | P | 1 | |
| 14:24:49 | 3673.55 | 250,000 | T | 1 | |
| 10:14:29 | 3672.84 | 1'000,000 | F | 1 | FP |
| 09:50:08 | 3674.00 | 500,000 | R | 1 | |
| 09:50:08 | 3674.00 | 250,000 | T | 1 | |
| 09:29:40 | 3673.00 | 250,000 | T | 1 | |
| 09:29:39 | 3672.23 | 250,000 | P | 1 | |
| 08:07:06 | 3675.00 | 250,000 | R | 2 | N |
| 08:07:06 | 3675.00 | 250,000 | R | 3 | O |
| 08:06:03 | 3675.00 | 500,000 | R | 1 | O |
| 08:06:03 | 3675.00 | 500,000 | R | 1 | N |
| 08:06:03 | 3675.00 | 500,000 | R | 1 | F |
| 08:06:03 | 3675.00 | 500,000 | R | 1 | F |
| 08:06:03 | 3675.00 | 500,000 | R | 1 | O |

| 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 • F: 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 76 / 98 |

| | | |
|----------|-------------|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> • P: (pegada) agresión sobre demandas • T: (Tomada) agresión sobre las ofertas |
| 5 | Fecha Valor | Plazo de la operación (1,2,3) |
| 5 | Ori | Origen de la operación, la columna presenta los siguientes valores: <ul style="list-style-type: none"> • N: Next Day • O: origen Swap O/N Contado • F: origen Swap Forward • U: origen swap Futuro • FP: FIX Price |

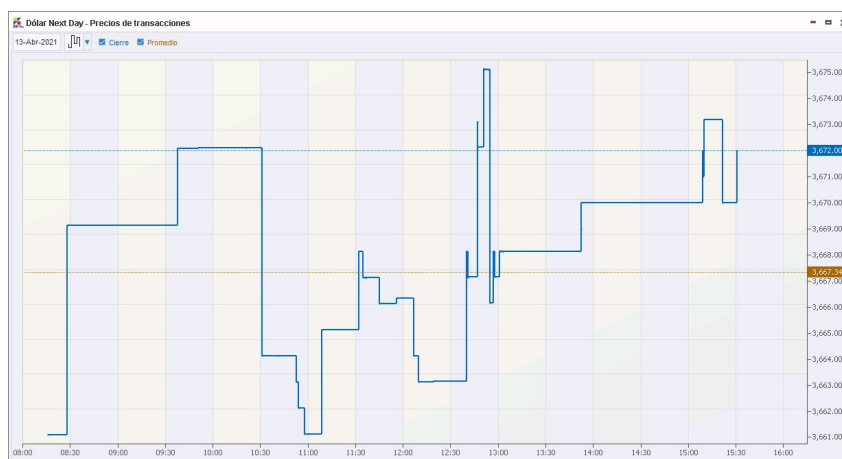



Ilustración 49 - Grafico de precios de transacciones

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 77 / 98 |

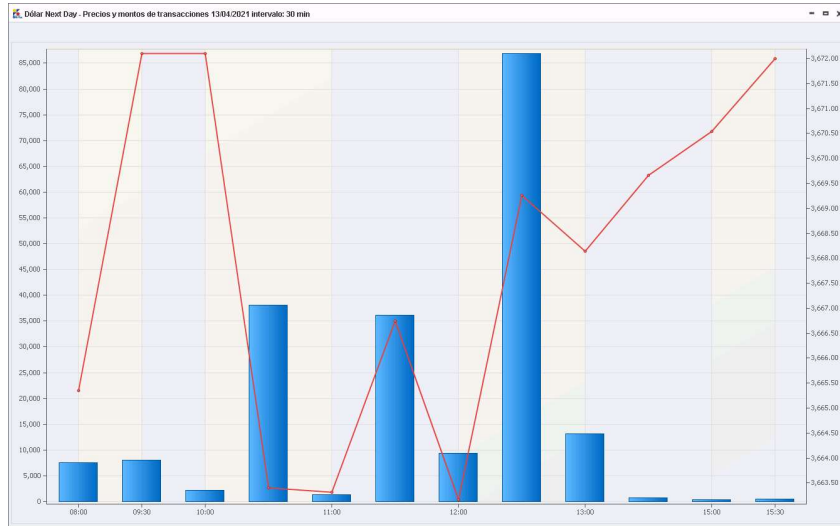


Ilustración 50 - Gráfico de precios y montos de transacciones

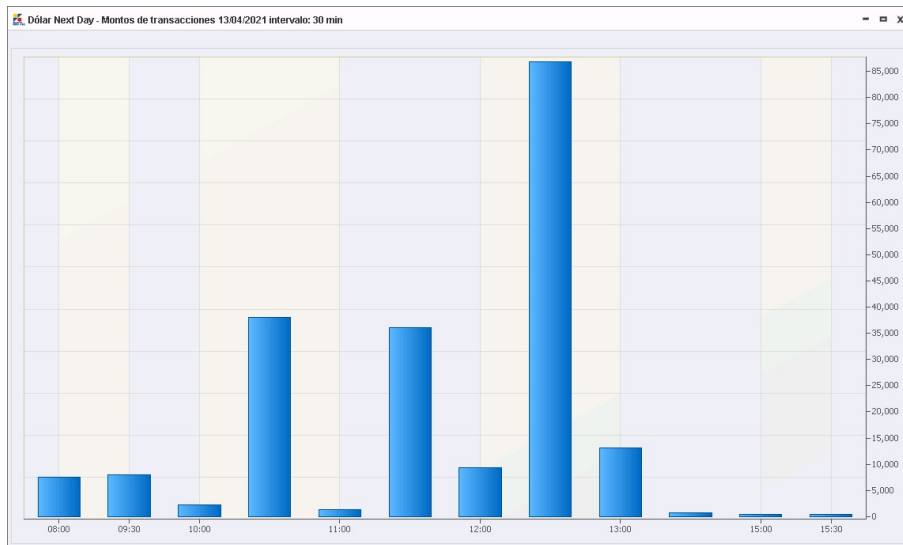


Ilustración 51 - Gráfico de montos de transacciones

| | | |
|--|--|---|
| 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 |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 78 / 98 |

2.10.6. Historia De Precios/Montos De Transacciones

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

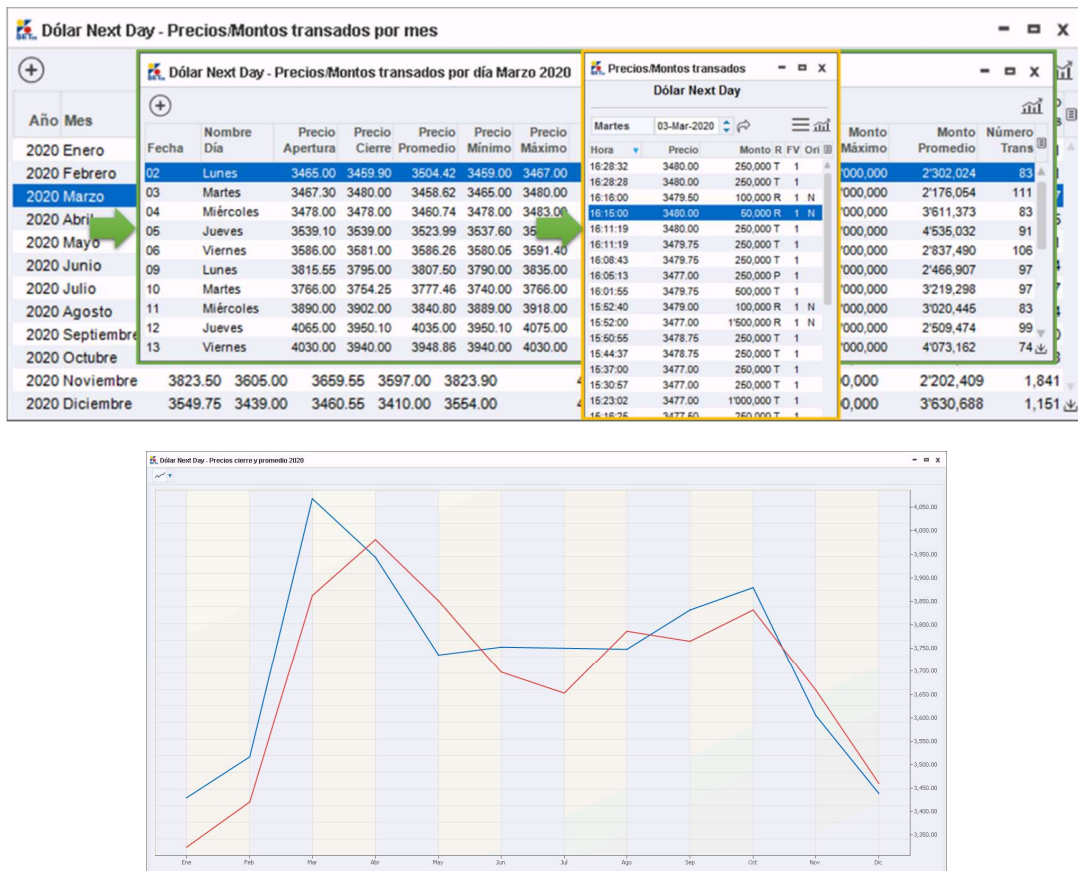



Ilustración 52 - Grafico de precios de cierre y promedio

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 79 / 98 |

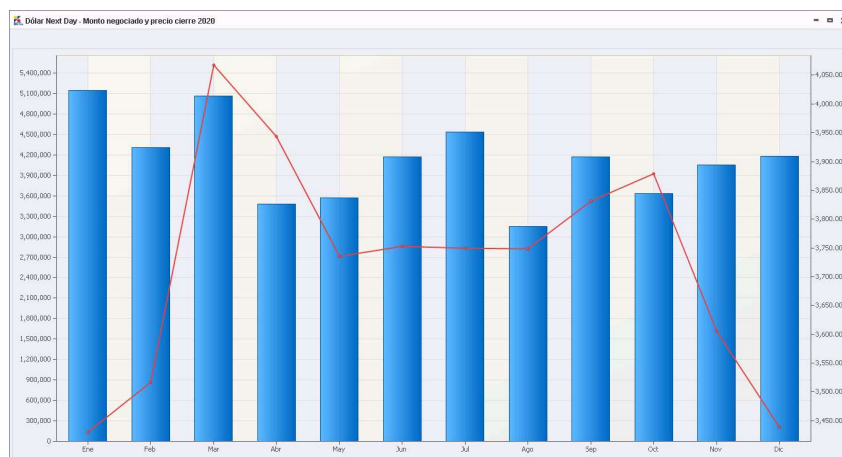


Ilustración 53 - Grafico de monto negociado y precio de cierre

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 .

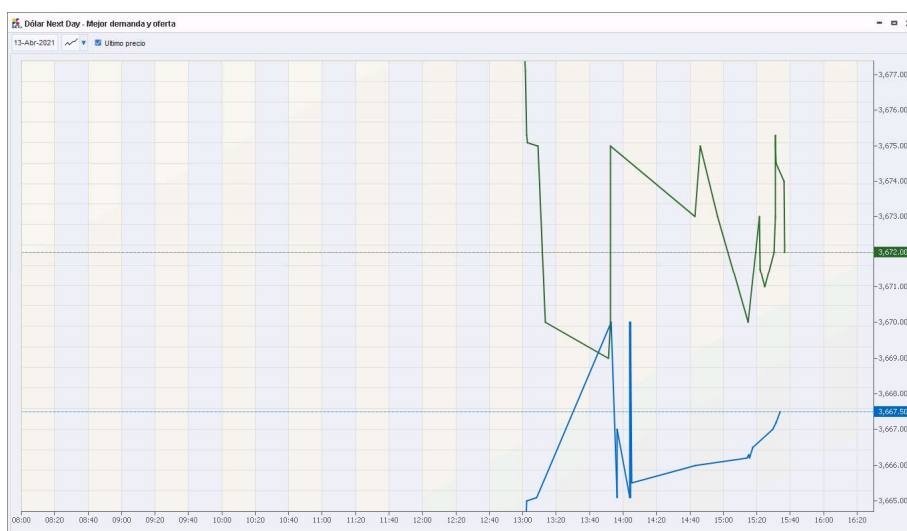



Ilustración 54 - Grafico de mejor demanda y oferta

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 80 / 98 |

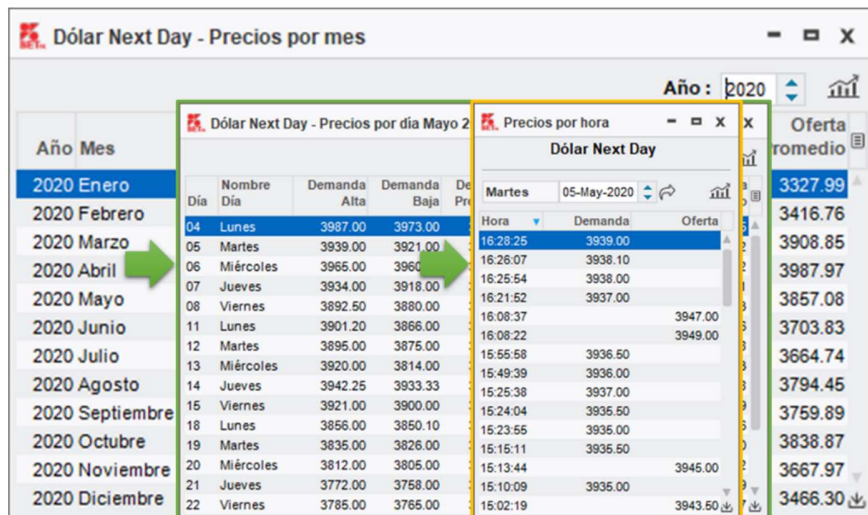


| Hora | Precio | Monto R | FV | Ori |
|----------|---------|------------|----|-----|
| 15:42:02 | 3607.00 | 250,000 | T | 1 |
| 15:27:33 | 3607.00 | 250,000 | T | 1 |
| 15:23:01 | 3605.00 | 46,000 | R | 1 N |
| 15:10:00 | 3607.20 | 45,000 | R | 2 N |
| 14:59:57 | 3607.00 | 250,000 | T | 1 |
| 14:59:29 | 3607.00 | 500,000 | T | 1 |
| 14:56:00 | 3607.00 | 250,000 | T | 1 |
| 14:40:45 | 3606.00 | 250,000 | T | 1 |
| 13:14:59 | 3604.50 | 250,000 | T | 1 |
| 13:14:58 | 3604.50 | 250,000 | T | 1 |
| 13:14:57 | 3604.50 | 250,000 | T | 1 |
| 13:14:56 | 3604.50 | 250,000 | T | 1 |
| 13:14:55 | 3604.50 | 250,000 | T | 1 |
| 13:03:00 | 3603.45 | 1'450,000 | R | 1 O |
| 13:02:29 | 3603.42 | 500,000 | R | 1 O |
| 13:00:00 | 3603.45 | 5'000,000 | R | 1 O |
| 12:57:00 | 3600.45 | 12'000,000 | R | 1 O |
| 12:53:00 | 3599.36 | 8'000,000 | R | 1 O |
| 12:49:07 | 3598.20 | 267,000 | R | 1 N |
| 12:48:00 | 3599.39 | 1'735,000 | R | 1 O |

Ilustración 55 - Ventana de precios/montos transados

2.10.8. Historia De Precios Mejor Demanda/Oferata

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



| Año Mes | Día | Nombre Día | Demanda Alta | Demanda Baja | De Pr | Oferta promedio |
|-----------------|-----|------------|--------------|--------------|-------|-----------------|
| 2020 Enero | | | | | | |
| 2020 Febrero | | | | | | |
| 2020 Marzo | 04 | Lunes | 3987.00 | 3973.00 | | 3327.99 |
| 2020 Abril | 05 | Martes | 3939.00 | 3921.00 | | 3416.76 |
| 2020 Mayo | 06 | Miércoles | 3965.00 | 3960.00 | | 3908.85 |
| 2020 Junio | 07 | Jueves | 3934.00 | 3918.00 | | 3987.97 |
| 2020 Julio | 08 | Viernes | 3892.50 | 3880.00 | | 3857.08 |
| 2020 Agosto | 11 | Lunes | 3901.20 | 3866.00 | | 3703.83 |
| 2020 Septiembre | 12 | Martes | 3895.00 | 3875.00 | | 3664.74 |
| 2020 Octubre | 13 | Miércoles | 3920.00 | 3814.00 | | 3794.45 |
| 2020 Noviembre | 14 | Jueves | 3942.25 | 3933.33 | | 3759.89 |
| 2020 Diciembre | 15 | Viernes | 3921.00 | 3900.00 | | 3838.87 |
| | 18 | Lunes | 3856.00 | 3850.10 | | 3667.97 |
| | 19 | Martes | 3835.00 | 3826.00 | | 3466.30 |
| | 20 | Miércoles | 3812.00 | 3805.00 | | |
| | 21 | Jueves | 3772.00 | 3758.00 | | |
| | 22 | Viernes | 3785.00 | 3765.00 | | |

| | | |
|--|--|---|
| 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 |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | | Versión: 03 |
| | | Página: 81 / 98 |



Ilustración 56 - Grafico mejor demanda y oferta

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 16:30 para el mercado Next Day.


| Precios | | Horario : 08:00 - 16:30 | |
|-------------------|-----------|-------------------------|---------|
| Apertura*: | 3669.00 | Minimo*: | 3669.00 |
| Cierre*: | 3672.00 ↑ | Promedio: | 3667.34 |
| Hora últ. trans*: | 15:31:00 | Maximo*: | 3672.00 |
| Montos en miles | | | |
| Negociado: | 204'255 | Ultimo*: | 500 |
| Transacciones: | 49 | Promedio: | 4'168 |
| | | Mínimo: | 18 |
| | | Máximo: | 20'000 |

* No incluye transacciones registradas

[Imprimir](#)
[Detalle](#)
[Anteriores](#)

Ilustración 57 - Resumen de hoy

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 82 / 98 |

Estadísticas de Precios




| 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 Promedio | Precio promedio ponderado de todas las operaciones transaccionales y de registro con cualquier origen. |
| 6 | Mínimo | Precio mínimo operado en la ventana transaccional |
| 7 | Máximo | Precio máximo operado en la ventana transaccional |

Estadísticas de Montos




| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 83 / 98 |


| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|---------------|---|
| 1 | Negociado | Monto total negociado en la jornada (incluye operaciones transaccionales y de registro). |
| 2 | Transacciones | 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 |

2.12. CONSULTAS

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.



| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 84 / 98 |




| Fecha | Hora | Suc. | Usuario | O/D | Precio | Monto T | Monto Total | C |
|------------|----------|------|---------|-----|---------|---------|-------------|---|
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.10 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.15 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.20 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.25 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.30 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.35 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.40 | 250 | | |
| 14/04/2021 | 10:42:15 | DVNB | HENRY | O | 3452.45 | 250 | | |


Ilustración 58 - Consulta de ingresos

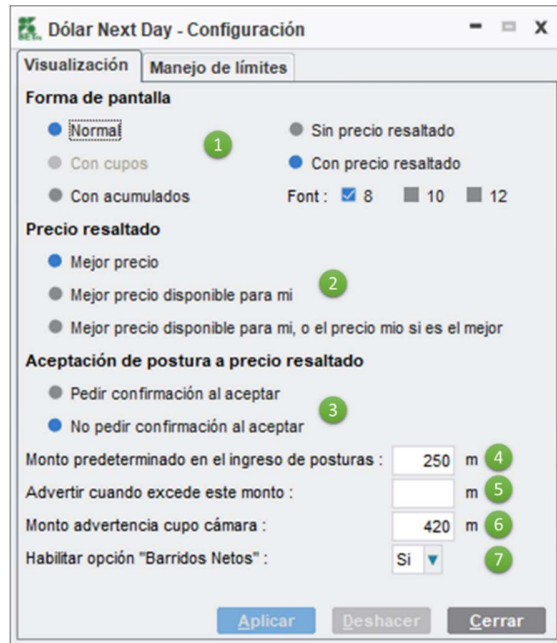
2.13. Configuración Del Mercado

El botón  abre la ventana de configuración del mercado Next Day, en la cual el usuario tendrá acceso a algunas opciones que afectarán la visualización de la ventana “Dólar Next Day” y podrá establecer otras configuraciones de 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 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 85 / 98 |




| Ítem | Nombre | Descripción |
|------|-------------------|--|
| 1 | Forma de pantalla | <ul style="list-style-type: none"> Normal: Permite visualizar las posturas en la ventana de "dólar Next Day" con precio y monto Con acumulados: Permite visualizar las posturas en la ventana de "dólar Next Day" con precio, monto, monto acumulado, precio promedio en cada línea Sin precio resaltado: en la ventana de "dólar Next Day" 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 Next Day"</p> <ul style="list-style-type: none"> Mejor precio Mejor precio disponible para mi |

| | | |
|--|--|---|
| 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 |
|--|--|---|

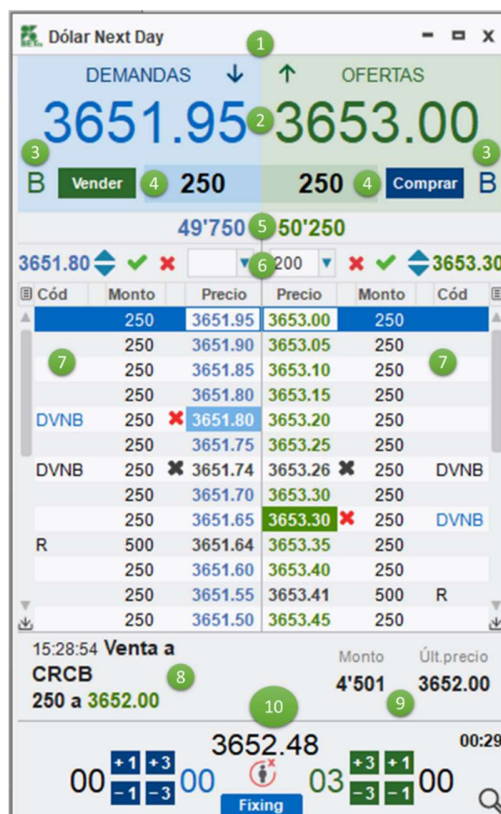
| | | |
|---|-------------------------------|--|
|  | MANUAL DE USUARIO | Código: IGO020204 |
| | | Archivo: IGO020204 Administrar SET-FX |
| | MERCADO DÓLAR NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 86 / 98 |

| | | |
|----------|--|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> • 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. |
| 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 Next Day" |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 87 / 98 |

3. VENTANA DÓLAR NEXT DAY



| 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 |

| | | |
|--|--|---|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 88 / 98 |

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.

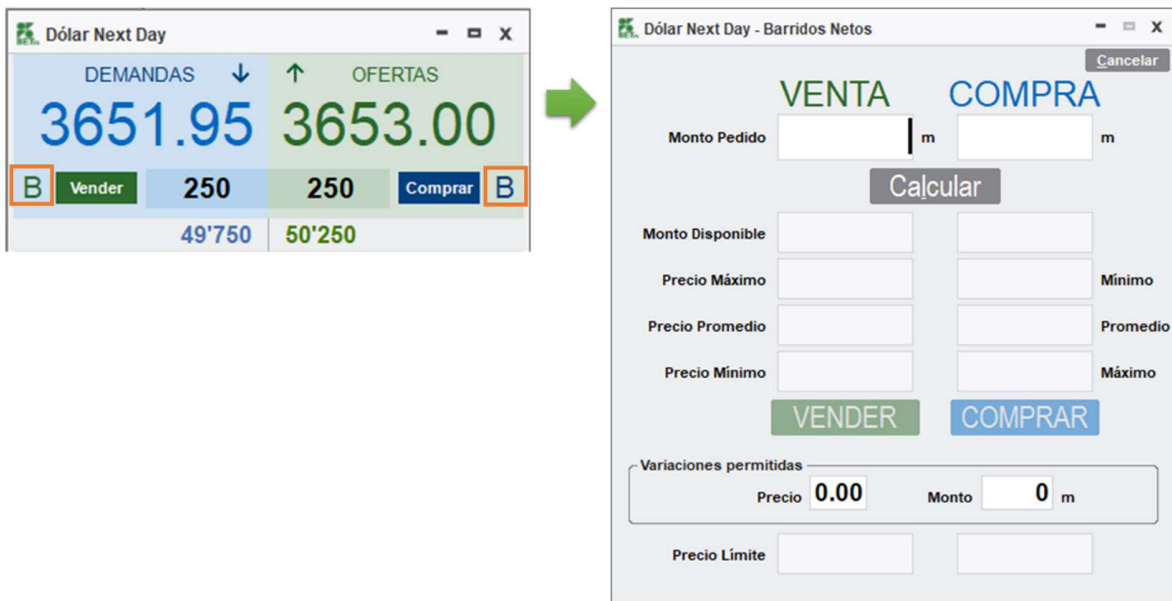




Ilustración 59 - Ventana barridos netos


| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 89 / 98 |



| 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 agredible 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 90 / 98 |

| | | |
|-----------|-------------------------------|---|
| | | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 91 / 98 |

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 GOTEO (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 | 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 92 / 98 |

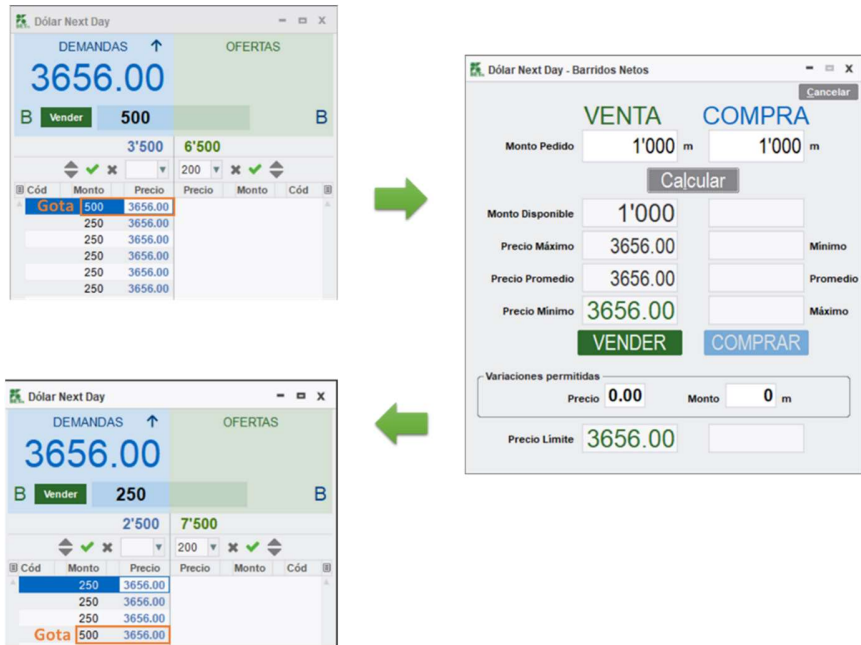



Ilustración 60 - Ejecución barridos netos con posturas de goteo

En el caso en el que la agresión de la postura visible con la condición de goteo 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 93 / 98 |

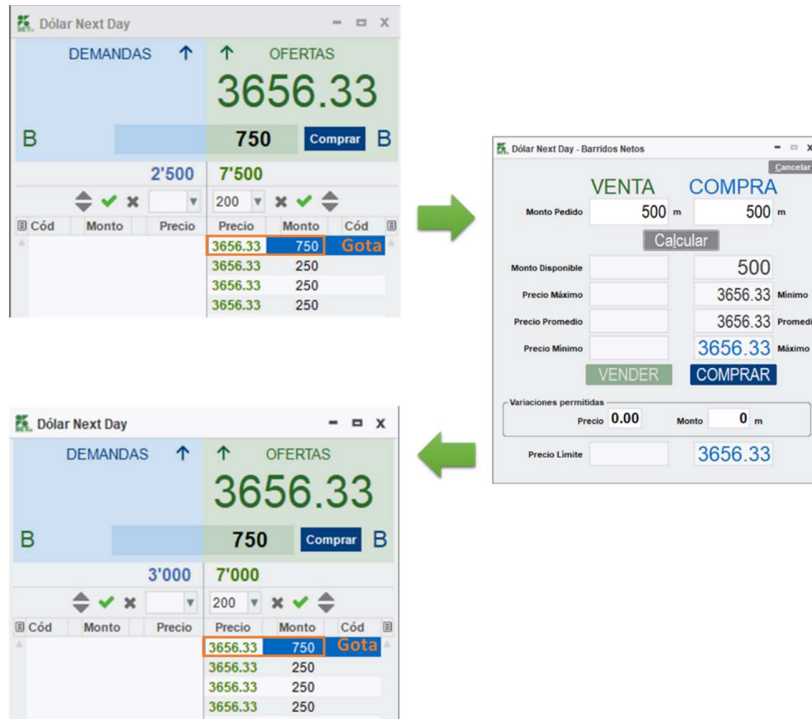



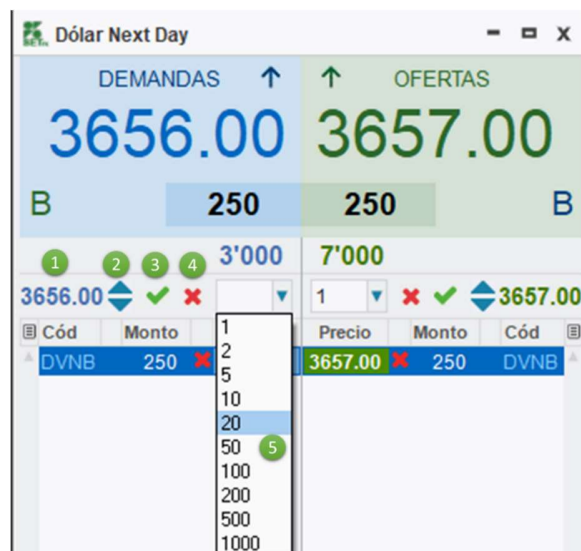
Ilustración 61 - Ejecución barridos netos con posturas de goteo

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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 94 / 98 |




| 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 | Ingresa 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. PROCEDIMIENTO PARA LA MODIFICACIÓN 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 y en atención al siguiente procedimiento:

- Este procedimiento se aplica si la modificación es requerida pasados más de quince (15) minutos posteriores a la ejecución de la operación. Para aquellos casos en que se requiera

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 95 / 98 |

modificar una operación dentro de los quince (15) minutos posteriores al cierre de una operación, las contrapartes podrán realizar la anulación de la operación a modificar y el registro de una nueva sin intervención del administrador.


- El afiliado interesado en realizar la modificación de una operación deberá informar dicha situación al administrador del Sistema a través de un medio verificable, bien sea mediante el “chat” del SET-FX, correo electrónico o vía voz (llamada telefónica). En el caso de operaciones realizadas entre dos IMC afiliados, ambos deben informar al administrador la intención de modificación.
- El administrador habilitará el Sistema para iniciar el proceso de modificación, permitiendo en primera instancia la anulación de la operación a modificar, tal como se muestra a continuación:



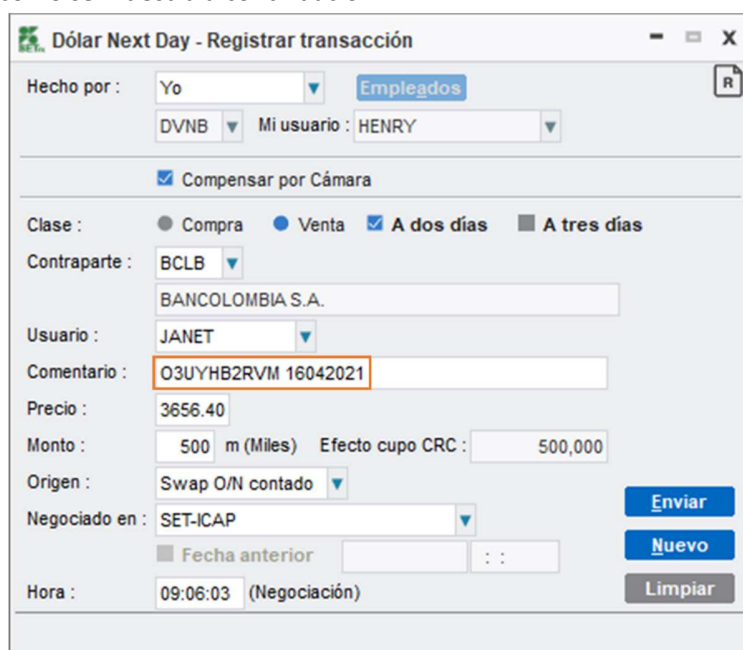
Posteriormente aparecerá una “X” sobre la operación a modificar, en el respectivo Blotter de operaciones:

| Dólar Next Day - Transacciones | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------|----------|------------|-----------|-----------|---------|-------|------|---|---|---|-----|----|----|---|----|----|----|
| Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit. | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fecha | Hora | H.Reg | Código | Usuario | C/V | Precio | Monto | Cód. | A | R | E | Ori | vC | FV | I | Ca | sC | pA |
| 16/04/21 | 11:14:01 | | O3UYHB2RTX | HENRY | Venta | 3656.30 | 250 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| 16/04/21 | 11:14:01 | | O3UYHB2RTY | HENRY | Venta | 3656.30 | 250 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| 16/04/21 | 11:19:05 | | O3UYHB2RV0 | HENRY | Venta | 3656.00 | 500 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| 16/04/21 | 11:19:05 | | O3UYHB2RV1 | HENRY | Venta | 3656.00 | 250 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| 16/04/21 | 11:19:05 | | O3UYHB2RV2 | HENRY | Venta | 3656.00 | 250 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| 16/04/21 | 11:39:48 | | O3UYHB2RVM | HENRY | Compra | 3656.33 | 500 | | A | | | | | 1 | | | | C |
| Total compras sucursal: | | | | 500,000 | | 3656.33 | | | | | | | | | | | | |
| Total ventas sucursal: | | | | 2'500,000 | | 3656.19 | | | | | | | | | | | | |
| En Cámara | Compras | Pérd/Gan | Ventas | Pérd/Gan | Netos | | | | | | | | | | | | | |
| DVN: | 500,000 | | 2'500,000 | | 2'000,000 | | | | | | | | | | | | | |
| Cupo: | 7'000,000 | | 3'000,000 | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 96 / 98 |

- El afiliado debe “anular” la operación marcada con una “X”. Posteriormente, debe ingresar la nueva operación corregida incluyendo en el campo “Comentario” el código de la operación anulada (seguido de un espacio) y la fecha en la que se registró la operación anulada, tal como se muestra a continuación:



Dólar Next Day - Registrar transacción

Hecho por : Yo Empleados

DVNB Mi usuario : HENRY

Compensar por Cámara

Clase : Compra Venta A dos días A tres días

Contraparte : BCLB
BANCOLOMBIA S.A.

Usuario : JANET

Comentario : 03UYHB2RVM 16042021

Precio : 3656.40

Monto : 500 m (Miles) Efecto cupo CRC : 500,000

Origen : Swap O/N contado

Negociado en : SET-ICAP

Fecha anterior : : :

Hora : 09:06:03 (Negociación)


Enviar Nuevo Limpiar

Nota:

- Primero se debe indicar el código y luego la fecha de la operación anulada.
- El código y la fecha de la operación anulada deben ser separados por un espacio
- La fecha no debe contener ningún tipo de separadores y debe ingresarse en el siguiente formato: **DDMMAA**
- La modificación de operaciones solamente procederá de conformidad con la regulación vigente, por lo tanto si bajo las normas aplicables alguna operación no es modificable, el afiliado deberá abstenerse de realizar este procedimiento

7. ANULACIÓN DE OPERACIONES

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 97 / 98 |

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 Next Day -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 operación ya hubiera sido enviada a la CRCC, una vez la solicitud de anulación ha sido aceptada, el sistema envía una solicitud de anulación a la CRCC y el estado del pedido de anulación se cambia a “Pendiente Cámara”. En este caso la CRCC es quien confirma o rechaza finalmente la anulación de la operación. Si la CRCC rechaza la anulación, la operación queda en firme; de lo contrario la operación es retirada del sistema y el sistema SET-FX guarda toda la trazabilidad de la anulación.

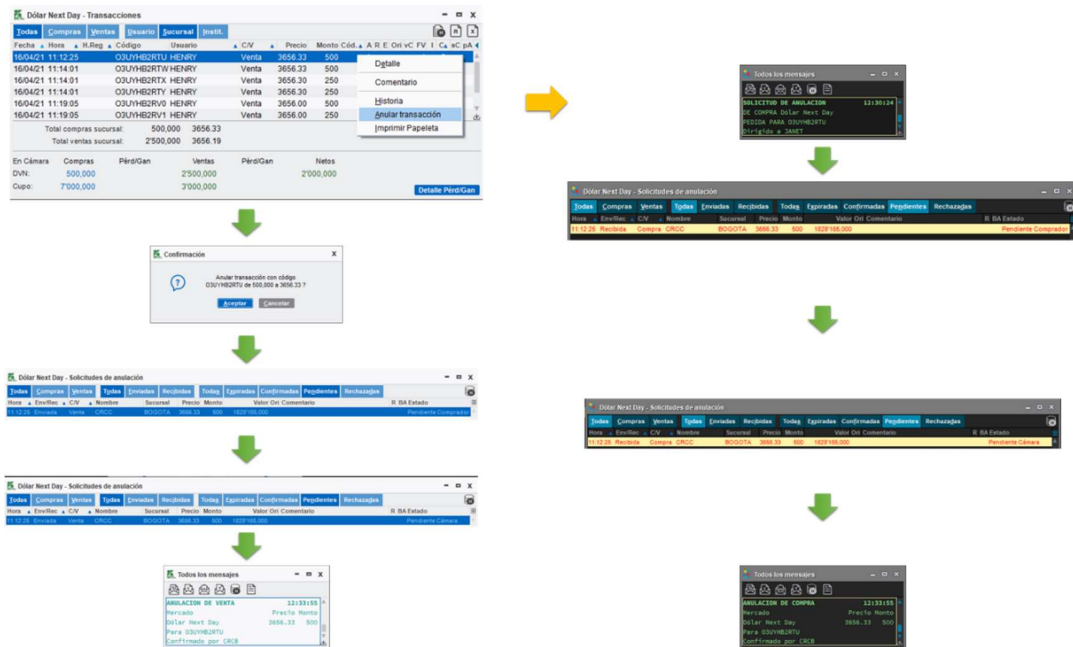



Ilustración 62 - Ejemplo anulación de operación

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------------|
| 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 NEXT DAY | Versión: 03 |
| | | Página: 98 / 98 |

Los tiempos de solicitudes de anulación antes de pasar a un estado “expirado” están contemplados de la siguiente manera:

- Solicitante 8 minutos
- Confirmación de anulación 4 minutos
- Confirmación Cámara de Riesgo Central Contraparte 3 minutos



| Hora | Env/Rec | CV | Nombre | Sucursal | Precio | Monto | Valor Ori | Comentario | R | BA | Estado |
|----------|---------|--------|--------|----------|---------|-------|--------------|------------|---|----|----------|
| 08:06:03 | Enviada | Compra | CRCC | BOGOTA | 3653.00 | 500 | 1826'500,000 | O | R | BA | Expirada |

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 |