

INDICE GENERAL

INDIC	E GENERAL	1
EJECU	CIÓN DEL PROGRAMA PWPREI	
0. 0	PCIONES GENERALES	
0.1.	INGRESAR	
0.2.	MODIFICAR	
0.3.	ELIMINAR	
0.4.	BUSCAR	
0.5.	DETALLE	
0.6.	CARGAR	
0.7.	EXPORTAR A EXCEL	
0.8.	SALIR	12
0.9.	CALCULAR	
1. D	EFINICIÓN DE PARÁMETROS	
1.1.	OPCIÓN GENERAL	
1.1.1	. EMPRESA	14
1.1.2	. TRADERS	15
1.1.3	. MERCADOS	17
1.1.4	. GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO	
1.1.5	. LINEAS DE NEGOCIO	20
1.1.6	. TIPOS DE PORTAFOLIO	22
1.1.7	. PORTAFOLIOS	24
12		
121		
4 2 2	TIPOS FACTORES RIESGOS	
1.7.7	. TIPOS FACTORES RIESGOS.	
1.2.2	 TIPOS FACTORES RIESGOS. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO. PARAMETROS APNR 	
1.2.2 1.2.3 1.2.4	 TIPOS FACTORES RIESGOS. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO. PARAMETROS APNR RELACION DE FACTORES. 	
1.2.2 1.2.3 1.2.4 1.2.5	 TIPOS FACTORES RIESGOS. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO. PARAMETROS APNR RELACION DE FACTORES. PARAMETROS COMPROMISOS. 	27 27 30 33 33 36 39
1.2.2 1.2.3 1.2.4 1.2.5 1.2.6	 TIPOS FACTORES RIESGOS. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO. PARAMETROS APNR RELACION DE FACTORES. PARAMETROS COMPROMISOS. PARAMETRO RIESGO DE CREDITO. 	27
1.2.2 1.2.3 1.2.4 1.2.5 1.2.6 1.2.7	 TIPOS FACTORES RIESGOS. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO. PARAMETROS APNR RELACION DE FACTORES. PARAMETROS COMPROMISOS. PARAMETRO RIESGO DE CREDITO. PARAMETRO INFORME SUPERVALORES. 	27 27 30 33 33 36 39 43 43



1.2.9.	FACTOR BURSATILIDAD	51				
1.2.10.	FACTOR RIESGO EN BANDAS DE TIEMPO	53				
1.2.11.	FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO	57				
1.2.12.	FACTORES DE AJUSTE EN ZONAS Error! Bookmark not define					
1.3. NO	TAS OPERATIVAS DERECHOS					
1.4. OP	CIÓN PWPREI					
1.4.1.	PARAMETRO RIESGO	72				
1.4.2.	PARAMETRO VALORIZADOR	74				
1.4.3.	VALORAR A PRECIO DE COMPRA					
1.4.4.	TASAS DE VALORAR DINERO	77				
1.4.5.	ENTIDADES REGULADORAS					
1.4.6.	FACTORES DE RIESGO PWPREI	79				
1.4.7.	PARAMETROS CONTABLES	81				
1.4.8.	PARAMETROS MONEDA / TASAS FWD					
1.4.9.	CUPOS					
1.4.10.	FUNCIONES PARA ADMINISTRACION Y CONTROL DE CUPOS					
1.4.11.	PARAMETROS GENERALES DE PWPREI					
1.5. OP	CIÓN CONTRAPARTES					
1.5.1.	CONTRAPARTE					
1.5.2.	AGENTES EXTERIOR					
1.6. OP	CION EMISOR					
1.6.1.	PONDERACION					
1.6.2.	CUENTAS BANCARIAS					
1.6.3.	CONCENTRACION					
2. MER	CADO Y SOCIEDAD					
2.1. OP	CIÓN MERCADO					
2.1.1.	EMISORES					
2.1.2.	GRUPO EMISORES					
2.1.3.	INDICADORES					
2.1.4.	MONEDAS					
2.1.5.	TASAS					
2.1.6.	TITULOS					
2.2. OP	CIÓN VALORES DE INDICADOR					
2.2.1.	VALORES DE INDICADORES	145				
2.2.2.	VALORES DE MONEDAS	149				
2.2.3.	VALORES DE TASAS	152				
2.2.4.	ÍNDICE IPC	156				
2.2.5.	GRUPO DIAS VENCIMIENTO	158				
2.2.6.	HAIRCUT					
2.3. OP	CIÓN ESPECIES					
2.3.1.	ESPECIES/RENTA VARIABLE ACCIONES Y DIVISAS	164				



2.3.2.	ESPECIES DE RENTA FIJA	169
2.3.3.	ISINES	
2.3.4.	ESPECIES ASOCIADAS	
2.3.5.	ESPECIES EQUIVALENTES	
2.3.6.	ISIN ANNA	
2.4 00		10/
2.4. 000		104
2.4.1.		107
2.4.2.		200
2.4.3.		202
2.4.4.	CUSTODIOS	
2.5. OP		
2.5.1.	BENEFICIARIOS	
2.5.2.	NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE	209
2.5.3.	NEGOCIOS DE RENTA FIJA	
2.5.4.	NEGOCIOS DE DIVISAS	215
2.6. OP	CIÓN INFOVAL	
2.6.1.	MARGEN PROMEDIO	
2.6.2.	MARGEN PROPIO	
2.6.3.	PRECIO	
2.6.4.	CURVAS	
2.6.5.	BETAS	
2.6.6.	PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL / TODOS	
2.6.7.	CANASTA DERIVADOS	
2.6.8.	PRECIOS DERIVADOS	
2.6.9.	MARGEN INICIAL	
INFOVAL	MER	231
2.7 00		222
2.7. UP		
2.7.1.		
2.7.2.		
2.7.3.		
2.7.4.		
2.7.5.		
2.7.6.	MATRICES SFC	245
2.8. OP	CIÓN FORWARD /OPCF	
2.8.1.	TASAS FORWARD	247
2.8.2.	PIPS	255
2.8.3.	MONEDA VS DÓLAR	259
3. CIER	RE	
	NDMEC	
4. INFO	JKMES	
4.1. OP	CIÓN FORWARD	



4.1.1.	INFORME FORWARD CONTRAPARTE	
4.1.2.	INFORME FORWARD	
4.1.3.	INFORME OPCIONES	
4.1.4.	INFORME GAP	
4.1.5.	VANILLA	
4.2. O	PCION INFORMES DE RIESGO	
4.2.1.	INVERSIONES	
4.2.2.	PARTICIPACION	
4.2.3.	HISTORICO	
4.2.4.	REPORTE VaR	
4.2.5.	CONTRAPARTES	273
4.2.6.	P&G	
4.2.7.	RIESGO DE LIQUIDEZ	
4.2.8.	RLQFIC – FORMATO 519	
4.2.9.	GENERAR DESDE EXCEL	
4.3. O	PCIÓN VALORACION	
4.3.1.	SUPERVALORES – Informe Perdida/Ganancia	
4.3.2.	REPsSIMS	
4.3.3.	NOTIFICACION	
4.3.4.	MOVIMIENTOS CONTABLES	
4.3.5.	MOVIMIENTOS PORTAFOLIOS	
4.4. O	PCIÓN CONCENTRACION	
4 4 1	CONCENTRACION DE RIESGO	314
4.4.1.		
4.4.1. 4.4.2.	CONCENTRACION PORTAFOLIO	
4.4.1. 4.4.2.	CONCENTRACION PORTAFOLIO	
4.4.1. 4.4.2.	CONCENTRACION PORTAFOLIO	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD	CONCENTRACION PORTAFOLIO	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE LISUARIOS	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS	
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS	316 318 318 319 323 323 324 324 326 327
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS	316 318 318 319 323 323 323 324 324 326
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1. 0	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS GS DE AUDITORIA	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1. 0 6.1.1.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LOO 6.1.1. 6.1.2.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS	316 318 318 319 323 323 323 324 324 326 327 327 330 330 331 332 332 334
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1. 0 6.1.1. 6.1.2. 6.1.3.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS GS DE AUDITORIA ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE RENTA FIJA ESPECIE ASOCIADA	316 318 318 319 323 323 323 324 324 326 327 327 327 330 330 331 332 334 336
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. O 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1.1. 6.1.2. 6.1.3. 6.1.4.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS GS DE AUDITORIA ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE RENTA FIJA ESPECIE ASOCIADA ESPECIES EQUIVALENTES	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1.1. 6.1.2. 6.1.3. 6.1.4. 6.1.3. 6.1.4. 6.1.5.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS GS DE AUDITORIA PPCIÓN AUDITORIA ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE RENTA FIJA ESPECIE ASOCIADA ESPECIES EQUIVALENTES PARAMETROS DE RIESGO	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1.1. 6.1.2. 6.1.3. 6.1.4. 6.1.5. 6.1.6.	CONCENTRACION PORTAFOLIO MINISTRACION DE SEGURIDAD PPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD GESTION DE USUARIOS CONSULTA DE USUARIOS RESTRICCIONES DE MODULOS RESTRICCIONES DE OPCIONES INFORME DE USUARIOS CONTROL USUARIOS CONTROL USUARIOS GS DE AUDITORIA ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE RENTA FIJA ESPECIE ASOCIADA ESPECIES EQUIVALENTES PARAMETROS DE VALORACIÓN	316
4.4.1. 4.4.2. 5. AD 5.1. 0 5.1.1. 5.1.2. 5.1.3. 5.1.4. 5.1.5. 5.1.6. 6. LO 6.1. 0 6.1.1. 6.1.2. 6.1.3. 6.1.4. 6.1.5. 6.1.6. 6.1.7.	CONCENTRACION PORTAFOLIO	316



6.1.9.	PARAMETROS GENERALES	
6.1.10.	. CUPOS	
7. CIF	RCULAR 016	
7.1. O	DPCION CIRCULAR 016	
7.1.1.	FORMATOS	
7.1.2.	GENERAR FORMATOS	
7.1.3.	FORMATOS EN EXCEL	
7.1.4.	FORMATO 351 DESDE EXCEL	
7.2. 0	DPCION CIRCULAR 008	
7.3. O	DPCION BRP	
7.3.1.	EXCEL BRP	
8. PO	RTAFOLIOS Y RIESGO	357
8.1. O	DPCIÓN METODOS	
8.1.1.	SIMULACIÓN HISTÓRICA	
8.1.2.	MONTECARLO ESTRUCTURADO	
8.1.3.	DURACIÓN MODIFICADA	
8.1.4.	DELTA NORMAL (VAR RISKMETRICS)	
8.1.5.	SUPERVALORES	
8.1.6.	VALORIZADOR EXTERNO	
8.1.7.	BORRAR HISTORIAL	
8.2. O	DPCIÓN CARGA	
8.2.1.	PARÁMETROS DE LA CARGA MANUAL DE PORTAFOLIOS	
8.2.2.	DISTRIBUCION	
8.2.3.	COMPROMISOS	
8.2.4.	PROVEEDOR EXTERNO	436
8.3. O	DPCIÓN CONSULTAR	
8.3.1.	MEDICION	
8.3.2.	INFORME SUPERVALORES	
8.3.3.	VER INVERSIONES	
8.4. O	DPCIÓN VeR POSPRO	
GENER	AR VeR POSPRO	
CONSL	JLTAR VeR POSPRO	
FORM	ATOS	450
INFORI	ME FORMATOS	450
8.5. O	DPCIÓN VER FONDO	450
8.5.1.	CONSULTAR	451
8.5.2.	GENERAR	451
8.5.3.	FORMATOS	452
8.5.4.	INFORME DE FORMATOS	



8.5.	5.	LIMPIAR FONDOS	452
8.5.	6.	453	
8.6.	OPC	IÓN VeR RESERVAS	454
8.6.	1.	455	
8.6.	2.	455	
8.6.	3.	456	
8.6.	4.	457	
ELIN	MINAC	CION Y RECUPERACION DE OPERACIONES	457
GAF	RANTI	AS ADICIONALES Y PARAMETROS CVA	459
INF	ORME	DE VAR POR PORTAFOLIO APTS	465
SIN	CRON	IZACION DE PORTAFOLIOS	466
NO	TAS –	DISEÑO OPERACIONES INTERNACIONALES	468
NO	TAS O	PERATIVAS – DERIVADOS Y TASAS	469
9. (CARC	GA BOF	
9.1.	OPC	IÓN MEC	
9.1	1.	NOTAS CARGA MASTER TRADER	
9.1	2	CARGAMESA	484
9.1	3	CARGAR MEC	486
9.1	4	CALCE / VENTAS	487
9.1	5	REG ISINES	490
9.1.	6	MI DIA	
0.1	7		
9.1.	2. 2		
9.1.	0.	SLOUINCIAS - FTOCORTOS	
10.	CO	NTABILIZAR	
10.1.	GEN	IERAR MOVIMIENTOS CONTABLES	507
10.2.	CUN	IPLIMIENTO Y RECAUDO	508
10.3.	NO	A OPERATIVA- DIFERENCIA EN CAMBIO TITULOS	512
11.	VA	LORIZADOR	
11 1			514
11 1	1 1		
11 1	1.1.	VALORIZAR ΤΙΤΗΙ OS AL DESCHENTO POR TASA	516
11 1	1 3		
11 1	1 <u>4</u>		
11 -	15		510 دیں
11 1	1.5.		
11 1	1 7		
11 11 /	1.7.		JZI ביז
11 11 /	1 0.		
11 11 -	1 10		
тJ.	1.10.		



11.2.	OPCIÓN VAL HISTÓRICOS	542
11.2	L. HISTORICO RF	542
11.2	P. HISTORICO ACC/DIV	547
11.3.	OPCIÓN DERIVADOS	547
11.3	L. VALORIZAR OPCIONES	548
11.3	2. VALORIZAR LOS DERIVADOS / TEORICO	548
12.	ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD	552
12.1.	SIMULACIÓN HISTÓRICA	555
12.2.	MONTECARLO ESTRUCTURADO	555
12.3.	DURACIÓN MODIFICADA	555
12.4.	DELTA NORMAL	556
12.5.	ARQUEO	556
12.6.	VER INVERSIONES	560
13.	BACKTESTING	561
13.1.	SIMULACIÓN HISTORICA BACKTESTING	561
13.2.	MONTECARLO ESTRUCTURADO BACKTESTING	567
13.3.	DURACIÓN MODIFICADA BACKTESTING	569
13.4.	DELTA NORMAL BACKTESTING	570
FRONT	RA EFICIENTE	573
FRONT	RA EFICIENTE – DELTA NORMAL	576
Accione	5	578
Divisas		580
VER IN	ERSIONES	580
14.	MARGINAL AND INCREMENTAL VAR	
14.1.	OPCIÓN METODOS	582
14.1	. DURACION MODIFICADA	
14.1	2. DELTA NORMAL	



15.	DI	VISAS IMC / SUPERBANCARIA - CIRCULAR 031	587
15.1.	OP	CIÓN PARÁMETROS	
15.	1.1.	TIPO DE ENTIDAD	
15.	1.2.	SUPERBANCARIA	
15.	1.3.	FONDO FIDEICOMISO	
15.	1.4.	PUC	
15.	1.5.	FILTROS	
15.	1.6.	COLUMNAS	601
15.2.	OP	CIÓN FORMATOS	603
15.	2.1.	FORMATOS	
15	2.2	EORMATOS EXTERNO	607
15	23		609
15	2.0.	ΙΝΕΩΡΜΑCΙΩΝ ΕΩΡΜΑΤΩ 031	612
15.	2.5.	FORMATO FIDEICOMISO	615
15.3.	OP		
15.	3.1.	GEN IMC / FORMATO 230	617
15.	3.2.	F-DIVISAS	618
15.	3.3.	INFORME SUPERBANCARIA	618
15.	3.4.	PLANO	619
TRA	ACKIN	G VAR AND PERFORMANCE ATTRIBUTION	619
16	۸۵	EDCA DE	676
10.	AU		
17.	PA	RAMETRIZACION CONTABLE	626
18.	GL	OSARIO PWPREI	
10.	41		
В	•••••		
с			
D			
F			727
L	•••••		
F	•••••		
I			
Р			
R			
S			



Т	
V	



EJECUCIÓN DEL PROGRAMA PWPREI

Para ingresar a **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES**, lo podrá hacer de dos formas: la primera de ellas es haciendo doble clic en el acceso directo que el proveedor haya instalado en el Escritorio del Computador. La segunda forma es dando clic en Inicio – Programas – **PWPREI RIESGO E INVERSIONES**. Después de que se haya ingresado aparecerá la siguiente pantalla:

REI PWPREI - INGRESO AL SISTEMA				
REI	Código Usuario administrador Contraseña *** Servidor Entidad			
Cambiar Aceptar 🔀 Cerrar				

En esta pantalla deberá ingresar el Código de Usuario y Contraseña suministrados por el Administrador del Sistema. Si estos datos son válidos podrá ingresar al menú principal de **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES**. En caso de que digite tres veces datos incorrectos el programa se saldrá.

Servidor: Dirección en la que se encuentra instalado el aplicativo principal.

Entidad: Entidad en la cual se encuentra instalado el aplicativo.

Cambiar Contraseña: El sistema le pedirá cada mes que se cambie la contraseña.

🛷 PWPREI - CAMBIAR CONSTRASEÑA					
Código Usuario	PWPREI				
Contraseña Anterior					
Contraseña					
Confirmar Constraseña					
	Aceptar 🛛 🔀 Cerrar				

MENU PRINCIPAL PWPREI – RIESGO E INVERSIONES



La pantalla principal del sistema se muestra a continuación y en ella encontrará cada uno de los módulos del mismo. Para acceder a ellos solo deberá dar clic sobre el botón o la opción correspondiente.

Así mismo al posicionarse en cada uno de los botones aparecerá en la parte inferior en la barra gris y en color azul, la descripción de lo que a grandes rasgos y generalmente hace cada uno de los módulos de **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES**.



Ver Accesos Con este botón puede verificar los últimos ingresos exitosos o fallidos al sistema A medida que se registren accesos fallidos estos quedarán registrados en el cuadro informativo una vez ingrese un acceso exitoso, borrara los ingresos fallidos.

0. OPCIONES GENERALES

Las funcionalidades que se muestran a continuación son generales a todas las opciones de este módulo, a excepción de Mercados. Tales opciones aparecerán siempre en la parte superior izquierda cada vez que se oprima algún botón. La barra es la siguiente:





- **1.** Ingresar
- 2. Modificar
- 3. Eliminar
- 4. Buscar
- 5. Detalle
- 6. Cargar Datos
- 7. Exportar a Excel
- 8. Salir
- 9. Calcular

0.1. INGRESAR

Esta opción se utiliza para registrar datos nuevos en la base de datos de acuerdo a la opción requerida.

0.2. MODIFICAR

Esta opción se utiliza para modificar datos existentes en la base de datos de acuerdo a la opción requerida.

0.3. ELIMINAR

Esta opción se utiliza para eliminar datos en la base de datos de acuerdo a la opción requerida.

0.4. BUSCAR

Esta opción tiene la misma funcionalidad en todas las pantallas que se muestren en este módulo. Es decir permite hacer consultas a toda la información que se encuentra almacenada en la base de datos por cada uno de sus campos principales.

0.5. DETALLE

Esta opción se utiliza para ver en detalle la información de la operación que se haya llevado a cabo. Con esta pantalla no se podrá eliminar ni modificar

0.6. CARGAR

Esta opción se utiliza para cargar la información del mercado y de la compañía a la base de datos.

0.7. EXPORTAR A EXCEL

Esta opción se utiliza para exportar toda la información generada por PWPREI a Excel.

0.8. SALIR

Esta opción se utiliza para ir hacia atrás

0.9. CALCULAR

Esta opción se utiliza para calcular Datos en el Modulo Infoval.



1. DEFINICIÓN DE PARÁMETROS



Al dar clic en este Icono el sistema lo llevará a la pantalla para manejo de los parámetros con los cuales debe alimentarse el sistema para organizar sus portafolios, conocer el modelo de riesgo a utilizar, con que parámetros realizar las evaluaciones, como mostrar la información etc. Estos parámetros se encuentran divididos en Generales, Supervalores, PWPREI y Contrapartes.

Como se observa en la figura que se muestra a continuación se puede acceder a las distintas opciones a través de los Iconos (Gráficos) ubicados en la columna del extremo izquierdo ó a través de las opciones que se encuentran en la barra superior.

DEFINICION DE PARAMETROS							
Archivo Ge	eneral	Super Valores	PWPREI	ContraPartes	Ventana		
General							
Super Valo	res						
PWPRE	I						
Contrapart	ies						
Emisor							
Salir							



1.1. OPCIÓN GENERAL



Se definen las estructuras de administración de los Portafolios.

1.1.1. EMPRESA

Por medio de esta opción se ingresa la información general de la empresa, esta información se ingresa una sola vez, y contiene datos que serán utilizados posteriormente en informes y listados.





1.1.2. TRADERS

😭 D	EFINICIO	DH E	E PAR	AMETROS - [Tra	iders]													ð	×
<u>8</u> A	Archivo G	iener	al Sup	er Valores PWPRE	EI ContraPartes Ver	ntana												. 8	×
Ð.	🎝 📝	۲																	
	General		Código	Identificación	Nombre	Mesa	Portafolio	Asociad	Código BVC	Código Ser	Código SET	Tipo Linea	Dire	Ciudad	Telefono	Email	Celula		^
			AV	AV	AV	MESA1	MESA 01	NO		:6134CNNII		POSPRO							
	BBB		BL	BL	BERNARDO LOPEZ	MESA1	MESA 12	NO		:6017CNNI	01SL	POSPRO							
			CAL	CARLOS LOPEZ	CARLOS LOPEZ	MESADOLAR	MESA 14	NO		N16		POSPRO							
	Empresa	.	CAL1	ID CAL1	NOMBRE CAL1	MESADOLAR	MESA 14	NO		01026013		POSPRO							
			CAL2	ID CAL2	NOMBRE CAL2	MESADOLAR	MESA 15	NO		01026020		POSPRO						1	
	<u></u>		CO	CO	CO	MESA1	MESA 04	NO		:6210CNNII		POSPRO						1	
	Traders		JB	JB	JB	MESARF	MESA 05	NO		01026004		POSPRO						1	
	22		JR	JR	JR	MESA1	MESA 06	NO		01026001		POSPRO						1	
Ι.	, V , J		JS	JS	JS	MESA1	MESA 07	NO		:6020CNNII		POSPRO						1	
P	viercados		LD	LD	LD	MESA1	MESA 09	NO		:6213CNNII		POSPRO							_

Al ingresar a esta opción se despliega una cuadricula donde posteriormente se verán los datos de Identificación y Nombre de los Traders autorizados por cada Compañía.

1.1.2.1. INGRESAR TRADERS

Para ingresar un Trader digite la Identificación (Puede contener números y letras de un máximo de 20 caracteres) y el Nombre. A continuación haga clic en aceptar y el programa ingresara la información digitada.

😫 Traders - I	ngresar	×
Código	1	
Identificación		
Nombre	,	
Mesa	_	
Portafolio	•	
Asociado	•	
Código BVC		
Código SEN		
Código SETFX		
Tipo Linea	•	
Dirección		
Ciudad		
Telefono		
Email		
Celular		
	ceptar 💟 Cerrar	



1.1.2.2. MODIFICAR TRADERS

	🛢 Traders - J	Aodificar	×		
	Código	PEPE			
	Identificación	123			
	Nombre	PEPE			
	Mesa	MESA1			
	Portafolio	Jotica 🗨			
	Asociado	NO 💌			
	Código BVC	1003001			
	Código SEN	143			
	Código SETFX	145			
	Tipo Linea	POSPRO			
	Dirección	123			
	Ciudad	CALI			
	Telefono	123			
	Email	pepe@pepel.com			
	Celular	123			
l					
	Aceptar 🔀 Cerrar				

Para modificar un Trader sitúese en la cuadricula sobre el ítem que desea modificar y haga clic en el botón de modificación arriba indicado, inmediatamente le mostrara la pantalla para la operación respectiva; así mismo puede dar doble clic sobre el ítem a modificar e inmediatamente aparece la pantalla correspondiente. El sistema solo le permite modificar el nombre si desea cambiar la identificación deberá eliminar el registro.



1.1.2.3. ELIMINAR TRADERS

Código	PEPE	
Identificación	123	
Nombre	PEPE	
Mesa	MESA1	
Portafolio	Jotica 🗾	
Asociado	NO	
Código BVC	1003001	
Código SEN	143	
Código SETFX	145	
Tipo Linea	POSPRO	
Dirección	123	
Ciudad	CALI	
Telefono	123	
Email	pepe@pepe.com	
Celular	123	

Si desea eliminar un registro ubíquese en el registro deseado y haga clic en el botón de eliminación arriba indicado, inmediatamente aparecerá la pantalla correspondiente. Una vez haga clic sobre el botón de aceptar el programa a continuación le pregunta si está seguro o no de eliminar el registro.

1.1.3. MERCADOS

La opción Mercados es de tipo informativo (No se puede Eliminar, Ingresar ni Modificar mercados) y muestra la clasificación dentro de la cual se evaluaran los distintos tipos de portafolios. Ejemplo: Acciones, Renta Fija, Divisas etc.



DEFINICION I	DEFINICION DE PARAMETROS - [Mercado]						
🙀 Archivo Gene	Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana						
ي ا 🕼	2 🕫						
General	Código	Descripción					
	ACC	ACCIONES					
	DV	DIVISAS					
NITERIA.	GEN	GENERICO					
Empresa	RF	RENTA FIJA					
	RG	REGISTRO					
I raders							
Mercados							

1.1.3.1. Detalle mercados

Ubique el cursor sobre la cuadricula en el ítem del cual desea ver el detalle haga clic sobre el botón arriba descrito el sistema desplegará la siguiente pantalla a manera de información.

💓 Mercado -	Detalle 🔀
Código Descripción	DV DIVISAS
	Cerrar

1.1.4. GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO

Al ingresar al Icono de Grupos/Líneas de Negocios se despliega la cuadricula donde se verán posteriormente las diferentes categorías donde están agrupadas las Líneas de Negocio que tenga la compañía.



🔄 DEFINICION I	DEFINICION DE PARAMETROS - [Grupo/Linea]						
🛃 Archivo Gener	ral Super-Valores F	PWPREI ContraPartes Ventana					
Ng 🕼 📝 🚿							
General	Código	Descripción					
	ASVALORES	ASVALORES S.A. COM. BOLSA					
	BANCA	BANCA DE INVERSION IDP					
	CLIENTES	PORTAFOLIOS CLIENTES					
Empresa	EJEMPLO	GRUPO DE PRUEBAS					
	FIDU	FIDUCIARIA CORFIVALLE					
	GFRONT	GRUPO FRONT					
Traders	GRUPO CB	PORTAFOLIO CASA DE BOLSA					
221	GRUPOBPT	PORTAFOLIO BANCO PANAMÁ TEORII					
	GRUPOCFV	PORTAFOLIO CORFIVALLE					
Mercados	GRUPOCEVT	PORTAFOLIO TEORICO CFV					
	HORIZONTE	PORTAFOLIO DE HORINZONTE					
	LEASING	PORTAFOLIO LEASING VALLE					
G/L	NEGOCIO	DESCRIPCION NEGOCIO					

1.1.4.1. INGRESAR GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO

🎫 Grupo/Línea de Negocio - Ingresar 🛛 🛛 👂				
Código Descripción				
	Aceptar 🔀 Cerrar			

Para ingresar un grupo de líneas de negocio haga clic sobre el botón de ingreso arriba descrito. El sistema despliega la pantalla para digitar el Código y la Descripción del grupo de líneas de negocio.

1.1.4.2. MODIFICAR GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO

Para modificar un registro sitúese en la cuadricula sobre el ítem requerido y de clic en el botón de modificación arriba descrito o puede también dar doble clic en el registro para que el sistema despliegue la pantalla que se muestra en la parte superior. Solo se puede modificar la descripción del grupo de líneas de negocio.





1.1.4.3. ELIMINAR GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO



Para eliminar un registro sitúese en la cuadricula sobre el registro a eliminar y Pulse el botón mostrado en la parte superior, el sistema le mostrará la pantalla con el registro a eliminar, al dar clic en el botón de aceptar el sistema le mostrará un mensaje donde le pregunta si esta seguro o no de eliminar el registro.

1.1.5. LINEAS DE NEGOCIO

Al ingresar al Icono de Líneas de Negocio se despliega la cuadricula donde se verán posteriormente las diferentes categorías donde están agrupados tipos de portafolios establecidos por la compañía y que más adelante serán necesarios en la creación de los portafolios.



DEFINICION D	DEFINICION DE PARAMETROS - [Línea de Negocio]					
🚎 Archivo Gener	🎬 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana					
Ng 🚨 📝 🔍	à 🏚 🛐 🔍					
General	Código	Descripción	Grupo			
	513 LINEA	PRUEB JOSE NIVEL II	PRUEBA 513			
	ABIERTOS	FONDOS ABIERTOS	SOCIEDAD			
	BOG	BOGOTA	PP			
Empresa	BONACCION	BONO YANKE-ACCIONES	HORIZONTE			
_	CERRADOS	FONDOS CERRADOS	SOCIEDAD			
Tradera	CLIENTES	CLIENTES	CLIENTES			
i raders	CORPORATIV	CORPORATIVO	CLIENTES			
221	CPINTER	CP. INTER	SCINTER			
	CTA PROPIA	CTA PROPIA BCO	CLIENTES			
Mercados	FID	FIDUCIARIA	FIDU			
_ _	FONDO	FONDO ASVALORES	ASVALORES			
	FONDO BCO	FONDO BANCO	POSICIONES			
G/L	LEASING VA	LINEA PORTAFOLIO LEASING	LEASING			
	LFRONT	LINEA FRONT	GFRONT			
	LICORERA	IND LICORES	HORIZONTE			
Lineas	LINBANCA	IDP BANCA DE INVERSION	BANCA			

1.1.5.1. INGRESAR LINEAS DE NEGOCIO

Para ingresar información de línea de negocio haga clic en el botón de ingresar para que el sistema le despliegue la pantalla para digitar la información correspondiente. Aquí se deberá ingresar el nombre de la línea de negocio, la descripción y el grupo al que pertenece (previamente ya creado). Si aún no se han creado grupos deberá hacerlo primero, de lo contrario no podrá crear las líneas de negocio.

🖼 Línea de I	🗃 Línea de Negocio - Ingresar 🛛 🛛				
Linea Descripción Grupo					
	Aceptar 🔀 Cerrar				

1.1.5.2. MODIFICAR LINEAS DE NEGOCIO





Para modificar la línea de negocio, de clic en el botón de modificación o doble clic sobre el registro requerido, posteriormente en Aceptar. Solo podrá modificar la descripción y el grupo.

1.1.5.3. ELIMINAR LINEAS DE NEGOCIO



Para eliminar un registro ubicar en la cuadricula el ítem requerido, de inmediato el sistema le traerá la pantalla para eliminar el registro seleccionado, cuando seleccione aceptar el sistema le preguntará si desea o no eliminar el registro.

1.1.6. TIPOS DE PORTAFOLIO

Al dar clic en el botón Tipos de Portafolio aparecerá la cuadricula de información de los tipos establecidos en la compañía y dentro de los cuales finalmente estarán los portafolios.

🚰 DEFINICION DE PARAMETROS - [Tipo de Portafolio]						
🎾 Archivo Gene	ral Super-Valores PWPRE	I ContraParte	s Ventana			
Ng 🔱 🛐 🚿						
General	Código	Mercado	Moneda			
	513 TPORTA	GEN	GEN			
	BONOS	RF	COP			
NIE III	CDT	RF	COP			
Empresa	EXTERNO	GEN	TRM			
	GARANAC	GEN	GEN			
	GARANDR	GEN	GEN			
I raders	GARANDV	GEN	GEN			
221	GARANRF	GEN	GEN			
. \ ₩-	GEN	GEN	GEN			
Mercados	GNA	GEN	GEN			
	MARGEN	GEN	GEN			
	MARPROPIO	GEN	COP			
G/L	OTROS	GEN	GEN			
	PORTAFOLIO	GEN	GEN			
	TES FIJA	RF	COP			
Lineas	TES USD\$	RF	TRM			
	TES UVR	RF	UVR			
	TFID	GEN	GEN			
Tipo Porta	TFRONT	GEN	GEN			
	TIPO EJEMP	RF	COP			



1.1.6.1. INGRESAR TIPOS DE PORTAFOLIO

🇭 Tipo de	Portafolio - Ingr 🔀
Nombre Mercado Moneda	
X	Aceptar 🔀 Cerrar

Para ingresar Tipos de Portafolio haga clic en el Icono descrito arriba, el sistema despliega la pantalla para ingreso de datos, los campos de mercado y moneda se pueden seleccionar por medio de las opciones que ahí se muestran.

1.1.6.2. MODIFICAR TIPOS DE PORTAFOLIO

🎾 Tipo de	Portafolio - Modi 🔀
Nombre	513 TPORTA
Mercado	GEN 🗨
Moneda	GEN 🗨
	Aceptar 🔀 Cerrar

Para modificar un registro seleccione el que desea modificar de la cuadricula dando clic sobre el botón de modificación o doble clic sobre el ítem requerido. El sistema le traerá la pantalla con la información que desee modificar. Solo lo podrá hacer con el Mercado y la Moneda.

1.1.6.3. ELIMINAR TIPOS DE PORTAFOLIO

Para eliminar un registro seleccione el ítem a borrar en la cuadricula, el sistema le mostrará la pantalla con la información a eliminar, si da aceptar el sistema le reconfirma si desea o no eliminar el registro.





1.1.7. PORTAFOLIOS

💣 DEFINICION DE PARAMETROS - [Portafolio]						×					
🕷 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana 🗕 🗗						a ×					
N 🔉 🝸 🔌											
General	Nombre	Nit1	Nit2	Nit3	Tipo	Linea de Negocio	Tipo de Fideicomiso	CodigoFF	Bloqueo	Estado	^
	ACCIONES				MARPROPIC	CTA PROPIA	NINGUNO	0000		ACTIVO	
	BP-RENTA FIJA BRASIL	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
NEL	BP-RENTA FIJA COLOMB	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
Empresa	BP-RENTA FIJA MEXICO	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
<u></u>	BP-RENTA FIJA U.S.A.	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
	CARLOS	555555555555555555555555555555555555555			GNA	513 LINEA	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
maders	CLIMAR1	CLIMAR1			MARGEN	PUBLICO			SI	ACTIVO	
<u>```</u>	CLIMAR2	CLIMAR2			MARGEN	PUBLICO			SI	ACTIVO	
	CTA PROPIA OTROS	02			CDT	CTA PROPIA	NINGUNO	0			
Mercados	CTA PROPIA TES FIJA	02			TES FIJA	CTA PROPIA	FID. DE INMOBILIARIO	0			
	CTA PROPIA USD\$	02			TES USD\$	CTA PROPIA	FID. DE INMOBILIARIO	0			
	CTA PROPIA UVR	02			TES UVR	CTA PROPIA	FID. DE INVERSION	0			
G/L	DIVISAS	01			GEN	CTA PROPIA	FID. DE INVERSION	1		ACTIVO	
	EMISOR GNA	8903229051			OTROS	SCB	NINGUNO	0			
	EMISORES PRIV.	8903229051			OTROS	SCB	NINGUNO	0			
Lineas	EXT	01			EXTERNO	PUBLICO	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO	
	FIDPRU2	11			TIPOSB	LINEA SB	NINGUNO	0000			
	FIDPRU3	11			TIPOSB	LINEA SB	FID. DE INVERSION	0			
Tipo Porta	FIDU1	11			TIPOSB	LINEA SB	FID. DE INVERSION	0			
	FIDUCIA	11			TFID	FID	NINGUNO	0000			
	FONDO BCO.	02			BONOS	FONDO BCO	PRIMA MEDIA - CAXDA	0			
	FONDOCARLOS	02			CDT	PRUEBA CAR	FID. DE INVERSION	0001			
Portafolios	FONDORENTAFIJA	02			GEN	ABIERTOS	FID. DE ADMINISTRAC	0			

Al dar clic en el botón Portafolios aparecerá la cuadricula de información de los portafolios creados en la compañía y dentro de los cuales estarán los títulos, papeles, especies o inversiones.

1.1.7.1. INGRESAR PORTAFOLIOS

Al dar clic en el botón de Ingresar, aparecerá la pantalla siguiente en la cual se debe digitar el Nombre del Portafolio, los Beneficiarios, el Tipo de Portafolio, la Línea de Negocio a la que pertenecen, que ya deben estar previamente creados, el tipo de fondo, el código de fondo y las opciones de bloqueo y estado en caso de que el portafolio este activo o inactivo.



🕵 Portafolio - Ingresar	
Nombre	
Tipo Linea de Negocio	-
Beneficiarios	
Tipo de Fondo/Fidecomiso Codigo Fondo/Fideia	comiso
Aceptar	Cerrar

1.1.7.2. MODIFICAR PORTAFOLIOS

🙀 Portafolio - Modificar	×
Nombre ACCIONES Tipo Linea de Negocio MARPROPIO	
Beneficiarios	
Tipo de Fondo/Fidecomiso NINGUNO Codigo Fondo/Fideicomiso 00000 Bloquear Estado ACTIVO	
Aceptar 🔀 Cerra	It

Para modificar portafolios puede dar clic en el ítem deseado y oprimir el botón de modificación, o puede dar doble clic sobre el registro. En ambos casos aparecerá la pantalla de modificación mostrada anteriormente. En este caso solo se podrán modificar el Tipo de Portafolio, la línea de Negocios, los Beneficiarios del Portafolio,



el tipo de fondo, el código de fondo y las opciones de bloqueo y estado.

1.1.7.3. ELIMINAR PORTAFOLIOS

🕷 Portafolio - Eliminar	×
Nombre	
ACCIONES	
Tipo Linea de Negocio	
MARPROPIO 🔽 CTA PROPIA 🔽	
Beneficiarios	-
PWPREI - DEFINICION DE PARAMETROS	
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
Bloquear Estado	
	(
Aceptar Cerra	эг

Para eliminar los portafolios debe tener en cuenta que estos no podrán tener Títulos o Especies. En ese caso el portafolio no se podrá eliminar. En caso contrario el sistema pedirá reconfirmación de eliminación como en las pantallas de eliminación anteriores.



1.2. OPCIÓN SUPER FINANCIERA

Se estipulan los parámetros de la Superintendencia Financiera.



Parámetros. Hemos definido un conjunto de parámetros independientes para operar el modelo, que deben ser establecidos antes de empezar a operar. Aunque entregamos los scripts correspondientes para cargar los propios del sistema y los publicados por la SFC, incluimos las funciones para su posterior actualización:

1.2.1. TIPOS FACTORES RIESGOS.



Son los factores de Riesgo definidos por la superintendencia de valores para aplicar a los títulos con el portafolio para evaluar el método proporcionado por la superintendencia de valores.



1.2.1.1. INGRESO TIPO FACTOR RIESGO

Por medio de esta opción el sistema permite ingresar los factores de riesgo, para ello ingrese el Código de la Súper, la clase de factor a la que corresponde y descripción del factor.

🔀 Tipo Factores - Ingresar 🛛 🔀
Ingresar Datos
CodSuper
Clase Factor
Descripcion
Aceptar 🛛 Cerrar

1.2.1.2. MODIFICACION TIPO FACTOR RIESGO.

📓 Tipo Factores - Modificar 🛛 🗙
Ingresar Datos
CodSuper 17
Clase Factor MONEDA -
Descripcion NO DEFINIDO MONEDA
Aceptar 💟 Cerrar

Para modificar un tipo de factor puede hacer clic sobre el registro a modificar o utilizando el icono ubicado en la parte superior, solo se puede modificar la clase de factor y la descripción, en caso de querer modificar el código súper debe eliminar el registro.



1.2.1.3. ELIMINAR TIPO FACTOR RIESGO.



Para eliminar un registro sitúese en el ítem deseado, haga clic en el Icono de Eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en las pantallas anteriores.

1.2.1.4. BUSCAR TIPO FACTOR RIESGO

🆻 Buscar Tipo Factor Riesgo 🛛 🔀
Buscar Por
Factor 📃 💌
Todos los Registros
Aceptar 🔀 Cerrar

Para consultar información sobre Tipo Factor de Riesgo, puede realizar la búsqueda seleccionando un factor determinado ó todos los registros.



1.2.2. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO.

🖀 DEFINICION DE PARAMETROS - [Parametro Patrimonio Tecnico]								
🚠 Archivo Gene	Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana							
Ng 🕼 🛐 💭	۵ 🕫							
Super Valores	Fecha Vigencia	Tipo	Cuenta	Descripcion	Porcentaje A	Signo		
	29/03/2007	CP	1504	Propiedades y equipo-terrenos	100	•		
	29/03/2007	CP	1508	Propiedades y equipo- construcciones en curso	100	•		
	29/03/2007	CP	1512	Propiedades y equipo- en tránsito	100	+		
	29/03/2007	CP	1516	Propiedades y equipo- edificaciones	100	-		
	29/03/2007	CP	1520	Propiedades y equipo- equipos de oficina	100	•		
	29/03/2007	CP	1524	Propiedades y equipo- equipo de computación y comunicaciór	100			
	29/03/2007	CP	1528	Propiedades y equipo- equipos de transporte	100	+		
	29/03/2007	CP	1592	Propiedades y equipo- depreciación acumulada	100	+		
	29/03/2007	I CP	1596	Propiedades y equino- depreciación diferida	100	+		

Establece las ponderaciones de las cuentas para el cálculo del patrimonio técnico

1.2.2.1. INGRESO PARAMETROS PATRIMONIO TECNICO.

Por medio de esta opción puede ingresar la información correspondiente a los parámetros del patrimonio técnico: **Fecha:** Fecha de vigencia **Tipo:** Tipo de Capital (CP: Capital Primario; CS: Capital Secundario) **Cuenta:** Cuenta **Descripción:** De la cuenta **Porcentaje Aplica:** Porcentaje utilizado **Signo: (+ ó -):** Positivo o negativo

🗃 Parametro Patrimonio Tecnico - I 🔀
Datos del Parametro
Fecha 112/06/2009 💌
Tipo
Cuenta
Descripcion
Pocentaje Aplica
Signo
Aceptar 🛛 Cerrar



1.2.2.2. MODIFICACION PARAMETROS PATRIMONIO TECNICO.

¥	🗃 Parametro Pa	atrimonio Tecnico 🛛
	- Datos del Parame	tro
	Fecha	29/03/2007 💌
	Tipo	CP 💌
	Cuenta	1504
	Descripcion	Propiedades y equipo- terrenos
	Pocentaje Aplica	100
	Signo	• •
		Aceptar 🔀 Cerrar

Para modificar seleccione un registro de la grilla o haga clic sobre el Icono de modificación. Solo puede modificar la descripción, el porcentaje que aplica y el signo. Para cambiar el tipo y la cuenta debe eliminar el registro.

1.2.2.3. ELIMINACION PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO.



🗃 Parametro Patrimonio Tecnico - E 🗙
Datos del Parametro
Fecha 29/03/2007 💌
PWPREI - RESOLUCION 513
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
Sí No
Aceptar 🛛 Cerrar

Seleccione el registro a eliminar el sistema le pedirá reconfirmación como en las opciones anteriores.

1.2.2.4. BUSCAR PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO

🏴 Buscar Parametro Patrimo 🔀					
Buscar Por					
🗖 Cuenta	▼ 18/06/2009 ▼				
Todos los Registros					
Aceptar	Cerrar				

Esta opción le permite consultar la información de Parámetro Patrimonio por fecha de vigencia o por Todos los Registro.

1.2.2.5. CARGAR INFORMACION PATRIMONIO TECNICO

Por medio de esta opción se puede cargar al sistema la información correspondiente a Parámetro patrimonio técnico desde un archivo plano o un archivo en Excel. En el punto **2.2.1.1.6** se explica con detalle la Carga de Datos.



🛓 Carga de Datos	s - Parametro Patrimonio		
Cargue Automático Archivo Tipo de Carga Fecha Vigencia	18/06/2009 T ipo CP V		
C Archivo Excel	(*.xls)	Aceptar 🔀 (Cerrar

1.2.3. PARAMETROS APNR

DEFINICION D	E PARAMETROS	[APNR]					
👫 Archivo Genei	👫 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana						
Ng 🕼 📴 💭 🧇 🗇							
Super Valores	Fecha Vigencia	Cuenta	Descripcion	Ponderacion	Signo		
	18/05/2005		ACTIVO	0	+		
N 1	18/05/2005	11	DISPONIBLE	0	+		
	18/05/2005	12	INVERSIÓNES Y DERIVADOS	0	+		
•	18/05/2005	13	DEUDORES	0	+		
•••	18/05/2005	19	VALORIZACIÓNES	0	+		
	18/05/2005	1105	CAJA	0	+		
	18/05/2005	1110	BANCOS	0	+		
	18/05/2005	1115	REMESAS EN TRANSITO	0	+		
JAA/	18/05/2005	1120	CUENTAS DE AHORRO	0	+		
22.22.22	18/05/2005	1125	PARTICIPACIÓN EN FONDOS A LA VISTA	0	+		
			1				

Establece las ponderaciones de las cuentas para la determinación de los activos ponderados por nivel de riesgo.

1.2.3.1. INGRESO PARAMETROS APNR.

Con esta opción el sistema le permite ingresar los parámetros para el manejo de los activos ponderados por nivel de riesgo.

Fecha Vigencia: Fecha a partir de la cual se encuentran vigentes las cuentas **Cuenta:** Número de cuenta contable



Descripción: Descripción de la cuenta contable **Ponderación:** % a establecer en las cuentas de Riesgo **Signo: (+ ó -):** Positivo o negativo

👫 APNR - Ingresar 🛛 🔀
Fecha Vigencia 18/06/2009 💌
Cuenta
Descripcion
Ponderacion
Signo
<u></u>
Aceptar 🛛 Cerrar

1.2.3.2. MODIFICACION PARAMETROS APNR.

👫 APNR - Modificar 🛛 🔀
Fecha Vigencia 18/05/2005 🗾
Cuenta 1
Descripcion ACTIVO
Ponderacion 0
Signo + 💌
Aceptar 🛛 Cerrar

Para modificar un registro puede hacer doble clic sobre el registro en la grilla o seleccionando el icono en la parte superior. El sistema solo le permite modificar la Descripción de la cuenta, la ponderación y el signo. En caso de necesitar cambiar la cuenta debe eliminar el registro.

1.2.3.3. ELIMINAR PARAMETROS APNR.



Para eliminar seleccione el registro de la grilla y haga clic en el botón correspondiente, el sistema le pedirá reconfirmar como en las pantallas anteriores.

🖬 APNR - Eliminar 🛛 🗙
Fecha Vigencia 18/05/2005 💌
PWPREI - DEFINICION DE PARAMETROS 🔣
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
Sí No
Aceptar Cerrar

1.2.3.4. BUSCAR PARAMETROS APNR.

🏴 Buscar APNR	
Buscar Por	▼ 18/06/2009 ▼ ros
Aceptar	Cerrar

Para consultar información sobre los APNR puede utilizar las fechas de vigencia o buscar por todos los registros.

1.2.3.5. CARGAR DE DATOS

Con esta opción puede cargar los datos de los APNR, a través de un archivo plano o de un archivo en Excel. En el punto **2.2.1.1.6** se explica con detalle la Carga de Datos.



🛓 Carga de Datos	- APNR				×
Cargue Automático Archivo					i
⊤ Tipo de Carga Fecha Vigencia	18/06/2009 💌				
C Archivo Excel	.xk) *.xks)				
		Errores	Aceptar	×	Cerrar

1.2.4. RELACION DE FACTORES

EFINICION DE PARAMETROS - [Relacion Factores]								
x Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana								
δy Δμ 🛐 🗐 🔎								
Super Valores	Fecha Vigencia	Tipo Emisor	Mercado	Tasa	Moneda	Tipo Inversión	Factor Tasa	Factor Moneda
	18/05/2005	NACION	RF	DTF	2	72 NEGOCIABLE	Tasa Credito Consu	FCO - RENTABILIE
1								
- <u></u>								
initi L								

Permite dar un parámetro al factor de riesgo y aplicar en cada caso según tipo emisor, mercado, tasa, moneda y el tipo de inversión.

1.2.4.1. INGRESO RELACION DE FACTORES

Esta opción permite ingresar al sistema la información necesaria para la relación de factores.

Fecha de Vigencia: Fecha a partir de la cual se encuentra vigente la información de los factores.
Tipo Emisor: Emisor al cual pertenece la información digitada.
Mercado: Acciones, Renta Fija, Divisas etc.
Tasa: Tasa del factor
Moneda: Moneda a la cual está asociada el factor
Tipo Inversión: Negociable, Permanente, vencimiento
Factor Tasa: DTF, Tasa de Repos, etc.
Variación a aplicar: Determina si la variación se aplica a un año, diez días o no se aplica.
Factor Moneda: Indicador de la Moneda
Volatilidad a aplicar: 10 días, un año, ninguno.


👪 Relacion Factores	- Ingresar 🛛 🔀				
Ingresar Datos					
Fecha Vigencia	18/06/2009 💌				
Tipo Emisor					
Mercado					
Tasa					
Moneda					
Tipo Inversión	_				
Factor Tasa	•				
Variación a Aplicar	•				
Factor Moneda	•				
Volatilidad a Aplicar	•				
Aceptar 🔀 Cerrar					

1.2.4.2. MODIFICACION RELACION DE FACTORES

🚾 Relacion Factores	s - Modificar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Vigencia	18/05/2005 💌
Tipo Emisor	NACION
Mercado	RF
Tasa	DTF
Moneda	272 🗸
Tipo Inversión	NEGOCIABLE
Factor Tasa	asa Credito Consumo 💌
Variación a Aplicar	NINGUNO
Factor Moneda	FCO - RENTABILIDA 💌
Volatilidad a Aplicar	10 DIAS 🗨
	Aceptar 🔀 Cerrar

Con esta opción puede modificar un registro dando doble clic en la grilla o utilizando el Icono ubicado en la parte superior, el sistema solo le permite modificar



el Factor tasa, la Variación a Aplicar, el Factor moneda, o la volatilidad a Aplicar, el cambiar cualquiera de los otros datos implica eliminar el registro.

1.2.4.3. ELIMINAR RELACION FACTORES

🚾 Relacion Factore	es - Eliminar 🛛 🗙
Ingresar Datos	
Fecha Vigencia	18/05/2005 💌
Tipo Emisor	NACION
PWPREI - RESOL	UCION 513
Esta Seg	juro de Eliminar el Registro ? No
Variacion a Aplicar	NINGUNO
Factor Moneda	FCO - RENTABILIDA 👻
Volatilidad a Aplicar	10 DIAS
[
	Aceptar Cerrar

Para eliminar un registro seleccione el registro y haga clic en el botón de eliminar el sistema pedirá reconfirmación como en las anteriores pantallas.

1.2.4.4. BUSCAR RELACION FACTORES

켜 Buscar Relaciones Factores	×
Buscar Por	
Fecha Vigencia 18/06/2009 💌	
Tipo Emisor NACION 💌	
Todos los Registros	
Aceptar 🔀 Cerrar	

Por medio de esta opción puede consultar información sobre Relaciones de Factores, esta búsqueda la puede realizar por Fecha de Vigencia, por Tipo de Emisor o si desea puede buscar por todos los registros.



1.2.5. PARAMETROS COMPROMISOS

Parámetros Compromisos. Estos parámetros determinan la forma el sistema debe interpretar los diferentes tipos de negocio; como por ejemplo, separarlos en posiciones nocionales. Para establecerlos ingrese por "Definición de Parámetros – Súper Financiera – Parámetros Compromisos". Le aparece la siguiente pantalla:



General:

🔮 DEFINICION DE PARAMETROS - [Parametro Compromisos]										
🖕 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana 🗕 🗗										
Sa B ₽ Ø ■										
Super Valores	Tipo Compromiso	Punta	Posicion	PosicionLarga	PosicionCorta	ValoraLarga	ValoraCorta	FactorTasaL	FactorMonedaL	
	CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Subyacente	Subyacente	
	CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Subyacente	Ninguno	
	CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	
•	CONTADOMAS	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	
	FONDEO	COMPRA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	
	FONDEO	VENTA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	
	FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	
•••••	FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Subyacente	Subyacente	
AA/	FORWDIVISA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Ninguno	Subyacente	
\$2,52,52	FORWDIVISA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	
<u> </u>	NINGUNO	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	
*	NINGUNO	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	
	OPCFTRM	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Ninguno	Subyacente	

 Posición Propia: Permite parametrizar la forma de valorar y que factor de riesgo aplicar a cada posición en el portafolio, según el tipo de compromiso, la punta y la posición.



DEFINICION D	E PARAMETROS -	Parametro Com	promisos]	-	-	and statements	a company of the	Manual Street		The second second	
🚑 Archivo Ge	eneral Super Valor	res PWPREI	ContraPartes Ver	ntana							
S & B 🖁 🗊 🗞 🜗											
Súper Financiera	Tipo Compromiso	Punta	Posicion	PosicionLarga	PosicionCorta	ValoraLarga	ValoraCorta	FactorTasaL	FactorMonedaL	FactorTasaC	FactorMonedaC
Received.	CALLSB	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CALLSB	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	CALLST	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CALLST	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno
	CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Subyacente	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	N	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CONTADOMAS	VENTA	CORTA	N	SI	No Valora	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
LAAS	FONDEO	COMPRA	CORTA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
SASAGE	FONDEO	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
A	FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
4	FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
1985 m	FORMOTHEA	COMPDA	LADCA	CT	CT	Descuente del Capit	Decquente del Capit	Cubuncente	Suburgente	Mingupo	Ninguno

 Reservas Técnicas: La función VaR Reservas implementa el modelo de la SFC descrito en el anexo 3 del capítulo 21, para evaluar el valor en riesgo de las posiciones que constituyen las reservas técnicas de las compañías de seguros. Este documento es una guía operativa para la preparación y generación de los archivos correspondientes.

hpo compromiso	i untu	robición	robicióncarga	r obición con ta	raioracarga	valor a cor ta	r actor rabae	r detorrioriedue	r dettor rabae	ractornoncada
CALLSB	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CALLSB	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
CALLST	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CALLST	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno
CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Subyacente	Ninguno	Subyacente	Subyacente
CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	N	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CONTADOMAS	VENTA	CORTA	N	SI	No Valora	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
FONDEO	COMPRA	CORTA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FONDEO	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWDIVISA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWDIVISA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
FUTUROA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROD	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROD	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROT	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROT	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROW	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacente	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROW	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
NINGUNO	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
NINGUNO	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
OPCFTRM	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
OPCFTRM	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PLAZOEFEC	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
PLAZOEFEC	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacente	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
PUTSB	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PUTSB	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
PUTST	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PUTST	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capit	Descuento del Capit	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
REPO	COMPRA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
REPO	VENTA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
SIMULINTRA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
SIMULINTRA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
SIMULTANEA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacente	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
SIMULTANEA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninauno	Ninauno	Ninauno	Ninauno
Registro(a) 40										

Nota: Para procesar el modelo y generar los informes, ingrese al módulo de "Portafolios y Riesgo" a la fecha de corte requerida. Una vez ahí seleccione el Grupo, Línea o Portafolio que contiene las posiciones a procesar. Luego seleccione "VeR Reservas".



1.2.5.1. INGRESO PARAMETROS COMPROMISO.

Por medio de esta opción puede ingresar los parámetros de compromisos.

4	e Parametro Comp	romisos - Ingresar 🛛 🛛 🔀
[Ingresar Datos	
	Tipo Compromiso	_
	Punta	_
	Posicion	•
	Posicion Larga	•
	Posicion Corta	•
	Valora Larga	•
	Valora Corta	•
	Factor Tasa Larga	•
	Factor Moneda Larga	•
	Factor Tasa Corta	•
	Factor Moneda Corta	_
-		
	J.	Aceptar 🔀 Cerrar

Tipo de Compromiso: De tipo Repo, Carrusel, Forward, Forwdivisa Punta: Compra ó Venta Posición: Corta ó Larga Posición Larga: Si tiene ó No Posición Corta: Si tiene ó No Valora Larga: Forma de valorar la posición larga Valora Corta: Forma de valorar la posición corta Factor Tasa Larga: Factor tasa que se debe aplicar en la posición larga Factor Tasa Corta: Factor tasa que se debe aplicar en la posición larga Factor Tasa Corta: Factor tasa que se debe aplicar en la posición larga Factor Tasa Corta: Factor tasa que se debe aplicar en la posición corta. Factor Tasa Corta: Factor tasa que se debe aplicar en la posición corta.

1.2.5.2. MODIFICACION PARAMETROS COMPROMISOS

Para modificar un registro puede dar doble clic sobre el registro que desea modificar en la grilla ó puede dar clic en el botón ubicado en la parte superior En este parámetro no se permite modificar Tipo compromiso ni punta, en caso de requerirse se debe eliminar el registro.



4	R Parametro Comp	romisos - Modificar 🛛 🔀
1	Ingresar Datos	
	Tipo Compromiso	CARRUSEL
	Punta	COMPRA
	Posicion	LARGA
	Posicion Larga	SI 💌
	Posicion Corta	SI 💌
	Valora Larga	Como el Subyacente 💌
	Valora Corta	Descuento del Capital 💌
	Factor Tasa Larga	Subyacente 💌
	Factor Moneda Larga	Subyacente 🗨
	Factor Tasa Corta	Subyacente 🗨
	Factor Moneda Corta	Ninguno
	V	Aceptar 🔀 Cerrar

1.2.5.3. ELIMINAR PARAMETROS COMPROMISOS

Para eliminar escoja el registro de la grilla y haga clic sobre el botón correspondiente el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

🜲 Parametro Compromisos - Eliminar 👘	×
Ingresar Datos	
Tipo Compromiso CARRUSEL	
Punta COMPRA -	
Posicion LARGA -	
PWPREI - RESOLUCION 513	
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
Factor Tasa Corta Subyacente Factor Moneda Corta Ninguno	
Aceptar Cerrar	



1.2.5.4. BUSCAR COMPROMISOS

🏴 Buscar Parametros Compromisos 🗙
Buscar Por
Tipo Compromiso
Punta 🗨
Todos los Registros
Aceptar 🛛 Cerrar

Para consultar información de Parámetros compromiso puede realizar la búsqueda por todos los registros o seleccionando, la punta o el tipo de compromiso.

1.2.6. PARAMETRO RIESGO DE CREDITO

🚰 DEFINICION DE PARAMETROS - [Parametro Riesgo Credito]										
🏹 Archivo Gene	🎮 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana									
Ng 🕼 🛐 🚚 🚿										
Super Valores	Fecha Vigencia	Tipo Entidad	Tipo Emisor	Ponderador						
	11/11/2003	NACION	NACION	0						
	11/11/2003	NACION	NO NACION	0						
	11/11/2003	NO NACION	NACION	80						
•	11/11/2003	NO NACION	NO NACION	100						
•••										
1000										
*										

Determina la ponderación para el riesgo de crédito según tipo de entidad y de emisor.



1.2.6.1. INGRESO PARAMETRO RIESGO DE CREDITO.

🍽 Parametro Rie	go Credito - In 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Vigencia	18/06/2009 💌
Tipo Entidad	_
Tipo Emisor	_
Ponderador	
	ır 🔀 Cerrar

Con esta opción podrá ingresar al sistema la información correspondiente al Parámetro Riesgo Crédito.

Fecha Vigencia: Fecha a partir de la cual se encuentra vigente el parámetro Riesgo de Crédito.

Tipo Entidad: Nación, No nación **Tipo de Emisor:** Nación, No nación **Ponderador:** Ponderador

1.2.6.2. MODIFICACION PARAMETRO RIESGO DE CREDITO

🌆 Parametro Riego Credito - M 🔀			
Ingresar Datos			
Fecha Vigencia	11/11/2003 💌		
Tipo Entidad	NACION		
Tipo Emisor	NACION		
Ponderador			
	ar 🔽 Cettar		

Con esta opción solo puede modificar el Ponderador, en caso de necesitar modificar otro dato debe eliminar el registro.



1.2.6.3. ELIMINAR PARAMETRO RIESGO CREDITO.

🐼 Parametro Riego Credito - El 🗙		
Ingresar Datos		
Fecha Vigencia 11/11/2003 💌		
PWPREI - RESOLUCION 513		
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?		
Sí No		
Aceptar Lerrar		

Para eliminar escoja el ítem deseado y de clic sobre el botón eliminar, el sistema le pedirá reconfirmar como en las anteriores pantallas

1.2.6.4. BUSCAR PARAMETRO RIESGO CREDITO

Para consultar información sobre Parámetro de Riesgo Crédito, puede realizar la búsqueda por Fecha de Vigencia o Todos los Registros.

🏓 Buscar Parametro Riesgo Credito 🛛 🔀			
Buscar Por			
Fecha Vigencia 17/09/2003 💌			
Todos los Registros			
Aceptar 🛛 🔀 Cerrar			



DEFINICION DE PARAMETROS - [Parametros Informe SV]			
🚔 Archivo Gener	ral Super-Valores F	PWPREI Con	traPartes Ventana
Ng 🚨 📝 📃	1		
Super Valores	FechaVigencia	RenGlon	Descripcion
	01/08/2003	1	IN - EMITIDAS POR LA
N 🚺	01/08/2003	2	IN - EMITIDAS POR LA NACION - TES A DTF
	01/08/2003	3	IN - EMITIDAS POR LA NACION - TES A IPC
•	01/08/2003	4	IN - EMITIDAS POR LA NACION - TES A UVR
•••	01/08/2003	5	IN - EMITIDAS POR LA NACION - TES INDEXADOS A
	01/08/2003	6	IN - EMITIDAS POR LA NACION - TES YANKEES
	01/08/2003	7	IN - EMITIDAS POR LA NACION - DIFERENTES DE T
·····	01/08/2003	8	IN - EMITIDAS POR VIGILADAS SUPERBANCARIA
AAA	01/08/2003	9	IN - OTROS TITULOS
22422422	01/08/2003	10	IN - BURSATILES
Â	01/08/2003	11	IN - NO BURSATILES - NO INCRITAS EN BOLSA
	01/08/2003	12	DIVISAS
. 49e.	01/08/2003	13	COMPROMISOS
600	01/08/2003	14	OPERACIONES DE LIQUIDEZ
	01/08/2003	999	VALOR EN RIESGO EN PESOS

1.2.7. PARAMETRO INFORME SUPERVALORES.

En este módulo se establece el formato del Informe de Riesgo para la supervalores.

1.2.7.1. INGRESO PARAMETROS INFORME SUPERVALORES

Para ingresar información sobre Parámetro informe Supervalores digite:

Fecha: En que ingresa el parámetro.

Renglón: En este campo de acuerdo a la circular 201, se debe parametrizar de manera ordenada la información que va en cada renglón del formulario. **Descripción:** A que corresponde cada uno de los campos parametrizados en renglón.



📌 Parametr	o InformeSV - Ingresar	×
⊢Ingresar Dato Fecha RenGlon Descripcion	s 12/06/2009]
	Aceptar 🔀 Cerrar	

1.2.7.2. MODIFICACION PARAMETROS INFORME SUPERVALORES

뤔 Parametro	InformeSV - Modificar	×
Ingresar Datos		
Fecha	01/08/2003 💌	
RenGlon	1	
Descripcion	IN - EMITIDAS POR LA	
	Aceptar 🔀 Cerrar	

Para modificar los parámetros del Informe de la Supervalores, haga doble clic sobre el registro seleccionado, o escoja el botón de Modificar ubicado en la parte superior, solo se permite modificar la descripción, en caso de necesitar modificar otro dato debe eliminar el registro.

1.2.7.3. ELIMINAR PARAMETROS INFORME SUPERVALORES

Para eliminar un registro, seleccione la información de la grilla y de clic en el botón ubicado en la parte superior, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.





1.2.7.4. BUSCAR PARAMETROS INFORME SUPERVALORES

🏓 Buscar Parametro InformeSV 👘		
Buscar Por Fecha Vigencia 18/06/2009 💌		
Aceptar 🔀 Cerrar		

Para consultar información sobre los parámetros del informe Supervalores, lo puede realizar haciendo clic en todos los registros o por fecha de vigencia.



1.2.8. PARAMETRO GRADUALIDAD SUPERVALORES.



Establece los porcentajes a aplicar del VeR según la gradualidad definida por la Supervalores.

1.2.8.1. INGRESO GRADUALIDAD SUPERVALORES.

1	Factor Burs	atilidad - Ingresar	×
	Fecha PorAplicaVeR	18/06/2009 💌	_
		Aceptar 🔀 Ce	errar

Por medio de esta opción ingrese los porcentajes para aplicar al VeR, digite la fecha y el porcentaje a ser aplicado.



1.2.8.2. MODIFICACION GRADUALIDAD SUPERVALORES.

ኛ Factor Burs	atilidad - Modificar	×
Fecha PorAplicaVeR	03/05/2006 💌	
	Aceptar 🗵 Cerra	91

La opción de modificar le permite cambiar solamente el Porcentaje a ser aplicado al VeR.

1.2.8.3. ELIMINAR GRADUALIDAD SUPERVALORES.

Para eliminar un registro haga clic, en el Icono ubicado en la parte superior, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

ኛ Factor Bursatilidad - Eliminar 💦 🗙
PWPREI - RESOLUCION 513
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
Sí No

1.2.8.4. BUSCAR GRADUALIDAD SUPERVALORES.

🏓 Buscar Parametro GradualSV 🛛 🔀			
Buscar Por			
Fecha 18/06/2009 💌			
Todos los Registros			
Aceptar 🔀 Cerrar			

La consulta de información la puede realizar por la Fecha o señalando todos los registros.



1.2.9. FACTOR BURSATILIDAD

Determina el factor a aplicar a las acciones según su bursatilidad, para el cálculo del VeR.



1.2.9.1. INGRESO FACTOR BURSATILIDAD

🖪 Factor Burs	atilidad - Ingresar 💦 🔀
- Ingresar Datos- Fecha Bursatilidad Multiplicador	12/06/2009 V ALTA V
	Aceptar 🔀 Cerrar

Para ingresar información sobre el Factor Bursatilidad ingrese.



Fecha: Fecha **Bursatilidad:** Alta, Media, Baja **Multiplicador:** multiplicador a aplicar al factor de riesgo según su bursatilidad.

1.2.9.2. MODIFICACION FACTOR BURSATILIDAD

En esta opción solo se puede modificar el Multiplicador, para otro cambio se debe eliminar el registro.

🖪 Factor Burs	satilidad - Modificar 💦 🔀
-Ingresar Datos-	
Fecha	05/08/2007 💌
Bursatilidad	NO INSCRITA EN BOLSA 👻
Multiplicador	4.7
	Aceptar 🔀 Cerrar

1.2.9.3. ELIMINAR FACTOR BURSATILIDAD

ļ,	🗙 Factor Bursatilidad - Eliminar 💦 🚺]
	Ingresar Datos	
	PWPREI - RESOLUCION 513	
	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
ſ	Sí No	1

Para eliminar un registro haga clic, sobre el botón ubicado en la parte superior, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.



1.2.9.4. BUSCAR FACTOR BURSATILIDAD

🖻 Buscar Factor Bursatilidad 🛛 🛛 🔀
Buscar Por Fecha Vigencia 18/06/2009 💌
Aceptar Cerrar

Para buscar un registro lo puede hacer por fecha o ver todos los registros señalando la casilla y luego dar clic en el botón aceptar.

1.2.10. FACTOR RIESGO EN BANDAS DE TIEMPO

Estos son los parámetros de la SFC para el riesgo de tasa interés por bandas de tiempo. Para configurarlos o registrar nuevos que publique la SFC, ingrese por "Definición de Parámetros – Súper Financiera – Factores de Riesgo en Bandas de Tiempo". Le aparece la pantalla:







Posición Propia

DEFINICION DE PARAMETROS - [Form1]								
🔂 Archivo General Super-Valores PWPREI ContraPartes Ventana								
Ng 🕼 🛐 🗊								
Super Valores	FechaVigenc	Zona	Banda	Límite Inferic	Límite Super	Moneda	Val. Factor	
	01/01/2003	1		0	0.08	COP	221	
N 1997	01/01/2003	1	1	0	0.08	EXT	100	
	01/01/2003	1	1	0	0.08	TRM	100	
	01/01/2003	1	1	0	0.08	UVR	221	
	01/01/2003	1	2	0.08	0.25	COP	221	
	01/01/2003	1	2	0.08	0.25	EXT	100	
	01/01/2003	1	2	0.08	0.25	TRM	100	
	01/01/2003	1	2	0.08	0.25	UVR	221	
444	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	COP	221	
\$2,22,22	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	EXT	100	
Â	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	TRM	100	
<u></u>	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	UVR	221	
	01/01/2003	1	4	0.5	1	COP	221	
Sec.	01/01/2003	1	4	0.5	1	EXT	100	
	01/01/2003	1	4	0.5	1	TRM	100	
	01/01/2003	1	4	0.5	1	UVR	221	
	01/01/2003	2	5	1	1.9	COP	206	
	01/01/2003	2	5	1	1.9	EXT	90	
	01/01/2003	2	5	1	1.9	TRM	90	
	01/01/2003	2	5	1	1.9	UVR	208	
	01/01/2003	2	6	1.9	2.8	COP	190	
	01/01/2003	2	6	1.9	2.8	EXT	80	
	01/01/2003	2	6	1.9	2.8	TRM	80	
10101010	01/01/2003	2	6	1.9	2.8	UVR	195	
10101010	01/01/2003	2	7	2.8	3.6	COP	175	
	01/01/2003	2	7	2.8	3.6	EXT	75	

Se definen los Factores de Riesgo en Bandas de Tiempo para el Modelo de la Superintendencia Financiera

Reservas Técnicas: La función VaR Reservas implementa el modelo de la SFC descrito en el anexo 3 del capítulo 21, para evaluar el valor en riesgo de las posiciones que constituyen las reservas técnicas de las compañías de seguros. Este documento es una guía operativa para la preparación y generación de los archivos correspondientes.

Seleccione "Reservas Técnicas" y le aparece la lista cargada. Si desea puede modificarlos.



FechaVigenc	Zona	Banda	Límite Inferio	Límite Super	Moneda	Val. Factor
01/07/2012	1	1	0	0.08	COP	82
01/07/2012	1	1	0	0.08	EXT	27
01/07/2012	1	1	0	0.08	UVR	165
01/07/2012	1	2	0.08	0.25	COP	74
01/07/2012	1	2	0.08	0.25	EXT	27
01/07/2012	1	2	0.08	0.25	UVR	143
01/07/2012	1	3	0.25	0.5	COP	65
01/07/2012	1	3	0.25	0.5	EXT	26
01/07/2012	1	3	0.25	0.5	UVR	120
01/07/2012	1	4	0.5	1	COP	52
01/07/2012	1	4	0.5	1	EXT	26
01/07/2012	1	4	0.5	1	UVR	94
01/07/2012	2	5	1	1.9	COP	56
01/07/2012	2	5	1	1.9	EXT	36
01/07/2012	2	5	1	1.9	UVR	78
01/07/2012	2	6	1.9	2.8	COP	69
01/07/2012	2	6	1.9	2.8	EXT	38
01/07/2012	2	6	1.9	2.8	UVR	83
01/07/2012	2	7	2.8	3.6	COP	80
01/07/2012	2	7	2.8	3.6	EXT	38
01/07/2012	2	7	2.8	3.6	UVR	84
01/07/2012	3	8	3.6	4.3	COP	81
01/07/2012	3	8	3.6	4.3	EXT	47
01/07/2012	3	8	3.6	4.3	UVR	81
01/07/2012	3	9	4.3	5.7	COP	84
01/07/2012	3	9	4.3	5.7	EXT	47
01/07/2012	3	9	4.3	5.7	UVR	77
01/07/2012	3	10	5.7	7.3	COP	82
01/07/2012	3	10	5.7	7.3	EXT	47
01/07/2012	3	10	5.7	7.3	UVR	72
01/07/2012	3	11	7.3	9.3	COP	82

Nota: Para procesar el modelo y generar los informes, ingrese al módulo de "Portafolios y Riesgo" a la fecha de corte requerida. Una vez ahí seleccione el Grupo, Línea o Portafolio que contiene las posiciones a procesar. Luego seleccione "VeR Reservas".

1.2.10.1. INGRESO FACTOR RIESGO EN BANDAS DE TIEMPO

🖻 Factor Tasa - Ingresar 🛛 🔀
Datos del Parametro
Fecha Vigencia 18/06/2005 💌
Zona 🗨
Banda
Dur. Inferior
Dur. Superior
Moneda 🗾 💌
Val. Factor (P.B)
Aceptar 🔀 Cerrar



1.2.10.2. MODIFICACION FACTOR RIESGO EN BANDAS DE TIEMPO

🖻 Factor Tasa - Modificar 🛛 🛛 🔀
Datos del Parametro
Fecha Vigencia 01/01/2003 🚽
Zona Z1 💌
Banda 1
Dur. Inferior
Dur. Superior 0.08
Moneda COP 🚽
Val. Factor (P.B) 221
Aceptar 🗵 Cerrar

En esta opción solo se puede modificar la Zona, la Banda y el Valor del Factor, si se desea hacer otro cambio se debe eliminar el registro.

1.2.10.3. ELIMINAR FACTOR RIESGO EN BANDAS DE TIEMPO

Para eliminar un registro haga clic, sobre el botón ubicado en la parte superior Eliminar y automáticamente se elimina el registro como se muestra en la figura.



5	Fac	tor Tasa - Eliminar 🛛 🗙
Г	Datos	s del Parametro
	Fec	ha Vigencia 01/01/2003 👻
	Zon	a Z1 🔽
	Ban	da 1
	Dur	Sistema PWPREI
	Dur	1 Transacción exitosa
	Мо	
	Val.	Aceptar
		Aceptar 🔀 Cerrar

1.2.11. FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO

DEFINICION DE PARAMETROS - [Form1]					
🔁 Archivo Gene	ral – Super Val	ores PWPR	EI ContraParte	es Ventana	
Ng 🖓 📝 🗦 💭					
Super Valores	FechaVigenc	Moneda	ValFac		
	01/01/2003	ACC	14.7		
1	28/02/2008	CCE	3.8		
	01/01/2003	EUR	6		
	01/01/2003	EXT	4.4		
	24/07/2007	FONDO1	10		
	01/01/2003	OTR	8		
	01/01/2003	TRM	4.4		
	01/01/2003	USD	4.4		
<u>10000</u>					
*					
🖉 🔤					
Ør					

Se definen los Factores de Riesgo para las Acciones y Divisas para el Modelo de la Superintendencia Financiera



1.2.11.1. INGRESO FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO

🖻 Factor Tasa - Ingresar	×
Fecha Vigencia 18/06/2009 💌 Moneda/Especie 💽 ValFac (%)	
Aceptar 🗵 Cerrar	

1.2.11.2. MODIFICACION FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO

🛱 Factor Moned	la Acciones - Modif 🔀
Fecha Vigencia	01/01/2003 🔽
Moneda/Especie	ACC
ValFac (%)	14.7
J.	Aceptar 🔀 Cerrar

En esta opción solo se puede modificar ValFac (%), si se desea hacer otro cambio se debe eliminar el registro.



1.2.11.3. ELIMINAR FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO



Para eliminar un registro haga clic, sobre el botón ubicado en la parte superior Eliminar y automáticamente se elimina el registro como se muestra en la figura.

1.3. NOTAS OPERATIVAS DERECHOS

A continuación se describen las funcionalidades PWPREI para administrar Derechos de Contenido Crediticio y Económico, tales como Facturas, Cheques, etc.

Nota: Todos los parámetros generales referidos aquí acompañados de (V) se refieren a parámetros que tiene vigencia desde una fecha (Tabla FParGenVig)

- 1. **Condiciones Generales**. Hay un conjunto de parámetros que se deben establecer antes de empezar a operar los derechos:
 - a. Lista de derechos que podrán requerir un pagador. Se deberá establecer el parámetro general 8099, donde se indica qué tipo derechos requerirán de un pagador. Las operaciones de este tipo de derechos se deberán registrar bajo una especie con Emisor y Pagador establecidos. El sistema provee las facilidades para este manejo.
 - b. Lista de derechos con Fecha de Costumbre Comercial. Se debe indicar cuáles derechos se calcularán a partir de una fecha de costumbre comercial, en lugar de la fecha de vencimiento propia del papel. El parámetro general 8100 permite indicar esta lista. Los efectos se verán reflejados al registrar la operación.
 - c. Se podrá establecer, en concordancia con lo anterior, unos días de costumbre comercial, genéricos, aplicables a los derechos que lo requieren, siempre que el emisor y/o pagador del título no los especifique en forma particular. El parámetro general 8101 permite establecer estos días genéricos.
 - d. Tasa de Mora por tipo de derecho. La tasa de mora por tipo de derecho se aplica para vencimientos no recaudados, cuando se ha establecido en lugar de la tasa Mora general aplicable a todo vencimiento. La Tasa Mora se registra a partir de una vigencia y puede ser cambiada cuando cambien las



condiciones del mercado, indicando una nueva "Vigencia Desde" una determinada fecha. Los parámetros generales para este efecto se debe establecer así:

- i. Parámetro Tasa Mora Facturas: 18099(V)
- ii. Parámetro Tasa Mora Cheques: 18099(V)
- iii. Parámetro Tasa Mora Libranzas: 18099(V)
- iv. Parámetro Tasa Mora Contratos: 18099(V)
- v. Parámetro Tasa Mora Pagarés: 18099(V)
- vi. Parámetro Tasa Mora otros títulos: Para cualquier otro título, Derecho o no, se aplicará la Tasa Mora general establecida en el parámetro 18098(V).

NOTA: Aplicar la tasa de mora es opcional. Al realizar el recaudo el usuario podrá modificar la tasa sugerida por el sistema, incluso por el valor cero (0).

- e. Orden de Provisionar. Podrá establecer el comportamiento del sistema en cuanto a las provisiones cuando un vencimiento no sea recaudado. Si establece el parámetro general 18104(V) en SI, el sistema iniciará la provisión en la fecha de cumplimiento, en otro caso no la inicia.
- f. Derechos que se deben provisionar. Se puede establecer la lista de derechos que se deben provisionar. Esto se indica en el parámetro 8102.
- g. Máximo recaudo permitido sobre el vencimiento. Esto se indica en el parámetro 8103
- Emisores y Pagadores. Para establecer a) Qué Emisores se agregan a lista de pagadores o registrar nuevos pagadores y b) Para establecer los días de costumbre comercial aplicables a un emisor o pagador en particular, ingrese al administrador de emisores en "Mercado y Sociedad – Mercado – Emisores". Por ejemplo ubique un emisor para establecer estos datos, como se ve en la figura:



🐝 Emisor -	Modificar		_			(×
Código	ACF		Grupo Emiso	r	•		
Nombre	ACCION FIDUCIAR	IA	Calificadora	Otra			•
Nit	800155413		Calif. Corto	BRC 1+	Pais		
Calificación	AAA		CIIU	11111	Colombia		•
Sector	FIN		Vinculado	NO 🔻			
SubSector			Natural	SOCIEDADES	PRIVADAS NACI	ONALES	-
Entidad	SUPER FINANCIEF	RA 💌	Tipo de Id.	NIT SOCIEDAD)		•
Es Pagador	<u>SI</u> –		Días Costbre	15			
				F aranian			
			~		Aceptar	Len	ar

Nota: SI desea que para un emisor y/o pagador específico la fecha de costumbre comercial corresponda a la misma fecha de vencimiento del papel, de forma que no se agreguen días de costumbre comercial a esas operaciones, entonces indique el valor -1 en el campo "Días Costbre" de ese emisor y/o pagador.

3. **Especies y Pagadores**. Ahora, al registrar una especie podrá indicar o no un pagador. Aunque el sistema le da facilidades para crear automáticamente las especies de los derechos, a partir de los datos de la operación, podrá crearlas manualmente si lo desea, como se ve en las figuras:



Especies/Renta Fija - Modificar ESPECIE CON	I PAGADOR
Código FACTURA-PWP-PWCAB Emisor PWP Descripción Especie subordinada de FACTUF Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Curva Anterior FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo FACTURAS	Pagador PWCAB Nemo Eqv R. Fija ISIN1 ISIN2 Curva Nueva Categoria Categoria Grupo Calificación
Código SF [FAC1 Aval] Emisión Fungible	Calificadora Utra
Fecha Emisión Vencimiento Image: O2/11/2016 Image: O2/11/2016 Image: O2/11/2016 Tasa Referencia Image: O2/11/2016 Fs Image: Oscillation Image: Oscillation Vencimiento Image: Oscillation Image: Oscillation Flujo Número de Flújos Image: Oscillation Día Mes Oscillation Image: Oscillation Image: Oscillation Image: Oscillation Image: Oscillation Image: Oscillation	Calculo Descuento Tasa Calaia Descuento Tasa Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Clase Factor 1 Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000
Modalidad de Pago de Intereses	– Modalidad Pago de Reinversión
Modalidad Periodicidad NO APLICA VO APLICA	Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA
	Aceptar Cerrar



Especies/Renta Fija - Modificar ESPECIE	SIN PAGADOR
Código FACALIA Emisor FACAJ Descripción FACTURAS COP Calíficación 0 Indicador Estado ACTIVO Curva Anterior FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo FACTURAS	Pagador NOPAG Nemo Eqv R. Fija FACALIA ISIN1 ISIN2 Curva Nueva Categoria Grupo Calificación
Superfinanciera Código SF TDERECON Aval Emisión Fungible	Calificadora
Fecha Vencimiento Emisión Vencimiento 02/11/2016 02/11/2016 Tasa Filipo Referencia FS FS Spread Uso ACTUAL Día Mes O O Número de Flújos Cantidad Aplica Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad	Calculo Descuento Tasa Caja Descuento Tasa Calendario COMERCIAL Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento INTERESES Comisión VALOR Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Pottafolio Destino Retefuente < 5
NO APLICA NO APLICA	NO APLICA NO APLICA Cerrar

4. Parámetros para provisiones. Utilice la opción "Definición de Parámetros – Súper Financiera – Provisiones" para administrar los parámetros utilizados para calcularlas:



DEFINICION I	DE PARAMETROS		
Archivo Genera	I Super Valores PWPREI ContraPartes	Ventana	
Súper Financiera	🖏 Parámetros Provisiones Vencimientos en I	Mora	
ParCprs	Fecha Vigencia 30/06/2016 💽 Refrescar 🐚 C	argar 🔀 Exportar 🔀 E	iliminar Prvs Salir
F.Bandas T.	FechaVigencia DiasMoraHasta CalCre 30/06/2016 0 A	diticio PorProvision	0
F. Acc y Div	30/06/2016 5 B 30/06/2016 20 C 30/06/2016 60 D		10 50
F Allahe	30/06/2016 90 E 30/06/2016 999,999,999 F		75 100
Provisiones			
in the second se			
General			
PWPREI			
Contrapartes			
Emisor			

5. **Arrendamientos**. Para todo lo relacionado con arrendamientos vaya al documento "ARR_NotasOperativasContratosArrendamiento.docx". Estos derechos tienen un manejo especial en su registro y cuenta con un administrador especial, aunque las definiciones generales para derechos les aplican.

6. Operaciones.

a. Registro Individual. Registre sus operaciones sobre derechos de la misma forma como lo hace hoy, pero teniendo en cuenta las siguientes adiciones y acciones. Veamos el registro de una factura, en la primera pantalla solo hemos indicado el Emisor, el Pagador y la especie genérica:



📕 Renta Fija 📃
Tipo de Upe ación • Norma • Contado+1a5 C Repo • Simultáneas C Tr.Temp. C Forward C SWAP C Opciones
Datos Compromiso
Fecha Hegistro Fecha Uper Fec Cumplimito Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Urden Portatolio Hora Compra
Emisor Pagador Especie Depósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Tipo Fw
PWP SOFTWARE SA BCO. DE OCCIDENTE - FACTURA - FISICO - NEGOCIABLE - NOV
Debes Exciples Videoxeés
Datos raciales
01/07/2016 + 01/07/2016 + 0.000 COMPLETO + NO APLICA + NO / + 0.00 0.00
Cantidad Valor de Comora Ult Vir Mercado Pv6/Tradino Modalidad Beiny I Beno/Drr Oper Begreso Valor Giro/Becomor
Nominal Adquirido Costo Adquisición Nominal Derechos Trader Dias Cor Fec Compromiso Orden CPR
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir
PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado Título
MEC V NORMAL V
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION C.C.Banco
SECUNDARIO V ESPECULA V DVP V TRA V Cal. Crediticio Inv. A 0 V
🛗 Calcular 🛛 📈 Aceptar 🔀 Cerrar

Una vez pasamos de la especie, esta es compuesta y creada por el sistema, como se ve en la pantalla:

🔜 Renta Fija 🗾
Tipo de Operación ⓒ Normal C Contado+1a5 C Repo C Simultáneas C Tr.Temp. C Forward C SWAP C Opciones
- Datos Compromiso
Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimito Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio Hora Compra
Emisor Pagador Especie Pepósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Tipo Fw
Datos Faciales
Emisión Vencimiento asa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida
01/07/2016 - 01/08/2016 - 0.000 COMPLETO - NO APLICA - NO / 6.00 99.0151089 0.00
Cantidad Valor de compra Ult.VIr. Mercado PyG/Trading. Modalidad Reinv. T.Repo/Cpr Oper. Regreso Valor Giro/Recompra
2,000,000.0 1,980,302.18 1.980,302.18 0.0 NO A V NO A V 0.0 0 0.00
Nominal Adquirido Costo Adquisición Nominal Derechos Trader Días Cpr Fec Compromiso Drden CPR
2,000,000.0 1,980,302.18 2,000,000.0 TRADER1 • 0.000 01/09/201E FINAL •
Comisión Base Comisión Heterición Base Heterición Traslado Base Traslado Uperación Urigen/A Lubrir
PUL Nit Liente Nombre Liente Sistema Usuano Estacion Estado I Itulo
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION C.C.Banco
Calcular 📈 Aceptar 🔀 Cerrar



Adicionalmente en la pantalla puede ver:

- Fecha de vencimiento: Fecha real de vencimiento del derecho.
- Fecha Compromiso: Fecha Costumbre Comercial, calculada de acuerdo con los días CC establecidos para el emisor PWP SOFTWARE SAS. En caso de caer en día no hábil el sistema ajustará dicha fecha al siguiente hábil.
- C.C. Banco. Este aplica para cheques y podrá registrar el código de compensación del banco girador.
- Nominal Derechos. Indique el valor nominal original del derecho, antes de aplicar el margen de cobertura.
- b. Carga Masiva de Derechos. También podrá usar la plantilla especial de Carga Derechos para alimentar en forma masiva un conjunto de operaciones al sistema. El comportamiento en esta carga, para el manejo de especies y fechas es igual al registro manual. Utilice la opción corriente de Carga Compromisos, seleccione "Derechos", elija el archivo y las operaciones serán alimentadas al sistema:

PORTAFOLIO	DS Y RIESGO		đ
Archivo Métor	dos Políticas Contratos S	(AP	
Corport Compromision Contrators SWAP Contrators Contrat	Organizar C Por Grupo C Por Linea C Por Topo C Por Portafolo □ TODOS □ ===0 CLIENTES □ CLIMAR1 □ CLIMAR2 □ Y	PORTAFOLIO 01/07/2016 Norder © Corpor Beneficiarios CLIMARI Beneficiarios Topo S0000001:1 CARTERA S0000001:1 Lina do Nego Cerga de Datos FUBLICO Cerga de Datos Cartera Derechos:Contenido:Crediticis/El Lina do Nego Cerga de Datos FUBLICO Fecha Carga Dispress Fecha Carga Dispress Tipo Acchivo = Excel Vista PlanoMercado Vista PlanoMercado Contreño Sociones Sociones Sociones Sociones Sociones OD/07678A Od Tato Normal O Cardidador Od Tato Normal O Cardidador Od 840000 Od 0 820000 Od 840000	
Métodos		UMPRA COMPRA COMPRA Vista Strotes 1 Enrores Aceptar Cerrar	
Consultar			
VeR POSPRO			
VeR FONDO			
VeR Reservas			
Salir			

La plantilla especial para la carga de derechos se encuentra en el archivo "FormatosTodasEntrada.xls", hoja "CargaDCC-DCE"

- 7. Asociación de Especies. No deberá preocuparse por los parámetros de la especie antes de registrar la operación, el sistema al crear la especie también la asocia automáticamente a una especie genérica para los que el área contable ya habrá establecido los parámetros. El parámetro 8098 le indica al sistema como debe asociar las especies.
- 8. **Recaudos**. La pantalla de recaudos ha cambiado. Ahora, al hacer sus recaudos podrá ver:



a. Pantalla de consulta. Verá la pantalla como sigue; hemos corrido la barra hacia la derecha para que pueda ver las nuevas columnas:

er	ne Pag	оСарНоу	Saldo	TasaMora	DiasMora	InteresMora	ProvisionViene	Provision Hoy	Provision.Acu	Provisiona
•	0		7000000	15	2	0	0	0	0	SI
	0		7000000	15	2	0	0	0	0	SI
	0		7000000	15	2	0	0	0	0	SI
	0		7000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0 0		12000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0 0		12000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0 0		12000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0 0		120000000	15	2	0	0	0	0	SI

En la pantalla se puede ver:

- Opciones de consulta nuevas:
 - Vencidos. Trae los cumplimientos de los títulos ya vencidos.
 - SIProvisión. Trae los cumplimientos con recaudos no efectuados en fecha y para los que está indicado SI provisionar
 - NOProvisión. Trae los cumplimientos con recaudos no efectuados en fecha y para los que está indicado NO provisionar
 - DESProvisión. Trae los cumplimientos con recaudos no efectuados en fecha y para los que está indicado desafectar la provisión que hasta la fecha se haya causado.
- Botón nuevo: El botón Sel Provisiones sirve para acceder a las opciones de alterar los estados de provisión. Volveremos más adelante sobre este tema.
- b. Pantalla de recaudos. Al seleccionar un cumplimiento y acceder a la pantalla de recaudo esta se verá como sigue (Hemos seleccionado un cumplimiento vencido y con saldo pendiente para mejor ilustración ilustración):



🖳 Cu	umplir Vencimiento								- 🗆	×
Saldo Fecha 30/00	Viene Page 70,000,000.00 0 Cumpinto Num.Neg 6/2016 CL11329	o Hoy 70,000,000.00 ocio Descripció 17 19: Cobro	uevo Saldo 0.00 n de Capital <u>Generar</u>	Tasa Mora 15.00 4.00	ant. Mora 15,068.49 Valor 120,000,000.00	A Pagar 70,115,068	Viene Provision 42,000.00 Diferencia 49 0.00	0.00 Contra Valor 70,115,068,	n Acum. 42,000.00 Fecha Reca 905/07/201	Est.Pro SI audo 6 ~
	PUCBas	Movimiento	Valor	ContraValor	Valor	Movimiento	PUCBas	SufijoCum		
•	132130	CREDITO	120,000,000.00	50,000,000.00	50,000,000.00	CREDITO	168700101012	1		
	168700	DEBITO	120,000,000.00	50,000,000.00	50,000,000.00	DEBITO	111505612001	7		
	810505	CREDITO	120,000,000.00	50,000,000.00						
	830500	DEBITO	120,000,000.00	50,000,000.00						
*										
<										>

Como se ve hay campos adicionales y otros tienen significado adicional:

- Saldo Viene: Representa el saldo pendiente de pago. Es igual al campo "Valor" el primer día y luego puede cambiar si se hacen pagos parciales.
- Pago Hoy: Al abrir la pantalla se le muestra igual a SaldoViene, pues se supone que se va recaudar todo el saldo, pero su resultado depende del campo "ContraValor" que define el valor del pago.
- NuevoSaldo: Representa el valor que quedará pendiente de pago después del pago de hoy.
- Tasa Mora: Se muestra la tasa aplicable, según el tipo de derecho. Puede cambiarla.
- Días Mora: Días que lleva en mora el recaudo.
- Int. Mora: Valor de los intereses a aplicar, de acuerdo con la Tasa y los Días Mora.
- Calc.: Este botón permite recalcular los intereses, en caso de que cambie la tasa. Si Tasa=0 los intereses serán 0.
- Provisión Viene: Provisión calculada hasta ayer.
- Provisión Hoy: Provisión calculada hoy.
- Provisión Acu. Provisión acumulada.
- A Pagar: Es el total que se debe pagar = Saldo Viene + Intereses.
- Al izquierda verá que el estado del cumplimiento puede ser ahora, además de CUMPLIDO o PORCUMPLIR, VENCIDO. Esto ocurre cuando el papel rebasó su fecha de vencimiento y no se ha recaudado.

El recaudo funciona así: Lo que digite en el campo contravalor será aplicado primero a intereses y lo que quede se aplica al saldo pendiente de pago.



c. Provisiones. Puede cambiar los estados de provisión de un recaudo a voluntad. Para ello utilice el botón "Sel. Provisiones". Al pulsarlo verá la pantalla:

•	Cun	nplimientos												-		×
5	Ż															
	Π	FechaRegistro	NumNegocio	Concepto	FechaCumple	EstadoCum		ProvisionAcu	EstadoPro	NOProvisiona	ar	SIProvisionar	DE	SProvision		FechaRe
	Þ	29/06/2016	CLI13296	19	30/06/2016	VENCIDO		42,000.00	SI							29/06/20
		29/06/2016	CLI13297	19	30/06/2016	VENCIDO		420,000.00	SI							29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
																29/06/20
	L															29/06/20
	~						-				-		-			>
Fe	cha	Inicial	Fecha Final				_									
21	/06	/2016 🗐 🔻 🗹 Pe	eriodo 04/07/2016	6 🔲 🖛 📃		O XCump	olir	◯ Vencidos ◯	SIProvisión	O NOProvisión	0	DESProvisión	O Cum	plidos 🔘	Todo	s
			Sel. Pro	visiones	SalvarPrvs	Refresc	ar	Informe	Cerrar							

Tiene las siguientes opciones sobre los estados de provisión de los títulos:

- NOProvisionar. Pulse en el cajón al frente del título para pasarlo a estado de no provisionar. No podrá hacer esto con cumplimientos que ya traigan una provisión acumulada; estos solo podrá mantenerlos en SI Provisionar o pasarlos a DES Provisionar.
- SI Provisionar. Marque en la casilla del cumplimiento respectivo para ordenar el sistema que empiece a provisionar el cumplimiento. Este es el estado por defecto y se aplica cuando el título no se recauda en su totalidad. La provisión aplica sobre el saldo.
- DES Provisionar. Marque en la casilla del cumplimiento respectivo para ordenar el sistema que genere un movimiento contrario para llevar a cero la provisión de este cumplimiento, devolviendo así toda la provisión causada hasta la fecha.
- Momento. Las acciones que programe aquí se harán efectivas al momento de VALORAR al cierre.
- Pagos Hoy y Provisiones. Cuando se realiza un pago sobre un cumplimiento ya provisionado ocurre una de dos cosas sobre dicho cumplimiento:
 - Pago del Saldo Total. Si paga todo el saldo pendiente, el sistema cancela la provisión acumulada a la fecha sobre ese vencimiento. No olvide establecer en sus parámetros de recaudo los



movimientos necesarios para cancelar la provisión. Estos movimientos de provisión en particular quedarán atados al evento contable "RECAUDO".

- Abono al Saldo Pendiente. En este caso el sistema no tocará la provisión en el evento RECAUDO; sin embargo al VALORAR al cierre se generarán movimientos de cancelación de provisión por la parte correspondiente al pago realizado, de forma que la provisión acumulada quedará ajustada al saldo que quede después de aplicado el abono.
- d. Vigencia de Cumplimientos. Los cumplimientos quedarán vigentes en su pantalla hasta que se realice el recaudo total de los mismos, por lo que cada vez que acceda al módulo de recaudos la primera lista que se le mostrará será la de los recaudos que estén pendientes hasta la fecha activa del sistema.

9. Contabilidad:

- a. **Operación normal**. Utilice los indicadores corrientes para establecer los parámetros para los derechos, el sistema los reconoce como tales y realiza los asientos indicados.
- b. **Casos Especiales**. Para los temas particulares que pueden ocurrir en un derecho:
 - i. **Prepagos(Solo contratos ARR)**. Para los prepagos establezca los parámetros normales correspondientes a una venta, dado que un prepago es equivalente a vender parte de un título cualquiera.
 - ii. Moras. Los intereses de mora no se causan, solo se acumulan hasta que ocurra el respectivo pago. Por lo anterior solo debe establecer parámetros para los intereses de mora en el evento RECAUDO, con el valor fuente INTMORA, que se asentarán al recibir el pago junto con el recaudo de la cuota o capital pagado.
 - iii. **Provisiones**. Para cuando un derecho sea enviado a provisión debe establecer los parámetros en los siguientes eventos:
 - PROVISION+. Este evento se lanzará al valor al cierre y debe indicar los movimientos para mover la provisión causada en el día para un título enviado a provisión por mora. El valor fuente que debe utilizar es PROVISION+
 - PROVISION-. Este evento también se lanza al valorar al cierre y debe indicar los movimientos a realizar para llevar al cierre la provisión de un título para el que manualmente se indicado "Sacar de provisión" aunque no se haya realizado el pago. El valor fuente que debe utilizar es PROVISION-



3. **RECAUDO**. En este evento, acerca de la provisión, debe indicar los movimientos a realizar para matar la provisión acumulada cuando ocurre el pago del saldo en mora. Note que difiere del anterior en que para este caso se trata de la ocurrencia del pago; por tanto ocurre en el recaudo. El evento que debe indicar es **RECAUDO** y el valor fuente **PROVISION-**

1.4. OPCIÓN PWPREI



En este módulo se encuentran los parámetros necesarios tanto para la valoración del modelo oficial, como los modelos que escoja el usuario.



1.4.1. PARAMETRO RIESGO

DEFINICION I	NICION DE PARAMETROS - [Parametro Riesgo]									
📶 Archivo Gene	General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana 💷 🗗 🗙									
N 🕼 🗑 📕	《									
PWPREI	PortaPropio	NivelSituado	UsuarioGrabaOF	MetodoOF	ObservacionesOF	NivelConfianzaOF	NivelToleranciaOF	HorizonteTemporalC	SimulacionesOF	Us
	EMISORES PRIV.	PORTAFOLIO	PWPREI	SV	0	0	0	0	0	PW
ģj										
A										

En este parámetro se debe registrar la información necesaria para valorar en el método oficial, o en el método que se escoja, posee solo un registro y solo puede ser modificado.

1.4.1.1. Modificación parámetro de riesgo

👖 Parametro Riesgo - Moo	lificar		
Ingresar Datos			
Nivel Situado	PORTAFOLIO -	Metodo Analisis	SV 🔹
Portafolio Propio	EMISORES PRIV.	Nro Observaciones Analisis	20
Usuario Graba Oficial	PWPREI 💌	Nivel de Confianza Analisis	95
Metodo Oficial	SV 💌	Nivel de Tolerancia Analisis	0.01 💌
Nro Observaciones Oficial	0	Horizonte Temporal Analisis	1
Nivel de Confianza Oficial	0	Simulaciones Analisis	200
Nivel de Tolerancia Oficial	0 -	Diasde Interpolacion	100
Horizonte Temporal Oficial	0	Datos Minimos	5
Simulaciones Oficial	0	Netear Posiciones	SI 💌
Nivel para Margenes Propia	PORTAFOLIO	Portafolio Externo	NO 🔻
Usuario Graba Analisis	PWPREI -	VaR Súper Moneda Ext	NO 🔻
		· 🔊	Aceptar 🔀 Cerrar

HISTORICO DE VAR INTERNO

Con esta versión recibe las facilidades para mantener un histórico de sus mediciones de VaR.

10. Salvar Mediciones.

Puede configurar el sistema para almacene históricamente sus evaluaciones de VaR por los modelos PWPREI:


- ME: Simulación de Montecarlo Estructurado.
- SH: Simulación Histórica
- DN: Delta Normal
- DM: Duración Modificada.

Para hacer lo anterior solicite a su área de tecnología que le configure el parámetro 8092, según las mediciones de qué métodos desea guardar, así:

- ACTIVO:SH;ME;DN;DM Graba las mediciones con cada uno d los métodos.
- ACTIVO:DN;DM Graba solo las mediciones con Delta y Duración.

11. VaR en Informe de Valoración.

En conjunción con lo anterior se mejorado el Informe de Valoración estándar PWPREI para agragar la siguiente información:

 VaR del título. El VaR informado aquí corresponderá a la medición realizada por el modelo que tengas establecido en "Definición de Parámetros – PWPREI – ParRiesgo", en el campo Modelo Análisis:

	DN DE F	ARAM	ETROS - [Parametro	Riesgo]						
Archivo	Gene	ral Su	per Valores PWPR	El Co	ntraPartes Ventan	a					
Ng 🔕 😰	F)									
PWPREI	Р	orteDee	NivelCitus	da	Heupris CroboOE	MotodoOE	Obsory		E NivelTelerer	E	Lasing
		M 🔳 🛛	Parametro Riesgo -	Modific	car						×
			Ingresar Datos							_	
ParRiesgo			Nivel Situado		PORTAFOLIO			Metodo Analisis	DN		
Q			Portafolio Propio		EMISORES PRIV.		-	Nro Observaciones Analisis	186		
ParValora			Usuario Graba Oficial		PWPREI 💌			Nivel de Confianza Analisis	99		
			Metodo Oficial		SV 💌			Nivel de Tolerancia Analisis	0.01	-	
MonTasFWI	:		Nro Observaciones Ol	ficial	0			Horizonte Temporal Analisis	1		
			Nivel de Confianza Of	icial	0			Simulaciones Analisis	2000	_	
ParContab			Nivel de Tolerancia O	ficial	0			Diasde Interpolacion	20		
			Horizonte Temporal O	ficial		_		Datos Minimos	5		
			Simulaciones Oficial		0	_		Netear Posiciones	SI -		
			Nivel para Margenes I	Propia		_		Portafolio Externo	NO -		
SetParGen	.							VaB Súper Moneda Ext			
			Usuario Grada Analisi:	5				ran oupor nonoda zik			
8811											-
_									-		
								- Ali and a second s	Aceptar 🛛	Cerra	ar
EntesRegul	•										
Pactores											
ValPelion											
Patiero											
General											
Súper Financi	era										
Contraparte	5										
Emisor											

- Volatilidad del papel, por el medio mencionado
- RMSE, erro cuadrático medio, según el modelo mencionado.

Si el sistema no encuentra la medición a la fecha de valoración, estos datos se reportaran en cero.



Para papeles distintos de Rf, como acciones y divisas, el VaR reportado será por defecto el evaluado por el modelo de DN.

1.4.2. PARAMETRO VALORIZADOR

DEFINICION	DE PARAMETROS -	[Parametro Valo	orizador]						- 7 🛛
🔍 Archivo Gen	eral SuperValores F	PWPREI ContraPart	es Ventana						_ @ ×
N 🗛 🗑 🕨	le 🖓 📢								
PWPREI	Nro Decimales Tasa	Nro Decimales Preci	Nro Decimales Nomii	Nro Decimales Peso:	Nro Decimales Marg	Plazo Minimo Repo	Plazo Maximo Repo	Diferencia fecharep	Castigo Repo TasaF Ca
	8	8	2	2	5	1	90	2	10
<u>III</u>									
đ									
T 17									

Define los parámetros que utiliza el valorizador al realizar los cálculos, cuenta con un solo registro y solo puede ser modificado.

🔍 Parametro Valorizador	- Modificar 🛛 🛛 🔀				
Ingresar Datos					
Nro Decimales Tasa	β				
Nro Decimales Precio	8				
Nro Decimales Nominales	2				
Nro Decimales Pesos	2				
Nro Decimales Margen	5				
Nro Decimales Var	10				
Nro Decimales Ver	6				
Nro Decimales Duracion	6				
Nro Decimales Precios Acciones	\$ 5				
Valor Contrato OPCF	25000				
Max Dias Contado ACC	3				
Max Dias Contado RF	5				
Cambio Contrato OPCF	15/03/2004 💌				
Nuevo Valor Contrato OPCF	5000				
Tipo de Valoracion para OPCF	TRM				
Tipo de Valoracion para Forwad	TASAS 🗨				
Convertir Moneda	NORMAL -				
Aceptar 🔀 Cerrar					

Para administrar este tipo de contratos en PWPREI se requiere:

- 1. Revisar en los parámetros de valoración los dos campos enmarcados en verde en la figura anterior.
 - El parámetro "Nuevo Valor Contrato OPCF" establece el valor estándar de los contratos OPCFTRM que se negocian



en bolsa.

- El parámetro "Tipo de Valoración para OPCF" establece cómo se van a valorar estos contratos. Hay 2 formas posibles:
 - TRM, que indica que se valoren con el valor diario de la TRM.
 - Precio, que establece que se deben valorar con el precio publicado por la BVC para el vencimiento respectivo de cada contrato. Tenemos entendido que esta es la forma establecida por la SFC.
- Ingresar sus contratos de OPCF en el portafolio, como se muestra en el archivo adjunto (Ejemplo Carga Compromisos -FORWARDS-FUTUROS -INTERBANCARIOS.xls). Tener en cuenta que:
 - Cantidad: Número de contratos negociados.
 - ValorCompromiso: Valor en pesos del negocio.
 - TipoCompromiso: "OPCFTRM"
 - Especie. Debe ser una especie de Tipo "OPCFTRM". Esto se establece al crearla por la opción "Mercado y Sociedad – Especies – Acc/Div" en el campo "Tipo de Especie".
- Si se va a valorar con los precios publicados por la BVC, se deben cargar diariamente estos precios, por la opción "Mercado y Sociedad – Forwards/Opc. – Precios OPCFTRFM". Esto es lo recomendable.
- 4. Las OPCFTRM están incluidas en todas las versiones de PWPREI.



1.4.3. VALORAR A PRECIO DE COMPRA



En esta opción se define si un título se debe valorar con el precio de compra del día que se adquirió o de lo contrario se valora con el precio de mercado. Contiene un solo registro y solo se puede modificar.

1.4.3.1. Modificación valorar a precio de compra





1.4.4. TASAS DE VALORAR DINERO

🔄 DEFINICION I	DE PARAMETRO	S - [Tasas para	a Valorar Dinero]
Archivo Gene	ral Super Valores	PWPREI Conti	raPartes Ventana
💊 🖧 📝 🝕			
PWPREI	Moneda	Tasa	
	COP	CEC	
- Infl	EUR	LIBOR	
	UVR	CECUVR	
	YEN	LIBOR]
<u>ș</u> i			
@			
\$			

Se definen las tasas para valorar el Dinero

1.4.4.1. Modificación tasas de valorar dinero



1.4.4.2. Eliminar tasas de valorar dinero





1.4.5. ENTIDADES REGULADORAS

DEFINICION DE PARAMETROS - [Entidades Reguladoras]								
💁 Archivo Gene	ral Super Valores PWPREI ContraPar	rtes Ventana						
📎 🚨 🗹 💐	à 🎄 🚰 \mid 💖							
PWPREI	Codigo	Nombre						
	SB	SUPER BANCARIA						
and i	SF	SUPERFINANCIERA						
	SS	SUPERSOCIEDADES						
	SV	SUPER VALORES						
્રો								
Ŷ								
\$								

Esta opción permite registrar las entidades encargadas de vigilar el mercado, como pueden ser Supervalores, Superbancaria u otra que se requiera.

1.4.5.1. Modificación entidades reguladoras

Solo puede modificar la información correspondiente al nombre de la entidad reguladora. Cualquier otro cambio requerido implica eliminar el registro.

🖻 Entidades Reguladoras - Modificar						
Identificación Nombre	SB SUPER BANCARIA	1				
	Aceptar 🛛 Cerrar					

1.4.5.2. Eliminar entidades reguladoras





Para eliminar un registro escoja el ítem deseado y oprima la opción eliminar, el sistema pregunta si está seguro como muestra la imagen.

1.4.6. FACTORES DE RIESGO PWPREI

M DEFINICION DE PARAMETROS - [Factores de Riesgo PWPREI]							
🔜 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana							
S 🕼 📝 🗾	I 🖓 🗐						
PWPREI	Nombre	Descripcion	Tipo Factor				
	EURO/TRM	FORWARDS	MONEDA				
and i	NINGUNO	NINGUN FACTOR DD	NINGUNO				
	PWP	PRUEBA	INDICE				
	TRM/EURO	FORWARDS	MONEDA				
ă)							
@							
\$							
8							

Se definen los Factores de Riesgo de PWPREI.

1.4.6.1. Ingreso factores de riesgo PWPREI

Para ingresar debe llenar los campos con el Factor, el Tipo de Factor y la Descripción y después presionar el Botón Aceptar.



🔜 Factores PWPREI - Ingresar						
└ Ingresar Datos -						
Factor						
Tipo	•					
Descripción						
		1				
	🔬 Aceptar 🛛 🛛	errar				

1.4.6.2. Modificación factores de riesgo PWPREI

🖬 Factores PWPREI							
_ Ingresar Datos							
Factor	EUR0/TRM						
Tipo	MONEDA 👻						
Descripción	FORWARDS						
	Aceptar	Cerrar					

Haga clic sobre la casilla Tipo y escoja la opción, la casilla Descripción es la única que se puede modificar completamente.

1.4.6.3. Eliminar factores de riesgo PWPREI

🔜 F	actores PWPREI - Eliminar	×					
_ Ing	resar Datos						
Fac	PWPREI - RESOLUCION 513						
Tip	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?						
De	Sí No						
Aceptar 🗵 Cerrar							

Para eliminar un registro escoja el ítem deseado y oprima la opción eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.



1.4.6.4. Buscar factores de riesgo PWPREI

🏴 Buscar Factores PWPREI 💦 🔀						
Buscar Por						
Factor 🗾						
Todos los Registros						
Aceptar 🔀 Cerrar						

La consulta de información la puede realizar por la Fecha o señalando todos los registros.

1.4.7. PARAMETROS CONTABLES

DEFINICION D	DE PARAMETROS - [Parametros Contables]	- • ×
B Archivo Ge	ieneral Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana	_ 8 ×
🤊 🕷 🛛 🔰		
PWPREI	Especie Todas Acociar Especie Sulip Acociar Especie Sulip Associar-Des. K Eliminar	
PatRiesgo	Tipo Pure Destino Tipo Controla Tipo Investion Punta	
PalValora	Vider Carlo Carlo Carlo Vider Agregar Quitar	
MonT asFWE		
ParContab		
CUPOS		
EntesRegula		
Patta.		9
VaPrecom		
POTRO		
General		
Súper Financiera		
Contrapartes	Registra(s) 0	

Para la administración de los parametros contables se ha implementado nuevas facilidades. Seleccione la pestaña PWPREI y a continuación pulse el botón ParContab, la pantalla se vera como sigue:



DEFINICION E	DE PARAMETROS - [Parametros Contables]	- I - X-
B Archivo G	General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana	- 8 ×
PWPREI	Especie Todar Acociar Especie Sufio Acociar-Des.	
ParRiesgo	Tipo Puc Destino Tipo Compromiso Tipo Contra Tipo Investion Punta	
PalValora		
MonT asFWD		
ParContab		
CUPOS		
EntesRegula		
		0
ValRecom		
Para.		
General		
Súper Financiera		
Contrapartes	Registro(s) 0	

- En la pantalla anterior los botones encerrados en rojo son los que hasta ahora ha tenido disponibles para administrar los parámetros contables, los cuales seguirán activos por si desea utilizarlos. Los botones encerrados en verde corresponden a las nuevas funcionalidades disponibles para el efecto. Estos botones no se habilitan hasta que no elija una especie en particular enla parte superior izquierda de la pantalla y pulse el botón "Buscar".
- Puede consultar todos los parámetros existentes seleccionando "Todas" y pulsando "Buscar". La pantalla le parecerá con la lista de parámetros registrados en el sistema, como se ve:



Ng 🔈 👸 🔰	le 🖓 🕹													
PWPREI	Especie 🔽 To	idas 🕞	Asociar Esper	sie Sufijo										
	1	Busca	A		Disociar	EI EI	iminar		auardar	Salir Salir				
di l														
ParRiesgo	Tipo Puc	Destino	Tipo Comprom	iso Tipo Contra	Tipo Inversio	n	Punta							
ah i			_				-		1		~			
	Evento	Valor Fuente	PUC Base	SuhioMovimiento	Concepto		-	1 Modific	ar Agregar	Quitar	<u>×</u>			
ParValora		<u>.</u>					-							
	TipoPUC	Destino	TipoCompromiso	TipoContra	TipoInversion	Punta	Especie	Evento	ValorFuente	PUCBas	Sufi	Movimiento	Concepto	CentroCosto
MonTasFW/D		PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	13041801	01	CREDITO	19	1
_	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81741501	02	CREDITO	19	1
4	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
ParContab	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	13131801	01	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81771501	02	CREDITO	19	1
CUPOS	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	13081801	01	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81761501	02	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
8	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	13	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	1	1
EntesRegula	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	13	1
 B	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	1	1
Pactores	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	1	1
ValPfeCom	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	31	1
~	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	31	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
PaiDilitéro	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDAX	34130501	01	CREDITO	31	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	RENDIS	13131801	01	CREDITO	18	1
General	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	18	1
Concert Firmerican	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	RENDIS	81771501	02	CREDITO	18	1
Super rinanciera	CINANCIEDO	DDADIA	MINICUNO	IMA	DEDMANENTE	ICOMDDY	IDDCH10CQAV	MALODAD	DENNIE	1000E0001	Inc	Incolto	110	-
Contrapartes	Registro(s) 16333													

3. Si quita la selección de "Todas", elija una especie y pulsa "Buscar" se habilitarán los botones de edición, como se ve a continuación:

A (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1)														
PWPREI	Especie To	odas 🚺	Asociar Espe	scie Sufijo							1			
	BBCI1069AV	- Busca	<u> </u>	~	Disociar	L	liminar	1	Guardar	Sair				
111														
ParRiesgo	Tipo Puc	Destino	Tipo Compro	miso Tipo Contra	Tipo Invers	ion	Punta COMPRA							
<u>a</u> 1	Evento	Valor Evente	PLIC Base	Sufin Movimient	 Concento 			-		X	x			
44	NEGOCIAR	 IVACOM 	· 25350001	33 DEBITO		ulos		- Modiff	<mark>car</mark> Agregar	Quitar				
ParValora								_						
	TipoPUC	Destino	TinoCompromiso	TipoContra	TipoInversion	Punta	Especie	Evento	ValorEvente	PHCBas	Sufi	Movimiento	Concento	CentroCosto
		PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALOBAB	CAPITAL	13041801	01	CREDITO	19	1
Montashwu	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALOBAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81741501	02	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
ParContab	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	13131801	01	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81771501	02	CREDITO	19	1
CUPOS	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
00100	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	13081801	01	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
2311	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	81761501	02	CREDITO	19	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
8	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	13	1
<u> </u>	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	1	1
EntesRegula	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	13	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	1	1
Pactores	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIMIENTO	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	1	1
ValmeLom	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	31	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	31	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	BBCI1069AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
Part/Inero	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	CUBRIR	PERDIDAX	34130501	01	CREDITO	31	1
	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALORAR	RENDIS	13131801	01	CREDITO	18	1
General	FINANCIERO	РНОРІО	NINGUNU	NA	PERMANENTE	LUMPRA	BRCI1069AV	VALURAR	HENDIS	168/9501	07	DEBILO	18	1
Súper Financiera	FINANCIERO	PROPIO	NINGUNU	NA	PERMANENTE	COMPRA	BBCI1069AV	VALUHAH	HENDIS	00050004	- 02	DEDITO	18	1
Contrapartes	Denistra(s) 1000													

- 4. Para editar, seleccione en la grilla un registro (cuando usted da click en la grilla los datos del registro pasan a las casillas inmediatamente arriba de la grilla) que desee modificar o eliminar, o simplemente registre en las casillas inmediatamente arriba de la grilla los parámetros. Cada vez usted puede editar uno o varios campos y luego utilizar el botón de edición apropiado.
- 5. Use los botones asi:



- a. Modificar: Edite los datos en las casillas, uno o más, luego pulse este botón y el sistema modificará ese registro con los datos que usted editó. La modificación queda pendiente en un espacio temporal hasta que utilice el botón "Guardar".
- b. Agregar: Adiciona un registro a los parámetros, con los datos que usted registró en las casillas. Recuerde que usted puede registrar todos los datos de un parámetro y agregar. A continuación puede por ejemplo simplemente editar la cuenta y el movimiento y pulsar Agregar y esto adiciona otro registro a la lista de parámetros. El registro agregado queda pendiente en un espacio temporal hasta que utilice el botón "Guardar".
- c. Quitar: Quita el registro en edición de la lista de parámetros. Usted puede seleccionar en la grilla un registro, el cual pasa a las casillas de arriba, luego pulsar "Quitar" y ese registro será retirado de la lista. El registro queda en un espacio temporal, pendiente de quitarse definitivamente, has que utilice el botón "Guardar".
- d. Guardar: Este botón hace efectivos en el sistema los cambios generados con los botones "Agregar", "Modificar" y "Quitar".
- e. Eliminar: Utilice con responsabilidad, elimina todos los parámetros de la especie, que están listados en la grilla, en forma DEFINITIVA.
- f. Asociar Disociar: Este botón aparece como "Disociar" si la especie elegida está asociada y entonces le permite eliminar dicha asociación; o como "Asociar" si la especie elegida no está asociada y entonces le permite asociar esa especie a otra que se elija.
- g. Buscar: Seleccione "Todas" para listar los parámetros de todas las especies. Quite la selección de "Todas" y elija una especie para listar los parámetros de esa especie; si está no tiene parámetros los botones quedarán habilitados para empezar a registrarlos o para asociarla a otra que ya los tenga.
- h. Excel: Utilice el botón con el ícono de Excel para exportar lo que está listado en la grilla.
- i. Salir: Si no ha guardado lo editado, el sistema le preguntará si desea guardarlos y si responde NO se descartarán los cambios realizados.
- 6. Log de los parámetros. Recuerde que los cambios que usted realice en los parámetros son registrados en un log por el sistema. Para acceder al



log se debe ingresar al módulo de Auditoria, opción "ParContab" y consultar. Aparece la pantalla así:

Auditoria	🔁 Log Parámetros Con	tables												
	FechaEvent HoraEvento	Usuario	Estacion EventoLg	TipoPUC	Destino	TipoComproi TipoCor	ntra TipoInversio	Punta	Especie	FechaEmisio	FechaVencin	Evento	ValorFuente	
- *	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIENT	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	RENDIS	Ξ.
Acc/Divi	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	RENCPR	
.	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPE	
neritarija	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	INCUMPLIR	CXP	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	CUMPLIR	VALOPE	
12	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	VALORAR	RENDIS	
Esp. Asoc	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	RENCPR	
the second se	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPE	
Esp. Eqv.	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIERO	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	INCUMPLIR	CXP	
⊳ √Ω	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	PERMANENT	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	CUMPLIR	VALOPE	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	NEGOCIABL	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	RENDIS	
ParŘiesgo	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGERENC MODIFICA	FINANCIERO	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	NEGOCIABL	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	RENCPR	
~ ~	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGERENC MODIFICA	FINANCIERO	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	NEGOCIABL	PASIVA	BBCI1069AV	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGERENC MODIFICA	FINANCIERO		SIMULTANE/ SEG	NEGOCIABL	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	INCUMPLIK	CVD	
ParamVal	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	EINANCIER		SIMULTANE/ SEG	NEGOCIABL	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	CUMPLIK	VALODE	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGERENC MODIFICA	ETNANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SEG	VENCIMIEN	DACIVA	BBCI1069AV	NA	NA	VALORAR	DENDIS	
	2015-01-09 10:49:02	DAVID	PWPGEREN(MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/ SCP	VENCIMIEN	PASIVA	BBCI 1069AV	NA	NA	VALORAR	RENCPR	
	2010 01 00 10. 10.02	UNITE	I WI GEREIR HODI ICH	1 Interester of		Stride Price Ser	TEI TEI TEI T	102110	bberioosav			TALOIGAN	Kerterik	
ParContab	Exportar	Cerrer												
	Registro(s) 1088													1.
Salir														

Utilice el botón "Exportar" para vaciar la consulta a Excel.

Ver anexos 2.18.1. PARAMETRIZACION CONTABLE

Debe diligenciar todos los campos dependiendo de la parametrización que desea como se explica en **PARAMETRIZACION CONTABLE.** Todos los campos son requisito.

1.4.7.1. Eliminar parámetros contables

Utilice con responsabilidad, elimina todos los parámetros de la especie, que están listados en la grilla, en forma DEFINITIVA.

1.4.7.2. Buscar parámetros contables

Especie Todas TFIT15240720 V Buscar	Asocial Especie	Sufijo	K Eliminar	Guardar Salir
Tipo Puc Destino	Tipo Compromiso T PUC Base Sufijo	Tipo Contra Tipo Inversion Movimiento Concepto	Punta	Modificar Agregar

Seleccione "Todas" para listar los parámetros de todas las especies. Quite la



selección de "Todas" y elija una especie para listar los parámetros de esa especie; si está no tiene parámetros los botones quedarán habilitados para empezar a registrarlos o para asociarla a otra que ya los tenga.

1.4.7.3. Eliminar especie asociada

Elimina asociaciones de especies. Debe ubicarse en un registro, seleccionar el botón eliminar y seleccionar Asociar. Digitar la especie, el sufijo, la especie a la que se encuentra asociada y el botón Aceptar.

1.4.7.4. Buscar especie asociada

Debe presionar el botón buscar y seleccionar Asociar

🖻 Parametros Contables - Buscar 📃 🗖 🔀
Parametros Contables
Tipo Puc FINANCIERO 💌 Destino 💌 Tipo Compromiso 💌
Tipo Contra 🔽 Tipo Inversion 🗨 Punta 🗨
Especie Fecha Emision 13/02/2010 V Fecha Vencimiento 13/02/2010 V
Evento Valor Fuente 🗨
PUC Base Sufijo Movimiento DEBITO
Concepto 1: Compra de Títulos Centro Costo 02010601
Asociación de Especies Asociación de Especies Asociari Especie Nueva Sufijo Especie Todos los Registros
Aceptar Cerrar

La búsqueda se realiza por Especie Nueva o por Especie.

 Por Especie Nueva, debe seleccionar una especie de la lista y presionar aceptar el resultado de la búsqueda muestra la especie y la especie a la que se encuentra asociada



Parametros Contables - Buscar	
Tipo Puc FINANCIERO 💌 Destino	Tipo Compromiso
Tipo Contra Tipo Inversion Especie Fecha Emision	Punta Fecha Vencimier
Evento Valor Fuente	_
PUC Base Sufijo	Movimiento DEBITO
Concepto 1: Compra de Titulos	Centro Costo
Especie Nueva Sufijo Especie	Aceptar 🔀 Cerrar
Especie Especie2	Sufijo
DOLAR/PESO COP/TRM	01

Se puede ver que la especie DÓLAR/PESO está asociada a la especie COP/TRM Por Especie, debe escribir una especie y presionar aceptar el resultado de la búsqueda muestra las especies asociadas a la especie que digito.

🖻 Parametros Contables - Buscar
Tipo Puc FINANCIERO 💌 Destino 💽 Tipo Compromiso
Tipo Contra Tipo Inversion Punta Punta
Especie Fecha Emision 13/02/2010 🗸 Fecha Vencimier 13/02/2010 💌
Evento Valor Fuente
PUC Base Sufijo Movimiento DEBITO
Concepto 1: Compra de Titulos Centro Costo UNICO
Asociar Asociar Aceptar Cerrar



	Especie	Especie2	Sufijo
I	DOLAR/PESO	COP/TRM	01
I	EURO/TRM	COP/TRM	01
I	GBP/TRM	COP/TRM	01
I	PESO/TRM	COP/TRM	01
I	TRM/JPY	COP/TRM	01
I	TRM/PESO	COP/TRM	01
I	USA/PESO	COP/TRM	01
	YEN/TRM	COP/TRM	01

Se pueden ver las especies que están asociadas a la especie COP/TRM

Software S.A.S

2.1.4.7.4. NOTAS OPERATIVAS - CAUSACION LINEAL

Para utilizar las funcionalidades de "Causación Lineal" en PWPREI, proceda por favor:

- 1. Activar la función. Ingrese al módulo de "Definición de Parámetros", opción "PWPREI SetParGen":
 - a. Busque el parámetro con el número 8117.
 - b. Asígnele el valor "ACTIVO".
 - c. Pulse "Modificar".
- 2. Cree los parámetros contables para mover la causación lineal:
 - a. Ingrese al módulo "Definición de Parámetros", opción "PWPREI ParContab"
 - b. Adicione los parámetros para mover la causación lineal.
 - c. Para conocer los Eventos y Valores Fuente que debe utilizar en los parámetros por favor refiérase al documento "Notas Parametros Contables-Manual Parametros.docx"
- 3. Una vez hecho lo anterior el sistema realizará los cálculos correspondientes a:
 - a. Prima
 - b. Intereses lineales
 - c. Costo Fiscal
- 4. Los valores anteriores serán calculados en los siguientes eventos
 - a. Al valorar su portafolio con la opción "Contabilizar"
 - b. Al vender un papel, mediante la opción "Venta"
- 5. En los informes de valoración "Export.Val" y "Export.Consol" podrá ver las columnas:
 - a. Prima



- b. Causación Prima
- c. Intereses Lineales
- d. Causación Intereses Lineales
- e. Costo Fiscal

En el informe "Export.Consol" estos datos aparecen en la Hoja "Renta Fija" únicamente.

1.4.8. PARAMETROS MONEDA / TASAS FWD



Registre los códigos de las tasas que se utilizarán para valorar los forwards de divisas, según las divisas negociadas. Tenga en cuenta que los códigos de tasa que puede elegir aquí se limitan a tasas previamente creadas en el sistema. Si requiere de una tasa no existente debe ir al modulo Mercado y Sociedad, luego la pestaña Mercado y la opción Tasas y crearla.



🗟 Parametro		
Fecha Vigencia	01/01/2010 💌	BUS
Moneda	<u>/</u>	0
Tasa Primaria	-	0
Tasa Secundaria	-	
Tasa Terciaria	· ·	
Acepta	ar 🔀 Cerrar	

1.4.8.1. Ingreso parametros moneda / tasas FWD

Se ingresan las tasas para valorar los forward en orden de prioridad.

1.4.8.2. Modificar parametros moneda / tasas FWD

Se debe ubicar en el registro que se quiere modificar, presionar el botón modificar o dar doble clic. Aparece la siguiente pantalla donde se pueden modificar las tasas después presionar el botón Aceptar

🛋 Parametro			x
Fecha Vigencia	01/01/2010	-	BUS
Moneda	YEN	-	0
Tasa Primaria	LIB1	•	0
Tasa Secundaria	LIB2	•	Todos-
Tasa Terciaria	LIB3	•	
	ar 🔀	Cerrar	

1.4.8.3. Eliminar parametros moneda / tasas FWD

Se debe ubicar en el registro que se quiere eliminar y presionar el botón eliminar. Aparece la siguiente pantalla luego presionar el botón Aceptar



🛋 Parametro			X
Fecha Vigencia	01/01/2010	-	BUS
Moneda	EURO	-	0
Tasa Primaria	LIB1	•	0
Tasa Secundaria	LIB2	•	
Tasa Terciaria		- [Todos
	ГПРЗ	_	
Acepta	ar 🔀	Cerrar	

1.4.8.4. Buscar parametros moneda / tasas FWD

Presionando el botón Buscar aparece la siguiente pantalla, la búsqueda se puede hacer por Fecha Vigencia, Moneda, Tasa Primaria o Todos los registros, luego presionar el botón Aceptar.

🛋 Parametro		
Fecha Vigencia	01/01/2010 💌	BUS
Moneda	I	0
Tasa Primaria	-	0
Tasa Secundaria	•	- Todos-
Tasa Terciaria	•	
Acept.	ar 🔀 Cerrar	

1.4.9. CUPOS

Con las funcionalidades que permiten el manejo de cupos de Emisor, Contraparte y Trader en PWPREI, se incluye la lista de parámetros que es posible establecer para que el sistema cargue y descargue los respectivos cupos. Los parámetros comprenden los conceptos que afectan los cupos y los factores que definen la forma de afectarlos

a. Conceptos.



- i. Tipo de Cupo. Se refiere a la pertenencia del cupo: Emisor, Contraparte o Trader.
- ii. Tipo de Compromiso. Se refiere al tipo de negocio realizado: NINGUNO, CONTADOMAS, SIMULATANEA, REPO, FUTURO, FORWARD.
- iii. Posición. Se refiere a la punta o posición en el negocio: COMPRA, VENTA, ACTIVA, PASIVA
- b. Factores.
 - Factor FecOper. Establece como se consumirá o liberará el cupo en la fecha de realización de la operación, según el tipo de cupo, el tipo de compromiso y la posición en el negocio. Por ejemplo para Tipo Cupo = EMISOR, Tipo Compromiso = NINGUNO, Punta = COMPRA, este factor está establecido por defecto en CONSUME; que indica que se le debe cargar consumo de cupo al emisor involucrado en el negocio. Así mismo para Tipo Cupo = EMISOR, Tipo Compromiso = NINGUNO, Punta = VENTA, este factor está establecido por defecto por defecto en DESCARGA; que indica que se debe liberar cupo al emisor involucrado en el negocio. Este factor puede asumir cualquiera de estos valores:
 - 1. CONSUME. Consume cupo
 - 2. DESCARGA. Libera cupo
 - 3. NO APLICA. No se toma acción alguna, no carga ni descarga cupo.
 - ii. Factor FecCumple. Establece como se consumirá o liberará el cupo en la fecha de cumplimiento de la operación, según el tipo de cupo, el tipo de compromiso y la posición en el negocio, en forma similar al factor FecOper. Este factor puede asumir cualquiera de estos valores:
 - 1. CONSUME. Consume cupo
 - 2. DESCARGA. Libera cupo
 - 3. NO APLICA. No se toma acción alguna, no carga ni descarga cupo.
 - iii. Factor Valor Fuente. Estable que valor se debe tomar para consumir y liberar el cupo correspondiente. Este factor solo puede asumir 2 valores:
 - 1. VALOPE. El cupo se consume y libera por el valor de la operación
 - 2. NOMINAL. El cupo se consume y libera por el valor nominal del título involucrado en la operación. Típicamente para cupos de Emisor.

1.4.9.1. Administración de cupos.

Para cambiar los parámetros preestablecidos por el sistema y para otorgar cupos a los Emisores, Contrapartes y Traders, ingrese a PWPREI por el módulo Definición de Parámetros, pestaña PWPREI, opción Cupos. Se le presentará la siguiente pantalla:



PWPREI	
ParRiesgo	Construction Construction Parametros Tipo Cupo Tipo Cupo Tipo Construction Parametros CONTRAPARTE CONTADOMAS COMPRA CONSUME DescarGA VALOPE Aplicar
ParValora	Empresa/Fideicomiso 9003380734 PWP SOFTWARE SAS. Fecha Registro 11/08/2014 -
	CONTRAPARTE Cupo Vigencia ExtraCupo Vigencia Total Consumo Saldo Saldo Saldo ExtraCupo 405 20.000.000.0 [31/12/2014] [0.0 [31/12/2014] [20.000.000.0
	BANCO DE OCCIDENTE Reference Agregar Keliminar Aplicar Descartar Reference Sality
	FechaRegis NitEmpFide TipoCupo Codigo Cupo FechaVigen ExtraCupo CupoTotal Consumo SaldoTotal Saldo 11/08/2014 9003380734 CONTRAPARTE 405 20.000.000.01 31/12/2014 0.00 20.000.000.00 0.00 20.000 20.000 11/08/2014 9003380734 CONTRAPARTE 410 2.000,000.00 31/12/2014 0.00 2.000,000.00 2.000
ValPreCom	
ParDinero	
EntesRegula	
Factores	
General	
Contrapartes	

En el primer recuadro, Parámetros, podrá recorrer y/o modificar los parámetros establecidos según lo expuesto en el numeral 1.

El segundo recuadro, Cupos, le permite administrar los cupos de los emisores, contrapartes y traders, según su necesidad.

El tercer recuadro es una grilla que presenta el conjunto de cupos otorgados según el tipo mostrado en "Tipo Cupo" del primer recuadro. Observe que "Tipo Cupo" controla lo que se muestra en los dos cuadros inferiores.

c. Administrar Parámetros.

Para modificar los parámetros simplemente recórralos y al cambiar alguno pulse el botón "APLICAR" o "DESCARTAR" para desechar los cambios. Cómo los recorre? Simplemente pulse en el campo respectivo y el sistema cambiará al siguiente en la lista. Por ejemplo, si en la pantalla anterior usted pulsa en "CONTRAPARTE", luego en "CONTADOMAS" y luego en "COMPRA", la pantalla cambiará a:



Cupos EMISOR -	CONTRAP	ARTE - TRADER							
Parametros Tipo Cupo	Tipo	Compromiso	Punta	En Fec. Oper.	En Fec. Comp/Venta	Valor Fuente			
EMISOR		NINGUNO	VENTA	DESCARGA	NO APLICA	NOMINAL	Aplicar	Descarta	•
Cupos Empresa/Fideico	miso lano:	2200724		CYC			Fecha Begi	istro In 2002001 4	1
EMISOR	Cupo	Vigencia	a ExtraCu	po Vigencia	Total	Consumo	Saldo	Saldo - ExtraCup	0
		31/12/	2014	31/12/20	14				
BANCO DE OCCID	ENTE		∎ø⊳	Agregar X Elin	ninar 🛛 🔬 Apl	icar 🔀 Descartar	nici 🖉	alizar 🔣 S	alir
FechaRegis NitEmp	Fide	TipoCupo	Codigo	Cupo Fecha	/igen ExtraCuj	oo CupoTotal	Consumo	SaldoTotal	Saldo
 • □									•

Para cambiar los factores que afectan el conjunto tipo de cupo, tipo de compromiso y punta que ve en cada pantalla, simplemente pulse sobre el factor correspondiente y este le ofrecerá la siguiente opción y cuando sea la de su elección simplemente pulse APLICAR. Sea intuitivo y proceda con confianza, la pantalla es tan simple como se ve.

Observe además que al pulsar en el campo Tipo Cupo, los cuadros inferiores cambiaron. En este caso como no hay cupos de emisor establecidos no se muestra nada en la parte inferior.

d. Administrar Cupos.

Los cupos son otorgados por usted o por las carteras que administra. El otorgante de un cupo corresponde a lo desplegado en el campo "Empresa/Fideicomiso". Simplemente registre su Nit o el de la cartera para la que va administrar los cupos y el sistema quedará ubicado en ese Nit. Si usted no administra carteras en este campo siempre debe estar su Nit, no registre otro.

Para otorgar o quitar cupos, simplemente pulse arriba bajo Tipo Cupo hasta que aparezca "CONTRAPARTE", "EMISOR" o "TRADER", la clase de cupo que desea administrar. Luego en el cuadro de la mitad registre:

- Código. Código del Emisor, Contraparte o Trader al que va otorgar cupo.
- Cupo. Valor del cupo asignado.
- Fecha Vigencia. Hasta cuándo quedará vigente ese cupo.
- Extra Cupo. Si requiere otorgar un extra cupo, regístrelo en ese campo.
- Vigencia. Vigencia del Extra cupo.

Luego pulse Aplicar en ese cuadro para grabar los datos.

Si necesita modificar un cupo, pulse doble click en la grilla sobre la línea del Emisor,



la Contraparte o el Trader a modificar. Cambie los datos cupo, extra cupo o vigencias que requiera y luego pule Aplicar.

Como en el cuadro de la mitad siempre aparece el primer registro o el que usted haya seleccionado de la grilla inferior, cuando necesite agregar un nuevo cupo pulse prime Agregar y luego registre los datos y pulse Aplicar.

1.4.9.2. Inicializar Cupos.

- e. Por Defecto, Individual. Cada vez que usted registra un nuevo cupo o modifica uno ya existente, el sistema inicializa ese cupo. Por ejemplo, si le otorga cupo al emisor "Banco Pepito", el sistema buscará en su portafolio todas las operaciones vigentes que involucren a "Banco Pepito" y le cargará los consumos correspondientes.
- f. Inicialización de Todos. Para inicializar todos los cupos pulse el botón "Inicializar". EL sistema procederá a cargar los consumos de todos los emisores, contrapartes y traders involucrados en el portafolio activo a la fecha de proceso actual, para todas las carteras y para la posición propia.

1.4.9.3. Estado Activo.

Como ve en la pantalla, al ingresar usted se encuentra en una fecha de proceso especifica. Adicionalmente usted puede indicar la cartera o su posición propia, a la que desea administrar los cupos. Por ejemplo, en la pantalla usted ve el estado al 11/08/2014 del cupo de Emisor otorgado por PWP Software SAS al Banco de Occidente:

Cupos EMISOR - CON	IRAPARTE - TRADER							
Parametros								
Тіро Сиро	Tipo Compromiso	Punta	En Fec. Oper.	En Fec. Comp/Venta	Valor Fuente			- I
EMISOR	CONTADOMAS	COMPRA	CONSUME	NO APLICA	NOMINAL	Aplicar	Descarta	3T
Cupos								_
Empresa/Fideicomiso	9003380734	PWP SOFTWARE	SAS.			Fecha Reg	jistro 11/08/2014	-
EMISOR Cup	Vigencia	s ExtraCup	o Vigencia	Total	Consumo	Saldo	Saldo - ExtraCup	00
180C 120,1	JUU,UUU.U 31/12/	2014 - 10.0	31/12/20	4]20,000,000.0		120,000,000.0	120,000,000.0	
BCO. DE OCCIDENTE			Agregar 🛛 🗙 Elin	inar Apli	car Descartar	(Inici	ializar 🛛 🔣 🛛	Salir
FechaRegis NitEmpFide	TipoCupo		Cupo FechaV	gen ExtraCup	cupoTotal	Consumo	SaldoTotal	Saldo
11/00/2014 3003300/34	EMISON		20,000,000,000 3171277	.014] 0.0	20,000,000.00	0.00	20,000,000.00	20,000
٠ 📃								۰.

1.4.9.4. Operatividad de los cupos.

Una vez acomodados los parámetros a su manejo particular y otorgados los cupos que



requiera, no necesita hacer nada distinto a lo que hoy hace en el sistema. Simplemente ocurrirá que:

- g. Novedades del Portafolio. Cuando ocurra una novedad en el portafolio; es decir, una compra, una venta, una simultánea, etc., el sistema cargará o descargará consumos, según los parámetros, en forma automática.
- h. Cierres. Al cierre, el sistema descargará los consumos por los cumplimientos ocurridos en el día en proceso, según lo establecido en los parámetros.

1.4.9.5. Exportar.

Usted puede exportar el contenido de la grilla, para ello simplemente pulse el botón:



Elija el archivo para guardar y tendrá una lista de los parámetros de la empresa o cartera, y del tipo en pantalla.

1.4.9.6. Carga Inicial.

Si lo desea puede utilizar el formato de carga Excel adjunto, registrar ahí sus cupos y entregarla a tecnología para que los cargue utilizando el script que se genera en la columna J.

1.4.9.7. Requerimientos.

Recuerde que, una vez haya activado la funcionalidad de "Control de Cupos" en el sistema, lo cual ocurre mediante un parámetro interno, no podrá registrar ninguna operación para la que no haya previamente establecido el cupo de Emisor, Contraparte y Trader. El sistema emitirá un mensaje de error si el cupo no existe, se consumió totalmente o perdió su vigencia.

1.4.10. FUNCIONES PARA ADMINISTRACION Y CONTROL DE CUPOS

a. Cupos por Emisor.

Los cupos por emisor se establecen para cada emisor sobre el que se define la posibilidad de realizar inversiones, a nivel de la empresa. Se entiende que usted asigna los cupos tomando como base lo que normativamente debe cumplir; es decir, el sistema actúa sobre los cupos que usted asigne. La concepción de tales cupos en PWPREI es como sigue:

- El sistema permite asignar un cupo a cada emisor, con una vigencia, o fecha de expiración, específica.
- El cupo es neto, es decir la resta de compras menos ventas, sin importar su fecha de cumplimiento.



- El cupo se consume o libera por el valor nominal de los títulos, convertido a la moneda de operación (Si usted opera PWPREI moneda extranjera, el cupo se consume en su moneda de operación; comúnmente \$USD; si opera PWPREI versión local el cupo se consume en \$COP), utilizando la tasa de conversión registrada para el día.
- El cupo para cada emisor se consume con las posiciones de compra, desde la fecha de realización de la operación. Así, tanto las operaciones spot como las de contado consumirán el cupo desde la fecha de la operación.
- El cupo se libera con la venta de posiciones, desde la fecha de realización de la operación. Así, tanto las operaciones spot como las de contado liberarán el cupo desde la fecha de la operación.
- Las operaciones de liquidez consumen o liberan cupo, según la posición activa o pasiva, como si fuesen posiciones spot.
- El sistema ofrece la opción de "Extra Cupo", el cual puede ser asignado por un usuario autorizado para el efecto, con una vigencia específica. El Extra Cupo se asigna al emisor específico deseado.
- El sistema no permite el registro de operaciones que no cumplan con las políticas de cupo establecidas. Por lo anterior, al terminar la vigencia de un cupo asignado, el sistema cierra el registro de operaciones hasta tanto no se abran nuevos cupos o se amplié la vigencia. Lo anterior significa que al terminar la vigencia el sistema opera como si el cupo fuese cero.

b. Cupos de Contraparte.

Los cupos de contraparte se establecen para cada contraparte sobre la que se define la posibilidad de cerrar operaciones, a nivel de la empresa. Se entiende que usted asigna los cupos tomando como base lo que normativamente debe cumplir; es decir, el sistema actúa sobre los cupos que usted asigne. La concepción de tales cupos en PWPREI es como sigue

- El sistema permite asignar un cupo a cada contraparte, con una vigencia, o fecha de expiración, específica.
- El cupo no es neto; es decidir, cada operación que se realice con una contraparte consume cupo de esa contraparte, sin importar si su posición es activa o pasiva.
- El cupo se consume o libera por el valor de la operación en la moneda de operación (Si usted opera PWPREI moneda extranjera, el cupo se consume en su moneda de operación; comúnmente \$USD; si opera PWPREI versión local el cupo se consume en \$COP).



- El cupo para cada contraparte se consume con el cierre de operaciones con esa contraparte, desde la fecha de realización de la operación, sin importar si la posición es activa o pasiva.
- El cupo se libera con el cumplimiento de las operaciones, al cierre. Las operaciones spot liberan el cupo al final del día de su realización, mientras las operaciones de contado y los compromisos futuros lo liberan al cierre del día de su cumplimiento.
- El sistema ofrece la opción de "Extra Cupo", el cual puede ser asignado por un usuario autorizado para el efecto, con una vigencia específica. El Extra Cupo se asigna a la contraparte específica deseada.
- El sistema no permite el registro de operaciones que no cumplan con las políticas de cupo establecidas. Por lo anterior, al terminar la vigencia de un cupo asignado, el sistema cierra el registro de operaciones hasta tanto no se abran nuevos cupos o se amplié la vigencia. Lo anterior significa que al terminar la vigencia el sistema opera como si el cupo fuese cero.

c. Cupos por Trader.

Estos cupos se establecen para cada Trader operando en su mesa de negociación. La concepción es como sigue:

- El sistema permite asignar un cupo a cada Trader, con una vigencia, o fecha de expiración, específica.
- El cupo no es neto; es decidir, cada posición que tome el Trader consume cupo de ese Trader, sin importar si su posición es activa o pasiva, mientras esa posición esté vigente.
- El cupo se consume o libera por el valor de la operación en la moneda de operación (Si usted opera PWPREI moneda extranjera, el cupo se consume en su moneda de operación; comúnmente \$USD; si opera PWPREI versión local el cupo se consume en \$COP).
- Para el control de los cupos de Trader el sistema define un portafolio virtual para cada Trader, de manera que:
 - El cupo se consume cada vez que entra una posición al portafolio virtual del Trader.
 - El cupo se libera cada vez que sale una posición del portafolio virtual del Trader.
 - Se entiende que una posición entra cuando permanece:
 - Una compra o una venta por ingreso normal permanece



- Una compra o una venta por calce no permanece, a menos que el calce sea parcial, en cuyo caso la punta con mayor saldo deja un remanente en el portafolio.
- El sistema ofrece la opción de "Extra Cupo", el cual puede ser asignado por un usuario autorizado para el efecto, con una vigencia específica. El Extra Cupo se asigna al Trader específico deseado.
- El sistema no permite el registro de operaciones que no cumplan con las políticas de cupo establecidas. Por lo anterior, al terminar la vigencia de un cupo asignado, el sistema cierra el registro de operaciones hasta tanto no se abran nuevos cupos o se amplié la vigencia. Lo anterior significa que al terminar la vigencia el sistema opera como si el cupo fuese cero.

2. FUNCIONES.

PWPREI implementa las siguientes funciones:

- Funciones para la administración de los cupos emisor. Podrán ser autorizadas a un usuario específico
- Funciones para la administración de cupos contraparte. Podrán ser autorizadas a un usuario específico
- Funciones para la administración de cupos por Trader. Podrán ser autorizadas a un usuario específico
- Las funciones de control descritas para los cupos emisor, insertas en la operatividad del sistema.
- Las funciones de control descritas para los cupos de contraparte, insertas en la operatividad del sistema.
- Las funciones de control descritas para los cupos por Trader, insertas en la operatividad del sistema.

1.4.11. PARAMETROS GENERALES DE PWPREI

Los parámetros generales de PWPREI son un conjunto de estados para indicar al sistema cómo comportarse en casos particulares. Estos parámetros en general deben ser administrados por el área de sistemas ya que no se deben cambiar arbitrariamente ni en forma frecuente. Adicionalmente, un cambio inapropiado puede causar un total mal funcionamiento del sistema en más de un aspecto. El área de sistemas puede decidir:

- Cuáles dejar visibles a los usuarios
- Cuáles de los visibles pueden ser modificados por los usuarios.



• Cuáles serán de uso exclusivo del área de sistemas

Presentamos aquí la pantalla de administración de los parámetros, el tema de cómo definir lo anterior se deja por fuera de este documento:

1. Ingresar al Administrador.

Ingrese por "Definición de Parámetros – PWPREI. Pulse "SetParGen". Verá una pantalla como esta:

6	Parametros G	ienerales PWPREI		
WPREI	Parámetro:	Descripción:		
				-
arRiesgo	Valor:	[Helrescar Modilicar Exportar	Sale
Q. P	arNum	Nombre	ParVal	
arValora	-10000	Redondeo intermedio en conversión tasas a modalidad pago: Defecto=3 como en los TDA	4	
<u>~</u>	-9999	ACTIVO-ELE ISBY ANNA SBY SPREAD	ACTIVO	_
	-9998	ACTIVO=PONE VALMERCADO EN VALRPWP PARA FORWDV Y FUT	INACTIVO	
nlasHWE	-9997	Fecha Vigencia Nuevas Curvas InfoValmer	20140119	
	-9986	Usuario autorizado para Devolver Cierres	PWPREI	
≝.	-9985	Control CECCCT	CECCCT	
arContab	7000	S=Valorar compromisos precio de compra el día de la operación. (Especial Valorizador Web)		
	8000	Funciones de BackOffice: ACTIVO o INACTIVO	ACTIVO	
	8001	Movimientos Contables: ACTIVO o INACTIVO	ACTIVO	
	8002	Log del Portafolio: ACTIVO o INACTIVO	ACTIVO	
	8003	Notificaciones:ACTIVO=notifica pagos, ingresos, INACTIVO=no notifica	INACTIVO	
etParGen.	8010	Numeración o Consecutivo general del sistema	127216	
	8011	TIPOPUC: FINANCIERO, AGENTE, BRP, GNA, PENSIONES, CESANTIAS	FINANCIERO	
	8012	CPR Liquidez cumplidos al trasladar en CIERRE. IGNORAR:no traslada, NINGUNO:tralada como NINGUNO	NINGUNO	
	8013	Utilidad en Venta, Default PREMER=Val Ven - ValMer Ayer, C-V=ValVen - Valor Compra	PREMERTODO	
[8014	SI:Calcule Causación en ValPortafolio normal, NO:Como siempre(No calcule)	SI	
8	8020	Login con Directorio Activo	INACTIVO	
<u> </u>	8021	Consecutivo para documentos contables	0	
esRegula	8022	"FAC"=Título de Facturas, "" o "N" = No definido	FAC	
	8023	"ACTIVO"=MovCon y Log facturas, "INACTIVO"=No MovCon y Log	INACTIVO	
	8024	ACTIVO=Usara isin ANNA	ACTIVO	
5.3	8025	Numero de caracteres del PUC Basico, sin incluir el sufijo	6	
	8026	ACTIVO =LEER PUCS DE PARAMETROS, INACTIVO =IGNORAR	ACTIVO	
aPreCom	8027	INACTIVO=Diferencia en Cambio por Obligación	INACTIVO	
	8028	String prefijo de tabla N09Obligaciones		
900 - C	8029	Servidor para WEBSERVICE IntContable		
	8030	Usuario para WEBSERVICE IntContable		
seneral	8031	Clave para WEBSERVICE IntContable		
r Financiera	8032	ACTIVO=351 automático	ACTIVO	

2. Modificar.

Para modificar un parámetro haga click en la grilla en la línea del parámetro que desea modificar.

• En la parte de arriba se copian los datos del parámetro:



💐 Parametros	Generales PWPREI	
Parámetro:	Descripción:	
8091	Control de ISINES, ACTIVD=Verificar ISINES	
Vak	ACTIVO	
Parlium	Nombre	Part/al
806	ACTIVO=Cierre por portafolio, en lugar de general	ACTIVO
806	ACTIVO-Carrae Evalutilita Peroritaria generari	ACTIVO
805	Code A-Parta I. Code and A-Parta 2. etc. (Porta fondina de parta p	Rentro
806	ACTIVO=Numerar automaticamente. CONPORTA=Preceder con 3) etras PORTA	CONPORTA
807	PREMER =VaR Carteras con PREMER, CLIRVA=con puntos curva dve titulo."" u OTRO=como circular	
807	FSP:SoName ISP:SoName FVW:ViewName IVW:ViewName FTB:TabName ITB:TabName IPI (Plano)	TPI
807	ACTIVO=Trader asociado Lisuario, PROPIAS=solo Adm. propias, no acción en otro caso	17 W
8074	ZEROS: Lista en comilla simple senarada nor comas: ect. Xa nortafolios generar en zeros	
807	RESPBRP:PEDRO PEREZ GARCIA, INFORMADOR, poerz@micorreo.com.co.55588844	
807	Valor porcentual para alarma diferencias RECAUDO	1
807	ACTIVO=No recontabilizar la valoración al vencimiento de los títulos	INACTIVO
807	RESERVADO, NO EN USO	
807	Tabla o VW o SP para el 351: ETB:TbName, ITB:TbName, ESP:SoName, ISP:SpName	
808	ACTIVO_ECT=Control Cupos Emisor,Contraparte,Trader=Activo	
808	MESA=archivo mesa(SIOPEL) es el de proceso y MEC el de validar	MESA
808	Consecutivo archivos de Custodios.	50
808	Tipos de negocio excluidos de movimientos contables.FUTUROS;LIQUIDEZ; etc.	
8084	ACTIVO: Maneja Custodios	ACTIVO
808	Fecha Vigencia NIIF	20150228
808	EXCEL_COMPLETA;MEC_DATOS;MESA_COMPLETA;VISTA_NO;SP_NO	EXCEL_COMPLETA
808	Numerador procesos de carga: archivos, vista o sp	35
808	Tipos de negocio excluidos de archivos Custodios.FUTUROS;LIQUIDEZ; DERIVADOS;CREDITICIO	CREDITICIO
808	Fuente Serie FICs.VW:Name o SP:Name o WS:Name	
809	Modo de uso de CVA: vacio o GENERAL=General, XCARTERA=X Cada fondo	GENERAL
809:	Control de ISINES. ACTIVO=Verificar ISINES	ACTIVO
900	Número máximo de Threads ValJava	0
900:	Versión: VREIC042, V2012OTC, VREIMONEXT, VREI2014BOF, VREI2015NIIF_CC, REI2015NIIF_VC, VREI2015NIIF_SW	VREI2015NIIF_SW;VREI2016ROP
900	Consecutivo NumNegocio y/o NumOrden	508
		\sim

 Seleccione en el campo Valor, el valor que desea asignar al parámetro y en seguida pulse el botón "Modificar". Se le preguntará si desea modificar el parámetro. Se modificará el parámetro y aparecerá el mensaje:



3. Refrescar.

Utilice el botón "Refrescar" para actualizar los parámetros en pantalla.

4. Exportar:

Utilice el botón "Exportar" para obtener los parámetros en un archivo Excel.



1.5. OPCIÓN CONTRAPARTES

1.5.1. CONTRAPARTE



2.1.5.1. CONTRAPARTE

	DADAMETROS IC	antra Dartaol														_ 0	-X
🕍 Archivo Gene	aral Super Valores	PWPREI ContraPartes Ve	entana														_ 8 X
N 🗛 👔 🔎	V																
Contrapartes	Codigo Super	Nombre	Tipo Entidad	Codigo BVC	Codigo SEN	Codigo SET	Grupo Emp.	Cod. Contra.	Supervisada	Calidad Trib.	Direction	Telefono	Ciudad	Email	Tipo de Ider	Nit	Tipol 🔺
	101	H BOLSA DE VALORES D	NACION	101) ()		SF	AUTORETE	CRA 7 No. 7	3139800	BOGOTA		NIT SOCIED	830085426	
	423	ACCION FIDUCIARIA	NACION	423	0) ()		SF	AUTORETE	CALLE 85 N	6915090	BOGOTA		NIT SOCIEE	800155413	
	22	ACCIONES DE COLOMBI#	NACION	0	0) CFI			SV	AUTORETE	Calle 80 No.	3318200	BOGOTA		NIT SOCIEE	800073493	
Contraparte	7	ACCIONES Y VALORES S	NACION	7	0) ()		SF	AUTORETE	Carrera 16 N	5300310	BOGOTA		NIT SOCIEE	860071562	
Profession in the second	606	ADM.CARTERAS COL.SU	NACION	606	0) ()		SF	AUTORETE	CARRERA (2602100	MEDELLIN		NIT SOCIEE	890903279	
XX	AEV	AEV	NACION	0	0) BCL	CORFIVALL	1	SV	AUTORETE	1	1	1		NIT SOCIEE	0	
Agentes	3	AFIN S.A.	NACION	3	0) ()		SF	AUTORETE	CARRERA 1	6372055	BOGOTA		NIT SOCIEE	860051175	
Exterior	18	ALIANZA VALORES S.A.	NACION	18	0) ()		SF	AUTORETE	AV. 15 No. 1	6447730	BOGOTA		NIT SOCIEE	860000185	
	344	ALIANZA FIDUCIARIA S.A	NACION	344	0) ()		SF	AUTORETE	Avenida 15	6447700	BOGOTA		NIT SOCIEE	860531315	
	1	ASESORES EN VALORES	NACION	0	0) CUA			SV	AUTORETE	Calle 72 No.	3122888	BOGOTA		NIT SOCIEE	890931609	
	13	ASESORIAS E INVERSIOI	NO NACION	13	0	D UNI				AUTORETE	Cile 72 N 10	3138888 -	BOGOTA		NIT SOCIEE	860079981	
	38	ASVALORES S.A.	NO NACION	38	0	D BBV				AUTORETE	CLL 10 No.	4853340	CALI		NIT SOCIEE	890322905	
	AYV	AYV	NACION	0	0	BCL	CORFIVALL	1	SV	AUTORETE	1	1	1	1	I NIT SOCIEE		
	447	BANCA DE INVERSION B.	NACION	447	0) ()		SF	AUTORETE	Calle 30 A N	2881028	BOGOTA		NIT SOCIEE	800235426	
	376	BANCO AGRARIO	NACION	376	0) ()		SF	AUTORETE	Carrera 8 No	3821400	BOGOTA		NIT SOCIEE	800037800	
	205	DANCO AVAILLAC	NACION	205					LCT .	AUTODETE	Courses 12.5	2072001	DOCOTA		MIT COCIEF	000005007	1

En esta opción se registran las entidades con las cuales se tienen negocios.



1.5.1.1. INGRESO CONTRAPARTES

😤 Contra Partes	- Ingresar				×
Ingrese los Datos—					
Codigo Super		Supervisada Por	•		
Nombre		Calidad Tribu.		•	
Tipo Entidad	NACION	Direccion			
Codigo BVC		Telefono			
Codigo SEN		Ciudad			
Codigo SETFX		E-Mail			
Grupo	-	Tipo de Id.		-	
Cod Contra. Emi		Nit			
Tipo Contra.		Clase Contra.		-]
Es IMC?		Cod. Agente Exterior		-]
		Aceptar 🛛	Cerrar		

Para ingresar información de las Contrapartes se debe registrar:

Código Súper: Código que identifica la identidad ante la Súper **Nombre:** Nombre de la entidad.

Tipo de Entidad: Si pertenece a la Nación o no.

Código BVC: Código que identifica a la entidad ante la Bolsa de Valores

Código SEN: Código que identifica a la entidad ante el Banco de la Republica.

Código SET FX: Código que identifica a la entidad ante el sistema SET FX.

Grupo: El grupo al cual pertenece.

Código Contra Emi, Supervisada por. Calidad Tribu, Dirección, Teléfono, Ciudad y e-mail.

Tipo Contraparte: Seleccione de la lista el tipo que le corresponde a la contraparte, según lo establecido por la SFC.

Clase Contraparte: Seleccione de la lista la clase de contraparte. Esta clasificación es necesaria para generar los movimientos contables y obedece a la clasificación establecida por la SFC en el PUC.

Indicador IMC: Seleccione de la lista la clasificación que le corresponda a la contraparte como intermediario del mercado cambiario.

Código Agente del Exterior: Si la contraparte es una agente del exterior seleccione el código definido por la SFC para él.

Por último, no olvide que las contrapartes y su emisor asociado deben contener datos fidedignos pues estos se incluirán en los diferentes donde la SFC lo solicite.



1.5.1.2. MODIFICACION CONTRAPARTES

Para modificar haga doble clic sobre la grilla ó haga clic en el Icono ubicado en la parte superior, el campo código súper es el único que no se puede modificar.

1.5.1.3. ELIMINAR CONTRAPARTES

👺 Contra Partes	- Eliminar
Ingrese los Datos—	
Codigo Super	101 Supervisada Por SF
Nombre)I BOLSA DE VALORES Calidad Tribu. AUTORETENEDOR
Tipo Entidad	NACION CRA 7 No. 71-21 TB P
Codigo BVC	101 PWPREI - DEFINICION DE PARAMETROS 3139800
Codigo SEN	D Bad BOGOTA
Codigo SETFX	
Grupo	Sí No BId. NIT SOCIEDAD
Cod Contra. Emi	Nit 830085426
Tipo Contra.	Clase Contra.
Es IMC?	Cod. Agente Exterior
	Aceptar Cerrar

Para eliminar un registro haga clic en el botón ubicado en la parte superior, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

1.5.1.4. BUSCAR CONTRAPARTES

🖻 Buscar Factores PWPREI 🛛 🔀
Buscar Por
Factor 🔽 🔽
Aceptar 🔀 Cerrar

La información se puede consultar por el factor o dando clic en todos los registros.



1.5.2. AGENTES EXTERIOR



1.5.2.1. INGRESAR AGENTE EXTERIOR

🚻 Agente del Ext	
Identificación	
Nombre	
1	
Aceptar	Cerrar

Para ingresar debe presionar el botón, y digita la identificación y el Nombre del agente



1.5.2.2. MODIFICACION AGENTE EXTERIOR

🚻 Agente del Ext	
Identificación	
1	
Nombre	
1	
1	
Acentar	Cerrar

Para Modificar un registro debe presionar el botón o dar clic sobre el registro que quiere modificar, solo se puede modificar el Nombre del agente.

1.5.2.3. ELIMINAR AGENTE EXTERIOR

🚻 Agente del Ext	
Identificación	
1	
Nombre	
1	
Aceptar	Cerrar

Para Eliminar un registro, debe seleccionar el registro y presionar el botón eliminar y luego presionar el botón aceptar

1.5.2.4. CARGA DE DATOS AGENTE EXTERIOR

Para cargar agentes del exterior los pasos son:

- 1. Descargue el archivo "codigosimc.xls" de la página de la SFC.
- 2. Presione el botón Cargar.



3. Elija el archivo que descargo de la SFC y presione el botón Aceptar

😩 Carga de Datos - AGEEXT	
Cargue Automático	
Archivo	
Tipo de Carga	
O Archivo Plano (*.txt)	
Archivo Excel (*.xls)	
	Aceptar 🔀 Cerrar

1.6. OPCION EMISOR



Se definen los Emisores de los Títulos Valores



1.6.1. PONDERACION

DEFINICION DE PARAMETROS - [Ponderación]								
🙀 Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana								
Ng 🕼 📴 🌒 🗇								
Emisor	Fecha de Vigencia	Tipo	Grupo Calificación	Calificación	Ponderación			
-	01/04/2005	Categoria	10	NA	0			
	01/04/2005	Categoria	58	NA	20			
88	01/04/2005	Categoria	59	NA	20			
	01/04/2005	Categoria	60	NA	20			
THE W	01/04/2005	Categoria	70	NA	20			
	01/04/2005	Categoria	90	NA	0			
N								

Se define la Ponderación de los Emisores por Calificación.

1.6.1.1. INGRESO PONDERACIÓN

En esta opción ingrese los datos para parametrizar de acuerdo a la categoría de los títulos.

Fecha Vigencia: Fecha desde la cual se ingresa el parámetro

Tipo: Si pertenece a una categoría ó a una titularización

Grupo Calificación: rango dentro del cual se encuentra el título para la calificación. **Calificación:** No aplica

Ponderación: Se aplica de acuerdo al rango de la calificación y están previamente establecidas.




1.6.1.2. MODIFICACIÓN PONDERACIÓN

🕼 Ponderación - Modificar 🛛 🔀		
Fecha de Vigencia	01/04/2005	
Tipo	Categoria 👤	
Grupo Calificacion	10 👻	
Calificación	NA	
Ponderación	0	
Aceptar	Cerrar	

Solo puede modificar el valor de la ponderación, en caso de requerir cambio en algún otro Ítem, debe eliminar el registro.

1.6.1.3. ELIMINAR PONDERACIÓN

Para eliminar escoja el registro deseado, haga clic sobre el botón ubicado en la parte superior, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.





1.6.1.4. DETALLE PONDERACIÓN

🎉 Ponderación - Detalle 🛛 🔀		
Fecha de Vigencia Tipo Grupo Calificacion Calificación Ponderación	01/04/2005 Categoria 10 NA 0	
	Cerrar	

Opción a manera de información le permite verificar en detalle la información registrada.

1.6.1.5. BUSCAR PONDERACIÓN



Para consultar información puede escoger por: Tipo, Grupo Calificación, Calificación o ver todos los registros.



1.6.2. CUENTAS BANCARIAS

DEFINICION DE PARAMETROS - [Cuentas Bancarias]					
철 Archivo 🛛 Gene	ral SuperVa	alores PWPREI ContraPartes Ve	entana		
Ng 🕼 📝 象	Ng 🕼 📴 🎕 🗦 🔎				
Emisor	Cuenta	Emisor	Tipo		
<u>^</u>	2222	PRUEBA CARLOS	Corriente		
	56536	PROTECCION S.A.	Corriente		
8 9	111111	PRUEBA CASABOLSA	Corriente		
	132141 ABONOS COLOMBIANOS Corriente				
W	432423 GOBIERNO NACIONAL Corriente				
	5345345 GOBIERNO NACIONAL Ahorro				
N					

Se deben registrar las cuentas tanto corriente como de ahorro y los bancos a donde pertenecen.

1.6.2.1. INGRESO CUENTAS BANCARIAS

🐸 Cuentas Bancaria	as - Ingresar 🛛 🔀
Cuenta Emisor Tipo	•
Aceptar	Cerrar

Para ingresar información de Cuentas Bancarias digite el número de la cuenta, la entidad a la cual pertenece y el tipo (corriente/ahorro).



1.6.2.2. MODIFICACION CUENTAS BANCARIAS

醛 Cuentas Bancarias - Modificar 🛛 🔀		
Cuenta	2222	
Tipo	Corriente	
Aceptar Cerrar		

Solo puede modificar el Tipo de Cuenta (corriente/ahorro), en caso de requerir otro cambio, debe eliminar el registro.

1.6.2.3. ELIMINAR CUENTAS BANCARIAS

Cue	ntas Bancarias - Eliminar 🛛 👂	
PWPREI	- INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	\times
2	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
	Sí No	

Para eliminar un registro escoja el ítem deseado y haga clic en el botón de eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

1.6.2.4. DETALLE CUENTAS BANCARIAS

醛 Cuentas Bancarias - Detalle 🛛 🛛 🔀		
Cuenta Emisor Tipo	2222 PRUEBA CARLC	
	Cerrar	

Para verificar la información registrada, puede hacer uso de la opción detalle.



1.6.2.5. BUSCAR CUENTAS BANCARIAS



La información puede ser consultada por Cuenta, Emisor, Tipo o consultando todos los registros.

1.6.3. CONCENTRACION

🚰 DEFINICION DE PARAMETROS - [Concentración]				
🍓 Archivo Gener	ral Super-Valores F	WPREI ContraParte	s Ventana	
N 🚨 🖉 🍭	7 🔊			
Emisor	Fecha de Vigencia	Límite Concentración	Exceso Riesgo	
	10/04/2004	1	2	
	20/04/2005	10	30	
	05/05/2005	5435	4325	
	06/05/2005	223	55	
W N	07/05/2005	5	10	
	31/03/2007 10 30			

En esta opción se deben registrar los porcentajes topes por riesgos acumulados que mantenga una sociedad comisionista miembro de la Bolsa de Valores respecto aun emisor individual o un grupo de emisores relacionados entre sí.



1.6.3.1. INGRESO CONCENTRACION

🝓 Concentración -	Ingresar 🛛 🔀
Fecha de Vigencia % Emisor % Total	04/05/2005 💌
Aceptar	Cerrar

Ingrese la fecha de vigencia a partir de la cual se establecieron los porcentajes, el porcentaje por Emisor no debe exceder el 10% y el total de los riesgos de todos los emisores no debe exceder el 30%.

1.6.3.2. MODIFICACION CONCENTRACION

🍓 Concentración -	Modificar 🛛 🔀
Fecha de Vigencia % Emisor % Total	10/04/2004 💌 1 2
Aceptar	Cerrar

El % Emisor y el %Total pueden ser modificados a medida que las disposiciones así lo requieran.

1.6.3.3. ELIMINAR CONCENTRACION

🝓 Concentración - Eliminar	\mathbf{X}
E 1 1 1 2	-
PWPREI	\mathbf{X}
Esta Seguro de Eliminar el Regis	tro ?
Sí No	



Seleccione el ítem deseado y haga clic en el botón de eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en las anteriores pantallas.

1.6.3.4. DETALLE CONCENTRACION

🝓 Concentración -	- Detalle 🛛 🔀
Fecha de Vigencia % Emisor % Total	10/04/2004 💌 1 2
	Cerrar

Opción que le permite verificar la información registrada para la concentración.

1.6.3.5. BUSCAR CONCENTRACION

🍓 Buscar Concentrac	ión	×
 Fecha de Vigencia % Emisor % Total Todos los Registros 		
Aceptar	Cerrar	

La información puede ser consultada por Fecha de Vigencia, % Emisor, % Total o escogiendo por todos los registros.

2. MERCADO Y SOCIEDAD



Al dar clic en esta opción aparecerá la pantalla del Módulo Información de Mercado y Sociedad, es decir, en donde se pueden cargar automática y manualmente la



información correspondiente al MEC, a BLOOMBERG y otros sistemas previamente especificados por el usuario. Aquí se alimenta la base de datos con información de mercado y los datos de las operaciones y negocios de la compañía. Así como se puede acceder a través de los botones, también se puede hacer por el Menú de la parte superior llamado **Carga de Información**.



2.1. OPCIÓN MERCADO



Esta opción corresponde al botón de color azul, dentro de cada una de ellas se encuentran los sub-menús del módulo de carga. Aquí se encuentran las siguientes opciones:



2.1.1. EMISORES

<u>=</u>	INFORMA	CION DE M	AERCAD	O Y SOCIEDAD - [Emisor]				
4	Archivo 🤇	Carga de Info	ormación	Ventana				
7	N 🎝 🛔	3 🗶 💊	🖉	V				
	Mercado	Código	Nombre		Nit	Calificación	Sector	S
	Emisores							
	.							

Al dar clic en la opción de Emisores aparecerá la cuadricula de datos respectiva. En este caso solo estarán activos los botones de Buscar, Ingresar, Carga Datos y Salir; ya que para modificar o eliminar primero habrá que buscar la información por la opción respectiva.

2.1.1.1. INGRESO EMISORES

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al emisor y posteriormente clic en Aceptar.

🗳 Emisor - Ingresar	
Código	Grupo Emisor
Nombre	Calificadora
Nit	Calif. Corto
Calificación	CIIU
Sector	Vinculado
SubSector	Natural
Entidad	Tipo de Id.
	🏹 Títulos 🔏 Aceptar 🛛 Cerrar

2.1.1.2. MODIFICACIÓN EMISORES



🖨 Emisor -	- Modificar	×
Código	ADM	Grupo Emisor
Nombre	ADMINEGOCIOS S.A	Calificadora
Nit	830113598-9	Calif. Corto
Calificación		CIIU
Sector	SER	Vinculado
SubSector		Natural
Entidad	•	Tipo de Id.
		🏹 Títulos 🔬 Aceptar 🔀 Cerrar
	, <u> </u>	Títulos Aceptar 💟 Cerrar

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos del emisor que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar.

Al presionar el botón Títulos aparecen los títulos de cada Emisor como se muestra en la siguiente pantalla

📇 IN	🛓 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Títulos del Emisor ADMINEGOCIOS S.A (ADM)]											
🗟 Ar	🔂 Archivo Carga de Información Ventana 🖉 🖉 🛪											
)	a i	¥ 🗶 🔗 💋 👎										
Me	rcado	Emisor	Especie	Moneda	Indicador	Estado	Código Súper	Tasa de Referencia	Spread	Modalidad	Fecha de Emisión	Fecha de
	00	ADMINEGOCIOS S.A	BAAP197A	COP	RFC	С	COBAAPO00008	DTF	0	0A		
П	ad the second	ADMINEGOCIOS S.A	BAAP197V	COP	RFC	C	COBAAPO00008	DTF	0	07		
	- KURU	ADMINEGOCIOS S.A	BAYP197A	COP	RFC	C	COBAYPO00008	DTF	0	0A		
E 11	lisoles	ADMINEGOCIOS S.A	BAYP197V	COP	RFC	С	COBAYPO00008	DTF	0	O٧		
	20	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSAL2A	COP	RFC	С	COBACCO00001	DTF	0	0A		
	S.	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSAL2V	COP	RFC	C	COBACCO00001	DTF	0	OV		
G, E	misores	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSALA	COP	RFC	С	COBACCO00001	DTF	0	0A		
1		ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSALV	COP	RFC	С	COBACCO00001	DTF	0	07		
. 4	ш											
Inc	dicador											
8	5 Q											

2.1.1.3. BUSCAR EMISORES

戸 Buscar Emisor	X
Buscar Por	
_	Codigo Emisor
	Nombre Emisor
F 1	Nit Emisor
C Emisores	
	Aceptar 🔀 Cerrar



En esta opción se podrán buscar los Emisores ya sea por todos los registros, o por un solo emisor, o por nombre emisor. Una vez se haya personalizado la búsqueda aparecerá la cuadrícula con la información respectiva. Inmediatamente se activan los botones de Modificar y Eliminar.

2.1.1.4. ELIMINAR EMISORES

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del Emisor eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder.

🐝 Emisor	- Eliminar	
Código	ADM	Grupo Emisor
Nombre	ADMINEGOCIO:	S S.A Calificadora
Nit	830113598-9	Calif. Cotto
Calificación		PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD 🔣
Sector	SER	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
SubSector		
Entidad		Sí No 🗾
		Títulos 🗼 Aceptar 🗵 Cerrar

2.1.1.5. DETALLE EMISORES

🐝 Emisore	es - Detalle	
Código	ADM	Grupo Emisor
Nombre	ADMINEGOCIOS S.A	Calificadora
Nit	830113598-9	Calif. Corto
Calificación		CIIU
Sector	SER	Vinculado
SubSector		Natural
Entidad	V	Tipo de Id.
		Títulos Cerrar

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle del Emisor.



2.1.1.6. CARGAR DATOS EMISORES

Al dar clic en el botón carga de datos el sistema muestra la pantalla que aparece a continuación. Oprimiendo el botón del lado derecho superior (el que tiene los 3 puntos) podrá buscar el archivo de extensión *.txt para proceder a cargarlo. Una vez seleccionado el archivo de clic en Aceptar para cargar la información que desee de acuerdo a la opción escogida. En caso de que existan errores al cargar saldrá un mensaje indicándole los errores, los cuales podrá ver oprimiendo ó imprimir. Si no hay errores este botón queda desactivado y aparecerá un mensaje de "Transacción Exitosa".

🚢 Carga de Datos - Emisores					
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

2.1.1.7. CARGA TABLA DE ACTIVIDADES ECONOMICAS EMISORES

Para agregar la actividad económica del emisor del papel a su informe de valoración proceda:

- 1. Cargue la tabla de actividades económicas según el código CIIU:
 - a. Ingrese a "Mercado y Sociedad Emisores". Pulse el botón "Cargar" y seleccione como se ve en la figura":



🚉 Carga de Datos - Emisores		
Cargue Automático		
Archivo (*.txt) D:\Productos\REI\AAAAAC	Clientes\AccionFiduciaria\2017\20171215 REQ-P-Adicion de columnas en portafolio\	
Tipo de Carga		
C Alterna	C Emisores 💿 CIIU	
C Normal		
(• Excel		
U Vista		
	Errores 📕 Errores 👰 Aceptar 🔀 Cerrar	

NOTA: Utilice la platilla "CargaCIIU" que está en el archivo Excel "FormatosTodasEntrada" para organizar los datos a cargar.

b. Pulse el botón "Aceptar". Al final le aparecerá el mensaje:

PWPREI - INF. DE MERCADO Y	DCIEDAD ×
Información Cargada	
	Aceptar

2. Consultar. Para consultar la lista de actividades económicas utilice el botón "Buscar" y seleccione como se ve en la pantalla:



🔊 Buscar Emisor	X
Buscar Por	
	Codigo Emisor
	Nombre Emisor
F 1	Nit Emisor
C Emisores	Lista CIIU Todos los Registros
	Aceptar 🔀 Cerrar

Pulse el botón "Aceptar" y la lista será desplegada.

3. Informe de Valoracion. Valore su portafolio como siempre y al exportarlo, al final de las hojas "Renta Fija" y "Simultaneas" le apareceran las columnas "CIIU" y "ActEcono"

2.1.2. GRUPO EMISORES

🚢 INFORMAC	LINFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Grupo de Emisores]							
🛃 Archivo Ca	🚁 Archivo Carga de Información Ventana							
ji 🖓 🖉 🛐	P 😼 🕸 🖥 🌒 Ø Ø							
Mercado	Grupo	Nombre	Nit					
	BCO SUDAM.	BCO SUDAMERIS	8600507501					
ക്ക്	BNA	BNA	12345678					
<u> m</u> ₩n	BOG D.C	BOGOTA DISTRITO CAPITAL						
Emisores	CELCARIB	CELCARIBE S A						
"	COLP.S.A	MERC.COLP. SA	860034594					
	COOMEVA	FINANCIERA COOMEVA	111111111					
G. Emisores	CORFIVALLE	CORP.FINANCIERA DEL VALLE	8600052475					
1.1	ETB	ETB	111111					
, unu	FIDCOMCART	F.C.CART	8300545390					
Indicador	FUND, SOC,	FUNDACION SOCIAL	8600073354					
	GEA	GRUP EMP ANTIOQ						
39	GOB. NAL	GOBIERNO NACIONAL	8999990830					
moneuas	GR. AVAL	GRUPO AVAL	800216181					
%	GR. S.DOM.	GRUPO EMPRESARIAL SANTO DOMINGC						
	INVERARGOS	INVERARGOS	8909002663					
Tasas	ISAGEN	ISAGEN						
	IVS	INVALSIME	123256236					
Titulos	MEG	MEGABANCO	8600349215					
ritalos	OCCIDEN54	OCCIDEN54						

Categoría bajo la cual se agrupan los emisores de cada entidad.



2.1.2.1. INGRESO GRUPO EMISORES

🖗 Grupo de Emisores - Ingresar				
Nit Grupo Nombre				
X	Aceptar 🔀 Cerrar			

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al grupo y nombre del emisor.

2.1.2.1. MODIFICACION GRUPO EMISORES

🖗 Grupo de Emisores - Modificar					
Nit	8600507501				
Grupo	Grupo BCO SUDAM.				
Nombre	BCO SUDAMERIS	1			
J.	Aceptar 🔀 Cerrar				

Solo se permite modificar el nombre del grupo de emisores, un cambio en el grupo implica eliminar el registro.

2.1.2.2. BUSCAR GRUPO EMISORES

🖗 Burcar Grupos de Emisores 🛛 🛛 🔀					
Grupo Grupo Nombre Todos los Registros					
Aceptar	Cerrar				



La consulta de información por Grupos de Emisores, se puede realizar seleccionando por grupo, nombre o todos los registros.

2.1.2.3. ELIMINAR GRUPO EMISORES

🖗 Gru	po de Emisores - Eliminar 💦 🚺	3	
N	là locostostot		
PWPREI	- INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	×	
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?			
	Sí No		
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		

Para eliminar escoja el ítem deseado y de clic en el botón correspondiente el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.1.2.4. DETALLE DE GRUPO EMISORES

🚰 Grupo de E	misores - Detalle 🛛 🛛 🛛)
Nit	8600507501	
Grupo	BCO SUDAM.	
Nombre	BCO SUDAMERIS	
	Cerrar	

Con esta opción puede verificar la información registrada.

2.1.3. INDICADORES

Para ingresar al Menú Indicadores haga clic en el Icono indicado en la parte superior. El sistema le mostrará la cuadricula con la información correspondiente a los indicadores que se ingresen. No existe la opción de buscar debido al volumen de información que se maneja.



INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Indicador]								
📶 Archivo 🛛 🖸	📊 Archivo Carga de Información Ventana							
Ng 🚨 📝 🧯								
Mercado Código Descripción Mercado Tipo de Rango								
68	AGR	SEC.AGRICOLA	ACC	GRUPO IRTES				
l 🚵	CEC	CURVA TES TF. PESOS	RF	GENERAL RF				
<u>™</u> 744	CECUVR	CURVA TES TF. DOLARES	RF	GENERAL RF				
Emisores	COMC	SEC.COMERCIAL	ACC	GRUPO IRTES				
-	DTF	DTF	RF	GRUPO AC-NO RAN				
	DTFA	DTF Semana Anterior	RF	GRUPO AC-NO RAN				
G. Emisores	DTFE	DTF Efectiva	RF	GRUPO AC-NO RAN				
	EXT	IND. PARA TITULOS EXTRANJEROS	RF	SIN RANGOS				
<u> </u>	FINC	SEC.FINANCIERO	ACC	GRUPO IRTES				
Indicador	FOGANSA	FOGANSA	ACC	SIN RANGOS				
	IGASB	IGASB	GEN	GRUPO ITUS, ITEE				
89	IGASC	IGASC	GEN	GRUPO ITUS, ITEE				

2.1.3.1. INGRESO INDICADORES

1	🗓 Indicador - Ingresar 🛛 🗙
	Ingresar Datos Código Descripción Mercado Tipo Rango
-	Aceptar Cerrar

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al Indicador y posteriormente clic en Aceptar.

2.1.3.2. MODIFICACION INDICADORES

1	📶 Indicador -	Modificar 🛛	<
	 Ingresar Datos Código 	AGR	
	Descripción	SEC.AGRICOLA	
	Mercado	ACC	
	Tipo Rango	GRUPO IRTES	
		Aceptar 🛛 🔀 Cerrar	



Al dar clic en el botón de Modificación o doble clic en la grilla, aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos del Indicador que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar.

2.1.3.3. ELIMINAR INDICADORES

🔟 Indicad	lor - Eliminar	×
Ingresar D Código Descripció Mercado Tipo Rang	Atos PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD Esta Seguro de Eliminar el Registro ? Sí No	
	Aceptar Cerrar	

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del Indicador a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Es importante señalar que hay que tener cuidado a la hora de eliminar Indicadores ya que son de vital importancia para la Valoración y la Medición de Riesgo.

2.1.3.4. DETALLE INDICADORES

1	Indicadores	- Detalle	
	-Ingresar Datos- Código	AGR	
	Descripción	SEC.AGRICOLA	
	Mercado	ACC	
	Tipo Rango	GRUPO IRTES 📃	
			Cerrar

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información de los Indicadores.



2.1.3.5. CARGA DATOS INDICADORES

🚢 Carga de Datos - Indicadores					×
Cargue Automático Archivo (*.txt)					ij
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.1.3.6. EXPORTAR A EXCEL.

La información de los indicadores puede ser exportada a Excel para ser utilizada en diferentes informes.

2.1.4. MONEDAS

🚢 INFORMAC	ION DE MER	RCADO Y SOCIEDAD - [Moneda]		
🥳 Archivo Ca	arga de Inform	ación Ventana		
ja 🔊 🖗 💆	🎯 🕸	Ø 🛛		
Mercado	Código	Descripción	Tipo Moneda	Solicitado Por
68	00001CSPVS	N021407.0028300854261200702140		
ക്	00002D2006	0924TRM +000002417.2300		
<u>™</u> 747	00002D2007	0214UVR +000000160.5584		
Emisores	00003D2006	0924TIF +001000000.0000		
,	00003D2007	0214TIS +001860511.0000		
	00004D2006	0924YOK +000000002.0157		
G. Emisores	00004D2007	0214PAC +000447698.5200		
	00005D2006	0924TIS +001860511.0000		
, <mark>uuu</mark>	00005D2007	0214MAC +000213750.3290		
Indicador	00006D2006	0924PAC +000447698.5200		
	00006D2007	0214IR5 +031644270.8100		
99	00007D2006	0924MAC +000209936.1046		
Moneuas	00007D2007	0214ESP +000001896.5810		

Para ingresar al módulo de monedas haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema le muestra la cuadricula donde el sistema despliega la información. Inicialmente no aparece información, utilice el botón de Buscar y realice la consulta de acuerdo a su selección.



2.1.4.1. INGRESO MONEDAS

😂 Moneda - Ingresar		3
Código		
Cód. SuperFin		
Descripción		ľ
Grupo Moneda		
Tipo Moneda	•	
Solicitada por	-	
		1
	🔬 Aceptar 🛛 🔀 Cerrar	

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a la moneda y posteriormente clic en Aceptar.

2.1.4.2. MODIFICACIÓN MONEDAS

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos de la moneda que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido.

🚳 Moneda - Modificar 🛛 🛛 🔀
Código 00001CSPVS
Cód. SuperFin
Descripción N021407.0028300854261200702140
Grupo Moneda
Tipo Moneda 📃 💌
Solicitada por
🔬 Aceptar 🔀 Cerrar

2.1.4.3. BUSCAR MONEDAS



🖻 Buscar Moneda 🛛 🚺 🛛	3
Buscar Por	
Moneda 🗾 💌	
Todos los Registros	
Aceptar 🔀 Cerrar	

En esta opción se podrán buscar las Monedas ya sea por todos los registros, o por una sola Moneda escogiéndola en el campo Moneda. Ahí estarán todos los códigos de las monedas existentes. Una vez se haya personalizado la búsqueda aparecerá la cuadrícula con la información respectiva. Inmediatamente se activan los botones de Modificar y Eliminar.

2.1.4.4. ELIMINAR MONEDAS

🔒 Mo	neda - Eliminar	×
Códi	go 00001CSPVS	
Cód		
Des		
Grup	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
Tipo		
Solid	Sí No	
	Aceptar 🗵 Cerrar	

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información de la moneda a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Recuerde que las monedas también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.

2.1.4.5. DETALLE MONEDAS

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle de la Moneda. Recuerde que en estas pantallas de detalle no puede llevar a cabo operaciones de modificación y eliminación, ya que como su nombre lo indica es solo pantalla informativa.



🚳 Monedas -	Detalle 🔀
Código	00001CSPVS
Cód. SuperFin	
Descripción	N021407.0028300854261200702140
Grupo Moneda	a
Tipo Moneda	
Solicitada por	
	Cerrar

2.1.4.6. CARGA DATOS

🚢 Carga de Datos - Monedas					
Cargue Automático					
Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga					
C Alterna Normal					
C INFOVAL					
C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	X	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.1.4.7. EXPORTAR A EXCEL.

Con esta opción puede utilizar la información de monedas para realizar diferentes informes en Excel.



2.1.5. TASAS

Para ingresar al Módulo de tasas haga clic en el Icono descrito en la parte superior a continuación el sistema le muestra la cuadricula donde posteriormente se despliega la información de las tasas.

🛓 INFORMAC	CION DE MER	RCADO Y SOCIEDAD - [Tasa]					
🕌 Archivo Ca	🗛 Archivo Carga de Información Ventana						
]= 💫 🖧 💆							
Mercado	Código	Descripción	Modalidad	Función			
	CM	CORRECCION MONETARIA	ANUAL VENCIDA	MULTIPLICATIVA			
ക്ക	CMTG	CORR. MONETARIA THG	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
<u>™774</u>	DTF	TASA DEP. TER. FIJO	TRIMESTRAL ANTICIPADA	ADITIVA			
Emisores	-DTF	TASA DEP. TER. FIJO(-)	TRIMESTRAL ANTICIPADA	ADITIVA			
	DTFE	DTF EFECTIVO O A.V +	ANUAL CUALQUIERA	MULTIPLICATIVA			
	DTFP	DTF PENSIONAL	TRIMESTRAL VENCIDA	ADITIVA			
G. Emisores	EUDO	TASA CAMBIO EU-DO	DIARIA VENCIDA	MULTIPLICATIVA			
	FS	FIJA SIMPLE	NO APLICA	ADITIVA			
, uuu	IPC	INDICE PRECIO CONSUM	ANUAL VENCIDA	MULTIPLICATIVA			
Indicador	IPC1	80% INDICE PRE.CON	SEMESTRAL VENCIDA	ADITIVA			
	IPC2	80% IPC ING, MED, 2M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
29	IPC3	IPC3 SALAR, MED, 12M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
monedas	IPC4	110% IPC ING MED. 2M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
%	IPM	INDICE PRECIOS ING. MED. 12M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
	LIB1	LIBOR 1 MES	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			
Tasas	LIB2	LIBOR 2 MESES	ANUAL VENCIDA	ADITIVA			

2.1.5.1. INGRESO TASAS

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a la Tasa y posteriormente clic en Aceptar.

🔏 Tasa - Ing	resar 🔀
Nombre	
, Cód. SuperFin	
Descripción	
. ,	Modalidad Periodicidad
ſ	
	Función 🗾 💌
Grupo Tasa	0
	Aceptar 🔀 Cerrar
	- · ·

2.1.5.2. MODIFICACION TASAS



🛃 Tasa - M	odificar		X
Nombre	СМ		
Cód. SuperFin	DTR		
Descripción	CORRECCION MO	NETA	RIA
	Modalidad		Periodicidad
	ANUAL	-	VENCIDA 🗾
	Fur	nción	MULTIPLICATIVA
Grupo Tasa	0		
	В		
	1		.ceptar 🔀 Cerrar

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos de la Tasa que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido.

2.1.5.3. BUSCAR TASAS

🆻 Buscar Tasa 🛛 🛛 🔀
Buscar Por
Tasa 🔽 💌
Todos los Registros
Aceptar 🔀 Cerrar

En esta opción se podrán buscar las Tasas ya sea por todos los registros, o por una sola Tasa escogiéndola en el campo Tasa. Ahí estarán todos los códigos de las Tasas existentes. Una vez se haya personalizado la búsqueda aparecerá la cuadrícula con la información respectiva. Inmediatamente se activan los botones de Modificar y Eliminar.

2.1.5.4. ELIMINAR TASAS

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información de la Tasa a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Recuerde que las Tasas



también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.

🚰 Tasa - Eliminar 🛛 🚺	ĸ
Nombre CM	
Cód. SuperFin OTR	
Des PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
Gru Sí No	
Aceptar Cerrar	

2.1.5.5. DETALLE TASAS

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle de la Tasa. Recuerde que en estas pantallas de detalle no puede llevar a cabo operaciones de modificación y eliminación, ya que como su nombre lo indica es solo pantalla informativa.

2.1.5.6. CARGA DATOS

🛓 Carga de Datos - Tasas					×
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.1.5.7. EXPORTAR A EXCEL

Con esta opción puede obtener la información de tasas y llevarla a un archivo en Excel.



2.1.6. TITULOS

NFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Titulos]					
💐 Archivo 🛛 C	arga de Informaci	ión Ventana			
N 🔉 📝	🗊 🔌 🦻	l			
Mercado	Titulo	Nombre	Tipo Deuda		
	013	FONDO INVERSION NACIONAL	NO APLICA		
ക്	016	FONDO INVERSION EN EL EXTRANJERO PORCION ACCIONES	EXTERNA		
<u>™</u> 787	ACC	Acciones	INTERNA		
Emisores	ACP	ACCIONES PREFERENCIALES	INTERNA		
	ACV	ACCIONES PRIVILEGIADAS	INTERNA		
	APB	ACEPTACION BANCARIA	NO APLICA		
G. Emisores	APF	ACEPTACION FINANCIERA	NO APLICA		
	B55	BONOS LEY 55			
	BAA	BONOS AGRARIOS	INTERNA		
Indicador	BCE	BONOS DE CESANTIA LEY 413			
	BCR	BONOS REPUBLICA DE COLOMBIA			
99	BCX	CERT.DEP.TERM.CORP.FINANCIERA	INTERNA		
Monedas	BD7	BONOS COLOMBIA DECRETO 700			
2	BDE	BONOS DEUDA PUBLICA EXTERNA	NO APLICA		
	BDS	BONO DESARRALLO Y SEG.INTERNA			
Tasas	BFC	TESB FORZOSA CONVENIDA			
	BFO	BONOS FORESTALES	NO APLICA		
	BFV	BONOS FINANCIAMIENTO VENCIDOS			
Titalos	RGG	BONOS DE GABANTIA GENEBAL	INTERNA		

2.1.6.1. INGRESAR TITULOS

🕅 Titulos - In	gresar		
Ingresar Datos Titulo Nombre			
Tipo Deuda	NO APLICA	•	
	Aceptar	Cer	rar

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a los títulos y posteriormente clic en Aceptar.

2.1.6.2. MODIFICACION TITULOS

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos del título que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido.



🕅 Titulos -	Modificar		
_ Ingresar Date	08		
Titulo	013		
Nombre	FONDO INVER	RSION NACIONAL	
Tipo Deuda	NO APLICA	•	
V	Aceptar	Cerrar	

2.1.6.3. ELIMINAR TITULOS

🕅 Ti	tulos - Eliminar 📃 🗖	×
Ingr	esar Datos	
Titu	PWPREI - RESOLUCION 513	
Non	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
	Sí No	
	Aceptar Cerrar	

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del título a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Recuerde que los TITULOS también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.

2.1.6.4. BUSCAR TITULOS

P Buscar Titulos	
Buscar Por	
_	🗌 Codigo Titulo
	Nombre Titulo
	Todos los Registros
	Aceptar 🔀 Cerrar

La información de títulos puede ser consultada por todos los registros, código del título ó nombre.



2.1.6.5. CARGAR DATOS DE TITULOS

🚢 Carga de Datos - Titulos					×
Cargue Automático					
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.1.6.6. TITULOS CONTENIDO CREDITICIO

- 1. FACTURAS.
- a. Crear un título para identificarlas como tales:

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para facturas, igual al de la figura:

🌾 Titulos - Mo	dificar		_ 0	23
-Ingresar Datos				
Titulo	FAC			
Nombre	FACTURAS			
Tipo Deuda	NO APLICA	•		
	Aceptar	X	Cerrar	

b. Crear una especie para las facturas, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:



🗐 Especies/Renta Fija - Modificar	X
Código FACTURA Emisor ZPW Descripción ESPECIE PARA FACTURAS Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super 0 FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Superfinanciera Código SF OTR Aval Emisión Emisión Fungible	: Calificadora Otra
Fecha Vencimiento Emisión Vencimiento Ila/03/2014 Ila/03/2014 Tasa Referencia FS Image: Spread Uso ACTUAL Día Mes O O Número de Flújos O Número de Aplica	Calculo Descuento Tasa Caja Descuento Tasa Calendario CORRIDO Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Retefuente < 5
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V
	Aceptar 🛛 Cerrar

- 2. CHEQUES.
- a. Crear un título para identificarlos como tales.

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para cheques, igual al de la figura:



Titulos - Ing	resar		23
- Ingresar Datos			
Titulo	CHE		
Nombre	CHEQUES		
Tipo Deuda	NO APLICA	•	
	Aceptar	Cerrar	

b. Crear una especie para los cheques, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:

Código CHEQUE Emisor ZPW Nemo Equiv Renta Fija Descripción ESFECIE DE CHEQUES Moneda CDP ISIN1 Calinoación Indicador RFC ISIN2 Estado ACTIVO Cod. Super () CurCD T FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo CHEQUES Categoria () Grupo Calificación () Superfinanciera Código SF () TR Aval Emisión Fungible Calificadora () Calendario CORRIDO () Código SF () TR Aval Emisión Fungible Calificadora () Tasa Referencia F5 Spread 0.00000 Calendario CORRIDO () Tabla de Desarollo NO TIENE () I) Rendimiento DESCUENTO () Dia Maso Cariada Aplica No APLICA () Portafolio Destino Indicaidad de Pago de Intereses Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Pago de Reinversión Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Pago de Reinversión	🗐 Especies/Renta Fija - Modificar	×
Superfinanciera Código SF OTR Aval Emisión Fungible Calificadora Otra Fecha Emisión Vencimiento Calculo Descuento Tasa Image: Calificadora Tasa Tasa Calendario CORRIDO Image: Calendario Calendario Tasa Referencia FS Image: Calendario NO TIENE Image: Calendario FS Spread 0.00000 Uso Actual Rendimiento DESCUENTO Image: Cantidad Aplica Omotización 100.000 Image: Calese Factor 1 Omotización Flujo Número de Flúijos Cantidad Aplica Omotización 100.000 Image: Calese Factor 2 Modalidad No Capitaliza Modalidad Periodicidad Portafolio Destino Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad NO APLICA Modalidad Periodicidad No APLICA Image: Cale State	Código CHEQUE Emisor ZPW Descripción ESPECIE DE CHEQUES Moneda COP Calíficación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super (0) FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Fecha Emisión Vencimiento I 18/03/2014 18/03/2014 Tasa Calculo Referencia Calendario FS Image: Calendario Spread 0.00000 Uso ACTUAL Flujo Número de Flújos Día Mes 0 No Capitaliza Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA	Código SF OTR Aval Emisión Fungible	e Calificadora Otra
NO APLICA VINO APLICA VINO APLICA VINO APLICA VINO APLICA	Fecha Emisión Vencimiento Emisión Vencimiento 18/03/2014 18/03/2014 Tasa Spread Referencia Spread FS Spread Uso ACTUAL Día Mes O O Número de Flújos Cantidad Aplica O No Capitaliza Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad	Calculo Descuento Tasa Caja Descuento Tasa Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Calese Factor 1 Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Retefuente < 5
Aceptar Cerrar		Aceptar Cerrar



- 3. CONTRATOS.
- a. Crear un título para identificarlos como tales.

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para contratos, igual al de la figura:

🚳 Titulos - Ingr	esar			23
Ingresar Datos				
Titulo	CON			
Nombre	CONTRATOS			
Tipo Deuda	NO APLICA	•		
	Aceptar	×	Cerrar	

b. Crear una especie para los contratos, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:



Especies/Renta Fija - Modificar	X			
Código CONTRATO Emisor ZPW Descripción ESPECIE DE CONTRATOS Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super 0 FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo CONTRATO	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación			
Superfinanciera Código SF OTR Aval Emisión Fungible Calificadora Otra				
Fecha Emisión Vencimiento ■18/03/2014 ■18/03/2014 Tasa Referencia FS Spread 0.00000	Calculo Descuento Tasa Caja Descuento Tasa Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Clase Factor 1			
Flujo Día Mes 0 0 0 Número de Flújos Cantidad Aplica	Amortización 100.000 Clase Factor 2 Retefuente > 5 0.000 Portafolio Destino Retefuente < 5			
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA			
	Aceptar 🛛 Cerrar			

- 4. LETRAS
- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para letras, igual al de la figura:



🚳 Titulos - Mo	dificar	- - ×	
- Ingresar Datos			1
Titulo	LET		
Nombre	LETRA		
Tipo Deuda	NO APLICA	•	
	Aceptar	Cerrar	

b. Crear una especie para las letras, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:

Especies/Renta Fija - Modificar				
Código LETRA Emisor ZPW Descripción ESPECIE DE LETRAS Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo LETRA	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación			
Superfinanciera Código SF OTR Aval Emisión Fungible Calificadora Otra				
Fecha Vencimiento Emisión Vencimiento 19/03/2014 19/03/2014 Tasa Referencia FS Image: Spread Uso ACTUAL Flujo Número de Flújos Día Mes Image: Imag	Calculo Descuento Tasa Caia Descuento Tasa Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Clase Factor 1 Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Portafolio Destino			
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V			
	Aceptar 🛛 Cerrar			



- 5. PAGARES
- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para pagarés, igual al de la figura:

🚳 Titulos - Mo	dificar		x
Ingresar Datos			
Titulo	PAG		
Nombre	PAGARES		
Tipo Deuda	NO APLICA	•	
	Aceptar	Cerrar	

b. Crear una especie para los pagarés, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:



🗐 Especies/Renta Fija - Modificar				
Código PAGARE Emisor ZPW Descripción ESPECIE DE PAGARES Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo PAGARES	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación			
Superfinanciera Código SF_OTR Aval Emisión Fungible CalificadoraOtra ▼				
Fecha Emisión Vencimiento Imisión Imisión Imisión Imisión Imisión Imisión	Calculo Descuento Tasa Caja Descuento Tasa Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento DESCUENTO Comisión VALOR Clase Factor 1 Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Pottafolio Destino			
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V			
	Aceptar Cerrar			

- 6. LIBRANZAS
- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresar por "Mercado y Sociedad – Mercado – Titulos – Ingresar" y crear el título para libranzas, igual al de la figura:



4	🔊 Titulos - Moo	dificar		_	X
Γ	-Ingresar Datos				
	Titulo	LBZ			
	Nombre	LIBRANZAS			
	Tipo Deuda	NO APLICA	•		
		Aceptar	X	Cerrar	

b. Crear una especie para las libranzas, asignándole el título definido previamente. EL NEMO puede ser cualquiera:

Especies/Renta Fija - Modificar	22			
Código LBRZA Emisor ZPW Descripción LIBRANZAS Moneda COP Calificación Indicador RFC Estado ACTIVO Cod. Super 0 FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo LIBRANZAS	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación			
Código SF LBZ Aval Emisión Fungible Calificadora Otra				
Fecha Emisión Vencimiento Imisión Imisión Imis	Calculo Interes Tasa Caja Interes Tasa Calendario COBRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento INTERESES Comisión VALOR Datos Faciales NO Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Portafolio Destino Portafolio Destino			
Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA	Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V			
	Aceptar Cerrar			


2.2. OPCIÓN VALORES DE INDICADOR



Esta opción corresponde al botón de color azul, dentro de cada una de ellas se encuentran los sub-menús del módulo de carga. Aquí se encuentran las siguientes opciones:

2.2.1. VALORES DE INDICADORES

Para ingresar al módulo Valores de Indicadores haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema le muestra a continuación la cuadricula donde posteriormente se desplegará la información que se encuentre registrada en el sistema.



L INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valor del Indicador]						
🔁 Archivo Ca	arga de Inform	ación Vent	ana			
🔊 😼 🖧 💆	🍭 象	Ø 💔				
Valores de	Fecha	Indicador	Rango de Días al Vcto.	Valor		
	30/06/2009	IGASB	489	6.531		
	30/06/2009	IGASC	489	7.331		
Indicador	30/06/2009	IIPLC	361-720	7.443		
muicauui	30/06/2009	INBAV	489	5.816		
Ý 🔨	30/06/2009	ISCOC	700	3.425		
866	30/06/2009	ITUS	49	3.026		
Monedas	29/06/2009	IGASB	490	6.531		

2.2.1.1. Ingreso valores de indicadores

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al valor del indicador y posteriormente clic en Aceptar.

점 Valor del Indicador	- Ingresar	×
Ingresar Datos Fecha	01/07/2009 ▼	
Indicador	·	
Dias al Veto		
Rango de Días al Voto.		
Valor		
4	Aceptar 🗵 Cerra	ar

2.2.1.2. Modificacion valores de indicadores

<mark>岩</mark> Valor del Indicador	- Modificar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha	30/06/2009 🔽
Indicador	IGASB
Dias al Veto	
Rango de Días al Voto.	489
Valor	6.531
	Acentar 🔽 Cerrar
%	



Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla siguiente donde podrá modificar los datos del valor de indicador que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido. La información de Valores de Indicadores es importante, por lo tanto deberá tener cuidado en el momento de alterar dicha información ya que cualquier cambio indebido repercutirá en la valoración y en la medición del riesgo, es decir, se podrán arrojar datos incorrectos. En la modificación de Valores de Indicadores solo podrá hacerlo con el valor.

2.2.1.3. Buscar valores de indicadores

👎 Buscar Valores de Indicadores	×
Buscar Por	
01/07/2009 🔽 🗖 Fecha	
Indicador	
📃 📃 🗖 Rango de Días al Vencimiento	
01/07/2005 01/07/2005 - Intervalo de Fechas	
Todos los Registros	
📈 Aceptar 🛛 🔀 Cerrar	

En esta opción se podrán buscar los Valores de Indicadores por la Fecha en la cual se registro dicho indicador, por el nombre del Indicador, por el Rango de Días al vencimiento en el cual se encuentra clasificado o podrá hacerlo buscando todos los registros que se encuentren en el sistema. Una vez se haya hecho la consulta deseada aparecerá la información e inmediatamente se activan los botones de modificación y eliminación para proceder a manejar la información como se desee. La pantalla de búsqueda se muestra a continuación. Para buscar deberá marcar porque opción se realizará la búsqueda y el patrón de búsqueda a utilizar.



2.2.1.4. Eliminar valores de indicadores

숸	Valor de	l Indicador - Eliminar	×
ſ	Ingresar Da Fecha	30/06/2009 💌	
	PWPREI	- INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	\times
	2	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
		Sí No	
		Aceptar 🔀 Cerra	91

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del valor de indicador a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Si desea eliminar haga clic en Aceptar, sino clic en Cerrar.

2.2.1.5. Detalle valores de indicadores

<mark>楼</mark> Valores de Indicad	ores - Detalle	×
Ingresar Datos		
Fecha	30/06/2009 💌	
Indicador	IGASB 📃	
Dias al Veto		
Rango de Días al Voto.	489	
Valor	6.531	
	🔀 Cerra	r

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle del Indicador respectivo. Recuerde que en estas pantallas de detalle no puede llevar a cabo operaciones de modificación y eliminación, ya que como su nombre lo indica es solo pantalla informativa.

2.2.1.6. Carga datos de los valores de indicadores

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



🚉 Carga de Datos - Valores de Indicadores					×
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

2.2.1.7. Exportar a excel valores de indicadores

Con esta opción puede exportar a Excel la información de valores de indicadores.

2.2.2. VALORES DE MONEDAS

🚢 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valor de la Moneda]						
🗼 Archivo Ca	arga de Información	n Ventan	a			
🔊 💊 🖧 💆	🎽 🔕 🖉	- 🧐				
Valores de	Fecha	Moneda	Valor			
	30/06/2009	018	14,185.1676			
	30/06/2009	180	19,206.3195			
Indiander	30/06/2009	272	13,474.48			
muicauor	30/06/2009	901	2,281.48			
· 🖄 🛛	30/06/2009	A75	25,369.92			
	30/06/2009	C90	2,235.56			
Monedas	30/06/2009	CAB	0.0			

Para ingresar al módulo Valores de Monedas haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema le muestra a continuación la cuadricula donde posteriormente se desplegará la información que se encuentre registrada en el sistema. Inicialmente no aparece información ya que tendrá que obtenerla a través de las opciones de búsqueda que se pueden ver en el primer botón de izquierda a derecha.

2.2.2.1. INGRESO VALORES DE MONEDAS



💸 Valor d	e la Moneda - Ing 🔀
Fecha Moneda	11/07/2009 •
Valor	
X	Aceptar 🔀 Cerrar

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al valor de la Moneda y posteriormente clic en Aceptar.

2.2.2.1. MODIFICACION VALORES DE MONEDAS

💸 Valor d	e la Moneda - Mo 🔀
Fecha	30/06/2009 🔽
Moneda	018
Valor	14185.1676
	Aceptar 🔀 Cerrar
	Aceptar 🔀 Cerrar

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla siguiente donde podrá modificar los datos del valor de la moneda que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido. La información de Valores de Monedas es importante, por lo tanto deberá tener cuidado en el momento de alterar dicha información ya que cualquier cambio indebido se repercutirá en la valoración y en la medición del riesgo, es decir, se podrán arrojar datos incorrectos. En la modificación de Valores de Monedas solo podrá hacerlo con el valor.

2.2.2.2. BUSCAR VALORES DE MONEDAS

En esta opción se podrán buscar los Valores de Monedas por la Fecha en la cual se registró dicha moneda, por el nombre de la moneda, por intervalos de fecha o podrá hacerlo buscando todos los registros que se encuentren en el sistema. Una



vez se haya hecho la consulta deseada aparecerá la información e inmediatamente se activan los botones de modificación y eliminación para proceder a manejar la información como se desee. Para buscar deberá marcar porque opción se realizará la búsqueda y el patrón de búsqueda a utilizar.

🖻 Buscar Valores de Monedas 🛛	×
Buscar Por	1
01/07/2009 🔽 🗖 Fecha	
Moneda	
01/07/2005 01/07/2005 🔽 Intervalos de Fecha	
Todos los Registros	
Aceptar Cerrar	

2.2.2.3. ELIMINAR VALORES DE MONEDAS

2	/alor de la Moneda - Eli 🗙	
PWPREI	INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	×
2	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
	Sí No	

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del valor de la Moneda a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Si desea eliminar haga clic en Aceptar, sino clic en Cerrar.

2.2.2.4. DETALLE VALORES DE MONEDAS

💸 Valores	de Monedas - De 🔀
Fecha Moneda Valor	30/06/2009 018 14185.1676
	Cerrar



Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle de la Moneda respectiva. Recuerde que en estas pantallas de detalle no puede llevar a cabo operaciones de modificación y eliminación, ya que como su nombre lo indica es solo pantalla informativa.

2.2.2.5. CARGA DATOS DE LOS VALORES DE MONEDAS

😩 Carga de Datos - Valores de Monedas	
Cargue Automático Archivo (*.txt)	
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista	
Imprimir BErrores	Errores Aceptar 🔀 Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.2.2.6. EXPORTAR A EXCEL VALORES DE MONEDA

Con esta opción Exporte la información de Monedas a un archivo en Excel.

2.2.3. VALORES DE TASAS

	🚉 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valor de la Tasa]				
	🌆 Archivo	Carga de Informació	n Ventana		
Ī	ja 🔏 🛴	🛐 🌒 🔌 🖉			
	Valores de	Fecha	Tasa	Valor	
Ì		30/06/2009	DFF	5.4	
		30/06/2009	-DT	-5.22	
	ludiandar.	30/06/2009	DTE	5.4	
	muicauoi	30/06/2009	DTF	5.22	
	· 🏠	30/06/2009	EUD	1.4134	
	~~ ~~	30/06/2009	IB1	4.41	
	Monedas	30/06/2009	IBE	4.536	
	10.00	30/06/2009	IBR	4.376	
		30/06/2009	ICP	4.77	
	Tasas	30/06/2009	IP2	4.68	
		30/06/2009	ID4	6.425	

Para ingresar al módulo Valores de Tasas haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema le muestra a continuación la cuadricula donde posteriormente



se desplegará la información que se encuentre registrada en el sistema.

2.2.3.1. INGRESO VALORES DE TASAS

🟙 Valor de la Tasa - Ingr 🔀			
Fecha 11/07/2009 💌 Tasa 🔍			
Aceptar 🔀 Cerrar			

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al valor de la Tasa y posteriormente clic en Aceptar.

2.2.3.2. MODIFICACION VALORES DE TASAS

🛍 Valor	de la Tasa - Mod 🔀
Fecha	30/06/2009 💌
Tasa	SSI 🔍
Valor	30.42
	Aceptar 🔀 Cerrar

Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla siguiente donde podrá modificar los datos del valor de la tasa que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación para que aparezca la pantalla respectiva, o puede también hacer doble clic sobre el registro requerido. La información de Valores de Tasas es importante, por lo tanto deberá tener cuidado en el momento de alterar dicha información ya que cualquier cambio indebido se repercutirá en la valoración y en la medición del riesgo, es decir, se podrán arrojar datos incorrectos. En la modificación de Valores de Indicadores solo



podrá hacerlo con el valor.

2.2.3.3. BUSCAR VALORES DE TASAS

👎 Buscar Valores de Tasas 🛛 💈	¢		
Buscar Por	7		
01/07/2009 🔽 🗖 Fecha			
Tasa			
01/07/2005 01/07/2005 🔽 🗖 Intervalos de Fecha			
Todos los Registros			
💦 Aceptar 🛛 🔀 Cerrar			

En esta opción se podrán buscar los Valores de Tasas por la Fecha en la cual se registro dicha Tasa, por el nombre de la Tasa o podrá hacerlo buscando todos los registros que se encuentren en el sistema. Una vez se haya hecho la consulta deseada aparecerá la información e inmediatamente se activan los botones de modificación y eliminación para proceder a manejar la información como se desee. La pantalla de búsqueda se muestra a continuación. Para buscar deberá marcar porque opción se realizará la búsqueda y el patrón de búsqueda a utilizar.

2.2.3.4. ELIMINAR VALORES DE TASAS



Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del valor de la Tasa a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Si desea eliminar haga clic en Aceptar, sino clic en Cerrar.



2.2.3.5. DETALLE VALORES DE TASAS

🚧 Valores de Tasas - Det 🔀				
Fecha	30/06/2009 💌			
Tasa	SSI			
Valor	30.42			
	Cerrar			

Al dar clic en el botón de detalle aparece la información en detalle del valor de la tasa respectivo. Recuerde que en estas pantallas de detalle no puede llevar a cabo operaciones de modificación y eliminación, ya que como su nombre lo indica es solo pantalla informativa.

2.2.3.6. CARGA DATOS DE LOS VALORES DE TASAS

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

🚢 Carga de Datos - Valores de Tasas		
Cargue Automático Archivo (*.txt)		
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista		
	Imprimir Herrores	Aceptar 🔀 Cerrar

2.2.3.7. EXPORTAR A EXCEL

Puede utilizar la información de los valores de tasas para informes en Excel.



2.2.4. ÍNDICE IPC

🛃 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Indice IPC]							
Archivo Carga de Información Ventana							
∿ 🔉 🗹							
Valores de	Fecha	Fecha Publicacion	Valor	Variación			
	01/09/1954	05/09/1954	0.978706				
	01/10/1954	05/10/1954	0.981935				
Indiandar	01/11/1954	05/11/1954	0.984586				
muicauoi	01/12/1954	05/12/1954	0.989805				
<u> </u>	01/01/1955	05/01/1955	0.988122				
866	01/02/1955	05/02/1955	0.987430				
Monedas	01/03/1955	05/03/1955	0.991380				
10.8.	01/04/1955	05/04/1955	0.998320				
- 	01/05/1955	05/05/1955	0.994027				
Tasas	01/06/1955	05/06/1955	0.993331				
	01/07/1955	05/07/1955	0.991047				
	01/08/1955	05/08/1955	0.992038				
	01/09/1955	05/09/1955	0.986780				
	01/10/1955	05/10/1955	0.989444				
112	01/11/1955	05/11/1955	0.998745				

2.2.4.1. INGRESO INDICE IPC

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente al valor del índice IPC y posteriormente de clic en aceptar.

*	Indice IPC - Ingresar 🛛 🗖 🔀
[Ingresar Datos
	Fecha 01/01/2009 💌
	Fecha Publicacion 01/07/2009 -
	C Variación Mes 0
	C Valor
l	
	Aceptar Cerrar

2.2.4.2. MODIFICACION INDICE IPC

Solo puede modificar la información correspondiente a Fecha Publicación, valoración mes y valor. En caso de necesitar un cambio adicional debe eliminar el registro.



🏾 Indice IPC- Modificar 🛛 🗖 🔀				
Ingresar Datos				
Fecha	01/09/1954 💌			
Fecha Publicacion	05/09/1954 💌			
🔿 Variación Mes				
C Valor	0.978706			
Aceptar Cerrar				

2.2.4.3. ELIMINAR INDICE IPC

Para eliminar un registro ubíquese en el ítem seleccionado y seleccione el botón ubicado en la parte superior. El sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

	🗂 Indice IPC- Eliminar		
	Ingresar Datos		
PWPREI - DEFINICION DE	PARAMETROS		X
Si Borra este regist Registro ?	ro, se Eliminaran los registros des	de '01-08-2008' H	nasta la fecha maxima.Esta Seguro de Eliminar el
	Sí	No	
	Aceptar 🛛	Cerrar	

2.2.4.4. BUSCAR INDICE IPC

🏓 Buscar Indice IPC 🛛 🔀						
Buscar Por						
Fecha 01/07/2009 💌						
Todos los Registros						
Aceptar 🛛 Cerrar						

Para consultar información sobre el índice IPC, puede hacerlo por Fecha, o por



todos los registros.

LINFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Grupos Días al Vencimiento]								
🔂 Archivo C	arga de Informació	ón Ventana						
P 😼 🖧 🖡	r 🐮 🔗 🖉	1 💖						
Valores de	Fecha Vigencia	Tipo Rango	Rango	Días Mínimos	Días Máximo	Grupo DiasV		
	01/01/2003	GRUPO AC-NO RANGOS	0-9999		9999			
<u>~</u>	01/01/2003	GRUPO SISVAL	0-30	0	30	15		
Indicador	01/01/2003	GRUPO SISVAL	31-61	31	61	16		
nacador	01/01/2003	GRUPO SISVAL	62-92	62	92	17		
%	01/01/2003	GRUPO SISVAL	93-181	93	181	18		
~~	01/01/2003	GRUPO SISVAL	182-273	182	273	19		
Monedas	01/01/2003	GRUPO SISVAL	274-365	274	365	20		
ll alla	01/01/2003	GRUPO SISVAL	366-548	366	548	21		
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	549-730	549	730	22		
Tasas	01/01/2003	GRUPO SISVAL	731-1095	731	1095	4		
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	1096-1460	1096	1460	5		
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	1461-1825	1461	1825	6		
Indice IPC	01/01/2003	GRUPO SISVAL	1826-2190	1826	2190	7		
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2191-2555	2191	2555	8		
112	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2556-2920	2556	2920	9		
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2921-3285	2921	3285	10		
Grp Dilas Vto.	01/01/2003	GRUPO SISVAL	3286-3650	3286	3650	11		
	01/01/2002	COUDO CTOUN	2/51 4015	2/51	4015	10		

2.2.5. GRUPO DIAS VENCIMIENTO

2.2.5.1. INGRESO GRUPO DIAS AL VENCIMIENTO

😽 Días al Vcto -	Ingresar	×
Ingresar Datos—		
FechaVigencia	01/07/2009 💌	
Tipo Rango	-	
Rango		
Dias Minimos		
Dias Maximos		
Grupo DiasV	0	
		-
	ar 🔀 Cerrar	

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a los días al vencimiento y posteriormente de clic en aceptar.

2.2.5.2. MODIFICACION GRUPOS DIAS AL VENCIMIENTO

La opción de modificación permite modificar, Días mínimos, Días Máximos y el Grupo de Días al vencimiento.



😽 Días al Vcto -	Modificar	×
Ingresar Datos —		1
FechaVigencia	01/01/2003 💌	
Tipo Rango	GRUPO AC-NO RANGOS 💌	
Rango	0-9999	
Dias Minimos	0	
Dias Maximos	9999	
Grupo DiasV	0	
Acepta	ar 🔀 Cerrar	

2.2.5.3. ELIMINAR GRUPOS DIAS AL VENCIMIENTO

🐯 Días al Vcto - Eliminar 🛛 🗙
Ingresar Datos
FechaVigencia 01/01/2003
Carga de Información - DiasVen 🛛 🕅
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
Sí No
Aceptar 🛛 Cerrar

Para eliminar escoja el ítem deseado y de clic en el botón ubicado en la parte superior. El sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.2.5.4. BUSCAR GRUPOS DIAS AL VENCIMIENTO

Para consultar información sobre Grupos Días al Vencimiento, puede hacerlo por Fecha, o por todos los registros.



🏴 Buscar Dias Vencimiento 💦 🔲 🔁 🔁							
Buscar Por							
FechaVigencia 01/07/2009 💌							
Tipo Rango	-						
Todos los Registros							
N							
Aceptar 🔀 Cerrar							

2.2.5.5. EXPORTAR A EXCEL DIAS AL VENCIMIENTO

Con esta opción puede manejar la información de días al vencimiento en Excel.

2.2.6. HAIRCUT

🛃 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [HAIRCUTS BRP]								
₿	🚯 Archivo Carga de Información Ventana							
Va	alores de	Fecha Vigenc	Num. Emisior	Plazo.	HAIRCUT			
		01/02/2010	35695	1	0.05			
	\sim	01/02/2010	35695	2	0.05			
		01/02/2010	35695	7	0.05			
	Indicador	01/02/2010	35695	8	0.05			
	•	01/02/2010	35695	19	0.05			
		01/02/2010	35695	23	0.05			
	Monedas	01/02/2010	35695	33	0.05			
	18a.	01/02/2010	41970	1	0.05			
	- KY	01/02/2010	41970	2	0.05			
	Tasas	01/02/2010	41970	7	0.05			
	and the second se	01/02/2010	41970	8	0.05			
		01/02/2010	41970	19	0.05			
	ndiae IPC	01/02/2010	41970	23	0.05			
1 '		01/02/2010	41970	33	0.05			
	112	01/02/2010	41993	1	0.1			
1	10	01/02/2010	41993	2	0.1			
Gir	rp Dias Vto.	01/02/2010	41993	7	0.1			
Ιг		01/02/2010	41993	8	0.1			
		01/02/2010	41993	19	0.1			
L I	HAIRCUT	01/02/2010	41993	23	0.1			
1 5		01/02/2010	41993	33	0.1			

Los Haircuts son márgenes de las operaciones Repo que calcula y publica el banco de la República, estos Haircuts se utilizan en el sistema para castigar los activos líquidos incluidos en el formato 475 y en el futuro podrán utilizarse también para la evaluación de garantías de los negocios de futuros.



2.2.6.1. BUSCAR HAIRCUT

🖲 Buscar Betas 📃 🗖 🔀
Buscar Por
14/10/2010 🔽 🗖 Fecha
Curva
14/10/2010 14/10/2010 Intervalos de Fecha
Todos los Registros
Aceptar Cerrar

Para buscar un registro se puede hacer por fecha de vigencia, por intervalos de fecha es decir, una inicial y una final o simplemente mostrar todos los registros de Haircuts.

2.2.6.2. CARGA DE DATOS HAIRCUT

🚢 Carga de Datos	
Cargue Automático Archivo (*.txt) D:\INFOV	AL\HAIRCUTS\HAIRCUT 02 2010.xls
Tipo de Carga O Alterna O Normal O INFOVAL	Espere un momento mientras se cargan los datos.
C Vista	Imprimir Frrores Cerrar

Para cargar los Haircuts los pasos son:

- 1. Descargar el archivo de Haircuts de la pagina del Banco de la República
- 2. Presionar el botón cargar, seleccionar el archivo y presionar el botón cargar

2.2.6.3. GENERAR FORMATOS IRL HAIRCUT



Al generar formatos del IRL se debe tener en cuenta lo siguiente:

- 1. Determinación de los haircuts aplicables, de acuerdo con la definición de la SFC en su circular 009 de 2018:
 - a. Los publicados por BRP.
 - b. Los no publicados:
 - i. 15% para FICS y papeles con calificación de largo plazo AA- o superior (o su equivalente de calificación)
 - ii. 20% para FICS y papeles con calificación de largo plazo entre A+ y BBB- (o su equivalente de calificación)
 - iii. 50% para FICS y papeles con calificación especulativa de largo o corto plazo (o su equivalente de calificación), o que no cuenten con calificación.

2. Calificaciones FICS.

De conformidad con lo anterior, en adelante deberá alimentar las calificaciones para los FICS. Para ello proceda:

- Ingrese por "Mercado y Sociedad Valores de"
- Use la opción "Haircuts"
- Pulse "Cargar"
- En la pantalla pulse la opción "Calif.FICs."
- Elija la fecha de vigencia
- Seleccione el archivo a cargar. La plantilla que debe usar para establecer las calificaciones de sus FICS se encuentra en "FormatosTodasEntrada.xls", hoja "CalifFICs"
- Pulse Aceptar y las nuevas calificaciones serán alimentadas al sistema:



🚹 INFORMAC	CION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [HAIF	cuts)
Archivo	Carga de Información Ventana	
P 💊 🖉	1	
Valores de	Fecha Vigencia. Num. Emision Plazo.	HAIROUT
Indices Monedas		
Tasas		Cargue Automático
Indice IPC		Archivo (*1xi) UN-VHoductos VHETVAAAADocumentos V-ormato de Largas PWPHETVEJemplo Carga Lair FILS.xisx
Grp Días Vto. HAIRCUT		C Normal C INFOVAL C Excel C H.MonExt C Vista C Acc.Elegib. C Califs.FICs.
Mercado Especies		
Historico Modo		
INFOVAL		e Imprimi ** Errores Aceptar 🔀 Cerrar
Forwards/Opc.		
Salir		

- Orden de determinación de la calificación. Cuando el activo no se encuentre entre los publicados por el BRP, el sistema procederá a determinar el castigo por calificación. La calificación se ubicará de la siguiente forma, de mayor a menor prioridad:
 - a. Si es un FIC, la última registrada para el mismo, según el punto anterior.
 - b. La calificación publicada en el archivo de precios de mercado.
 - c. La registrada en la especie.
 - d. La registrada en el emisor, según el plazo al vencimiento del papel.



2.3. OPCIÓN ESPECIES



Esta opción corresponde al botón de color azul, dentro de cada una de ellas se encuentran los sub-menús del módulo de carga. Aquí se encuentran las siguientes opciones:

2.3.1. ESPECIES/RENTA VARIABLE ACCIONES Y DIVISAS

Para ingresar al módulo de especies de renta variable haga clic en el Icono descrito en la parte superior, de inmediato el sistema le muestra la cuadricula donde posteriormente vera la información que se encuentre registrada en su sistema.

🚢 INFOR	🛓 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Especies/Renta Variable]										
📋 Archivo	Carga de Informació	in Ventana									_ 8 ×
Especie:	Especie	Descripción	Tipo Especie	Emisor	Moneda	Calificaion	Estado	Estado de Suspensión	Tipo de Bursatilidad	% Bursatilidad	Fecha Patrimonial 🔺
	56	56	ACCION	AAA	COP	656	A	A	A	123 %	25/08/2002
	AAJEFAO	AAJEFAO	ACCION	AC7	TRM		A	A	N	0%	08/07/2009
Accilia	ACASA		ACCION	ACA	COP		A	Р	I	0%	30/06/1996
- MOGYDIN	ACASA1		ACCION	ACA	COP		A	Р	I	0%	30/06/1996
	ACC.CEMENTOS		ACCION	INV	COP		A	A	A	0%	03/02/2006
	ACC.INVERSIO		ACCION	CE	COP		A	A	A	0%	03/02/2006
nentari	ACES		ACCION	AEC	COP	2333	A	Р	I	0%	30/09/1998
100 A	ACES1		ACCION	AEC	COP		A	Р	I	0%	30/09/1998
ISINES	AEROTEC		ACCION	AER	COP		A	P	I	0%	31/03/2004

2.3.1.1. INGRESO ESPECIES DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a la especie de renta variable o divisas y posteriormente clic en Aceptar.



Especies/Renta Variable - Ingres	ar 🛛 🔍
Código Calificación Estado Emisor	AAAAMMDD Fec. Evento ISIN Tipo Especie
Descripción Categoría G	rupo de Calificación
Estado de Negociación Bursatilidad Tipo NINGUNA Porcentaje 0.000 Factor1 Factor 2	Fecha Patrimonial Valor Patrimonial 128/05/2013 0.0000000 Fecha Nominal Valor Nominal 28/05/2013 0.0000000 Fecha Fiscal Valor Fiscal 128/05/2013 0 Acc. Circulación 0 Pottafolio Destino
Superfinanciera Aval Código SF Aval	Emisión Fungible
	Aceptar 🔀 Cerrar

2.3.1.2. BUSCAR ESPECIES DE RENTA VARIABLE

En esta opción se pueden buscar las especies de renta variable (Acciones) por especie o por el emisor. O por todos los registros.

🏴 Buscar Especie/Renta Variable 🛛 🔀
Buscar Por
Seleccione Emisor
▼ • Especie
C Emisor
C Todos los Registros
Aceptar 🛛 Cerrar



2.3.1.3. MODIFICACION ESPECIES DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en la opción de Modificar para las Especies de Renta Variable, aparecerá la pantalla anteriormente mostrada, en la cual no se podrá modificar o cambiar el nombre asignado a la especie. La información restante se podrá manejar como se desee.

Especies/	Renta Variable	- Mod	ificar		×
Código Calificación Estado Emisor Tipo Título Descripción Categoría	56 ESE ACTIVO AAA Acciones 56 0	▼ ▼ Grup	Cod. Super ISIN Tipo Especie Moneda	23 ACCION COP	•
Estado de Ni ACTIVO Bursatilidad- Tipo ALTA Porcentaje [123.000 Factor1	egociación	F F A F	echa Patimonial 25/08/2002 cha Nominal 25/08/2002 cha Fiscal 25/08/2002 cc. Circulación ortafolio Destino	Valor Patrimonial 123.00000000 Valor Nominal 23.00000000 Valor Fiscal 123 123	
Superfinancier Código SF 🛛 Calificadora 🗍	aAv.	al	Emisión	Aceptar	Cerrar

2.3.1.4. ELIMINAR ESPECIES DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la misma pantalla mostrada anteriormente, a excepción de que todos los campos están bloqueados, y cuando se da clic en el Botón Aceptar aparece un mensaje preguntando ¿Está seguro de eliminar el registro?, en este caso el usuario deberá proceder como desee. Las especies tanto de renta variable como de renta fija no se eliminan físicamente de la base de datos, solo se inhabilitan.



🖶 Especies/Renta Variable - Eliminar 🛛 🛛 🔀
Código 56 Cod. Super 23 Calificación 656 ISIN ISIN Estado ACTIVO Tipo Especie ACCION Emisor AAA Moneda COP Tipo T ítulo Acciones Image: Composition of the security of the securety of the security of the securety of the securety o
Estado de PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD monial ACTIVO Image: State Seguro de Eliminar el Registro ? inal Bursatilidad 000 000 Tipo State Seguro de Eliminar el Registro ? inal ALTA Image: State Seguro de Zate Seguro de Zate Seguro de Circulación 123 Porcentaje Acc. Circulación 123 I23.000 Portafolio Destino Image: State Seguro de Segu
Superfinanciera Aval Emisión Fungible Código SF AAEVS
Aceptar 🛛 🔀 Cerrar

2.3.1.5. DETALLE ESPECIES DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.



Especies/	Renta Variab	le - Deta	ille		×
Código Calificación Estado Emisor Tipo Título Descripción Categoría	56 656 ACTIVO AAA Acciones 56 0	Grup	Cod. Super ISIN Tipo Especie Moneda o de Calificación	23 ACCION COP	
Estado de Ni ACTIVO Bursatilidad- Tipo ALTA Porcentaje [123.000 Factor1	egociación	FI FI A P	echa Patrimonial	Valor Patrimonia 123.00000000 Valor Nominal 23.00000000 Valor Fiscal 123 123	
-Superfinancier Código SF Calificadora	a	Aval	Emisión	Fungible	Cerrar

2.3.1.6. CARGA DE DATOS ESPECIE DE RENTA VARIABLE

🚢 Carga de Datos -	Especies/Renta V	ariable					
Cargue Automático Archivo (*.txt)							
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista							
			Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.



2.3.1.7. EXPORTAR A EXCEL ESPECIE DE RENTA VARIABLE

Con esta opción puede cargar la información de renta variable y divisas en Excel.

2.3.2. ESPECIES DE RENTA FIJA

1													
	🚢 INFORMA	CION DE MERC	ADO Y SOCIEDA	D - [Espec	ies/Rent	a Fija]							_ 7
	📋 Archivo - C	Carga de Informac	ión Ventana										_ 8 ×
	芦 🗞 🖧 🚺	7 💐 🚳 🕹	2 🛛										
	Especies	Especie	Descripción	Emisor	Moneda	Calificacion	Estado	Cálculo	Caja	Calendario	Tasa	Modalidad	Fecha de Emisiór ٨
I		0112847446		GNA	EUR		INACTIVO	ALCULO SIN DEFINI	CAJA SIN DEFINIR		FS	AV	30/06/20
		0118953107		GNA	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	AV	20/10/20
	Acce/Dini	0123152521		BAN	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	С	FS	AV	31/01/20
	ACCIDIN	0129675350		BAN	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	AV	31/05/20
		112847446		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	С	FS	AV	30/06/20
	Benta Fila	118953107		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	AV	20/10/20
	Therman Ital	123152521		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	AV	31/01/20
	1000 C	129675350		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	AV	31/05/20
	101616-0	195325AA92		GNA	TRM		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	FS	SV	15/02/19
	ISINES	1052254525		CNIA	TDM		UENCIDO	Ohung Dungsing	Ohnen Drasies	6	EC	CU	22/02/16

Para ingresar al módulo de especies de renta fija haga clic en el Icono descrito en la parte superior, de inmediato el sistema le muestra la cuadricula donde posteriormente vera la información que se encuentre registrada en su sistema.

2.3.2.1. BUSCAR ESPECIES DE RENTA FIJA

🏓 Buscar Especie/Renta Fija 🛛 🛛 🔀
- Buscar Por
Seleccione Emisor
▼
C Emisor
C Moneda
C Todos los Registros
Aceptar 🔀 Cerrar

En esta opción se pueden buscar las especies de renta fija por su nombre, por emisor, por moneda, o ver todos los registros. Adicionalmente existe una opción con la cual se pueden buscar las especies sin definir. Es decir aquellas especies que se cargaron por archivo plano y alguna parte de su información está incompleta. En este caso esa información incompleta es la Caja, la Fórmula de Cálculo y la Tasa de Referencia. Aquí podrá imprimir un listado de dichas especies para que posteriormente sean registradas y actualizadas en la base de datos.



🗐 Especies/Renta Fija - Ingresar	
Código Emisor Emisor Descripción Moneda Calificación Indicador Estado Cod. Super FecMaxReinv 17/09/2003 T Titulo	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Superfinanciera	
Fecha Emisión Vencimiento Imisión Imisión Vencimiento Imisión Imisión Vencimiento Imisión Imisión Vencimiento Tasa Imisión Imisión Referencia Imisión Imisión Imisión Imisión Imisión Uso Imisión Imisión Día Mes Cantidad Aplica Imisión Imisión Imisión Imisión Modalidad Periodicidad Periodicidad NO APLICA Imisión Imisión Imisión	Calculo Caja Calendario Tabla de Desarrolo Rendimiento Comisión Comisión Comisión Comisión Clase Factor 1 Clase Factor 2 Clase Factor 2 Clase Factor 2 Clase Factor 2 Portafolio Destino Retefuente < 5 Portafolio Destino Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA NO APLICA
	Aceptar 🛛 Cerrar

2.3.2.2. INGRESO ESPECIES DE RENTA FIJA

Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a la especie de renta fija o deuda pública y posteriormente clic en Aceptar.

En caso de que se este ingresando una especie nueva, deberá tener en cuenta las siguientes indicaciones, además recuerde que toda esta información deberá tomarla del MEC de la BVC:

- **Campo Código:** Ingrese el nemotécnico. Para las especies de Deuda Pública deberá ingresar el largo.
- Campo Descripción: Deje el campo vacío.
- **Campo Calificación:** Deje el campo vacío.
- Campo Estado: Ingrese el campo que está señalado con el número 1 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Emisor: Ingrese el campo que está señalado con el número 2 en la pantalla de ejemplo del MEC. Deberá ingresar el código no el nombre completo.
- Campo Moneda: Ingrese el campo que está señalado con el



número 3 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.

- Campo Indicador: Ingrese el campo que está señalado con el número 4 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Cod. Súper: Ingrese el campo que está señalado con el número 5 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Fecha de Emisión: Ingrese el campo que está señalado con el número 6 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación. Si la fecha de emisión que aparece en la pantalla es 0000-00-00, deberá quitar el chulo que aparece en lado izquierdo del campo Fecha de Emisión. Si en el MEC esta fecha es diferente de 0000-00- 00, deberá poner el chulo y digitar la respectiva fecha.
- Campo Fecha de Vencimiento: Ingrese el campo que está señalado con el número 7 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación. Si la fecha de vencimiento que aparece en la pantalla es 0000-00-00, deberá quitar el chulo que aparece en lado izquierdo del campo Fecha de Vencimiento. Si en el MEC esta fecha es diferente de 0000-00-00, deberá poner el chulo y digitar la respectiva fecha.
- Campo Tasa de Referencia: Ingrese el campo que está señalado con el número 8 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Spread: Ingrese el campo que está señalado con el número 9 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Uso: Ingrese el campo que está señalado con el número 10 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Día Flujo: Ingrese 0.
- Campo Mes Flujo: Ingrese 0.
- **Campo Cálculo:** Ingrese el campo que está señalado con el número 11 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Caja: Para ingresar este campo deberá tener en cuenta lo siguiente:
 - Si el Cálculo es 11 la Caja es 1.
 - \circ $\,$ Si el Cálculo es 31 la Caja es 3.
 - Si el Cálculo es 41 la Caja es 4. Especie del Continuo la Caja es 6.
 - Si el Cálculo es 51 la Caja es 5.
- Campo Calendario: Para ingresar este campo deberá tener en cuenta lo siguiente de acuerdo al campo señalado número 12:
 - Si la tasa base es 360 el Calendario es Comercial



- Si la tasa base es 365 el Calendario es Corrido
- Si la tasa base es 360-i o 365-i el Calendario es Sin Bisiesto.
 Nota: Calendario. Esta variable establece la forma como se calcularán los días de pago de los interese de un periodo, así:
 - COMERCIAL: significa que los días de pago se contarán como si todos los meses fuesen de 30 días.
 - CORRIDO: significa que los días de pago se contarán de forma normal pero descontando días bisiestos.
 - CONBISIESTO: significa que los días de pago se contarán de forma normal sin descontar días bisiestos
- Campo Tabla de Desarrollo: Este campo tiene dos opciones: Si Tiene y No Tiene: Si la Caja que se digitó es la 5 en este campo deberá ingresar Si Tiene. Si es otra Caja deberá ingresar No Tiene.
- Campo Rendimiento: Ingrese el campo que está señalado con el número 13 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.

Nota. Rendimiento. Este dato se combina con el anterior en los siguientes casos:

- COMERCIAL: se traduce en Actual/360. El valor del flujo se calcula como:
 - Vfi = TasaEmi * Dpa / 360
- ACTUALCORRIDO: Se traduce en Actual/Corrido. El valor del flujo se calcula como:
 - Si el calendario de emisión es CORRIDO: Vfi=TasaEmi*Periodo/12, siempre que la modalidad no sea PV.
 - Si no: Vfi=TasEmi*Dpa/360
- Campo Comisión: Ingrese el campo que está señalado con el número 14 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Anualizada: Ingrese el campo que está señalado con el número 15 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Amortización: Ingrese el campo que está señalado con el número 16 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Retefuente > 5: Ingrese el campo que está señalado con el número 17 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Retefuente < 5: Ingrese el campo que está señalado con el número 18 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.



- Campo Modalidad de Pago de Interés: Ingrese el campo que está señalado con el número 19 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.
- Campo Modalidad de Pago de Reinversión: Ingrese el campo que está señalado con el número 20 en la pantalla de ejemplo del MEC que se muestra a continuación.

Una vez haya ingresado toda la información de clic en Aceptar.

2.3.2.3. CARGAR TABLAS DE DESARROLLO

Para cargar varias tablas de desarrollo los pasos que se deben realizar son:

1. Ubicar los archivos descargados desde INFOVALMER en una carpeta, en el momento de guardar el archivo por favor colocar el nombre de la especie como se muestra en la imagen:

Nombre	Fecha de modifica	Тіро	Tamaño
INST10100522.txt	09/05/2013 11:28 a	Documento de tex	10 KB
INST10171121.txt	09/05/2013 11:28 a	Documento de tex	10 KB
INST10210921.txt	14/05/2013 04:12	Documento de tex	10 KB
INST10220222.txt	14/05/2013 04:03	Documento de tex	10 KB
INST10220621.txt	09/05/2013 11:30 a	Documento de tex	10 KB
INST10230822.txt	09/05/2013 11:31 a	Documento de tex	10 KB

Nota: Esta carpeta solo debe contener archivos de las tablas de desarrollo a cargar.

2 Parametrizar las especies con el Nemo equivalente Renta Fija correspondiente y este estar debidamente creado:

Código	INST10100	522	Emicor	100	• <	eno Equiv Pienta Fán	TIPN5A22
Descripción	1		Moneda	COP	•	ISINT	0
Calificación			Indicador	IRFBVC	-	ISIN2	0
Estado	ACTINO	-	Cod Supe	1		CurCDT	OEC •
FecMasReim	01/01/4000		Titulo	TITULOS HI	POTECARIOS	Categoria	Grupo Calificación [70]
Superfinance	iera						
Códgo SF	-	Aval	Enmin	Fungble	Cal	icadora Otra	
E D LO	Reterencia (FS) lia (a Mes) (0) todalidad de P	Spread (i Uso (i Cantidad 0 ago de Interese	, 70100 CTUAL e Filips Aplice No Capitaliza		Table de Desanoli Rendmiente Consisión Datos Faciales Amortización Reteluente > 1 Roteluente < 1 Modelidad Pago di	ALTERNA INTERESES NALOR SI 10000 0.000 0.000	Class Factor 1 Class Factor 1 Class Factor 2 Portado Destino
	Modelided MENSUAL	Penc • VEN	dicidad ODA	J	Modalidad NO APLICA	• Peric	doidad APLICA



3. Abrir cualquiera de las especies a cargar la tabla de desarrollo, cambiar el campo Tabla de Desarrollo por ALTERNA y presionar el botón seguido a este campo; inmediatamente abre una pantalla para cargar:

Se uñor 词 🗎 :	≫ ∿					
echa Vigencia	Cupón	Amortización	Interés	Fecha	Total	Saldo
2013/05/09	1	0 %	6.701 %	2012/05/10	6.701	10
2013/05/09	2	2.200406 %	6.701 %	2012/06/10	8.901406	97.79959
2013/05/09	3	1.636547 %	6.701 %	2012/07/10	8.337547	96.16304
2013/05/09	4	2.170441 %	6.701 %	2012/08/10	8.871441	93.99260
2013/05/09	5	1.179352 %	6.701 %	2012/09/10	7.880352	92.81325
2013/05/09	6	2.119318 %	6.701 %	2012/10/10	8.820318	90.69393
2013/05/09	7	2.731332 %	6.701 %	2012/11/10	9.432332	87.96260
2013/05/09	8	1.914618 %	6.701 %	2012/12/10	8.615618	86.04798
2013/05/09	9	2.453242 %	6.701 %	2013/01/10	9.154242	83.59474
2013/05/09	10	1.681391 %	6.701 %	2013/02/10	8.382391	81.91335
2013/05/09	11	1.525494 %	6.701 %	2013/03/10	8.226494	80.38785
2013/05/09	12	2.462883 %	6.701 %	2013/04/10	9.163883	77.92497
2013/05/09	13	1.700311 %	6.701 %	2013/05/10	8.401311	76.22466
2013/05/09	14	1.740196 %	6.701 %	2013/06/10	8.441196	74.48446
2013/05/09	15	1.768541 %	6.701 %	2013/07/10	8.469541	72.71592
2013/05/09	16	1.743753 %	6.701 %	2013/08/10	8.444753	70.97217
2013/05/09	17	1.717697 %	6.701 %	2013/09/10	8.418697	69.25447
2013/05/09	18	1.684582 %	6,701 %	2013/10/10	8.385582	67,56989

4. Presionar el botón cargar, buscar la ruta de la carpeta donde se encuentran los archivos y luego aceptar:





5. Al presionar Aceptar, el sistema pregunta:

-argue Automatico-	
l ipo de Carga C Alterna	Desea cargar todas las tablas de desarrollo presentes en esta ubicación?
Normal	
C Excel	Si No
C Vista	

Si la respuesta es **SI** el sistema tomara en cuenta todos los archivos que se encuentren en esa carpeta; si la respuesta es **NO** el sistema tomara el archivo seleccionado.

6. Si se presentan errores como se ve en la imagen, seguido de la descripción del error se encuentra el nombre del archivo al que pertenece el error:

Errores en	Descripción	*
Linea 2	[Columna 9:] La Especie no puede estar en blanco, archivo INST10210921.txt	
Linea 7	[Columna 9:] La Especie no puede estar en blanco, archivo INST10210921.txt	
Linea 9	[Columna 9:] La Especie no puede estar en blanco, archivo INST10210921.txt	
Linea 12	[Columna 9:] La Especie no puede estar en blanco, archivo INST10210921.txt	Ŧ
•	•	



2.3.2.4. MODIFICACION ESPECIES DE RENTA FIJA

🗐 Especies/Renta Fija - Modificar	
Código 0123152521 Emisor BAN Descripción Moneda EUR Calificación Indicador RFC Estado INACTIVO Cod Super CORBANO FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo ACEPTACI	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 00005 CurCDT ON BANCARIA Categoria G Grupo Calificación
Código SF Aval Emisión Fungib	le Calificadora
Fecha Vencimiento Imisión Vencimiento Imisión Imisión Imisión Imisión	Calculo Otros Precios Cala Otros Precios Calendario COMERCIAL Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento NO PAGA Comisión VALOR Comisión VALOR Amortización 100.000 Retefuente < 5
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad ANUAL VENCIDA V	Modalidad Periodicidad Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA
	Aceptar Cerrar

Al dar clic en la opción de Modificar para las Especies de Renta Fija, aparecerá la pantalla anteriormente mostrada, en la cual no se podrá modificar o cambiar el nombre asignado a la especie. La información restante se podrá manejar como se desee.

2.3.2.5. ELIMINAR ESPECIES DE RENTA FIJA

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la misma pantalla mostrada anteriormente, a excepción de que todos los campos están bloqueados, y cuando se da clic en el Botón Aceptar aparece un mensaje que pregunta ¿Está seguro de eliminar el registro?, en este caso el usuario deberá proceder como desee. Las especies tanto de renta variable como de renta fija no se eliminan físicamente de la base de datos, solo se inhabilitan.



📕 Especies/Renta Fija - Eliminar	×
Código 0123152521 Emist Descripción Mone Calificación Indic: Estado INACTIVO Cod. FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo	or BAN Verno Equiv Renta Fija eda EUR ISIN1 ador RFC ISIN2 Super CORBAN000005 CurCDT V ACEPTACION BANCARIA Calegoria 0 Grupo Calificación
Superfinanciera Código SF Aval Emisión	Fungible Calificadora
Fecha Emisión Vencimiento I 12/(PWP Tasa Referencia FS Spread 0.00 Uso ACTUAL	Calculo Otros Precios REI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD pcios Esta Seguro de Eliminar el Registro ? DAL Image: Simple Simp
Flujo Día Mes 0 0 0 Cantidad Aplic.	Amortización 100.000 Clase Factor 2 Retefuente > 5 Portafolio Destino
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad ANUAL VENCIDA	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA
	Aceptar Cerrar

2.3.2.6. DETALLE ESPECIES DE RENTA FIJA

Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.



Especies/Renta Fija - Detalle Código 0123152521 Emisor BAN Descripción Moneda EUR Calificación Indicador RFC Estado INACTIVO Cod. Super CORBANI FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo ACEPTAC Superfinanciera	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Código SF Aval Emisión Fungi	ible Calificadora
Fecha Vencimiento Image: State S	Calculo Otros Precios
FS Spread 0.000 Uso ACTUAL	Rendimiento NO PAGA Comisión VALOR Datos Faciales NO Amortización 100.000 Clase Factor 2
Flujo Día Mes 0 0 No Capitaliza	Retefuence > 5 Portafolio Destino Retefuence < 5 Image: Construction of the second se
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad ANUAL VENCIDA	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad ND APLICA V ND APLICA V
	Cerrar

2.3.2.7. CARGA DE DATOS DE RENTA FIJA

Para cargar datos de Renta Fija primero debe seleccionar el tipo de especie si es Renta Fija o Deuda Publica como muestra la imagen.



Y a continuación en el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



🚢 Carga de Datos - Especies/Renta Fija				
Cargue Automático Archivo (*.txt)				
Tipo de Carga Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista				
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	Cerrar

2.3.2.8. EXPORTAR A EXCEL ESPECIES DE RENTA FIJA

La información de especies de renta fija, puede ser bajada a Excel para realizar diferentes informes.

2.3.3. ISINES

🛓 INFORM	ACION DE ME	RCADO Y SOC	CIEDAD - [ISINES]							- 7 🗙
脑 Archivo	Carga de Inforn	nación Ventana	а							- 8 ×
a & H	8 🗶 🔶	I 🖉 🛛 🚿 👘								
Especies	NEMO	EMI	EMISOR	NIT	TIT	TITULO	ISIN1	ISIN2	SERIE	ADMIN
Acc/Divi										
Eenta Fija										
A										

En este módulo solo encontrará la opción de cargar información de Isines e Isines ANNA, como se puede ver en la imagen en el lado izquierdo se escoge el tipo de archivo que se va a cargar.

🚟 Carga Actualizacion - ISINES	
- Cargue Automático	
Archivo (*.txt)	
- Tipo de Carga	
Tipo de Archivo Archivo Excel (.xls)	
C Act. ISIN ANNA	
Imprimir III Ver Ver Kerrores Acep	tar 🔀 Cerrar



1. Si se va a cargar Isines recuerde que el archivo Excel que descarga debe ser modificado de la siguiente forma:

2:137	(H - 🔽) ±			NEMOS-ISINSEP072010-	xls [Modo de compatibilid	ad] - Microsoft Excel						
Inicio	Insertar Diseño d	le página Fórmulas	Datos I	Revisar Vista				1		th S Autor	A A	- @ -
Copia	Verdana	* 8 * A A		Ajustar texto	General +			Ť	' 🔐 🕻	Rellen	ar + Z	
Pegar 🍼 Copia	ar formato	• 🖽 • 🔕 • 🗛 •		🛱 🚝 🔤 Combinar y centrar *	\$ ~ % 000 **** ***	Formato Dar for condicional * como t	mato Estilos d abla * celda *	e Inserti	ar Eliminar Forn	ato 2 Borrar	* Orc y fil	denar Buscary Itrar * seleccional
Portapapele	s G	Fuente 5		Alineación	Número 🕞	Estilo	S		Celdas		Modi	ficar
A4J	A	E	1	С		D		E	F	(3	Н
1		Ca	mbios en el ar Martes, 0	chivo de Nemos-ISIN para e 7 de Septiembre de 2010	el día							
3			,									
Con En consecu	motivo de la salida a p uencia, para la consulta	oroducción de la Agen a de los ISIN de nemo página de	icia Numeradora nemoté stécnicos NO est www.infoval.con	Nacional – ANNA- en este archi cnicos estandarizados. andarizados, por favor realizar n.co, ingresando por la opcion d	ivo únicamente se pul la consulta del archivo p le Renta Fija.	blicará ISIN ANNA (para ISIN en la					
6 7 8 9 10 N	lemotécnico	Campo Mo	Car	mbios Nemos-ISIN Valor Anterior		Valor Actual						
12	018 - 30											
14 15 N	emotécnico	Cla	Categor	ización Títulos Creados Calificación		Valoran por						
16 CDTCLP809 17 CDTCLP80A		1	1	EMISOR EMISOR		PRECIO PRECIO						
18 CDTCLP80B 19 CDTCLP80	8	1	1	EMISOR EMISOR		PRECIO						
21 Eliminar	esta hoja											
23		Cambiar el no	mbre por Ho	ia1								
26						<i>62</i> - 2						
C n 🖬 🔊 -	(% - 📝) ±			NEMOS-ISINSEP072010xls	s [Modo de compatibilidad]	- Microsoft Excel						_ = x
Pegeestime Filipina Fil	(* - Q) = Insertar Diseño de r Verdana r ar estas colur	e página Fórmulas • 8 • A A I nnas la A y la	Datos Re = = = % C = #	NEMOS-ISINSEP072010-xis evisar Vista Pr Pr Ajustar texto	s [Modo de compatibilidad] General • \$ • % 000 *** ***	- Microsoft Excel	to Estilos de a - celda -	Insertar E	Iminar Formato	Σ Autosuma Rellenar + 2 Borrar +	• Ž Ordenai y filtrar	e a x
Peg Elimin	r Diseño de r Verdana	e página Fórmulas • 8 • A A A mnas la A y la § INC	Datos Ro = = = % C = #	NEMOS-ISINSEP072010-wik tvisar Vista Alineación c	Seneral S ~ % 000 % % % Número G	- Microsoft Excel	to Estilos de a× celda ×	Insertar E	liminar Formato Celdas	Σ Autosuma	Ordenar y filtrar Modificar	e a x
A	r Diseño de r Verdana r Verdana • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	e página Fórmulas * 8 * A A A mnas la A y la k INC C	Datos Ri = = = % C = = #	NEMOS-ISINSEP072010-wik zvisar Vista Pr I Ajustar texto E I Combinary central (* Alineación (*)	s [Modo de compatibilidad] General • \$ • % 000 *& % Número 72	- Microsoft Excel	to Estilos de a× celda×	Insertar E	iminar Formato Celdas	∑ Autosuma	Ordenau y filtrar Modificar	Buscar y
Pee Elimin D5 Comentario 2	Provide a construction of the second	e página Förmulas * 8 * A A mnas la A y la k INC c c c c c c c c c c c c c	Datos R	NEMOS-ISINSEP072010-uik evisar Vista P Justar texto E P Gombinary centrar • Alineación (*) E fecha anterior.	s (Modo de compatibilidad) General • § • % 000 *8 *8 Número **	- Microsoft Excel Formato Dar forma condicional × como table Estilos F ar diferentes valores	to Estilos de a + celda +	Insertar E	liminar Formato Celdas	∑ Autosuma	Ordenau y filtrar ' Modificar	© _ © X © _ © X F Buscary seleccionary
Linicio I	The second	r página Fórmulas r 8 r A ⁺ A ⁺ mnas la A y la inc C c c netroversión I netroversión I netroversión I netroversión I BAGBA16050	Datos RR = = = = * C = = * C = = * C = * * C = * * * * * * * * * * * * * *	NEMOS-ISINSEP072010-sils evisar Vista Alusat texto Alineación c Ferencia anterior. refecha anterior. refecha anterior. refecha anterior. refecha anterior. refecha anterior. refecha anterior. refecha anterior.	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000] *8 *8 Número '>	- Microsoft Excel	to Estilos de a - celda -	G G TIT - BAA BAA	Iminar Formato Celdas	► Autosuma a Rellenar ~ ∠ Borrar ~ H H	Ordenai y filtrar Modificar	Buscary selectionary
Per Elimin Comentario Control Methods Control Methods		E página Fórmulas S S A A S A S A S A S A S A S A S A S A	Datos Re Datos Re C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINSEP072010-vis visar Vista Alustar texto Alustar texto Alustar texto Alustar texto F General Combinary central Alustaria Alustaria F General Combinary central Combiner Central Incorea Incorea Incorea Costerno Cervibulica ne co	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000 % % % Número * *	- Microsoft Excel	to Estilos de a* celda* s.	G G G G G BAA BAA BAA BAA	TITULO BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA	∑ Autosuma	• Ar Ordenau y filtrar Modificar	Buscar y selectionar
Copial Comentario Copial Comentario Copial Comentario Copial Comentario Copial C		Epigina Fómulas I I I I I I I I I I I I I I I I I I I	Datos Ri Datos Ri Datos Ri Datos Ri Datos Ri Datos Ri Datos Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Datos Ri Ri Ri Ri Ri Ri Ri Ri Ri Ri	NEMOS-ISINSEP072010-uis visar Vista Ajustar texto Ajustar texto Alineación r Ferfacha anterior. , significa que en la operaci INCORA INCORA INCORA GOBIENNO REPUBLICA DE C GOBIENNO REPUBLICA DE C	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000 % % % Número * * tón estos pueden toma * toucomBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Estilos de a ceida - ss.	G G G G G G G G BAA BAA BAA BAA BAA BAA	TTTULO BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA	Autosuma Autosuma Relienar ~ Zeorrar ~ H RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIO	Ordenai y filtrar Modificar	Bussery Bussery
Inicio Inicio Inicio Inicio Copia		Epigina Fórmulas Santa A Santa A Sant	Datos Re E = = C =	NEMOS-ISINSEP072010-vis visar Vista Alineación c Field Combinary central • Alineación c Field Combinary central • Alineación c Field Combinary central • Field Combinary central • Field Combinery central • INCORA INCORA INCORA INCORA COBIENNO REPUBLICA DE C GOBIENNO REPUBLICA DE C INCORA	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000 % % % Número * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	- Microsoft Excel	to Estilos de * celda *	G BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO EONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA BONOS AGRA	X Autosuma Relienar → Z Borar → RIOS	Ordenai y filtrar Modificar	x · Busary · selectionar
Image: Second		Epigina Fórmulas Santa A Santa A Sant	Datos R Datos R Datos R D C D D D D D D D D D D D D D	NEMOS-ISINSEP072010-vis visar Vista Ajustar texto Ajustar texto Ajustar texto Combinary central Alineación INCORA INCORA INCORA INCORA INCORA INCORA	s [Modo de compatibilidad] General • \$ • % 000 % % % Número (> Companya (> Com	- Microsoft Excel	to Etilos de • celda •	G G G G G G G G BAA BAA BAA BAA BAA BAA	TITULO Ecidas Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran Enros Agran	X Autosuma Relienar → Z Borar → H H H RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS RIOS	Ordenau y filtrar Modificar	- o x @ - o x f Busery selectionar
Comentaria Coment		Página Fórmulas Fórmul	Datos R Datos R D C D D C D D C D D D D D D D D D D D D D	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Visar Vista Ajustar texto Ajustar texto Combinary centrar Alineadón E F fecha anterior. Softereno Revuestica De co Softereno Revuestica De co Softereno Revuestica De co INCORA	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000 % % % Número * tón estos pueden tom ColomBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilos de • celda •	G G TIT C BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	THULO Eddaz Eddaz Eddaz Ednos Agran Bonos Agran	X Autosuma Relienar → Z Borar → KIOS RIOS	Ordenau y filtrar ' Modificar	e a x e a a x f Busery selectionar
Inicia In		Página Fórmulas Sendar Senda	Datos R Datos R D C D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Viar Vista Viar Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central E Combinary central	s [Modo de compatibilidad] General * \$ * % 000 % % % Número * ColomBIA COLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilos de • celda •	G G G G G G BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA	TITULO Ecidas	X Autosuma Relienar - ∠ Borar - H H H RIOS RIO	Viteration of the second secon	- o x @ - o x f Busery selectionar
Image Image Image Contained Image Containe Image Cont		Página Fórmulas Sendar Senda	Datos R Datos R C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINSEP072010JIS Viar Vista Viar Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central E Combinary central	s (Modo de compatibilidad General • \$ • % 000] • * * * * * Número * * Sión estos pueden toma • CILOMEIA CILOMEIA	- Microsoft Excel	to Etilos de • celda •	G G G G G G G G G G G G G G G G G G G	TITULO Ecidas Ec	X Autosuma Rellenar * Autosuma Rellenar * Alos Rellenar * Rellenar	Ordenaa yfiltar Modificar	r Busary
Comentaria Comentaria		Página Fórmulas Sendar Senda	Datos R Datos R Datos R D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINSEP072010JIS Viar Vista Viar Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central Alucación E Combinary central E Combinary central	s (Modo de compatibilidad General • \$ • % 000] • * * * * * Número * * Sión estos pueden toma * CILOMEIA CILOMEIA	- Microsoft Excel	to Etilos de • ceida •	G G HII = G BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Ecidas Ec	X Autosuma Rellenar *	Yofenaar Yofittar Modificar	- o x @ - o x r Busory selectionar
Comentaria Comentaria	The second	Página Fórmulas Fórmul	Datos R Datos R Datos R D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Viar Vista Viar Combinary central Alucación Combinary central Alucación Combinary central Combinary central Combi	s (Modo de compatibilidad General • \$ • % 000] • & & % Número • • OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilos de • celda •	G G THT - G BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Ecidas Ec	X Autosuma Relienar * Autosuma Relienar * Alos Relienar * Relienar	Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z Z	- o x @ - o x F Buscry selectionar - IS
Comentaria Comentaria	Comparing the second sec	Página Fórmulas Página Fórmulas Página Fária A Para Para San A Para Para Para Para Para Para Para	Datos R Datos R Datos R C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Visia Vista Visia Combinary centrad Combinary centrad Combinary centrad Combinary centrad Combinery centrad Combinery centrad Combinery centrad Combinery centrad Combinery centrad Incora Combinery Incora Combinery Incora Combinery Incora Combinery	s [Modo de compatibilidad] General • \$ ~ % 000] * % % Número * OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilios de a · ceida ·	G G TIT = BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Ecidas Ec	X Autosuma Reiterar *	A Transformer Strengthered Stre	-
Comentaria Comentaria	Constant Dischool Constant Dischoo	Página Fórmulas Página Fórmulas Página Fármulas Página P	Datos R Datos R Datos R C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Vista Vista Ajusta texto Combinary centrate Alineación Ferrorent Incora Contacto Incora Cont	s [Modo de compatibilidad] General \$ ~ % 000] ~ % % % Número ~ ~ OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilios de a · ceida ·	G G TITI = BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Ecidas Envos Agra, Sonos Agra, Sono	X Autosuma Reiterar *	Ordenana y filtar a	-
Comparison of the second	The second	Página Fórmulas Página P	Datos R Datos R C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010JIS Vista Vista Ajusta texto Combinary centrate Alineación Ferrore Fecha ante que a la operación Ferrore Ferrore Incora A Incora A In	s [Modo de compatibilidad] General S ~ % 000] * % % Número ** OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilios de a · ceida ·	G Insettar E BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Ecidas Ec	X Autosuma Reiterar *	Ordenany y filter to ISIN 1	-
Comentaria Comentaria	Topological and a second	Página Fórmulas Página Fórmulas Página Fármulas Inc C	Datos R Datos R Datos R D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEP072010JIS visar Vista Vista Combinary central Aluceation Combinary central Combinary central Aluceation Combinery Ferfaceanterior. Fer	s [Modo de compatibilidad] General S ~ % 000] *08 *08 Número ** OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilios de a* ceida*	G Insettar E BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Edidas Bonos Agra Bonos Ag	X Autosuma X Autosuma Reiterar *	ZT Ordenary Modificar	-
Image Image Image Imagee Imagee Imagee	Topological and a second	Página Fórmulas Página Fórmulas Página Fármulas Inc C	Datos R Datos R Datos R D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010UIS Vista Vista Vista Combinary central Alineación Combinary central Combinery c	s [Modo de compatibilidad] General S % 000 % % % Número Colombia OLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etilios de a* ceida*	G Insettar E BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	THULO Iminiar Formato Iminiar Formato Edidas	X Autosuma X Autosuma Reitenar *	ZT Ordenary Hittara	-
Image Image Imagee Imagee Image<	Insertar Diseño de r Verdana r Verdana Verdana Verdana Verdana Verdana Se S	Página Eórmulas Página Eórmulas Inc Inc Inc Inc Inc Inc C Inc C Inc C Inc C Inc C C Inc C	Datos R Datos R Datos R D C C C C C C C C C C C C C	NEMOS-ISINGEPO72010UIS viviar Vista Vista Vista Vista Vista Combinary centracy Alineación Vista Combinery centracy Alineación Vista Combinery centracy Combinery centracy Alineación Vista Combinery centracy Combinery centracy Alineación Vista Combinery centracy Combine	s (Modo de compatibilidad) General S % 000 % % % Número CoLOMBIA OLOMBIA OLOMBIA	- Microsoft Excel	to Etillos de a• ceida •	G IIII G BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BAA BA	TITULO Edidas Enviso Agra Bonos A	Σ Autosuma Q Relifenar * Q Borrar * H H RIOS RIOS RAIOS SUBRIS	27 Ordenaria	-


C.,	1 4) =			NEMOS-ISINSEP072010	xls [Modo de compatibilida	d] - Mid	crosoft Excel			_ = X
	Inicio Insertar	Diseñ	io de página Fórmulas	Datos Revisar	Vista						🥑 – 🖷 X
Peg	Cortar	Verdana N K	• 8 • A * <u>S</u> • • <u>A</u> • Fuente	= = <mark>=</mark> ≫·· ■ = = 译 律 Aline	alion ar y centrar ↔	General ▼ \$ - % 000 *00 *00 Número 5	For condi	mato Dar formato Estilos de cional + como tabla + ceida + Estilos	Insertar Eliminar Formato Celdas	∑ Autosuma -	ar Buscary r* seleccionar* r
	C2506 -	0	f _x								*
1	A	В		С		D	E	F	G	Н	1
2 3 1007 1008 2490 2491 2492	NEMO NUEVO BODS1089A10 BODS108B10	EMI ODS ODS	EMISOR ORGANIZACION DE ORGANIZACION DE	INGENIERIA INTERNA INGENIERIA INTERNA	NIT CIONAL - ORGANIZACI CIONAL - ORGANIZACI	ON DE INGENIERIA IN E	IT - IOR IOR	TITULO BONOS ORDINARIOS BONOS ORDINARIOS	ISIN 1 - I COF11CB00028 COF11CB00036	SIN 2 · IS	IN 3
2493 2494 2495 2496 2497 2498				Filtrar la co regularmen	lumna NIT y verifi nte aparecen estas	car que solo haya i dos, se debe cam	núme piar a	ros, 0 (cero)			
2499 2500 2501 2502 2503											
2504 2505 2506 2507 2508 2509											
2510 2511 2512 2513 2514											
2515 2516 2517 2518 2519											
2520	Hoia1						_				*
Listo	Modo Filtrar							Control Contro		III I 100% (-)	- T (+)

		- (°I - []] ∓			NEMOS-ISINSE	P072010xls [Moc	lo de compatibi	lidad] - Microsoft Excel				_ = X
	Inicio	Insertar Diseño de pá	gina Fórmulas I	Datos Revisar	Vista							🕑 – 🖷 X
Desde Access	Desde Web Obt	Desde De otras texto fuentes - tener datos externos	s Actualizar todo + Conexiones	dades vínculos	denar Filtro	Borrar Volver a aplicar Avanzadas rar	Texto en Q columnas dup	uitar Validación Consolida licados de datos ~ Herramientas de datos	r Análisis Y si *	Agrupar Desagrupar S	Mostrar det ====================================	alle sile
	M3	▼ (? fx	PLAZO MAX									*
	J	к	L	M	N	C)	P		Q	R	S
1												
2 3 5	ERIE		PLAZO MINIMO		MONEDA	CUPON	-			SA ACTUAL	TASA B	PERIODICIDAD
1018 B		DVL	0	#N/A	COP		0	DTF	PREVIA		36	D SV
2490												
2492												
2494		Hacer lo mismo co	on la columna Pla	zo Max, filt	ar v verificar	que todos s	ean					
2495		numérico, si no lo	son cambiarlos r	nor 0 (cero)	ary vermea	que touos s						
2497			oon can bran oo p		_		_					
2499												
2500												
2502												
2503												
2505												
2507												
2508												
2510												
2512												
2513												
2515												
2516 2517												
2518												
2520												
14 4 +	H Ho	ja1 / 🕲 /		1				14	1			× 0
Listo	Se	encontraron 2 de 2486 registros	5	_					_		100	6 🕤 🗌 🕀



	(- L)	=		NE	MOS-ISINSEP072010xls	[Modo de compatibilidad] - Microsoft Excel						х
•	Inicio Insertar	Diseño de página	Fórmulas Dat	s Revisar Vi	ita								σx
Desde D Access	Desde Desde De o' Web texto fuent Obtener datos ex	rras es - Conexiones existentes ternos	ctualizar todo + Conexione Conexiones	s es ulos X Ordenar	Filtro	icar Texto en Quitar columnas duplicad Her	Validación Consolidar os de datos - ramientas de datos	Análisis Y si +	Agrupar Desagrup	ar Subtotal	Mostrar detaile Ocuitar detaile		
	AA4 🔫 (fx NO	APLICA										*
1	S	Т	U	V	W	Х	Y		Z	AA	AB	AC	4
3 PERIO	ODICIDAD -	REINVERSION	ESTADO - Curv	a Referencia	Amortizable -	FECHA EMISION	FECHA VTO	Método V	/aloración	CLASE -	TIPO TASA -		_
4 SV		NO	A		NO			PRECIO		NC APLICA	NOMINAL		
5 SV		NO	A		NO			PRECIO		NC APLICA	NOMINAL		
6 SV		NO	A		NO			PRECIO		NC APLICA	NOMINAL		
/ SV		NO	A		NO			PRECIO	-	NO APLICA	NOMINAL		_
8 SV		NO	A		NO		5	PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
9 SV		NO	A		NO			PRECIO	-	NO APLICA	NOMINAL		
10 50		NO	A		NO			PRECIO	*	NO APLICA	NOMINAL		
12 51		NO	A		In the second second	and a sector sectors	Class al same		data and an an	and the second	hinder and Ol	1	_
13 SV		NO	A		iguaimente su	cede en la columi	ha Clase, el campo	es num	ierico; ios no	aplica carr	ibiarios por u (cero)	
124 01		NO	A		NO			PRECIO		NO ARLICA	NOMINAL		
144 MV		NO	A		NO	09/07/2009	09/01/2011	PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
145 MV		NO	A		NO	07/09/2009	07/03/2011	PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
146 MV		NO	A		NO	16/07/2009	16/01/2011	PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
147 MV		NO	A		NO	15/02/2010	15/08/2011	PRECIO		NO APLICA	NOMINALO APLICA	N.	
148 MV		NO	A		NO	15/02/2010	15/02/2012	PRECIO		NO APLICA	NOMINALO APLICA		
149 MV		NO	A		NO	15/02/2010	15/02/2013	PRECIO		NO APLICA	NOMINALO APLICA		
239 SV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
272 OA		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
273 OV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
285 OA	-	NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
286 OV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
287 OA		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		_
288 0V 289 0A 290 0V	NOTA	: Finalizand	o los cambio	s por favor	guardarlos y	proceder a ca	argarlos por IS	INES e	en la aplic	ación PW	/PREI		
291 OA		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
292 OV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
293 OA		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
294 OV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
330 MV	-	NO	A	-	NO	25/03/2010	25/03/2013	PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
361 TV		NO	A		NO	AN 94		PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		
3/8 SV		NO	A		NO			PRECIO		NO APLICA	NOMINAL		*
H 4 P H	Hoja1	NO	1.		ier I		1	DBECIO		INO ADUTCA			
Listo	Se encontraron 1	65 de 2486 registros								(m)	100% 🕘	U	÷

Después que se han hecho las modificaciones, debe seleccionar en el lado izquierdo Archivo Excel y después seleccionar la ruta del archivo donde se encuentran el archivo ISINES.

🔤 Carga Actualizacion - I	sines 📃 🗖 🔀										
– Cargue Automático											
Archivo (*.txt) E:\Infoval\ISI	Archivo (*.txt) E:\Infoval\ISINES\NEMOS-ISINJUL092009.xls										
– Tipo de Carga											
Archivo Excel (.xls)	Espere un momento mientras se cargan los datos.										
•	Imprimir Errores Ver Nuevos Modificados La Cerrar										

Cuando se termina de cargar los datos los botones inferiores se habilitan; si se da clic en el botón Ver Nuevos muestra la siguiente pantalla, donde aparecen las especies nuevas que ha actualizado.



🔤 Carga Actualizacio	n - ISINES									
– Cargue Automático										
Archivo (*.txt) E:\Infova	INSINES/NEMOS-ISINJ	UL092009.xls								
– Tipo de Carga										
Archivo Excel (.xls)										
Contraction fraction										
Ni nevos										
Fila Nemo	Emisor	Nit	Tit	Titulo	lsin1					
329 BBCB3071B2	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000764					
330 BBCB3071B5	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000764					
331 BBCB3075I1	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000749					
540 BBCB307SA3	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000756					
703 BBCB3079C5	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000772					
704 BBCB3079C10	BCO. BANCOLOMBIA	890903938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS	COB07B000772					
				siz 🔿						
	👤 İmprimir	Ver	Ver Madifianda	Errores 🔊 Acepta	ar 🔽 Cerrar					
		Nuevos 🛌	Modificado:							

 Si se va a cargar Isines ANNA, debe seleccionar en el lado izquierdo Act. ISIN ANNA, buscar el archivo y presionar aceptar. El archivo de Isines ANNA viene listo para ser cargado por la aplicación.

2.3.4. ESPECIES ASOCIADAS

🛓 INFORMA	CION DE MERCAI	OO Y SOCIEDAD	- [Especie Asocia	1da]						BX
🐔 Archivo C	arga de Información	i Ventana								_ 8 ×
ji 🖓 🖗 🚺	3 🕷 🔗 🖉	-								
Especies	Especie	Emisión	Vencimiento	Modalidad	Reinversión	Moneda	Tasa Ref.	Spread	Cqp	
A 1999	BBVT10200115	20/01/2005	20/01/2015	AV	NO	COP	IPC	6.52	COMPLETO	BBAV1
	BCOS049B8V	11/03/2004	11/03/2014	TV	NO	COP	IPC	6.34	COMPLETO	BBAV3
	BEDA059A2V	18/05/2005	18/05/2012	TV	NO	COP	IPC	5.94	COMPLETO	BCHB1
ACCIDIN	BWWB105CV	24/02/2005	24/02/2008	TV	NO	COP	FS	10.37	COMPLETO	BFAN1
—	cdtbcb10d	11/08/2004	11/11/2007	TV	NO	COP	DTF	2.05	COMPLETO	CDTBC
Ponto Filo	CDTCLPS5V	01/06/1996	01/06/2006	AV	NO	COP	FS	7.59	COMPLETO	SCMT1
rienta rija	CDTIVCS0V	29/09/2006	29/09/2007	PV	NO	COP	FS	8.33	COMPLETO	CDTME
1000	cdtloc10	30/07/2004	12/08/2005	PV	NO	COP	DTF	1.74	COMPLETO	tbft10
TOTALE	CDTLOC10	06/08/2004	01/03/2005	PV	NO	COP	DTF	1.74	COMPLETO	TBFT1
ISINES	CDTLOYS0VD	30/11/2008	03/06/2009	PV	NO	COP	FS	10.85	COMPLETO	CDTLC
-	CDTLOY50VD	03/12/2008	03/06/2009	PV	NO	COP	FS	10.85	COMPLETO	CDTLC
	SBAVARIA9V	26/10/2004	26/10/2014	SV	NO	COP	IPC	7.5	COMPLETO	SBVT1
ESP. EQV. EX	SBVT10261014	26/10/2004	26/10/2014	SV	NO	COP	IPC	7.5	COMPLETO	SBAVA
	TIDISDVL02	22/06/2005	22/06/2006	NO	NO	COP	FS	0	COMPLETO	TIDISE
	TIDISDVL05	23/06/2005	23/06/2006	AV	NO	COP	FS	0	COMPLETO	TIDISE
Esp. Asoc										

En esta opción se asocian aquellas especies que no tienen un historial lo suficientemente largo con otras de características similares para realizar una adecuada medición del Var.

2.3.4.1. INGRESAR ESPECIES ASOCIADAS



nisor	Especie	Emisión Vencimiento				
	•	▼ 12/02/2002 ▼ 12/02/2002 ▼				
Modalidad de Pago d	le Intereses	Moneda CQP				
Modalidad	Periodicidad	-				
NO APLICA	▼ NO APLICA ▼					
-Modalidad Pago de F	Reinversión	Referencia				
Modalidad	Periodicidad					
NO APLICA	▼ NO APLICA ▼	Spread				
pecie Asociada	Especie	Emisión Vencimiento				
pecie Asociada nisor	Especie	Emisión Vencimiento				
pecie Asociada nisor Modalidad de Pago d	Especie Especie	Emisión Vencimiento 12/02/2002 I 12/02/2002 I Moneda CQP				
pecie Asociada nisor Modalidad de Pago d Modalidad	Especie	Emisión Vencimiento T2/02/2002 Moneda CQP T				
pecie Asociada nisor Modalidad de Pago d Modalidad NO APLICA	Especie Ele Intereses Periodicidad NO APLICA	Emisión Vencimiento I2/02/2002 I 12/02/2002 I Moneda CQP Tasa				
pecie Asociada hisor Modalidad de Pago d Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de F	Especie Se Intereses Periodicidad NO APLICA Reinversión	Emisión Vencimiento 12/02/2002 T 12/02/2002 T Moneda CQP Tasa Referencia				
pecie Asociada iisor Modalidad de Pago d Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de F Modalidad	Especie Especie eIntereses Periodicidad NO APLICA Reinversión Periodicidad	Emisión Vencimiento 12/02/2002 T 12/02/2002 T Moneda CQP Tasa Referencia				
pecie Asociada iisor Modalidad de Pago d Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de F Modalidad NO APLICA	Especie Especie Periodicidad NO APLICA Periodicidad NO APLICA NO APLICA	Emisión Vencimiento 12/02/2002 12/02/2002 Moneda CQP Tasa Referencia Snread				
pecie Asociada iisor Modalidad de Pago d Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de F Modalidad NO APLICA	Especie Periodicidad NO APLICA Periodicidad Periodicidad NO APLICA	Emisión Vencimiento 12/02/2002 12/02/2002 Moneda CQP Tasa Referencia Spread				

En esta opción digite la información de la especie asociada

2.3.4.2. BUSCAR ESPECIES ASOCIADAS

La información puede ser consultada seleccionando el Emisor, por especie, especie asociada o todos los registros.

🖻 Buscar Especie Asociada 🛛 🛛 🚺	ł
Buscar Por	1
Seleccione Emisor	
G Especie	
C Espeice Asociada	
C Todos los Registros	
Aceptar 🔀 Cerrar	



2.3.4.3. MODIFICAR ESPECIES ASOCIADAS

Para modificar un registro haga doble clic sobre el registro deseado o clic sobre el icono de modificar, solo podrá modificar aquellos campos que se encuentran habilitados.

Emisor	Especie	Emisión	Vencimiento
BAVARIA	BBVT10200115	20/01/20	05 💌 20/01/2015 💌
Modalidad de Pago de I	ntereses	Moneda	CQP
Modalidad	Periodicidad	COP	COMPLETO
ANUAL	VENCIDA V	Terre	
		lasa	
Modalidad Pago de Reir	nversión	Referencia	
Modalidad	Periodicidad	IPC	-
NO APLICA 🔄	NO APLICA		Spread 6.520
Emisor BAVARIA	Especie BBAV1049BV	Emisión 12/02/2	Vencimiento
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de II	Especie BBAV10498V	Emisión 12/02/2 Moneda	Vencimiento 2002 Vencimiento 12/05/2005 Vencimiento
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de II Modalidad	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad	Emisión T2/02/2 Moneda COP	Vencimiento 2002 12/05/2005 CQP COMPLETO
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de Ir Modalidad NO APLICA	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad	Emisión 12/02/2 Moneda COP Tasa	Vencimiento 2002 V 12/05/2005 V CQP COMPLETO V
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de la Modalidad NO APLICA	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad VENCIDA	Emisión 12/02/2 Moneda COP Tasa Referencia	Vencimiento 2002 V 12/05/2005 V COP COMPLETO V
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de lu Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de Reir Modalidad	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad Vencida versión Periodicidad	Emisión 12/02/2 Moneda COP Tasa Referencia IPC	Vencimiento 2002 V 12/05/2005 V COP COMPLETO V
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de Ir Modalidad NO APLICA Modalidad NO APLICA	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad VenciDA Versión Periodicidad NO APLICA	Emisión 12/02/2 Moneda COP Tasa Referencia IPC	Vencimiento 2002 V 12/05/2005 V COP COMPLETO V
Emisor BAVARIA Modalidad de Pago de la Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de Reir Modalidad NO APLICA	Especie BBAV1049BV ntereses Periodicidad VENCIDA Vencidad Periodicidad Periodicidad NO APLICA	Emisión 12/02/2 Moneda COP Tasa Referencia IPC	Vencimiento 2002 V 12/05/2005 V COP COMPLETO V Spread 0.000

2.3.4.4. ELIMINAR ESPECIES ASOCIADAS



misor	Especie	Emisión	Vencimiento
BAVARIA	BBVT10200115	20/01/2005	20/01/2015 💌
- Modalidad de Pago de Inter	eses	Moneda	CQP
Modalidad	Periodicidad	COP	COMPLETO
ANUAL	VENCIDA	– Tasa	
– Modalidad Pago de Reinve	rsión	Referencia	
Modalidad	Periodicidad	IPC	T
NO APLICA 📃	PWPREI - INF. DE MERCAI	DO Y SOCIEDAD 🛛	ead 6.520
specie Asociada	Esta Seguro de Elim	inar el Registro ?	
misor	•		Vencimiento
JAVARIA	Sí	No	12/05/2005 💌
- Modalidad de Pago de Inter	eses	Moneda	
Modalidad	Periodicidad	COP	COMPLETO
NO APLICA 📃	VENCIDA		
	.,		
- Modalidad Pago de Reinve	Deviation de	Referencia	
		S	pread 0.000

Para eliminar escoja el registro y haga clic sobre el Icono de eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.3.4.5. DETALLE ESPECIES ASOCIADAS



	Especie	Emisión	Vencimiento
AVARIA	BBVT10200115	20/01/2	2005 🔽 20/01/2015 💌
- Modalidad de Pago de Int	ereses	Moneda	CQP
Modalidad	Periodicidad	COP	COMPLETO
ANUAL	VENCIDA 👤	Tasa	
Modalidad Pago de Beinv	versión	Beferencia	
Modalidad i ago de meinv	Periodicidad	IPC	-
NO APLICA	NO APLICA		Sprood 6 520
,			spieau jo.szo
AVARIA	BBAV1049BV	12/02	/2002 12/05/2005
		Moneda	LUP
-Modalidad de Pago de Int Modalidad	Periodicidad		
-Modalidad de Pago de Int Modalidad NO APLICA	Periodicidad VENCIDA		COMPLETO
Modalidad de Pago de Int Modalidad NO APLICA	Periodicidad VENCIDA	COP Tasa Referencia	COMPLETO
Modalidad de Pago de Int Modalidad NO APLICA	Periodicidad VENCIDA rersión Periodicidad	Tasa Referencia	COMPLETO
Modalidad de Pago de Int Modalidad NO APLICA Modalidad Pago de Reinv Modalidad NO APLICA	Periodicidad VENCIDA resión Periodicidad NO APLICA VENCIDA	Tasa Referencia	COMPLETO

Esta opción se utiliza a manera de información.

2.3.4.6. EXPORTAR A EXCEL ESPECIES ASOCIADAS

Con esta opción puede cargar la información, para ser manejada en Excel

2.3.5. ESPECIES EQUIVALENTES

En esta opción sirve para indicar al sistema que una especie es similar a la otra desde el punto de vista riesgo y que sirve como cobertura, el sistema netea las posiciones en especies equivalentes.



🛓 INFORMAC	CION DE MERCAD	O Y SOCIEDAD -	Especie Equivale	nte						ъ×
	arga de Información	Ventana							-	. 🗗 🗙
🗾 🗞 🔔 🧕	Y 💐 🗞 🖉	الله 刘								
Especies	Especie	Emisión	Vencimiento	Modalidad	Reinversión	Moneda	Tasa Ref.	Spread	Cqp	
Acc/Divi	TBFC05140307	14/03/2002	14/03/2007	AV	NO	COP	FS	15	CUPON	TBFC0
Eenta Fija										
15INES										
Esp. Eqv. Ext										
Esp. Asoc										
Esp. Eqv.										

2.3.5.1. INGRESAR ESPECIES EQUIVALENTES

En esta opción ingrese la información de la especie equivalente.

Especie Equivalente - Ingresar	
Emisor Especie	Emisión Vencimiento
	▼ 12/02/2002 ▼ 12/02/2002 ▼
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Moneda CQP Tasa Pafaranaia
Modalidad Pago de Reinversion Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Spread
Especie Equivalente Emisor Especie	Emisión Vencimiento
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad	Moneda CQP
NO APLICA VINO APLICA	Tasa
Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Referencia
	Aceptar 🔀 Cerrar

2.3.5.2. MODIFICAR ESPECIES EQUIVALENTES



Emisor	Especie	Emis	sión	Vend	cimiento	_
GUBIERNU NACIUNAL	▼ 18FC05140307	· 114/	0372002	<u> </u>	0372007	<u> </u>
Modalidad de Pago de Intere	eses	Moneda		CQP		
Modalidad	Periodicidad	COP	•	CUPON	1	-
ANUAL	VENCIDA 🔹	– Tasa––––				
_ ⊢Modalidad Pago de Reinver	sión	Referenc	ia			
Modalidad	Periodicidad	FS				-
NO APLICA 🔹	NO APLICA	11	Spre	ad 15.0	100	_
L'	·		Spie	au prote		
specie Equivalente Emisor GDBIERNIN NACIONAL	Especie	En	nisión 2/08/2001	Ver	ncimiento	-
Especie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intere	Especie TBFC06220807 eses	En 2 Moneda	nisión 2/08/2001	Ver	ncimiento 2/08/2007	Y
Especie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intere Modalidad	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad	En 2: Moneda PESO	nisión 2/08/2001	Ver 22 CQP CUPON	ncimiento 2/08/2007	Y
Especie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intero Modalidad ANUAL	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad VENCIDA	En 22 Moneda PESO	nisión 2/08/2001	Ver 22 CQP CUPON	ncimiento 2/08/2007	Y
Especie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intero Modalidad ANUAL Modalidad Pago de Reinver:	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad VENCIDA	En Zi Moneda PESO Tasa Reference	nisión 2/08/2001	Ver 22 CQP CUPON	ncimiento 2/08/2007	V
Especie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intero Modalidad ANUAL Modalidad Pago de Reinvers Modalidad	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad VENCIDA	En 2 Moneda PESO Tasa Referenc FS	nisión 2/08/2001 ia	Ver 22 CQP CUPON	ncimiento 2/08/2007	<
Specie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Intero Modalidad ANUAL Modalidad Pago de Reinver Modalidad NO APLICA	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad VENCIDA Sión Periodicidad NO APLICA	En Voneda PESO Tasa Reference FS	nisión 2/08/2001 	Ver 22 CQP CUPON Sad 15.0	ncimiento 2/08/2007 1	T T
Specie Equivalente Emisor GOBIERNO NACIONAL Modalidad de Pago de Interd Modalidad ANUAL Modalidad Pago de Reinvers Modalidad NO APLICA	Especie TBFC06220807 eses Periodicidad VENCIDA	En Z Moneda PESO Tasa Reference FS	nisión 2/08/2001 	Ver 22 CQP CUPON sad 15.0	ncimiento 2708/2007 4	

Para modificar haga doble clic sobre el registro, o seleccione el botón ubicado en la parte superior, solo puede modificar aquellos campos que se encuentren habilitados.

2.3.5.3. BUSCAR ESPECIES EQUIVALENTES

🖻 Buscar Especie Equivalente 🛛 🛛 🗙
Buscar Por
Seleccione Emisor
Especie
C Espeice Asociada
O Todos los Registros
Aceptar 🔀 Cerrar

La información relacionada con especies equivalentes, se puede consultar seleccionando el emisor, la especie ó la especie equivalente.

2.3.5.4. ELIMINAR ESPECIES EQUIVALENTES



	Especie	Emisión	Vencimiento
GUBIERNU NACIUNAL	TBFC05140307	14/03/2002	▼]14/03/2007 ▼
⊢ Modalidad de Pago de Inte	reses	Moneda	CQP
Modalidad	Periodicidad	COP	🔽 CUPON 📃
ANUAL	VENCIDA 🗾	- Tasa	
⊢ ⊢ Modalidad Pago de Beinve	rsión	Beferencia	
Modalidad	Periodicidad	FS	
NO APLICA			Ja [15,000
	PWPREI - INF. DE MERC	ADU Y SUCIEDAD	
	9		
specie Equivalente	Esta Seguro de El	liminar el Registro ?	Vencimiento
			22/08/2007
	Sí	No	
Modalidad de Pago de Inte	re		
Modalidad	Periodicidad	ICOP	CUPON 🔽
ANUAL	VENCIDA 🔽	- Tasa	
	rsión	Referencia	
– Modalidad Pago de Reinve	1901		
– Modalidad Pago de Reinve Modalidad	Periodicidad	FS	_
Modalidad Pago de Reinve Modalidad	Periodicidad	FS	road 15.000
Modalidad Pago de Reinve Modalidad NO APLICA	Periodicidad	FS Sp	read 15.000

Para eliminar información como en las opciones anteriores, escoja el registro deseado y el sistema le pedirá reconfirmar.

2.3.6. ISIN ANNA

🖶 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Isin ANNA]										
🔂 Archivo Carga de Información Ventana										
🖆 🍠 🖏 👼 🌾 \mid 🗞 🛯 🔌										
Especies	Especie	Emisor	Titulo	Serie	Ano	IsinANNA	Descripcion	FechaExpedicion	FechaVencimientc	TipoTasa
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00081	CARTERA COLECTIVA ES	20/04/2010	21/06/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00065	CARTERA COLECTIVA ES	23/04/2010	22/06/2010	SIN RENDIMIENTO
Acc/Divi	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00073	CARTERA COLECTIVA ES	26/04/2010	25/06/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00107	CARTERA COLECTIVA ES	10/05/2010	09/07/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00099	CARTERA COLECTIVA ES	14/05/2010	13/07/2010	SIN RENDIMIENTO
Benta Eija	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00123	CARTERA COLECTIVA ES	31/05/2010	30/07/2010	SIN RENDIMIENTO
i i cinta i ija	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00164	CARTERA COLECTIVA ES	01/06/2010	02/08/2010	SIN RENDIMIENTO
1 100 C	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00131	CARTERA COLECTIVA ES	10/06/2010	09/08/2010	SIN RENDIMIENTO
ISINES	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00198	CARTERA COLECTIVA ES	15/06/2010	17/08/2010	SIN RENDIMIENTO
ionite's	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00149	CARTERA COLECTIVA ES	18/06/2010	17/08/2010	SIN RENDIMIENTO
…	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00180	CARTERA COLECTIVA ES	21/06/2010	20/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00156	CARTERA COLECTIVA ES	28/06/2010	27/08/2010	SIN RENDIMIENTO
Esp. Eqv. Ext	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00172	CARTERA COLECTIVA ES	06/07/2010	06/09/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00214	CARTERA COLECTIVA ES	13/07/2010	13/09/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGR060	COR98	PT	TP0GRALF0001	GRAL	COR98PT00206	CARTERA COLECTIVA ES	23/07/2010	21/09/2010	SIN RENDIMIENTO
Esp. Asoc										
Esp. Eqv.										



2.3.6.1. INGRESAR ISIN ANNA

🖻 Isines ANNA - Ingresar
Datos
Isin ANNA Especie Emisor
Título Serie Año Emisión
Descripción
Fecha Expedición 10/09/2010 💽 Fecha Vencimiento 10/09/2010 💽 Tipo Tasa
Periodicidad Valor Tasa
Tasa Referencia Vigencia Inicial Vigencia Final Vigencia Final
Spread Calendario Moneda Deposito 🗨
Código CFI Tipo Registro Código Super
Aceptar Cerrar

Isin ANNA: Código asignado por la Agencia Numeradora Nacional

Emisor: Código asignado del emisor

Especie: Código de la Especie

Titulo: Tipo de titulo asignado por

Metodología ANNA

Serie: Serie de la emisión en la cual fue

emitido el titulo

Descripción: Descripción del Isin

Fecha de Expedición: Fecha de emisión del Titulo

Fecha Vencimiento: Fecha de vencimiento del Titulo

Tipo Tasa: Identifica el tipo de tasa con la que fue emitido el titulo (Fija, variable simple, variable compuesta, Acciones, Sin rendimientos)

Periodicidad: Corresponde a los periodos de vencimiento de pagos del título (Al plazo, Mensual, Bimensual, Trimensual, Cuatrimestral, Semestral, Anual, Sin Periodicidad)

Modalidad: Describe si el pago de titulo es Anticipado o Vencido.

Tasa Referencia: Identifica el tipo de tasa con la que fue emitido el titulo **Vigencia Inicial:** Periodo de tiempo Inicial en el cual se pagan intereses de un titulo.

Vigencia Final: Periodo de tiempo final, en el cual se pagan intereses de



un titulo **Spread:** Puntos que se adicionan a la tasa para el pago de rendimientos **Calendario:** Base calculo intereses equivalentes **Deposito:** Código del depósito origen del titulo **Código CFI:** Código Financiero Internacional **Tipo de Registro:** Tipo de registro (Nuevo, Modificado, Inactivo)

2.3.6.2. MODIFICAR ISIN ANNA

Para Modificar un Isin ANNA debe presionar el botón modificar o dar doble clic sobre el registro que desea modificar y aparecerá la siguiente pantalla.

Isines ANN	IA - Modificar					
Datos						
Isin ANNA	C0A36PA00012	Especie	AGROCHAL	Emisor	COA36	
T ítulo	PA	Serie	AOOG	Año Emisión	GRAL	
Descripción	ACCIONES ORDINARIAS	ò				
Fecha Expedic	xión 05/06/2010 💌	Fecha Venc	imiento 30/11/1999	🖵 Tipo Tasa	ACCIONES	•
Periodicidad	AL PLAZO	Modalidad	SIN MODALIDAD	📕 Valor Tasa	0	
Tasa Referenc	sia FS 💌	Vigencia Inic	sial 99	Vigencia Fin	al 99	
Spread 0	Calendario 360	· –	Moneda COP	– D	eposito DVL	•
Código CFI 🛛	ESVUFR 1	lipo Registro	NUEVO 👻	Código Super	0A36PAA0005	
	A 🔊	ceptar		Cerrar		

Puede modificar todos los campos menos el Isin ANNA



2.3.6.3. BUSCAR ISIN ANNA

🛢 Buscar Isin ANNA	
Buscar Por	
_	Especie
	C Todos los Registros
Aceptar	Cerrar

La consulta se puede hacer por especie o todos los registros.

2.3.6.4. ELIMINAR ISIN ANNA

Para eliminar debe presionar el botón Eliminar, luego aceptar y aparecerá la siguiente pantalla

🛱 Isines ANN/	A - Eliminar				_ 🗆 🛛
Datos					
Isin ANNA	COA36PA00012	Especie	AGROCHAL	Emisor	COA36
Título	PA	Serie	AOOG	Año Emisión	GRAL
Descripción	ACCIONES OR	PWPREI - INF. DE	E MERCADO Y SOC	IEDAD 🔀	
Fecha Expedici	ión 05/06/20	🕐 Esta Segu	uro de Eliminar el Regis	stro? asa	ACCIONES
Periodicidad	AL PLAZO	Sí	No	1 Tasa	0
Tasa Referenci	a FS			ia Fin	al 99
Spread 0	Calenda	ario 360 💌	Moneda COP	De De	eposito DVL
Código CFI E	SVUFR	Tipo Registro	NUEVO	Código Super 🕞	0A36PAA0005
	•	Aceptar		X	



2.4. OPCIÓN HISTORICO DE MERCADO.



Se refiere a la Información Histórica del Mercado distinta de INFOVALMER.

2.4.1. PRECIO ALTERNA RF



Precios Históricos de Renta Fija diferente al de Infoval.



2.4.1.1. BUSCAR PRECIO ALTERNA RF

🦻 Buscar Precios Alterna RF
Buscar Por
08/07/2009 💌 🗖 Fecha
Seleccione Emisor
Especie
08/07/2005 💌 08/07/2005 💌 🗖 Intervalos de Fecha
Todos los Registros
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
Aceptar 🔟 Cerrar

Para consular información de los precios de títulos de renta fija, obtenga la información a partir de una fecha dada, seleccionando el emisor, la especie, puede utilizar intervalos de fecha determinados o solicitar todos los registros.

2.4.1.2. INGRESAR PRECIO ALTERNA RF

Información alterna de Renta Fija donde puede registrar manualmente la información de precios, en caso de no ser cargada automáticamente por el Sistema.

Precios Alterna RF - Ingresar				
Fecha Registro 05/07/2009 V Emisor Especie V	Completo/Cupon/Principal Fecha Emision 08/07/2009 Fecha Vencimiento 08/07/2009			
- Modalidad de Intereses Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V	Modalidad de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA NO APLICA			
Moneda TasaRef Spread Dias al Vencimiento Valor Moneda Duracion O	Seleccione ^O Precio Sucio Promedio 0 ^O Precio Limpio Promedio 0 ^O Tasa Promedio Precio Inicio ^O Precio Cierre ^O Precio Máximo ^O Precio Mínimo ^O			
Aceptar 🔀 Cerrar				



2.4.1.3. MODIFICAR PRECIO ALTERNA RF

La opción de modificar solo permite cambiar la información relacionada con los precios de Inicio, Cierre, Máximo y Mínimo.

Precios Alterna RF - Modificar	
Fecha Registro 26/04/2004 V Emisor Especie BBCB1041AV V	Completo/Cupon/Principal COMPLETO Fecha Emision 11/02/2004 Fecha Vencimiento 11/08/2005
– Modalidad de Intereses	Modalidad de Reinversión
Modalidad Periodicidad TRIMESTRAL VENCIDA	Modalidad Periodicidad
	Seleccione
Moneda PESO 💌	100 C Precio Sucio Promedio
TasaRef DTF	98,5061853750374 O Precio Limpio Promedio
Spread 0	8,84412590980804 C Tasa Promedio
Dias al Vencimiento 472	Precio Inicio
Valor Moneda 1	Precio Cierre 102.262
Duracion	Precio Máximo 102,314
	Precio Mínimo
	Aceptar 🔀 Cerrar

2.4.1.4. ELIMINAR PRECIOS ALTERNA RF

Se debe tener cuidado al eliminar este tipo de información, ya que puede afectar al momento de valorar un título.

2.4.1.5. DETALLE PRECIOS ALTERNA RF

Esta opción permite verificar la información a manera de consulta no puede ser modificada.

2.4.1.6. CARGA DATOS DE PRECIOS ALTERNA RF



🚢 Carga de Datos - Precios Alterna RF	
Cargue Automático Archivo (*.txt)	
Tipo de Carga MEC Excel	
e Im Er	orimir 🚈 Errores 🔊 Aceptar 💟 Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.4.1.7. EXPORTAR A EXCEL

La información de precios que se encuentra almacenada en el sistema puede ser bajada a Excel para posteriores informes.

2.4.2. PRECIOS DE ACCIONES

🛓 INFORMAC	INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Precios Acciones]								
👹 Archivo Carga de Información Ventana									
Ŋ. D. ₫	🗾 鹷 🖉 🖪								
Historico Medo	Fecha	Especie	Bursatilidad	Precio	Liquidez				
	10/08/2009	AGROCHAL	NINGUNA	222.16	BAJA				
	10/08/2009	BBVACOL	BAJA	117.63	BAJA				
	10/08/2009	BCOLOMBIA	ALTA	17162.75	ALTA				
Precio	10/08/2009	BELLSOUTH	NINGUNA	2055.73	BAJA				
Alterna RF	10/08/2009	BNA	ALTA	2273.66	ALTA				
	10/08/2009	BOGOTA	MEDIA	30015.67	ALTA				
	10/08/2009	BRIO	NINGUNA	366	BAJA				
Precios	10/08/2009	BVC	ALTA	26.86	ALTA				
Acciones	10/08/2009	CARACOLTV	NINGUNA	691.57	BAJA				
	10/08/2009	CARTON	BAJA	12636.18	BAJA				
17	10/08/2009	CEMARGOS	ALTA	9105.38	ALTA				
	10/08/2009	CHOCOLATES	ALTA	18604.32	ALTA				

Precios Históricos de Acciones y Divisas diferentes al de Infoval.

- 1. Se agrega el concepto de liquidez en los datos de los precios de las acciones.
- 2. Al procesar el archivo publicado por la BVC se cargará también el indicador de liquidez de cada acción.
- 3. El mantenedor de precios de acciones permite registrar la liquidez de la acción.
- 4. Igualmente se agrega este dato en la carga por Excel.

2.4.2.1. INGRESAR PRECIOS DE ACCIONES



Para ingresar información de una acción registre la Fecha de ingreso, la especie, la bursatilidad y el precio.

🗱 Precios Acciones - Ingresar 📃 🗖 🖡				
Ingresar Datos Fecha 1000/07/2009 V Especie V Bursatilidad V Precio				
Aceptar 🔀 Cerrar				

2.4.2.2. MODIFICAR PRECIOS DE ACCIONES

K	Precios Accio	ones - Modificar	
	- Ingresar Datos- Fecha	07/07/2009 💌	
	Especie	AGROCHAL	
	Bursatilidad	NINGUNA	
	Precio	222.16	
	Act	eptar 🔀 Cerrar	

Al momento de modificar, solo puede cambiar la bursatilidad y el precio, en caso de requerir cambiar la especie, debe eliminar el registro.

2.4.2.3. BUSCAR PRECIOS DE ACCIONES

Para consultar información sobre precio de acciones, puede hacerlo por fecha, Especie, Bursatilidad, Intervalo de Fechas ó por Todos los registros.



P Buscar Precio Acciones	X
Buscar Por	
08/07/2009 🔽 🗖	Fecha
_	Especie
	Bursatilidad
08/07/2005 🔽 08/07/2005 🔽 🗖	Intervalo de Fechas
Г	Todos los Registros
Acepi	tar 🔀 Cerrar

2.4.2.4. ELIMINAR PRECIOS DE ACCIONES

Para eliminar un registro haga clic en el botón de eliminar, posteriormente el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.4.2.5. CARGA DATOS DE LOS PRECIOS DE ACCIONES

🚉 Carga de Datos - Precios Acciones	
Cargue Automático Archivo	
Tipo de Carga Tipo de Carga	
C Archivo Plano (*.txt)	
◯ Archivo Excel (*.xls)	
C Vista	
	Imprimir 🚈 Errores 🚽 Errores 🕡 Aceptar 💟 Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.4.2.6. CARGA PRECIOS DE ACCIONES VECTOR INTERNACIONAL

 Después de creadas las especies ingresar al módulo Mercado y Sociedad, presionar el botón Precio Acciones, luego el botón cargar:



INFORMAC	ION DE MERCADO Y SOC	CIEDAD - [Precios Accion	nes]							
Archivo	Carga de Información	Ventana								_ 6 ×
DIBIE										
·3 60 11		Incore	(provided)	Decede	(Income of the second					
Historico Medo	neura	cspecie	bursauldad	Predo	Liquidez					<u> </u>
	20/05/2013	AAPL	BAJA	010130.3	DAJA					
	20/05/2013	ADA	DAJA	34184.4	DAJA DAJA					
Precio	20/05/2013	AGROCHAL	DATA	403.10	DAJA					
Alterna BF	20/05/2013	AUTU I	DAJA DAJA	402122 20	DAJA DAJA					
	20/05/2013	ANDINA P	DAJA DAJA	11975 2	DAJA DAJA	-				
9 1 2	20/05/2013	ARC	BAJA	168000.4	BA1A					
	20/05/2013	BAC	BAIA	24893 3	BA1A					
Precios	20/05/2013	BANMEDICA		2 10 3 3 3						
Accortes	20/05/2013	BBVACOL	😫 Carga de Datos - Prec	ios Acciones				×		
17	20/05/2013	BCOLOMBIA								
E	20/05/2013	BIOMAX	Cargue Automático							
Festivos	20/05/2013	BMC								
	20/05/2013	BOGOTA	Archivo							
	20/05/2013	BSANTANDER								
Denosto	20/05/2013	BVC	Tipo de Carga							
	20/05/2013	С								
	20/05/2013	CARACOLTV								
	20/05/2013	CARTON	C INFOVAL @ Acc	ciones Internacionales - For	nato Local					
Mercado	20/05/2013	CAT								
Malaraa da	20/05/2013	CCU	C Archivo Plano (*.txt)							
values de	20/05/2013	CELSIA	C Archivo Excel (*.xls)							
Especies	20/05/2013	CEMARGOS	C.V.							
Negocios	20/05/2013	CENCOSUD	(Vista							
Regocios	20/05/2013	CHILE								
INFOVAL	20/05/2013	CL				Imprime				
Valores Super	20/05/2013	CLH				Errores - Errores	Aceptar	Cerrar		
	20/05/2013	CNEC						_		
Forwards/Upc.	20/05/2013	COLIEJER	Americana.	712.0	0.4.34					
Salir	20/05/2015	CONCIVILES	MEDIA	/12.8	ALTA					
	20/05/2013	CONCONCRET	MEDIA	129	ALIA RA1A					
	20/05/2013	CODEC	ININGUNA Data	0.5	DAJA DAJA					
	20/05/2013	COPEC	MINIMA	25418.20	BA1A					
	20/05/2013	CORETCOLCE	ALTA	1933.0	ALTA					
	20/05/2013	CVX	BAIA	220018 3	RATA					
	20/05/2013	DESCALICANO	NINCLINA	5483.1	RA1A					
	20/05/2013	ECOPETROL	ΔΙΤΔ	399	ALTA					-
	Begistro[s] 134	teres attrack								
	Linkene(e) i e.t.									

Para cargar estos archivos debe seleccionar la opción Acciones Internacionales -Formato Local, buscar el archivo por ejemplo MX061013_RV_FormatoLocal.txt y seleccionar Aceptar.

Si el archivo no se carga correctamente el botón de errores se habilitara

2.4.2.7. EXPORTAR A EXCEL.

La información de precios de acciones puede ser utilizada para construir diferentes informes.

2.4.3. FESTIVOS

Se deben especificar los días festivos del Año





2.4.3.1. BUSCAR FESTIVOS

🏴 Buscar Festivo 🛛 🛛 🔀
Buscar Por
Fecha 📴/07/2009 💌
Todos los Registros
Aceptar 🔀 Cerrar

La información de festivos se puede consultar por fecha o por todos los registros, una vez se consulta la información se activan los botones de Eliminar, Detalle, Carga de Datos, Exportar a Excel.

2.4.3.2. INGRESAR FESTIVOS

La información de festivos puede ser capturada manualmente, por medio de esta opción.



2.4.3.3. ELIMINAR FESTIVOS



Los días festivos pueden ser eliminados dando doble en la grilla o seleccionando el botón de eliminar.



2.4.3.4. DETALLE DE FESTIVOS



Esta opción permite ver la información de festivos, no permite modificar.

2.4.3.5. CARGAR DATOS DE FESTIVOS

Los datos de festivos pueden ser cargados por un archivo plano o un archivo en Excel. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto

2.2.1.1.6 tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

🚢 Carga de Datos - Festivo					×
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	Cerrar	

2.4.3.6. EXPORTAR A EXCEL FESTIVOS

La información de los días festivos, puede ser manejada en Excel para diversos informes.

2.4.4. **DEPOSITOS**



🚉 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Depósitos]					
🛃 Archivo Carga de Información Ventana					
📕 🗞 🚨 🧵	Y 💐 🗞) 🖉 🔍			
Historico Medo	Deposito	Descripcion	Nit		
	DC	DEPOSITO DCV			
	DCV	DEPOSITO DCV			
	DV	DECEVAL			
Precio	DVL	DECEVAL			
Alterna HF	EX	EXTRA			
COM	FISICO	FISICO			
I 💓 I	NINGUN	NINGUN DEPOSITO			
Precios	OTRO	OTROS DEPOSITOS			
Acciones					
Festivos					
Depósito					

Se definen los depósitos de Valores

2.4.4.1. INGRESAR DEPOSITOS

🖪 Depósito -	Ingresar		×
_ Ingresar Datos			
Nit			
Deposito			
Descripción			
	Aceptar	Cerrar	

2.4.4.2. MODIFICAR DEPOSITOS

Solo se puede modificar la descripción, en caso de querer modificar otro parámetro se debe eliminar el registro y volver a ingresar.



🖪 Depósito -	Modificar		X
☐ Ingresar Dato:	3		
Nit			
Deposito	DVL		
Descripción	DECEVAL		
			Ξ.
	Aceptar	Cerrar	

2.4.4.1. ELIMINAR DEPOSITOS

Cuando se da clic en eliminar un registro, la aplicación pregunta si esta seguro de la Eliminación, como muestra la imagen

	Depósito - Eliminar 🛛 🛛 🗙					
Γ						
	PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD					
	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?					
	Sí No					
	Aceptar 🗵 Cerrar					

2.4.4.1. DETALLE DE DEPOSITOS

El botón Detalle es solo para información ya que no tiene contacto con el registro solo puede ver la información.

🖪 Depósito -	Detalle	×
Ingresar Dato:	3	
Nit		
Deposito	DVL	
Descripción	DECEVAL	
	Cerrar	



2.4.5. CUSTODIOS



2.5. OPCION NEGOCIOS



Esta opción corresponde al botón de color azul, dentro de cada una de ellas se encuentran los sub-menús del módulo de carga. En esta opción se podrá cargar la información de los negocios de la compañía del sistema BackOffice.



2.5.1. **BENEFICIARIOS**

En esta opción se podrán visualizar los clientes o beneficiarios cargados a la base de datos del sistema. Esta información también se podrá Ingresar manualmente así como cargar mediante archivos planos, se podrá modificar, eliminar, visualizar en detalle la información y utilizar la información para ser cargada a Excel y obtener diversos informes.

🛓 INFORMAC	ION DE MERCA	DO Y SOCIEDAD - [Beneficiarios]				
🔂 Archivo Ca	🔂 Archivo Carga de Información Ventana					
🔊 💫 🖉	P 😼 🎘 🖉 🏽 🔗 🖉 💷					
Negocios	Identificación	Apellidos y Nombres y/o Razón Social				
	13	AMANDA				
	8903229051	ASVALORES S.A. COMISIONISTA DE BOLSA				
Benefic	CLIMAR1	CLIENTE DE MARGEN 01				
benenc.	CLIMAR2	CLIENTE DE MARGEN 02				
	777777777777777777777777777777777777777	FGGGGGGFG				
	888	FONDO 1				
Acciones	30391341	Jaqueline Toro Villarreal				
	0001	Jota				
	0004	JT1				
Renta Fija	11	JUAN				
	12	ΜΔΡΙΔ				

2.5.1.1. BUSCAR BENEFICIARIOS

🐐 Buscar Clientes 🛛 🛛 🚺	
Buscar Por	1
Identificación	
Todos los Registros	
Aceptar 🗵 Cerrar	

2.5.1.2. INGRESAR BENEFICIARIOS

Se debe ingresar la identificación, el tipo de ID y el nombre.



🐞 Beneficiarios - Ingresar 💦 🔀
Identificación
ļ
Tipo ID
CEDULA DE CIUDADANIA
Nombre
🔬 Aceptar 🛛 Cerrar

2.5.1.3. MODIFICAR BENEFICIARIOS

🐐 Beneficiarios - Modificar 🛛 🔀
Identificación
800073493
Tipo ID
N
Nombre
ACCIONES DE COLOMBIA S.A.
Completion of A DE DOE
1
Aceptar 🔀 Cerrar

Como se ve en la imagen solo se puede modificar el Nombre de la Empresa, si se quiere modificar el NIT se debe eliminar el registro completamente.

2.5.1.4. ELIMINAR BENEFICIARIOS

Cuando se presiona el Botón Eliminar sobre cualquier registro la Aplicación pregunta si esta seguro de realizar la eliminación.



	🍓 Beneficiarios - Eliminar 🛛 🔀				
	Nit				
PW	PREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	\times			
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?					
	Sí No				
	Aceptar 🛛 Cerrar				

2.5.1.5. DETALLE DE BENEFICIARIOS

El detalle muestra la información del Beneficiario sin opción de Modificar o Eliminar.

🐐 Beneficiarios - De	etalle 🛛 🔀
Identificación	
80808080	
Tipo ID	
C	v
Nombre	
MARIA GONZALEZ	
	Cerrar

2.5.1.6. CARGA DE DATOS DE BENEFICIARIOS

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



🛓 Carga de Datos - Nit					
Cargue Automático Archivo (*.txt)					i i
Tipo de Carga C Alterna Normal INFOVAL Excel Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

2.5.1.7. EXPORTAR A EXCEL BENEFICIARIOS

El sistema permite exportar los beneficiarios a Excel, presionando el botón Exportar.

2.5.2. NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE



Al dar clic en esta opción aparecer la pantalla anteriormente mostrada en la cual se podrá visualizar la información respectiva a los negocios de renta variable que se hayan cargado.

2.5.2.1. INGRESAR NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en la opción de Ingresar aparecerá la pantalla mostrada anteriormente y en la cual se deberá registrar todos los datos que ahí se piden. El campo monto no se ingresa ya que este se calcula automáticamente. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar.



🍄 Negocios/Renta Variab	le - Ingresar			×
Fecha DE/07/2009 Seleccione Emisor Especie Oficina Depósito	3 V V Número		Beneficiarios	v v
Negocio Número Nro. Fracción Línea Corredor	• •	Precio Cantidad Monto	0.000 0.00000000 000.00	
			Aceptar [Cerrar

2.5.2.2. MODIFICAR NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en la opción de Modificar aparecerá la pantalla mostrada a continuación y en la cual se podrán modificar los datos deseados a excepción de la fecha de registro, el número del negocio y la línea de negocio adjudicados. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar para proceder a la modificación, de lo contrario clic en Cerrar.

2.5.2.3. BUSCAR NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

🆻 Buscar Negocios/Renta Variable 🛛 🛛 🔀					
Buscar Por					
12/02/2002 💌 🕫 Fecha					
C Línea de Negocio					
C Número					
12/02/2002 12/02/2002 C Intervalo de Fechas					
C Todos los Registros					
~					
🔬 Aceptar 🔀 Cerrar					

Con esta opción podrá buscar los registros de negocios de renta variable que se hayan hecho ya sea manualmente o automáticamente. Las búsquedas se podrán efectuar por la fecha de registro, por la línea de negocio a la cual se clasificó el registro, por el número de dicho negocio o por todos los registros. Posteriormente



deberá dar clic en Aceptar para efectuar la consulta deseada.

2.5.2.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la misma pantalla mostrada anteriormente, a excepción de que todos los campos están bloqueados, es decir de color gris, y cuando se da clic en Aceptar aparece un mensaje que dice ¿Está seguro de eliminar el registro?, en este caso el usuario deberá proceder como desee.

2.5.2.5. DETALLE NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.

2.5.2.6. CARGA DE DATOS DE RENTA VARIABLE

🚢 Carga de Datos - Negocios/Renta Variable					
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Alterna Normal NIFOVAL Excel Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.5.2.7. EXPORTAR A EXCEL DE RENTA VARIABLE

Esta opción permite utilizar la información de negocios de renta variable, para ser trabajados en Excel.



2.5.3. NEGOCIOS DE RENTA FIJA



Al dar clic en esta opción aparecer la pantalla anteriormente mostrada en la cual se podrá visualizar la información respectiva a los negocios de renta fija que se hayan cargado.

2.5.3.1. INGRESAR NEGOCIOS DE RENTA FIJA

Al dar clic en la opción de Ingresar aparecerá la pantalla mostrada anteriormente y en la cual se deberá registrar todos los datos que ahí se piden. El campo monto no se ingresa ya que este se calcula automáticamente. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar.



🌮 Negocios/Renta Fija - Ingresar	X
Seleccione Emisor	Beneficiarios
Fecha Días al Vcto. de Emisión de Vencimiento 12/02/2002 12/02/2002 de Negociación 08/07/2009	- Modelidad de Emición
Oficina Depósito Número Tasa Nominal 0.000 Tipo de Operación Completo/Cupon/Principal	Modalidad de Enistein Modalidad de Reinversión Modalidad de Reinversión
Negocio Número Nro. Fracción 0 P Línea 🗨 Can Corredor M	Tasa 0.000 recio 0.000 tidad 0.00000000 Ionto 000.00
	Aceptar 🛛 Cerrar

2.5.3.2. MODIFICAR NEGOCIOS DE RENTA FIJA

Al dar clic en la opción de Modificar aparecerá la pantalla mostrada a continuación y en la cual se podrán modificar los datos deseados a excepción de la fecha de registro, el número del negocio y la línea de negocio adjudicados. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar para proceder a la modificación, de lo contrario clic en Cerrar.

2.5.3.3. BUSCAR NEGOCIOS DE RENTA FIJA



🖻 Buscar Negocios/Renta Fija 🛛 🛛 🔀			
Buscar Por			
12/02/2002 💌 🖲 Fecha			
C Línea de Negocio			
C Número			
12/02/2002 12/02/2002 C Intervalo de Fechas			
C Todos los Registros			
🔏 Aceptar 🔀 Cerrar			

Con esta opción podrá buscar los registros de negocios de renta fija que se hayan hecho ya sea manualmente o automáticamente. Las búsquedas se podrán efectuar por la fecha de registro, por la línea de negocio a la cual se clasificó el registro, por el número de dicho negocio o por todos los registros. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar para efectuar la consulta deseada.

2.5.3.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE RENTA FIJA

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la misma pantalla mostrada anteriormente, a excepción de que todos los campos están bloqueados, es decir de color gris, y cuando se da clic en Aceptar aparece un mensaje preguntando ¿Está seguro de eliminar el registro?, en este caso el usuario deberá proceder como desee.

2.5.3.5. DETALLE NEGOCIOS DE RENTA FIJA

Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.

2.5.3.6. CARGA DATOS DE NEGOCIOS DE RENTA FIJA



🚢 Carga de Datos - Negocios/Renta Fija					
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.5.4. NEGOCIOS DE DIVISAS



Al dar clic en esta opción aparecer la pantalla anteriormente mostrada en la cual se podrá visualizar la información respectiva a los negocios de divisas que se hayan cargado.

2.5.4.1. BUSCAR NEGOCIOS DE DIVISAS

Con esta opción podrá buscar los registros de negocios de divisas que se hayan hecho ya sea manualmente o automáticamente. Las búsquedas se podrán efectuar por la fecha de registro, por la línea de negocio a la cual se clasificó el registro, por el número de dicho negocio o por todos los registros. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar para efectuar la consulta deseada.



🗭 Buscar Negocios/Divisa	X		
Buscar Por			
12/02/2002 💌 🕫 Fecha			
C Línea de Negocio			
C Número			
12/02/2002 12/02/2002 C Intervalo de Fechas			
C Todos los Registros			
Aceptar 🔀 Cerra	r		

2.5.4.2. INGRESAR NEGOCIOS DE DIVISAS

🤣 Negocios/Divisas - Ingresar			
Fecha	Negocio Número Linea Corredor Clase Precio Precio Cantidad 0.000 Monto 000.00		
Aceptar 🔀 Cerrar			

Al dar clic en la opción de Ingresar aparecerá la pantalla mostrada anteriormente y en la cual se deberá registrar todos los datos que ahí se piden. El campo monto no se ingresa ya que este se calcula automáticamente. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar.

2.5.4.3. MODIFICAR NEGOCIOS DE DIVISAS

Al dar clic en la opción de Modificar aparecerá la pantalla mostrada a continuación y en la cual se podrán modificar los datos deseados a excepción de la fecha de registro, la oficina, el número del negocio y la línea de negocio adjudicada. Posteriormente deberá dar clic en Aceptar para proceder a la modificación, de lo contrario clic en Cerrar.


2.5.4.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE DIVISAS

Al dar clic en el botón de eliminación aparece la misma pantalla mostrada anteriormente, a excepción de que todos los campos están bloqueados, es decir de color gris, y cuando se da clic en Aceptar aparece un mensaje ¿Está seguro de eliminar el registro?, en este caso el usuario deberá proceder como desee.

2.5.4.5. DETALLE DE NEGOCIOS DE DIVISAS

Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.

2.5.4.6. CARGA DATOS DE NEGOCIOS Y DIVISAS

🚉 Carga de Datos - Negocios/Divisas				
Cargue Automático Archivo (*.txt)				
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL C Excel C Vista				
	Imprimir Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



2.6. OPCIÓN INFOVAL



En esta opción encuentra las opciones por medio de las cuales pude cargar al sistema la información que en cuanto a Tasas, Curvas, Márgenes etc. Publica la Bolsa de Valores.

2.6.1. MARGEN PROMEDIO



Son las márgenes de los títulos que se carga a partir de la información de Infoval.



2.6.1.1. BUSCAR MARGEN PROMEDIO

Para consultar información de Margen Promedio, puede seleccionar: El emisor, la especie, el Grupo de días al vencimiento o por un rango de fechas dadas.

🏴 Buscar Margen Promedic	• 🔀
Buscar Por	
•	Seleccione Emisor
_	Especie
v	🔲 Grupo Dias Vcto
09/07/2009 💌	Fecha Inicial
09/07/2009 💌	🔽 Fecha Final
Acer	otar 🔽 Cerrar
V	

2.6.1.2. CARGAR DATOS DE MARGEN PROMEDIO

🛓 Carga de Datos		×
Cargue Automático Archivo (*.txt)		
Tipo de Carga C Alterna Normal C INFOVAL Excel C Vista		
	Imprimir 🚈 Errores 🔊 Aceptar 区 Cerra	

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.6.1.3. EXPORTAR A EXCEL MARGEN PROMEDIO

La información correspondiente a Margen Promedio, puede ser exportada a Excel, para realizar diversos informes.



2.6.2. MARGEN PROPIO

🛓 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Margen Propio]									ð	×		
🐼 Archivo Carga de Información Ventana										- 8	×	
🔊 🔋 🗞	1											
INFOVAL	FechaRegistro	Nivel Medido	GrupoCal	Moneda	Tasa	DiasVcto	Plazo	MargenCota	FechaVigencia	MargenPropio		Tipe
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	5		-999.99999	2006/01/13	0.72	2712	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	6	2	-999.99999	2006/01/13	0.6	5976	PRC
Márgen	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	7	2	-999.99999	2006/01/13	0.85	5547	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	8	2	-999.99999	2006/01/13	0.15	5865	PRC
A	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	10	2	-999.99999	2006/01/13	-0.01	241	PRC
M. Propio	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	22	2	-999.99999	2006/01/13	0.0	3753	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	6	2	-999.99999	2006/01/13	1.64	1517	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	7	2	-999.99999	2006/01/13	2.53	3543	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	9	2	-999.99999	2006/01/13	3.8	3484	PRC
Precio	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	10	2	-999.99999	2006/01/13	4.98	3037	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	11	2	-999.99999	2006/01/13	2.49	3971	PRC

Son las márgenes propias que se dan internamente.

2.6.2.1. BUSCAR MARGEN PROPIO

Para consultar información de Margen Propio, lo puede realizar por rangos de fecha, teniendo en cuenta la fecha de registro ó la fecha de vigencia, o todos los registros.

🆻 Buscar Margen Propia 📃 🗖 🗙
Buscar Por
Fecha de Registro
09/07/2009 🔽 🛛 Fecha Inicial
09/07/2009 🔽 🔽 Fecha Final
Fecha de Vigencia
09/07/2009 🔽 🔽 Fecha Inicial
09/07/2009 🔽 🔽 Fecha Final
Todos los Registros
Aceptar Cerrar

2.6.2.2. CALCULAR MARGEN PROPIO

A partir de una fecha determinada el sistema realizará los cálculos, para determinar el Margen Propio, este se utiliza para valorar cuando no hay margen, ni precio oficial.





2.6.2.3. EXPORTAR A EXCEL MARGEN PROPIO

La información de margen propio, puede ser exportada a Excel para realizar diferentes informes.

2.6.3. **PRECIO**

El precio de cada especie se carga a partir de la información de Infoval.

	🛓 INFORMA	CION DE MERCADO	D Y SOCIEDAD - [Precios INFC	VAL]								- 6 🛛	
	🝈 Archivo 🔇	Carga de Información	Ventana										_ 8 >	к
	🧊 🗞 🖧 🚺	7 🗶 💊 🖉 🛛	۹											
	INFOVAL	Especie	ISIN	Fecha Reg.	Fecha Emision	Fecha Vcto.	Modalidad	Dias Vcto.	Moneda	Tipo Tasa	Spread	Fecha Cierre	Precio Cierre 🔥	
ł		BBCB1071B24V	COB07BO00699	08/07/2009	26/09/2007	26/09/2009	TV	80	COP		2.2		100.7	
		BBCX4059B5A	COB31BO00277	08/07/2009	22/09/2005	22/09/2010	TV	441	COP	3	3.25		100.2	2
	Márgen	BBGA108B60A	COB13BO00465	08/07/2009	26/08/2008	26/08/2013	TV	1509	COP	3	6.2		106.1	
		BCAF108D5	COC30BO00020	08/07/2009	16/12/2008	16/12/2013	SV	1621	COP	1	11.25		109.5	
	A	BCCB109A5	COH04BO00024	08/07/2009	28/04/2009	28/04/2014	AV	1754	COP	1	9.7		102.2	
	M. Propio	BDVI1089G5	COB51BO00853	08/07/2009	05/08/2008	05/08/2013	TV	1488	COP	3	6.24		107.3	
		BEMG1099B12	COI14BO00088	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2021	TV	4374	COP	3	6.1		100.7	
		BEMG1099B9	COI14BO00088	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2018	TV	3279	COP	3	5.9		101.2	
		BEMG109SE5	COI14BO00096	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2014	AV	1819	COP	1	9.27		101.3	
	Hecio	CDTBCBS0VD	COB07CT02890	08/07/2009	29/04/2009	29/09/2009	PV	83	COP	1	7.39		101.8	
		CDTBCBS0VD	COB07CT02890	08/07/2009	30/04/2009	30/10/2009	PV	114	COP	1	7.509		102.0	
		CDTBOCS0V	COB23CT03010	08/07/2009	22/01/2009	22/07/2010	PV	379	COP	1	10.8236		109.6	
	Europe -													

2.6.3.1. BUSCAR PRECIO

켜 Buscar Precio	
Buscar Por	Seleccione Emisor
09/07/2009 💌	Fecha Inicial
Асер	tar 🔀 Cerrar

La información de precios se puede consultar, seleccionando el emisor, la especie



o utilizando un rango de fechas determinado.

2.6.3.2. INGRESAR PRECIO

La información de precio de una especie se puede ingresar de forma manual, digitando la información que se muestra en la gráfica superior.

🙆 Precio - Ingresa	ır		
Seleccione Emisor		Fecha de Emision	12/02/2002 🔽
Especie		Fecha de Vencimiento	12/02/2002 💌
Estado		ISIN	
Fecha de Registro	09/07/2009 💌	Numero Emisor	0
– Modalidad de Interese	8		
Modalidad	_	Periodicidad	
Moneda		ISIN2	0
Tasa Ref.	0	ISIN3	0
Spread	0	Dias Vencimiento	0
Precio	0	Vigente	SI 💌
Precio Limpio	0	Fecha Vigencia	12/02/2002 💌
			Aceptar 🔀 Cerrar

2.6.3.3. MODIFICAR PRECIO



🗴 Precio - Modifio	ar		
Seleccione Emisor Especie Estado Fecha de Registro	BBCB1071B24V ACTIVO	Fecha de Emision Fecha de Vencimiento ISIN Numero Emisor	2€/09/2007 ▼ 26/09/2009 ▼ COB078000699 0
– Modalidad de Interese Modalidad	S TRIMESTRAL	Periodicidad	VENCIDA
Moneda Tasa Ref. Spread Precio Precio Limpio	COP DTF 2.2 100.775 100.775	ISIN2 ISIN3 Dias Vencimiento Vigente Fecha Vigencia	0 0 80 SI V 108/07/2009 V
		J.	Aceptar 🔀 Cerrar

Para modificar haga doble clic sobre la información que desee modificar, solo puede cambiar aquellos campos que se encuentren habilitados.

2.6.3.4. ELIMINAR PRECIO

🗴 Precio - Elimin	ar		
Seleccione Emisor		Fecha de Emision	26/09/2007 💌
Especie	BBCB1071B24V	Fecha de Vencimie	ento 26/09/2009 🔽
Estado	A	ISIN	COB07B000699
Fecha de Registro	08/07/2 Carga de Infor	mación - DiasVen 🛛 🕅	0
– Modalidad de Interese	15	anna da Eliziana el Danistra D	
Modalidad		eguro de Eliminar el Registro ?	VENCIDA
Moneda		<u>N</u> o	0
Tasa Ref.	DTF	ISIN3	0
Spread	2.2	Dias Vencimiento	80
Precio	100.775	Vigente	SI 👻
Precio Limpio	100.775	Fecha Vigencia	08/07/2009 🔽
			Aceptar 🛛 Cerrar



Al eliminar un registro, se debe tener cuidado de no borrar información que pueda interferir al momento de valorar.

2.6.3.5. CARGAR INFORMACION DE PRECIO

🚢 Carga de Datos					×
Cargue Automático					
└ Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	X	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.

2.6.3.6. EXPORTAR A EXCEL PRECIO

La información de precios puede ser manejada en Excel, para manejo de diversos informes.

2.6.4. CURVAS

🛓 INFORMA	CION DE MER	RCADO Y SO	CIEDAD - [C	Curvas INFOVA	L]	
🔂 Archivo C	arga de Inform	ación Ventai	na			
🔊 🄗 🖉	1					
INFOVAL	Fecha Oper.	Indicador	Plazo Días	Rent. Observada	Rent. Estimada	
	08/07/2009	CEC	5689	0	9.5418	
	08/07/2009	CECUVR	5689	0	5.3589	
Márgen	08/07/2009	CEC	5709	0	9.5392	
	08/07/2009	CECUVR	5709	0	5.3593	
<u>d</u>	08/07/2009	CEC	5710	0	9.5391	
M. Propio	08/07/2009	CECUVR	5710	0	5.3594	
0000	08/07/2009	CEC	5711	0	9.539	
Ä	08/07/2009	CECUVR	5711	0	5.3594	
<u> </u>	08/07/2009	CEC	5712	0	9.5389	
Precio	08/07/2009	CECUVR	5712	0	5.3594	
	08/07/2009	CEC	5713	0	9.5387	
	08/07/2009	CECUVR	5713	0	5.3594	
Curvas	08/07/2009	CEC	5714	0	9.5386	
	08/07/2009	CECUVR	5714	0	5.3594	
•	08/07/2009	CEC	5715	0	9.5385	

Con esta información se pueden valorar títulos de tasa fija, cuando estos no



presentan precios de cotización, sino solamente margen.

2.6.4.1. BUSCAR CURVA CERO CUPON

🚮 Buscar Rentablildad Curva Cero Cupón 💦 👂					
Buscar Por					
09/07/2009 💌 🗖 Fecha					
CEC 🔽 Indicador					
0 🔽 Plazo Dias					
09/07/2005 - 09/07/2005 - Intervalos de Fecha					
Todos los Registros					
Aceptar Cerrar					

Para consultar información de Curva cero Cupón, puede utilizar: la Fecha, el Indicador, el plazo en días, por Intervalos de fecha o consultando todos los registros.

2.6.4.2. CARGAR DATOS DE CURVA CERO CUPON

🚉 Carga de Datos				
Cargue Automático Archivo (*.txt)				
Tipo de Carga C Alterna C Normal INFOVAL C Excel C Vista				
	Imprimir 🕷	Errores	Aceptar	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.6.4.3. EXPORTAR A EXCEL CURVA CERO CUPON

La información relacionada con curvas pude ser exportada a Excel para manejos de informes.

2.6.5. BETAS



🛓 INFORMAG	🛃 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Betas INFOVAL]								
B Archivo C	Archivo Carga de Información Ventana								
🔊 🔌 🖉	- 1								
INFOVAL	Fecha Oper.	Indicador	Valor0	Valor1	Valor2	Valor3			
	08/07/2009	CEC	8.025504	-5.731652	11.388708	3.311034			
	08/07/2009	CECUVR	5.332419	-5.332419	3.545263	0.978139			
Márgen	08/07/2009	CRCDT	5.638294	-0.766596	5.702955	1.631462			
M. Propio									
Precio									
Curvas									
Betas									
Todos									

2.6.5.1. BUSCAR BETAS

Consulte la información de Betas, por fecha, Indicador, Intervalos de fecha o por todos los registros.

2.6.5.2. CARGA DATOS DE BETAS

🚉 Carga de Datos					
Cargue Automático					
Archivo (*.txt)					··· ·
Tipo de Carga					
C Alterna					
INFOVAL					
C Excel C Vista					
	Imprimir	*			
	Errores	Errores	火 Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.6.5.3. EXPORTAR A EXCEL BETAS

Con esta opción puede cargar la información de betas en Excel, para ser utilizada



en diversos informes.

	ION DE MERCA	DO Y SOCIEDAD - [Parámetros de Carea de Infoval]				
Archivo Carga de Información Ventana						
F 💊 🔊 🖻	1 🗶 💊 🏈	1				
INFOVAL	Archivo	Directorio				
	Acciones	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
	Betas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
Márgen	Curvas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
a mai	Indicadores	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
	Margen Prom	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
M. Propio	Monedas (SN)	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
	Monedas (SR)	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
(Å)	Precios	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
Precio	Tasas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio				
Curvas						
Betas						
Todos						
2						

2.6.6. PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL / TODOS

Es la Carga de Todos los archivos de Infoval una vez hayan sido descargados de la pagina Web de Infoval.

2.6.6.1. MODIFICAR PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL

🛢 Carga Infoval		×
🔽 🛛 Betas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Curvas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Indicadores	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Margen Prom	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Monedas (SN)	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Monedas (SR)	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
Precios	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Tasas	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
🔽 Acciones	E:\Infoval\Infoval Año 2009\01 Julio	
	Aceptar	Cerrar

En cada una de las casillas se debe colocar la ubicación de donde se encuentran los archivos descargados desde la página Web de Infoval.



2.6.6.2. CARGAR DATOS DE PARAMETROS DE INFOVAL

🛱 Carga Compl	eta de Infoval	
 Un día Un Periodo 	Image: Contract of the second seco	
	Aceptar	Cerrar

Para cargar la información que ha descargado desde la pagina de Infoval debe primero seleccionar la fecha y a continuación el botón Aceptar. Cuando la información ha sido cargada correctamente sale el mensaje de Información Cargada, pero si tiene errores muestra la siguiente imagen.

🕒 Carga Completa de Infoval		— — ×
 ♥ Un día 09/07/2009 ♥ ♥ Un Periodo 09/07/2009 ♥ 	Fecha Inicio Fecha Final	
SN070909.001 Inicio Carga: 08:46:02	PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	<u> </u>
SR070909.001 Inicio Carga: 08:46:05 SP070909.001 Inicio Carga: 08:46:05 SV070909.001 Inicio Carga: 08:46:11	Se Generarón Errores al Cargar Algunos Datos, Favor Verifique.	
	Aceptar	>
	Errores	Aceptar 🛛 Cerrar

Se debe dar aceptar y presionar el botón Errores que se encuentra habilitado.



🛱 Carga Co	ompleta de Infoval		
 Un día Un Period 	09/07/2009 💌 Fecha Inicio do 09/07/2009 💌 Fecha Final		
			<u>^</u>
SR070909.0	001 Inicio Carga: 08:46:05 Finaliza Carga: 08:46:05	ок	
SP070909.0	101 Inicio Carga: 08:46:05 Finaliza Carga: 08:46:11	ок	
SV070909.0	101 Inicio Carga: 08:46:11 Finaliza Carga: 08:46:13	OK	
			× ×
stFila	stError		stArc
6134	La Especie BBCB3079C5 no existe		SM070909.001
6135	La Especie BBCB3079C10 no existe		SM070909.001
7534	La Especie BBCB307SA3 no existe		SM070909.001
9567	La Especie BBCB3071B5 no existe		SM070909.001
9568	La Especie BBCB3071B2 no existe		SM070909.001
	•		<u> </u>
1			
		Errores 🔊 Acer	otar 🔀 Cerrar

Esta imagen muestra cuales son las especies que faltan por cargar. Para solucionar este error debe descargar los ISINES y NEMOS de la página de Infoval las cuales contienen la respectiva información y luego cargar en Especies ISINES.

2.6.7. CANASTA DERIVADOS

Es la lista de especies que conforman los contratos de derivados.



LINFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Canasta Derivados]							
B Archivo Carga de Información Ventana							
🏓 🔗 🎮	- 10						
INFOVAL	Fecha Reg.	Especie	Especie Boni	Especie Sub	Factor		
Mårgen						J	
M. Propio							
Precio							
Curvas							
Betas							
Todos							
THERE							

2.6.7.1. CARGA DE DATOS DE CANASTA DERIVADOS

🚢 Carga de Datos					×
Cargue Automático Archivo (*.txt)					
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	×	Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.



2.6.8. PRECIOS DERIVADOS

LINFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Precios Derivados]									
🛞 Archivo C	arga de Inform	iación Ventana							
F 🔶 🌶									
INFOVAL	Fecha Reg.	Especie	Fecha Ven.	Precio Str	Precio Liq	Especie Sub.	Precio Sub.	Precio Ant.	Variación
Márgen					1				
M. Propio									
Precio									
Curvas									
Betas									
Todos									
Canas.Dr Precios Dr									

Es la lista que conforman los precios de los Productos derivados.

2.6.8.1. CARGA DE DATOS DE PRECIOS DERIVADOS

🚢 Carga de Datos		
Cargue Automático Archivo (*.txt)		
Tipo de Carga C Alterna C Normal C INFOVAL C Excel C Vista		
	Imprimir Hirores	Aceptar 🗵 Cerrar

En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.

2.6.9. MARGEN INICIAL

INFOVALMER

Esta actividad se relaciona con el proceso de Carga de Información de Mercado, Valoración, Evaluación de Riesgo y Generación de Informes.

Al cargar la información con la nueva estructura de archivos proceda como siempre, solamente asegúrese de no tener en su carpeta de carga las dos versiones de archivos,



particularmente el de Precios, pues el sistema intentará cargar los dos.

a. Curvas y Especies.

- En el proceso de actualización hicimos 2 cosas:
 - 1. Asociamos las curvas a las especies, según los datos suministrados por Infovalmer. Sin embargo, para las especies nuevas deberá usted realizar tal asociación.
 - 2. Hicimos que el proceso de carga de Curvas y Betas creara automáticamente las nuevas curvas que encuentre en tales archivos.
- Asociación de Curva a Especie. Ahora encuentra usted un campo denominado "Curva Nueva" en donde deberá registrar la curva que le corresponde a la especie, como se ve en la figura siguiente:

🕘 Especies/Renta Fija - Modificar	X
Código CDTBB090 Emisor BB0 Descripción Moneda COP Calificación Indicador IRFBVC Estado ACTIVO Curva Anterior FecMaxReinv 01/01/4000 T Titulo CERT.DEF Superfinanciera Código SF CDT Aval Emisión Fungit	Nemo Equiv Renta Fija
Fecha Vencimiento Emisión Vencimiento 05/09/2014 05/09/2014 Tasa Image: Constant of the second s	Calculo Interes Tasa Caja Interes Tasa Calendario COMERCIAL Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento INTERESES Comisión VALOR Clase Factor 1 Datos Faciales SI Amortización 100.000 Retefuente < 5
Modalidad de Pago de Intereses Modalidad Periodicidad CUALQUIERA VENCIDA V	Modalidad Pago de Reinversión Modalidad Periodicidad NO APLICA V NO APLICA V
	Aceptar Cerrar



- b. Valoración. El proceso de valoración no sufre modificaciones esenciales, el sistema ubicará el precio del papel por el ISIN o por las características faciales, según usted lo haya establecido en los parámetros. En caso de procesos en los que se deba valorar con la curva, se utilizará la nueva curva.
- c. **Generalidad**. Aparte de lo anterior no se presentan más novedades por este motivo.

2.7. OPCIÓN VALORES SUPER

Parámetros para los modelos de la Superintendencia Financiera





2.7.1. VALOR FACTORES

LINFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valores de los Factores]								
🛐 Archivo Carga de Información Ventana								
Valores Super	Fecha	Factor	Valor 10 Dias	Valor 1 Año				
	02/10/2003	DTF	30	126				
- 🚔	02/10/2003	Tasa de Repos	250	0				
	02/10/2003	Tasa Interbancaria	135	0				
VII. Factores	02/10/2003	Tasa Real	3.33	12.4				
1 2	02/10/2003	Libor	6.86	41.18				
AC	02/10/2003	Tasa Credito Consumo	222	0				
Correlación	02/10/2003	Money Market	12	0				
	02/10/2003	Tasa Tes	150	250				
	02/10/2003	UVR	0.37	3.9				
	02/10/2003	TRM	2.63	0				
Utas Pat.	02/10/2003	EURO	5.45	0				
rechico	02/10/2003	YEN	5.18	0				
	02/10/2003	Indice Acc de la BVC	6	9				

En esta opción se registran los valores de los factores, para la medición del VaR oficial.

2.7.1.1. INGRESAR VALORES DE FACTORES

Ingrese la información de factores, digitando la fecha, el factor y el valor de este en días y a un año.

Valores Facto	ores - Ingresar	
⊢ Ingresar Datos — Fecha Factor Valor Dias Valor Año	፪2/07/2009 ▼	
	itar 🔀 Cerrar	



2.7.1.2. MODIFICAR VALORES DE FACTORES

Valores Fact	ores - Modificar	
_ Ingresar Datos—		
Fecha	02/10/2003 💌	
Factor	DTF	_
Valor Dias	30	
Valor Año	126	
Ace	otar 🔀 Cerrar	

Al momento de modificar un factor solo puede cambiar el valor, si desea otro cambio debe eliminar el registro.

2.7.1.3. ELIMINAR VALORES DE FACTORES

🛛 Valores Factores - Eliminar 🛛 🗖 🗖
Ingresar Datos
PWPREI - RESOLUCION 513
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
Sí No
Aceptar Cerrar

Para eliminar escoja el ítem y haga clic en el botón correspondiente, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas adicionales.



2.7.1.4. BUSCAR VALORES DE FACTORES



La consulta de información se puede realizar por fecha, factor o por todos los registros.

2.7.2. MATRIZ DE CORRELACION

La información de la matriz de correlación es publicada por la superintendencia para la medición del VaR oficial.

LINFORMACI	NFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Matriz de Correlaciones]											
N 🔉 🝸	7											
Valores Super	Fecha	Factor	Valor1	Valor2	Valor3	Valor4	Valor5	Valor6	Valor7	Valor8	Valor9	Valor10 Va
	01/08/2003	-2	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
i i i i i i i i i i i i i i i i i i i	01/08/2003	-1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	01/08/2003	1	1	0.925	0.948	0.804	0.842	0.954	0.844	0.678	0.838	-0.493
VII. Factores	01/08/2003	2	0.925	1	0.973	0.612	0.845	0.961	0.843	0.647	0.86	-0.27
11 1 3 1	01/08/2003	3	0.948	0.973	1	0.627	0.857	0.962	0.858	0.654	0.898	-0.259
I AC I	01/08/2003	4	0.804	0.612	0.627	1	0.613	0.676	0.617	0.499	0.424	-0.781
Correlación	01/08/2003	5	0.842	0.845	0.857	0.613	1	0.884	0.999	0.662	0.702	-0.11
	01/08/2003	6	0.954	0.961	0.962	0.676	0.884	1	0.887	0.644	0.871	-0.285
	01/08/2003	7	0.844	0.843	0.858	0.617	0.999	0.887	1	0.654	0.706	-0.112
••••	01/08/2003	8	0.678	0.647	0.654	0.499	0.662	0.644	0.654	1	0.573	-0.272
Ctas Pat.	01/08/2003	9	0.838	0.86	0.898	0.424	0.702	0.871	0.706	0.573	1	-0.105



2.7.2.1. INGRESAR MATRIZ DE CORRELACION

Esta información es suministrada por la Superintendencia y el sistema se encarga de construir la matriz.

🖇 Matriz de Correlaciones - Ingresar	
Ingrese los datos	
Fecha 00/07/2009 - Numero de Columnas Constuir Matriz	
MATRIZ DE CORRELACIONES	
*	
Anentar 🔽 Cerrar	



MODIFICAR MATRIZ DE CORRELACION

🚜 Matriz de Correlacione	es - Modificar			
Modificar Datos				
Fecha 01/08/2003 💌	Numero de Columnas	o	Constuir Matriz	
CodSuper 1	2	3	4	
• -2 0	ō	ŏ	Ö	
*				
11				Þ
	Aceptar	Cerrar		

Como se muestra en el gráfico solo se puede modificar los datos que se encuentran bajo las columnas, el código súper no puede ser modificado.

2.7.2.2. ELIMINAR LA MATRIZ DE CORRELACION

🚜 Matriz de Correlaciones -	Eliminar	
– Eliminar Datos	PWPREI - RESOLUCION 513	
Fecha 🔟/08/2003 💌 🛚	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	Matriz
Ace		

Como se muestra en la parte superior, la pantalla de eliminación es diferente a todas las anteriores, se debe escoger la fecha de la cual se desea eliminar la información.

2.7.2.3. BUSCAR MATRIZ DE CORRELACION

La información sobre la Matriz de Correlación se puede consultar por una fecha específica o por todos los registros.



戸 Buscar Matriz de Correlac 🔀				
Buscar Por				
Fecha 09/07/2009 💌				
Aceptar 🔀 Cerrar				

2.7.3. CUENTAS PATRIMONIO TECNICO

En esta opción se registran todas las cuentas del patrimonio técnico, estas cuentas se utilizan para calcular el nivel de solvencia.

🗄 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valores Cuentas Patrimonio Tecnico]					
🚠 Archivo Car	ga de Información 🛛 Ventar	าล			
🧏 🔉 🖉 🛛	J 🖗 🚿				
Valores Super	FechaCarga	Тіро	Cuenta	Valor	
Vir Eactores					
Ac					
Matříž Correlación					
Ctas Pat. Tecnico					

2.7.3.1. INGRESAR CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

📩 Valores Cuenta	s - Ingresar 📃 🗖 🔀
Fecha Carga	<u>IE</u> /07/2009 <u>-</u>
Tipo	CP 💌
Cuenta	
Valor	
	5 .
	ar Kerrar



Al ingresar la información de Cuentas Patrimonio Técnico, ingrese la siguiente información: Fecha, el tipo de cuenta (CP: Cuenta Principal ó CS: Cuenta Secundaria), el número de la cuenta y el valor.

2.7.3.2. MODIFICAR CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

Para modificar haga doble clic sobre el ítem requerido, solo podrá modificar el valor, en caso de necesitar modificar otro parámetro deberá eliminar el registro.

2.7.3.3. ELIMINAR CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

Para eliminar escoja el registro deseado, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.7.3.4. BUSCAR CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

Para consultar la información de las cuentas Patrimoniales, puede utilizar la fecha de carga, el tipo (CP: Cuenta Principal ó CS: Cuenta Secundaria).

2.7.3.5. CARGA DATOS DE CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

La información de cuentas de Patrimonio, se puede cargar automáticamente, a través de un archivo plano ó un archivo de Excel, utilizando la fecha de carga o el tipo de cuenta. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto

2.2.1.1.6 tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.7.4. VALOR CUENTAS APNR

Son los valores de las cuentas para calcular el valor de los activos ponderados por nivel de riesgo.





2.7.4.1. INGRESAR VALORES CUENTA APNR

🖩 Valores Cuentas - Ingresar 📃 🗖	×
Fecha Carga 💽/07/2009 💌 Cuenta Valor	
Aceptar 🔀 Cerrar	

Ingrese los valores correspondientes a la Fecha de Carga, la cuenta y el valor.

2.7.4.2. MODIFICAR VALORES CUENTA APNR

Al momento de modificar, solo puede cambiar el valor de la cuenta APNR, en caso de otra modificación debe eliminar el registro.

2.7.4.3. ELIMINAR VALORES CUENTA APNR

Al eliminar seleccione el registro deseado, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.7.4.4. BUSCAR VALORES CUENTA APNR

🗭 Buscar Valores APNR	×
Buscar Por	
Fecha Vigencia 09/07/2009 💌	
✓ Todos los Registros	
Aceptar Cerrar	

Para consultar la información de las APNR, utilice la fecha de vigencia o todos los registros.



2.7.4.5. CARGA DATOS DE VALORES CUENTA APNR

Utilice esta opción para cargar la información de los APNR, escoja la fecha de carga a utilizar, y el medio bien sea: Archivo plano, archivo Excel o una fuente externa. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.

2.7.5. DATOS NETOS

Contiene los valores obtenidos de activos ponderados por nivel de riesgo y patrimonio técnico, en caso de que no se generen estos datos para el cálculo, se pueden registrar directamente.

INFORMAC	ION DE MERCADO	Y SOCIEDAD - [Datos Net	cs]		
📅 Archivo 🛛 Ca	rga de Información 🛛 V	'entana			
à 🎄 🛐	🗩 🗉 🚿				
Valores Super	Fecha Dato	PatTecnico	APNR	Rle	R.Derivados
1450	06/02/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
÷	28/02/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
. 	30/03/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
Vir. Factores	18/04/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
18.	25/04/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
AC	29/06/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
Forrelación	30/06/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
	24/07/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
	31/08/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
	03/09/2007	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
Ctas Pat.	17/12/2007	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$0.0	\$0.0
rechico	30/04/2008	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
	31/05/2008	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
	27/06/2008	\$ 100,000,000.0	\$1,236.0	\$0.0	\$0.0
/Ir Ctas APNR	30/06/2008	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$0.0	\$0.0
- the	05/12/2008	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$0.0	\$ 0.0
- 2 8 2	31/12/2008	\$1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$0.0	\$ 0.0
Datos Netos					

2.7.5.1. INGRESAR DATOS NETOS

🐨 Datos Netos -	ngresar 📃 🗖 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Carga	<u></u> <u>/07/2009</u> <u> </u>
PatTecnico	
APNR	
Rle	0
Riesgo Derivados	0
🔊 APNR	Aceptar 🔀 Cerrar

La información perteneciente a los datos netos puede ser registrada de manera



manual digitando la fecha de carga, el Patrimonio Técnico, el valor de los Activos Ponderados por nivel de riesgo, el Riesgo de Liquidez y el Riesgo de Derivados. Una vez digitada esta información puede dar clic en el botón APNR el cual le mostrará la ponderación por especie de cada título que conforma el portafolio.

2.7.5.2. MODIFICAR DATOS NETOS

En esta opción puede modificar toda la información correspondiente a valores, la fecha de carga no se puede modificar.

🐨 Datos Netos 🛛 -	Modificar 📃 🗖 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Carga	06/02/2007 💌
PatTecnico	\$ 100,000,000.0
APNR	\$ 1,236.0
Rle	\$ 0.0
Riesgo Derivados	\$ 0.0
🔊 APNR	Aceptar 🔀 Cerrar

Al presionar el Botón APNR aparece la siguiente tabla.





2.7.5.3. ELIMINAR DATOS NETOS

📅 Datos Netos - Eliminar 🛛 🗖 🗖 🔀			
Ingresar Datos Fecha Carga 31/08/2007 💌			
PWPREI - RESOLUCION 513			
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?			
Sí No			
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			
APNR Aceptar Cerrar			

Al eliminar la información, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.7.5.4. BUSCAR DATOS NETOS

Consulte la información de Datos Netos, por fecha o por todos los registros.

👎 Buscar Datos Netos	×
Buscar Por Fecha Dato 09/07/2009 💌	
Aceptar 🔀 Cerrar	

2.7.5.5. CALCULAR DATOS NETOS

🖽 Calcular	
− Ingresar Datos Fecha 📧/07/2009 💌	
Calcular 🔍 Mostrar	Cerrar

La información correspondiente a los Datos Netos, puede ser calculada



automáticamente dando la fecha para la cual se desea realizar el cálculo correspondiente.

2.7.6. MATRICES SFC



Las Matrices de la SF son los valores de los factores de riesgo y las correlaciones para el cálculo del riesgo de mercado de las carteras colectivas.

2.7.6.1. BUSCAR MATRICES SFC



Si desea buscar debe seleccionar la Fecha de Vigencia y la Matriz que desea ver.



2.7.6.2. CARGAR DATOS MATRICES SFC

🛓 Carga de Datos	s - Cargar Matrices SFC	×
Cargue Automático Archivo		
Tipo de Carga		
Fecha Carga	[[™] ./09/2010 ▼ (*.xls)	
	Errores 🚽 Errores 📈 Aceptar 🔀 Cerra	ar

Después de descargar las matrices de la SF, debe presionar el botón cargar y después seleccionar la ruta del archivo Excel de las Matrices de riesgo y, muy importante, la Fecha de Vigencia con quedarán registradas las matrices. Esta fecha es la fecha a partir de la cual el sistema toma en cuenta estas matrices para evaluar el riesgo (1º del mes de la fecha de corte o mes a cargar).

Presione el botón "Aceptar". Al terminar le aparecerá el mensaje "Información Cargada". En caso de errores le aparecerá el mensaje "Se generaron Errores. Revise el botón Errores"

2.8. OPCIÓN FORWARD / OPCF

Se definen los Precios y Tasas de los Forwards.





2.8.1. TASAS FORWARD

🛓 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Tasas Forward/Vain]					
😥 Archivo - C	arga de Información Venta	ina			
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia	Tasa	Plazo	Valor	
	2010/05/06	IBR	1	1.9	
	2010/05/06	IBR	7	2.1	
	2010/05/06	IBR	15	2.38	
Tasas Fw	2010/05/06	IBR	30	2.7	
\$ C	2010/05/06	LIB1	1	1.8	
<u> </u>	2010/05/06	LIB1	30	2.2	
PIPS	2010/05/06	LIB1	360	12.7	
	2010/05/07	IBR	1	2	
Ĩ	2010/05/07	IBR	7	2.23	
	2010/05/07	IBR	15	2.5	
OPCETBM	2010/05/07	IBR	30	2.8	
	2010/05/07	LIB1	1	1.9	
. (\$).	2010/05/07	LIB1	30	2.3	
Moneda vs	2010/05/07	LIB1	360	12.86	
Dolar	2010/05/08	IBR	1	1.9	
com 1	2010/05/08	IBR	30	2.1	
	2010/05/08	LIB1	270	2.8	
Def.	2010/05/08	LIB1	360	2.9	
Contratos	2010/05/08	LIB1	9999	3.257	
	2010/05/08	LIB1	99999	3.015	
\$					
Volatilidad					

Son las Tasas internas y externas para determinar el precio de los Forwards

2.8.1.1. BUSCAR TASAS FORWARD

Buscar Tasas Forward	\mathbf{X}
Buscar Por	1
FechaVigencia 00/07/2009 -	
🗖 Dias 🛛 🗍	
 Todos los Registros 	
Aceptar 🔟 Lerrar	

La información de las tasas, se puede obtener por Fecha de Vigencia, por los días



o por todos los registros.

2.8.1.2. INGRESAR TASAS FORWARD

Para ingresar manualmente la información de las tasas digite: Fecha, Tasa, Plazo y Tasa (Efectiva)

Ę	a Tasas Forward	/Vain - Ing 🔳 🗖 🔀
	Fecha Tasa Plazo Digite la Tasa para Tasa (EFECTIVA)	08/05/2010 💌 🔍 0 los días
	J	Aceptar 🔀 Cerrar

2.8.1.3. MODIFICAR TASAS FORWARD

🛱 Tasas Forwa	rd/Vain - Mo 🔳 🗖 🔀
Fecha	06/05/2010 🔻
Tasa	LIB1
Plazo	1
Digite la Tasa p	ara los días
Tasa (EFECTIV.	A) 1.8
	Aceptar 🔀 Cerrar

Esta opción le permite modificar la Tasa (Efectiva), si se desea modificar otro dato implica eliminar el registro.

Registre cada día los valores de las tasas que asoció a cada moneda en el modulo de Definición de Parámetros la pestaña PWPREI (2.1.4.8. PARAMETROS MONEDA / TASAS FWD)



2.8.1.4. ELIMINAR TASAS FORWARD

Al eliminar un registro, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

🛱 Tasas Forward/Vain - Eli 🔳 🗖 🗙	
Fecha 06/05/2010 💌	
PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD	
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
Sí No	
Aceptar 🔀 Cerrar	

2.8.1.5. DETALLE TASAS FORWARD

E	t Tasas Forwar	d/Vain - Det 🔳 🗖 🔀
	Fecha	06/05/2010 👻
	Tasa	LIB1
	Plazo	1
	- Digite la Tasa par	ra los días
	Tasa (EFECTIVA	1.8
		Cerrar

Esta opción es solo informativa, no se puede modificar ningún campo.



2.8.1.6. CARGA DATOS DE TASAS FORWARD

🚢 Carga de Datos - Tasas Forward/Opciones			
Cargue Automático Archivo (*.txt)			
Tipo de Carga C MED C Excel C Vista			
	Imprimir Errores	Aceptar	Cerrar

La información de Forward/opciones se puede cargar desde un archivo plano en Excel o MEC. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.8.1.7. EXPORTA A EXCEL TASAS FORWARD

La información de Forward/opciones se puede exportar a Excel, para manejo de diferentes informes.

NOTAS OPERATIVAS – VALORAR FORWARD POR PRECIO PPV

Para valorar sus forwards OTC con precio individual para estos, suministrado por su PPV (lo relacionado aquí corresponde solo a las estructuras de Infovalmer) utilice los archivos y proceda:

- 1. Archivos necesarios. Le serán publicados 2 archivos en formato csv y usted armará un tercero propio de PWPREI en formato .xlsx:
 - a. Archivo de precios de sus forwards: entidad_fxforwards_aaaammdd.csv, donde "entidad" es algún abreviado del nombre de su entidad. PWPREI va a reconocer la estructura del nombre y la estructura interna del archivo, por tanto no le cambie nada y si lo construye manualmente debe respetar esa estructura. El formato está en la plantilla "Infoval_FxForwards_F.csv" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls" de PWPREI.
 - b. Archivo de riesgo de contraparte: entidad_cva_alloc_aaaammdd.csv. Aplica lo mismo que para el caso anterior. El formato está en la plantilla "Infoval_cva_F.csv" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls" de PWPREI.
 - c. Archivo PWPREI en formato Excel: RelFwd_entidad.xlsx, el prefijo "RelFwd_" es necesario en el nombre del archivo para que PWPREI lo reconozca como un archivo de relación de números de negocio. Relacione en este archivo el número



de negocio en PWPREI de cada forward con el número de operación con el que se lo publica su PPV. Utilice la plantilla "RelFwd_NumNeg.xls" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls" de PWPREI.

- 2. Carga de los Archivos. Para alimentar los archivos proceda:
 - a. Ingrese a "Mercado y Sociedad Forwards/Opc TasasFw"
 - b. Utilice el botón Cargar para alimentar los archivos, simplemente elija cada archivo, como se ve en la pantalla, y el sistema los registrará donde corresponde. RECUERDE, siempre debe cargar primero el archivo de precios (fxforwards) y luego de riesgo de contraparte (cva_alloc):

ja 💊 🌲 🛐	🗶 💊 🖉 🔍									
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia Ta	sa Pla:	20	Valor	Fech	na Flujo				
Tasas Fw	Buscar Archivo (*.txt) $\leftarrow \rightarrow \checkmark \uparrow \square \ll$	2018 > Forward > 2018	0111	~ Č ⊟	uscar en 20180)111	× م			
ے۔ PIPS	Organizar 🔻 Nueva	a carpeta				== •	•			
Ä	Este equipo	^ Nombre	^	Fecha d	de modifica	Тіро				23
Morieda vs Dolar	Descargas	serfinansa_cva_	alloc_20180111.csv	12/01/2	2018 8:51 a	Archivo de valo	ores	ansa_fxforwards_201	80111.csv	
Mercado	Documentos	and seminarisa_txron	wards_20160111.csv	12/01/2	010 0:01 d	Archivo de valo				
Valores de	Escritorio									
Especies	Música									
Historico Medo	Objetos 3D									
INFOVAL	Vídeos						_			
Negocios	🏪 Disco local (C:)									
Salir	Disco local (D:)									
	🕳 Seagate Backup									
	🕳 Seagate Backup P	v <					>			
	No	mbre: serfinansa_fxforwa	rds_20180111.csv	~	Archivo (*.txt;*. Abrir	.xls*;*.dat; *.csv) Cancelar	✓ rimi ires	ir 🕌 Errores	Aceptar	Cerrar

NOTA: El archivo "RelFwd" solo lo deberá cargar cuando tenga un nuevo forward que agregar a la lista.

3. Consulta de la Información. Para consultar lo cargado simplemente utilice el botón "Buscar" y seleccione lo deseado:





RMAC	ION DE MERCADO	Y SOCIEDAD - [Tasa:	Forward/Vain]														-
ivo (Carga de Informació	ón Ventana															
	🜗																
pc.	FechaRegistro	NumPPV	GrpNumF	PV	Curva		Dere	echo	Obligacion	PSpot	PIPS	TasaX	TasaY	CVA	DVA	CVADVANet	
	11/01/2018	1			1 BAAA2			2001926399.026	68736.5213	2865.79	22.34	1.44836712	4.41370678	9.93952558	.371690962	.432165382	_
	11/01/2018	2			1 BAAA2			401421179.43043	4 353.307022	2865.79	13.08	1.4355303	4.48487332	3549818138	3842862627	2293044489	_
	10/01/2018	1			1 BAAA2		_	2022369486.65	5 5240.95699	2895.69	22.43	1.51589734	4.43238756	.257077408	.383609888	1265324792	-
	10/01/2018	2			1 BAAA2		_	405578574.13134	5 319.074418	2895.69	13.36	1.45924737	4.48589139	2409601228	7387975077	978373849	-
	09/01/2018	1			DAAA2		_	2035312615.9779	9135.00072	2914.37	12.77	1.5191472	4.40000900	2449709607	12/00/020	1099375014	-
	09/01/2018	2			1 04442			2022207122 6253	9071 21011	2914.37	22.45	1.5572059	4 41510105	617024122	664621043	19002/0919	-
	08/01/2018	2			1 84442		_	405862457 51014	465 326864	2898.32	13.48	1 53080440	4 48442005	3022166755	3515407851	4032411024	-
	07/01/2018	1			1 84442		_	2023715545.05	3 2013 83393	2898.32	22.66	1.5584994	4 41371056	617224133	664621043	1473969088	-
	07/01/2018	2			1 BAAA2			405846818,10476	5 213.099401	2898.32	13.72	1.53723288	4.48271609	3022166755	9515407857	1932411024	
	06/01/2018	1			1 BAAA2			2023617210.113	5 6175.49451	2898.32	22.86	.015604831)441222916	.617224133	.664621042)473969088	
	06/01/2018	2			1 BAAA2			405829827.12928	2 011.070249	2898.32	13.95)153678747)448101122	3022166755	9515407857	1932411024	
	05/01/2018	1			1 BAAA2			2023519062.636	1 0556.05639	2898.32	23.06	0156239604)441074777	0	0) 0	
-1	05/01/2018	2			1 BAAA2			405812878.40465	4 859.194203	2898.32	14.18)153629638)447930636	0	0	0 0	
ł																	
	Registro(s) 14																
\sim			A 1	x1 🖂	v E	w	A.		Ø				~) ESP 2:	58 p. n

2.2.8.1.5. NOTAS OPERATIVAS – VALORAR DERIVADOS POR PRECIO PPV

Para valorar sus derivados (Forwards divisas, Forwards títulos y Swaps) con precio individual para estos, suministrado por usted de la fuente que sea, utilice la plantilla "PWPPreDerivadoEspecifico" que está en el archivo "FormatosTodasEntrada.xls" y proceda: 6. Carga del archivo. Para alimentar el archivo proceda:

- a. Ingrese a "Mercado y Sociedad Forwards/Opc TasasFw"
- b. Pulse el botón "Cargar".


- c. En la pantalla de carga seleccione la fecha de carga.
- d. Chequee la opción "PWPPreDerEspecifico"
- e. Luego seleccione el archivo Excel donde ha configurado los precios a cargar, por derivado.
- f. Una vez todo esté listo, como se ve en la pantalla, pulse "Aceptar":

🧊 🔊 🖉 🖬	r 🗶 🔗 🕬 🤜				
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia	Tasa	Plazo	Valor	Fecha Flujo
	🔁 Carga de Datos - T	asas Forward/Vain			X
Tasas Fw	Cargue Automático-				PrecioDerEspecífico
r -r	Archivo (.txt)	ASOPORTE\CrediCorp\2018	\20180416 Desarrollos Espe	ciales\PlantillaPWPCargaPr	eDerivadosEspecifico
PIP5	Tipo de Carga				
S Moneda vs	C Normal No	mbre Curva: PWPDERESPCF			
Dolar	C INFOVAL	Fecha Vigencia	-		
Mercado	Vista	1-10/04/2010			
Valores de					
Especies					
Historico Medo					
INFOVAL					
Negocios					
Valores Super					
Salir			Imprimir Errores	Errores	Aceptar 🔀 Cerrar

- g. La información quedará registrada en el sistema.
- 7. Flujos SWAPS. Para algunos formatos, como el 508º el 519, es necesario mapear al menos el flujo próximo con el propósito de ubicarlo en la banda correspondiente. Para ello debe alimentar el sistema utilizando la plantilla "PWPFlujosSwap" que está en el archivo "FormatosTodasEntrada.xls" y proceda:
 - a. Ingrese a "Mercado y Sociedad Forwards/Opc TasasFw"
 - b. Pulse el botón "Cargar".
 - c. En la pantalla de carga seleccione la fecha de carga.
 - d. Chequee la opción "PWP Flujos Swap Específico"
 - e. Luego seleccione el archivo Excel donde ha configurado los flujos a cargar, por cada swap.
 - f. Una vez todo esté listo, como se ve en la pantalla, pulse "Aceptar":



📮 💊 🌲 E	' 🗶 🔗 🕬 🦃				
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia	Tasa	Plazo	Valor	Fecha Flujo
Tasas Fw By C PIPS	Carga de Datos - Ta Cargue Automático Archivo (*.txt)	sas Forward/Vain	20180416 Desarrollos Espe	uios Swap Específico – PWF sciales\PlantillaPWPCargaFlu	PtecioDerEspecífico
Morreda vs Dolar Mercado	C Alterna Tipo C Alterna Tipo C Normal Norr C INFOVAL C Excel C Vista	Curva PWPFLUJOSSW bre Curva: PWPFLUJOSSW Fecha Vigencia	A V AP		
Valores de					
Especies					
Historico Medo					
INFOVAL					
Negocios					
Valores Super					d
Salir			Imprimir Errores		Aceptar 🔀 Cerrar

8. Consulta de la Información. Para consultar lo cargado simplemente utilice el botón "Buscar" y seleccione "PREFWD" en la casilla "Tipo Curva":

🕄 TasasFw/Vain - Buscar					
-Buscar Por Tipo Curva	PREFWD				
🗖 Tasa	_	–			
🔽 Fecha Inicial	01/01/20	118 💌			
☑ FechaVigenc	11/01/20	118 💌			
🗖 Plazo	0				
C Todos los Re	gistros				
J.	Aceptar	Cerrar			



📃 💊 🖉	۹											
Forwards/Opc.	- echaRegistro	NumPPV	GrpNumPPV Curva	Derecho	Obligation	PSpot	PIPS	TasaX	TasaY	CVA	DVA	CVADVANeto
	23/04/2018	YYZ13875	NA	1,268,000,000	1,267,000,000	0	0	0	0	1,457,000	1,268,000	189,000
4	22/04/2010	1	1 DAAAZ	1,923,000,130.39074	2,055,145,114.09254	2,757.90	4.49	2.9000349	4.11404210	0,040.7092094140	-4/1,000.0/900000	-403,290.170200222
\sim	22/04/2018	4	4 BAAA2	1,922,508,009.18261	1,944,513,729.91976	2,757.96	4.49	2.9608349	4.11484218	48,975.3907821418	-173,492.60038267	-124,517.209600528
Tasas Fw	22/04/2018	5	5 BAAA2	1,235,898,005.9031	1,259,860,320.94814	2,757.96	4.49	2.9608349	4.11484218	23,365.9662884369	-140,105.624651661	-116,739.658363224
<u>م ب</u>	21/04/2018	1	1 BAAA2	1,925,741,870.19776	2,032,919,228.99413	2,757.96	4.59	2.95597511	4.11308407	8,345.7092894145	-471,635.879555636	-463,290.170266222
<u> </u>	21/04/2018	4	4 BAAA2	1,922,364,002.02278	1,944,297,691.31121	2,757.96	4.59	2.95597511	4.11308407	48,975.3907821418	-173,492.60038267	-124,517.209600528
PIPS	21/04/2018	5	5 BAAA2	1,235,805,429.87179	1,259,720,348.4365	2,757.96	4.59	2.95597511	4.11308407	23,365.9662884369	-140,105.624651661	-116,739.658363224
	20/04/2018	1	1 BAAA2	1,925,597,828.99522	2,032,693,590.8272	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	8,345.7092894145	-471,635.879555636	-463,290.170266222
<u>Š</u>	20/04/2018	4	4 BAAA2	1,922,220,213.47726	1,944,081,889.44325	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	48,975.3907821418	-173,492.60038267	-124,517.209600528
Moneda vs	20/04/2018	5	5 BAAA2	1,235,712,994.37824	1,259,580,529.31028	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	23,365.9662884369	-140,105.624651661	-116,739.658363224
Dolar	19/04/2018	1	1 BAAA2	1,902,370,227.80245	2,032,481,671.49896	2,724.47	5.14	2.84202313	4.10512189	4,575.949497938	-566,177.721961307	-561,601.772463369
	19/04/2018	4	4 BAAA2	1,899,033,354.90739	1,943,879,208.36534	2,724.47	5.14	2.84202313	4.10512189	31,017.41462784	-240, 122.065547824	-209,104.650919984
Mercado	19/04/2018	5	5 BAAA2	1,220,807,156.72618	1,259,449,211.21057	2,724.47	5.14	2.84202313	4.10512189	14,523.0242244264	-187,901.918604242	-173,378.894379815
Malana da	18/04/2018	1	1 BAAA2	1,889,184,301.27347	2,032,271,909.24423	2,705.64	5.33	2.80350811	4.09845865	3,829.2950926172	-643,083.873829638	-639,254.578737021
Valores de	18/04/2018	4	4 BAAA2	1,885,870,557.29423	1,943,678,590.32711	2,705.64	5.33	2.80350811	4.09845865	24,332.1056145919	-297,819.815641587	-273,487.710026995
Especies	18/04/2018	5	5 BAAA2	1,212,345,358.26058	1,259,319,229.76476	2,705.64	5.33	2.80350811	4.09845865	11,392.865612883	-228,016.041663594	-216,623.176050711
Lines and a March	17/04/2018	1	1 BAAA2	1,903,142,207.26889	2,032,040,895.78197	2,725.66	5.65	2.76051704	4.098813	6,106.8590941784	-584,226.346633114	-578,119.487538936
HISTOILEO MEDU	17/04/2018	4	4 BAAA2	1,899,803,980.27497	1,943,457,647.49036	2,725.66	5.65	2.76051704	4.098813	36,748.2149655036	-248,915.14581355	-212,166.930848046
INFOVAL	17/04/2018	5	5 BAAA2	1,221,302,558.7482	1,259,176,079.77875	2,725.66	5.65	2.76051704	4.098813	17,592.7162382417	-194,419.463417941	-176,826.747179699
Magazies	16/04/2018	1	1 BAAA2	1,903,274,093.12462	2,031,794,891.2558	2,726.47	5.36	2.85661706	4.10386153	7,579.8910442515	-601,383.972502637	-593,804.081458385
Negocius	16/04/2018	4	4 BAAA2	1,899,935,634.79491	1,943,222,367.09876	2,726.47	5.36	2.85661706	4.10386153	39,173.0452210349	-259,666.243165615	-220,493.19794458
Valores Super	16/04/2018	5	5 BAAA2	1,221,387,193.79673	1,259,023,640.41815	2,726.47	5.36	2.85661706	4.10386153	19,111.6841527399	-202, 192.001190475	-183,080.317037736
Calir	16/04/2018	YYZ13876	NA	2,120,000,000	2,115,000,000	0	0	6.23	5.48	1,457,000	1,268,000	189,000
Jan	15/04/2018	1	1 BAAA2	1,896,903,843.10282	2,039,005,284.23478	2,705.34	0.09	3.06926654	4.267	0	0	0
	15/04/2018	4	4 BAAA2	1,893,576,558.57846	1,950,115,857.10105	2,705.34	0.09	3.06926654	4.267	0	0	0
	15/04/2018	5	5 BAAA2	1,211,694,729.59778	1,258,810,553.89548	2,705.34	5.27	2.92405694	4.13885592	0	0	0
	14/04/2018	1	1 BAAA2	1,896,742,423.99823	2,038,763,950.45288	2,705.34	0.18	3.06662389	4.26445928	0	-11,566.3291683648	-11,566.3291683648
	14/04/2018	4	4 BAAA2	1,893,415,422.61279	1,949,885,044.14603	2,705.34	0.18	3.06662389	4.26445928	0	-4,598.8470203828	-4,598.8470203828
	14/04/2018	5	5 BAAA2	1,211,613,638.56671	1,258,670,587.75321	2,705.34	5.39	2.91552654	4.13701007	13,349.2792514031	-258,912.987558689	-245,563.708307286
	13/04/2018	1	1 BAAA2	1,896,574,300.89888	2,038,522,961.42964	2,705.34	0.26	3.10834519	4.26191856	0	-11,566.3291683648	-11,566.3291683648
	13/04/2018	4	4 BAAA2	1,893,247,594.41156	1,949,654,560.9201	2,705.34	0.26	3.10834519	4.26191856	0	-4,598.8470203828	-4,598.8470203828
	13/04/2018	5	5 BAAA2	1,211,532,688.9354	1,258,530,780.88753	2,705.34	5.51	2.90721552	4.13516423	13,349.2792514031	-258,912.987558689	-245,563.708307286
	12/04/2018	1	1 BAAA2	1,899,651,280.80949	2,038,281,927.05708	2,710.03	0.28	3.33087703	4.26110018	0	-11,267.0978479163	-11,267.0978479163
	12/04/2018	4	4 BAAA2	1,896,319,177.11256	1,949,424,034.32183	2,710.03	0.28	3.33087703	4.26110018	0	-4,329.7594663998	-4,329.7594663998
	12/04/2018	5	5 BAAA2	1,213,466,673.83583	1,258,358,081.48936	2,710.03	5.52	2.94084609	4.14892806	15,702.1423433749	-252,302.80134548	-236,600.659002105
	11/04/2018	1	1 BAAA2	1,915,791,420.42182	2,038,041,683.94339	2,733.24	0.42	3.15115014	4.2580136	0	-9,969.0420716277	-9,969.0420716277
	11/04/2018	4	4 BAAA2	1,912,431,005.93995	1,949,194,264.48788	2,733.24	0.42	3.15115014	4.2580136	0.1489251777	-3,014.1246412029	-3,013.9757160251
	11/04/2018	5	5 BAAA2	1,224,386,732.2958	1,258,191,574.80333	2,733.24	7.11	2.64208158	4.15939155	23,518.1567013847	-215,229.480948266	-191,711.324246881
	10/04/2018	1	1 BAAA2	1.940.043.023.52877	2.037.802.316.96424	2.767.82	0.77	2.5836388	4.25354125	0	-8.030.8079015983	-8.030.8079015983

2.8.2. **PIPS**

👢 INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Form1]									
🔂 Archivo C	🛐 Archivo Carga de Información Ventana 🗧 🗗 🗴								
🗩 🗞 🖧 🧕									
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia	Moneda1	Moneda2	Plazo	Valor				
	2010/05/07	PESO	USD	1	2.4				
4	2010/05/07	PESO	USD	7	2.42				
	2010/05/07	PESO	USD	15	2.501				
Lasas Fw	2010/05/07	PESO	USD	30	2.78				
5 5	2010/05/07	PESO	USD	60	2.97		-		
- ²	2010/05/07	PESO	USD	180	3.257		-		
PIPS	2010/05/07	PESO	USD	360	3.924		-		
899	2010/05/08	PESO	USD	1	2.035		-		
	2010/05/06	PESO	USD	15	2.30		-		
Precios	2010/05/08	PESO	USD	30	2.323		-		
OPCETRM	2010/05/08	PESO	USD	60	2.9873		-		
à	2010/05/08	PESO	USD	180	3,147				
Morreda vs	2010/05/08	PESO	USD	360	3.96				
Volatilidad Mercado Valores de Especies Historico Modo INFOVAL Negocios Valores Super Safr									
	Registro(s) 0								



2.8.2.1. BUSCAR PIPS



2.8.2.2. INGRESAR PIPS

🖻 PIPS/Vain -	Ingresar
Fecha Menodol	08/05/2010 💌
Moneda2	
Plazo	
Digite la Tasa	para los días
Valor	0
	Aceptar 🔀 Cerrar



2.8.2.3. MODIFICAR PIPS

E	3 PIPS/Vain - M	odificar 📃 🗖 🔀
	Fecha Moneda1	07/05/2010 🔽 PESO
	Moneda2	USD
	Plazo	1
	_ Digite la Tasa pa	ıra los días
	Valor	2.4
	•	Aceptar 🔀 Cerrar

Registre cada día los puntos forward aplicables en la valoración, según las monedas negociadas. El registro asume que son puntos en Moneda1 por unidad de Moneda2. Aunque la norma solo habla de PIPS COP/USD, el sistema le permite registrar PIPS para otras monedas, en cuyo caso el sistema los aplicará para valorar el forward respectivo. Si no los registra, el sistema aplica las tasas forwards correspondientes que haya registrado.

2.8.2.4. ELIMINAR PIPS





Al eliminar un registro, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.8.2.5. 2.2.8.2.1. DETALLE PIPS

Esta opción es solo informativa, no se puede modificar ningún campo.

Ę	a PIPS/Vain - De	etalle 📃 🗖 🔀
	Fecha Moneda1	07/05/2010 V
	Moneda2	USD
	Plazo	1
	_E Digite la Tasa pa	ra los días
	Valor	2.4
		Cerrar



2.8.2.6. CARGAR DATOS PIPS

🚉 Carga de Datos - PIPS/Vain					
Cargue Automático Archivo (*.txt) Tipo de Carga C MEC C Excel					
	Imprimir Errores	Errores	Aceptar	X	Cerrar

La información de PIPS se puede cargar desde un archivo plano en Excel. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.

2.8.2.7. EXPORTAR PIPS

La información de PIPS se puede exportar a Excel, para manejo de diferentes informes.

2.8.3. MONEDA VS DÓLAR

🛓 INFORMA	CION DE MERCADO	Y SOCIEDAD - [Moneda vs Dolarj			
🙇 Archivo - C	Carga de Información	Ventana				
🧊 💫 🚨 🚺	3 🕷 🔗 🖉 🛛	()				
Forwards/Opc.	Fecha	Moneda	Moneda Add	Compra	Venta	Promedio
	30/06/2006	DOLAR	PESO	2,578.14	2,580.02	2,579.08
	30/06/2006	TRM	PESO	2,578.14	2,580.02	2,579.08
	30/06/2006	YEN	TRM	114.5475	114.4165	114.482
Tasas Fw	30/06/2006	YEN	USD	114.5475	114.4165	114.482
\$ F	31/07/2006	DOLAR	PESO	2,426.37	2,426.67	2,426.52
	31/07/2006	TRM	PESO	2,426.37	2,426.67	2,426.52
PIPS	31/07/2006	YEN	TRM	114.5475	114.4165	114.482
1	31/07/2006	YEN	USD	114.5475	114.4165	114.482
	31/08/2006	DOLAR	PESO	2,398.34	2,398.78	2,398.56
	31/08/2006	TRM	PESO	2,398.34	2,398.78	2,398.56
OPCETBM	31/08/2006	YEN	TRM	117.3709	117.3709	117.3709
~~~~	31/08/2006	YEN	USD	117.3709	117.3709	117.3709
<u>s</u>	13/09/2006	DOLAR	PESO	2,406.5	2,407.28	2,406.89
Morreda vs	14/09/2006	DOLAR	PESO	2,399.82	2,400.01	2,399.915
Dolar	29/09/2006	DOLAR	PESO	2,393.89	2,394.73	2,394.31
~~~~	29/09/2006	TRM	PESO	2,393.89	2,394.73	2,394.31
	29/09/2006	YEN	TRM	118.0638	117.9245	117.99415
-Def.	29/09/2006	YEN	USD	118.0638	117.9245	117.99415
Lontratos	15/12/2006	DOLAR	PESO	2,269.87	2,270.49	2,270.18
	18/12/2006	DOLAR	PESO	2,262.0	2,262.3	2,262.15
~	19/12/2006	DOLAR	PESO	2,255.16	2,255.61	2,255.385
Volatilidad	20/12/2006	DOLAR	PESO	2,249.05	2,249.51	2,249.28
	21/12/2006	DOLAR	PESO	2,234.07	2,234.65	2,234.36

Esta opción permite ver la equivalencia entre dos monedas determinadas.



2.8.3.1. BUSCAR MONEDA VS DÓLAR

🔺 Buscar Moneda vs Dolar 📃 🗖 🗙
Buscar Por
09/07/2009 🔽 🗖 Fecha
Moneda
09/07/2005 09/07/2005 Intervalo de Fechas
Todos los Registros
Aceptar Cerrar

La información de Moneda vs. Dólar se puede consultar por intermedio de la fecha, la moneda, por un intervalo de fechas o por todos los registros.

2.8.3.2. INGRESAR MONEDA VS DÓLAR

🛓 Por Dolar - Ingresar 📃 🗖 🗙						
Ingresar Datos						
Fecha	02/07/2009 💌					
Moneda	PESO	•				
Moneda Adicional	PESO	•				
🔲 Valor Compra						
🔲 Valor Venta						
🔲 Valor Promedio						
Aceptar 🔀 Cerrar						

Al ingresar información digite la fecha, Moneda, Moneda adicional, el valor de compra, el valor de venta y el valor promedio.

2.8.3.3. MODIFICAR MONEDA VS DÓLAR

La opción de modificar le permite solo cambiar el valor de compra, venta o promedio, cualquier otro cambio implica eliminar el registro.



🚢 Por Dolar - Modi	ficar 📃 🗆 🔀
Ingresar Datos	
Fecha	30/06/2006 💌
Moneda	DOLAR
Moneda Adicional	PESO
🔽 Valor Compra	2,578.14
🔽 Valor Venta	2,580.02
🔽 Valor Promedio	2,579.08
<u> </u>	Aceptar 🔀 Cerrar

Registre cada día la relación de valor entre las distintas monedas negociadas. El registro asume unidades que se pagan en Moneda1 por cada unidad de Moneda2: p.e. 1.5 USD por EUR, donde USD es la Moneda1 y EUR es la Moneda2. Recuerde que aunque esté negociando monedas distintas al dólar, debe registrar también la tasa de conversión de cada moneda al dólar, de acuerdo con las tasas de conversión de monedas establecidas para el mercado por la SFC.

2.8.3.4. ELIMINAR MONEDA VS DÓLAR

🔺 Por Dolar - Eliminar 📃 🗖 🗙
Ingresar Datos
Fecha 30/06/2006 -
PWPREI - RESOLUCION 513
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?
<u>Sí</u> <u>N</u> o
Aceptar Cerrar

Escoja la información que desee eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.



2.8.3.5. CARGA DATOS MONEDA VS DÓLAR

🚢 Carga de Datos - Por Dolar 🛛 🔀
Cargue Automático
Tipo de Carga
(• INFUVAL (*.txt) C. Archivo Plano (*.txt) C. Archivo Excel (*.txt)
C Vista
e Imprimir Herrores Aceptar 🔀 Cerrar

La información por dólar, puede ser cargada por un archivo plano o por un archivo en Excel. En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto

2.2.1.1.6 tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.8.3.6. EXPORTAR A EXCEL MONEDA VS DOLAR

Opción que permite llevar a Excel, la información para emitir diversos informes.

3. CIERRE



El cierre es un proceso que debe realizarse diariamente

- Fecha Proceso de Cierre: Corresponde a la última fecha de portafolios.
- Fecha hábil siguiente: Corresponde al día inmediatamente siguiente.

Tipo de Cierre

- Normal: El que se realiza diariamente.
- Cerrar Uno: Cerrar un día que normalmente se abre para realizar una actividad particular.
- Abrir Uno: Abrir un día, para realizar una actividad particular.



Trasladar: Toma el portafolio y lo traslada para el día siguiente los títulos vencidos salen del portafolio, los compromisos cumplidos si son compras pasan a ser posiciones en el portafolio, si son ventas salen del portafolio.

No trasladar: Abre un nuevo día de procesamiento, pero no traslada las posiciones del portafolio del día anterior.

🧇 Cierre	×
Fecha Proceso de Cierre07/03/2019Fecha Habil Siguiente08/03/2019	TipoCierre Normal Cerrar Uno Abrir Uno
Portafolios Traslada::	Devolver Cierre O Borrar Esps Vencidas: O
Cierre Por Portafolio Nivel TODOS ACCION DE CIE	RRE
Aceptar 🛛 Cerrar	

Cuando se presiona el botón aceptar se realiza el cierre como se muestra en la imagen.



Borrar Especies Vencidas

Es el mantenimiento de Especies, cuyo propósito es permitir el borrado de las especies que no presenten movimiento sobre los portafolios desde una cierta fecha indicada por el usuario. Su funcionamiento es el siguiente:



1. Pulsar el botón "Borrar Esp. Vencidas" para que la pantalla de Cierres cambie:

😍 Cierre	×				
Fecha Proceso de Cierre 30/06/2008 💌	TipoCierre Normal C				
	Cerrar Uno 🔿				
Portafolios	Abrir Uno 🔿				
Trasladar: C No Trasladar: C	Berrar Esps Vencidas: 💿				
ACCIÓN DE MANTENIMIENTO Limpiar ESPECIES y PORTAFOLIOS VENCIDOS DESDE: 12/02/2002					
Aceptar 🔀 Cerrar					

2 Seleccione la fecha límite. Esta fecha le indica al sistema la vigencia a verificar antes de borrar una especie. Por ejemplo, si usted registra la fecha 31/12/2005 el sistema borrará las especies y las posiciones que no hayan registrado movimiento en los portafolios desde el 31 de diciembre en adelante. En otras palabras, si el último movimiento de la especie "CDTIFI" fue el 30/12/2005 la especie será borrada; pero si tiene movimientos en portafolios después de esa fecha no se borra. Se aclara, que lo que se verifica es si su portafolio ha presentado Compras o Ventas de la especie.

Al pulsar "Aceptar" el sistema despliega el siguiente mensaje:



Pulse "Si" si esta seguro, de lo contrario pulse "No" para descartar la operación. Al pulsar "Si" se da inicio el proceso. Cuando la barra de progreso llegue al final el sistema mostrará el mensaje: "Proceso terminado con éxito."

Se debe tener en cuenta que el proceso es bastante pesado y dependiendo del tamaño de su portafolio (Movimientos diarios del mismo) y los recursos de su instalación podría llegar a tardar un par de horas en ejecutarse; por lo que usted deberá elegir una hora



de poca o ninguna actividad para ejecutarlo a fin de no afectar los demás procesos.

4. INFORMES



Al dar clic en esta opción aparecerá la pantalla del Módulo Informes, donde se verán los informes de Riesgo, Valoración y Concentración.

linformes
Archivo
Opc./Forward
Riesgo
Valoración
Concentración
Salir

4.1. OPCIÓN FORWARD





4.1.1. INFORME FORWARD CONTRAPARTE

🏴 Inf. Forward Contrapartes 🛛 🛛 🔀
Buscar Por
09/07/2009 🕞 C Fecha Registro
Fecha Valoración 09/07/2009 👻
Josi 6172000
🔏 Aceptar 🔀 Cerrar

4.1.2. INFORME FORWARD

🖻 Informe Foward 🛛 🗙
Buscar Por
09/07/2009 🔍 💽 Fecha Registro
·
Fecha Valoración 09/07/2009 👻
,
Acentar 🔽 Cerrar



4.1.3. INFORME OPCIONES

🖻 Informe Opciones 🛛 🔀
Buscar Por
09/07/2009 🗨 🖲 Fecha Registro
Fecha Valoración 09/07/2009 💌
Aceptar 🔀 Cerrar

4.1.4. INFORME GAP

🖻 Informe GAP 🛛 🔀
Buscar Por
27/10/2010 🕞 🤄 Fecha Registro
27/10/2010 - 27/10/2010 - C Intervalo Fechas
Fecha Valoración 27/10/2010 💌
Aceptar 🔀 Cerrar



4.1.5. VANILLA

Para generar los formatos del Plan VANILLA.

- Indique la Fecha de Corte.
- Los datos de la entidad.
- Presione el botón Aceptar. Los formatos quedan en la carpeta "VANILLA"

🗂 Formatos			X
	Datos Básicos —		
	Fec de Medición	25/08/2010 💌	
	Tipo Entidad 🛛	085	
	Código Entidad 🥤	123	
	Clave 🛛	*****	
	UBICACION	PORTAFOLIOS	
	NIVEL	NOMBE	9E
	MITEL	1101101	12
Portafolio: F	ORTAFOLI 💌		
Portafolio: F	PORTAFOLI		

de su ambiente PwpRei respectivo.



4.2. OPCION INFORMES DE RIESGO



4.2.1. INVERSIONES

Este botón se encuentra deshabilitado

4.2.2. PARTICIPACION

Las funcionalidades descritas a continuación corresponden a:

• Informe Riesgo-Participación.

Observe la siguiente pantalla en el módulo de Informes:





Para generar el informe de participación proceda:

- 1. Seleccione la fecha para el informe.
- 2. Seleccione el Nivel para el que va generar el informe:
 - TODOS.
 - GRUPO.
 - LINEA.
 - PORTAFOLIO.
- 3. Seleccione el nombre del nivel: nombre del grupo, línea o portafolio.
- 4. Indique por qué concepto desea las participaciones:
 - Especie.
 - Emisor.
 - Título.
 - Calificación.
- 5. Indique el método para tomar los valores en riesgo de las posiciones incluidas en el grupo seleccionado, teniendo en cuenta que debe haber corrido un proceso de evaluación de riesgo para esa fecha por el método indicado:
 - Simulación Histórica.
 - Simulación de Montecarlo.
 - Delta Normal.
 - Duración Modificada.



Una vez seleccionados los parámetros pulse "Aceptar" y espere hasta que el sistema procese. Le aparecerá la pantalla:

Participación por ESP	ECIE					
NombreNivel	CodigoGr	NombreGr	Monto	ParticipaMor	aRAdi	ParticipaVaR
TODOS	BBPO0612SB2	BBP00612SB2	505,170,000	3.53	2,414,550.95	53.22
TODOS	CDTBB080	CDTBB080	539,243,128.66	3.76	330,103.02	11.02
TODOS	CDTBBOSOVD	CDTBBOSØVD	812,801,000	5.67	213,742.64	4.71
TODOS	CDTBCBS0VD	CDTBCBS0VD	2,038,481,500	14.22	424,287.23	9.35
TODOS	CDTBCRSOV	CDTBCRSOV	510,375,000	3.56	93,408.83	2.06
TODOS	CDTBGA10D	CDTBGA10D	520,425,816.75	3.63	215,617.62	4.75
TODOS	CDTBSCS5VD	CDTBSCS5VD	511,333,589.05	3.57	136,086.32	3
TODOS	CDTCFCS0VD	CDTCFCS0VD	503,380,000	3.51	130,435.83	2.88
TODOS	CDTDVISOVD	CDTDVISØVD	503,895,000	3.52	151,309.59	3.34
TODOS	CDTFALSOV	CDTFALSOV	715,911,000	5	127,911.82	2.82
TODOS	CDTFANSOV	CDTFANSOV	19,907,953.51	0.14	4,173.70	0.09
TODOS	CDTIVCSØV	CDTIVCSOV	512,570,000	3.58	89,351.20	1.97
TODOS	TFIT15240720	TFIT15240720	3,977,040,000	27.75	0	0
TODOS	TFIT16240724	TFIT16240724	2,661,060,000	18.57	0	0

18.57%	0088P00612552 000 T680 50 0 CD T680 50 VO 000 T60850VD 000 T608 50 V
3755	CO 156 A100 BCO TESCESVO BCO TOFICEOVO BCO TOVISOVO BCO TFALSOV
0.14%	CD TF AN SOV CD TIVOSOV D TF IT1 5240720 DTF IT1 6240724
Total de especie: 14 Total Monto: \$14,331,593,987.97 por el Metodo DELTA	
	tar Cerrar

EL gráfico inicial muestra las participaciones "X Monto", si desea puede pulsar la opción "X VaR" para ver las participaciones por valor en riesgo. Los valores en riesgo corresponden a la suma de los valores en riesgo individuales de cada posición incluido en el concepto de participación.

4.2.3. HISTORICO



🐨 Reporte Historico	
Buscar Por	
14/07/2009 💌	🔲 Fecha Inicio
14/07/2009 💌	🗖 (Fecha Fiina)
-	Seleccione la Fuente
	Seleccione las Especies
	(Maximo 31E species)
	Seleccione la Opcion
•	Aceptar 🔀 Cerrar

4.2.4. **REPORTE VaR**

🏦 Reporte de VaR	
Buscar Por 14/07/2009 14/07/2009	 Fecha Inicio Fecha Fiinal Seleccione el Nivel
	Seleccione la opcion



4.2.5. CONTRAPARTES



Después de seleccionar la fecha aparece el reporte de Concentración de Contrapartes. Esta imagen tiene dos formas de ver el reporte por Detalle o por Consolidado.

🙀 Reporte Concentracion de ContraPartes	
Reporte Concentracion de ContraPartes Detaile Organizar Organizar Por Grupo Por Grupo Por Tipo ContraParte Todas Inversiones Inversiones Por Tipo ContraParte Todas Inversiones Inversiones Port Tipo ContraParte Todas Inversiones Inversiones Portafolio Inversiones Portafolio Inversiones Proteines Inversiones Portafolio Inversiones Inversiones Inversiones	
Cer	rar



Reporte Concentracion de ContraPartes	
Detalle Consolidado CONCENTRACION DE CONTRAPARTES POR PUNTA	
CONCENTRACION	
CONCENTRACION TOTAL POR CONTRAPARTES	
	Cerrar

4.2.6. P&G



Después de seleccionar la fecha aparece el informe de Pérdida y Ganancia como la siguiente imagen.



尾 Informe Pérdida/Gananci	a
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio
# ≛• CLIENTES ⊯ ≛• PWP	Especie Depósito Número Dias al Vcto. Úl Tasa Nominal Tasa Efectiva Precio
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	09/07/2009 • • Fecha Liquidación • Fecha Compromisos Cerrar 03/07/2009 • • <td< th=""></td<>

Al presionar el botón Aceptar aparece la siguiente pantalla donde muestra tres pestañas TIR de Compra, Precios de Mercado y Utilidad en Venta.

alorización P	or Portafolio.						X	
TIR DE C	COMPRA P	RECIOS DE MERCAI	оо 👔 ит	ILIDAD EN	VENTA			
	GRU	PO		Fecha	∋s ——		Resultados Finales	
						Total ¥	alor Compra	
				Valorizaci	ón	\$ 0.000	0	
				09/07/20	009	Total V	aloración Mercado	
	Nombre CLIEN	TES			,	\$ 0.000	10	
	Joner	120		Liquidacio	on	Т-1-1 л		
				09/07/20	009	Total A	Guste	
						\$ U.UUL	JU	
					_	1		
Portafolio	Emisor	Especie	Val. Nominal Uni./Mo	n. Emisión 👌	Val. Nomir	hal	Val. Compra Uni./Mon. Emi 🔨	
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIEF	A CDTCNFS0V	23,1	83,985.00	23,	183,985.00	\$ 23,544,03	
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIEF	A CDTCNFSOV	100,0	00,000.00	100,	000,000.00	\$ 100,000,000	
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIEF	A CDTCNFSOV	80,0	00,000.00	80,	000,000.00	\$ 80,000,00(
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A	CDTDVISOV	4,6	20,774.60	4,	620,774.60	\$ 4,628,67(
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A		10,5	09,012.00	10,	509,012.00	\$ 10,580,22	
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A	CDTDVISOV	6,0	00,000.00	6,	000,000.00	\$ 5,956,095	
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A.	C CDTFALSOV	3,3	08,982.00	3,	308,982.00	\$ 3,315,092	
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A.	CCDTFALSOV	24,1	27,015.00	24,	127,015.00	\$ 24,497,298	
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A.	CCDTFALSOV	2,9	30,079.00	2,	930,079.00	\$ 3,077,526	
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PI	CH CD TFINSOV	3,5	00,710.00	3,	500,710.00	\$ 3,650,415	
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PI	CECTFINSOV	1,0	00,000.00	1,	000,000.00	\$ 1,012,17	
				07 OEO 001	2	202 0E0 UU	• 2 202 E7(
Exportar Resultado Cerrar								



🗐 Valorización Por Portafolio.					×			
TIR DE COMPRA	PRECIOS DE MERCAI	DO L	UTILIDAD EN	VENTA				
GRUPO Nombre CLIENTES			Fechas Valorización 09/07/2009 Liquidación 09/07/2009	Res Total ¥aloraci \$ 42,780,500.8280 Total ¥aloraci \$ 0.0000 PyG + Interés \$ 16,986,620.9800 PyG in Interé * 42,780,500.830	sultados Finales ón Mercado ón Mercado 5 ón (Hoy - Ayer) 10			
Portafolio Emisor VAMCOL C.F.C. CONFINANC	Especie CIERA CDTCNFSØV	Val. Nomin	al Uni./Mon. Emisión 23,183,985.00	Val. Nominal 23,183,985.00	Val. Compra Uni./Mon. Emist			
VAMCOL C.F.C. CONFINANC	CIERA COTONESOV		100,000,000.00	100,000,000.00	\$ 100,000,000.1			
VAMCOL C.F.C. CONFINANC	CIERA COTONESOV		80,000,000.00	80,000,000.00	\$ 80,000,000.1			
VAMCOL BCO. DAVIVIENDA	S.A CDTDVISOV		4,620,774.60	4,620,774.60	\$ 4,628,670.1			
VAMCUL BCO. DAVIVIENDA	S.A CDTDVISOV		10,509,012.00	10,509,012.00	\$ 10,580,227.1			
VANCOL BUUL DAVIVIENDA			5,000,000.00	5,000,000.00	\$ 5,956,095.1			
			24 127 015 00	2/ 127 015 00	\$ 3,313,032.1			
VAMCOL CMB FALABELLAS			2 930 079 00	2 930 079 00	\$ 3 077 5261			
VAMCOL C.F.C. INVERSORA	A PICH CDTFINSOV		3,500,710.00	3,500,710.00	\$ 3,650,419,1			
	PICKCDTEINSOV		1 000 000 00	1 000 000 00	¢1012177i			
				D Re	xportar 🔀 Cerrar ssultado			



4.2.7. RIESGO DE LIQUIDEZ

Para generar los informes de riesgo de liquidez simplemente siga, diariamente, las siguientes instrucciones en forma ordenada:



- Carga de Portafolios: Recuerde que su portafolio de posición propia que usa para el riesgo de mercado es el mismo que usaremos para el riesgo de liquidez, solamente adicionándole la cuenta PUC. Para cargar los dos portafolios (Propio y Clientes) utilice al plantilla Excel adjunta "PuebaRLIQ.xlsx". La definición técnica de la plantilla se encuentra en "FormatoCargaRLIQ.xls". Si tecnología le genera esta interfaz, hágales llegar esta definición técnica. Recuerde que:
 - a. Debe crear un portafolio para cargar ahí las operaciones por cuenta de terceros.
 - b. El campo "Contraparte" debe ser diligenciado con el código de la contraparte con quien hizo el negocio. Con esto el sistema diferencia si la operación es cruzada o convenida. Para ello también es necesario que en su código de contraparte este registrado su NIT exactamente igual como se encuentra cuando usted ingresa por "Parámetros", "General", "Empresa". El sistema compara estos dos datos para identificar si la contraparte es la misma firma y entonces determinar si la operación es cruzada o convenida.
 - c. El campo "PUC" solo es necesario para las posiciones correspondientes a "Activos Líquidos", pero si quiere colocarla para sus compromisos no molesta.
 - d. Los campos "TipoId", "NroId" y "Nombre" solo son necesarios para el portafolio de operaciones por cuenta de terceros. Para su propio portafolio no aplican.
- 2. **Disponible:** Registre el valor del disponible (PUC No. 110000) en PwpRei así:
 - a. Ingrese por "Mercado y Sociedad"
 - b. Seleccione la pestaña "Valores Super"
 - c. Seleccione la Opción "Datos Netos"
 - d. En la parte superior seleccione "Ingresar". El sistema le trae automáticamente los datos netos del último día operativo.
 - e. En el campo "Disponible" ingrese el valor del disponible. El dato seguramente se lo suministrarán en contabilidad y corresponde al saldo de la cuenta PUC 110000.
- 3. **Cargar**: No olvide cargar mensualmente los Haircuts publicados por el Banco de la República.
- 4. **Generar los Informes:** Para generar los informes diariamente presiones el botón RIESLIQ



🗇 Formatos			X
	Datos Básicos		
	Fec de Medición 🚺	/10/2010 💌	
	Tipo Entidad		
	Código Entidad		
	Clave		
	UBICACION P	ORTAFOLIOS	-
	NIVEL	NOMB	RE
Compañía 🛛	•		-
Clientes			
Cilcines	•		_
	Aceptar	Ver 475	Cerrar

Dónde:

Fecha de Medición es la fecha para tomar los portafolios. Tipo Entidad, Código Entidad y Clave son los datos normales que usted utiliza al generar los informes para la SFC. Nivel corresponde al nivel donde está colgado el portafolio a leer. Puede ser "GRUPO", "LINEA" o "PORTAFOLIO". Seleccione el nivel tanto para la compañía como para clientes. Nombre corresponde al nombre de ese nivel. Seleccione el nombre respectivo donde están los portafolios a leer.

Una vez ingresados los datos anteriores pulse "Aceptar" y el sistema generará los archivos. Debe aparecer el mensaje:



Si le aparece un mensaje de error ya sabe que estamos a su disposición

Los archivos a transmitir quedan en la carpeta "CRLIQ" bajo su carpeta PwpRei. Debe ver



dos archivos con nombres de la forma: "CRLIQPROddmmyyyy.txt" y

> "CRLIQCLIddmmyyyy.txt", correspondientes a los formatos 475 y 476 respectivamente. Se generan dos porque estos formatos tienen distinto "Tipo de Informe".

5. **Ver Resultados:** Para ver los resultados obtenidos utilice el botón "Ver 475" que le permite generar el informe 475 en una plantilla Excel. Como ya sabe en este informe aparece el Indicador de Riesgo de Liquidez.

STRESS Y BACK TESTING RIESGO DE LIQUIDEZ

- 1. Puede aplicar Stress Testing a cualquier par de portafolios Compañía – Cliente que desee Evaluar, con opción de estresar las variables:
 - a. Activos Líquidos.
 - b. Obligaciones.
 - c. Indicador de Riesgo de Liquidez.
 - d. Estas variables se pueden Castigar (-) o Mejorar (+)
- Solo podrá aplicar Back Testing al conjunto de portafolios Compañía – Clientes que haya manejado corrientemente en el periodo.
- 3. Para el Back Testing se requiere que se haya generado el indicador de Riesgo de Liquidez durante el periodo de evaluación, al mismo par de portafolios Compañía – Clientes administrado corrientemente.
- Para utilizar estas funciones Ingrese normalmente por "Informes – Riesgo –RIESLIQ". Obtendrá una pantalla ampliada, como se muestra en la figura:



🚰 Riesgo de Liquidez		X				
	Datos Básicos Fecha Inicial 23/01/2011 Fec de Medición 23/02/2011 Código Entidad					
PROCESO	Confianza Clave					
FORMATOS	Act. Liq. Obligacs. Terceros IRL STRESS (%):					
O STRESS TESTING	UBICACION PORTAFOLIOS					
C BACK TESTING	Compañía NIVEL NOMBRE	•				
	Clientes	•				
Acepte	ar 🔀 Ver 475-476 🚺 Cerrar					

- 5. En la parte izquierda de la pantalla, en el recuadro PROCESO, encuentra las opciones pertinentes:
 - a. FORMATOS. Le permite generar sus formatos de RLIQ, como lo ha venido haciendo normalmente.
 - b. STRESS TESTING. Activa las casillas de stress. Usted debe:
 - i. Seleccionar la fecha de Medición.
 - ii. Indicar los porcentajes de Stress, positivos o Negativos en las casillas frente al título STRESS (%).
 - iii. En las casillas donde indique ningún porcentaje se asume cero (0).
 - iv. Seleccione el par de portafolios, como lo hace normalmente para generar los formatos.
 - v. Luego de pulsar el botón "Aceptar" y que el sistema ejecute el proceso, le aparecerá la pantalla de resultados, como se ve en la figura:



3 Stress Testing							
DATOS DE ENTRADA			F	RESULTADOS E	ACK TEST	ING	
Act. Liq. Obligg STRESS (%): Fec de Medición 07/11/2009 Image: Constraint of the state of the	acs. Terceros IRL 10 5 Encontrados		Mínimo IRL Var	ianza Desv.	Media IRL Std. F	>ercentil	láximo IRL Percentil
Concepto	UniCap SubC	ienti (Columna 01	Columna 02	Columna 03	Column	a 04
	1	5	990,000.00				
	1	15	1,080,068.00				
	1	999	2 070 792 00			<u> </u>	
		000	2,010,102.00				
	2	5		873,000.00			
TOTAL OBLIGACIONES ACTIVAS EN CUENTA PROPIA	2	999		873,000.00			
	2	10		990 000 00			
TOTAL OBLIGACIONES PASIVAS EN CUENTA PROPIA	3	999		990.000.00			
REQUERIMIENTO DE LIQUIDEZ DE CUENTA PROPIA (RLcp=FOAcp - FOPcp)	4	5		117,000.00			
PEOLIEPIMIENTO DE LIQUIDEZ DE OBLIGACIONES POR CUENTA DE TERCEROS	7	5				—	
	- /						
FLUJO OBLIGACIONES NETAS DERIVADOS (FONd=FOAd-FOPd)	10	5					
		_	0.070.700.00				
INDICADOR DE RIESGO DE LIQUIDEZ IRL=AL+RLcp	11	5	2,070,792.00				
🖉 Exportar 🔀 Cerrar							

- vi. Puede exportar esos resultados a Excel para sus posteriores análisis.
- c. BACK TESTING. Activa las casillas de Back. Usted debe:
 - i. Seleccionar la fecha de inicio de periodo de evaluación.
 - ii. Seleccionar la Fecha Final o de medición.
 - iii. Recuerde que durante este periodo debe haber generado el IRL. El sistema no le pedirá conjunto de portafolios, pues asume que todos los datos de IRL que encuentre en ese periodo corresponden a su conjunto de portafolios corrientemente evaluado.
 - iv. Indique el Nivel de Confianza en la casilla correspondiente.
 - v. Al pulsar "Aceptar" se le presentará una pantalla de resultados, como se ve en la figura:



Back Testi	ng							_ 🗆 🗙
DATOS DE ENTRADA				RESULTADOS BACK TESTING				
STRESS (BACK TES	%): Fec de Medic T: Fecha Inicial	ión 07/11/2009	Act. Liq. Oblig 0 0 Niv. Conf. 95 Dates	acs. Terceros IRL 0 0 0 0 0	M [51	inimo IRL 164,464.00 Varianza Desv 3,611,015,074.00 716,6	Media IRL 2,543,289.00 v. Std. Percentil(5%) 66.60 1,975,124.80	Máximo IRL 4,184,961.00 Percentil(95%) 3,736,841.10
(Fecha	Dato)	(Numero Dato)	(Dias Al Dato)	0	'alor Dato)	(Distancia A Media)	(Distanc	ia A Media)^2
200	9/11/01	1	0		1,964,464.00	-578,825.00	33	5,038,380,625.00
200	9/11/02	2	1		2,000,000.00	-543,289.00	29	086 055 584 00
200	9/11/04	4	2		2 691 228 00	1,041,072.00	2,03	885 947 721 00
200	9/11/05	5	4		2.391.766.00	-151.523.00	2	.959.219.529.00
200	9/11/06	6	5		2,499,812.00	-43,477.00		,890,249,529.00
200	9/11/07	7	6	:	2,070,792.00	-472,497.00	22	3,253,415,009.00
RESULTAD	08>	Vledia: 2,543,289.00	Varianza: 513,611,015,074.00	Desv.Str	: 716,666.60	Perc.lzq(5%): 1,975,124.80	Perc.Der(95	% <u>): 3,736,841.10</u>
			💋 Exportar 🔀) Cerrar				

vi. Puede exportar esos resultados a Excel para sus posteriores análisis.

4.2.7.1. RIESGO DE LIQUIDEZ BANCOS

Para generar el formato 458, por favor proceda:

- 1. Ingrese al módulo "Informes Riesgo"
- 2 Pulse en el ícono "RIESLIQ". Le aparece la pantalla:

Responde Liquide: Datas Básicos Peda Inicial Peda Inicial Peda Inicial Peda Medición Peda Medi	Riesgo		
Wind Verd	Inversiones		
Recigo de Liquide: PROCESO PROCESO PROCESO PEORMATOS PEORMATOS PROCESO PROCESO PEORMATOS Proved PROCESO PROCESO PROCESO PROCESO Proved PROCESO Proved PROCESO Proved PROCESO Proved PROCESO Proved Proved <th>Participación</th> <th></th> <th></th>	Participación		
Methods Service Se	and a	Riesgo de Liquidez	- Diates B Asiens
Wind Conference Wind Conference Core Core Core Core Core Core			Fecha Inicial 02/10/2012 V Tipo Entidad
In Parter In Parter	Conte Vari	PROCESO	Nivel Confianza Clave
Comparia BACK TESTING UBICACION PORTAFOLIOS Comparia NIVEL NUMBRE Comparia Comparia <th>ntraPartes</th> <th>(* FORMATOS</th> <th>Act. Lq. Oblgacs. Terceros IRL STRESS (%):</th>	ntraPartes	(* FORMATOS	Act. Lq. Oblgacs. Terceros IRL STRESS (%):
Forward Accrete Sait Sait <th>5%G</th> <th></th> <th>UBICACION PORTAFOLIOS</th>	5%G		UBICACION PORTAFOLIOS
/Forward erstrasión Salar Salar € Cargar € Aceptar № Ver 458 ⊠ Cerrar	IESLIQ	C BACK TESTING	Con Portaf. NIVEL NOMBRE
extración sala Esta	/Forward		Compañía
easón site Cargar 🔊 Ver 458 🔽 Cerrar	intración		
Sir Sir Cargar Acceptal Sir Ver 458 Craa	ación		
	alir	😂 🛛	argar 🔊 Aceptar 🔀 Ver 458 🔀 Cerrar



3. Cargue los datos de las unidades de captura y subcuentas que no son generadas o calculadas por el sistema. En el archivo Excel "F458IdentificacionDatosManuales" en la columna X se muestra la lista de subcuentas que se deben cargar. El archivo Excel "FormatoCarga458_Y_Ejemplo" se muestra la forma de acomodar los datos para la carga. En esta estructura la columna "FechaRegistro" corresponde a la fecha de proceso para generar el formato. Para cargar los datos pulse el botón "Carga" de la pantalla anterior y le aparecerá:



4. En esta pantalla utilice el botón "Cargar" para subir la hoja Excel al sistema. Si desea ver lo que hay cargado a una fecha determinada, seleccione la "Fecha Registro" y luego pulse "Ver". Le aparecerá una pantalla como la siguiente:





La columna "Tipo" contiene dos códigos:

- XUNI: indica que son datos cargados por usted.
- XPAR: indica que son datos calculados por el sistema, a partir de parámetros y del portafolio o cálculos determinados por el instructivo del formato.
- 5. Generar el formato. Regrese a la pantalla inicial y registe o seleccione los siguientes datos:
 - a. Tipo Entidad: registre el tipo de entidad que le corresponde según la SFC.
 - b. Código Entidad: registre su código entidad, según la SFC.
 - c Palabra Clave: registre la clave asignada por la SFC.
 - d. Con Portafolio: Si no desea que el sistema genere datos a partir del portafolio, porque usted cargó las subcuentas correspondientes, quite el chulo de este campo. En caso de que si desea procesar un portafolio vaya a los campos frente a la etiqueta "Compañía":
 - Bajo "Nivel" seleccione Grupo, Línea o Portafolio.
 Esto indica a qué nivel v a tomar el portafolio.
 - i. Bajo "Nombre" seleccione de la lista el nombre del Grupo, Línea o Portafolio a procesar.
 - e. Pulse "Aceptar" y el sistema le genera el archivo plano



que debe transmitir a la SFC. Este archivo queda bajo la carpeta "CRLIQ" que está dentro de la carpeta PWPREI correspondiente al ambiente que está trabajando: PwpRei, PwpReiPruebas, etc; como le haya llamado.

6. Ver el formato. Para ver el formato 458 en la plantilla, utilice el botón "Ver 458". Seleccione una ubicación destino y el sistema exportará a Excel el archivo plano generado. Esto le facilitará sus revisiones.

4.2.7.2. RIESGO DE LIQUIDEZ – FORMATO 531

A continuación describimos el proceso operativo para generar el formato 531, Riesgo de Liquidez. Siga los pasos siguientes:

- 4. Copie la plantilla adjunta "Formato_531.xls" a la carpeta Plantillas que está bajo la carpeta C:\PwpRei o su equivalente en el ambiente que esté probando.
- 5. **Carga de Portafolios.** Se utilizará la misma información alimentada para el formato 508. Recuerde que este formato tiene como base el 508 y por tanto la fuente debe ser la misma para que haya coherencia.
- Disponible y Significancia de Monedas. El disponible está ahora separado por moneda. Cargue la tabla de disponible por moneda, con sus significancias. Al hacer este proceso el sistema procederá:
 - a. Alimentará las significancias de cada moneda.
 - b. Alimentará el disponible de cada moneda. Adicionalmente, si existe a la fecha el valor de las monedas alimentadas, se actualizará el disponible acostumbrado así:
 - i. El disponible alimentado para COP se actualizará en el campo "Disponible COP" de "Datos Netos" que se usa en el 508. Usted podrá igual modificar este dato general en "Datos Netos", pero se supone que debe ser coherente con la tabla alimentada.
 - ii. La sumatoria de los disponibles en las otras monedas, convertidos a COP, se actualizará en el campo "Disponible MExt" de "Datos Netos" que se usa en el 508. Usted podrá igual modificar este dato general en "Datos Netos", pero se supone que debe ser coherente con la tabla alimentada.

Para alimentar al tabla de significancias y disponibles proceda:

c. Ingrese por "Mercado y Sociedad"



- d. Seleccione la pestaña "Valores Súper"
- e. Seleccione la Opción "Datos Netos"
- f. Si no ha ingresado los datos a la fecha de proceso, pulse "Ingresar". De lo contrario pulse "Modificar" para cambiar el registro a la fecha de proceso.
- g. A la derecha de "Disponible COP" y "Disponible MExt" seleccione "XMoneda"
- h. Seleccione el archivo a cargar y el sistema alimentará la información. Use la hoja "CargaDisponible" que está en el archivo Excel "FormatosTodasEntrada.xls" como formato para alimentar los datos:

Ng 🕼 🛃	P 🗉 💔						
Valores Super	Fecha Dato Pa	atTecnico	APNR	Rle	R.Derivados	Disponible	Disp. MonExt
	03/10/2016 \$	1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.	.0 \$0.0	\$0.0	\$ 1,000,000,000.0	\$0.0
<u> </u>	📅 Datos Netos - Modifi		8	🙁 Disponibles por Moneda.			
VIr. Factores	In second Dates			FechaDato Moneda	Disponible Significa	ancia	
.13	Ingresar Datos			03/10/2016 COP	1,200,000,000	87.56	
AC	Fecha Carga 03/	10/2016 💌		03/10/2016 EUR	280,000	2.47	
Correlación	PatTecnico \$1,	000,000,000.0		03/10/2016 JPY	800,000,000	0.25	
	APNB S50	0 000 000 0		03/10/2016 IRM	670,000	7.45	
••••	Disconible COR		Moneda				
Ctas Pat.	pisponible con \$1,	000,000,000.0					
rechico	Disponible MEXI \$ 0.	<u>ା</u> (ରୁ. ମି	er.X.Mon				
	Rle \$0.	0					
VIr Ctas APNR	Riesgo Derivados \$ 0.	0					
A	,						
- 2 88-							
Datos Netos	APNR 🔬 A	ceptar 🔀					
Matrices SFC							
			l			li.	
Mercado							
Valores de							
Especies							
Historico Medo							
INFO) (AL							
INPOVAL							
Mogocies							

- 7. Haircuts. Son los mismos datos alimentados para el 508
- 8. GENERAR EL FORMATO. Para generar el informe proceda:
 - a. Ingrese por "Informes".
 - b. Seleccione la pestaña "Riesgo".
 - c. Seleccione la opción "RIESLIQ". Le aparecerá la siguiente pantalla:



INFORMES		
Archivo		
Riesgo		
Participación		
Histórico	🖀 Riesgo de Liquidez	
ना	Datos Básicos	
Reporte VaR	Fecha Inicial 03/09/2016 Tipo Entidad 04	
	Fec de Medición 03/10/2016 🗸 Código Entidad 33	
ContraBartes	PROCESO Nivel Confianza Clave xxxxxxxxx	
	C FOR 508 C FOR. 531 7D fas	
	C FOR 475 UBICACION PORTAFOLIOS	
<u>~</u>	© FORMATOS	
RLQFICS		
⊾ <i>≣</i> 2		
Generar		
desde Excel		
	🛛 🐼 Cargar 🔊 Aceptar 🔀 Ver 531 🛛 🔀 Cerrar	
Upc./Forward		
Concentración		
Valoración		

Pulse en "7 Días" si desea el formato solo para el plazo a 7 días.

d. Una vez ingresados los datos anteriores pulse "Aceptar" y el sistema generará el archivo. Debe aparecer el mensaje:



Si le aparece un mensaje de error ya sabe que estamos a su

disposición

- e. Los archivos a transmitir quedan en la carpeta "CRLIQ" bajo su carpeta PwpRei. Debe ver un archivo con nombre de la forma: "RLQ531PRODDMMAAAA.txt".
- 9. **Ver Resultados.** Para ver los resultados obtenidos utilice el botón "Ver 531" que le permite generar el informe 531 en una plantilla Excel.



4.2.8. **RLQFIC – FORMATO 519**

Para la generación del formato 519, los pasos son:

1. Datos en la definición de los portafolios.

Como es normal en PWPREI, las posiciones del FIC se ingresan en uno o más portafolios, según la estructura jerárquica que usted haya definido. Si a un FIC le corresponde más de un portafolio, a esos portafolios debe asociarles el mismo código del FIC y la categoría que le corresponda, en los campos como se muestra en la figura:

🙀 Portafolio - Modificar
Nombre
CLIMAR1
Tipo Linea de Negocio
Beneficiarios Custodio
900338073-4 V SIN CUSTODIO V
Cuenta Custodio
Categoria del FIC
Tipo de Fondo/Fidecomiso
FONDO DE VALORES 🗨 3
Estado
Acceptar 🔽 Course

2. Participaciones en Fondos.

Para identificar las inversiones que sus fondos tengan en otros fondos que cumplan con las características para que tales inversiones deban ser incluidas como parte de los activos líquidos en la unidad de captura 7 subcuenta 20, la especie respectiva se debe registrar, en el campo Estado Neg, como se ve en la figura:


• **FIC**:

Especies/Re	nta Variable - Modifio	car		×
Código Calificación Estado Emisor Zipo Título Descripción Categoría	FIC01 ACTIVO ZPW FONDOS DE VALORES MI FIC MOENTARIO SI 0 GI	Fec. Evento ISIN Tipo Especie Moneda S N PERMAN. rupo de Calificación	AAAAMMDD ACCION COP	•
Estado de Nec FIC SIN PAC. Bursatilidad Tipo NINGUNA Porcentaje 0.000 Factor1	Factor 2	Fecha Patrimonial 24/11/2015 Fecha Nominal 24/11/2015 Fecha Fiscal 29/12/1899 Acc. Circulación Portafolio Destino	Valor Patrimonial 1.00000000 Valor Nominal 1.00000000 Valor Fiscal 0	
Superfinanciera Código SF CC Calificadora CI	Aval CV	Emisión	Fungible	
		Į.	Aceptar 🚺 Ce	rrar



• Extranjero

Especies/R	enta Variable - Modifi	car	×
			AAAAMMDD
Código	FONEXT	Fec. Evento	
Calificación		ISIN	
Estado	ACTIVO	 Tipo Especie 	ACCION
Emisor	ZPW	▼ Moneda	TRM
Tipo Título	FONDOS DE VALORE	S	•
Descripción	FONDO EXTRANJERO)	
Categoría	0 G	rupo de Calificación	0
Estado de Ne MERCADO I Bursatilidad- Tipo NINGUNA Porcentaje 0.000 Factor1	Factor 2	Fecha Patrimonial 24/11/2015 Fecha Nominal 24/11/2015 Fecha Fiscal 29/12/1899 Acc. Circulación Portafolio Destino	Valor Patrimonial 0.00000000 Valor Nominal 0.00000000 Valor Fiscal 0 0
- Superfinanciera Código SF [0 Calificadora [0	Aval	Emisión	Fungible
			Aceptar 🔀 Cerrar

3. Serie Histórica del FIC.

Es necesario alimentar en PWPRE la serie histórica del FIC, correspondiente a los retiros netos y al valor del FIC, diarios. La primera vez cargue la serie desde el nacimiento del FIC hasta la Fecha Registro o de proceso actual y en subsiguientes veces solo alimente lo de la Fecha Registro en proceso para actualizar la serie, de esa forma quedará registrada la



información en forma continua como se requiere.

Para hacer lo anterior ingrese a "Informes – Riesgo – RLQFICS, como se muestra en la figura:

Riesgo	FICs - Riesgo de Liquidez - Formato 519		- • ×
Inversiones		ConLista 🔽 Seleccionar Todo	
Participación	Fecha Inicial 30//03/2015 Tipo Entidad 0/4 Fec de Medición 30//03/2015 Código Entidad 33		
Histórico	Recordar Clave Processor		
Reporte VaR			
PyG	Código FIC:	Ver 519	Cerrar
RLQFICS			
Generar desde Excel			
Opc./Forward			
Concentración			
Salir			

Pulse la opción "Ratios y Carga", se muestra la pantalla:

rilesgo	HCs - Riesgo	de Liquidez - Formato 519			
		VOMBRE	ConLista PORTAFOLIO	🗖 Seleccionar Todo	
Participación	Fecha Inicial Fec de Medición	Dede Hasta			
Histórico		30/03/2005 - 30/03/2015 -	ICODOS Image: Transmission of the second secon	© Excel C Vista C Sp C WSrv	Eliminar Exporta
ContraPartes				ADULAT HEILUS ADULES	
<mark>₽y</mark> G	& Ratios ;	l	4		
♦ Generar desde Excel					
Opc./Forward					
Valoración Salir		<			Þ

Para cargar la información puede elegir:

- a. Carga por Excel. Seleccione el archivo Excel con la información del o los FICS a alimentar, use la plantilla "FormatoCargaSerieFIC.xlsx" o use la hoja "SerieFICS" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls".
- b. Carga por Vista. Esta opción se muestra por defecto en caso de que su área de tecnología haya configurado un acceso directo a los datos por Vista. En este caso no necesita seleccionar ningún archivo.



- c. Carga por Sp. Esta opción se muestra por defecto en caso de que su área de tecnología haya configurado un acceso directo a los datos mediante un store procedure. En este caso no necesita seleccionar ningún archivo.
- d. Carga por Wsrv. Esta opción se muestra por defecto en caso de que su área de tecnología haya configurado un acceso directo a los datos mediante un Web Service. En este caso no necesita seleccionar ningún archivo.

Condiciones para la carga. Antes de proceder a cargar, debe establecer las condiciones:

- Fecha Inicial. Fecha inicial para la carga. El sistema cargará solo los datos que correspondan a registros con una fecha mayor o igual a la fecha inicial indicada, con independencia de que la fuente haya entregado más datos. Por ejemplo, si la fuente es un Excel y en la hoja Excel hay filas con Fecha Registro menor a la fecha inicial, esas filas no serán cargadas.
- Fecha Final. Fecha final para la carga. El sistema cargará solo los datos que correspondan a registros con una fecha menor o igual a la fecha final indicada, con independencia de que la fuente haya entregado más datos. Por ejemplo, si la fuente es un Excel y en la hoja Excel hay filas con Fecha Registro mayor a la fecha final, esas filas no serán cargadas.
- Código del FIC. Código del FIC del que se va a cargar la serie. Si elige "TODOS" se cargarán los datos de todos los FICs que se encuentren en la fuente. Si elige un FIC en particular el sistema cargará solo los datos que correspondan a registros con ese código de FIC, con independencia de que la fuente haya entregado más datos. Por ejemplo, si la fuente es un Excel y en la hoja Excel hay filas con códigos FIC distintos al indicado, esas filas no serán cargadas.

Una vez establecidas estas condiciones pulse "Cargar". El sistema cargará la información y al terminar la pantalla:

Software S.A.S

PWPREI – RIESGO E INVERSIONES

NIVEL	▼ NOMBRE		TAFOLIO	if I odo		
Fecha Inicial Fec de Medición	Datos Históricos FICs					_
	Dede Hasta	Código FIC	Ver Excel C	Vista	¥ Eliminar	
	30/03/2005 - 30/03/2015			WSrv		
	FechaBenistro	CodigoEIC E			Anulaciones	ValorNetoFIC
	30/03/2015	1 490 Es	pere un momento mientras se	cargan los datos.	294,066,80	490 183 785 694 78
	30/03/2015	1 490			294.066.80	490.183.785.694.78
	29/03/2015	4 335,692,770.99	2.014.156.625.97 1.00	6,929 50,346,484,50	201,385.80	335.692.770.996.20
	29/03/2015	1 490,111,445.24	2 940 669 671 47 1 47	0 117 73 505 867 32	294,023.40	490,111,445,245.20
S Ratios 1	28/03/2015	4 335,643,230.05	Informes		201,356.20	335,643,230,054.90
1	28/03/2015	1 490,039,115.47			293,980	490,039,115,471.48
	27/03/2015	4 335,593,696.42			01,326.40	335,593,696,425.24
	27/03/2015	1 489,966,796.37			93,936.60	489,966,796,372.03
	26/03/2015	4 335,544,170.10	Datos leidos:19	99, datos cargados:1999.	01,296.60	335,544,170,105.33
	26/03/2015	1 489,894,487.94	_		93,893.20	489,894,487,945.24
	25/03/2015	4 335,494,651.09			201,267	335,494,651,094.07
	25/03/2015	1 489,822,190.18			93,849.80	489,822,190,189.52
	24/03/2015	4 335,445,139.39		Aceptar	01,237.20	335,445,139,391.17
	24/03/2015	1 489,749,903.10			93,806.40	489,749,903,103.26
	23/03/2015	4 335,395,634.99	2,012,373,809.96 1,00	6,038 50,301,920.68	201,207.60	335,395,634,994.73
	23/03/2015	1 489,677,626.68	2,938,065,760.10 1,46	8,816 73,440,804.14	293,763.20	489,677,626,684.86
	22/03/2015	4 335,346,137.90	2,012,076,827.42 1,00	5,889 50,294,497.21	201,177.80	335,346,137,904.45
	22/03/2015	1 489,605,360.93	2,937,632,165.60 1,46	8,599 73,429,965.87	293,719.80	489,605,360,933.52
	21/03/2015	4 335,296,648.11	2,011,779,888.71 1,00	5,741 50,287,074.84	201,148.20	335,296,648,118.44
	21/03/2015	1 489,533,105.84	2,937,198,635.08 1,46	8,382 73,419,129.21	293,676.40	489,533,105,846.85
	20/03/2015	4 335,247,165.63	2,011,482,993.81 1,00	5,593 50,279,653.56	201,118.60	335,247,165,636.40
	20/03/2015	1 489,460,861.42	2,936,765,168.53 1,46	8,165 73,408,294.14	293,633	489,460,861,423.24
	• • • • • • • • • • • • • • • • • • •					

Puede utilizar las demás opciones en la parte superior de la pantalla:

- Ver. Permite consultar la serie, con las condiciones que establezca: Fecha Inicial, Código FIC.
- Eliminar. Permitir eliminar datos de la serie, con las condiciones que establezca: Fecha Inicial, Código FIC.
- Exportar. Exporta a Excel los datos actualmente listados en pantalla.
- Errores. Este botón se activa cuando se presentan errores en la carga y al pulsarlo muestra en pantalla la lista de errores.

Pulse "Salir" para volver a la pantalla de generación del formato.

4. Procesos Previos.

- a. Portafolio. Debe cargar el portafolio de los fondos diariamente. Utilice la opción regular que normalmente usa para alimentar sus portafolios.
- b. Haircuts. Debe actualizar los haircuts cada vez que el BRP los publique. Vea las notas del 508 (BOFNotasOperativas - CRLIQ508.doc), numeral 4, para instrucciones al respecto.
- c. Especies Elegibles. Debe actualizar las especies elegibles. Vea las notas del 508 (BOFNotasOperativas CRLIQ508.doc), numeral 4, para instrucciones al respecto.

5. Generación del Formato.

Para generar el formato, proceda, en la pantalla siguiente:



Riesgo	🛱 FICs - Riesgo de Liquidez - Formato 519		x
Inversiones Participación	NIVEL NOMBRE Image: Concentration of the second se	ista Seleccionar Todo	
Histórico			
ContraPartes	Código FI	TO 519 generado con exito <mark>.</mark> Vealo en su carpeta CRLIQ de su an Pulse Ratios y Carga para ver el IRL.	nbiente
			Aceptar
Generar desde Excel Opc./Forward			
Concentración Valoración			
Salir			

- Seleccione el conjunto de portafolios donde están las posiciones de los FICs que deben involucrarse en el formato. Para ello tiene 2 opciones:
 - Por Nivel. Seleccione un nivel y nombre de ese nivel. Este debe corresponder al nivel que contiene todas las líneas o portafolios donde están las posiciones de todos los FICs a genera.
 - Por Selección. Pulse la opción "Con Lista". Inmediatamente le aparece la lista de todos los portafolios que tiene configurados en PWPREI. Seleccione los que contienen las posiciones de los FICs a generar. El sistema los agrupará por código de FIC para generar el formato.
- Indique la fecha de corte (Fecha Medición) de los datos. El sistema generará el formato desde el primer día hábil de esa semana hasta la Fecha Medición indicada. Como podrá ver en la pantalla, la Fecha Inicial que se muestra aquí siempre es el primer día hábil de la semana de Fecha Medición.
- Datos de su sociedad. Indique los datos de la sociedad para trasmisiones a la SFC. Pulse "Recordar" para que el sistema los conserve y no deba digitarlos la próxima vez. Si ya genera otros formatos en PWPREI y ha usado esta opción, ya deben estar "recordados".
- Generar. Una vez establecidas las condiciones, pulse "Aceptar". El sistema genera el formato y le aparece el mensaje de archivo generado como está en la pantalla de arriba. Pulse "Ratios y Carga" si desea ver los índices:



Riesgo	🔄 FICs - Riesgo de Liqui	dez - Formato 519					- • ×	٢		
		Datos Histórico:	; FICs		atan Ch	Roome Tab				- • • × •
Participación	Fecha Inicial 30/03	Dede 30/03/2015 -	Hasta 30/03/2015 💌	Código FIC (TODOS)	Ver	<pre></pre>	Vista WSrv	🗙 Eliminar 📘	Exportar	Salir
Histórico Histórico Reporte VaR	Fec de Medición 30/0	FechaRegistro Codig 30/03/2015 30/03/2015	oFIC EfectivoCOP 4 335,742,319.24 1 490,183,785.69	EfectivoEXT 4 2,014,453,915.49 9 2,941,102,714.16	Retiros Aportes 1,007,078 50,353,915.6 1,470,334 73,516,716.71	Anulaciones Va 201,415.60 33 294,066.80 49	alorNetoFIC MaxRe 35,742,319,249,44 90,183,785,694,78	tiroNeto MaxReqLiq / -0.01 33,574,231.92 -0.01 49,018,378.57	liveEfectivo PropRecLiq Pro 0.67 0.67 0.67 0.67	DLiq30 IRLFIC 0.67 0 4.71 47.11
ContraPartes	Ratios y Carga									
RIESLIQ										
RLQFICS										
Generar desde Excel										
Opc./Forward										
Concentración		L								
Valoración										
Salir										

Para ver el histórico de cómo ha sido su IRL, indique una fecha inicial y final, un código FIC si lo desea, y pulse "Ver". El sistema le mostrará en pantalla el histórico. Utilice la opción "Exportar" si lo desea.

El archivo para trasmitir lo podrá ver en su carpeta CRLIQ de su PWPREI. Si dese ver el archivo en Excel pulse "Ver 519".

4.2.8.1. NOTAS CONTROL IRL FICs

Para aplicar control al IRL de sus FICs proceda:

- 1. Establezca el mínimo IRL que desea cómo límite de control: 0 (SFC) o más. Para ello proceda:
 - a. Ingrese a "Definición de Parámetros"
 - b. Pestaña "PWPREI"
 - c. Opción "SetParGen"
 - d. Baje hasta el parámetro 8123 y selecciónelo.
 - e. Arriba en el campo "Valor" ingrese el mínimo IRL deseado.
 - f. Pulse "Modificar"
 - g. Si no tiene permisos para modificar este parámetro, solicite a su área de TI que se lo establezca en el valor deseado.
- Variación Máxima. Establezca el porcentaje de variación máxima aceptable entre sus mediciones durante la semana y la medición del día viernes (corte de trasmisión). Para ello proceda:
 - a. Ingrese a "Definición de Parámetros"
 - b. Pestaña "PWPREI"
 - c. Opción "SetParGen"



- d. Baje hasta el parámetro 8124 y selecciónelo.
- e. Arriba en el campo "Valor" ingrese el porcentaje de variación aceptable. Ponga el número sin el signo de porcentaje, por ejemplo: 0.3
- f. Pulse "Modificar"
- g. Si no tiene permisos para modificar este parámetro, solicite a su área de TI que se lo establezca en el valor deseado.
- 3. Ejercer el Control. Una vez establecidos los parámetros de control, el sistema empezará a registrar sus mediciones, simplemente ejecute su proceso como siempre. El control se activará bajo las siguientes condiciones:
 - a. Cada vez que genere el formato 519 el sistema registrará en un log los resultados.
 - b. Cuando la fecha de corte seleccionada sea viernes, se activarán las verificaciones:
 - i. Si el IRL resulta menor que el mínimo establecido, el sistema generará el mensaje "El IRL es menor al ... Desea continuar?":
 - 1. Si pulsa "SI", el proceso continua.
 - 2. Si pulsa "NO" el proceso termina y no se genera el archivo.
 - ii. Si alguno de los datos: Efectivo COP, Efectivo EXT, Valor Neto del FIC, o los indicadores, difiere en un porcentaje superior a la mínima variación aceptable registrada en el parámetro 8124, el sistema sacará el mensaje y usted podrá continuar (SI) o abortar (NO) el proceso para revisar.
- 4. Consultar sus mediciones previas. Para ver el log de sus mediciones simplemente ponga una fecha de corte en el campo "Fecha Medición" y pulse "Ver Log":



Archivo	
Riesgo	
\mathbf{N}	🛱 FICs - Riesgo de Liquidez - Formato 519
	NIVEL VOMBRE
Participación	PORTAFOLIO
**	Fecha Inicial 15/02/2016 Tipo Entidad 04
Histórico	Fec de Medición 18/02/2016 Código Entidad 23
ContraPartes	
A G	Código FIC:
RLQFICS	
• <i>2</i>]	
Generar desde Excel	
One /Forward	
Concentraci <u>ón</u>	

En seguida le aparece la lista de sus resultados anteriores, desde esa fecha y hasta el lunes anterior:

🖏 Log IRL FIC										×
FechaEvento	HoraEvento	Usuario	FechaRegistro	CodigoFIC	EfectivoCOP	EfectivoEXT	Retiros	Aportes	Anulaciones	Valor
06/10/2018	14:55:59	PWPREI	18/02/2016	1	514,269,195	3,085,615,170.05	1,542,579	77,128,995.01	308,515.80	514
06/10/2018	14:54:15	PWPREI	18/02/2016	1	514,269,195	3,085,615,170.05	1,542,579	77,128,995.01	308,515.80	514
06/10/2018	14:55:59	PWPREI	17/02/2016	1	514, 193, 300.07	3,085,159,800.46	1,542,352	77,117,612.45	308,470.40	514
06/10/2018	14:54:15	PWPREI	17/02/2016	1	514, 193, 300.07	3,085,159,800.46	1,542,352	77,117,612.45	308,470.40	514
06/10/2018	14:53:57	PWPREI	17/02/2016	1	514, 193, 300.07	3,085,159,800.46	1,542,352	77,117,612.45	308,470.40	514
06/10/2018	14:55:59	PWPREI	16/02/2016	1	514,117,416.34	3,084,704,498.08	1,542,124	77,106,231.57	308,424.80	514
06/10/2018	14:54:15	PWPREI	16/02/2016	1	514,117,416.34	3,084,704,498.08	1,542,124	77,106,231.57	308,424.80	514
06/10/2018	14:53:57	PWPREI	16/02/2016	1	514, 117, 416. 34	3,084,704,498.08	1,542,124	77,106,231.57	308,424.80	514
06/10/2018	14:53:40	PWPREI	16/02/2016	1	514,117,416.34	3,084,704,498.08	1,542,124	77,106,231.57	308,424.80	514
06/10/2018	14:55:59	PWPREI	15/02/2016	1	514,041,543.81	3,084,249,262.88	1,541,897	77,094,852.37	308,379.40	514
06/10/2018	14:54:15	PWPREI	15/02/2016	1	514,041,543.81	3,084,249,262.88	1,541,897	77,094,852.37	308,379.40	514
06/10/2018	14:53:57	PWPREI	15/02/2016	1	514,041,543.81	3,084,249,262.88	1,541,897	77,094,852.37	308,379.40	514
06/10/2018	14:53:40	PWPREI	15/02/2016	1	514,041,543.81	3,084,249,262.88	1,541,897	77,094,852.37	308,379.40	514
06/10/2018	14:53:17	PWPREI	15/02/2016	1	514,041,543.81	3,084,249,262.88	1,541,897	77,094,852.37	308,379.40	514
<	Cerrar									>

4.2.8.2. **RIESLIQ - FORMATO 508**

A continuación describimos el proceso operativo para generar el formato 508, Riesgo de Liquidez SCB. Siga los pasos siguientes:

1. Copie la plantilla adjunta "Formato_508.xls" a la carpeta Plantillas que está bajo la carpeta C:\PwpRei o su equivalente en el ambiente que esté probando.



2. Carga de Portafolios.

- Por favor registre su portafolio de maneral normal, con los datos reales de las operaciones tal cual las hizo en el mercado, solo tenga en cuenta las situaciones especiales como "Venta de un título recibido en una operación activa" que debe quedar en corto (Estado=GARCOR), los títulos dados en garantía (Estado=GARANTIA) y las exclusiones que usted por su forma particular de operar deba hacer (OrdenCpr=uno de los códigos listados abajo para el efecto).
- Recuerde que su portafolio de posición propia, que usa para el riesgo de mercado es el mismo que usaremos para el riesgo de liquidez, ya no es necesario que incluya la cuenta PUC de los activos líquidos como ocurría con el 475. Para cargar los dos portafolios (Propio y Clientes) utilice la plantilla Excel adjunta "Ejemplo Carga Compromisos con marca de ESTADO titulo.xls". La definición técnica de la plantilla se encuentra en "FormatosTodasEntrada.xls", Hoja "Compromisos". El único cambio que hemos involucrado en esta plantilla es que en adelante deberá especificar, para títulos que se encuentren en el DCV, el número de emisión así:
 - a. Si la especie es estandarizada (de emisión única), tal como un TES, simplemente registre el número de emisión en el campo "Emisión" de la especie, como lo ha hecho hasta ahora.
 - b. Si la especie no es estandarizada, registre dicho número en la columna BD del formato de carga compromisos.
 - c. Si tecnología le genera esta interfaz, hágales llegar esta definición técnica. Recuerde que tiene 3 opciones para la carga del portafolio:
 - i. Desde el formato Excel de Carga Compromisos.
 - ii. Desde una Vista poblada con la información, tanto de clientes como de la posición propia, cada uno por su puesto con la asignación de portafolios que defina.
 - iii. Mediante un SP que PWPREI ejecutará para obtener la información.
 - d. El campo "Contraparte" debe ser diligenciado con el código de la contraparte con quien hizo el negocio. Con esto el sistema diferencia si la operación es cruzada o convenida. Para ello también es necesario que en su código de contraparte este registrado su NIT exactamente igual como se encuentra cuando usted ingresa por "Parámetros", "General", "Empresa". El sistema compara estos dos datos para identificar si la contraparte es la misma firma y entonces determinar si la operación es cruzada o convenida.



- e. El campo "PUC" ya no es necesario, pero si quiere colocarla para sus compromisos no molesta.
- f. **Valoración por ISIN.** Si desea que PWPREI realice la valoración utilizando como referencia el ISIN en lugar de deducirlo con las características faciales del papel como hace hoy, deberá hacer 2 cosas:
 - i. Registrar el ISIN de cada posición en su portafolio en el campo NumDcvDvl (Columna D del Excel) de la plantilla de Carga Compromisos.
 - **ii.** Pedir a Tecnología que asigne el parámetro correspondiente. Ellos se comunicaran con nosotros para este parámetro.
- g. **Exclusiones 508.** Para las inversiones que deben ser excluidas del IRL correspondiente a operaciones por cuenta de terceros, proceda de la siguiente manera:
 - **i. Primarios:** Registre "PRIMARIO" en el campo Mercado (Columna AY del formato Excel de carga compromisos) de la operación.
 - **ii. Ofertas Públicas de Adquisición:** Registre "OPA" en el campo Mercado (Columna AY del formato Excel de carga compromisos) de la operación.
 - **iii. Oferta Pública para Democratización.:** Registre "OPD" en el campo Mercado (Columna AY del formato Excel de carga compromisos) de la operación.
 - iv. Operaciones de Administración de Portafolios de Terceros, Carteras, Etc., que no deban incluirse: Estas operaciones debe incluirlas en portafolios de los tipos especiales, indicados a continuación, para que el sistema las ignore en el formato 508. Cree los siguientes tipos de portafolio y luego asigne a los portafolios de exclusión estos tipos:
 - **1. PCTAMARGEN o MARGEN:** Operaciones de Cuentas de Margen.
 - 2. APT: Administración de Portafolios de Terceros.
 - **3. PWPCARTERA o CARTERA, PWPPENSION o PENSION:** Carteras administradas.



4. En general, todos los tipos de portafolio siguientes han sido reservados por el sistema como excluidos del 508, entre otras funciones: "PCTAMARGEN","MARGEN","PAPT", "PCONTADM","CARTERA","PATRIMONIO","PWPCARTERA", "PENSIONES", "PENSION", "PWPPENSION", "FPENSIONES"

Al asociar un portafolio a estos Tipos de Portafolio, el sistema los excluirá del formato 508.

- v. Exclusiones propias, particulares, hechas a voluntad según sus necesidades. Para su uso particular hemos habilitado los siguientes códigos de forma que tales operaciones sean ignoradas para el IRL mas no para el RM. Las que en la columna AK (OrdenCpr) del archivo de carga del portafolio tengan estos códigos serán ignoradas: INGOTR, EGROTR, INGETF, EGRETF
- vi. Exclusión del componente FLUJOS para compromisos de liquidez compensados por cámara o derivados OTC compensados por cámara: Las que en la columna AK (OrdenCpr) del archivo de carga del portafolio tengan la sigla CRCC, operan así:
 - 1. SIMULTANEAS: Se procesa el título para los ALAC, no se procesa el compromiso ni el título para los ALAC.
 - 2. DERIVADOS: No se procesa, se excluye.
- 3. **Disponible.** El disponible está ahora separado en 2: Pesos y MonExt. Registre el valor del disponible en Pwprei así:
 - a. Ingrese por "Mercado y Sociedad"
 - b. Seleccione la pestaña "Valores Súper"
 - c. Seleccione la Opción "Datos Netos"
 - d. En la parte superior seleccione "Ingresar". El sistema le trae automáticamente los datos netos del último día operativo.



🐞 Datos Netos - Ir	ngresar 💶 🗴
Ingresar Datos —	
Fecha Carga	23/07/2014 💌
PatTecnico	\$ 1,000,000,000.0
APNR	\$ 500,000,000.0
Disponible COP	\$ 1,000,000,000.0
Disponible MEXT	\$ 0.0
Rle	\$ 0.0
Riesgo Derivados	\$ 0.0
	Aceptar 🔀 Cerrar

- e. En el campo "Disponible COP" ingrese el valor del disponible en pesos.
- f. En el campo "Disponible MEXT" ingrese el valor del disponible en moneda extranjera. Este dato, que se refiere a lo tenga en dólares, euros, etc., debe registrarlo en pesos ya que el sistema lo que necesita es identificarlo para aplicarle el haircut correspondiente.
- 4. **Haircuts**. Ahora deberá cargar 3 archivos sobre el peso de los activos, relacionados con el formato, para determinar el tratamiento de las diferentes especies:
 - a. HairCuts especies locales. Cargue el archivo de haircuts corriente, del BRP, como lo venía haciendo hasta ahora. Por la opción "Mercado y Sociedad – Valores de – HAIRCUTS", seleccionado "Excel". El sistema además de registrar los haircuts presentes en el archivo, adicionalmente utiliza el número de emisión para determinar la especie y registrarla como elegible para operaciones de mercado monetario.
 - b. Haircuts especies moneda extranjera (Yankees). Baje el nuevo archivo de haircuts adicionales del BRP, donde vienen las especies de deuda pública externa. Cárguelo por la opción "Mercado y Sociedad Valores de HAIRCUTS", seleccionado "H.Monext". El sistema además de registrar los haircuts presentes en el archivo, adicionalmente registra las especies como elegibles para operaciones de mercado monetario.
 - c. **Especies Elegibles**. Es necesario registrar las acciones elegibles para repos y establecer además si son admisibles como garantía. Arme un archivo Excel según el formato "Elegibles", que se encuentra en el archivo de formatos de



carga PWP denominado "FormatosTodasEntrada", hoja "EspeciesElegibles". Cárguelo por la opción "Mercado y Sociedad – Valores de – HAIRCUTS", seleccionando "Acc.Elegibles".

- 5. Agregar registros manuales al formato. Si requiere agregar registros para que aparezcan en el formato tal cual usted desea, como por ejemplo insertar un registro para créditos (Unidad de captura 3, subcuenta 60 "Obligaciones finanacieras"), utilice la plantilla "Fto_Manual" que está en el archivo "FormatosTodasEntrada". Puede poner los registros incluyendo la banda (columna) en la que deben ir o, si lo desea, agregue la fecha del flujo al final y el sistema calculará la banda.
- 6. **GENERAR LOS INFORMES.** Para generar los informes diariamente proceda:
 - a. Ingrese por "Informes".
 - b. Seleccione la pestaña "Riesgo".

🗐 Riesgo de Liquidez		x		
PROCESO 	Datos Básicos Fecha Inicial 15/06/2014 ▼ Tipo Entidad 01 Fec de Medición 15/07/2014 ▼ Código Entidad 01 Nivel Confianza Clave ** Act. Liq. Obligacs. Terceros IRL STRESS (%):			
C FOR 475 FORMATOS C STRESS TESTING C BACK TESTING	UBICACION PORTAFOLIOS			
	Clientes			
Cargar 🔬 Aceptar 🔀 er 508-476 🗵 Cerrar				
Donde:				

c. Seleccione la opción "RIESLIQ". Le aparecerá la siguiente pantalla:

• FOR 508 y FOR 475. Le permiten durante la transición generar tanto el 475 como el 508, según su necesidad. Inicialmente le



aparecerá por defecto seleccionado 475, pero esto luego cambiará a 508. En cualquier caso, seleccione el requerido.

- Deje Seleccionado "FORMATOS" para generar.
- Fecha de Medición es la fecha para tomar los portafolios.
- Tipo Entidad, Código Entidad y Clave son los datos normales que usted utiliza al generar los informes para la SFC. Puede seleccionar "Recordar" para que el sistema guarde estos datos.
- Nivel corresponde al nivel donde está colgado el portafolio a leer. Puede ser "GRUPO", "LINEA" o "PORTAFOLIO". Seleccione el nivel tanto para la compañía como para clientes.
- Nombre corresponde al nombre de ese nivel. Seleccione el nombre respectivo donde están los portafolios a leer.
- d. Una vez ingresados los datos anteriores pulse "Aceptar" y el sistema generará los archivos. Debe aparecer el mensaje:

PWPREI	×
(į)	Archivos generados satisfactoriamente
	Aceptar

Si le aparece un mensaje de error ya sabe que estamos a su

disposición

- e. Los archivos a transmitir quedan en la carpeta "CRLIQ" bajo su carpeta PwpRei. Debe ver dos archivos con nombres de la forma: "RLQ508PROddMMaaaa.txt" y "RLQ508CLIddMMaaaa.txt", correspondientes a los formatos 508 y 476 respectivamente. Se generan dos porque estos formatos tienen distinto "Tipo de Informe".
- 7. **Ver Resultados.** Para ver los resultados obtenidos utilice el botón "Ver 508 476" que le permite generar el informe 508 en una plantilla Excel. El nombre de este botón cambia a 475 cuando haya seleccionado ese formato.



4.2.9. GENERAR DESDE EXCEL

Para generar archivos planos de los formatos del 435 al 440 desde la plantilla Excel proceda como se indica en las siguientes instrucciones:

 Verificar que en C:\PwpREI\Plantillas se encuentre el archivo ParametrosdeFormatos.xlsx. Este archivo contiene los parámetros de ubicación de los datos de las plantillas de los formatos, se debe especificar el Nombre del formato, la unidad de Captura, en que fila

inicia y en que fila termina, en que Columna inician los datos y en que Columna terminan, y el nombre del Documento técnico; Asi para todos los formatos del 435 al 440. Como se indica en la imagen:

- 4	A	В	С	D	E	F	G	Н	
1	FORMATO	UNIDAD CAPTURA	FILA INICIAL	FILA FINAL	COL INICIAL	COL FINAL	DOC TEC		
2	435	1	19	36	3	9	SFC-DTP-001		
3	435	2	38	43	3	9	SFC-DTP-001		
4	435	3	45	49	3	9	SFC-DTP-001		
5	435	4	51	55	3	9	SFC-DTP-001		
6	435	5	57	57	3	9	SFC-DTP-001		
7	435	6	59	59	3	9	SFC-DTP-001		
8	435	7	70	93	3	9	SFC-DTP-001		
9	435	8	95	102	3	9	SFC-DTP-001		
10	435	9	104	108	3	9	SFC-DTP-001		
11	435	10	110	114	3	9	SFC-DTP-001		
12	435	11	116	116	3	9	SFC-DTP-001		
13	435	12	118	118	3	9	SFC-DTP-001		
14	436	1	24	25	3	12	SFC-DTP-001		
15	436	2	27	28	3	12	SFC-DTP-001		
16	437	1	21	33	3	5	SFC-DTP-001		
17	437	2	35	40	3	5	SFC-DTP-001		
18	437	3	42	45	3	5	SFC-DTP-001		
19	437	4	47	49	3	5	SFC-DTP-001		
20	437	5	51	51	3	5	SFC-DTP-001		
21	437	6	55	58	3	5	SFC-DTP-001		
22	437	7	60	62	3	5	SFC-DTP-001		
23	437	8	64	65	3	5	SFC-DTP-001		
24	437	9	67	69	3	5	SFC-DTP-001		
25	437	10	71	71	3	5	SFC-DTP-001		
26	438	1	21	37	3	3	SFC-DTP-001		
27	438	2	39	40	3	3	SFC-DTP-001		
28	438	3	42	42	3	3	SFC-DTP-001		
29	439	1	20	23	3	4	SFC-DTP-001		
30	439	2	25	25	3	4	SFC-DTP-001		
31	440	1	16	45	3	31	SFC-DTP-001		
32	440	2	47	56	3	31	SFC-DTP-001		
33	440	3	58	62	3	31	SFC-DTP-001		
34	440	4	64	68	3	31	SFC-DTP-001		
35	440	5	70	70	3	31	SFC-DTP-001		
36	440	6	72	74	3	31	SFC-DTP-001		
27	< ► ► ■ ¹⁴⁰ H	oia1 Hoia2	Hoia3 /	105	2	24	SEC DTD 004		



 Ingrese al módulo Informes, en la pestaña Riesgo y en el botón Generar desde Excel; Aparecerá la pantalla con el formato que va a generar.

🔄 Generar Formatos					_ 0	x
Información						
Generar formato completo:	🗢 Si 🖲 No					
Nombre Entidad	Tipo Entidad	Codigo Entidad	Clave			
	J	I	<u> </u>			
Formato Ninguno 👻	Archivo(*.xls, *xlsx)					
Formato Ninguno 🖵	Archivo(*.xls, *xlsx)					
Formato Ninguno 🖵	Archivo(*.xls, *xlsx)					
Formato Ninguno 🖵	Archivo(*.xls, *xlsx)					
Formato Ninguno 🚽	Archivo(*.xls, *xlsx)					
Formato Ninguno 🖵	Archivo(*.xls, *xlsx)					
				Aceptar	Cer	rar

- a. Debe digitar el Nombre de la Entidad, el tipo de la Entidad (Campo Numérico), Código de la Entidad (Campo Numérico) y la Clave.
- b. Si se van a generar varios formatos seleccionas Si, si no se van a generar varios se debe seleccionar No
- c Si la respuesta es No, solo se habilitara un campo Formato donde selecciona el Formato 435, 436, 437, 438, 439 o 440 y se habilita el campo donde debe buscar la ruta del archivo.
- d. Si la respuesta es Sí, se habilitaran todos los formatos para generar más de un formato. Frente a cada formato debe seleccionar la ruta del archivo.
- Después de generar los formatos los archivos se encontraran en C:\PwpREI\Circular051\, el nombre de los archivos serán Nombre-Manual.txt, la palabra Manual indicara que se generó desde Excel.



4.3. OPCIÓN VALORACION



4.3.1. SUPERVALORES – Informe Perdida/Ganancia

Debe seleccionar primero la fecha.



Luego presionar Aceptar, y a continuación muestra el informe Perdida/Ganancia



尾 Informe Pérdida/Gananci	ia	X
Organizar Por <u>Grupo</u> Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio	
æ-≞ CLIENTES æ-≞ PWP	Especie Depósito Número Dias al Vcto. Úl Tasa Nominal Tasa Efectiva Pr	ecio
		>
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	09/07/2009 • Liquidar compromisos a: 09/07/2009 • Fecha Liquidación C Fecha Compromisos	Cerrar

El sistema valora el portafolio y emite los informes correspondientes de acuerdo a las características de los títulos, y a la estructura suministrada por la Supervalores. Al presionar el Botón Aceptar se genera la siguiente pantalla.



🗐 Valoración po	r Port	afolio								X	
	Nombre	GR	JPO Es	_	Г Г	Fechas /alorización 09/07/2009 .iquidación 09/07/2009	T (\$ () T (\$ () P :	otal Val D.0000 otal Val D.0000 yG Vir.	— Resultados Fina Ioración Comp Ioración Merca Mercado	iles ra ido	
INFORME 01	RME 02	INFORME 0	3 INFORME	04	NFORME 05	INFOR	\$ 0.0000				
INV	/ERS	IONES E	N RENTA F	IJA EMITIDO	S POR	ENTIDAD	ES DIST	INTAS	DE LA NACIÓ	ŃN	
Emisor		Especie		Nemotécnico	Cantidad I	Nominal Valo	or Nominal	C	antidad de Compra	Valor de Compra 🔥	
C.F.C. CONFINANC	CIERA	CERT.DEP	TERM, CIA.FC	CDTCNFS0V	23,1	83,985.00	\$ 23,183,9	85.000	23,544,037.00	\$ 23,54	
C.F.C. CONFINANC	CIERA	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTCNFS0V	100,0	00,000.00	\$100,000,0	00.000	100,000,000.00	\$ 100,00	
C.F.C. CONFINANC	CIERA	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTCNFS0V	80,0	00,000.00	\$ 80,000,0	00.000	80,000,000.00	\$ 80,00	
BCO. DAVIVIENDA	۸S.A	CERT.DEP	OSITO TERMII	CDTDVISOV	4,6	20,774.60	\$ 4,620,7	74.600	4,628,670.00	\$ 4,62	
BCO. DAVIVIENDA	۸S.A	CERT.DEP	OSITO TERMIÌ	CDTDVISØV	10,5	09,012.00	\$ 10,509,0	12.000	10,580,227.00	\$ 10,58	
BCO. DAVIVIENDA	۸S.A	CERT.DEP	OSITO TERMIÌ	CDTDVISOV	6,0	00,000.00	\$ 6,000,0	00.000	5,956,095.00	\$ 5,95	
CMR FALABELLA S	s.a. cia	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	3,3	08,982.00	\$ 3,308,9	82.000	3,315,092.00	\$ 3,31!	
CMR FALABELLA S	s.a. cia	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	24,1;	27,015.00	\$ 24,127,0	15.000	24,497,298.00	\$ 24,49	
CMR FALABELLA S	S.A. CIA	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	2,9	30,079.00	\$ 2,930,0	79.000	3,077,526.00	\$ 3,07	
C.F.C. INVERSORA	A PICHI	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	3,5	00,710.00	\$ 3,500,7	10.000	3,650,419.00	\$ 3,65	
C.F.C. INVERSORA	A PICHI	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	1,0	00,000.00	\$1,000,0	00.000	1,012,177.00	\$ 1,01;	
C.F.C. INVERSORA	A PICHI	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	2,2	07,858.00	\$ 2,207,8	58.000	2,283,570.00	\$ 2,28:	
C.F.C. G.M.A.C. FIN	1. DE C	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTGMASOV	1,4	83,403.00	\$ 1,483,4	03.000	1,495,930.00	\$1,49!	
C.F.C. G.M.A.C. FIN	I. DE C	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTGMASOV	4,9	28,558.00	\$ 4,928,5	58.000	4,987,704.00	\$ 4,98	
C.F.C. G.M.A.C. FIN	I. DE C	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTGMASOV	4,1	71,643.00	\$ 4,171,6	43.000	4,187,176.00	\$ 4,18	
C.F.C. G.M.A.C. FIN	N. DE C	CERT.DEP	TERM. CIA.FC	CDTGMASOV	6.4	39.269.00l	\$ 6.499.2	69.000l	6.691.556.00	\$ 6.69	
						Î	Exportar	Ø	Exportar Todo	Cerrar	

4.3.2. REPsSIMS

Seleccionar la fecha de medición

🎐 Fecha Portafolios	×
Fecha Medición 🔟/11/2010	•
Aceptar 🔀 Cerrar	



🕵 Informe Vencimientos Co	mpromisos Liquidez
Organizar Por <u>Grupo</u> Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio
* 1 CLIENTES	Especie Depósito Número Dias al Vcto. Úl Tasa Nominal Tasa Efectiva Precio
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	11/11/2010 • Liquidar compromisos a: 11/11/2010 • Fecha Liquidación Fecha Compromisos

Luego de presionar el botón aceptar aparece la pantalla con el respectivo informe de Vencimientos Compromisos Liquidez

Informe Vencimientos Compromisos Liquidez		
PORTAFOLIO Portafolio	Valorización	Resultados Finales Total Valoración Mercado Total Posicion Total Compr. Largas Total Compr. Cortas PyG Cprs.
		Exportar 🔀 Cerrar



4.3.3. NOTIFICACION

Cuando presiona el botón Notificación aparece la siguiente pantalla

🧬 Fecha Po	rtafolios 🛛 🔀
Fecha Medic	ión 08/02/2009 💌
TipoFech ⊙ Regist	a iro C Evento C Contab
	Acepta 🔀 Cerrar

Debe seleccionar la fecha y el tipo de fecha:

Registro: Fecha de registro o de proceso **Evento**: Fecha de ocurrencia del evento **Contable**: Fecha de contabilización

Luego presionar el botón aceptar y se mostraran las notificaciones por compraventas como se ve en la pantalla.

E	🖻 Eventos del Portafolio.														
	NOTIFICACIONES POR COMPRAVENTAS														
							27,100,1	2000 -							
							1227087	2009 🔟							
Γ			1				and the state	Laure							
	FechaEvento	HoraEvento	Evento	FechaRegistro	FechaLumple	No.Uper.	LipoNoti	NitContab	Beneficiario	Valor	Reteruente	BaseHetette	I raslado	Basel raslado	
	24/08/2003	16:14:23	BEGISTRA	20/08/2003	21/08/2008	2	EGRESO	01	0	\$ 437 200 000 00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
	24/08/2009	16:14:29	BEGISTBA	20/08/2009	25/11/2008	3	EGBESO	01	0	\$ 1 011 677 000 00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
	24/08/2009	16:14:30	REGISTRA	20/08/2009	12/05/2009	4	EGRESO	01	0	\$ 2,688,049,052.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
	24/08/2009	16:14:30	REGISTRA	20/08/2009	20/08/2009	5	EGRESO	01	0	\$ 531,933,500.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
	24/08/2009	16:14:30	REGISTRA	20/08/2009	20/08/2009	6	EGRESO	01	0	\$ 531,933,501.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
	24/08/2009	16:14:31	REGISTRA	20/08/2009	20/08/2009	7	EGRESO	01	0	\$1,154,399,000.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
														>	
												<u></u>		_	
												Export	ar	🗙 Cerrar	
												-			



4.3.4. MOVIMIENTOS CONTABLES

Para que PWPREI genere los movimientos contables se debe proceder:

- Activar el parámetro 8021: Movimientos Contables (Esta activación se hace por medio de la Base de Datos de la aplicación PWPREI).
- Parametrizar los movimientos contables:
- Ingrese por Definición de Parámetros.
- Seleccione Parámetros Contables
- Se abrirá una ventana de trabajo para que los registre o modifique.

Si usted administra carteras colectivas recuerde que al parametrizar debe:

- Para los parámetros de su portafolios indicar Destino = "PROPIO", con mayúscula.
- Para los parámetros de sus fondos indicar Destino = "PATRIMONIO", con mayúscula

Al crear sus portafolios tener en cuenta:

Para los de Posición Propia:

- Asignar como beneficiario el NIT de la compañía.
- Asignar como Tipo Portafolio cualquiera diferente de "PATRIMONIO"

Para las carteras colectivas o patrimonios:

- Asignar como beneficiario el NIT del patrimonio o fondo correspondiente.
- Asignar como Tipo Portafolio="PATRIMONIO"
- Si los portafolios no están debidamente creados, como se indicó en el punto anterior, los movimientos no se generan correctamente. Le puede ocurrir que:
- El destino de los movimientos (NitContab) no quede correcto si el beneficiario del portafolio es incorrecto o si el tipo de portafolio no es el requerido.
- El sistema no pueda realizar movimientos para sus patrimonios sino se han establecido los parámetros para estos (Destino="PATRIMONIO")
- Las contrapartes con las que hace negocios deben tener registrado el NIT correcto para que el beneficiario de los Pagos que usted deba hacer y deba recibir por sus operaciones sea el correcto.
- Los emisores deben tener registrado su NIT correcto para que el tercero en las cuentas de inversión quede bien registrado.
- Los cambios que usted realice en sus parámetros y en sus portafolios solo se activaran para los registros que realice a partir de ese momento, lo que haya registrado anteriormente no será actualizado por esos cambios.



Cuando presiona el botón Movimientos Contables aparece la siguiente pantalla

📌 Fecha Portafolios 🛛 🛛 🔀
Fecha Medición 🔟/11/2010 💌
TipoFecha I Registro I Evento I Contab
Aceptar 🛛 Cerrar

Donde debe seleccionar la fecha y el tipo de fecha:

Registro: Fecha de registro o de proceso **Evento**: Fecha de ocurrencia del evento **Contable**: Fecha de contabilización

> Luego presionar el botón Aceptar, aparecerá la siguiente pantalla con los movimientos contables:

FechaEvento HoraE 13/11/2009 16: 13/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	Evento Evento 3:05:13 NEGOCIAR 3:06:11 NEGOCIAR 3:29:50 NEGOCIAR 3:30:44 MODIFICA	FechaRegistro 01/10/2009 01/10/2009 01/10/2009	FechaContab 01/10/2009 01/10/2009	No.Oper.	Concepto												
FechaE vento HoraE 13/11/2009 16: 13/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	Evento Evento 3:05:13 NEGOCIAR 3:06:11 NEGOCIAR 3:29:50 NEGOCIAR 3:30:44 MODIFICA	FechaRegistro 01/10/2009 01/10/2009 01/10/2009	FechaContab 01/10/2009 01/10/2009	No.Oper.	Concepto	Deteriorien	ContraConte	I									
FechaEvento HoraE 13/11/2009 16: 13/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	Evento Evento 8:05:13 NEGOCIAR 8:06:11 NEGOCIAR 8:29:50 NEGOCIAR 8:30:44 MODIFICA	FechaRegistro 01/10/2009 01/10/2009 01/10/2009	FechaContab 01/10/2009 01/10/2009	No.Oper. 122	Concepto	Description	Carta Carta	I									
13/11/2009 16: 13/11/2009 16: 13/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	205:13 NEGOCIAR 206:11 NEGOCIAR 229:50 NEGOCIAR 230:44 MODIFICA	01/10/2009 01/10/2009 01/10/2009	01/10/2009	122	Concepto	schaFventn HousEventn FechaBenistra FechaPontah No Oner I Concentra Descrincion Centra Costa Nombre Documenta Asiento PUCRase											
13/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	29:50 NEGOCIAR 3:29:50 NEGOCIAR 3:30:44 MODIFICA	01/10/2009	01/10/2009		1	COMPRA DE TITULOS	CENTIOCOSIO	LINICO	Documento		130						
03/11/2009 16: 03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	29:50 NEGOCIAR 3:30:44 MODIFICA	01/10/2009		222	1	COMPBA DE TITULOS	-	LINICO	0		130						
03/11/2009 16: 03/11/2009 16:	30:44 MODIFICA	01110120001	01/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS	-	LINICO	0		130						
03/11/2009 16:	xoox in prior bin roan i p	01/10/2009	09/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS		LINICO	0		130						
	31:18 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS	-	UNICO	0	- O	130						
03/11/2009 17:	14:59 MODIFICA	01/10/2009	03/11/2009	34	2	VENTA DE TITULOS	-	UNICO	Ō	t ő	130						
03/11/2009 17:	26:25 MODIFICA	01/10/2009	12/10/2009	34	2	VENTA DE TITULOS	-	UNICO	0		130						
03/11/2009 17:	31:10 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	36	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
03/11/2009 17:	33:12 MODIFICA	01/10/2009	16/11/2009	36	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	l o	130						
03/11/2009 18:	3:05:19 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	37	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
06/11/2009 15:	5:14:27 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	78	1	COMPRA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
06/11/2009 15:	5:16:53 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	79	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
06/11/2009 15:	5:13:25 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	87	1	COMPRA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	:39:32 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
26/10/2009 15:	5:38:26 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	. 0	130						
26/10/2009 15:	5:38:44 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	. 0	130						
26/10/2009 15:	5:39:07 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	39:17 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	. 0	130						
26/10/2009 14:	1:57:48 NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	5:02:33 MODIFICA	01/10/2009	26/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	5:31:56 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	5:32:16 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	5:33:27 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	:34:02 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	34:29 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
26/10/2009 15:	34:47 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	5:35:03 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0	0	130						
26/10/2009 15:	:35:33 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
26/10/2009 15:	5:36:04 MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1	UNICO	0		130						
26/10/2009 15:	5:36:28I MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS	1 1	I UNICO I	0	1 0	130						
											~						
								0	1		-						
								í	Exportar	l l	Cerrar						

Esta información puede ser exportada a Excel para una mejor manipulación de datos



4.3.5. MOVIMIENTOS PORTAFOLIOS

🎐 Fecha Portafolios							
 Fecha Medicion Periodo 	07/03/2019	• •					
Num. Negocio Usuario Usuario Evento Nivel(Grp, Lin, Port.) Nombre Nivel Tipo Portafolio TipoFecha G Registro C	TODO						
Acept	ar 🗵 Cerrar						

🖏 Eventos del Portafolio.

– 🗆 🗙

MOVIMIENTOS DEL PORTAFOLIO

77/03/2014 💽

										_
FechaRegistro	Portafolio	Deposito	Numdevdvl	NumNegocio	NumOrden	Punta	Posicion	Especie	FecOper	
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0020	010-140226-0020	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014	4
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0021	010-140226-0021	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014	ιŢ
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0022	010-140226-0022	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014	ιŢ
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0023	010-140226-0023	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014	ιŢ
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0024	010-140226-0024	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014	ιŢ
<										>
							l	Evportar	Cerrar	
							1	Carportal		

Registro(s): 5



4.4. OPCIÓN CONCENTRACION

Estos informes corresponden a la solicitud hecha por la Superintendencia de Valores en su circular 211.



4.4.1. CONCENTRACION DE RIESGO

Informe Concentración d	e Riesgo	X
Organizar	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio Especie Depósito Número Dias al Veto. Úl Tasa Nominal Tasa Efectiva	Precio
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	Og/07/2009 • Liquidar compromisos a: Og/07/2009 • • Fecha Liquidación © Fecha Liquidación ©	Cerrar

Al presionar el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla



🕵 Informe Concentración d	e Riesgo	
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea Patrimonio Técnico Og/07/2009 \$0.00 Cerrar Cerrar	
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	09/07/2009 Liquidar compromisos a: 09/07/2009 Fecha Liquidación Fecha Compromisos	

El resultado aparece por informe y por grafico, en el inferior de las pantallas se puede ver que hay opciones de exportación tanto del grafico como del Informe.

🔊 Informe Concentración de Riesgo				×
INFORME CONCENTRACION RIESE	INFORME CONCENTRACION RIESGO			
GRUPO Nombre CLIENTES	_	Fechas	Resultados Finales Total Valoración Mercado \$ 0.0000 Total Compras \$ 0.0000 Total Ventas \$ 0.0000 Patrimonio Tecnico	
Grupo Emisor	Compra	Venta	Valor Cuenta	
	\$00	\$00		
SIN DEFINIR BCO. DAVIVIENDA S.A	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR C.F.C. CONFINANCIERA	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE CO	L. \$0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR C.F.C. INVERSORA PICHIN	CHA \$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR CMR FALABELLA S.A. CIA.	DE FIN \$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR LEAS. DE CREDITO	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR LEAS. IFI	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	
SIN DEFINIR LEAS. POPULAR	\$ 0.0	\$ 0.0	\$0.0	
Excede el 10% Excede el 30%	Total por Grupo	đ	Exportar 😥 Exportar 💟 Cerrar	



📓 Informe Concentración de Riesgo	
INFORME CONCENTRACION RIESGO	GRAFICO
GRAFICO POR PARTICIPACION NETO	D AV VILLAS
	BCO. DAVIMENDA SA
0.00%	C.F.C. CONFINANCIERA
	C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE COL.
	C.F.C. INVERSORA PICHINCHA
	CMR FALABELLA S.A. CIA. DE FIN
	■ LEAS. DE CREDITO
	o LEAS. IFI
	LEAS. POPULAR
	GOBIERNO NACIONAL
	Grafico 😥 Exportar 🔀 Cerrar

4.4.2. CONCENTRACION PORTAFOLIO



Se debe seleccionar primero la fecha.



Informe Concentración d	e Portafolios	×
Organizar Por <u>Grupo</u> Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio	
* = CLIENTES * = PWP	Especie Depósito Número Dias al Vcto. Úl Tasa Nominal Tasa Efectiva Precio	Í
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	09/07/2009 • Iquidar compromisos a: 09/07/2009 • • • Fecha Liquidación • • Fecha Liquidación • • Fecha Liquidación • • • • <t< th=""><th>ar</th></t<>	ar

Al presionar el Botón aceptar se aparece la siguiente pantalla.

	Informe Concentracio	ón de Portafolios					
Γ		GRUPO		— Fechas —		ltados Finales ación Mercado	7
	Nombre CLIENTES			Valorización 09/07/2009 Liguidación	\$ 0.0000 Total Posici \$ 0.0000	ion	_
				09/07/2009	\$ 0.0000 Total Comp \$ 0.0000 \$ 0.0000	r. Largas r. Cortas	_
	arupo Emisor	Emisor	Pósiciones	Compr. L	argas	Compr. Cortas	^
	SIN DEFINIR	AV VILLAS	\$ 0.0	\$ 0.0		\$ 0.0	
9	SIN DEFINIR	BCO. DAVIVIENDA S.A	\$ 0.0	\$ 0.0		\$ 0.0	_
	SIN DEFINIR	C.F.C. CONFINANCIERA	\$ 0.0	\$ 0.0		\$0.0	_
1	SIN DEFINIR	C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE COL.	\$ 0.0	\$ 0.0		\$ 0.0	_
	SIN DEFINIR	C.F.C. INVERSORA PICHINCHA	\$0.0	\$ 0.0		\$ 0.0	- 11
	SIN DEFINIR	CMR FALABELLA S.A. CIA. DE FIN	\$ 0.0	\$ 0.0		\$0.0	- 11
		LEAS, DE CREDITU	\$ 0.0	\$ U.U		\$ 0.0	- 11
			\$U.U ¢00	\$ 0.0		\$U.U ¢00	_
		LEAS. FOFODAN	\$ 0.0	\$0.0		\$ 0.0	>
					Ext	portar 🔀 Cerra	ar



5. ADMINISTRACION DE SEGURIDAD



EL sistema brinda al administrador del software diferentes controles que le permiten tener mayor seguridad sobre el manejo de su aplicativo. Para ingresar a esta utilidad haga clic en el botón descrito en la parte superior, de inmediato el sistema le lleva a la pantalla con todas las opciones de administración.

Para ingresar a las distintas opciones de este menú puede utilizar los Iconos gráficos o a través de las opciones ubicadas en la parte superior de la pantalla.



5.1. OPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD



5.1.1. GESTION DE USUARIOS

En esta opción se podrán crear los usuarios que vayan a utilizar el sistema **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES.** Al dar clic aparece la siguiente pantalla en la cual se muestra el primer usuario.

Administración de Usuarios		
	DATOS GENERALES	
Código del Usuario: PWPREI	Nombre: pwprei	Nivel Acceso
Password ************************************	Calidad: NORMAL	NIVEL:
Fecha de Creación: 10/03/2015	Fecha Cambio: 01/03/2011 🖃	NOMBRE:
Estado: ACTIVO		
Navegador	Registro: 1 de 11	
KKPP	Existen 11 Registros	
Todos los 🕒 Nuevo Usuarios Usuario	Ingresar Modificar Minhabilitar Usuario Usuario	Cerrar

1. Flechas de Navegador: Con estas flechas se podrá desplazar a través de todos los usuarios existentes. En el lado derecho de estos botones se muestra en que registro se está posicionando y cuantos registros hay.

2 Botón Todos los Usuarios: Esta opción despliega la lista de todos los usuarios para mayor facilidad de visualización. La pantalla que se muestra es la siguiente:



E	Usuarios PWPREI - RIESGO E INVERSIONES						
ĺ	እ 7 🛙						
•							
		Usuarios	PWPREI - RIESG	o e inversiones	1		
	Código	Nombre	Calidad	Fecha Creación	Fecha Ult. Cambio	Estado	
			NORMAL	01/04/2008	01/04/2008	ACTIVO	
	DAVID	DAVID MOSQUERA	SUPERUSUARIO	01/04/2008	01/04/2008	ACTIVO	-

En la parte superior izquierda se encuentran los botones de Modificar, Inhabilitar y Ver Restricciones. Posicionándose en el usuario respectivo podrá llevar a cabo la operación correspondiente.

Al dar Clic en Modificar aparece la siguiente pantalla, en la cual podrá cambiar la información del usuario. Podrá modificar todos los datos a excepción de la fecha de creación.

Una vez haya parametrizado la información del usuario a su gusto, deberá dar clic en Aceptar.



👌 Modificar Usuario	
Código del Usuario	PWPREI
Nombre	pwprei
Password	******
Calidad	NORMAL
Fecha de Creación	01/04/2008 -
Fecha Cambio	01/04/2008 -
Estado	ACTIVO
	Aceptar 🗵 Cerrar

Al dar clic en el botón de Inhabilitar de la lista de todos los usuarios aparece la pantalla anteriormente mostrada con la información del usuario que se desea inhabilitar para que ingrese al sistema. Posteriormente puede hacerlo dando clic en Aceptar y reconfirmándole al sistema que está seguro de inhabilitar dicho usuario.

Finalmente se encuentra la opción Ver Restricciones en la cual podrá visualizar las restricciones en Módulos y Opciones que tiene dicho usuario.

En la pantalla que se muestra a continuación aparece dicho usuario. En el lado superior derecho aparecen los módulos a los que no tiene acceso, en el lado inferior central se encuentran las opciones de los módulos a los que no tiene acceso y finalmente en la parte inferior se encuentra un botón para poder obtener un informe impreso de dicha pantalla.

El funcionamiento del informe es igual al de los demás informes del sistema que ya se han explicado previamente.



🐐 Usuarios Restringidos e	en Módulos y Opciones		
Datos Gen	erales del Usuario	Módulos Restringidos	
Código del Usuario CARI Nombre CARI Password Mor Calidad NOR Fecha de Creación 13/0 Fecha Cambio 01/0 Estado ACTI	LOS LOS MAL 1/2005 6/2005	Módulo ADMINISTRACION DE SEGURIDAD CIRCULAR 031 FRONTERA	
	Opciones Restringidas	para el Usuario	
		Informe	Cerrar

3. Botón Nuevo Usuario: Este botón se debe oprimir siempre antes de crear un usuario nuevo. Es indispensable pues limpia los campos donde posteriormente se va a ingresar la información.

4. Botón Ingresar Usuario: Una vez se haya dado clic en el botón Nuevo Usuario deberá ingresar los datos respectivos y oprimir este botón para registrarlos a la base de datos.

5. Botón Modificar Usuario: Al navegar por los usuarios con las flechas de la izquierda se pueden también por aquí modificar los datos del usuario. Lleve a cabo el proceso y oprima el botón de Modificar.

6. Botón Inhabilitar Usuario: Al navegar por los usuarios con las flechas de la izquierda se pueden también por aquí inhabilitar los usuarios que por determinadas circunstancias no vayan a ingresar más al sistema. Lleve a cabo el proceso y oprima el botón de Inhabilitar.

Nivel Acceso: En el lado derecho debe seleccionar el Nivel, seguidamente debe especificar el Nombre del nivel. Los niveles son Grupo, Línea, Portafolio y Todos; si el nivel seleccionado es Todos esto quiere decir que el usuario tendrá acceso a todos los niveles,



si el nivel es Grupo, Línea, Portafolio el usuario tendrá acceso al nivel y nombre seleccionado.

5.1.2. CONSULTA DE USUARIOS

Al dar clic en esta opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresarse el código de usuario para que aparezca la información respectiva.



Dicha información se muestra a continuación:

🐐 Usuarios				
DATOS GENERALES				
Código del Usuario: PWPREI	Nombre: pwprei			
Password: *******	Calidad: NORMAL			
Fecha de Creación: 01/04/2008 📃 🚽	Fecha Cambio: 01/04/2008 🖃			
Estado: ACTIVO 🖵				
	Cerrar			

5.1.3. RESTRICCIONES DE MODULOS

Esta es la opción donde se restringen los usuarios a los diferentes módulos del sistema de acuerdo a su perfil. Restringir quiere decir que el usuario no tendrá acceso a dichos módulos. El modo de operación es el siguiente:



- Clic en el usuario a restringir (Cuadrícula lado derecho de la pantalla).
- Clic en las cajitas que se encuentran al frente de los módulos que indican que los usuarios no tendrán acceso a estos.
- Clic en el botón Restringir Opciones.

🖻 Restricciones para Módulos						
MODULOS PWPREI	Código	Nombre				
J	PWPREI	pwprei				
	PRUEBA13	PRUEBA COL	FONDOS M	ODIFICADO YN		
Definición de Parametros	DAVID	DAVID MOSQ	UERA			
Información de Mercado y Sociedad						
Portatolios y Riesgo						
Análisis de Sensibilidad						
Back Lesting						
Administración de Seguridad						
Valorizador						
Frontera						
Circular 031						
Circular 003						
Auditoria						
VaR Marginal - Incremental						
Tracking VaR						
Ingrese el código del usuario:	Jan Bu Us	scar 🛃	Restringir Opciones	Eliminar Restricció	n 🗵	Cerrar
]

Inmediatamente aparece un mensaje de Transacción Exitosa.

Si desea quitar la restricción deberá quitar las marcas de los módulos a los que no tenga acceso y oprimir el botón Eliminar Restricción.

Así mismo con el botón Buscar Usuario podrá ingresar el código de usuario en el campo que dice "Ingrese el código de usuario", para que este aparezca señalado en la cuadricula del lado derecho de la pantalla.

5.1.4. **RESTRICCIONES DE OPCIONES**

Esta es la opción donde se restringen los usuarios a las diferentes opciones de cada uno de los módulos del sistema de acuerdo a su perfil. Restringir quiere decir que el usuario no tendrá acceso a dichas opciones. El modo de operación es el siguiente:


- Clic en el usuario a restringir (Cuadrícula lado derecho de la pantalla).
- Clic en las cajitas que se encuentran al frente de las opciones (lado izquierdo de la pantalla) que indican que los usuarios no tendrán acceso a estos.
- Clic en el botón Restringir Opciones.

🖷 Restricciones para Usuarios en Opo	iones		
Médulor	Opciopor	Código	Nombre
		PWPREI	pwprei
		PRUEBA13	PRUEBA COLFONDOS MODIFICADO
		DAVID	DAVID MOSQUERA
	LISTA USUARIUS RE		
	RESTRICCIONES MO		
	RESTRICCIONES OP		
	DELTA NORMAL		
	DURACION MODIFIC		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	MONTECARLO ESTRI		Módulos Restringidos
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI APLICAR A VA		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI DELTA NORM4		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI DURACION M		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI ELIMINAR INV		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI INGRESAR IN		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI MODIFICAR II		
ANALISIS DE SENSIBILIDAD	SENSI MONTECARLC		
Ingrese el código del Uguerio>.		D	Destriction Provide a second
pwprei		Usuario	

Inmediatamente aparece un mensaje de Transacción Exitosa.

Si desea quitar la restricción deberá quitar las marcas de las opciones a los que no tenga acceso y oprimir el botón Eliminar Restricción.

Así mismo con el botón Buscar Usuario podrá ingresar el código de usuario en el campo que dice "Ingrese el código de usuario", para que este aparezca señalado en la cuadricula del lado derecho de la pantalla.

Note que en la parte inferior derecha existe un cuadro donde están los módulos a los que dicho usuario al que se le ha dado clic no tiene acceso, ya que si un usuario está restringido en un módulo, no hay necesidad que se restrinja para las opciones de dicho módulo.



5.1.5. INFORME DE USUARIOS



INFORME USUARIOS PWPREI

Código de Usuario	Nombre	Calidad	Estado	Fecha de Creación	Fecha de l
PWPREI	pwprei	s	A	03/09/2003	06/10/2005
JOSE	JOSE VALENTIN	N	A	03/09/2003	02/09/2005
PRUEBA13	PRUEBA COLFONDOS MODIFICADO	N	I	13/06/2005	13/06/2005
PRUEBA	PRUEBA	N	1	02/07/2004	01/01/2006
CCHICA	CATALINA CHICA	s	A	03/09/2003	14/03/2005
usuario	USUARIO	s	A	13/08/2004	13/08/2004
CARLOS	CARLOS	N	A	13/01/2005	13/09/2005
usuario1	USUARIO1	N	I	10/02/2005	20/04/2005

Con esta opción podrá ver un informe de los usuarios existentes del sistema que puede imprimir posteriormente de acuerdo a como se ha explicado anteriormente.



5.1.6. CONTROL USUARIOS.



Esta opción permite al administrador, consultar el listado de usuarios inactivos, y adicionalmente controlar el Log de Usuarios que muestra los ingresos al sistema.

5.1.6.1. Usuarios Inactivos

🚨 Usuarios Inac	ctivos				×
Codigo	Nombre	Calidad	Estado	Fecha de Creación	Fecha de Cambio
PRUEBA13	PRUEBA COLFONDOS MI	N	Inactivo	01/04/2008	01/04/2008
				Eliminat	Cerrar



5.1.6.2. Log de Usuarios



鰭 Log de Usuar	ios						
Exportar Cer	ar l						
Fecha de Evento	Hora de Evento	Evento	Estado del E	Usuario	Nombre	Calidad	Password
01/06/2005	09:02:37 a.m.	Acceso	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	ÍËÜÖÙÝ ∥
01/06/2005	09:02:05 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	ÍĔÜÖÙÝ ∥
01/06/2005	09:01:24 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	ίξΰούή
01/06/2005	09:01:21 a.m.	Modificación	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	ÍËÜÖÙÝ II
01/06/2005	09:00:59 a.m.	Modificación	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	-≪¼¶¹½
01/06/2005	09:00:44 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	•≪¼¶¹½
01/06/2005	08:59:40 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	•≪¼¶¹½
01/06/2005	08:59:33 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	-≪¼¶¹½
31/05/2005	12:13:54 p.m.	Consulta	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	•«¼¶¹½
31/05/2005	12:13:17 p.m.	Consulta	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	-«¼¶1½

Adicionalmente puede exportar la información del Log de Usuarios, para manejo de informes.

6.1.6.2.1. Parámetros

Con este modulo el administrador del sistema, controla todos los posibles eventos que tienen relación con el Password de los usuarios.



🖳 Parámetros	
Dias Vigencia Password	1000
Dias Vigencia Usuario	1080
Intentos Fallidos	12
Cambios de Clave por Dia	12
Longitud Máxima de Clave	10
Longitud Mínima de Clave	3
Máximo de Dias sin Acceso	90
Aceptar	Cancelar

6.1.6.2.2. Usuarios restringidos

🏴 Consultar Usuarios Restringidos								
Ingrese el código del Usuario>								
Seleccione> ⓒ Módulos ⓒ Opciones	 Detalle Todas las Restricciones 							
	Aceptar 🔀 Cerrar							

Al ingresar el código de usuario en esta opción, escoger posteriormente si quiere Módulos u Opciones y dar clic en el botón Aceptar; podrá ver la lista de dicho usuario con sus módulos u opciones restringidas, es decir a lo que no tiene acceso del sistema **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES.**



🖶 Usuarios Restringidos para Mód	ulos 🔀
MODULOS PWPREI	Código de Usuario: CARLOS
 Definición de Parámetros Información de Mercado y Sociedad Portafolios y Riesgo Análisis de Sensibilidad BackTesting Administración de Seguridad Informes Malorizador Cierre 	MODULOS RESTRINGIDOS PARA EL USUARIO Módulo ADMINISTRACION DE SEGURIDAD CIRCULAR 031 FRONTERA
└── Frontera └── Circular 031	Cerrar

6. LOGS DE AUDITORIA



Esta opción permite monitorear el comportamiento de cada usuario dentro del sistema y las actividades realizadas por este, agrupados por categorías de especies.

Ahora el sistema permite llevar un Log de cambios en el portafolio. Aunque esto no es estrictamente necesario dado que los portafolios son históricos, la función es útil para que el sistema registre todo lo que ocurrió durante el día.

😻 Logs de Auditoría											
Auditoria											
Salir											



6.1. OPCIÓN AUDITORIA







6.1.1. ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE

😻 Logs de A	uditoría - [ESF	ECIES RENTA VA	RIABLE]															BX
6 2-																		_ 8 ×
Ø																		
Auditoria	Fecha	Hora	Usuario	Evento	Especie	Description	Accrf	Emisor	Moneda	Calificacio	Indicador	Estado	CodSuper	Titulo	ISIN1	ISIN2	CurCDT	Catego
A 899	05/11/2010	2:31:41 p.m00001	PWPREI	М	CNEC	CANACOL ENERGY I	ACCION	CNE	COP		IGBVC	A	CAC13PAAO	ACC	CA13480810			
	05/11/2010	2:32:20 p.m00001	PWPREI	M	GRUPOSUR	ACCION DE SURAM	ACCION	SIS	COP		IGBVC	A	COAC55000	ACC	COT13PA000			T
Acco/Dini	30/11/2010	5:02:03 p.m00001	PWPREI	I	PROENERG	PROENERGI S.A.	ACCION	PEN			IGBVC	A	COT75PAAO		COT75PA000			
ACCIDINI	30/11/2010	5:08:16 p.m00001	PWPREI	I	INTERBANC	INTERBANC - PARA	DIVISA	USA	TRM		IGBVC	A	VACIO	DIV				
A	22/12/2010	.:06:37 a.m00001	PWPREI	I	AAPL	APPLE INC	ACCION	11			IGBVC	A	US03783310		US03783310			
Benta Fija	22/12/2010	.:11:26 a.m00001	PWPREI	М	AAPL	APPLE INC	ACCION	APP			IGBVC	A	US03783310	ACC	US03783310			
i i ci i di i di	29/12/2010	3:25:30 p.m00001	pwprei	I	ABX	BARRICK GOLD COF	ACCION	BGA			IGBVC	A	CA06790110		CA06790110			
	29/12/2010	3:33:45 p.m00001	pwprei	I	AMZN		ACCION	AZN			IGBVC	A	US02313510		US02313510			
	29/12/2010	3:36:20 p.m00001	pwprei	I	APC	ANADARKO PETROL	ACCION	ANA			IGBVC	A	US03251110		US03251110			
Esp. Asuc	29/12/2010	3:38:54 p.m00001	pwprei	I	BAC	BANK OF AMERICA	ACCION	BOA			IGBVC	I	US06050510		US06050510			
L DE	29/12/2010	3:46:52 p.m00001	pwprei	I	C	CITIGROUP INC	ACCION	CTG			IGBVC	I	US17296710		US17296710			
	03/01/2011	1:59:55 p.m00001	pwprei	I	GTE	GRAN TIERRA ENER	ACCION	GTI			IGBVC	A	US38500T10		US38500T10			
Esp. Eqv.	03/01/2011	5:01:45 p.m00001	pwprei	I	JNJ	JOHNSON & JOHNS	ACCION	JON			IGBVC	I	US47816010		US47816010			
No	03/01/2011	5:03:12 p.m00001	pwprei	I	JPM	JP MORGAN CHASE	ACCION	JPC			IGBVC	I	US46625H10	ACC	US46625H10			
	03/01/2011	5:04:40 p.m00001	pwprei	I	MUR	MURPHY OIL CORPO	ACCION	MOC			IGBVC	I	US62671710		US62671710			
ParRiesgo	03/01/2011	5:11:44 p.m00001	pwprei	I	PFE	PFIZER INC	ACCION	PHZ			IGBVC	I	US71708110		US71708110			
	03/01/2011	5:13:00 p.m00001	pwprei	I	PG	THE PROCTER & GA	ACCION	PYG			IGBVC	I	US74271810		US74271810			
i inte	03/01/2011	5:14:37 p.m00001	pwprei	I	RIM	RESEARCH IN MOTI	ACCION	RML			IGBVC	A	CA76097510		CA76097510			
	03/01/2011	5:16:04 p.m00001	pwprei	I	SLB	SCHLUMBERGER NV	ACCION	SCH			IGBVC	I	AN80685710		AN80685710			_
r aramvai	03/01/2011	5:16:14 p.m00001	pwprei	м	SLB	SCHLUMBERGER NV	ACCION	SCH			IGBVC	I	AN80685710	ACC	AN80685710			<u> </u>

Este botón corresponde a la auditoria de las Especies de Acciones y Divisas.

6.1.1.1. BUSCAR ESPECIES ACCIONES/DIVISAS.

🛱 Especie Acciones	
-Buscar Por	
24/02/2011 💌	🔲 Fecha
·	🔲 Usuario
·	🗖 Evento
-	Especie
	Todos los registros
Acept	ar Cerrar

La búsqueda se puede hacer por:

- Fecha: Fecha de ingreso al sistema
- Usuario: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación
- **Especie**: Nombre de la especie
- **Todos los Registros**: Muestra todos los registros.

El Sistema suministrará la siguiente información:

- Fecha: Fecha de ingreso al sistema
- Hora: Hora en que se ingreso al sistema
- Usuario: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación



- **Especie**: Nombre de la especie
- **Descripción**: Descripción de la especie
- ACCRF: Si la especie es una acción o pertenece a Renta Fija
- Emisor: Emisor
- Moneda: Moneda
- Calificación: Calificación dada a la especie
- Indicador: Indicador de la calificación
- Estado: A= Activo/Vigente, I= Inactivo, S= Suspendido, C= Cancelado,
- V= Vencido.
- CodSuper: Código Súper
- Título: Título
- Isin1: Isin1
- Isin2: Isin2
- CurCDT: Curva para los CDT`S
- Categoría: Categoría asociado con INFOVAL al título.
- GrupoCal: Agrupa las categorías de las calificaciones
- Portafolio: Portafolio al que pertenece la especie
- **Factor1**: Factor de Riesgo 1 asociado al título
- Factor2: Factor de Riesgo 2 asociado al título
- Estadosusp: Estado Suspensión.
 - o A = Activo
 - o I = Inactivo
 - o P = Suspensión en proceso
 - o L = No hay suspensión
- TipoBursa: Tipo de Bursatilidad
 - o A = Alta
 - o M = Media
 - o B = Baja
 - o I = Mínima
 - o N = Ninguna
 - o E = No inscrita en bolsa
- Porbursa: Porcentaje de bursatilidad
- · ValorPatri: Valor Patrimonial
- Valornomin: Valor nominal
- Fecnomin: Fecha del valor nominal
- · ValorFiscal: Valor Fiscal
- FecFiscal: Fecha del valor fiscal
- · Acccircula: Número de acciones en circulación

6.1.1.2. EXPORTAR ESPECIES ACCIONES/DIVISAS.

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, le botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel las Especies Renta Variable y hacer diferentes informes.





6.1.2. RENTA FIJA.

😻 Logs de A	uditoría - [Especie F	Renta Fija]																BX
5																		- 8 x
Ø																		
Auditoria	Fecha Hora		Usuario	Evento	Especie	Description	Accrf	Emisor	Moneda	Calificacio	Indicador	Estado	CodSuper	Titulo	ISIN1	ISIN2	CurCDT	Ca 🔨
A 899	10/09/2010 1:44:41	1 p.m00001	PWPREI	М	ANDIN2726		RENTA FIJA	L27	272		IRFBVC	A		TIM				
	10/09/2010 h:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	APOPULAR		RENTA FIJA	BPO	COP		IRFBVC	A		APB			CRCDT	
Acc/Divi	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BAGRA605(RENTA FIJA	GNA	COP		IRFBVC	A		BAA				
	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BALF101B1		RENTA FIJA	ALF	COP		IRFBVC	A		BOR				
.	10/09/2010 k:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBAV1991C		RENTA FIJA	BAV	COP		IRFBVC	I		BOR				
Benta Fila	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBB010470		RENTA FIJA	BBO	UVR		IRFBVC	A		BOS			CECUVR	
	10/09/2010 H:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCB041D2		RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	I		BOR				
- E	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCB049D1		RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCB1041B		RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	A		BOR				
Lisp. Asoc	10/09/2010 h:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCI1069A		RENTA FIJA	BCI	COP		IRFBVC	A		BOR	COQ52CB00			-
L DU	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCX02A72		RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	С		BOR			L	
	10/09/2010 H:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCX41A39		RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	I		BOR				_
esp. eqv.	10/09/2010 h:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBCX41A45		RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBOC1049\		RENTA FIJA	BOC	COP		IRFBVC	A		BOS	COB23CB000			
	10/09/2010 H:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBOC205V4		RENTA FIJA	BOC	COP		IRFBVC	A		BOS	COB23CB000			_
ParRiesgo	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBPO1049V		RENTA FIJA	BPO	COP		IRFBVC	A		BOS	COB02CB000			
	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	М	BBSA1059V		RENTA FIJA	BSA	COP		IRFBVC	A		BOS	COB06CB000			
DU D	10/09/2010 h:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBTA1199A		RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBTA1199B		RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
r aramvai	10/09/2010 1:44:4:	1 p.m00001	PWPREI	м	BBTA119A1		RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
	10/09/2010 1-44-4	1 n.m. 00001 li	PWPRFT	М	RRT_119V		RENTA ET1A	BOG	Irop		IRFB\/C	Δ		RPT	1	COG168902	<u>d</u>	

Este botón corresponde a la auditoría de las Especies de Renta Fija.

6.1.2.1. BUSCAR ESPECIES DE RENTA FIJA.



La búsqueda se puede hacer por:

- Fecha: Fecha de ingreso al sistema
- Usuario: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación
- **Especie**: Nombre de la especie
- Todos los Registros: Muestra todos los registros.



El Sistema suministrará la siguiente información:

- · Fecha: Fecha de ingreso al sistema
- Hora: Hora en que se ingreso al sistema
- **Usuario**: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: (I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación)
- **Especie**: Nombre de la especie
- **Descripción**: Descripción de la especie
- ACCRF: Si la especie es una acción o pertenece a Renta Fija
- Emisor: Emisor
- Moneda: Moneda
- · Calificación: Calificación de la especie
- Indicador: Indicador de la calificación
- Estado: A= Activo/Vigente, I= Inactivo, S= Suspendido, C= Cancelado, V= Vencido.
- CodSuper: Código Super
- Título: Título
- Isin1: Isin1
- Isin2: Isin2
- CurCDT: Curva para los CDT'S
- Categoría: Categoría asociado con INFOVAL al título.
- GrupoCal: Agrupa las categorías de las calificaciones
- Portafolio: Portafolio al que pertenece la especie
- Factor1: Factor de Riesgo 1 asociado al título
- Factor2: Factor de Riesgo 2 asociado al título
- Cálculo: Formula de valoración del papel
- Caja: Contiene los datos que requiere el papel, para ser valorado
- Calendario: Corresponde al calendario Comercial o Normal
- Tasaref: Tasa de Referencia
- · Spread: Spread
- Usotasa: Informa si se toma tasa de Inicio o Fin Periodo
- Modalidad: Modalidad
- Rendimiento: Rendimiento
- Rate1: Retefuente 1
- **Rate2**: Retefuente 2
- Comisión: Valor Comisión
- Anualizada: No aplica

• **Reinversión**: Si los intereses generados por el título se reinvierten y la modalidad

- Amortización: % final de retorno del capital del título
- **Fecemi**: Fecha de Emisión
- Fecven: Fecha de Vencimiento



- Tablades: Tabla de desarrollo

• **Díaflujo1**: Para títulos con flujos irregulares, se informa el día de adquisición del titulo

• **MesFlujo1**: Para títulos con flujos irregulares, se informa el mes de adquisición del titulo

- Nemoequiva: Nemotécnico Equivalente

• FlujosRe: Número de flujos que se reinvierten

• **Flagre**: Indica el tipo de capitalización del papel: No capitaliza, Mixta o Simple

• FecMaxrein: Fecha Máxima de Reinversión

6.1.2.2. EXPORTAR ESPECIES DE RENTA FIJA.

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, le botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel las Especies Renta Fija y hacer diferentes informes.

Logs de Auditoría - [Especie Renta Fija]
6.
Ø

6.1.3. ESPECIE ASOCIADA

😻 Logs de Ar	uditoría - [E	pecie Asociada]																
6 2-																	-	a ×
1																		
Auditoria	Fecha	Hora	Usuario	Evento	Especie	Fecemi	Fecven	Modalidad	Reinversión	Moneda	Tasaref	Spread	CQP	Especie2	Fecemi2	Fecven2	Modalidad2	Reinve
Acc/Divi									1			1						
Renta Fija																		
Esp. Asoc																		
Esp. Eqv.																		
ParRiesgo																		
ParamVal																		

Este botón corresponde a la auditoría de las especies que por su falta de liquidez se asocian a otra a fin de obtener suficiente información histórica para evaluar el riesgo de mercado.



6.1.3.1. BUSCAR ESPECIE ASOCIADA

🛢 Especie Asociada	
-Buscar Por	
24/02/2011 💌	🗖 Fecha
·	🗖 Usuario
·	🗖 Evento
•	Especie
	Todos los registros
	ar 🔀 Cerrar

La búsqueda se puede hacer por:

- **Fecha:** Fecha de ingreso al sistema
- Usuario: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación
- **Especie**: Nombre de la especie
- Todos los Registros: Muestra todos los registros.

El sistema suministrará la siguiente información:

- Fecha: Fecha de Ingreso
- Hora: Hora de Ingreso
- Usuario: Usuario que ingreso al sistema
- Evento: (I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación)
- **Especie**: Especie
- **Fecemi**: Fecha de Emisión
- Fecven: Fecha de Vencimiento
- Modalidad: Modalidad
- Reinversión: Reinvsersión
- Moneda: Moneda
- TasaRef: Tasa Referecia
- **Spread**: Spread
- CQP: Completo, Cupón, Principal
- **Especie2**: Especie
- Fecemi2: Fecha de Emisión
- **Fecven2**: Fecha de Vencimiento
- Modalidad2: Modalidad



Reinversión2: Reinversión
 Moneda2: Moneda
 TasaRef2: Tasa Referencia
 Spread2: Spread
 CQP2: Título (Completo, Cupón, principal)

6.1.3.2. EXPORTAR ESPECIE ASOCIADA

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, el botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel las Especies Asociadas y hacer diferentes informes.

6.1.4. ESPECIES EQUIVALENTES



Este botón corresponde a la auditoria de las especies que para efectos de VaR diversificado y neteo en este proceso se asimilan a otra como si se tratara de la misma.

6.1.4.1. BUSCAR ESPECIES EQUIVALENTES

La búsqueda se puede hacer por:

🛱 Especie Equivalent	te 🛛 🔀						
Buscar Por							
24/02/2011 💌	🗖 Fecha						
-	🗖 Usuario						
-	Evento						
	🗖 Especie						
	Todos los registros						
[
Aceptar 🔀 Cerrar							

Fecha: Fecha de ingreso al sistema



Usuario: Usuario que ingreso al sistema

Evento: I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación **Especie**: Nombre de la especie **Todos los Registros**: Muestra todos los registros.

El Sistema suministrará la siguiente información:

Fecha: Fecha de Ingreso **Hora** : Hora de Ingreso Usuario: Usuario que ingreso al sistema Evento: (I-Ingreso, M- Modificación, E-Eliminación) **Especie** : Especie Fecemi: Fecha de Emisión Fecven: Fecha de Vencimiento Modalidad: Modalidad **Reinversión**: Reinversión Moneda: Moneda TasaRef: Tasa Referencia Spread: Spread CQP: Completo, Cupón, Principal Especie2: Especie Fecemi2: Fecha de Emisión Fecven2: Fecha de Vencimiento Modalidad2: Modalidad Reinversión2: Reinversión Moneda2: Moneda TasaRef2: Tasa Referencia Spread2: Spread **CQP2**: Título (Completo, Cupón, principal)

6.1.4.2. EXPORTAR ESPECIES EQUIVALENTES

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, el botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel las Especies Equivalentes y hacer diferentes informes.



6.1.5. PARAMETROS DE RIESGO



Muestra la información de los cambios ocurridos en los parámetros de Riesgo; por fecha, usuario, evento, especie o todos los registros.

6.1.5.1. EXPORTAR PARAMETROS DE RIESGO

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, el botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel los Parámetros de Riesgo y hacer diferentes informes.

5 A				
😻 Logs de A	uditoría - [PARAMETROS VALORIZADOR]			_ 0 🛛
6				
<i>i</i>				
Auditoria				
Acc/Divi	Parametros Valorizador			
Renta Fija	-Buscar Por			
1	Evento			
Esp. Eqv.	Todos los registros			
ParRiesgo	Aceptar 🔀 Cerrar			
W				
ParamVal				

6.1.6. PARAMETROS DE VALORACIÓN

Muestra la información de los cambios ocurridos en los parámetros de Valoración; por fecha, usuario, evento, especie o todos los registros.

6.1.6.1. EXPORTAR PARAMETROS DE VALORACIÓN

Después de realizar la búsqueda y que haya obtenido resultados, el botón Exportar se habilita; lo cual podrá exportar la información a Excel los Parámetros de Valoración y hacer diferentes informes.



NOTAS OPERATIVAS – LOGS DE CUPOS

Estas notas hacen referencia al Log de Cupos en PWPREI.

1. Datos auditados.

Hay dos conjuntos de datos que se auditan sobre el control de cupos en PWPREI:

- Parámetros de Cupos. Se refiere a los parámetros que establecen el comportamiento de los cupos, mediante los cuales el sistema determina como aplicarlos según el tipo de compromiso y el destino(emisor, trader o contraparte).
- Cupos. Se refiere a los cupos asignados a cada emisor, trader o contraparte.
- 2. Eventos auditados.

Los siguientes eventos son auditados, según el origen:

- Log de Parámetros. Los parámetros se auditan cuando se modifican, por la pantalla de administración de cupos, los ya establecidos. Dado que estos se arrancan pre establecidos en el sistema, el único evento auditable es la modificación.
- Log de Cupos. Los cupos se auditan en los eventos generados en la pantalla de administración de cupos:
 - Registro de nuevos cupos.
 - Modificación de cupos existentes.
 - Eliminación de cupos existentes.

DEFINICIÓN DE	: PARAME I KUS
Archivo General	Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana
PWPREI	B - Cupos EMISOR - CONTRAPARTE - TRADER
ParRiesgo	Parametros Tipo Cupo Tipo Compromiso Punta En Fec. Oper. En Fec. Comp/Verta Valor Fuerte TRADER CONTADOMAS COMPRA CONSUME DESCARGA VALOPE Aplicar Descartar
ParValora MonTasFWD	Empresa/Fideicomiso 9003380734 PwP SOFTw/ARE SAS. Fecha Registro 12/06/2016 • TRADER Cupo Vigencia Total Consumo Saldo Saldo Saldo ExtraCupo 31/12/2016 • 31/12/2016 • 1 1 Consumo Saldo Saldo
ParContab	ALIANZA FIDUCIARIA S.A. 🕅 Aplicar 🔀 Descartar 🕬 Agregar 🗙 Eliminar 🛞 Inicializar 😒 뻺 Salir
CUPOS SetPartren.	
EntesRegula Pactures VaPreCom	
PatDinero General	
Cár Cinning	
Super Financiera	
Contrapartes	
Emisor	



3. Consulta del Log.

Para consultar el Log de Cupos ingrese al módulo de Auditoria, opción "Cupos":

🧈 Logs de Au	uditoría	
Auditoria		
Acc/Divi		
(Tenta Fija	🖏 Consulta del Log 📃 📼 💌	
Esp. Asoc	12/06/2018 Fecha Inicial 12/06/2018 Fecha Final Elija:	
Esp. Eqv.	Usuario Cupos	
ParRiesgo	Todos los registros	
ParamVal	Aceptar 🔀 Cerrar	
ParContab		
Custodios		
ParGenerales		
CUPOS Salir		

Una vez haya establecido los criterios de búsqueda pulse "Aceptar". Le saldrá una pantalla como la siguiente:



🖏 Log Cupos										
FechaEvento	loraEvento	Evento	Usuario	NombreDato	DatoAnterior	DatoNuevo	FechaRegistro	NitEmpFide	ТіроСиро	Co
16/07/2018	17:43:33	MODIFICA	PWPREI	ExtraCupo	0	3,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	
10/07/2010	17. 10.11	HODITICA	I WI INCA	rechavigencia	30/00/2013	50/00/2020	12/00/2010	500550075-1	CONTRACTO	
16/07/2018	17:42:58	MODIFICA	PWPREI	FechaVigencia	31/12/2018	30/06/2019	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	P۱
16/07/2018	17:42:35	MODIFICA	PWPREI	FechaVigencia	31/12/2018	31/03/2019	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	
16/07/2018	17:42:09	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	EMISOR	BC
16/07/2018	15:58:36	MODIFICA	PWPREI	Cupo	15,000,000,000	20,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	P۱
16/07/2018	15:58:25	MODIFICA	PWPREI	Cupo	10,000,000,000	15,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	P۱
16/07/2018	15:58:15	MODIFICA	PWPREI	Cupo	8,000,000,000	9,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	
10/07/2018	17:48:10	ELIMINA	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	AE
10/07/2018	17:47:54	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	
10/07/2018	17:46:27	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	A
10/07/2018	17:43:49	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PV
¢										
< C Exporter	Cerrer									
C Exportar Registro(s) 12	Cerrar									
< Exportar Registro(s) 12	Cerrar									

6.1.7. PARAMETROS CONTABILIDAD



🖏 Log P	🖏 Log Parámetros Contables											- [ı ×		
FechaEvent	HoraEvento	Usuario	Estacion	EventoLg	TipoPUC	Destino	TipoComproi	TipoContra	TipoInversio	Punta	Especie	FechaEmisio	FechaVencin	Evento	ValorFu 🔺
26/06/2018	17:49:11	PWPREI	PWPGERIDM	ASOCIAR	NA	NA	NA	NA	NA	NA	CONTRA2	NA	NA	NA	NA
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIERC	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENDIS
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIERC	PROPIO	SIMULTANE/	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/	SEG	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENDIS
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENDI:
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE/	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCA
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIERC	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE/	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGERENC	MODIFICA	FINANCIER(PROPIO	SIMULTANE	SCP	VENCIMIENT	PASIVA	TFIT152407	NA	NA	VALORAR	RENDI:



6.1.8. CUSTODIOS

	🖏 Consulta del Log		_		\times	
Auditoria						\times
i	Por favor seleccione a la c	lerecha los c	onceptos	; de bús	queda.	
					Aceptar	
		odos	los registro	08		
	Aceptar	Cen	ar			

PARAMETROS GENERALES 6.1.9.

5. Log Parámetros Generales

🖏 Log Parámetros Generales —										
FechaEvent	HoraEvento	Usuario	Estacion	Evento	ParNum	Nombre	ParVal			
08/11/2017	20:01:17	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8112	ACTIVO=Contabilizar diferencia en cambio títulos	ACTIVO			
24/05/2017	14:49:21	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8046	00=default, 01=Infovalmer, 02=PIP				
11/04/2017	08:37:09	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8080	ACTIVO_ECT=Control Cupos Emisor,Contraparte,Trader=Activo				
11/04/2017	08:36:44	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8080	ACTIVO_ECT=Control Cupos Emisor,Contraparte,Trader=Activo	ACTIVO_ECT			
09/11/2016	16:08:27	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8013	Utilidad en Venta, Default PREMER=Val Ven - ValMer Ayer, C-V=ValVen - Valor Compra	PREMERTODO			
28/10/2016	11:32:45	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	-9986	Usuario autorizado para Devolver Cierres	PWPREI			
28/10/2016	11:32:24	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	-9986	Usuario autorizado para Devolver Cierres	CARLOS			
27/10/2016	16:28:40	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8001	Movimientos Contables: ACTIVO o INACTIVO	ACTIVO			
27/10/2016	16:28:14	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8001	Movimientos Contables: ACTIVO o INACTIVO	INACTIVO			
08/03/2016	18:54:43	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8091	Control de ISINES. ACTIVO=Verificar ISINES	ACTIVO			
08/03/2016	18:53:46	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8091	Control de ISINES. ACTIVO=Verificar ISINES	ACTIVO			
08/03/2016	18:52:32	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8071	PREMER=VaR Carteras con PREMER, CURVA=con puntos curva dve titulo,"" u OTRO=como circular				
08/03/2016	18:52:13	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8071	PREMER=VaR Carteras con PREMER, CURVA=con puntos curva dve titulo,"" u OTRO=como circular	PREMER			
08/03/2016	18:45:08	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8003	Notificaciones:ACTIVO=notifica pagos, ingresos, INACTIVO=no notifica	INACTIVO			
08/03/2016	18:44:50	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8003	Notificaciones:ACTIVO=notifica pagos, ingresos, INACTIVO=no notifica	ACTIVO			
08/03/2016	18:35:29	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8010	Numeración o Consecutivo general del sistema				
08/03/2016	18:34:57	PWPREI	PWP-GEREN	MODIFICA	8001	Movimientos Contables: ACTIVO o INACTIVO	ACTIVO			

6.1.10. CUPOS

🖏 Consulta del Log	_		
07/03/2019 V 05/04/2019 V V	 Fecha Inicial Fecha Final Usuario Evento Especie Todos los regis 	Elija: © Cupos © Par Cupos stros	
Aceptar	Cerrar		



7. CIRCULAR 016



🗯 INFORMES	SUPERFINANCIERA
Circular 016	
Circular 008	
Salir	

7.1. OPCION CIRCULAR 016





7.1.1. FORMATOS

🗯 INFORMES	SUPERFINANC	IERA - [Supe	r Financiera]												_ @ 🗙
6																- 8 ×
🔊 🖓 📥 10	C 🖻 🌄 🖉 🖡	•													,,	
Circular 016	Portafolio	Punta	Especie	Vir Compra	Depósito	Número	Negocio No.	Orden No.	Fec Emisión	:c Vencimient	. Compromise	Modalidad	Tasa Nominal	Cantidad	Tasa Efectiva	Precio
Formatos																
Generar																
Procesos																
Formatos Excel																
Cerrar																
Circular 008																
Sair																
	< [11]															>

Al dar clic en Formatos se carga una grilla y se activa la barra de herramientas en la cual puede Buscar, Ingresar, Cargar Datos, Modificar, Eliminar y Exportar.

7.1.1.1. BUSCAR FORMATOS

Buscar Inversiones		
Fecha Proceso DE/01/2009 💌		
Aceptar 🔀 Cerrar		

Esta consulta se hace con el fin de que pueda buscar lo que maneja en su portafolio para ingresar la información adicional con el fin de generar posteriormente los formatos especificados en la Circular 003. La búsqueda se puede hacer por fecha o seleccionando el portafolio.

Cuando sale la siguiente pantalla es porque no hay datos eso quiere decir que ese portafolio no ha sido importado.





7.1.1.2. INGRESAR FORMATOS

🛋 Inver003						
	Fech	a de Registro 12/2010 💌				
Portafolio	VAMCOL			IINFU		
Especie Cantidad	40712778			Base Provisión	1. Titulos Deuda-Vr. Resid	lual 💌
				Avalado Restricción	SI: esta avalado 👻 2.No Restringido 💌	
PUC Inversión		Fungible		Sistema	9.Otro	
PUC Provisión		Val Provisión		Mercado Novedad	1.Primario 1.Compra	-
PUC Causación	Res.	Val Causación Res.		Origen Novedad		
PUC Causación	Patimonio	Val Causación Patimo	nio	Compensación Cal. Crediticio	A.Riesgo Normal	-
		,				
					Aceptar	Cerrar

Fecha de Registro.- Esta fecha debe ser igual a la fecha Actual del proceso de Cierre.

Portafolio.- Portafolio al que se asigna el título o inversión.

Especie.- Nombre de la especie existente en el Sistema

Cantidad.- Valor nominal del título.

PUC Inversión.- Compromiso="NINGUNO":Subcuenta donde se halla registrada la inversión.

FORWARDS: Digite la cuenta de la valoración a precios de mercado.

Fungible.- Fungible DECEVAL, si el título está en el DECEVAL. Si está en DCV se toma el número de emisión de la especie.

PUC Provisión.- Subcuenta donde se halla provisionada la inversión **Val Provisión.-** Valor de la provisión

PUC Causación Res.- Subcuenta de causación de la valoración en cuentas de resultados. Cuando se trate de Forwards registre



aquí el PUC del derecho.

Val Causación Res.- Valor causado por valoración en cuentas de resultados. Cuando se trate de forwards se registra aquí el valor del derecho.

PUC Causación Patrimonio.- Subcuenta de patrimonio de causación de la valoración. Cuando se trate de Forwards registre aquí el PUC de la obligación

Val Causación Patrimonio.- Valor causado por valoración en cuentas de patrimonio. Cuando se trate de forwards se registra aquí el valor de la obligación.

Base Provisión.- Registre 1= si se trata de títulos de deuda y la base de cálculo es el valor nominal neto de amortizaciones (valor residual), es decir, si se trata de aquellos títulos que no se pueden valorar de conformidad con lo dispuesto en los literales a, b y d del numeral

6.1.1 del capítulo I de la CBCF. Registre 2= si son títulos de deuda y la base de cálculo es el valor de mercado de la inversión, es decir, si se trata de aquellos títulos clasificados como hasta el vencimiento pero se pueden valorar de conformidad con lo dispuesto en los literales a, b y d del numeral 6.1.1 del capítulo I de la CBCF. Registre 3= si se trata de títulos participativos, cuya base de cálculo es el costo de adquisición.

Avalado.- SI:Título avalado, NO: no avalado, PA: parcialmente **Restricción.-** Registre 1 = si el título tiene gravamen, embargo, medidas preventivas o cualquier otra naturaleza que impida su libre cesión o transferencia ó 2 = si no tiene restricción alguna.

Sistema.- Registre el código del medio de negociación o de registro: 1 = Continuo-MEC, 2 = Serializado-MEC, 3 = SEN, 4 = SIF Garban, 5 = Gesmosa, 6 = Telepregon, 7 = Fuera de rueda, 8 = Evento en el cual la operación no se realizó por los medios de negociación anteriores y se registró en INVERLACE y 9 = Otro. **Mercado.-** Primario-Secundario

Novedad.- Registre el código del tipo de novedad: 1 = compra; 2 = venta; 3 = cancelación por fraccionamiento; 4 = creación por fraccionamiento; 5 = cancelación por unificación y 6 = creación por unificación.

Origen Novedad.- Si el tipo de novedad es 4, registre el número asignado por la entidad a la inversión que originó el fraccionamiento. Si el tipo de novedad es 5, registre en este campo el número asignado por la entidad a la inversión que se originó con la unificación. (Alfanumérico)

Compensación.- Registre el código según la compensación utilizada: DVP = entrega contra pago con liquidación bruta, CES = compensación especial con entrega libre de Pago (aplica solamente para títulos en DECEVAL), CET = compensación especial plena



(aplica para títulos en DECEVAL y DCV), NET = neto bolsa, REP = repo compensado. (Alfanumérico)

Cal Crediticio.- Registre la calificación de la inversión por riesgo crediticio, establecida por el inversionista de conformidad con el numeral 8.2 del capítulo I de la CBCF: A = Riesgo normal, B = Riesgo aceptable, C = Riesgo apreciable, D = Riesgo significativo, E = Inversión incobrable. Para aquellas inversiones que cuenten con calificaciones externas registre la información consignada en la columna 49. (Alfanumérico)

Para no estar actualizando manualmente se puede hacer por la opción de Cargar datos (ver

2.7.1.1.4. CARGAR DATOS DE FORMATOS)

7.1.1.3. MODIFICAR FORMATOS

Se abre la siguiente pantalla donde se puede hacer la actualización de un determinado Portafolio.

🛋 Inver003						X	
	Fech	a de Registro 12/2010 💌	_	_ IINFO			_
Portafolio	VAMCOL		_				
Especie	CDTBCBSOV				1 Titulae Doude Mr. Residu		
Cantidad	40712778			Base Provisión	T. Huios Deuda-vr. Hesidu	a 💌	
CIIU - VAL				Avalado	SI: esta avalado 💌		
PUC Inversión		Funcible		Restricción	2.No Restringido 💌		
				Sistema	9.Otro 💌		
, PUC Provisión		, Val Provisión		Mercado	1.Primario 🗨		
				Novedad	1.Compra	-	
PUC Causación	Res.	Val Causación Res.		Origen Novedad			
		1		Compensación	-		
PUC Causación	Patimonio	Val Causación Patimo	onio	Cal Crediticio	A.Riesgo Normal 👻		
1		1			,		
					Aceptar	Cerrar	

7.1.1.4. CARGAR DATOS DE FORMATOS

Toda esta información se puede cargar mediante un archivo de Excel, sin necesidad de estar actualizando manualmente una a una las inversiones de su portafolio, con el Botón de carga de Datos; al pulsarlo se abre una ventana, en la cual puede escoger el nombre del archivo de Excel a cargar, dando clic en aceptar empieza la



carga de la información de dicho archivo.

🛱 Carga de Datos				
Cargue Automático Archivo (*.txt)				
Forma de Carga Anexar a esta fecha Reiniciar carga para esta fecha	Fecha Carga	06/01/2009		
	•	Imprimir Errores	Aceptar	Cerrar

7.1.1.5. IMPORTAR FORMATOS

Cuando se presiona el botón de importar datos aparece la siguiente pantalla:

🖻 Importar Portafolio			
	Fecha Portafolio 06/01/2009 💌 Nivel PORTAFOLIO 💌	Fecha de Cargue 06/01/2009 💌 Nombre EMISORES PRIV.	•
	Aceptar	Cerrar	

Debe seleccionar la fecha de Portafolio, de Cargue, seleccionar el nivel e igualmente el nombre del Portafolio. Cuando presiona el botón Aceptar aparece la





siguiente pantalla, donde se confirma que el portafolio ha sido importado.

7.1.2. GENERAR FORMATOS

🚰 Formatos	×				
Fecha de Proceso Tipo Entidad	Código Entidad Clave				
Tipo de Reporte	Tipo de Formatos				
O. Portafolio de Inversión	F351 F355 F360				
C 1. Novedades de Inversión	F352 F356 F 362				
C 2. Derivados	□ F353 □ F357 □ F396				
 3. Interbancarias 	E E354 E E358 E E397				
4. Inversiones de las reservas					
Características Adicionales © Completo Consecutivo © Parcial Limpiar Selección					
Aceptar 🔀 Cerrar					

FECHA DE PROCESO.- Corresponde a la fecha del portafolio a reportar.

TIPO DE
de**ENTIDAD.-**
Corresponde a su tipo de entidad
a la Superintendencia Financiera

CODIGO DE ENTIDAD.- Corresponde a su código de entidad de acuerdo a la Superintendencia Financiera.

CLAVE.- Clave de transmisión asignada por la Superintendencia Financiera.

El sistema permite generar un solo archivo con todos los formatos o generar un archivo por cada uno de los formatos, de acuerdo a nuestra interpretación del instructivo suministrado por la Superintendencia Financiera se debería generar uno por cada formato puesto que tienen diferente tipo de informe. Sin embargo es posible producir archivos por grupo de informe seleccionado los que tengan un mismo color, porque estos tienen el mismo tipo de informe.

CARACTERISTICAS ADICIONALES.- Los archivos se pueden generar de dos formas:

- **COMPLETOS.-** Seleccionando esta opción el sistema al generar el archivo lo deja listo para ser enviado a la Superintendencia Financiera, es decir contiene desde el encabezado hasta el fin de archivo de acuerdo al documento técnico de la Superintendencia Financiera.
- **PARCIAL.-** Esta opción se utiliza cuando se desea pegar un archivo a otro. Se da clic en PARCIAL, a continuación se digita el consecutivo a partir del cual se desea que inicie el archivo



luego seleccione el o los formato que desee incluir en el archivo y de aceptar. El sistema genera un archivo sin encabezado, numerado a partir del consecutivo que se indicó y con registro tipo 6 al final. Mire este registro Tipo 6 y tome de ahí el número total de registros para que lo coloque en el registro tipo del 1er. archivo, una luego los dos archivos y podrá trasmitir. Sin embargo esta opción no garantiza que los dos archivos se ajusten a las condiciones de generación de la SuperFin cuando se trate de conceptos de transmisión similares, aunque estructuralmente nuestro archivo y el otro sean correctos.

7.1.2.2. PROCESOS DE LOS FORMATOS

NS Procesos 003	
♥ Unir Archivos 003	Información Adicional Archivo 1:
	Aceptar 🔀 Cerrar

Este es el procedimiento para unir los dos archivos y ser enviados a la Superintendencia Financiera.



7.1.3. FORMATOS EN EXCEL



7.1.4. FORMATO 351 DESDE EXCEL

Para generar el formato 351 desde Excel proceda como sigue:

- 1. **Archivo Fuente**. Arme archivo con los datos ordenados de acuerdo con el ejemplo registrado en el archivo de muestra "Formato carga 351 Desde Excel.xlsx"
- 2. **El Formato**. Ingrese a "Circular 016" y Pulse la opción "Desde Excel". Le aparece la siguiente pantalla:





Seleccione el archivo fuente para generar el formato. Pulse aceptar y listo, el sistema convertirá el Excel fuente en el formato 351 para la SFC. El proceso puede tardar unos minutos, dependiendo del tamaño del archivo fuente.

7.2. OPCION CIRCULAR 008





7.2.1.1. GENERAR FORMATOS

🔁 Generar Formatos	- Circular 008					
Datos Básicos Fecha de Med.:	Fecha de Liquid: 06/01/2009 💌	Consecutivo:				
Tipo Entidad	Código Entidad	Clave				
 Tipo de Informe T51: Blces. Diarios - Comisionistas (Ftos: 368 a 372 y 374) T54: Blces. Diarios - Comisionistas (Ftos: 366 y 373) T64: Exceso Lte. de C/tración de Riesgo (Ftos: 375 y 376) Todos los Formatos 						
J.	Aceptar 🔀 (Cerrar				

7.2.1.2. FORMATOS EN EXCEL





7.2.1.3. CONCENTRACION DE RIESGO

🖻 Concentración de Riesgo 🛛 🚺				
-Datos Básicos Fecha de Med.: 10€/01/2009 ▼	Fecha de Liquid: 06/01/2009 💌			
Aceptar	Cerrar			

7.3. OPCION BRP



7.3.1. EXCEL BRP

🖏 Informe BRP			\times
Fecha Registro 07/	03/2019	•	
Nivel TO	00	•	
Nombre Nivel	00	~	
Preparando			
Aceptar	<table-cell></table-cell>	errar	



8. PORTAFOLIOS Y RIESGO



Al dar clic en esta opción aparecerá la pantalla del Módulo de Portafolios y Riesgo, es decir, en donde se pueden hacer las mediciones del *VaR (Valor en Riesgo)*, el ingreso manual y automático de Inversiones y Portafolios y finalmente la aplicación de políticas de control de *VaR*.

Al dar clic en el Modulo de Portafolio y Riesgos pregunta primero la fecha.



Después de seleccionar la fecha debe dar clic en el botón Aceptar, así se generara la pantalla principal de Portafolios y Riesgos.



Inicialmente la pantalla principal se compone de las siguientes opciones:





Esta parte permite definir como desea ver la información de los portafolios. Existen cuatro formas de organizar los portafolios:

- Por Grupo
- Por línea
- Por Tipo
- Por portafolio

A continuación se describirán cada una de ellas.

 Por Grupo: Aquí se encuentran todos los Grupos establecidos por la compañía dentro de los cuales estarán las Líneas de Negocio. Ejemplo: Fondo, Firma. Al dar clic en el nombre del Grupo aparecen los portafolios pertenecientes a cada uno de esos grupos.



• Por Líneas de Negocio: Son las Líneas de Negocio o actividades que desarrolla la firma y dentro de las cuales se clasifican los portafolios.

ę-ど MI	XTO
🔀	FIBMA
😯	FONDO AB
🗄 🛃 RE	NTA FIJA
🌾	CLIENTE
💱	CTA. PROPIA
··· 😵	FONDO

 Por Tipo de Portafolio: Es la agrupación de portafolios por alguna característica común determinada por la firma.





- Por Portafolio: Muestra la lista de todos los portafolios que tiene la entidad.
 - B ··· <mark>⊘ CLIENTE</mark> B ··· <mark>⊘</mark> CTA. PROPIA B ··· <mark>⊘</mark> FIRMA B ··· **⊘** FONDO B ··· **⊘** FONDO AB
- La siguiente pantalla se ha dividido por 4 áreas para una mejor explicación

Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Fipo Linea de Negocio	04/11/2 neficiarios	010		1
E E CLIENTES	INVERSIONES Ingresa Modifica Elimina Punta Especie	Venta Compra	Ver Reversa Negocio No.	3 Orden No.	Fec Emisión
					>

Área 1: Muestra la información general del portafolio que se haya seleccionado. Si se ha marcado un grupo, tipo o línea esos campos quedarán vacíos.



Área 2: Se encuentran los portafolios con sus respectivos títulos, inversiones o papeles.

Área 3: Se encuentran las opciones de Ingreso, Modificación, Eliminación de Inversiones, Compra, Venta, Ver y Reversar.

Área 4: Se encuentra la descripción de dichos títulos.

INGRESAR

Para ingresar la información de una inversión haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema le mostrará la siguiente pantalla para adicionar los datos. Deberá posicionarse en el portafolio donde desea ingresar el nuevo título o inversión. Así mismo podrá posicionarse en el Grupo, Tipo o Línea de negocio, al hacerlo ahí el portafolio y sus respectivas inversiones quedarán en dicho Grupo, Tipo o Línea.

El sistema muestra la siguiente pantalla para escoger el tipo de inversión a ingresar:



De acuerdo a la opción que escoja el sistema le mostrará la pantalla correspondiente.


Cuando escoge el tipo Renta Fija aparece la siguiente pantalla de Ingreso.

🗐 Renta Fija
Tipo de Operación
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 COMPRA LARGA 0 0
Valoración Datos Faciales Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 12/02/2002 12/02/2002 0.00 COMPLETO Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Cantidad Valor de Compra Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Nod1 Image: Completo-Cup-Ppal No1 Image: Completo-Cup-Ppal
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T ítulo MEC MEC NORMAL V
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ▼ ESPECULA ▼ TRA ▼ Cal. Crediticio Inv. ▲
Calcular Cerrar

Después de ingresar la información respectiva deberá dar clic en el botón Aceptar.



Cuando escoge el tipo Acciones aparece la siguiente pantalla de Ingreso.

Acciones
Tipo de Operación ● Normal ○ Contado+1a3 ○ Repo ○ Trans. Temp.○ Oper. a Plazos ○ Forward○ OPCFTRM ○ Opciones ○ InterBancarios
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Número del Negocio 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 0 0 Número de Orden Portafolio Emisor Especie
0 Image: Contraparte Image: Contraparte <t< td=""></t<>
Valoración Cantidad Precio Valor de Compra Valor Captación Valor Giro/Recom Tasa Cpr. Neto Repo 0.0 0.00000000 0.00 0.000 0.000 0.000 0.000 Fec Compromiso Dias Comprom. Orden Comprom. Adicional Trader
28/05/2013 0.000 FINAL 0.000 Trader Comisión Base Comisión Operación Origen PUC Nit Cliente
Usuario Estación Nombre Cliente Estado Título
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago Decl. de Cambio Nral. Cambiario SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA 0 0 0 Lugar de la transacción NA(NA) (PwP=0000) Pais Origen Image: Compensación Image: Compensación
Calcular Cerrar



Cuando escoge el tipo Divisas aparece la siguiente pantalla de Ingreso.

Divisas
Tipo de Operación
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Número del Negocio 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 COMPRA LARGA 0 Número de Orden Postafolio Emisor Especie
Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Forward Depósito Isin/NumEmisión NEGOCIABLE Image: Contraparte Image: Contrana Image: Contrap
Valoración Valor de Compra Valor Captación Valor Giro/Recom Tasa Cpr. Neto Repo 0.0 0.00000000 0.00 0.00000000 0.000 0.000 0.000 Fec Compromiso Dias Comprom. Orden Comprom. Adicional Trader 28/05/2013 0.000 FINAL 0.000 Trader
Comisión Base Comisión Operación Origen PUC Nit Cliente Sistema Usuario Estación Nombre Cliente Estado T ítulo
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago Decl. de Cambio Nral. Cambiario SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA 0 0 0 Lugar de la transacción NA(NA) (PWP=0000) Pais Origen
Calcular Cerrar



MODIFICAR

🗐 Renta Fija
Tipo de Operación
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 COMPRA LARGA 0 0 Emisor Especie Depósito Isin/NumEmisión Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Fw V DCV 0 NEGOCIABLE VIII:03:15:05 NDV VIII:03:15:05
Valoración Datos Faciales Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 12/02/2002 12/02/2002 0.00 COMPLETO Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Cantidad Valor de Compra Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal Mod1 Image: Completo-Cup-Ppal 0.00 0.00 0.00 Cantidad Valor de Compra Image: Completo-Cup-Ppal Modalidad Reinv. Image: Completo-Cup-Ppal Imag
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T ítulo MEC V NORMAL V
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ▼ ESPECULA ▼ TRA ▼ Cal. Crediticio Inv. ▲
Calcular Cerrar

Para modificar información correspondiente a Inversiones, seleccione de la cuadricula ubicada en la parte inferior derecha la especie a la cual desea realizar los cambios, posteriormente oprima el botón de modificación, o también puede dar doble clic en dicha especie. Una vez realizados los cambios haga clic en el botón de aceptar para actualizar la información en la base de datos. La pantalla que aparece es la misma mostrada anteriormente, la diferencia es que aparece la información de la inversión, la cual podrá modificar como se desee.

ELIMINAR INVERSIÓN

Seleccione de la cuadricula ubicada en la parte inferior derecha el registro que desea eliminar, el sistema despliega la pantalla que se mostró anteriormente con la información de la inversión a eliminar. Una vez de clic en el botón de aceptar el sistema le reconfirma si desea o no eliminar el registro.



Eliminar Inversiones y Compromisos Renta Fija
Tipo de Operación © Normal O Contado+1a5 O Repo O Simultáneas O Trans. Temp. O Forward O Opciones O Op. Plazo
Datos Compromiso Posto Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 28/05/2013 COMPRA LARGA PP01 PP01 POSPRODEUDA Image: Compra Tipo Fw Emisor Especie Depósito Isin/NumEmisión Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Fw GOBIERNO NACIONAL TFIT15240720 DCV COL17CT02302 NEGOCIABLE AEV Image: 12:11:42 NDV
Datos Faciales Portafolio - Inversión X3 Emisión Vencimiento Tasa N 24/07/2005 24/07/2020 11.00 Cantidad Valor q 2.000.000,000.0 2.617 Trader Adicional TRADER1 0.0
Comisión Base Comisión Retencion massado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0
PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T ítulo 0 MEC ✓ NORMAL ✓
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv.
Calcular Cerrar

ELIMINAR PORTAFOLIOS

Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Por tafolio	PORTAFOLIC Nombre XX Tipo GNA Linea de Neg PUBLICO	Benefi	30/09/200	1 8 ≪ S.A.	
E CLIENTES	INVERSI	ONES	Venta Comp	ra Ver Reversi	Posiciones 760
	Punta COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA	Especie BGLT10221015 BGLT10221015 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT10080611 TBVT15270513 TFIC05100709	Número N COG178×0031 1 COG178×0031 1 43768 1 <	egocio No. 0rde 107150 127225 100797 88722 96478 96517 117596 117594 102972 88841 86647	No. Fee Emil 49739 24/0 60517 24/0 49489 08/0 43366 08/0 47589 08/0 47607 08/0 49486 08/0 50414 08/0 50357 08/0 42944 27/0 43361 10/0



Al lado izquierdo se despliega el árbol de Portafolios debe dar doble clic sobre el Portafolio que desea borrar; al dar doble clic aparece el siguiente mensaje:

Portafolio	
Desea ELIMINAR este Portafolio? Eliminará todo lo relacio XX en la fecha de registro 30/09/2008	nado con el portafolio
	<u>Sí N</u> o

Al dar clic en Si se eliminara todo lo relacionado con el Portafolio, si no lo desea presione No

TRASLADAR PORTAFOLIOS

Para trasladar una inversión de un portafolio a otro debe ingresar a Portafolios y Riesgos, seleccionar la inversión como se ve en la imagen:

<u>Archivo M</u> etodos <u>Politicas C</u> arga de Portafolios
Archivo Metodos Carga Organizar Consultar • Por Grupo • Por Grupo • Por Tabo • Por Tabo • Por tafolo • Por



Sobre la inversión hacer doble clic y aparece la siguiente pantalla:

Tipo de Operación C Normal C Contado+1a5 C Repo & Simultánea Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punt	a Posición	Nro. Negocio	Nro: de Orden	Trasladar A:
28/12/2012 28/12/2012 28/12/2012 CON Emicor Especie D GOBIERNO NACIONAL US1953258E41 C Datos Facales Emisión Vencimiento	IPRA ULARGA epósito Isrv/NumE ICV US19532 Modelidad I	CON01501	CONDISOI esión Contrapaño IABLE - AEV Compromisos Captación/Salida	Valor Giro/Recompra T.Cpr
20/09/2004 22/12/2014 8.25 Nominal Precio Limpio Principal 1.000.000.0 [100.15 [1.001.500.0 Diss Acum. Inter. Acum Total 6.000 [1.002.875.0	SEMESTRAL - Prima 11,500.0 Estado Título GARLIQ -	VENCIDA V T. Elect. 8:3317516 Precio 100.2875	1.001,000.0 P.Cpr Fec Cpr. 100,1384 03/01/20 Oper Origen/A Cobin 20121228 CDN01	1.001.384.00 2.80 D.Cpr Trader 015 - 5.000 11.236.321 - Observaciones
6	Calcular	Act	eptar 🔀 Cerrar	

En el campo Trasladar a debe seleccionar el nuevo portafolio.

VENTA

Permite señalar una aposición larga y "Venderla". Esto implica que el sistema descarga la posición LARGA del portafolio y registra el "Trading" resultante de la operación de VENTA.

Este botón no es válido para posiciones de LIQUIDEZ (SIMULTANES, REPOS, etc.).

COMPRA

Permite señalar una posición corta y "Comprarla". Esto implica que el sistema descarga la posición CORTA del portafolio y registra el "Trading" resultante de la operación de COMPRA

Este botón no es válido para posiciones de LIQUIDEZ (SIMULTANES, REPOS, etc.).

REVERSAR

Esta opción es útil cuando por efectos de COMPRAR o VENDER una posición esta es sacada del portafolio total o parcialmente.

Después que presiona el botón Reversar, El sistema busca las compras y ventas del día que se hayan sacado del portafolio, parcial o totalmente, mostrando una



lista como se ve en la figura:

G Compras	s y Ventas c	lel día				
Portafolio	Deposito	NumDcvDvl	NumNegocik	NumOrden	Punta	Secuencia
DIVISAS	DVL	1	D4	D4	COMPRA	2917

Ubique el ratón en la operación que desea reversar y pulse doble clic. Aparecerá la operación, como se muestra la figura:

REVERSAR Inversiones y Compromisos Acciones y Divisas	X
Tipo de Operación	
	FTRM C Opciones
Datos Compromiso	
Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta	Posición Número del Negocio
06/05/2010 V 06/05/2010 V COMPRA V	LARGA 🔽 D4
Número de Orden Portafolio Emisor	Especie
D4 DIMISAS STADOS UNIDOS D	
Tipo Inversión Contraparte Hora Compra	Tipo Forward Depósito Isin/NumEmisión
NEGOCIABLE 🗸 AEV 🔽 11:28:30 a.m. 🛨	NDV V DVL V 1
Vela an elfa	
Cantidad Precio Valor de Compra Valor Giro/Becom	Valor Captación Tasa Beno
1,200,000.0 1,999.000000 2,398,800,000.00 0.00	0.0000000 0.000
Fee Compromise Dias Comprom Orden Comprom Adicional	Trader
	Trader
Comisión Base Comisión Operación Origen PUC	Nit Cliente Sistema
0.0 0.0	MEC 🗸
Usuario Estación Nombre Cliente	
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago De	ecl. de Cambio Nral. Cambiario
SECUNDARIO V ESPECULA V DVP V TRA V 0	0
Lugar de la transacción NA (NA) (CAVD-0000)	Pais Origen (000/Colombia)
	_
🛗 Calculat 🛛 🏹 Aceptar 🚺	Cerrar

Para confirmar que desea reversar la operación pulse "Aceptar", para descartar pulse "Cerrar". Si pulsa aceptar le aparecerá el siguiente mensaje:





Seguidamente podrá ver la operación en el portafolio

respectivo. Se debe tener en cuenta que:

- El sistema reversa la operación.
- El registro inicial en el Log del portafolio, de la operación que se compró o se vendió, queda como inicialmente se registró.
- Los movimientos contables generados por la compra o venta son eliminados y se dejan los registros antes de ese suceso.
- Las notificaciones producidas por la compra o la venta son descartadas y se dejan los registros antes del suceso.
- Todo queda como si no se hubiese realizado la COMPRA o VENTA.
- Todo movimiento contable o notificación que no sea posible eliminar, por ser ya un hecho cumplido, genera movimientos de reversión; por lo tanto se deben realizar las notas contables correspondientes dado que, como se acordó, las reversiones no se procesan en la interfaz contable.

NOTAS OPERATIVAS - CORTOS CUMPLIR

A continuación se presenta el proceso de operación en corto. El procedimiento operativo interno exige los siguientes pasos:

- Registrar primero la simultánea activa, donde recibimos el título, así en el mercado se haya realizado primero la venta en corto, esto es solo por cuestiones del procedimiento operativo en el sistema.
- Vender el título recibido.
- Comprar un título con el propósito de cubrir la simultánea activa, o utilizar uno que haya entrado al portafolio en algún momento
- Ejecutar la acción de cubrir el corto; es decir, trasladar el título del portafolio al pasivo de la simultánea para cubrirla.

A continuación, ilustramos el proceso:



1. Tenemos la siguiente ACTIVA:

Tipo de Operación Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio Od/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 VENTA CORTA VX2379 0 Nro. de Orden Portafolio Out/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 024/05/2015 VENTA CORTA VX2379 0 Nro. de Orden Portafolio Emisor Especie Depósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Forward GOBIERNO NACIONAL TFIT16240724 OCV C COL17CT02385 NEGOCIABLE AEV Image: Precio Captación/Salida Datos Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión Cantidad Valor de Compra UIt.VIr. Mercado PyG/Trading. VenciDA 143.971797! 2.879.435.951.80 Cantidad Valor de Compra UIt.VIr. Mercado PyG/Trading. VencIDA Dias Cpr Pec Compromiso Irden CPR 1.000 0.2879.7435.951.8 2.582.460.000.0 296.975.951.8 VENCIDA Dias Cpr Fec Compromiso Irden CPR 1.000 0.0 NO APLICA NO APLICA NO APLICA NO APLICA NO APLICA Dias Cpr Fec Compromiso Irden CPR <tr< th=""></tr<>
Datos Compromiso Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 VENTA CORTA XZ379 0 X Image: Constant of Contraparts Hora Compra Tipo Forward G0BIERNO NACIONAL TFIT16240724 DCV COL17CT02385 NEGOCIABLE AEV Image: Constant of Contraparts Hora Compra Tipo Forward Datos Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal ComPleto-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida 5.00 143.971797! 2.879,435.951.80 Cantidad Valor de Compra Ult.VIr. Mercado PyG/Trading. YenCIDA Nalor de Compra Valor Giro/Recompra 2.000.000.000.0 2.879,435.951.8 2.582,460.000.0 296.975.951.8 YENCIDA Dias Cpr Pec Compromiso Irden CPR 1.000 02.007.2015 0.0 NO APLICA NO APLICA NO APLICA Dias Cpr Fec Compromiso Irden CPR 1.000 05/05/2015 TNAL Taslado Operación Origen/A Cubrir
Datos Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Captación/Salida 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Captación/Salida 2000.000.000.0 2,879,435,951.8 Ult.VIr. Mercado PyG/Trading. T. Repo/Cpr Oper. Regreso Valor Giro/Recompra 1rader Addicional Modalidad Reinv. Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Compromiso Irden CPR 1.000 0.0 NO APLICA NO APLICA Operación Origen/A Cubrir Comisión Base Comisión Retención Traslado Operación Origen/A Cubrir
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir
0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación 0 MEC GARLIQ
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION SECUNDARIO V ESPECULA V DVP V TRA V Cal. Crediticio Inv. A 53059

2. Vendemos el título:



📋 Vender/Fondear Inversiones y Compromisos Renta Fija
Tipo de Operación
Datos Compromiso Fecha Der Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 04/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 VENTA CORTA XxZ405 0 Xx Image: Constraint of the const
Valoración Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Captación/Salida 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Captación/Salida 2,000,000,000.0 2,889,000,000.0 2,879,435,951.8 564,048.2 VENCIDA 0.00 0.00 0.00 Trader Adicional Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Compromiso Orden CPR TRADER1 0.0 N0 APLICA N0 APLICA N0 APLICA FinAL FinAL
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 20150504:><2379
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv. A 53059
Calcula Cerrar

3. La simultánea nos queda en corto:



🗐 Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija 🗾
Tipo de Operación C Normal C Contado+1a5 C Repo r Simultáneas C Tr.Temp. C Forward C SWAP C Opciones
Datos Compromiso Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 04/05/201E ▼ 04/05/201E ▼ 04/05/201E ▼ 04/05/201E ▼ VENTA ▼ CORTA ▼ X X ▼ Emisor Especie Depósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Forward GOBIERNO NACIONAL ▼ TFIT16240724 ▼ COL17CT02385 NEGOCIABLE ▼ AEV ▼ 4:27:37 NDV ▼ Datos Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida
24/07/2008 < 24/07/2024
Comisión Base Comisión Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado Título 0 MEC Image: Comissión MEC Image: Comissión Estado Título
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv. A 53059
Calcular Cerrar

4. La operación pasa al día siguiente sin generar el cumplimiento porque está en CORTO. La podríamos CUBRIR el mismo día o cualquier día hasta su cumplimiento, pero para el ejercicio la dejamos en CORTO hasta el día del cumplimiento. Al día siguiente compramos un papel para cubrirla, o usamos este que tenemos en el portafolio:



🗎 Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija 💽 🗠
Tipo de Operación Contado+1a5 C Repo C Simultáneas C Tr.Temp. C Forward C SWAP C Opciones
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 05/05/201E 04/05/201E 04/05/201E COMPRA LARGA X>Z395 395 X Image: Compra Tipo Fw Emisor Especie Depósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Fw GOBIERNO NACIONAL TFIT16240724 DCV COL17CT02385 NEGOCIABLE AEV Image: 3:13:37 NDV
Valoración Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLE TO Image: Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida 10,000,000,000.00 12,612,733,368.0 12,976,500,000.0 363,766,632.0 VENCIDA Image: Compromiso Valor Giro/Recompra 10,000,000,000.00 12,612,733,368.0 12,976,500,000.0 363,766,632.0 VENCIDA Image: Compromiso 0.00 0.00 0.00 Trader Addicional Modalidad Reinv. Image: Compromiso Orden CPR 0.00 04/05/201E FINAL FINAL
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir [0.0]
PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T (tulo 0 MEC MEC NORMAL
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv. A 53059
Calcular Cerrar

Nótese que es un papel de las mismas características faciales y que no está comprometido (TipoOper=Normal).

5. Partir el papel. Como es un papel de mayor valor que el de la simultánea, lo partimos para tener una fracción del mismo valor nominal. Utilizamos el botón SelPartir:

Metodos			
Carga	Organizar	E Upor Listo Salaasianada E Salaasi	anor Todo
Constant		PORTAFOLIO 05/05/2015	
CURSUILA	Por Grupo	Nombre Beneficiarios	^
VeR POSPRO	C. Por Línea		
VeB FONDO	- For crico	Tipo 900338073-4 PWP SOFTWARE SAS.	
	C Por Tipo	GNA	
VeR Reservas	C Por Portafolio		
Salir	E TODOS		
	I TODOS	POBLICO	
	B-E CLIENTES	Eliminar: O X Potafio Nombre: Elia un Austrian Connecte Man	
	- 🔀 CLIMAR1	Becuperar	
	🔀 🗙	C XArchivo Número: Elija un Nro de Archivo - CUMAR3	
		LienarLista C X.Eliminadas Hoy	~
		INVERSIONES	V Incluir Consolidador
			Incluir Portafolios en Zeros
		Ingres Modifica Elimina Venta Compra Tratadar Reversa Burgar Gapatia Sellarir Sellari	Posiciones
		Punta Espècie NUCUV/ISIN Regiono No. Urden No. Pec Emisión Pec Venomenti II. Compromisio Modalidad	Tasa Nominal Cantidad
		VENTA LUP/THM U VX2.356 U 28/04/2015 UB/05/2015 FUM/DIVISA NU VENTA LEFT 45/07/2016 UD/12/CT0/2006 VX2/200 0 24/07/2006 UD/11 ALEA AV/	11.0 2,000,00
		PENTA INTEGENZZU COLLINGTUZZU (VV2300 0 24/07/2003 24/07/2003 INTEGENTER AV	11.0 2,300,000,00
		COMPAR THTTS24020 COLOCID200 XV2300 307 24/07/2003 24/07/2003 INING NO AV	11.0 750,000,00
		VENTA TELES20724 COLL2CT0238 X/2377 0 24/07/2008 SM017202 MIMULTANEA AV	10.0 1.000.000.00
		VENTA TETT 5240724 COL17CT0388 XZ379 0 24/07/2008 24/07/2004 SIMULTANEA AV	10.0 2.000.000.00
		VENTA TFIT16240724 COL17CT0288 XXZ381 0 24/07/2008 24/07/2024 SIMULTANEA AV	10.0 5.000.000.00
		COMPRA TFIT16240724 COL17CT0238 XZ385 384 24/07/2008 24/07/2024 NINGUNO AV	10.0 450,000,00
		COMPRA TFIT16240724 COL17CT0238 XXZ386 384 24/07/2008 24/07/2024 NINGUNO AV	10.0 450,000,00
		COMPRA TFIT16240724 COL17CT0238 X <z395 07="" 2008="" 2024="" 24="" 395="" av<="" ninguno="" th=""><th>10.0 10,000,000,00</th></z395>	10.0 10,000,000,00
			>

Elegimos la fracción que requerimos y presionamos Partir:



Métodos	_			
Carga	Organizar		Jsar Lista Seleccionada 🗖 Seleccionar Todo	
Consultar	6 Decembra	05/05/2015 POR	RTAFOLIO	^
VeB POSPBO	eor Grupoj	Beneficiarios	ACCIONES	
Territo or no	C Por Línea	TTTT 900338073-4 PWP SOFTWARE SAS.	ARQUEO	
VeH FUNDU	C Por Tipo		BP-RENTA FIJA BRASIL	
VeR Reservas	C Por Portafolio		BP-RENTA FIJA COLOMBIA	
Salir		Linea de Negocio	BP-RENTA FIJA MEXICO	
			BP-HENTA FUA U.S.A.	
			CLIMAR1	
		Eliminar: C X.Portafio Nombre: Elija un Archivo Cargado Hoy 🚽	CLIMAR2	
		Recuperar: C XArchivo Número: Elia un Mra do Archivo	CLIMAR3	
	······································		CTA PROPIA OTROS	
		TINVEDSTONES		*
			/aR APTs/Portafolio	Incluir Consolidador
		🛚 💫 🖄 🜠 🚮 📓 🖾 🗖 🕀 M I		Incluir Portafolios en Zeros
				Posiciones
		Ingresa Modifica Elimina Venta Compra Trasladar Reversa Buscar arantia Partir	SelUnir	10
		Punta Especie NDcDv/ISIN Negocio No. Orden No. ec Britosy Concernantes de la concernante de la concernate de la concernate de la concernat	Compromiso Modalidad Tasa Nominal	Cantidad
		VENTA LUP/THM U XX2356 U 28/04/2015 Ut VENTA TELTES/0720 C0117CT02202 XX7260 0 24/07/2005 2	D6/U5/2015 FUHWDIVISA NU	11.0 2,000,00
		COMPRA TELT 15240720 COL 17CT 02303 XXZ380 0 24/07/2005 24 COMPRA TELT 15240720 COL 17CT 02304 XXZ388 387 24/07/2005 24	24/07/2020 SIMOLIANER AV	11.0 250,000,00
		COMPRA TFIT15240720 COL17CT02302 XXZ389 387 24/07/2005 24	24/07/2020 NINGUNO AV	11.0 750,000,00
		VENTA TFIT16240724 COL17CT02385 XXZ377 0 24/07/2008 24	24/07/2024 SIMULTANEA AV	10.0 1,000,000,00
		VENTA TEIT16240724 COL17CT02385 XXZ379 0 24/07/2008 24	24/07/2024 SIMULTANEA AV	10.0 2,000,000,00
	1	VENTA TFIT16240724 C0L17CT0238; XXZ381 0 24/07/2008 24	24/07/2024 SIMULTANEA AV	10.0 5,000,000,00
		COMPRA TELT16240724 CUL17CT0238 XX2385 384 24/07/2008 24 COMPRA TELT16240724 COL17CT0238 XX2385 384 24/07/2008 24	24/07/2024 NINGUNU AV	10.0 450,000,00
		COMPBA TELT16240724 COL17CT0238 XXZ395 395 24/07/2008 24	24/07/2024 NINGUNO AV	10.0 10.000.000.00
		(>

Nos quedan 2 operaciones, una por 2,000,000,000 y otra por 8,000,000,000:

Detal	le de Inversiones y Co	mpromisos Renta I	Fija	
Tipo de Operación ☞ Normal C Contado+1a5 C Repo C Simult	áneas O Tr.Temp. O Forwa	ard O SWAP O Opcio	nes	
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper 05/05/201€ 04/05/201€ Emisor GOBIERNO NACIONAL	Punta Posición COMPRA V LARGA V Depósito ISIN DCV V COL17CT023	Nro. Negocio XZ409 Tipo Inversión C NEGOCIABLE ▼ 4	Nro. de Orden 395 contraparte AEV	Portafolio Hora Compra Tipo Fw S :13:37 NDV V
Datos Faciales Vencimiento Tasa Nominal 24/07/2008 24/07/2024 10.00 Cantidad Valor de Compra Ult.Vlr. Me 8.000.000,000.00 10.090,186,694.4 10.329,84 Trader Adicional Adicional TRADER1 0.0 10.00	Completo-Cup-Ppal COMPLETO PyG/Trading. 10,000.0 239,653,305.6 Modalidad Rei NO APLICA	Modalidad Emisión ANUAL V VENCIDA V NO APLICA V	aloración T. Efect. Pre 7.20 12 T.Repo/Cpr Oper 0.00 0 Dias Cpr Fec I 0.000 05/1	ccio Captación/Salida 6.127333i 0.00 Valor Giro/Recompra 0.00 Compromiso Orden CPR 05/2015 FINAL
Comisión Base Comisión Retención 0.0 0.0 0.0 0.0 PUC Nit Cliente Nombre Cliente 0 0 0 0	Base Retención 0.0 Sistema MEC	Traslado Base T 0.0 0.0 Usuario	Fraslado O F Estación	Peración Origen/A Cubrir PARTIR_20150504:>>Z395 Estado Título NORMAL
Mercado Finalidad Compen SECUNDARIO - ESPECULA - DVP	sación Forma de Pago	Cal. Crediticio Inv. A	#EMISION 53059 Cerrar	
			<u> </u>	



Detalle de Inversiones y Compromisos Re	enta Fija 🛛 💌
Tipo de Operación	Opciones
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fecha Registro Fecha Oper 05/05/2015 ▼ 04/05/2015 ▼ COMPRA ▼ LARGA ▼ Emisor Especie Depósito ISIN	ocio Nro. de Orden Portafolio 395 XX IIII in Contraparte Hora Compra Tipo Fw
GOBIERNO NACIONAL V TFIT16240724 V DCV V COL17CT02385 NEGOCIABL	LE 🗸 AEV 💽 3 :13:37 🛟 NDV 💌
Datos Faciales Modalidad Emisión Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisiór 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL Image: Completo-Cup-Ppal Cantidad alor de Compra Ult.Vir. Mercado PyG/Trading. Image: Cup-Ppal I	Valoración T. Efect. Precio Captación/Salida 7.20 126.127333i 0.00 T.Repo/Cpr Oper. Regreso Valor Giro/Recompra
2,000,000,000.0 2,522,546,673.6 2,582,460,000.0 59,913,326.4 VENCIDA	
TRADER1 0.0 NO APLICA NO APLICA	0.000 05/05/2018 FINAL
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado	Base Traslado Operación Origen/A Cubrir [0.0 [PARTIR_20150504:☆<2395]
PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario 0 MEC ✓	Estación Estado Título
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ↓ ESPECULA ↓ DVP ↓ TRA ↓ Cal. Crediticio Implementation	#EMISION
Calcular 🔊	ceptar Cerrar
	0311 297177711001 297177711291 NUS

6. Cubrir la simultánea. Utilizamos la fracción de 2000 para CUBRIR nuestra simultánea. Para ello nos paramos en la operación de COMPRA de 2000 y presionamos Vender. El sistema asigna automáticamente como valor de venta (Campo Valor Compra), el valor de mercado al día anterior del título de la simultánea, porque ese es el pasivo que necesitamos CUBRIR:



latos Comprom	iso							
echa Registro	Fecha Oper	Fec Cumplimiento P	unta Po	sición	Nro. Negocio	Nro. de Orde	n Portafolio	
05/05/2015 💌	05/05/2015 💌	05/05/2015	(ENTA 📃 CI	DRTA 🚽	XXZ410	395	X	-
misor	Esp	ecie	Depósito ISI	N	Tipo Inversión	Contraparte	Hora Com	pra Tipo Fw
GOBIERNO NA	ACIONAL 🔄 TF	IT16240724 📃 🛛	CV 🖵 CI	DL17CT0238	5 NEGOCIABLE	- AEV	\star 🗹 4 :31:4	47 🕂 NDV 🖃
atos Faciales -	Vancimiento	Tasa Nominal C	omoloto Cup Pa	-1	Madalidad Emisión	Valoración —	Propio C	antanián /Calida
			опресо-сар-пр. Оменято					aptacion/salida
24/07/2000 _	Valor de L'om	pra UEV/r Merc	ada PuG/Tr	ا <u>ا</u>		T Beng/Cor. (Der Begress V	alor Giro /Recompra
2 000 000 000	0 2 582 460 00		100 0 59 911	3 326 4				
	Adiciona	2,002,400,	M/	dalidad Bein		Dias Cor E	ec Compromise D	rden CPB
madem	- 10.0		Inover			10.000		
Comisión	Base Comisión	Retención	Base Reter	nción	Traslado Ba	ise Traslado	Dperación Origer	n/A Cubrir
0.0	0.0	0.0	0.0		0.0 0.	0	20150504:>>Z3	79
PUC	Nit Cliente	Nombre Cliente		Sistema	Usuario	Estación	Estado Tí	tulo
-				MEC				

En el campo Estado, elija CIBRIR y arriba de este, en el campo Operaación Origen/A Cubrir registre la FecOper de la simultánea a cubrir + dos puntos + número de la simultánea a cubrir.

7. Sale de CORTO. Como se ve a continuación nuestra simultánea ya no está en CORTO:



🗐 Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija 🗾 🗾
Tipo de Operación C Normal C Contado+1a5 C Repo
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimient Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 05/05/2015 04/05/2015 04/05/2015 VENTA COBTA >
Valoración Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/S alida 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL 5.00 143.971797! 2.879,435.951.80 Cantidad alor de Compra Ut.Vir. Mercado PyG/Trading. T. Repo/Cpr Oper. Regreso Valor Giro/Recompra 2.000.000.000.0 2.879,435.951.8 2.582.460.000.0 296.975.951.8 VENCIDA 4.00 0 2.879,745.375.36 Dias Cpr Fec Compromiso Orden CPR 1.000 05/05/2015 FINAL Invelocition
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir [0.0
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago #EMISION SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv. A 53059

- 8. Cumplimiento y Recaudo. El sistema genera el cumplimiento al momento de CUBRIR la simultánea. Se debe entonces hacer el RECAUDO correspondiente para terminar el proceso.
- 9. Contabilidad. Antes de utilizar las facilidades para ventas en corto debe establecer los parámetros contables respectivos, para los eventos:
 - a. NEGOCIAR: Vender el título de la simultánea. Aquí usted crea el pasivo correspondiente.
 - b. VALORAR: Valorar el pasivo (título vendido) diariamente.
 - c. NEGOCIAR: Vender el título que tengo en el portafolio para CUBRIR la simultánea.
 - d. CUBRIR: Cubrir el pasivo.
- 10. Unir. Para unir 2 operaciones, ubique una de ellas en la Grilla y luego presione SelUnir. Arriba le aparece la lista de operaciones que cumplen con las mismas características faciales y tipo de compromiso, dentro del portafolio de la seleccionada. Seleccione 2 de la lista y pulse Unir. El sistema le genera una nueva operación por la suma de las 2.
- 11. Reversar. Cuando haya unido o partido operaciones, puede usar el botón Reversar para deshacer lo hecho o Eliminar y Recuperar. No deshaga operaciones utilizadas en procesos posteriores.

NOTAS OPERATIVAS - FORWARDS SOBRE TÍTULOS



Los forwards sobre títulos son implementados en PWPREI como compromisos futuros tipo forward. Para administrar este tipo de operaciones en PWPREI proceda como se indica en las siguientes instrucciones.

- **1.** Registro de compromisos.
 - a. Ingreso manual. Incluya forwards sobre títulos en PWPREI ingresándolos con TipoCompromiso=FORWARD, TipoFw=NDV y con una FechaCompromiso futura, tal como se ve en el ejemplo de una posición "LARGA":

🗐 Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija
☐ Tipo de Operación — O Normal O Contado+1a5 O Repo I O Simultáneas O Trans. Temp. I Forward O Opciones O Op. Plazo
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio Z/04/2012 Z4/04/2012 Z4/04/2012
Valoración Datos Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión T. Efect. Precio Captación/Salida 14/05/2008 ▼ 14/05/2014 ▼ 9.25 COMPLETO ▼ ANUAL ▼ 0.00 115.256274i 0.0 Cantidad Valor de Compra VENCIDA ▼ 0.00 0 11.525.627.480.00 Trader Adicional Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Cpr. Orden CPR TRADER1 0.0 NO APLICA ▼ NO APLICA ▼ 8.000 02/05/2012 ▼ FINAL ▼
Comisión Base Comisión Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado Título 0 Image: Comparison of the comparison of
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ▼ ESPECULA ▼ DVP TRA Cal. Crediticio Inv.
Calcular Cerrar

- b. Carga. Para cargar sus forwards sobre títulos en PWPREI, inclúyalos en el archivo de carga compromisos estándar del sistema. En particular, defina los siguientes campos así:
 - i. Especie: La especie sobre la que va a operar el forward.
 - ii. FecOper y FechaCompra: Fecha de la operación.
 - iii. Cantidad: Valor nominal del subyacente.
 - iv. TipoCompromiso: FORWARD.
 - v. Precio: Precio Pactado futuro del forward, ó



- vi. ValorCompromiso: Valor Pactado futuro del compromiso.
- vii. FechaCompromiso: Fecha pactada para el cumplimiento futuro del compromiso.
- viii. TipoFw: NDV.
- ix. Sistema: OTRO. Esto le indica al sistema que es un negocio OTC.
- x. Finalidad: ESPECULA.
- 2. Valoración.
 - a. Parámetros (Tasas a utilizar). Para valorar los compromisos forwards sobre títulos usted debe definir las tasa asociadas que debe utilizar el sistema. Recuerde que la normatividad establece el uso del indicador IBR para plazos cortos y de las tasas de la CCS para plazos superiores. Deberá establecer estos parámetros, por cada moneda en la que vaya a operar, ingresando a "Definición de Parámetros Parámetros Moneda / Tasa FWD Ingresar" y definir las tasas, como se muestra en el siguiente ejemplo para la moneda COP:



DEFINICION DE PARAMETROS - [Parametros FORWARDS Moneda / Tasa]							
🚯 Archivo Ger	neral	Super Valores PV	VPREI Contra	aPartes Ventana	3		
Ng 🚨 📝 🗾	۰ 🌭	9					
PWPREI	Fee	chaVigencia	Moneda	TasaPri	TasaSec	TasaTer	
ul	201	0-01-01 00:00:00	EURO	IBR CCS	CECW		
	20	🔄 Parametros FO	RWARDS M	- 0 ×		CECW	
્રો	20	Fache Mineraie	\frown	- BUS		CECW	
201		Fecha Vigencia	01/01/2010 -				
		Moneda	COP				
<u> </u>		Tasa Primaria	BR	<u>-</u>] [<u> </u>]			
<u> </u>		Tasa Secundaria 🛛	CECW				
		Tasa Terciaria	CECW				
2			\smile				
		Aceptar	×	Cerrar			
					J		

Tenga en cuenta que los parámetros tienen fecha de vigencia, como se ve en la gráfica.

 b. Valores de las tasas. Diariamente debe registrar los valores de las tasas definidas para valorar. Ingrese por "Mercado y Sociedad – Forwards/Opc – Tasas Fw – Ingresar" y registre los datos para los diferentes plazos, como se ve en la figura:



INFORMAC	ION DE MERCADO Y SO	CIEDAD - [Tasas Fo	rward/Vain]	Augenerative	
🔁 Archivo	Carga de Información	Ventana			
ja 🗛 🖉	Y 🗶 🎯 🔎 🥩				
Forwards/Opc.	Fecha Vigencia	Tasa	Plazo	Valor	
Tasas Fw Tasas Fw PIPS PIPS DPCFTRM Momeda vs Dolar Contratos Volatilidad	Fecha Tasa Plazo Digite la Tasa (Tasa (EFECTIV	I/Vain - Ing	Cerrar		
Mercado					
Valores de					
Especies					
Historian Mada					

Recuerde lo siguiente:

- Cuando el sistema encuentra en los parámetros que la tasa primaria es la IBR, busca en el histórico el IBR, IB1 e IBE; por lo que no es necesario que registre aquí tales datos.
- Solo la tasa CECW que en realidad corresponde a la curva CEC se asume como efectiva 365, las demás se asumen 360. Esta tasa se convierte a 360 antes de utilizarla en lar fórmulas definidas por la SFC, utilizando el mismo plazo de compromiso; Es decir, el punto de la curva del plazo p1 se lleva a su equivalente 360 al mismo plazo p1 en 360.
- El sistema busca los valores de esas tasas en el orden en que son definidas: Busca datos de la tasa primaria, si es necesario busca datos de la tasa secundaria y finalmente de la tercera tasa si aún no ha encontrado datos para el plazo del compromiso.
- El sistema interpola entre los plazos para los que encuentre datos, a fin de determinar la tasa para el plazo específico del compromiso.



- Si la tasa es 360, la usa tal cual y si es 365 la convierte a 360.
 Por ejemplo, si usa la curva CEC, que en este contexto se ha creado como CECW para que el sistema busque en el histórico de la CEC, el punto extraído de la curva será convertido a 360 antes de usarlo.
- El sistema determina el conjunto de tasas a usar de acuerdo con la moneda del subyacente.
- **3.** Informes Oficiales.
 - c. Riesgo de Mercado Posición Propia. Aparte de incluir sus forwards en el portafolio, no requiere ejecutar ninguna acción distinta a lo que hace comúnmente. Genere sus archivos y el sistema incluirá estos compromisos en las subcuentas correspondientes. Debe tener en cuenta que para efectos de lo definido por la SFC estos compromisos se descomponen en dos posiciones: una por el subyacente y otra por el valor del compromiso pactado. Por lo anterior en este contexto la valoración de la primera posición es a precio de mercado del subyacente y la nocional se descuenta con la tasa establecida en "Definición de Parámetros PWPREI Dinero".
 - d. Riesgo de Mercado Carteras Colectivas. Se aplica lo mismo indicado en el literal a. de este numeral.
 - e. Riesgo de Liquidez. Dado que la SFC no ha establecido subcuentas para este tipo de compromisos en el formato 476, los tales se ignoran en el procesamiento del modelo.
- 4. Informe de Valoración. En el informe de valoración estos compromisos aparecerán valorados como tales (Es decir, no se aplica lo indicado en el numeral 3) y el sistema mostrará el valor del Derecho y el valor de la Obligación.
- **5.** Modelos de Riesgo de Mercado PWPREI. Para efectos de los modelos de riesgo PWPREI se aplica lo indicado en el numeral 3 y el histórico a utilizar para determinar la volatilidad es el del subyacente.

NOTAS OPERATIVAS – VALORAR PAPELES SIN PRECIO PPV – MATEMATICAS APLICADAS

Este documento solo refleja la opción disponible en PWPREI de valorar papeles a los que nunca se les publica precio.

1. Definición Aplicada.



Cualquier papel con flujos futuros se valora en PWPREI mediante la fórmula de valor presente

 $VPN = SUMA(Vf/(1 + T) ^Dv/365)$

- Donde:
 - VPN= Valor Presente neto a la fecha de valoración.
 - Vf= Valor del flujo futuro
 - T= Tasa efectiva aplicable al flujo
 - Dv= Días hasta el flujo en base 365
 - 2. Opciones para la tasa T.

La tasa con la que van a descontar los flujos puede determinarse de las siguientes formas: a. Usando márgenes y curvas.

- Usted puede hacer que el sistema utilice el margen y la curva asociada al papel para determinar la tasa de descuento para cada flujo. Dado que no es hoy una forma común de operar, de conformidad con las reglas para "Valoración a Precios de Mercado" en Colombia, se le permite modificar un parámetro para hacer que el sistema utilice esta opción, mismo que deberá regresar a su estado actual para sus demás procesos de valoración (inversiones)
- b. À la TIR del papel.

Está es la opción normal hoy cuando no se publica precio para el papel y consiste en determinar la TIR aplicable hoy así:

i. Papeles de tasa fija.

La tasa de descuento queda determinada por la tasa correspondiente al costo de adquisición o de colocación de las unidades nominales, al valor de la moneda, en la fecha de adquisición o colocación. En el registro de operaciones de PWPREI corresponde a:

- Costo de adquisición = "Valor Compra"
- Unidades Nominales = "Cantidad"
- Valor de la Moneda = Valor de la moneda en la fecha de operación "FecOper"
- Fecha de adquisición = "Fecha Compra"
- Tasa = "Tasa Efectiva"
- ii. Papeles indexados.

La tasa inicial de descuento queda determinada por la tasa correspondiente al costo de adquisición o de colocación de las unidades nominales, al valor de la moneda, en la fecha de adquisición o colocación, compuesta por el margen inicial + el valor de la tasa a la que el papel está indexado. En el registro de operaciones de



PWPREI corresponde a:

- Costo de adquisición = "Valor Compra"
- Unidades Nominales = "Cantidad"
- Valor de la Moneda = Valor de la moneda en la fecha de operación "FecOper"
- Fecha de adquisición = "Fecha Compra"
- Tasa = "Tasa Efectiva"
- Valor tasa de referencia = Valor de la TasaRef (IPC, DTF, etc.) en la fecha de operación "FecOper"
- Margen Inicial = Distancia entre el valor de la TasaRef y la "Tasa Efectiva" en la "Fecha Compra"

La tasa de descuento para "Valorar Hoy" se determina mediante el "Margen Inicial" y el valor de la "TasaRef" hoy.

3. Calcular el margen inicial:

MarIni = (((TasaCompra + 1) / (1 + TasaRefCom)) - 1) * 100

Donde:

- TasaCompra=tasa de adquisición del papel, no la nominal sino la de negocio.
- TasaRefCom=valor de la tasa de referencia (DTF, IPC, etc) en la fecha de compra.
- MarIni=margen inicial o distancia entre la tasa de compra y el valor de la tasa de referencia en la fecha de compra.

Calcular la nueva tasa:

TasaRepreciada = (((1 + TasaRefVal) * (1 + MarIni)) - 1) * 100Donde:

- TasaRefVal = valor de la tasa de referencia (DTF, IPC, etc) en la fecha de valoración.
- TasaRepreciada=tasa de compra actualizada en la fecha de valoración, con el nuevo valor de la tasa referencia.



8.1. OPCIÓN METODOS



En esta opción podrá encontrar todos los métodos con los cuales se mide el riesgo de la compañía. Para evaluar un Portafolio, Grupo, Tipo o Línea de Negocio, deberá posicionarse en él y oprimir posteriormente el botón de cualquiera de los métodos con el cual se hará la medición del riesgo. A continuación aparecerá una pantalla de entrada de datos dependiendo del método escogido.

8.1.1. SIMULACIÓN HISTÓRICA

El cálculo del **VaR** histórico, consiste en la simulación de escenarios basados en el comportamiento histórico de los factores de riesgo. Estas simulaciones permiten generar la distribución de pérdidas y ganancias del valor del portafolio. El número de escenarios posibles, depende de la cantidad de información histórica con la que se cuente en la base de datos de los factores de riesgo. El modelo no hace ningún supuesto sobre la distribución de los factores de riesgo. El modelo de simulación histórica, puede capturar los eventos extremos, las características leptokúrticas de la distribución, así como las asimetrías que suelen observarse en los mercados, derivadas de grandes pérdidas en el mercado.

Mientras más información histórica disponible, mayor número de escenarios, ya que cada escenario corresponde al rendimiento observado cada día de la historia. El método es robusto, fácil de implementar e intuitivo, lo que facilita su explicación a la dirección dentro de las instituciones.



Para ingresar a este método haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema despliega la pantalla que se muestra a continuación para que el usuario digite los datos con los cuales desee realizar la medición.

📓 Método - Simulación Histórica (Grupo : C	CLIENTES) 🛛 🔀
Fecha Medición 105/01/2009 Número de Observaciones 20 Nivel de Confianza 95	•
-Seleccione la Fuente de Información C ALTERNA INFOVAL	 Seleccione Precio – Precio Sucio Precio Limpio
Seleccione el tipo de la Moneda O Simulada	
Ac	ceptar 🔀 Cerrar

Los datos requeridos por el sistema para realizar la medición son los siguientes:

Fecha de Medición: Es la fecha a partir de la cual se desea realizar la medición. El Número de Observaciones digitado se tomará desde esa fecha hacia atrás.

Número de Observaciones: Es la cantidad de datos históricos que se va a tomar de cada una de las posiciones del Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio que se vaya a valorar. Este rango de observaciones deber ser mayor a 20 y menor a 999. En caso de que se encuentren rangos menores a 20 no se valora la posición; así mismo cuando sé este valorando un Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio se trabajará con la cantidad de rangos de la posición que menos tenga. Esto solo aplica para este método.

Nivel de Confianza: Es la certeza con la cual, la pérdida probable del portafolio este considerado en el *VaR*.

Fuente de Información: Escoja Si desea trabajar con información suministrada por SISVAL ó por otra fuente.

Seleccione Precio: Debe seleccionar Precio Sucio o Precio Limpio.

- **Precio Sucio:** Precio actual del papel.
- **Precio limpio:** Precio descontando los rendimientos de pago.

Tipo de Moneda: Seleccione la moneda a utilizar, Simulada, histórica ó actual.

Después de digitar estos valores y dar clic en el botón Aceptar aparece la siguiente



pantalla con los resultados obtenidos a partir de los datos suministrados.

🌃 Método d	le Simulación His	tórica por Gr	upo.								
Gráficos	- Gráficos Curva	Historicos E	xportar Exc	el Inf. Jerarc	l 🔽 Iuico Cerr] ar	1				
GRUPO							MED	ICION			
Grupo	CLIENTES		1	-Datos Sumi	inistrados —			Resultados	Obtenidos		
Descripción	PORTAFOLIOS CLI	ENTES		Fecha	06/01/2009			Neto Portal	folio	\$ 888,6	56,649.84
				Nro. Obs	ervaciones —			Valor Con	npra	\$ 876,	941,088.00
				Solicitade	o Real			Vir. A Tasa	Cmp \$	888,794,8	59.632973
	2			20	20			Duración Pr	rom.	-	0.347294
				Niveles -				Volat. Port	afolio 🖊	ł	0.0
				Confianz	a			PyG	Real	-\$	138,209.81
i				9	2			Monto VaR	(\$)	\$ 888,	656,649.85
				1				VaR (%)	VaR	(\$)	
								0.19	\$1356 \$	1,700,496	6.12100002
			I-								
Punta	Especie	Número	Fee	cha Emision	Días al Vcto.	N	/alor Compr	a Ta	sa Efec.	C	antidad 🔥
COMPRA	CDTCNFS0V		0	15/09/2008		70	2	3544037	12.91	478492	\$:
COMPRA	CDTCNFS0V		0	23/12/2008		168	10	0000000	11.83	422387	\$11
COMPRA	CDTCNFS0V		0	29/12/2008		170	8	0000000	11.83	117647	\$1
COMPRA	CDTDVISOV		0	06/10/2008		90	8	4628670	0.19	781194	\$:
COMPRA	CDTDVISOV		0	05/11/2008	11	30	1	0580227	14.53	488911	\$
COMPRA	CDTDVISOV		0	25/11/2008		50		5956095	14.53	629276	\$~
											>
1				Valor en Ri	esgo del Gru	oqu				-	
	\$ 1,70	0,496.12100002	> Pérdida	máxima si se lle	egare a preser	itar a ur	n día con ur	na probabilida	ad del 95 %	6	
	0.191	306> Variación	maxima que	s puede arecta	ar el portarólio j	para un	i dia con un	a probabilida	a aei 35 %		

La pantalla que despliega el sistema muestra la información correspondiente a:

Área 1: Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

• Gráficos:



Esta utilidad sirve para observar tres tipos de gráficos:

1. Composición Títulos con VaR. El grafico se puede visualizar en 2D o 3D









Y el tipo de grafico puede ser:



2. Composición Total del Portafolio



3. VaR en pesos





• Gráficos Curvas:



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado.



TIB Vs CEL		
25		
20		_
15		-
10	* * *	-
5-		-
0 -	284 567 850 1133 1416 1699 1982 2265 2548 2831 3114 3397 3680 3963 4246 4529 4812 5095 5378 5661 5944 6227 6510 6793 707	76
J		
		Cerrar

• Exportar a Excel:



La información suministrada en el método de simulación histórica, puede ser exportada a Excel para manejo de diversos informes.

• Informe Jerárquico:



En este informe se muestra el valor del portafolio por niveles y el VaR total.

• Históricos:



Datos históricos que se utilizan para realizar la medición.



echa	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALSOV	CDTF
6/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249	105
5/01/2009	103.15034662	100.76760663	100.58365647	97.78359961	101.41379589	100.51480955	105.15198296	105
2/01/2009	103.05711345	100.67315701	100.48950895	97.77757493	101.32915209	100.42810591	105.06296746	105
1/12/2008	102.98976289	100.50043167	100.3157616	97.69265114	101.29396783	100.38264853	105.01928597	10
0/12/2008	102.96047016	100.47028166	100.28569204	97.66517718	101.26724409	100.35540779	104.99085233	10
9/12/2008	102.93506997	100.40988887	100.22425712	97.63846438	101.24493268	100.33310066	104.96470289	10
6/12/2008	102.82740862	100.28165249	100.37977524	97.51959857	101.17755829	100.26918168	104.87574581	10
4/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774	10
3/12/2008	102.72556981	100.29366424	100.308897	97.42388448	101.0965623	100.07657011	104.78198627	10
2/12/2008	102.68571224	100.33300538	100.30752408	97.31591831	101.05379193	100.01888148	104.74859186	10
9/12/2008	102.58627308	100.30555013	100.31189049	97.24107032	100.9671523	99.92779959	104.65226531	10
8/12/2008	102.49394441	100.28468238	100.32941716	97.17032207	100.94159568	99.89429053	104.62395238	10
7/12/2008	102.46302653	100.28528836	100.31934554	97.16247005	100.86792281	99.85141524	104.59175563	10
6/12/2008	102.43662043	100.3004381	100.31541485	97.12625913	100.85597273	99.83046768	104.56523658	10
5/12/2008	102.39065353	100.30179287	100.31671842	97.08095831	100.81171873	99.80651671	104.53271645	10
2/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032	10
1/12/2008	102.1591297	100.29355042	100.31989065	96.96838892	100.67590234	99.68790878	104.42360755	10
0/12/2008	102.12210864	100.29532402	100.31798535	96.93460103	100.64388813	99.64615201	104.3936663	10
9/12/2008	102.09156029	100.29733116	100.31771331	96.89112366	100.61237067	99.60903573	104.36145609	10
5/12/2008	101.96737896	100.29670977	100.318173	96.79086223	100.45956431	99.49521949	104.24384975	10
lutare.			A inde D			6.2.		

Área 2 GRUPO: Aquí se muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, de acuerdo a la selección: Por grupo, Por línea, Por tipo o por Portafolio.

GRUPO —	
Grupo	CLIENTES
Descripción	PORTAFOLIOS CLIENTES

Área 3: Datos Suministrados: Información correspondiente a los datos suministrados por el Usuario para la medición del Riesgo.

-Datos Suministrados Fecha 06/01/2009
Nro. Observaciones Solicitado Real 20 20
Niveles Confianza 95

Área 4 Resultados Obtenidos: Aquí aparecen los resultados de riesgo a nivel general, es decir del Portafolio, Tipo, Grupo o Línea. Dichos resultados son el valor neto del portafolio, el valor de compra, el valor a tasa compra, la duración promedio del portafolio, el PyG real, el *VaR* en Pesos, el *VaR* en Porcentaje, el Valor del Portafolio. En la parte inferior se muestra la descripción del *VaR*.



-Resultados Obtenidos							
Neto Portafolio	\$ 888,656,649.84						
Valor Compra	\$ 876,941,088.00						
Vlr. A Tasa Cmp	\$ 888,794,859.632973						
Duración Prom.	0.347294						
Volat. Portafolio	0.0						
PyG Real	-\$ 138,209.81						
Monto VaR (\$)	\$ 888,656,649.85						
VaR (%)	VaR (\$)						
0.191356	\$1,700,496.12100002						

Área 5 Información de las Inversiones del Portafolio: En

esta cuadricula aparecen cada una de las inversiones con sus correspondientes datos y valoraciones:

Punta	Especie	Número	Fecha Emision	Días al Veto.	Valor Compra	Tasa Efec.	Cantidad 🔷 🔺
COMPRA	CDTCNFS0V	0	15/09/2008	70	23544037	12.91478492	\$.
COMPRA	CDTCNFS0V	0	23/12/2008	168	10000000	11.83422387	\$11
COMPRA	CDICNESOV	0	29/12/2008	170	8000000	11.83117647	\$1
COMPRA	CDTDVISØV	0	06/10/2008	90	4628670	0.19781194	\$
COMPRA	CDTDVISØV	0	05/11/2008	30	10580227	14.53488911	\$
COMPRA	CDTDVISØV	0	25/11/2008	50	5956095	14.53629276	\$ 🗸

- **Punta:** ya sea la compra o la venta
- **Especie:** Especie o título que sé esta negociando.
- Número: Número DCV o DVL (DECEVAL) con el cual se encuentra registrado el título.
- Fecha de Emisión: Fecha de Emisión del título
- Días al vencimiento: Días al vencimiento del título o papel
- Valor compra: Valor compra del título
- Tasa efectiva: Tasa del título
- **Cantidad:** Valor Nominal del título.
- **Precio Reciente:** De acuerdo a la fecha dada este valor es el más reciente con el cual se está negociando en el mercado.
- **Monto:** Valor total de la inversión.
- **Tasa Reciente (%):** De acuerdo a la fecha dada este valor es el más reciente con el cual se está negociando en el mercado.
- Precio a tasa compra: Precio calculado hoy a la tasa a la que se compró el papel.
- Valor a tasa compra: Valor calculado hoy a la tasa a la que se compró el papel.
- PYG Real: Utilidad o perdida obtenida
- VaR (\$): Valor en Riesgo en Pesos.
- VaR (%): Valor en Riesgo en Porcentaje.
- Duración: Corresponde a la duración del papel
- **Volatilidad:** Es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un activo o un portafolio.
- RMSE: (ROOT MEAN SQUARED ERROR) Error de Pronóstico de la Varianza
- **Tipo FW:** Tipo de forward (Delivery or not Delivery)
- **Observaciones:** En este campo el sistema despliega el motivo



por el cual no se valoró determinada inversión.

- Num. Negocio: Número de la operación
- **Posición:** Si es larga o corta
- **Tipo Compromiso:** Corresponde al tipo de negocio celebrado.
- Fecha Vencimiento: Fecha de Vencimiento del título

Área 6: Descripción del VaR en Pesos y en Porcentaje: Aquí se explica que significan los valores proporcionados por el sistema en cuanto al VaR en \$ y en %.

 Valor en Riesgo del Grupo

 \$ 1,700,496.12100002 --> Pérdida máxima si se llegare a presentar a un día con una probabilidad del 95 %

 0.191356 --> Variación máxima que puede afectar el portafolio para un día con una probabilidad del 95 %

8.1.2. MONTECARLO ESTRUCTURADO

Este método emplea técnicas de métodos robustos de estimación. Permite estimar la distribución de probabilidad empírica a partir de datos históricos. La evaluación del VaR se puede llevar a cabo bajo diferentes horizontes de tiempo. Así mismo requiere elevados costos en términos de tiempo y de recursos computacionales.

El concepto básico de VaR Montecarlo Estructurado, consiste en la simulación repetida de procesos aleatorios para las variables financieras de interés. Estas simulaciones permiten construir la distribución de probabilidad completa para los valores de la posición. Para ingresar a esta opción haga clic en el botón Método Montecarlo Estructurado y a continuación aparece la siguiente pantalla.

📓 Método - (Grupo : CLIENTES) 🛛 🛛
Fecha Medición Número de Observaciones Horizonte Temporal Nivel de Tolerancia Nivel de Confianza Número de Simulaciones	0€/01/2009 20 1 0.01 95 200
-Seleccione la Fuente de Información - C ALTERNA (* INFOVAL	Seleccione Precio
Seleccione el tipo de la Moneda	let
	Aceptar 🔀 Cerrar





Los datos requeridos por el sistema para realizar la medición son los siguientes:

Fecha: Es la fecha a partir de la cual se desea realizar la medición. El Número de Observaciones digitado se tomará desde esa fecha hacia atrás.

Número de Observaciones: Es la cantidad de datos históricos que se va a tomar de cada una de las posiciones del Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio que se vaya a valorar. Este rango de observaciones deber ser mayor a 20 y menor a 999. En caso de que se encuentren rangos menores a 20 no se valora la posición; así mismo cuando sé este valorando un Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio se trabajará con la cantidad de rangos de la posición que menos tenga. Esto solo aplica para este método.

Horizonte Temporal: Es el número de días al que se va a proyectar el sigma pronóstico.

Nivel de Tolerancia: Es una medida que permite saber para cierto nivel de Lambda cual va a ser el error.

Nivel de Confianza: Es la certeza con la cual, la perdida probable del portafolio este considerado en el *VaR*.

Número de Simulaciones: Es el número de escenarios que se generan mediante números aleatorios a partir de los cuales se realizan los cálculos respectivos. Están comprendidos entre 200 y 10000.

Fuente de Información: Seleccione entre la información suministrada por Infoval o por una fuente alterna.

Seleccione Precio: Debe seleccionar Precio Sucio o Precio Limpio.

- **Precio Limpio:** Precio descontando los rendimientos pendientes de pago
- Precio Sucio: Precio actual del papel
- Seleccione el tipo de moneda: Los tipos de Moneda son:

- **Simulada:** Proceso de simulación que determina la volatilidad de la moneda.

- Histórica: Se toma el valor histórico que la moneda registró ese día.
- Actual: La de hoy

Después de escribir la información debe dar clic en el Botón Aceptar y a continuación aparece la siguiente pantalla.



Método d	le Montecarlo Esti	ructurado por	Grupo.						
Gráficos	Gráficos Curva	Matrices	Historicos	Exportar	Excel Inf. J	erarquico (Cerrar 1		
GRUPO	CUENTES		_				EDICION		
Grupo	ILLIENTES			Datos Sumin	istrados —		Resultado	s Obtenidos —	
Descripción	PORTAFOLIOS CLIE	INTES		Fecha 0	6/01/2009	2	Neto Porta	afolio \$	888,656,649.84
8				Nro. Obser	rvaciones —	3	Valor Co	mpra \$	876,941,088.00
	2			Solicitado	Real	Simulaciones	Vir. A Tasi	a Cmp \$ 888	,794,859.632973
	2			20	20	200	Duración P	Prom.	0.347294
1 - C				Niveles			Volat. Por	afolio 4	0.061279307
				Confianza	Tolerancia	Horizonte	PyG	Real	-\$ 138,209.81
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				95	0.01	1	Monto Val	2 (\$)	888,656,649.85
				Lambda In	794328234	724	VaR (%)	VaR (\$)	E
				10	.1 04020204	-1	0.1	00795 \$ 895	5,725.825705286
			1-4						
Punta	Especie	Número	Fecha	Emision	Días al Vcto.	Valor Cor	mpra T.	asa Efec.	Cantidad 🔥
COMPRA	CDTCNFS0V		0 1	5/09/2008		70	23544037	12.914784	92 \$:
COMPRA	CDTCNFSOV		0 2	3/12/2008		168	100000000	11.834223	87 \$ 11
COMPRA	CDTCNFS0V		0 2	9/12/2008	E	170	80000000	11.831176	\$47 \$1
COMPRA	CDTDVIS0V		0 0	6/10/2008	9	90	4628670	0.197811	94 \$
COMPRA	CDTDVISOV		0 0	5/11/2008		30	10580227	14.534889	911 \$
COMPRA	CDTDVISOV		0 2	5/11/2008		50	5956095	14.536292	276 🛯 🛯 🕹 🧹
C 50									

	Yalor en Riesgo del Grupo \$ 895,725,825705286 -> Pérdida máxima si se llegare a presentar a un día con una probabilidad del 95 % 6 0.100795 -> Variación máxima que puede afectar el portafolio para un día con una probabilidad del 95 % 6								
A									

Área 1 Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

• Matrices:



Esta opción muestra las matrices intermedias de Varianza – Covarianza y descomposición de Cholesky la cual se obtiene aplicando diferentes fórmulas a la matriz de Varianza - Covarianza para realizar la medición del VaR.


VOLATILIDADES CDTCNFS0 CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTALS0V CD0000525 CD00000528 CD00000528 CD00000552 CD00000552 CD00000552 CD00000552 CD000000552 CD000000000000000000000000000000000000	¢6	Matrices I	ntermedias de	Cálculo					
CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTALS0V CDTFALS0V CDTFALS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTFALS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTOVIS0V CDTCNFS0V CD000005331 0.000003531 0.0000002535 0.0000005331 0.00000011 CDTCNFS0V 0.000005235 0.0000027056 0.000028084 0.0000028034 0.0000045771 0.000005592 0.00000116 CDTFALS0V 0.000002535 0.000002327 0.000002637 0.0000005592 0.0000005592 0.000000100 CDTFALS0V 0.000000237 0.000000237 0.000000383 0.000000363 0.000000044 0.00000001 CDTFALS0V 0.000000237 0.00000237 0.000000383 0.000000378 0.000000378 0.00000044 0.00000011 V CDTFALS0V 0.000000347 0.0000003277 0.000	F	VOLATILIDAD	ES						
CDT CNFS0 0.000005162 0.000005162 0.00000426 0.00000426 0.000003359 0.000000333 0.00000233 0.00000233 0.00000233 0.00000233 0.000002335 0.0000002335 0.000002359 0.000000267 0.000000267 0.000000267 0.000000267 0.000000267 0.000000267 0.00000016 0.00000267 0.00000016 0.00000267 0.000002634 0.000002637 0.0000002634 0.000002637 0.00000016 0.000000553 0.000000553 0.0000002535 0.000000235 0.000000243 0.0000045771 0.000000532 0.000000 0.00000004 0.000000000 0.00000000000000000000000000000000000			CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVISOV	CDTDVIS0V	CDTDVISOV	CDTFALSOV
CDTCNFS0 0.000005162 0.00000426 0.0000027056 0.000003339 0.00000531 0.00000221 CDTCNFS0 0.00000539 0.0000027056 0.000002864 0.000003768 0.000005287 0.000005297 0.00000552 0.00000552 0.00000552 0.000000552 0.000000552 0.000000000 0.000000000 0.00000000 0.00000000 0.000000000 0.000000000 0.000000000 0.000000000000000 0.0000000000000000000 0.00000000000000000000000000000000000		CDTCNFS0 [®]	0.000006857	0.000005162	0.00000504	-0.000036359	0.000005235	0.000008559	0.0000003
CDTCNFS0 0.00000504 0.000004081 0.000004261 -0.000028864 0.0000003768 0.000006287 0.0000011 CDTDVIS0v -0.00002835 0.0000027056 -0.000028684 0.000008034 -0.00000532 0.00000111 CDTDVIS0v 0.000005235 0.000003768 -0.000028034 0.00000532 0.00000111 CDTFALS0v 0.0000005235 0.000002831 0.000002827 -0.000005822 0.000000532 0.0000005 CDTFALS0v 0.000000231 0.000000287 0.000001661 0.00000033 0.000000111 0.00000000000000000000000000000000000		CDTCNFS0 [®]	0.000005162	0.00000426	0.000004081	-0.000027056	0.000003839	0.000006381	0.0000002
CDTDVIS0v -0.000028359 -0.000027056 -0.00002864 0.000028034 -0.000045771 -0.00000161 CDTDVIS0v 0.000005235 0.000003333 0.000003768 -0.00004073 0.00000552 0.000000161 CDTDVIS0v 0.00000559 0.000006381 0.000005287 -0.000045771 0.000001652 0.000001774 0.00000001 CDTFALS0v 0.000000351 0.0000002837 -0.00001661 0.00000030 0.000000044 0.00000000 CDTFALS0v -0.000003347 -0.000002357 0.000001661 0.00000032 -0.000000044 0.000000044 0.0000000044 0.00000000000000000000000000000000000		CDTCNFS0 [®]	0.00000504	0.000004081	0.000004261	-0.000026864	0.000003768	0.000006287	0.0000001
CDTDVISOV 0.000005235 0.000003839 0.000003768 -0.000028034 0.000006592 0.000000592 CDTFALSOV 0.000000351 0.000000243 0.00000186 -0.00000161 0.00000003 0.00000044 0.00000011 CDTFALSOV 0.0000003347 -0.000002357 0.000001883 -0.000002387 0.00000033 0.00000044 0.00000011 CDTFALSOV -0.000003347 -0.000002357 0.0000002357 0.0000002382 -0.000002382 0.000000432 0.00000011 • CDTFALSOV -0.000002347 -0.000002357 0.0000002387 0.0000002708 -0.00000432 0.00000011 • CDTFALSOV -0.000002377 0.000002357 0.0000002708 -0.00000432 0.00000011 •		CDTDVIS0v	-0.000036359	-0.000027056	-0.000026864	0.000196276	-0.000028034	-0.000045771	-0.0000016
CDTDVISOV 0.0000063553 0.0000006381 0.000006287 -0.0000045771 0.000000532 0.000000774 0.00000007 CDTFALSOV 0.000000351 0.000000243 0.000000186 -0.000001661 0.00000033 -0.00000011 CDTFALSOV -0.000003347 -0.000002327 -0.000002357 0.0000002708 -0.00000432 -0.0000011		CDTDVIS0v	0.000005235	0.000003839	0.000003768	-0.000028034	0.000004079	0.000006592	0.00000
CDTFALSON 0.000000351 0.000000243 0.0000001661 0.0000003 0.00000044 0.0000000 CDTFALSON 0.0000003347 0.000002327 0.00001883 0.0000002708 0.00000432 0.0000001 COTFALSON 0.0000002327 0.000002327 0.000002327 0.000002327 0.00000000000000000000000000000000000		CDTDVIS0v	0.000008559	0.000006381	0.000006287	-0.000045771	0.000006592	0.000010774	0.000000
COTFALSO -0.000003347 -0.000002327 -0.000002357 0.000001883 -0.0000002708 -0.00000432 -0.0000432 -0.0000432 -0.00004432 -0.00004432 -0.00004432 -0.00004432 -0.00004432 -0.00004432 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0000442 -0.0004		CDTFALS0\	0.000000351	0.000000243	0.000000186	-0.000001661	0.0000003	0.00000044	0.0000000
Exportar Resultade Cerrar		CDTFALS0\	-0.000003347	-0.000002327	-0.000002357	0.00001883	-0.000002708	-0.00000432	-0.0000001! 🤜
Exportar Resultade Cerrar		< _							>
Exportar Resultade	L								
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade									
Exportar Resultado									
Exportar Resultade									
Exportar Resultade							1	Contract 1	
								Resultado	Cerrar

Esta matriz se puede exportar presionando el botón inferior Exportar Resultado

• Gráficos:



Esta utilidad sirve para observar tres tipos de gráficos:





1. Composición Títulos con VaR. El grafico se puede visualizar en 2D o 3D

2. Composición Total del Portafolio





3. VaR en Pesos



• Gráficos Curva





Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado.

Grafico VaR		X
TIR Vs CE	C TIR V& CECUVR TIR V& CRCDT TIR V& IGASB TIR V& IGASC TIR V& ITEE TIR V	sITUS
25		
20		
20		
15		
10	x • •	
5		
0-	284 567 850 1133 1416 1699 1982 2265 2548 2831 3114 3397 3680 3963 4246 4529 4912 5095 5378 5661 5944 6227 6510 6793 7075	
	— FentEstimada → CDTFINS0V → CDTFINS0V → TFIP05100709 → TFIP06120210 → TFIP025012 → TFIP1026012	
		errar

• Históricos:



Datos históricos que se utilizan para realizar la medición.



Fecha	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTDVIS0V	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTFALS0V
06/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249
05/01/2009	103.15034662	100.76760663	100.58365647	97.78359961	101.41379589	100.51480955	105.15198296
/01/2009	103.05711345	100.67315701	100.48950895	97.77757493	101.32915209	100.42810591	105.06296746
31/12/2008	102.98976289	100.50043167	100.3157616	97.69265114	101.29396783	100.38264853	105.01928597
30/12/2008	102.96047016	100.47028166	100.28569204	97.66517718	101.26724409	100.35540779	104.99085233
29/12/2008	102.93506997	100.40988887	100.22425712	97.63846438	101.24493268	100.33310066	104.96470289
26/12/2008	102.82740862	100.28165249	100.37977524	97.51959857	101.17755829	100.26918168	104.87574581
24/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774
23/12/2008	102.72556981	100.29366424	100.308897	97.42388448	101.0965623	100.07657011	104.78198627
22/12/2008	102.68571224	100.33300538	100.30752408	97.31591831	101.05379193	100.01888148	104.74859186
19/12/2008	102.58627308	100.30555013	100.31189049	97.24107032	100.9671523	99.92779959	104.65226531
18/12/2008	102.49394441	100.28468238	100.32941716	97.17032207	100.94159568	99.89429053	104.62395238
17/12/2008	102.46302653	100.28528836	100.31934554	97.16247005	100.86792281	99.85141524	104.59175563
16/12/2008	102.43662043	100.3004381	100.31541485	97.12625913	100.85597273	99.83046768	104.56523658
15/12/2008	102.39065353	100.30179287	100.31671842	97.08095831	100.81171873	99.80651671	104.53271645
12/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032
11/12/2008	102.1591297	100.29355042	100.31989065	96.96838892	100.67590234	99.68790878	104.42360755
10/12/2008	102.12210864	100.29532402	100.31798535	96.93460103	100.64388813	99.64615201	104.3936663
09/12/2008	102.09156029	100.29733116	100.31771331	96.89112366	100.61237067	99.60903573	104.36145609
05/12/2008	101.96737896	100.29670977	100.318173	96.79086223	100.45956431	99.49521949	104.24384975
<							
Interpo Promed	lación As fiado As	sociado Histórico sociado Interpolad	Asociado P	romediado		Expo Resi	ortar ultado

Exportar Excel

La información suministrada en el método de simulación histórica, puede ser exportada a Excel para manejo de diversos informes.

• Informe Jerárquico:



Este informe muestra el valor del portafolio por niveles y el VaR total.

Área 2: Grupo: Aquí se muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, como se escogió Grupo aparece el Nombre del Grupo y la descripción. En caso de que sea Portafolio muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, como es el Nombre, el Tipo de Portafolio al que pertenece y la Línea de Negocio asociada, si fuese Tipo aparece el Nombre del Tipo, el Mercado y la Moneda, y si fuese una Línea de Negocio aparece el nombre de la Línea, la Descripción y el Grupo al que pertenece.

Área 3: Datos Suministrados: Información correspondiente a los datos suministrados por el Usuario para la medición del Riesgo.



El Lambda o Factor de Decaimiento, se utiliza para el cálculo de la desviación estándar, su valor esta comprendido entre 0 y 1, este factor da peso a los rendimientos históricos, un valor igual a 1 indica que los rendimientos históricos tienen el mismo peso, un valor cercano a 0 indica que los rendimientos históricos mas recientes tiene mas peso que los lejanos.

Área 4: Resultados Obtenidos: Aquí aparecen los resultados de riesgo a nivel general, es decir del Portafolio, Tipo, Grupo o Línea. Dichos resultados son el Neto del portafolio, el valor compra, el valor a tasa compra, la duración promedio, el valor del portafolio, PyG real, el VaR en Pesos, el VaR en Porcentaje. En la parte inferior se muestra la descripción del VaR.

Área 5: Información de las Inversiones del Portafolio: En esta cuadricula aparecen cada una de las inversiones con sus correspondientes datos y valoraciones:

- **Punta:** ya sea la compra o la venta
- **Especie:** Especie o título que sé esta negociando.
- Número: Número DCV o DVL (DECEVAL) con el cual se encuentra registrado el título.
- Fecha de Emisión: Fecha de Emisión del título
- Días al vencimiento: Días al vencimiento del título o papel
- Valor compra: Valor compra del título
- Tasa efectiva: Tasa del título
- **Cantidad:** Valor Nominal del título.
- **Precio Reciente:** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se está negociando en el mercado.
- Monto: Valor total de la inversión.
- **Tasa Reciente (%):** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se está negociando en el mercado.

- **Precio a tasa compra**: Precio calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.

• **Valor a tasa compra:** Valor calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.

- **PYG Real:** Utilidad o perdida obtenida
- VaR (\$): Valor en Riesgo en Pesos.
- VaR (%): Valor en Riesgo en Porcentaje.
- Duración: Corresponde a la duración del papel
- **Volatilidad:** Es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un activo o un portafolio.

- **RMSE:** (ROOT MEAN SQUARED ERROR) Error de Pronóstico de la Varianza

- **Tipo FW:** Tipo de forward (Delivery or not Delivery)
- **Observaciones:** En este campo el sistema despliega el motivo por el cual no se valoró determinada inversión.



- Num. Negocio: Número de la operación
- **Posición:** Si es larga o corta
- Tipo Compromiso: Corresponde al tipo de negocio celebrado.
- Fecha Vencimiento: Fecha de Vencimiento del título

En caso de que al valorar se escoja el máximo número de observaciones, en la pantalla de resultados aparecerá el mensaje respectivo, no aparece el Lambda a nivel general, sino por cada uno de los títulos y a su vez el número de observaciones real aparece por cada uno de ellos. Esto debido a que por cada uno se valora con la cantidad de observaciones que encontró.

Área 6 Descripción del VaR en Pesos y en Porcentaje: Aquí se explica que significan los valores proporcionados por el sistema en cuanto al VaR en \$ y en %.

8.1.3. DURACIÓN MODIFICADA

Es un método desarrollado a partir de la función de precio de los instrumentos financieros. Permite medir los cambios en el valor del portafolio ante los cambios en las tasas de interés. Es una medida del término temporal de recuperación del valor del título.

La Duración está directamente vinculada al Valor en Riesgo, ya que éste cuantifica la exposición de un portafolio ante cambios en los factores de riesgo (Duración).

La Duración ha sido considerada como una herramienta esencial para medir la exposición al riesgo sobre las tasas de interés, sin embargo, esta medida es estrictamente válida solo para movimientos pequeños y paralelos en la tasa del rendimiento.

 $VaR = a * \sigma$ portafolio * Valor portafolio

 σ portafolio = ([w] T [σ precios] [C] [\tilde{A} precios]

[w]) ^ (1/2) σ precios = Dm * σ * r

 [C] = Matriz de correlaciones
 [w] = Vector de pesos de las posiciones del portafolio
 [σ] = Matriz diagonal de volatilidades

Para ingresar a este método haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema despliega la pantalla que se muestra a continuación para que el usuario digite los datos con los cuales desee realizar la medición.



📓 Método - Duración Modificad	la (Grupo : CLIENTES) 🛛 🛛 🔀
Fecha Medición Número de Observaciones	1
Nivel de Tolerancia Nivel de Confianza	0.01 • 95
Seleccione la Fuente de Información - C ALTERNA INFOVAL	
	Aceptar 🔀 Cerrar

Los datos requeridos por el sistema para realizar la medición son los siguientes:

Fecha: Es la fecha a partir de la cual se desea realizar la medición. El Número de Observaciones digitado se tomará desde esa fecha hacia atrás.

Número de Observaciones: Es la cantidad de datos históricos que se va a tomar de cada una de las posiciones del Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio que se vaya a valorar. Este rango de observaciones deber ser mayor a 20 y menor a 999. En caso de que se encuentren rangos menores a 20 no se valora la posición; así mismo cuando sé este valorando un Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio se trabajará con la cantidad de rangos de la posición que menos tenga. Esto solo aplica para este método.

Horizonte Temporal: Es el número de días al que se va a proyectar el sigma pronóstico. **Nivel de Tolerancia:** Es una medida que permite saber para cierto nivel de Lambda cual va a ser el error.

Nivel de Confianza: Es la certeza con la cual, la perdida probable del portafolio este considerado en el *VaR*.

Fuente de Información: La información puede ser tomada de Infoval o de una fuente alterna.

Después de digitar estos valores se debe dar clic en el botón Aceptar para que el sistema muestre la siguiente pantalla con los resultados obtenidos a partir de los datos suministrados.



👫 Método de Duración Modificada	a por Grupo.							
Gráficos Gráficos Curva Matri	ces Historico	s Exportar	Excel Inf.)	erarguico	Cerrar	1		
GRUPO					MEDIC	ION		
Grupo ILLIENTES		-Datos Sumin	strados			Resultados Obter	nidos —	
Descripción PORTAFOLIOS CLIENTES		Fecha 0	6/01/2009			Neto Portafolio	\$ 888	,656,649.84
		Nro. Obser	vaciones —			Valor Compra	\$ 876	,941,088.00
		Solicitado	Real	3		/lr. A Tasa Cmp	\$ 888,794,	859.632973
	2 :	20	20		EH (Ouración Prom.	4	0.349495
		Niveles				/olat. Portafolio	0	.291306526
<u> </u>		Confianza	Tolerancia	Horizonte		PyG Real	-\$	138,209.81
		95	0.01	1	EH.	Monto VaR (\$)	\$ 881	,653,967.50
		Lambda lo	7942202247	724		/aR (%)	VaR (\$)	
		10	1 343202347	24		0.479157	\$ 4,224,50	6.70105397
	4-				-			L. C. MILLING
Punta Especie	Número Fecl	na Emision) ías al Veto.	Valor Co	ompra	Tasa Efe	c. (Cantidad
COMPRA CDTCNFS0V	0	15/09/2008		70	235	44037 1	2.91478492	\$:
COMPRA CDTCNFS0V	0	23/12/2008		168	1000	100000 1	1.83422387	\$11
COMPRA CDTCNFS0V	0	29/12/2008	5	170	800	100000 1	1.83117647	\$1
COMPRA CDTDVISØV	0	06/10/2008		90	46	28670	0.19781194	\$
COMPRA CDTDVISOV	0	05/11/2008	64 87	30	105	80227 1	4.53488911	\$:
COMPRA CDTDVISOV	0	25/11/2008		50	59	56095 1	4.53629276	\$ 🗸
				-'				
		Valor en Rie	sgo del Gru	oqu				
\$ 4,224,506.7 0.479157>	0105397> Pérdida m Variación máxima que	iáxima si se lleg puede afectar	jare a preser el portafolio j	itar a un día ci para un día co	on una on una j	probabilidad del probabilidad del S	95 % (5

La pantalla que despliega el sistema muestra la información correspondiente a:

Área 1: Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

• Matrices



Esta opción muestra las matrices intermedias de Correlaciones y Varianza-Covarianza. En la parte Inferior cuenta con un Icono por medio del cual puede llevar esta información a Excel.



¢6	Matrices I	ntermedias de	Cálculo					X
	VOLATILIDADE	ES						
		CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVISOV	CDTDVIS0V	CDTDVISOV	CDTFALSOV
	CDTCNFS0 [®]	0.00326355	0	0	0	0	0	
	CDTCNFS0	0	0.002286112	0	0	0	0	
	CDTCNFS0 ⁶	0	0	0.002283772	0	0	0	
	CDTDVIS0v	0	0	0	0.00215184	0	0	
	CDTDVIS0v	0	0	0	0	0.002864103	0	
	CDTDVIS0v	0	0	0	0	0	0.004682486	
	CDTFALS0\	0	0	0	0	0	0	0.0001722
	CDTFALS0\	0	0	0	0	0	0	~
	<	- '	-					>
L	,							
	CORRELACIO	VES						
		CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVISOV	CDTDVIS0V	CDTDVISOV	CDTFALSOV
	CDTCNFS0	1	0.982512998	0.982349296	-0.30219021	0.998437554	0.998296674	0.9855276
	CDTCNFS0 [®]	0.982512998	1	0.990105799	-0.213212344	0.975739298	0.978620343	0.9442373
	CDTCNFS0 [®]	0.982349296	0.990105799	1	-0.216861944	0.977358758	0.980601051	0.9424910
	CDTDVIS0v	-0.30219021	-0.213212344	-0.216861944	1	-0.307691059	-0.295371007	-0.3276992
	CDTDVIS0v	0.998437554	0.975739298	0.977358758	-0.307691059	1	0.998885936	0.9898535
	CDTDVIS0v	0.998296674	0.978620343	0.980601051	-0.295371007	0.998885936	1	0.9876971;
	CDTFALS0\	0.985527621	0.944237303	0.942491023	-0.327699217	0.989853582	0.987697124	
	CDTFALS0\	-0.599364571	-0.51912915	-0.522554495	0.943731091	-0.604260316	-0.593804545	-0.6149879
	<	/						>
							Exportar Resultado	Cerrar

En caso de que se escoja la valoración por el máximo número de observaciones, la pantalla anterior desplegará en color amarillo las varianzas – covarianzas más significativas en el portafolio.

• Gráficos



Esta utilidad permite ver el comportamiento del portafolio en tres tipos de gráficos:

1. Composición de los títulos con VaR





2. VaR:





• Gráficos Curva



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado



a Grafico VaR
TIR V\$ CEC TIR V\$ CECUVR TIR V\$ CRCDT TIR V\$ IGASE TIR V\$ IGASC TIR V\$ ITEE TIR V\$ ITUS
1 1
Cerrar

• Matrices



Esta opción muestra las matrices intermedias de Correlaciones y Varianza-Covarianza. En la parte Inferior cuenta con un Icono por medio del cual puede llevar esta información a Excel.



6	Matrices I	ntermedias de	Cálculo					X
-1	/OLATILIDADE	5						
		CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTFALSOV
	CDTCNFS0 [®]	0.00326355	0	0	0	0	0	
	CDTCNFS0 [®]	0	0.002286112	0	0	0	0	
	CDTCNFS0 [®]	0	0	0.002283772	0	0	0	
	CDTDVIS0 _V	0	0	0	0.00215184	0	0	
	CDTDVIS0 _V	0	0	0	0	0.002864103	0	
	CDTDVIS0 _V	0	0	0	0	0	0.004682486	
	CDTFALS0\	0	0	0	0	0	0	0.0001722
	CDTFALSO	0	0	0	0	0	0	~
	<							>
Ľ	CORRELACION	IES						
		CDTCNFS0V	CDTCNFSOV	CDTCNFS0V	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTFALSOV
	CDTCNFS0	1	0.982512998	0.982349296	-0.30219021	0.998437554	0.998296674	0.9855276
	CDTCNFS0	0.982512998	1	0.990105799	-0.213212344	0.975739298	0.978620343	0.9442373
	CDTCNFS0 ⁶	0.982349296	0.990105799	1	-0.216861944	0.977358758	0.980601051	0.9424910;
	CDTDVIS0 _V	-0.30219021	-0.213212344	-0.216861944	1	-0.307691059	-0.295371007	-0.3276992
	CDTDVIS0 _V	0.998437554	0.975739298	0.977358758	-0.307691059	1	0.998885936	0.9898535
	CDTDVIS0V	0.998296674	0.9/8620343	0.980601051	-0.295371007	0.998885936	1	0.9876971;
	COTFALSO	0.985527621	0.944237303	0.942491023	-0.327699217	0.989853582	0.987697124	0.0140070
	COTFALSU	-0.599364571	-0.51912915	-0.522554495	0.943731091	-0.604260316	-0.593804545	-0.6149879
	<							>
						· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	Exportar Resultado	Cerrar

En caso de que se escoja la valoración por el máximo número de observaciones, la pantalla anterior desplegará en color amarillo las varianzas – covarianzas más significativas en el portafolio.

• Históricos



Información que se utiliza para realizar la medición.



Fecha	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALSOV	CDTF
06/01/2009	12.91478492	11.83422387	11.83117647	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	(
05/01/2009	10.26176293	10.95293462	10.95734711	10.41924427	9.82397056	9.89011079	10.48964294	1
02/01/2009	10.31690159	10.97259033	10.97640112	10.09685286	9.9003705	9.95535447	10.58049946	1
31/12/2008	10.37823341	11.23984771	11.24365851	10.24004257	9.71111402	9.90714392	10.19129958	1
30/12/2008	10.38552529	11.24175312	11.24546362	10.24592164	9.72187167	9.91600907	10.20443679	1
29/12/2008	10.37313906	11.31315546	11.31867109	10.2485124	9.68621174	9.89060881	10.16141522	1
26/12/2008	10.49020886	11.40331096	11.14830829	10.41447275	9.59425589	9.79995614	10.27242889	1
24/12/2008	10.53595799	11.43199225	11.18650053	10.45175758	9.58273583	10.44459782	10.37140858	1
23/12/2008	10.57231752	11.17848037	11.22852041	10.47947196	9.63777167	10.5252181	10.43849821	1
22/12/2008	10.62585799	11.31373843	11.22549279	10.80092005	9.79000446	10.71308262	10.52042977	1
19/12/2008	10.68958708	11.32813549	11.22149862	10.77337049	9.86522094	10.75741269	10.67235912	1
18/12/2008	10.97238274	11.3311315	11.20206413	10.93949044	9.86144447	10.78991403	10.66152851	1
17/12/2008	10.97979317	11.31669561	11.2128153	10.86456194	10.24099989	10.87577541	10.70515173	1
16/12/2008	10.9674758	11.29363628	11.21807825	10.89744264	10.12378819	10.8341504	10.67025316	1
15/12/2008	11.03957752	11.31666746	11.21598982	10.96364868	10.25889221	10.81062411	10.7150798	1
12/12/2008	12.91478492	11.31725327	11.21408922	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	
11/12/2008	11.51180264	11.31507682	11.21260734	10.97067815	10.45877153	10.84475649	10.63050723	1
10/12/2008	11.53863156	11.31186589	11.21471599	10.9925973	10.4909714	10.91670073	10.64203015	1
09/12/2008	11.53863154	11.31089994	11.21509612	11.04853491	10.51870625	10.9627429	10.67740033	1
05/12/2008	11.54677067	11.31435268	11.2144997	11.01095152	10.79483313	10.96436817	10.693332	t

Exportar a Excel:



La información puede ser llevada a Excel, para realizar diferentes informes.

Área 2: Grupo: Aquí se muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, como se escogió Grupo aparece el Nombre del Grupo y la descripción. En caso de que sea Portafolio muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, como es el Nombre, el Tipo de Portafolio al que pertenece y la Línea de Negocio asociada, si fuese Tipo aparece el Nombre del Tipo, el Mercado y la Moneda, y si fuese una Línea de Negocio aparece el nombre de la Línea, la Descripción y el Grupo al que pertenece.

Área 3: Datos Suministrados: Información correspondiente a los datos suministrados por el Usuario para la medición del Riesgo. Así mismo un mensaje que dice si se valoró por el mínimo de observaciones o por el máximo de observaciones.

El Lambda o Factor de Decaimiento, se utiliza para el cálculo de la desviación estándar, su valor esta comprendido entre 0 y 1, este factor da peso a los rendimientos históricos, un valor igual a 1 indica que los rendimientos históricos tienen el mismo peso, un valor cercano a 0 indica que los rendimientos históricos mas recientes tiene mas peso que los lejanos.



La volatilidad es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un portafolio. Es un indicador fundamental para la cuantificación de riesgos de mercado porque representa una medida de dispersión de los rendimientos con respecto al promedio o la media de los mismos en un periodo determinado.

Área 4: Resultados Obtenidos: Aquí aparecen los resultados de riesgo a nivel general, es decir del Portafolio, Tipo, Grupo o Línea. Dichos resultados son el Valor. Neto portafolio, el valor compra, valor a tasa compra, duración promedio, valor portafolio, PyG real, el VaR en Pesos, el VaR en Porcentaje, el Valor del Portafolio y la Duración Modificada Promedio. En la parte inferior se muestra la descripción del VaR.

Área 5: Información de las Inversiones del Portafolio: En esta cuadricula aparecen cada una de las inversiones con sus correspondientes datos y valoraciones:

- **Punta:** ya sea la compra o la venta
- **Especie:** Especie o título que sé esta negociando.
- Número: Número DCV o DVL (DECEVAL) con el cual se encuentra registrado el título.
- Fecha de Emisión: Fecha de Emisión del título
- Días al vencimiento: Días al vencimiento del título o papel
- Valor compra: Valor compra del título
- Tasa efectiva: Tasa del título
- **Cantidad:** Valor Nominal del título.
- **Precio Reciente:** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- Monto: Valor total de la inversión.
- **Tasa Reciente (%):** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- Precio a tasa compra: Precio calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.
- Valor a tasa compra: Valor calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.
- **PYG Real:** Utilidad o perdida obtenida
- VaR (\$): Valor en Riesgo en Pesos.
- VaR (%): Valor en Riesgo en Porcentaje.
- **Duración:** Corresponde a la duración del papel
- Volatilidad: Es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un activo o un portafolio.
- RMSE: (ROOT MEAN SQUARED ERROR) Error de Pronóstico de la Varianza



- **Tipo FW:** Tipo de forward (Delivery or not Delivery)
- **Observaciones:** En este campo el sistema despliega el motivo por el cual no se valoró determinada inversión.
- **Num. Negocio:** Número de la operación
- **Posición:** Si es larga o corta
- **Tipo Compromiso:** Corresponde al tipo de negocio celebrado.
- Fecha Vencimiento: Fecha de Vencimiento del título

Área 6: Descripción del VaR en Pesos y en Porcentaje: Aquí se explica que significan los valores proporcionados por el sistema en cuanto al VaR en \$ y en %.

8.1.4. DELTA NORMAL (VAR RISKMETRICS)

Esta metodología fue propuesta por JP-Morgan y consiste en suponer que los rendimientos de los activos financieros se distribuyen como una Normal Multivariada, adicionalmente se supone que el cambio relativo en el valor de una cartera es una función lineal de estos rendimientos.

El cálculo del VaR Riskmetrics, no requiere de la simulación de escenarios, ya que se calcula directamente sobre la distribución de los cambios en el valor del portafolio (Normal), con base en los resultados de la estimación de la matriz de volatilidades y correlaciones.

El Valor en Riesgo o VaR Riskmetrics, se define como el percentil a de la distribución de los cambios en el valor del portafolio, es decir:

 $VaR = Za/2 * \sigma$

Donde Za/2 representa el percentil correspondiente a a/2 de probabilidad en cada una de las colas de la distribución Normal y σ La desviación estándar de la distribución de los cambios en el valor del portafolio.

Para ingresar a este método haga clic en el Icono descrito en la parte superior, el sistema despliega la pantalla que se muestra a continuación para que el usuario digite los datos con los cuales desee realizar la medición.



📓 Método - Delta Normal (Grup	• : CLIENTE	S)	×
Fecha Medición Número de Observaciones Horizonte Temporal Nivel de Tolerancia Nivel de Confianza	05/01/2009 20 1 0.01 95	•	VaR Factores
Seleccione la Fuente de Información C ALTERNA F INFOVAL			5eleccione Precio — Precio Sucio Precio Limpio
	Ad	cepta	ar 🔀 Cerrar

Los datos requeridos por el sistema para realizar la medición son los siguientes:

Fecha: Es la fecha a partir de la cual se desea realizar la medición. El Número de Observaciones digitado se tomará desde esa fecha hacia atrás.

Número de Observaciones: Es la cantidad de datos históricos que se va a tomar de cada una de las posiciones del Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio que se vaya a valorar. Este rango de observaciones deber ser mayor a 20 y menor a 999. En caso de que se encuentren rangos menores a 20 no se valora la posición; así mismo cuando sé este valorando un Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o

Portafolio se trabajará con la cantidad de rangos de la posición que menos tenga. Esto solo aplica para este método.

Horizonte Temporal: Es el número de días al que se va a proyectar el sigma pronóstico. **Nivel de Tolerancia:** Es una medida que permite saber para cierto nivel de Lambda cual va a ser el error.

Nivel de Confianza: Es la certeza con la cual, la perdida probable del portafolio este considerado en el *VaR*.

Seleccione la Fuente de Información: Las Fuentes son:

Alterna: Información procedente de otras fuentes.

Infoval: Información emitida por la Bolsa de Valores.

Seleccione Precio: Los precios son:

Precio Limpio: Precio descontando los rendimientos pendientes de pago.

Precio Sucio: Precio actual del papel

VaR Factores: Si da clic en este botón, se calcula el VaR agrupando las inversiones de acuerdo a los factores de riesgo (solo método Delta Normal), de lo contrario la información se mostrará como sigue a continuación.

Una vez digitados estos valores se debe dar clic en el botón Aceptar para que el sistema muestre la siguiente pantalla con los resultados obtenidos a partir de los



datos suministrados.

Método d	le Delta Normal por	Grupo.					
Gráficos	- In Gráficos Curva M	Tatrices	Historicos Exportar Ex	cel Inf. Jerarqui	ico Cerrar		
GRUPO					MEDICION		
Grupo	ICLIENTES		-Datos Suminist	rados	Resultad	os Obtenidos	
Descripción	PORTAFOLIOS CLIEN	TES	Fecha 06/	01/2009	Neto Por	tafolio \$888,6	656,649.84
			Nro. Observa	aciones —	Valor C	iompra \$ 876,	941,088.00
			Solicitado F	eal [Vir. A Ta	sa Cmp \$ 888,794,8	59.632973
		2	20	20	Duración	Prom.	0.347294
		2	Niveles		Volat. Po	rtafolio 4 0.3	228714576
			Confianza 1	olerancia Horiz	zonte p	G Real	138,209.81
÷			95	0.01	1 Monto V	aR (\$) \$ 888	656 649 85
			Lambda 0.7	4220224724	VaR (%)	VaR (\$)	030,043.03
			Combod JU.7	34328234724		376202 \$ 3,343,146	6.19478635
Punta	Especie	Número	Fecha Emision Dí	as al Vcto.	Valor Compra	Tasa Efec. C	antidad
COMPRA	CDTCNFS0V		0 15/09/2008	70	23544037	12.91478492	\$.
COMPRA	CDTCNFS0V	Q.	0 23/12/2008	168	10000000	11.83422387	\$ 11
COMPRA	CDTCNFS0V		0 29/12/2008	170	80000000	11.83117647	\$1
COMPRA	CDTDVISOV		0 06/10/2008	5 90	4628670	0.19781194	\$
COMPRA	CDTDVISOV		0 05/11/2008	30	10580227	14.53488911	\$
COMPRA	CDTDVISOV		0 25/11/2008	50	5956095	14.53629276	5 🗸
<1001							
-			Valor en Rieso	o del Grupo			
	\$ 3,343,14	46.19478635>	Pérdida máxima si se llega	e a presentar a u	n día con una probabi	idad del 95 % 6	
	0.376202	 Variación má 	áxima que puede afectar el	portafolio para un	n día con una probabili	dad del 95 %	

La pantalla que despliega el sistema muestra la información correspondiente a:

Área 1: Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

• Gráficos:



En esta opción encontrará tres tipos de gráficas:

1. Composición títulos con VaR





2. Composición Total



3. VaR.





Gráficos Curva







Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado

• Matrices



Esta opción muestra las matrices intermedias de Correlaciones y Varianza-Covarianza. En la parte Inferior cuenta con un Icono por medio del cual puede llevar esta información a Excel.

En caso de que se escoja la valoración por el máximo número de observaciones, la pantalla anterior desplegará en color amarillo las varianzas – covarianzas más significativas en el portafolio.

• Datos Históricos



Información histórica con la que se realizan las respectivas mediciones

• Exportar a Excel



La información contenida en el portafolio, puede ser llevada a Excel para diversos informes.

• Informe Jerárquico





Este informe muestra el valor del portafolio por niveles y el VaR total.

Área 2: Portafolio: Aquí se muestra la información general del Portafolio que se ha valorado, como es el Nombre, el Tipo de Portafolio al que pertenece y la Línea de Negocio asociada. En caso de que sea un Grupo aparece el Nombre del Grupo y la Descripción, en caso de que sea un Tipo aparece el Nombre del Tipo, el Mercado y la Moneda, en caso de que sea una Línea de Negocio aparece el nombre de la Línea, la Descripción y el Grupo al que pertenece.

Área 3: Datos Suministrados: Información correspondiente a los datos suministrados por el Usuario para la medición del Riesgo. Así mismo un mensaje que dice si se valoró por el mínimo de observaciones o por el máximo de observaciones.

El Lambda o Factor de Decaimiento, se utiliza para el cálculo de la desviación estándar, su valor esta comprendido entre 0 y 1, este factor da peso a los rendimientos históricos, un valor igual a 1 indica que los rendimientos históricos tienen el mismo peso, un valor cercano a 0 indica que los rendimientos históricos mas recientes tiene mas peso que los lejanos.

Área 4: Resultados Obtenidos: Aquí aparecen los resultados de riesgo a nivel general, es decir del Portafolio, Tipo, Grupo o Línea. Dichos resultados son El valor neto portafolio, valor compra, vr. A tasa compra, duración promedio, volatilidad portafolio, PyG real, el VaR EN % Y EL VaR en \$. En la parte inferior se muestra la descripción del VaR.

La volatilidad es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un portafolio. Es un indicador fundamental para la cuantificación de riesgos de mercado porque representa una medida de dispersión de los rendimientos con respecto al promedio o la media de los mismos en un periodo determinado.

Área 5: Información de las Inversiones del Portafolio: En esta cuadricula aparecen cada una de las inversiones con sus correspondientes datos y valoraciones:

- Punta: ya sea la compra o la venta
- Especie: Especie o título que sé esta negociando.
- Número: Número DCV o DVL (DECEVAL) con el cual se encuentra registrado el título.
- Fecha de Emisión: Fecha de Emisión del título
- Días al vencimiento: Días al vencimiento del título o papel
- Valor compra: Valor compra del título
- Tasa efectiva: Tasa del título
- **Cantidad:** Valor Nominal del título.



- **Precio Reciente:** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- Monto: Valor total de la inversión.
- **Tasa Reciente (%):** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- Precio a tasa compra: Precio calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.
- Valor a tasa compra: Valor calculado hoy a la tasa a la que se compro el papel.
- PYG Real: Utilidad o perdida obtenida
- VaR (\$): Valor en Riesgo en Pesos.
- VaR (%): Valor en Riesgo en Porcentaje.
- **Duración:** Corresponde a la duración del papel
- **Volatilidad:** Es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un activo o un portafolio.
- RMSE: (ROOT MEAN SQUARED ERROR) Error de Pronóstico de la Varianza
- **Tipo FW:** Tipo de forward (Delivery or not Delivery)
- **Observaciones:** En este campo el sistema despliega el motivo por el cual no se valoró determinada inversión.
- Num. Negocio: Número de la operación
- Posición: Si es larga o corta
- **Tipo Compromiso:** Corresponde al tipo de negocio celebrado.
- Fecha Vencimiento: Fecha de Vencimiento del título

Área 6: Descripción del VaR en Pesos y en Porcentaje: Aquí se explica que significan los valores proporcionados por el sistema en cuanto al VaR en \$ y en %.

8.1.5. SUPERVALORES

Este es el método oficial de medición del VaR, suministrado por la supervalores.

Al dar clic en el Icono de ingreso, aparecerá la siguiente pantalla para registrar la fecha de Precios y la Fecha de la medición como se muestra a continuación.





Fecha Precios: Fecha a la cual se toman los precios de mercado para valorar el portafolio. **Fecha Medición:** Fecha a la cual se realiza la medición del VeR. A continuación se muestra la

pantalla de resultados

rtar a Excel	Informe	súper	Cerrar	1							
	•••••		MEDICIÓN	•••••	•••••	11 I I		1	TOTALES		
							Monto T	otal Compra	\$ 876 941 0	188.0	
Nivel Media	ión GR	UPO			-		Monto T	otal Valorado	+ 000 704 00	0.05	
Nom		ENTES			2		montori	otar y alorado	\$ 888,794,85	2.65	
NOTIL		LINES								• • •	
Mél	todo SÚ	PER VALO	RES				Monto C	ompromisos		\$ 0.0	
Tipo Medi	ción MÉ	TODO AN	ÁLISIS					VaB Total	\$ 1 422 594 42	7165	
									\$ 1,422,004.43	/105	
							Hel	. Solvencia	1	%.0	
Comprom P	linta	Posicion	Especie	DE	TALLE DE L	A MEDICIÓN -		%T Compra	2P Compra (\$V/		
Comprom. P	unta OMPRA	Posicion	Especie CDTCNFS0V	DE F.Compra 13/12/2008	F.Vence	A MEDICIÓN Cantidad 23.18	3,985,00	%T.Compra 12.915	%P. Compra \$Va 101.553	al. Compra	1
Comprom. P NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA	Posicion LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008	TALLE DE LA F.Vence 7/03/2009 23/06/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00	3,985.00	<mark>%T.Compra</mark> 12.915 11.834	%P. Compra \$Va 101.553 100.000	al. Compra	
Comprom. F NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008	F.Vence 7/03/2009 13/06/2009 15/06/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00	3,985.00 0,000.00 0,000.00	%T.Compra 12.915 11.834 11.831	%P. Compra \$Va 101.553 100.000 100.000	al Compra	
Comprom. P NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008	F.Vence 7/03/2009 13/06/2009 15/06/2009 16/04/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60	*T.Compra 12.915 11.834 11.831 0.198	%P. Compra \$Va 101.553 100.000 100.000 100.171	al. Compra 23,544,0 100,000,0 80,000,0 4,628,6	
Comprom. F NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008 26/12/2008	F.Vence 7/03/2009 3/06/2009 15/06/2009 16/04/2009 15/02/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62 10,50	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60 9,012.00	%T.Compra 12.915 11.834 11.831 0.198 14.535	%P. Compra \$Va 101.553 100.000 100.000 100.171 100.678 100.678	Compre 23,544,0 100,000,0 80,000,0 4,628,6 10,580,2	4
Comprom P NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 8/12/2008	F.Vence 7/03/2009 3/06/2009 5/06/2009 16/04/2009 15/02/2009 15/02/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62 10,50 6,00	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60 9,012.00 0,000.00	XT.Compra 12.915 11.834 11.831 0.198 14.535 14.536	%P. Compra \$Va 101.553 100.000 100.000 100.171 100.678 99.268	I. Compre 23,544,0 100,000,0 80,000,0 4,628,6 10,580,2 5,956,0	4
Comprom. (P NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTFALS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 11/08/2008	F.Vence 7/03/2009 3/06/2009 5/06/2009 15/06/2009 16/04/2009 15/02/2009 15/02/2009 15/02/2009 4/01/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62 10,50 6,00 3,30	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60 9,012.00 0,000.00 8,982.00	%T.Compre 12.915 11.834 11.831 0.198 14.535 14.536 11.830	%P. Compra \$Va 101.553 100.000 100.000 100.171 100.678 99.268 100.185 100.185	AL Compra 23,544,0 100,000,0 80,000,0 4,628,6 10,580,2 5,956,0 3,315,0	4
Comprom. P NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTFALS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 11/08/2008 2/09/2008	F.Vence 7/03/2009 3/06/2009 5/06/2009 16/04/2009 16/04/2009 15/02/2009 15/02/2009 4/01/2009 4/01/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62 10,50 6,00 3,30 24,12	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60 3,012.00 0,000.00 8,982.00 7,015.00	%T.Compre 12.915 11.834 11.831 0.198 14.535 14.535 14.536 11.830 12.745	%P. Compta \$V& 101.553 100.000 100.000 100.000 100.071 92.88 100.185 101.535	SI Compre 23,544,0 100,000,0 4,628,6 10,580,2 5,956,0 3,315,0 24,497,2	4
Comprom. P NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C NGUNO C	unta OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA OMPRA	Posicion LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA LARGA	Especie CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTFALS0V CDTFALS0V CDTFALS0V	DE F.Compra 13/12/2008 23/12/2008 29/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 8/12/2008 11/08/2008 11/08/2008 31/07/2008	F.Vence 7/03/2009 3/06/2009 3/06/2009 5/06/2009 16/04/2009 15/02/2009 5/02/2009 4/01/2009 4/01/2009 4/01/2009	A MEDICIÓN Cantidad 23,18 100,00 80,00 4,62 10,50 6,00 3,30 24,12 2,33	3,985.00 0,000.00 0,000.00 0,774.60 9,012.00 0,000.00 8,982.00 7,015.00 0,079.00	*T.Compra 12.915 11.834 11.831 0.198 14.535 14.536 11.830 12.745 0.793	2P. Compta \$V2 101.553 100.000 100.000 100.000 100.000 100.078 99.268 99.268 100.185 101.535 105.032 105.032	AL Compta 23,544,0 100,000,0 80,000,0 4,628,6 10,580,2 5,956,0 3,315,0 24,497,2 3,077,5	4

AREA 1: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

• Exportar a Excel



La información proveniente de la medición de la Súper puede ser llevada a Excel para realizar diversos informes.

• Informe Súper



Con esta opción se genera el archivo plano para trasmitir a la Superintendencia de Valores. Al dar clic en esta opción se muestra la siguiente pantalla.



🗿 Generación Informe 🔀
Completo Consecutivo Parcial
Con Ceros
Aceptar 🛛 Cerrar

Completo: El archivo es generado con encabezado y fin de archivo como lo requiere la superintendencia de valores.

Parcial: Se generan los registros correspondientes al VeR, sin encabezado ni fin de archivo, con el fin de pegarlo a un archivo contable y poder de esta manea trasmitir tanto la información del VeR como la parte contable.

Consecutivo: Con esta opción se le indica al sistema el número desde el cual se quiere que el sistema numere los registros del archivo-

Con Ceros: Si se pincha esta opción, se incluirán en el archivo los registros que dieron valor cero de lo contrario estas columnas no se incluirán en el archivo.

Después debe dar clic en aceptar y el sistema genera el informe de acuerdo a las características suministradas, en un archivo plano como se muestra a continuación.

🗊 super - Bloc de notas	
Archivo Edición Formato Ver Ayuda	
00001200000100201 0000242010101001+00014167164191.64 0000342011601001+0151886951.940213 0000442012801001+0151886951.940213 000064201010103+0000332236242.96 0000742011601003+0000876364.156523 0000842012801003+0000876364.156523 0000942013001003+0000876364.156523 000142010101004+0002203204.289475 0001142010801004+0002203204.289475 0001242011801004+000579565.111514 0001342012801004+0007795869.400989 0001442013001004+0007795869.400989 000154201010107+0000084418.798657 0001742012801007+000084418.798657	
0001842013001007+0000084418.798657 0001942010101008+0029778313595.99 0002042010201008+0020339106.017025 0002142012801008+0020339106.017025 0002242013001008+0020339106.017025 000224201010109+00000060034682.38 0002442010201009+0000047767.233475 0002242012801009+0000047767.233475	V
	≥

AREA 2: Aquí se muestra la información del portafolio como son: Nivel de Medición, Nombre, Método y Tipo de Medición.

AREA 3: Corresponde a información de Totales: Monto total compra, Monto total valorado, Monto Compromisos, VaR total, Relación de solvencia. **AREA 4:** En detalle se muestra la información de la medición.

Tipo de Compromiso: Corresponde al tipo de operación



Punta: Compra o Venta Posición: Corta o Larga Especie: Título F. Compra: Fecha de Compra **F. vence:** Fecha de vencimiento Cantidad: Cantidad del título **T. Compra:** Tasa de compra P. Compra: Precio de compra Val. Compra: Valor de la compra F. Cmpso: Fecha del compromiso V. Cap/Sal: Valor captación V. Cmpso: Valor del compromiso D. Cmpso: Días del compromiso T. Cmpso: Tasa del compromiso P. Val Lar: Precio de valoración de la Posición larga Mto. Val Lar: Monto de valoración de la Posición larga Dur Lar: Duración de la Posición larga T. Val_Lar: Tasa de valoración de la Posición larga VeRtasa Lar: Valor en Riesgo efecto tasa de la Posición Larga VeRMone_Lar: Valor en Riesgo efecto moneda de la Posición Larga Factasa Lar: Factor de Riesgo tasa Posición larga FacMone Lar: Factor de Riesgo moneda Posición larga P.Val Cor: Precio de valoración de la posición corta MtoVal Cor: Monto de valoración de la posición corta Dur Cor: Duración de la Posición corta **TasaVal Cor:** Tasa de valoración de la posición corta VeRtasa_Cor: Valor en riesgo efecto tasa de la posición corta VeRMone Cor: Valor en riesgo efecto moneda de la posición corta FacTasa Cor: Factor de riesgo tasa posición corta FacMone_Cor: Factor de riesgo moneda posición corta **Observaciones:** Anotaciones especiales.

8.1.6. VALORIZADOR EXTERNO

Para utilizar el Valorizador Externo de Portafolios, debe proceder:

- 1. Cree, en la base de datos del sistema que va a utilizar el Valorizador Externo, una vista a la tabla "N09ValExterno" de PWPREI, con accesos de Lectura y Escritura.
- Lea las especificaciones definidas en el archivo "InterfazValorizadorExterno.xls" para ver cómo debe cargar los datos y cómo debe leer los resultados. Cargue, por los métodos que prefiera en su sistema, la tabla citada a través de la vista. Una vez hecho esto está listo para procesar en PWPREI los portafolios cargados.



3. Presione el icono Valorizador Externo:



Fecha Portafolios: Fecha para leer los datos de la tabla "N09ValExterno". Fecha Valoración: Fecha para liquidar o valorar las posiciones leídas.

4. Pulse Aceptar, una vez procesado aparece el siguiente mensaje:



5. Los resultados le quedan en la tabla "N09ValExterno" y podrá acceder a ellos a través de la vista que creó para el efecto. En el archivo adjunto "InterfazValorizadorExterno.xls" podrá ver cuáles son los campos de resultado.

8.1.7. BORRAR HISTORIAL

Con esta opción se borra información alterna utilizada para la medición del VaR y aunque esta información sea borrada el sistema la regenera cuando la necesita, esta información se puede borrar por especie o por todos los registros como se muestra en el cuadro a continuación.





NOTA: Es importante realizar este borrado cuando se cambien las características faciales de una especie.

8.2. OPCIÓN CARGA



8.2.1. PARÁMETROS DE LA CARGA MANUAL DE PORTAFOLIOS

Con esta opción podrá establecer o crear los portafolios para posteriormente cargar las inversiones o negocios de la compañía provenientes de otros sistemas BackOffice existentes.

Al dar clic en la opción respectiva aparecerá la siguiente pantalla con las opciones para Ingresar, Modificar y Eliminar.



🚢 Parámetros Carga de Portafolios 📃 🗖 🔀								
δ ₂ β ₂ 🚰 🜗								
Nit 1	Nit 2	Nit 3	Mercado	Moneda	Portafolio			
30391341			GEN	GEN	JT			
SP			GEN	GEN	SONIA PELAEZ			
01			GEN	GEN	POSICION			
0004	0	0	GEN	GEN	JT1			
0001	0	0	GEN	GEN	Jotica			
					>			
Registro(s) 5								

8.2.1.1. INGRESAR CARGA MANUAL

Los datos que se ingresen en esta utilidad para los distintos tipos de mercado conformarán los parámetros que posteriormente serán utilizados por la carga automática de inversiones.

🛓 Parámetros Carga de Port 🔀
Mercado Moneda Portafolio Beneficiarios
Opción O Siempre Reemplazar O Borrar y Recargar
Aceptar 🔀 Cerrar



Deberá en esta pantalla ingresar los datos correspondientes al portafolio para que ahí se puedan cargar las inversiones respectivas. Si escoge la opción siempre reemplazar, cada que haga nuevas cargas de inversiones existentes se reemplazaran aquellas que ya existen. Si escoge la opción Solo actualizar o agregar, cada que haga nuevas cargas de inversiones se actualizaran inversiones existentes y se agregaran las que no existan.

8.2.1.2. MODIFICAR CARGA MANUAL

Para modificar la carga manual de inversiones deberá escoger el dato deseado y oprimir el botón de modificación del sistema. Aparece la pantalla mostrada anteriormente y deberá cambiar la información deseada oprimiendo el botón de Aceptar.

El sistema solo permite la modificación del Portafolio y de las opciones de actualización, en caso de que sea necesario modificar otro campo puede eliminar el registro o adicionar uno nuevo.

🛓 Parámetros Carga de Port 🔀
Mercado GEN 💌 Moneda GEN 💌 Portafolio 🎹 💌
30391341
Opción © Siempre Reemplazar © Borrar y Recargar
Aceptar 🔀 Cerrar



8.2.1.3. ELIMINAR CARGA MANUAL

	🚢 Parámetros Carga de Port 🔀	
	Mercado GEN 💌	
	Moneda GEN 🖃	
	Portafolio JT	
	- Beneficiarios	
ļ	WPREI - PORTAFOLIOS Y RIESGO 🛛	
	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
	 Siempre Reemplazar Borrar y Recargar 	
	Acepta Cerrar	

Para eliminar seleccione el registro y pulse la tecla descrita en la parte superior, el sistema le envía un mensaje reconfirmando si desea o no eliminar dicho registro.

8.2.1.4. REGISTRO MANUAL DE ISIN

Esta actividad esta relacionada al proceso de Valoración y reporte de información a la SFC. Recuerde que a partir de la versión VREI2014BOF puede elegir entre valorar por ISIN o por características faciales del papel. Si opta por la carga manual deberá tener debidamente registrado el ISIN en el campo NumDcvDvl de cada posición en su portafolio.

Está opción le permite actualizar el ISIN de una operación particular en su portafolio, que haya sido registrada o cargada sin el ISIN correspondiente. Proceda:

- Ingrese a PWPREI.
- Para actualizar el ISIN, diríjase al módulo de Portafolios y Riesgos. Si usa cierres por portafolio indique la última fecha abierta para el portafolio donde está la operación a actualizar, de lo contrario; o si tiene todos los portafolios al día, simplemente acepte la fecha desplegada por el sistema.



🥕 Fecha Portafolios 🛛 🗧	x
Fecha Medición 1 /07/2014 💽	
Aceptar 🔀 Cerrar	

Seleccione el portafolio y ubique la inversión, por la opción de búsqueda:

Urganizar									
organizariti	PORTAFOLIO	11/0	07/2014						
Por Grupo	Nombre	- Beneficiarios -			_				
C Por Línea	ACCION UNO	000102040 0		ACCION	-				
C Por Tipo	Tipo			ACCION					
C Por Portafolio	JUARTERA		_						
	Linea de Negocio	_ !							
10003	ACC								
	INVERSIONES								
ACCION UND	S 🔊	r 🔁							
CONSERVADOR	V 🔏 🔍 🖡		Z	━ ≥	Posiciones				
EDMESA	Ingresa Modifica	Elimina Venta	Compra Trasladar	Reversa Buscar	452				
	Punta Espe	cie NDcDv/IS	IN Negocio No.	Orden No.	Fec Emisión	Fec Vencimient	T. Compromiso	Modalid	ε.
	COMPRA BAVA	01099A COI03CB0	0011 ACC8398	13040101166	25/08/2009	25/08/2014	NINGUNO	TV	
BENGIONEO	COMPRA BBB0	0108A19A' COB01CB	0031 ACC10748	14031800277	15/04/2008	15/04/2015	NINGUNO	AV	
FENSIONES	COMPRA BBB0	0108C11A' COB01CB	1005 ACC8765	13052100817	15/04/2008	15/04/2015	NINGUNO	TV	-

🖏 Parámetros Búsqueda				×
Ingrese Parámetros que conozca Trader Numdovdv	I/ISIN NumNegocio	Especie	Fe.Oper Cantidad	
	FILTRAR	Aceptar	Cerrar	

 Ubicada la inversión seleccione la opción de Trasladar, para asignar el ISIN. Recuerde que en esta versión la acción de Doble Click sobre la grilla de datos es para "Ver" y el ícono que antes era "Ver" ahora es "Trasladar":



Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio TODOS	PORTAFOLIO 11/07/2014 Nombre Beneficiarios ACCION UNO 800193848-8 Tipo 800193848-8 CARTERA 900193848-8 Linea de Negocio 900193848-8
CAR CAR CONSERVADOR CONSERVADOR CONSERVADOR FACTURAS GARANTIAS CONSER CONSERVA CONSERVADOR CONSERVA CONSERV	INVERSIONES Ingresa Modifica Elimina Venta Compra Trasladar Reversa Buscar 1 Punta Especie NDcDv/ISIN Negocio No. COMPRA BAVA01099A CO103CB00011 ACC8398 13040101166 25/08/200

En el campo Nuevo ISIN registre la información y pulse Aceptar.

🗐 Traslado de Portafoio/Cambio ISIN 🥢 🕰
⊂ Tipo de Operación ⓒ Normal C. Contado+1a5. C. Repo – C. Simultáneas C. Tr.Temp. C. Forward, C. SWAP. C. Opciones
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Trasladar A: 11/07/2014 01/04/2013 01/04/2013 COMPRA LARGA ACC8398 13040101166 ACCION UNO Image: Compra Tipo Fw Emisor Especie Depósito Nuevo ISIN Tipo Inversión Contrapate Hora Compra Tipo Fw AVIANCA Image: BAVA01099A Image: Collo3CB00011 NEGOCIABLE ULTRABURSATILE: Image: Collo3CB Image: Collo3CB
Datos Faciales Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 25/08/2009 25/08/2014 5.50 COMPLETO TRIMESTRAL Cantidad Valor de Compra Ult.VIr. Mercado PyG/T rading. 530,000,000.0 551,102,480.0 537,112,600.0 -13,989,880.0 VENCIDA 0.00 0 0.00 Trader Adicional Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Cpr. Orden CPR CCASAS 0.0 NO APLICA NO APLICA 0.000 30/04/2014 ✓
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir [0.0
SECUNDARIO SEPECULA DVP TRA Cal Crediticio Inv. A NA



8.2.2. DISTRIBUCION

Para realizar este procedimiento seleccione la fecha y el mercado a partir del cual desea realizar la carga y posteriormente haga clic en el botón Aceptar. En la parte inferior en el cuadro Estadístico se lleva un control de la información que se ha cargado.

La información que aquí se cargue da como resultado de los parámetros que el usuario haya ingresado en la carga manual.

🚢 Distribución en Portafolios				
Fecha 107/2009 Mercado C Acciones C Renta Fija C Divisas C Todos C Todos Registros	Resultados de l Mercado Acciones Renta Fija Divisas Total	la Distribuciór Leídos 0 0 0	Seleccionados O O O O	
			Aceptar	Cerrar

Después de dar clic en el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla:

🛓 Distribución en Portafolio	os				
Fecha 20/04/2009 💌		Resultados de la Distribución			
C Acciones		Mercado	Leídos	Seleccionados	
🔿 Renta Fija 🔰 30391341	1	Acciones	0	0	
C Divisas		Renta Fija	4	0	
G Tudu		Divisas	U	U	
(• Todos		Total	0	0	
C Todos Registros					
Portafolio	Especie	Depósito	Número D	eceval/I Error	
JT	TBFP10250112	NINGUN		1 PK'. No se	puede insertar u
JT	TBFT15240720	NINGUN		1 PK'. No se	puede insertarι
JT	TRST12250215	NINGUN		1 PK'. No se	e puede insertar u
JT	TRST07220910	NINGUN		1 PK'. No se	e puede insertar u
					>
				Acepta	Cerrar



8.2.3. COMPROMISOS



	🔀 FormatosTodasEntrada.xls [Modo de compatibilidad] - Microsoft Excel										
	А	В	С	D	E	F	G	Н		J	к
1								6			
2	SERIE	LONG		-IN	TIPO	DOMINIO	NOMBRE	DESCRIPCION	REQUERIDO	OBSERVACIONES	PROCEDENCIA DE LOS DATOS
4	2	03		88	-		Petrafolio	Portafolio al que se asigna el título o inversion	Si	Llave Primaria	Pormato AAAAMMOD sin espacios in separadores de
-	-	10		70			Describe	Deposito de Valores. Recuede que este es el administrador por	e:	Line Diania (DVC DVI, FIGICO OTDO)	
5	3	10	63	<i>`</i> °	~		Deposito	defecto.	51	Liave Primaria (DVC ;DVL; PISICO ;OTRO)	
6	4	20	79	98	<u>A</u>		NumDevDvI	Uselo como ISIN o número libre	SI	Llave Primaria	
8	0	15	99	113	<u>A</u>		Numero Negocio	Numero del NegocionNumero asignado a la inversion	51	Llave Primaria	
9	7	6	129	134	A		Punta	Numero de Ordenmumeración Elbre	Si	Llave Primaria (Compra o Venta)	
10	8	5	135	139	Ä		Posicion		Si	Lagra o Corta	
11	9	12	140	151	A		Especie		Si	-	
12	10	8	152	159	F	-	Fecha Operación	Fecha de Realizacion de la Operación	Si		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
13	11	8	160	167	F	-	Fecha Compra	Fecha en la que se realizo la compra Valor de Compra del Titulo	SI NO		Formato AAAAMMUU sin espacios ni separadores de
15	13	8	187	194	F		Fecha Emision	Fecha de Emision	Si		Formato AAAAMMDD sin espacios ni senaradores de
16	14	8	195	202	F		Fecha Vencimiento	Fecha de Vencimiento	Si		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
17	15	10	203	212	N		Tasa Nominal	Tasa de Emision	NO		Formato 6,3 Decimal
18	16	2	213	214	<u>A</u>		Modalidad Emision		Si		
19	17	2	215	216	<u>A</u>		Modalidad	Modalidad de Reinversion	Si		Even MAD view
20	18	1/	217	233	N		Completo Cup-	Valor nominal del título	5i Gi	Completo Cupon principal	Formato 14,2 Decimal
22	20	20	235	254	N	-	Tasa Efectiva	Tasa de Compra del título	NO	Completo, Capon, principal	Eormato 6.3 Decimal
23	21	10	255	264	N		Precio	Precio de Compra	SI		Formato 6,3 Decimal
24	22	10	265	274	Α	-	Tipo Compromiso		SI	REPO + TIPOFV=INT son	
25	23	8	275	282	F	-	Fecha Compromiso		SI		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
26	24	5	283	287	<u>N</u>	-	Dias Compromiso		SI		Formation 0.0 Provincel
28	20	19	200	237	N		Valor Cantacion	Valor de Cantacion para renos	NO	Valor Salida	Formato 6,3 Decimal
29	27	19	317	335	N		Valor Compromiso		SI	Valor Salida	Formato 6.3 Decimal
30	28	15	336	350	A	-	Operación Regreso	Operación de Regreso en Simultaneas	SI		
31	29	12	351	362	A		Tipo Inversion		SI	NEGOCIABLE O VENCIMIENTO O	
32	30	10	363	372	<u>N</u>	-	ContraParte	United Comment	SI		
34	31	3	373	385	-		TipoFu	Tipo Forward	3	DELIVERY & NO DELIVERY	
35	33	18	389	406	N		Spot	N/A: Dejar vacio en carga compromisos normal	NO	Spot	Decimal
36	34	18	407	424	N	-	ValorMercado	N/A: Dejar vacio en carga compromisos normal	NO	•	Decimal
	35	5	425	429	N		Adicional	N/A: Dejar vacio en carga compromisos normal. Para BackOff poner el # del Fracto o cero. En "Carga Inicial" de PYPNOV se usa así:1:Poner el nombre	SOLO BACKOFF Y PVPNOV		
37								gue viene en la columna "Portafolio",	0 <u>.</u>		
38	36	10	430	439	A	•	Trader Orden Communication	N/A: Dejar vacio en carga compromisos normal	NU COLO DACKOES		Char
40	38	10	440	459	A		Sistema	Sistema Origen de la Operación	SOLO BACKOFF		Char
	39	20	460	479	A		Negocio Origen	Operación donde se compró el titulo que se esta vendiendo o	SOLO BACKOFF		Char
41		40	400				Our initial of the second s	viceversa.			Energy (0.0 Daylord
42	40	19	480	938 517	N		Base Comisión	Valor de Comisión pagada Valor Base de la comisión	SOLO BACKOFF		Formato 16.2 Decimal
44	42	19	518	536	N	-	Retefuente	retención en la Fuente	SOLO BACKOFF		Formato 16,2 Decimal
45	43	19	537	555	N		Base Retencion	Base retención en la Fuente	SOLO BACKOFF		Formato 16,2 Decimal
46	44	19	556	574	N	-	Traslado	Retención trasladada	SOLO BACKOFF		Formato 16,2 Decimal
47	45	19	575	593	<u>N</u>	<u> </u>	Base Traslado	Base retención trasladada	SOLU BACKOFF		Formato 16,2 Decimal
40	46	4	599	598	A			TIPO INTERNAZISKU SUCIEVU SUCI	SOLUTILIQ		
50	48	20	599	618	Ä		NROID	IDENTIFICACIÓN DEL CLIENTE	SOLO FLIQ		
51	49	60	619	678	A	-	NOMBRE	NOMBRE DEL CLIENTE	SOLO RLIQ		
52	50 E1	20	679	698			PUC	CUENTA INVERSION	SOLO RLIQ		
33	52	10	700	709	-		FINALIDAD	ESPECULA,COBVAL,COBFLU,COBACT,DONACION,O			
54	50		710	710			COMPENSACION	BLIGADA,NA			
56	54	4	710	716	A .		PAGO	TRA CHE FEE			
57	55	4	717	720	N		CODMUNPVP	CODIGO DE MUNICIPIOS SEGÚN TABLA			
58	56	10	721	730	A		DCL CAMBIO	NRO DECLARACION DE CAMBIO SEGÚN FORMULARIO			
59	57	10	731	740	A		NRAL CAMBIARIO	NRAL CAMBIARIO			
60	58	1	741	741	A		CAL CREDITICIO	CAL RIEGO CREDITO INVERSIONISTA			
01		4	742	(40			F MID	MARGEN QUE DESEA UTILIZAR PARA VALORAR A TIR SI			
62	60	10	746	755	N		MARGEN INICIAL	EL TITULO ESTA AL VENCIMENTO			
63	61	10	756	765	A		ESTADO	ESTADU DEL TITULO: NORMAL(SIN RESTRICCION), GARLIQ(GARANTIZANDO OPERLIQ), GARCOR(VENDIDO EN CORTO), GARCRC(DADO EN GARNATIA A LA CRC)			


Inversiones para mantener hasta el Vencimiento - Margen Inicial

Sobre el tema referido hemos agregado a PWPREI la opción de carga de márgenes iníciales para títulos al vencimiento y la funcionalidad de deducirlos. Se describe el funcionamiento a continuación.

- 1. En el formato de "Compromisos" PWPREI puede adicionar el "Margen Inicial" en la columna 60. (Ver Formatos de Carga PWPREI FormatosTodasEntrada.xls – Hoja Compromisos(D))
- 2 Al Valorar el sistema procederá:
- 3. Si se ha cargado el margen inicial, se valora con ese margen más la tasa de referencia del día, haciendo la respectiva conversión.
- 4. Si no se ha cargado:
 - a. Primario:
 - i Si es primario se define con el campo "Mercado", por defecto es Secundario.
 - i Con la tasa efectiva de compra + la Tasa de Referencia de esa fecha se define el margen.
 - Valora siempre con la tasa de referencia del día + ese margen.
 - b. Compra en secundario y se clasifica de una vez al vencimiento. Se queda con el margen propio. Se Define esto mirando cómo estaba ayer:
 - i Con la tasa efectiva de compra + la Tasa de Referencia de esa fecha se define el margen.
 - i. Valora siempre con la tasa de referencia del día + ese margen.
 - c Cuando viene a mercado y se reclasifica al vencimiento. Se define el margen como el último con que valoró a mercado se define:
 - i Se toma la TasaVal de ayer y con esa define el margen.
 - i. Valora siempre con la tasa de referencia del día + ese margen.

8.2.3.1. NOTAS OPERATIVAS CARGA PORTAFOLIOS DESDE ARCHIVO 351 EXCEL

Para alimentar sus portafolios desde el archivo 351, trasformado en un Excel, proceda como se indica a continuación.

1. Consideraciones Generales:



- a. Formato del archivo. El 351 debe estar en formato Excel con encabezado según la estructura SFC y con un registro por cada posición a alimentar en sus portafolios.
- b. Solo se admite lo que corresponde estrictamente al 351; es decir el sistema supone que todo lo incluido en ese archivo es de ese formato y no del 397.
- c. Para agilizar la carga por favor vacíe el .xls a un .csv, este último formato es de lectura mucho mas rápida.
- 2. Parámetros. Los siguientes parámetros deben ser establecidos:
 - a. Parámetros Portafolio. Para que el sistema pueda determinar el portafolio al que deben vaciarse las operaciones, establezca los parámetros como indica en el archivo "Formatos Todas Entrada" en la hoja "ParPorta351EXCEL".
 - b. Ruta Periodos. Para poder alimentar por periodos deberá establecer en el parámetro general 8122 la ruta donde están ubicado los archivos. Para puede ir "Definición de Parámetros PWPREI SetParGen" y ubicar en la lista el número 8122 y modificar el valor a la ruta deseada.
 - c. Nombre para Periodos. Para procesar periodos debe guardar los archivos con el nombre de la forma "Faaammdd" donde la F es fija y aaaa, mm y dd corresponden al año, mes y día, respectivamente, de corte del archivo.
- 3. Carga.
 - a. Un archivo. Para cargar un archivo proceda:
 - i. Ingrese a Portafolios y Riesgo.
 - ii. Seleccione al pestaña "Carga y Contratos" o "Carga", según su versión del sistema.
 - iii. Use la opción "Compromisos"
 - iv. Pulse el Check "Desde 351 Excel"
 - v. Seleccione el archivo a cargar
 - vi. Pulse Aceptar:



PORTAFOLI	LIOS Y RIESGO	
Archivo Méto	todos Políticas Contratos SWAP	
Compromisos	or Organizar PORTAFOLIO 10/08/2018 Usar Lista Selecci PORTAFOLIO Onther I Additions C por Linea Tpo Tpo	onada 🏳 Seleccionar Todo
Contratos SWAP Contratos ARIR Admon. Garantías Proveedor Externo	Por Too Por Too Por Portafolo Troos Troos	Esde F351/ X Periodo Desde 331Excel Image: Incluir Consolidador Image: Incluir Portals en Zeros dsd Tass Nominal Cantidad
Métodos Consultar VeR POSPRO VeR FONDO VeR Reservas Salir	C Exportar Services I Errores Aceptar	Cerar

- b. Por Periodos. Para alimentar un periodo proceda:
 - i. Siga los pasos anteriores hasta antes de pulsar Aceptar y sin necesidad de seleccionar un archivo.
 - ii. Pulse en "X Periodo"
 - iii. Selecciones la Fecha Inicial (arriba)
 - iv. Seleccione al Fecha Final (abajo)
 - v. Pulse Aceptar.

Archivo Métode	os Políticas Contratos SWAP	
Carga y Contratos		
Comparements SWAP Contratos Contratos Admon. Garantias Garantias	Organizar Por Grupo Por Linea Por Tibo Por Portafolio TODOS P - CLIENTES	Nombre V Carryos 10/08/2018 PORTAFOLIO 10/08/2018 PORTAFOLIO PORTAFOLIO Cargue Automático PORTAFOLIO Activio: Portafolio Portafolio: PORTAFOLIO Partafolio: Portafolio: Portafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: Partafolio: Portafolio: <td< th=""></td<>
Métodos Consultar VeR POSPRO VeR FONDO VeR Reservas Safr	1	Exportar Vista Second Cerrar

4. Nota. Tenga en cuenta que con la opción "Periodo" el sistema no hace control carga, aunque la tenga habilitada, por lo que el proceso es muy pesado. Dado lo anterior, al



final del proceso se recomienda exportar los errores a Excel y revisarlos en los archivos de cada fecha (La lista de errores para cada archivo está encabezada por el nombre del archivo a que corresponden)

8.2.4. PROVEEDOR EXTERNO

	;			
Fecha Carga	101/2009 ▼			
	L Errores	Aceptar	Cerrar	

Opción que permite cargar información de mercado, necesaria para alimentar el sistema.

8.2.4.1. CONTRATOS DE ARRENDAMIENTO

A continuación se describen las funcionalidades PWPREI para administrar contratos de arrendamiento.

- 12. **Contrato de Arrendamiento**. El contrato de arrendamiento se define como un activo cuyo valor está determinado por el conjunto de flujos futuros pactados.
- 13. **Pantalla de Administración**. Para acceder a las funciones de administración de sus contratos ingrese por "Portafolios y Riesgo Carga ContratosARR". Le aparece la siguiente pantalla:



Carga	🖪 Contratos de Arrenda	miento										
1	Pa 🕼 🗗 💭 🌒	🔉 🔁 🚾 📢 🛛 🗹 Fec	. Registro 21	/05/2016 💌								
	FechaRegistro Portafoli	NumNegocio	FechaCompra	CantidadCon	ValorCompraCon	TasaCon	Fechalnicial	FechaFinal	□ Selecc	ionar Todo)	
Compromisos	21/05/2016 YY	YYZ12980	21/04/2016	240,000,000		0 16	21/04/2016	21/04/20				^
17 M	21/05/2016 YY	YYZ12981	21/04/2016	100,000,000		0 18	21/04/2016	21/11/20				
	21/05/2016 YY	YYZ12982	21/04/2016	200,000,000		0 17.80	21/05/2016	21/01/20				
Contratos	21/05/2016 YY	YYZ12983	21/04/2016	300,000,000		0 17.60	21/05/2016	21/03/20				
SWAP	21/05/2016 YY	YYZ12984	21/04/2016	400,000,000		0 17.40	21/05/2016	21/05/20				
8-3	21/05/2016 YY	YYZ12985	21/04/2016	500,000,000		0 17.20	21/05/2016	21/07/20				
<u> 1</u>	21/05/2016 YY	YYZ12986	21/04/2016	600,000,000		0 17	21/05/2016	21/09/20				
Contratos	21/05/2016 YY	YYZ12987	21/04/2016	/00,000,000		0 16.80	21/05/2016	21/11/20				
AHH	21/05/2016 YY	11212988	21/04/2016	800,000,000		0 16.60	21/05/2016	21/01/20				
	21/05/2016 11	11212989	21/04/2016	1,000,000,000		0 16.40	21/05/2016	21/03/20				
-40-	21/05/2016 11	VV713991	21/04/2016	1 100 000 000		0 16.20	21/05/2016	21/05/20				
	21/05/2016 11	VYZ12992	21/04/2016	1,200,000,000		15 80	21/05/2016	21/09/20				
Admon.	21/03/2010 11	11212002	21/04/2010	1,200,000,000		0 15.00	21703/2010	21/00/20				•
Garantías									-	1	🔲 Incluir Cons	olidador
_ عاد									_	-	Incluit Porta	folios en Zeros
স্ক												IONOS ON LOIDS
Proveedor												
Externo	<							>	Modalidar	Tasa No	minal Da	ntidad
	Registro(s) 13								<u> </u>			
	1											
Métodos												
Concultar												
Ven POSPRU												
VeR FUNDU												
VeR Reservas		<										>
Salir		, _										

En la pantalla se destaca:

- La Fecha de Registro: Corresponde a la fecha activa de portafolios.
- Iconos de Carga:
 - El **Verde** es para cargar Tablas de Flujo, en forma masiva, asociadas a contratos previamente creados.
 - El **Azul** sirve para cargar contratos, en forma masiva.
- La grilla contiene:
 - La lista de contratos a la fecha.
 - La lista de contratos consultados.
 - La lista de contratos, inmediatamente después de una carga masiva.
- Botones:
 - Ingresar Contratos.
 - Modificar Contratos.
 - Eliminar Contratos.
 - Consultar Contratos.
 - Detalle de un Contrato. Este botón activa las funciones secundarias sobre los contratos, que se describen más adelante.
 - Cargar Tablas.
 - Cargar Contratos.
 - Exportar la lista en pantalla.
 - o Salir.
- 14. **Funciones Secundarias**. Una vez registrado un contrato, puede usar el botón "Detalle" para verlo. Se activarán las funciones secundarias, como se ve en la pantalla:



🖏 Contratos de Arrendamiento					
Ng 🕼 🚰 💭 🗶 🧇 🕑 🛛	🗴 📢 🛛 🔽 Fec. I	Registro 21/05/	2016 💌		
FechaRegistro Portafolio 21/05/2016 YY	NumNegocio F	echaCompra Car 21/04/2016	ntidadCon 240.000.000	ValorCompraCon	TasaCon Fecha
🔄. Contratos ARR - Detalle					
Consulta: 💿 Contratos 🔿 🤆	Tablas DATOS DE	L CONTRATO	ADQUIRIDO		
Fec. Registrc Portafolio 21/05/2016 ✓ Valor Contrato Tasa Contr. 0.0 17.2 Curva Incr. Tasa Mora ✓ 24.8	Cha Inicial Fecha Fi 1/05/2016 21/07/2 Ido Cantidad Valo 00,000,000.0 0.0	Nro. Contrato YYZ12985 nal Modalidad 2021 V MV Son Xa Saldo Tasa 17.2	Fecha Co 21/04/20 d Tasa Ref. Incr. IPC V Xa Saldo	mpra Cantidad 16 V 500,000, Spread Incr. Mes In 0.0 5 Tipo Tabla FLUJOS V	Adquirida ,000.0 ncr. DíaIncr. 21 Punta COMPRA
DATOS Cantidad Total Contrato Fac. Fecha 500,000,000.0 21/04/20 Id Arrendador/Emisor ACCINEGOCIOS LTDA::86045 Id Tercero/Lontraparte PwP:900338073-4	FACIALES Inicial Fac. Fecha Final 16 21/04/2018 1 Id Arrendatario/Pagador/0 PWP:900338073-4	Tipo Derecho ECONOMICO	Fec. Vigencia Tat 21/05/2016 VII: Nuevo Canon 0.0 Nvo Canon desde 21/06/2016 VIII: Nva Tabla	b. Fecha Pago 21/05/2016 7alor Pago 0.0 • Final • Cancelar	Tasa Pago 17.2 Lantidad Pago 0.0 Linicio Baiar Vir
Crear Compra	Acep	tar 🔀 Cerrar	[Ver Tabla	argar Tabla

Las funciones secundarias:

- a. Nva Tabla. Este botón permite generar una nueva tabla de flujos, o la primera, para el contrato, a la fecha de registro activa. Dentro del recuadro verde se debe indicar:
 - i. Vlr. Nuevo Canon. Canon para crear los flujos.
 - ii. Nvo Canon desde. Fecha a partir de la cual aplica el nuevo canon. Esta fecha no puede ser la de registro activa, pues ese canon ya pasó. Si para alcanzar el valor del contrato se deben llevar los flujos más allá de la fecha final del contrato se solicita un canon mayor. Lo contrario simplemente hace que los flujos finales sean cero.
 - iii. Si es la primera tabla del contrato esta se generará con vigencia desde la fecha inicial del contrato.
- b. Ver Tabla. Una vez el contrato tiene una tabla de flujos registrada, puede consultarla con el botón Ver Tabla.
- c. Cargar Tabla. También puede cargar una tabla de flujos para el contrato desde un Excel, si lo desea.
- d. Crear Compra. Una vez registrado el contrato y registrada la tabla de flujos, puede utilizar este botón para lanzar la operación de compra del contrato. El



sistema calcula los valores presentes a partir de la tasa del contrato y la tabla de flujos vigente. Se le presenta la pantalla para confirmar:

٩.	PORTAFOLIOS Y RIESGO		
Arc	🖪 Contratos ARR - De	📴 Renta Fija	
	Consulta: © Contr Fec. Registro Port	Tipo de Operación	
Co	21/05/2016 V Valor Contrato Tas 206,337.758.93 16.1 Curva Incr. Tas	Dates Compreniso No. Negocio No. de Orden Porta/olio Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Postoión Nro. Negocio Nro. de Orden Porta/olio [21/05/2016 ** [21/04/2016 ** [21/04/2016 ** [COMPRA ** [W213006 [W213006 [W213006 [W213006 W * Emicor Emicor Erepecie Emicor Emicor Foro Prov Emicor Foro Prov Emicor Foro Prov Emicor Foro Prov Emicor Emicor Emicor Foro Prov Emicor Emicor <t< th=""><th>☐ Seleccionar Todo</th></t<>	☐ Seleccionar Todo
C F	Canidad Total Contrato 240,000,000.0 Id Anerdador/Emisor ACCINEGOCIOS LTDA. Id Tercero/Contrapate PWP:900380734	Datos Fecales FisiLidi + 0 Necedicidad Envision Emisión 21/04/2016 + 21/04/2018 - 0.000 COMPLETO + Mension Telenticin Cantidad Valoradin Telenticin Telenticin Telenticin 21/04/2016 + 21/04/2018 - 0.000 COMPLETO + Mension Mension Telenticin Telenticin Cantidad Valoradin Comisión 20.000.000.0 20.8337.758.93 Telenticin Modalidad Reirv. [20.000.000.00 208.537.758.93 Teaber Adcional Modalidad Reirv. [0.00 [0.00 Context on teaber of teabero of teabero of teaber of teaber of teabero of teaber of teabero	▼ ☐ Incluir Consolidador ☐ Incluir Portafolios en Zeros Modaldad Tesa Nominel Cantidad
	Métodos (b)	Mercado Finaldad Compensación Forma de Pago ESPECULA Cal Crediticio Inv. A NA Cal Crediticio Inv. A NA Cal Crediticio Inv. A Centar Calcular Calcular Calcular Calcular Calcular Calcular	
Ve Ve	Consultar R POSPRO eR FONDO R Reservas Salir	<	>

Los datos en verde pueden ser cambiados.

- e. Prepagos. La función Prepago le permite descontar una parte del contrato a una tasa:
 - i. Descontar los flujos finales del contrato.
 - ii. Descontar los flujos iniciales, restantes, del contrato.
 - iii. Descontar cuotas iguales del contrato, bajando cada cuota restante en el mismo valor.
 - iv. Indicar la tasa de descuento.
 - v. El sistema genera una venta de los flujos a cancelar.
 - vi. Se presenta la pantalla:



🖏 Contratos ARR - Detalle
Consulta: C Contratos C Tablas DATOS DEL CONTRATO ADQUIRIDO
Fec. Registro Portafolio Nro. Contrato Fecha Compra Cantidad Adquirida 21/05/2016 YY YZ13009 21/05/2016 300,000,000.0
Valor Contrato Tasa Contr. Fecha Inicial Fecha Final Modalidad Tasa Ref. Incr. Spread Incr. Mes Incr. Día Incr. 244,892,109.9 17.6 21/05/2016 21/03/2019 MV IPC 0.0 5 21
Curva Incr. Tasa Mora Saldo Cantidad Valor Xa Saldo Tasa Xa Saldo Tipo Tabla Punta v 26.4 300,000,000.0 244,892,109.9 17.6 FLUJOS COMPRA
DATOS FACIALES Cantidad Total Contrato Sa00,000,000.0 21/04/2016 21/04/2016 21/04/2016 21/04/2016 21/04/2016 21/04/2016 21/05/2016
Crear Compra

Registre los datos del prepago:

- Tasa Prepago. Tasa para descontar los flujos.
- Valor Prepago. Valor del prepago.
- \circ $\,$ Final o Inicio:
 - Final. Se descontarán los flujos finales del contrato
 - Inicial. Se descontarán los flujos iniciales, restantes, del contrato
- Cancelar o Bajar VIr.:
 - Cancelar. Se toman flujos completos para cancelar.
 - Bajar. El prepago se divide en valores futuros iguales y estos se descuentan de las cuotas del contrato.
- Cuando pulse en el Botón PrePago le aparecerá la tabla de flujos del contrato como va a quedar después del prepago:



	PORTAFOLIOS Y RIESGO						_ F
Arc	Contratos ARR - Detalle						
Carg		NUBIDO					
	Fao Benjetra E. Bertafalia	Facha Comora Co	antidad Adox úrida				
		23/06/2017 - 4	69.901.743.92	Eechalpicial	FeehaFinal	cionar Todo	
Co	Valor Contrato Tasa Contr. Fecha Inicial Fecha Enal Modalidad	Tasa Bef Incr. Spread Incr.	Mesince Dialoce	12.50 23/06/2	23/06/20		^
	370.864.781.34 12.5 23/06/2017 V 23/06/2021 V MV V	IPC V D.O	6 23				
	Curva Incr. Tasa Mora Saldo Cantidad Valor Xa Saldo Tasa Xa	Saldo Tino Tabla	Punta				
9	FS v 0.0 469,901,743.92 370,864,781.34 12.5	FLUJOS	- COMPRA				
		ļ					
	DATOS FACIALES	ac Vigencia Tab Eecha Pa	ann Tasa Pann				
C	Castidad Tatal Contrate, East Easter Inicial East Easter Einal, Tine Deventer	7/06/2017 - 27/06/2	2017 - 12.5				
		r. Nuevo Canon Valor Pao	go Cantidad Pago				
	Id årrendador/Emisor	.0 10,000,0	0.0 0.000				
	AEV:8909316099 V BCO. DE OCCIDENTE:890300 V	vo Canon desde:	Par Table de Flaire del contest	CUIDEAE/DOCT DD	EDVICON		
- 4	Id Tercero/Contraparte	7/07/2017 💌	CashaVisanain NewNeessin	LEIISO45(POST=PR	EPAGO)	Casha Raille	
	PWP:123 -	• Ci	27/06/2017 CLI13645	V V	n Lanon 1 0	23/06/2017 459.713.252.5	7
	·	Nya Tabla	27/06/2017 CLI13645	V	2 9,713,252.57	23/09/2017 450,000,00	JO OS
P			27/06/2017 CLI13645	V	3 10,000,000	23/10/2017 440,000,00	0
	~		27/06/2017 CLI13645	V	4 10,000,000	23/11/2017 430,000,00	
	Aceptar Cerrar	Ver Tabla	27/06/2017 CLI13645	v	6 10.000.000	23/01/2018 410.000.00	
	Crear Compra		27/06/2017 CLI13645	V	7 10,000,000	23/02/2018 400,000,00	10
			27/06/2017 CLI13645	V	8 10,000,000	23/03/2018 390,000,00	10
			27/06/2017 CLI13645	V	9 10,000,000	23/04/2018 380,000,00	10
			27/06/2017 CL113645 27/06/2017 CL113645	V	10 10,000,000	23/05/2018 3/0,000,00	10
			27/06/2017 CU13645	v	12 10,000,000	23/07/2018 350.000.00	10
k	Méladas		27/06/2017 CLI13645	V	13 10,000,000	23/08/2018 340,000,00	10
	metodos		27/06/2017 CLI13645	V	14 10,000,000	23/09/2018 330,000,00	10
C	Consultar		27/06/2017 CLI13645	V	15 10,000,000	23/10/2018 320,000,00	JO 🗸 🗸
VeF	R POSPRO						
Vel	RFONDO			~ .	rportar 🔽 Carror	Confirmar PrePago	
VeF	B Beservas					Communities age	
_	<						
		L					

Pulse en Confirmar PrePago si desea dejarlo en firme, en otro caso pulse cerrar.

- 15. Informe Valoración. Al valorar sus portafolios los contratos serán enviados a la hoja "DCC_DCE".
- 16. **Operatividad**. El resto de la operatividad del contrato es transparente para el usuario: el registro de las operaciones, la valoración, formatos, etc., operan como otras operaciones.

17. Contabilidad:

- a. **Operación normal**. Utilice los indicadores corrientes para establecer los parámetros para este tipo de contratos, el sistema los reconoce como tales y realiza los asientos indicados.
- b. **Casos Especiales**. Para los temas particulares que pueden ocurrir en un contrato proceda:
 - i. **Prepagos**. Para los prepagos establezca los parámetros normales correspondientes a una venta, dado que un prepago es equivalente a vender parte de un título cualquiera.
 - ii. Moras. Los intereses de mora no se causan, solo se acumulan hasta que ocurra el respectivo pago. Por lo anterior solo debe establecer parámetros para los intereses de mora en el evento RECAUDO, con el valor fuente INTMORA, que se asentarán al recibir el pago junto con el recaudo de la cuota o capital pagado.
 - iii. Provisiones. Para cuando un derecho, en este caso contrato, sea enviado a provisión, debe establecer los parámetros en los siguientes eventos:



- PROVISION+. Este evento se lanzará al valor al cierre y debe indicar los movimientos para mover la provisión causada en el día para un título enviado a provisión por mora. El valor fuente que debe utilizar es PROVISION+
- PROVISION-. Este evento también se lanza al valorar al cierre y debe indicar los movimientos a realizar para llevar al cierre la provisión de un título para el que manualmente se indicado "Sacar de provisión" aunque no se haya realizado el pago. El valor fuente que debe utilizar es PROVISION-
- 3. **RECAUDO**. En este evento, acerca de la provisión, debe indicar los movimientos a realizar para matar la provisión acumulada cuando ocurre el pago del saldo en mora. Note que difiere del anterior en que para este caso se trata de la ocurrencia del pago; por tanto ocurre en el recaudo. El evento que debe indicar es **RECAUDO** y el valor fuente **PROVISION-**
- 18. **Cumplimientos**. Tenga en cuenta que las cuotas del contrato generan vencimientos, como si fuesen cupones de un título.

8.3. OPCIÓN CONSULTAR



8.3.1. MEDICION

De acuerdo a la fecha dada el sistema muestra de manera detallada las mediciones que se han realizado durante ese día.





Después de seleccionar la fecha debe dar Aceptar y a continuación aparece la siguiente pantalla

🖉 Mediciones											X
Fecha Medic Nivel Medic	Fecha Regi:	Metodo	Usuario	TipoMedicio	Monto Total	Monto Total	Tasa Prome	Monto Comp	VaR Total	Rel. Solv	
06/01/2009 CLIENTES	06/01/2009	DM	PWPREI	NO	0	0	0	0	16.70105397		
06/01/2009 CLIENTES	06/01/2009	DN	PWPREI	NO	0	0	0	0	-6.19478635		
06/01/2009 CLIENTES	06/01/2009	ME	PWPREI	NO	0	0	0	0	i.825705286		
06/01/2009 CLIENTES	06/01/2009	SH	PWPREI	NO	0	0	0	0	16.12100002		
Kaliciones realiz	adas el día l	1670172009								>	
incultiones realize		5070172005									
								Acep	otae 🗵 (Cerrar	

Debe de dar Aceptar para ver los resultados.

🖑 Resultados VeR Súper Valores				
Exportar a Excel Cerrar				
MEDICIÓN		۱	OTALES	
No. of Marchard and an annual		Monto Total Compra	\$ 0.0	
Nivel Medicion GRUPO		Monto Total Valorado	\$ 0.0	
Nombre CLIENTES				
Método DURACIÓN MODIFI		Monto Compromisos	\$00	
Tipo Medición MÉTODO ANÁLISIS		VaB Total	¢ 4 224 E00 7010E4	
		Pol Columnia	\$ 4,224,306.701034	
		nei, soivencia	%.0	
	DETALLE DE LA MEDICIÓN			
T.Comprom. Punta Posicion Especie	F.Compra F.Vence Cantidad	%T.Compra	%P. Compra \$Val. Compra	
NINGUNO COMPRA LARGA TFIP06120210	01/11/2006 2/02/2010 7,00	0,000.00 9.500	74.240 5,196,	<u>z</u>
NINGUNU COMPRA LARGA TEP105120210	18/03/2007/26/04/2012	0,000.00 9.300	75.634 1,286, 64.246 963	<u>/</u>
NINGUNO COMPRA LARGA TFIP10260412	1/01/2008 26/04/2012 3,50	0,000.00 9.506	67.748 2,371,	<u> </u>
NINGUNO COMPRA LARGA TFIP10250112	5/05/2008 25/01/2012 10,90	00,000.00 11.535	66.780 7,279,	ō
NINGUNO COMPRA LARGA TFIP05100709	9/06/2008 0/07/2009 3,40	0,000.00 10.500	89.979 3,059,	2
NINGUNU CUMPHA LARGA TEIP05100709	2,5/05/2008 0/07/2009 2,60		89.983 2,339, 90.216 4.420	5
NINGUNO COMPRA LARGA CDTLPPSOV	23/07/2008 0/02/2009 1,00	01,952.00 11.622	99.396 995,	<u> </u>
<	to an			
,				



Esta información se puede exportar dando clic en el Botón exportar a Excel

8.3.2. INFORME SUPERVALORES

Esta opción permite que dando una fecha determinada, se pueda consultar el informe correspondiente a la Supervalores, el informe puede ser exportado a Excel o se puede generar un archivo plano.



8.3.3. VER INVERSIONES

De acuerdo a la fecha seleccionada, se pueden ver las inversiones que tenían en ese momento





Organizar	PORTAFOLIC)						
 Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio 	Nombre PROFESION Tipo GEN Linea de Neg PWPCLI	NALES	iciarios	YY S.A. 				
CLIENTES	INVERSIONES							
	Punta	Especie	Número	Fec Emisión	Fec Vencimient T. Cor 🔨			
	COMPRA	BPEMINHTA4	10	15/05/2008	04/12/2009 NINGL			
	COMPRA	CDTBB010D	1	03/12/2008	03/06/2010 NINGL			
	COMPRA	CDTBB010D	2	03/12/2008	03/06/2010 NINGL			
	COMPRA	CDTBGA10D	7	09/05/2008	09/11/2009 NINGL			
	COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008 OPCF1			
	COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008 OPCF1			
	COMPRA COMPRA	OPCFTRM OPCFTRM	0	05/12/2008 05/12/2008	05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1			
	COMPRA COMPRA COMPRA	OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM	0 0 0	05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008	05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1			
	COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA	OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM	0 0 0 0	05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008	05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1			
	COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA	OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM	0 0 0 0 0	05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008	05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1 05/12/2008 0PCF1			
	COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA VENTA	OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM OPCFTRM	0 0 0 0 0 0 0	05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008 05/12/2008	05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1 05/12/2008 OPCF1			

8.4. OPCIÓN VeR POSPRO



Para operar los derivados en PWPREI se requiere:

1 Para los derivados en pesos:

- a. Cree un título de código "DTT".
- b. Cree cada especie de este tipo de derivados como de renta fija, a tasa fija, moneda="COP", Titulo="DTT", Fecha de Vencimiento=Vencimiento del Contrato, Calculo="Descuento Tasa" y Caja="Descuento Tasa"
- 2. Para los derivados en TRM:
 - a. Cree un título de código "DDV".



- b. Cree cada especie de este tipo de derivados como de Divisas, moneda="TRM", Titulo="DDV", Fecha de Vencimiento=Vencimiento del Contrato. El dato Fecha Vencimiento le aparecerá en el espacio donde normalmente va "Fecha Fiscal"
- c NOTA: Para Derivados SHORT(Mínimos) de TRM, cree un título de código "DDS" que se utilizará para parametrizar el valor del contrato en 5.000 dólares en lugar de los 50.000 de los derivados normales.
- d. Para Derivados OTC inscrito en la CCRC, que usted valore con precio de la cámara como si fuese un futuro, cree el título **DMO**. Luego cree una especie asignándole ese título y registra la operación como si fueses un futuro. E sistema tomará las unidades en la moneda (TRM) de negocio * precio * 1 y eso le dará el valor del derivado.

3. Para los derivados en Acciones:

- a. Cree un título de código "DAC".
- b. Cree cada especie de este tipo de derivados como de Acciones, moneda="COP", Titulo="DAC", Fecha de Vencimiento=Vencimiento del Contrato. El dato Fecha Vencimiento le aparecerá en el espacio donde normalmente va "Fecha Fiscal"

4. Derivados de Tasa de Interés:

- 1. General. Para sus derivado de tasa de interés, general, proceda:
 - Cree un título de código "DTA", Nombre = "Derivados Tasa de Interés".
 - ii. Cree cada especie de este tipo de derivados como de renta fija, a tasa fija, moneda="COP", Titulo="DTA", Fecha de Vencimiento=Vencimiento del Contrato, Calculo="Descuento Tasa" y Caja="Descuento Tasa".
- 2. OIS. Para sus derivados OIS, proceda:
 - i. Cree un título de código "OIS", Nombre = "Derivados Tasa OIS".
 - ii. Especies. Debe tener en cuenta que negociará en bolsa con un nemotécnico y cumplirá en cámara con otro. Infovalmer le publica los precios con el nemotécnico de la BVC. Manejar el nemo de cámara en sus operaciones implica la creación de muchísimas especies, por los vencimientos que se van abriendo cada día. Para facilitar sus procesos en PWPREI, el



sistema convierte el nemo de cámara al genérico de la BVC al cargar la Información, distinguiendo las especies por su vencimiento. Proceda:

- Cree cada especie con el nemo genérico de la BVC, como de renta fija, a tasa fija, moneda="COP", Titulo="OIS", deje abierta la fecha de Vencimiento(quite el chulo) del Contrato, Calculo="Descuento Tasa" y Caja="Descuento Tasa".
- 2. Cuando cargue los precios de los derivados no tiene que hacer nada especial, el sistema hará la conversión del nemo cámara a la especie BVC.
- 3. Al valorar el sistema recabará el precio del vencimiento correspondiente a su operación.
- iii. Tamaño del contrato. Si el tamaño del contrato no está debidamente registrado solicite a tecnología que ejecute el script correspondiente (Póngase en contacto con nosotros si tiene algún inconveniente)

5. Proceso Diario.

- a. Cargue las canastas que publica la BVC. Recuerde que antes debe haber creado las especies de derivados.
- b. Cada día cargue los precios de derivados que publica la BVC.
- c Cargue en su portafolio las posiciones de estas especies de forma normal como cualquier otra especie. Se ingresan con:
 - TipoCompromiso="FORWARD" para los TES y Tasa de Interés; y "FORWDIVISA" para los de Divisas y Acciones,
 - TipoFw (Tipo Forward)="FWF"
 - Fecha de Compromiso=Fecha de Vencimiento del contrato,
 - TipoInversión="NEGOCIABLE",
 - Cantidad=No de contratos adquiridos o vendidos,
 - Valor Compromiso = Valor en pesos del negocio a precio de Compra y/o
 - PrecioCompromiso=Precio pactado en el contrato. Solo debe indicar uno de los dos: ValorCompromiso o Precio.
- d. Valorice y Genere sus informes de manera normal. Al valorar los futuros OIS el sistema procederá:
 - Si su operación está cargada con el nemo más genérico de la BVC, para el cual el precio publicado es una tasa, el sistema hará el cálculo del precio a partir de esa tasa, aplicando la fórmula de precio trasformado para el



plazo correspondiente a los días al vencimiento del contrato.

- Si su operación está cargada con el nemo genérico pero corresponde al año del vencimiento del contrato, el sistema leerá el precio directamente que corresponde a ese nemo.
- e. Comuníquese con nosotros para cualquier inquietud.

6. Riesgo de Mercado.

a. Modelo Oficial.

En el modelo oficial de la SFC, estás posiciones se tratan según lo establecido en la norma. En términos generales, cada posición en futuros se descompone en dos posiciones nocionales determinadas según el tipo de subyacente del futuro. Para mayor información remítase por favor al numeral 2.1.1 del anexo 1 del capítulo 21 de la circular básica contable. Una vez determinadas las posiciones nocionales estas se ubican en las subcuentas establecidas para el efecto; así por ejemplo, una posición "LARGA" en un futuro de TES se ubicará en la subcuenta 135 de la unidad de captura 1 del formato 381.

El procedimiento de generación de los informes no sufre alteración.

b. Modelos Internos PWPREI.

En nuestros modelos internos estas posiciones tienen el tratamiento normal; es decir, PWPREI recaba un conjunto de precios históricos para cada posición y acto seguido determina las variaciones diarias correspondientes con objeto de evaluar el valor en riesgo, haciendo las consideraciones especiales cuando no existe suficiente información:

- Futuros en títulos. PWPREI procede a determinar el Ship Delivery de la muestra y tomar el precio de este.
- Futuros en Divisas. PWPREI toma el valor de la moneda como precio del día.
- Futuros en Acciones. PWPREI busca el precio de la acción subyacente.

En cualquier caso PWPREI requerirá que para la fecha de medición exista información del propio derivado.

En todos los casos donde no se pueda obtener información histórica suficiente para el activo primario, PWPREI buscará información del activo asociado, si existe, para determinar el dato histórico.



8.4.1. GENERAR VeR POSPRO

Al dar clic en el Botón Generar parece la siguiente pantalla donde se debe la fecha de Precios y de Medición, al presionar el Botón Aceptar el proceso se termina

🗳 Generar Formatos 🛛 🔀	
Fecha Precios 05/01/2009 💌	PWPREI
Fecha Medición J05/01/2009 💌	Proceso terminado con éxito
Aceptar 🛛 Cerrar	Aceptar

8.4.2. CONSULTAR VeR POSPRO

Consultar Formatos	
Fecha Regsitro 12/01/2009 💌	
Consultar 😥 Exportar Excel	Certar

Los Formatos consultados pueden ser exportados a Excel.



8.4.3. FORMATOS

🖥 Formatos 🛛 🔯
Datos Básicos
Fec de Medición 11/2009
Tipo Entidad
Código Entidad
Clave
Aceptar 🔀 Cerrar

8.4.4. INFORME FORMATOS

🖻 Form1 🛛 🔀		
Fecha Medición 🔟 /01/2009 💌		
 381- Riesgo de Tasa de Interés 382 - Riesgo Carteras Colectivas 383 - Compen. y R. Total de Tasa de Interés 384 - Riesgo de Precio de Acciones 385 - Riesgo de Tasa de Cambio 386 - Valor en Riesgo por Módulos 		
Código Fondo		
Aceptar 🛛 Cerrar		

8.5. OPCIÓN VeR FONDO





8.5.1. CONSULTAR

Consultar Formatos		E
Fecha Regsitro 02/01/2009	•	
Consultar 😥 Exportar Excel		Cerrar

Esta información consultada puede ser exportada a Excel.

8.5.2. GENERAR

Al dar clic en el Botón Generar parece la siguiente pantalla donde se debe la fecha de Precios y de Medición, al presionar el Botón Aceptar el proceso se termina

🚰 Generar Formatos 🛛 🛛 🔀	
Fecha Precios 📴/01/2009 💌 Fecha Medición 06/01/2009 💌	PWPREI
Aceptar Cerrar	Proceso terminado con éxito



8.5.3. FORMATOS

🖥 Formatos 🛛 🔀]
Datos Básicos Fec de Medición 16/01/2009 Tipo Entidad Código Entidad Clave	
Aceptar 🔀 Cerrar	

8.5.4. INFORME DE FORMATOS

🖻 Form1	×	
Fecha Medición 📴/01/2009 💌		
 435-Riesgo de Tasa de Interes DTF e IPC 436-Riesgo de Tasa de Cambio 437-Riesgo de Precio de Acciones 438-VeR Por Factores 439-Riesgo de Participación en Carteras 440-Riesgo de Tasa de Interes M-E M-L y UVR 		
Código Fondo		
Aceptar 🔀 Cerrar		

8.5.5. LIMPIAR FONDOS

Al dar clic en el Botón Limpiar fondos aparece la pantalla donde debe seleccionar la fecha del portafolio y al dar en el Botón Aceptar, los datos se eliminan como muestra la imagen.

	🚽 Fecha Portafolios 🛛 🔀
Portafol	io 🔀
٩	Datos FONDOS borrados. Por favor vuelva a generar todos los FONDOS a la fecha:06/01/2009, antes de usar la opción FORMATOS
	Aceptar



8.5.6. VaR MODELO CARTERAS COLECTIVAS

Esta funcionalidad le permite generar el VaR modelo Carteras Colectivas en un solo paso, en lugar de hacerlo cartera por cartera como hasta ahora lo hacía. Siga los siguientes pasos:

> Ingrese normalmente al módulo Portafolios y Riesgo. En la parte derecha de la ventana tiene ahora un grilla con la lista de sus portafolios, la cual aparece deshabilitada como se ve en la pantalla:

Métodos		
Carga	Organizar	PORTAFOLIO DAVIDUADIA
Consultar	Por Grupo	Nombre Reportivies
VeR POSPRO	C Por Línea	
VeR FONDO	C Por Tipo	Tipo
VeR Reservas	C Por Portafolio	
Salir	TODOS	
		CARLOS +
	■ ELIENTES	
		🗽 🕼 🧗 🛐 🔎 🖛 🔎 🛛 Incluir Consolidador
		Ingresa Modifica Elimina Venta Compra Trasladar Reversa Buscar 🔽 Incluir Portafolios en Zeros
		Punta Especie NDcDv/ISIN Negocio No. Orden No. Fec Emisión Fec Vencimient T. Compromiso Modalidad
	1	

- 2. Pulse la pestaña "VeR FONDO". Inmediatamente se le habilitará la lista de portafolios.
- 3. Pulse la opción "Usar Lista Seleccionada" y seleccione de la lista los portafolios que se deben incluir en el VaR.
- 4. En la parte inferior de esta lista seleccione, o quite la selección, según su necesidad, las opciones "Incluir Consolidador" e "Incluir Portafolios en Zeros".
- 5. La pantalla se verá como la siguiente:



- 6. Una vez seleccionada su lista, simplemente siga los pasos comúnes:
 - a. Pulse "Generar" para que el sistema genere el VaR.
 - b. Pulse "Formatos" para producir los archivos correspondientes.
 - c. Si desea ver los formatos en Excel pulse el botón "Informe Formatos".

8.6. OPCIÓN VeR RESERVAS





8.6.1. GENERAR

Pulse el Botón "Generar". Le aparece la pantalla



Pulse el Botón "Aceptar" y luego de terminar el proceso debe aparecer:



8.6.2. CONSULTAR

Pulse el Botón "Consultar". Le aparece la pantalla, aquí puede exportar la información de acuerdo a la fecha seleccionada



🔄 Consultar For	matos					×
Fecha Regsi	tro 04/07/2012 💌					
Fecha de Registro	TipoCompromiso	Especie	Posicion	FechaEmision	Fechavencimiento Modalio	dad
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024 AV	
04/07/2012	NINGUNO	TFIT16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024 AV	
04/07/2012	NINGUNO	TFIT16240724	LARGA	24/07/2008	24/07/2024 AV	
04/07/2012	NINGUNO	TFIT16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024 AV	
04/07/2012	NINGUNO	TFIT16240724	LARGA	24/07/2008	24/07/2024 AV	
						ŀ
Consultar	Exportar Excel					Cerrar

8.6.3. FORMATOS

Pulse el Botón "Formatos". Le aparece la pantalla, aquí puede generar los archivos planos

6	Formatos - RESERVAS
	Datos Básicos
	Fec de Medición 04/07/2012 💌
	Tipo Entidad
	Código Entidad
	Clave
	Aceptar 🔀 Cerrar

Digite los datos solicitados y pulse "Aceptar". Terminado el proceso le aparece:





Los archivos generados quedan bajo su carpeta PwpRei/RESERVAS.

8.6.4. INFORME FORMATOS

🔄 Form.Excel - RESERVAS
Fecha Medición 04/07/2012 💌
 381- Riesgo de Tasa de Interés 382 - Riesgo Carteras Colectivas 383 - Compen. y R. Total de Tasa de Interés 384 - Riesgo de Precio de Acciones 385 - Riesgo de Tasa de Cambio 386 - Valor en Riesgo por Módulos
Código Fondo
Aceptar 🔀 Cerrar

Exportar formatos a Excel.

ELIMINACION Y RECUPERACION DE OPERACIONES

Para eliminar operaciones en PWPREI cuenta con las siguientes opciones:

- i. Seleccionar una operación en la grilla. Ubíquese en una operación de la lista que aparece en la grilla y pulse el botón "Elimina". El sistema le mostrará esa operación y le pedirá confirmación para eliminarla.
- ii. Doble Click en un portafolio. Pulse doble click sobre el portafolio deseado, en la lista al lado izquierdo de la grilla de operaciones. EL sistema le pedirá confirmación para eliminar todas las operaciones de ese portafolio.
- iii. Por Selección:



- 1. Elija la casilla "Eliminar", que está al frente de la lista de portafolios.
- 2. Luego selecciones "XPortafolio" o "XArchivo" al frente de esta opción e indique el portafolio donde están las operaciones o el archivo fuente que cargó y las contiene.
- 3. Pulse el botón "LlenarLista". En la grilla de la parte superior derecha le aparece la lista de operaciones de ese archivo o portafolio, como se ve en la pantalla:

Métodos		
Carga	Organizar	PORTAFOLIO 2019/20191
Consultar	Por Grupo	Nombre Deserve Carridad TipoCompromist
VeR POSPRO	C. Por Línea	CLI337 2013090CLIMAR1 TFIPI5240720 50000000 NINGUNO
VeR FONDO	C Por Tino	
VeR Reservas	C Por hpo	CLI340 1423 CLIMAR1 CDTBCB90DP 50000000 NINGUNO
Salir		Linea de Negocio
		Elimina:
	CLIMAR1	
	CLIMAR2	
	L W	WYFESTORES
		V Incluir Consolitation
		💦 🔊 🛐 💋 💭 🖓 🖓 🖓 🖓
		Ingresa Modifica Elimina Venta Compra Trasladar Reversa Buscar
		Punta Especie NDcDv/XSIN Negocio No. Orden No. Fee Emissión Fee Vencimient (T. Compromiso Modalidad Taxa Nominal Cantidad

- 4. Seleccione las operaciones que desea eliminar, de esa lista, o utilice la opción "Seleccionar Todo" para chequearlas todas.
- Una vez establecida la selección, pulse el botón "Elimina" de al lado de "Ingresar" y "Modificar". El sistema le pedirá conformación y enseguida eliminará la lista de operaciones que usted haya seleccionado.

Para recuperar operaciones, que por error haya eliminado previamente, proceda:

- i. Elija la casilla "Recuperar", que está al frente de la lista de portafolios.
- ii. Luego selecciones "XPortafolio", "XArchivo" o "Eliminadas Hoy" al frente de esta opción e indique el portafolio donde están las operaciones o el archivo fuente que cargó y las contiene; o elija "XEliminadas Hoy".
- iii. Pulse el botón "LlenarLista". En la grilla de la parte superior derecha le aparece la lista de operaciones de ese archivo, portafolio o las eliminadas en el día, como se ve en la pantalla:



Métodos								
Carga	Organizar	PORTAFOLIO 20/02/2015	T F	Usar List	a Seleccionad	Seleccia	nar Todo	
Consultar	Por Grupo	Nombre Repoliciation		Numblegecie	NumOrden	Portatolio	Especie	Cantidad Tipol 🔺
VeR POSPRO	C. Por Línea		1	CLI309	20130909-108776	CLIMAR1	TFIP15240720	60000000 NINC
VeR FONDO	C Des Tex	Тіро	11		20140808-136694	CLIMAR1 CLIMAR1	CDTBGATO	43000000 NINU 51000000 NINU
VeB Beservas	S Por tipo		1 U	CLI315	1423	CLIMAR1	CDTBCB90DP	50000000 NINC -
C alia	Por Portatolio	Linea de Negocio	1	LI ULI 323	20130909-108776	CLIMAR1	TFIP15240720	60000000 NINC
Jam	E TODOS			CLI324	20140808-136694	CLIMAR1	CDTBGA10	43000000 NINC
		Liste	< I	CU326	20140812-137025	CLIMAR1	CDTRCRMDR	51000000 NINU
	B-B-CLIENTES	Eliminar: • X.Portafio Nombre CLIMAR1			20130909-108776	CLIMAR1	TFIP15240720	60000000 NINC
		Recuperar: O XArchivo Número:	J]	CLI338	20140808-136694	CLIMAR1	CDTBGA10	43000000 NINC
	- <u></u>	LienarLista C X.Elminadas Hov	1	<	00140010102005	0.000	CD THE IS A	P1000000 1000
		INVERSIONES	J ;	- Incluit Con	solidador			
			- ,	V Incluir Con				
		V3 🚚 🛩 🔯 🛃 🗶 🖛 🔛	J.	✓ Incluir For	ratolios en 2.610s			
		Ingresa Modifica Recupera Jenta Compra Trasladar Reversa Buscar					,	
		Punta Especie NDcDv/ISIN Negocio No. Orden No. Fec Emis	sión	Fec Vencimient	T. Compromiso	Modalidad	Tasa Nominal	Cantidad
		•						Þ

- i. Seleccione las operaciones que desea eliminar, de esa lista, o utilice la opción "Seleccionar Todo" para chequearlas todas.
- Una vez establecida la selección, pulse el botón "Recupera" de al lado de "Ingresar" y "Modificar". El sistema le pedirá conformación y enseguida recuperará la lista de operaciones que usted haya seleccionado.

GARANTIAS ADICIONALES Y PARAMETROS CVA

Estas son las instrucciones para el manejo de garantías adicionales y para el cálculo de CVA y DVA mediante parámetros.

1. Garantías Adicionales.

Con garantías adicionales nos referimos a las garantías que le serán solicitadas para respaldar cualquier operación. Tenga en cuenta que las operaciones de liquidez ya tienen por defecto una garantía asociada, que es el título sobre el que se hizo la operación, el cual es tratado como un derecho (operación pasiva) o una obligación (operación activa). Ese título no requiere ningún tratamiento distinto al ya establecido en el sistema. Para el tratamiento de las garantías solicitadas debe proceder así:

- a. Dar el título en garantía. Los títulos que se den garantía deberán tener un numero de operación único (NumNegocio, columna E del Excel de carga compromisos) que se deberá conservar siempre. Si no conserva el número se le dificultará administrar las garantías pues estas se asocian luego a las operaciones que garantizan.
 - i. Por carga. Para dar un título en garantía al cargar sus portafolios al sistema, simplemente ponga "GARANTIA" en el campo Estado (columna



BI del Excel) y en FechaCompromiso (Columna XX del Excel) la fecha la fecha de cumplimiento de la operación, entre las que va a garantizar con él, que se cumple más tarde. Esta fecha solo es relevante si usted está utilizando las funciones de BackOffice, de lo contrario puede poner la del día todos los días.

- ii. Por pantalla.
 - 1. En Portafolios y Riesgo, seleccione el título en la grilla y pulse el Botón "DarEnGar":

Métodos Carga	F. Oursing										
Consultar VeR POSPRO VeR FONDO VeR Reservas Salir	Organizar Por Grupo Por Linea Por Tipo Por Portafolio TODOS == CLIENTES == CLIARE1	PORTAFOLIO Nombre 🖗 Campos Doc Tipo (GNA Linea de Negocio PUBLICO Eliminar: Recuperar:	25/01/20 Beneficiarios [900338073-4 [16 PWP SOFTWARE Nombre: Elija i	SAS.	iado Hoy 🔻	Usar Lista PORTAFOLIO	a Seleccionada	Seleccion	ar Todo	
	L	LienarLista INVERSIONES Ingress Modifica El Puna Especie COMFRA EFINAT COMFRA TETINS2 COMFRA TETINS2 COMFRA TETINS2 COMFRA TETINS2	X Elminadas Hoy X Elminadas Hoy Venta V	1400-000 1700-000 1400-0	Reversa Bu	DarEnGar DarEnGar 0 13/12/201 0 24/07/200 0 24/07/200 0 24/07/200 0 24/07/200	VaB APTs. SelPartir SelUnir 5 21/10/2018 5 24/07/2020 5 24/07/2020 8 24/07/2021	Totales Por: TIPO Exportist T. Compromiso NINGUNO NINGUNO	Modalidad MV AV AV	Incluir Const Incluir Porta Posicione 0.0 11.0 11.0 10.0	biidador folios en Zeros \$ 97,086,09 1,600.000,00 2,400.000,00 600.000,00 1,000.000,00
		¢							1		>

2. Le aparece la operación del título. Indique la fecha hasta cuando el título estará en garantía. Debería ser la fecha de cumplimiento de la operación, entre las que va a garantizar con el, que se cumple más tarde. Esta fecha solo es relevante si usted está utilizando las funciones de BackOffice, de lo contrario puede poner la del día todos los días:



Dar el Título en Grantía
Tipo de Operación ⓒ Normal C Contado+1a5 C Repo C Simultáneas C Tr.Temp. C Forward C SWAP C Opciones
Datos Compromiso Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 25/01/2016 • 21/12/2018 • 21/12/2018 • 21/12/2018 • COMPRA • LARGA • XXZ503 0 XX • Emisor Especie Depósito ISIN Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Fw GOBIERNO NACIONAL • TFIT16240724 • DCV • COL17CT02385 NEGOCIABLE • AEV • III:05:30:24 • NDV •
Valoración Faciales Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 24/07/2008 24/07/2024 10.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Captación/Salida Cantidad Valor de Compra Ult.VIr. Mercado PyG/Trading. T. Repo/Cpr Oper. Regreso Valor Giro/Recompra S00,000,000.0 623,522,675.95 623,411,101.9 -111,574.05 VENCIDA 0.00 0 0.00 Nominal Adquirido Costo Adquisición Trader Adicional Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Compromiso Orden CPR 500,000,000.0 623,522,675.95 TRADER1 0.0 N0 A N0 A FinAL FinAL
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 PARTIR_20151221:X>Z495 PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T ítulo 0 MEC Image: Compensación Forma de Pago #EMISION
SECUNDARIO VERVE ESPECULA VERVE DVP VERVE Cal. Crediticio Inv. A 53059

- 3. Pulse Aceptar. El título quedará marcado como "Dado en Garantía".
- b. Liberar. Para liberar un título dado en garantía proceda:
 - i. Por Carga. Simplemente ponga el campo Estado en "NORMAL"
 - ii. Por pantalla. Ubíquese en el título. El Botón "DarEnGar" cambiará a "Liberar". Púlselo y Aceptar:



R PORTAFOLIC Archivo Méto	OS Y RIESGO dos Políticas Contratos SV	Pap
Métodos Carga	C-Organizar	
Consultar VeR POSFRO VeR FONDO VeR Reservas Salir	Por Gueo Por Gueo Por Chea C Por Too Por Portafolo TODOS DOS DO	Eliminar: Citita Immedia Citita Citita Citita <tr< th=""></tr<>
		Image: Modified Elimite Image: Modifie

- c. Asociar garantías. Una vez tiene sus títulos dados en garantía, deberá asociarlos a las operaciones que está garantizando. Utilice la plantilla que está en el archivo "FormatoTodasEntrada.xls", hoja "Garantias". Extraiga esa hoja en un archivo aparte y llénela con la lista de títulos y las operaciones que garantiza con cada uno. Nótese que en cada fila debe poner:
 - i. A la izquierda los datos de la operación del título usado como garantía.
 - ii. A la derecha los datos de la operación que garantiza con él. La columna H ("CanGarantizada") se refiere a la fracción del título utilizada como garantía en esa operación.
 - iii. En Portafolios y Riesgo, menú "Carga", opción "Admon. Garantías" utilice el botón "Carga" para alimentar al sistema esta distribución de garantías. Recuerde que si en el cierre usted no utiliza la opción "Trasladar", o si cambia continuamente, deberá alimentar este archivo diariamente. La pantalla de Admon. Garantías:

Software S.A.S

PWPREI – RIESGO E INVERSIONES

PORTAFOLIC	DS Y RIESGO	
Archivo Méto	dos Políticas Contratos SWAP	
Carga	🔁 Administración de Garantías	
	Fecha Registro 25/01/2016 🔄 🔍 Pefrescar 🙀 Cargar 💥 Exportar 💥 Eliminar Una 🔯 Eliminar Todas 📓 Salir	
Compromises Contrates SWAP		
Admon. Garantías		
Proveedor Externo		
		onsolidador
		ortafolios en Zeros iones 5
		Cantidad 97,086,09 1,600,000,00 2,400,000,00
		1,000,000,00
Métodos		
Consultar		
VeR POSPRO		
VeR FONDO		
Salir	<	>

- d. Formato 508. En el formato 508 el sistema hará la distribución correspondiente, de acuerdo con las operaciones que cada título esté garantizando.
- e. BackOffice. En estas funciones se sigue el proceso normal:
 - i. Operaciones. El título se maneja como dado en GARANTIA y no se puede operar.
 - ii. Al cierre se liberan todos los títulos cuya fecha máxima de garantía corresponda a la próxima apertura.
 - iii. Contabilidad:
 - 1. Al dar en garantía se traslada el papel a la cuenta "Derechos de .."
 - 2. Al salir de garantía se traslada nuevamente a su cuenta original de "Inversiones en ..."

2. Riesgo de Contraparte - CVA y DVA.

Para sus operaciones OTC y para todo formato donde se requiera el CVA y DVA, como el 468, puede establecer parámetros para que el sistema los evalúe, de acuerdo a la siguiente definición:

Se maneja el riesgo de contraparte como parámetros por contraparte y plazo, que usted establece a su gusto:

- Contraparte
- Plazo Hasta
- Probabilidad de falla
- Tasa de recuperación



El CVA se calculará con base en la exposición (ExpM) definida como:

- PyG del compromiso, para NDVs (Forwards)
- Valor del compromiso, para otros (Simultáneas)

Si la exposición es positiva (PyG positivo para NDVs, posición Pasiva para otros) se calculará un CVA, de lo contrario se calculará un DVA.

Entonces el CVA será:

CVA = ExpM * PD * (1 - TR)

Donde:

- PD=Probabilidad de Default. Probabilidad de que esta contraparte me falle en este plazo.
- TR=Tasa de Recuperación. Si me falla, cuánto puedo recuperar de lo que me adeuda.

Para el DVA, mi propio riesgo, se aplica lo mismo, estableciendo parámetros para mí como contraparte y se calcula cuando el MTM me es desfavorable o tengo la posición Pasiva en una OMM.

Para establecer parámetros para el cálculo del CVA y DVA ingrese a "Definición de Parámetros – Contrapartes – CVA". Utilice la plantilla que está en el archivo "FormatoTodasEntrada.xls", hoja "CVA" para alimentarlos por Excel. La pantalla "CVA":

	🖏 Parámetros Cál	culo CVA y DVA	4									
artes	figencia Desde 01/12/2015 💌	Ultima Valor 21/12/2015	ación Nit 5 - PW	Emp.O.Fondo P SOFTWARE	900338073-4	·	Refress	car 🔒 Carga	ar 🔀 Exporta	🗙 Eliminar Und	o <mark>N</mark> Eliminar	Todos
rte	FechaVigencia	NitEmpFide	Contrapar	PlazoHasta	ProbDefault	TasaRecupera	VAx1000MM	FechaRegistro	XCobrarOMM	XPagarOMM X	CobrarNDV (Pa	igarNDV XCo
	01/12/2015	900338073-4	309	1	0.15	90	150,000	21/12/2015	0	0	0	0
	VIILEIEULU		309	3	0.10	89	176,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	309	15	0.60	92	480,000	21/12/2015	3,503,744,809.06	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	309	30	1.20	94	1,000.000000001	21/12/2015	U	522, 196, 952.05	0	0
	01/12/2015	900338073-4	309	180	2.50	97	1,000.000000001	21/12/2015	0		0	0
	01/12/2015	900338073-4	309	365	5	99.99	i,000.000000005	21/12/2015	0	0	0	0
ĩ	01/12/2015	900338073-4	309	9,999	5	99.99	i,000.000000005	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	1	0.15	90	150,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	3	0.16	91	144,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	15	0.50	93	350,000	21/12/2015	2,403,067,062.31	1,201,178,149.50	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	30	1	95	500,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	180	2	97	1,000.000000001	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	365	4	99.99	I,000.000000004	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	405	9,999	4	99.99	1,000.000000004	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AEV	1	0.50	82	900,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	ACY	3	0.80	85	1,200,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AEV	15	1.20	85	1,800,000	21/12/2015	2,611,914,525.37	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AEV	30	2	87	2,600,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AEV	180	3.60	89	3,960,000	21/12/2015	0	2,869,145,779.42	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AEV	365	6	91	5,400,000	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	AFV	9,999	12	95	0,000.00000001	21/12/2015	0	0	0	0
al	01/12/2015	900338073-4	PWP	1	0.10	98	20,000	21/12/2015	0	0	0	0
nciera	01/12/2015	900338073-4	PWP	3	0.10	98	20,000	21/12/2015	0	0	0	0
-	01/12/2015	900338073-4	E WE	15	0.20	99	20,000	21/12/2015	0	0	0	0
EI	01/12/2015	900338073-4	PWP	30	0.30	99	30,000	21/12/2015	0	0	0	0
e .	01/12/2015	900338073-4	PWP	180	0.40	100	0	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	PWP	365	0.50	100	0	21/12/2015	0	0	0	0
	01/12/2015	900338073-4	PWP	9,999	0.50	100	0	21/12/2015	0	0	0	0
			1							-1	-1	- 1

Si administra fideicomisos o fondos puede establecer parámetros para usted como empresa y para sus fondos. Para determinar si va usar sus parámetros en forma general o por fondo solicite a su área de tecnología que establezca el parámetro 8090 así:

- ParVal = 'GENERAL' o '': Parámetros aplican para mi y para mis fondos.
- ParVal = 'XCARTERA': cada fondo tiene sus propios parámetros.

Los parámetros establecidos para usted como contraparte se aplican para calcular el DVA



cuando corresponda.

INFORME DE VAR POR PORTAFOLIO APTS

para la generación del Informe de VaR por portafolio (APTS).

- **1.** Ingrese a Portafolios y Riesgo.
- 2. Seleccione la pestaña "Métodos"
- 3. VaR APTs:

En la pantalla acostumbrada le aparece la opción "VaR APTs Totales Por:". A la derecha elija a qué nivel desea agrupar el VaR: Tipo, Portafolio, Grupo o Línea. En seguida le aparece arriba la lista de: Tipos, Portafolios, Grupos o Líneas con inversiones en la fecha de registro indicada, como se ve a continuación:

Archivo Méto	dos Políticas Contratos	s SWAP	
Métodos			
Simulación Histórica Estructurado	Organizar Por Grupo Por Tipo Por Tipo Por Totafolio TODOS # == CLIENTES	PORTAFOLIO 25/01/2016 Nombre ✓ Usar Lista Seleccionada Tipo Linea de Negodo	ionar Todo
Delta Normal Súper Valores		Recupera: C Maladio C Maladio Numer: Elina un Alchivo Lagidade Hoy V Ilenardirate C Xatchivo Recupera: Númer: Elina un Alchivo Lagidade Hoy V INVERSIONES C Xeliminadas Hoy Númer: Elina un Alchivo Lagidade Hoy V Validade Hoy V Inversiona Antiona Filiparation Filiparation Numer: Elina un Alchivo Lagidade Hoy V Inversiona Modifica Eliminadas Hoy Numer: Elina un Alchivo Lagidade Hoy V Validade Hoy V Ingresa Modifica Elimina Verta Compra Trasladar Reversa Buscar Garantia SelPartir SelDaritis Exportist	1 ☐ Incluir Consolidador ☐ Incluir Portalolios en Zeros Poticines 5
Valorizador Externo		Punta Especie ND-CDV/ISIN Negocio No. Orden No. Fee Emisión Fee Vencimient T. Compromiso Modalidad	t Tasa Nominal Cantidad
Carga Consultar VeR POSPRO VeR FONDO			
VeR Reservas Salir		¢	\$

En la lista anterior seleccione Todos, o solamente los ítems que desee incluir en el Informe. El sistema le preselecciona todo ítem que esté dentro del Grupo o Línea en que usted se haya ubicado en el árbol del lado izquierdo.

4. Método.

Seleccione el Método para calcular el VaR de los ítems, establezca las condiciones y pulse Aceptar. Al terminar de generar el sistema le pedirá el destino del informe. Si no se le activa la venta para seleccionar el archivo atienda el mensaje, como se ve en la pantalla:



🗴 Método - Delta Normal	(VaR X Lista Portafolios) 💌
Fecha Medición Número de Observaciones Horizonte Temporal Nivel de Tolerancia	n 06/02/2015 186 1 VaR Factores 0.01 POR FAVOR (Alt+Tab)
Seleccione la Fuente de Información	Seleccione Precio
C ALTERNA	Precio Sucio
INFOVAL	O Precio Limpio
	Aceptat Cerrar

5. Archivo.

Una vez seleccionado el archivo el sistema grabará el informe, así:

- En la primera hoja, los totales por cada ítem.
- En las subsiguientes hojas del Excel, el detalle de las posiciones para cada ítem. Le aparecerán tantas hojas como portafolios haya incluido en el informe.

SINCRONIZACION DE PORTAFOLIOS

Las funcionalidades descritas a continuación corresponden a:

- Sincronizar Portafolios.
- Copiar Posiciones.

Observe la siguiente pantalla de administración de Inversiones:



Consolidador
D-1-(7
es
antidad
2,000,00
3,000,00
1 000 000 00
1 200 000 00
1,000,000,00
3,000,000,00
1,000,00
>

1. Sincronizar.

La función "Sincronizar" permite sincronizar o igualar un portafolio a otro. Proceda como sigue:

- Seleccione un portafolio en el árbol de la izquierda.
- Pulse el check "Sincronizar" a la izquierda. Se le habilitará la opción "Sincronizar" a la derecha.
- El portafolio "Origen" será aquel que haya seleccionado en el árbol de portafolios de la izquierda. Se tomarán las posiciones de ese portafolio como fuente.
- Elija de la lista el portafolio "Destino". Los portafolios listados en "Destino" son aquellos que haya registrado como "Portafolios de Evaluación" en el parámetro general 8107.
- Hecha la selección pulse, abajo en la lista de comandos, el reloj (Sincronizar). El sistema procederá a igualar el portafolio "Destino" con el contenido del portafolio "Origen". Se exceptúan de las posiciones sincronizadas aquellas correspondientes a contratos de arrendamientos, swaps y opciones; dado que estás requieren definiciones adjuntas que se deben registrar previamente. Todas las demás posiciones serán copiadas al portafolio destino.
- Tenga en cuenta que si el portafolio "Destino" contenía posiciones previo a la sincronización, tales posiciones serán eliminadas antes de ejecutar el proceso, de forma que al final los dos portafolios queden iguales.

2. Copiar.

La función "Copiar" permite copiar una posición de un portafolio a otro. Proceda como sigue:

• Seleccione una posición en la grilla de inversiones.



- Pulse el check "Sincronizar" a la izquierda. Se le habilitará la opción "Copiar" a la derecha.
- Pulse la opción "Copiar".
- La posición "Origen" será la seleccionada en la grilla de inversiones.
- Elija de la lista el portafolio "Destino". Los portafolios listados en "Destino" son aquellos que haya registrado como "Portafolios de Evaluación" en el parámetro general 8107.
- Hecha la selección pulse, abajo en la lista de comandos, el par de flechas (Copiar). El sistema procederá a copiar la posición seleccionada al portafolio "Destino". No se pueden copiar posiciones correspondientes a contratos de arrendamientos, swaps y opciones; dado que estás requieren definiciones adjuntas que se deben registrar previamente. Cualquier otro tipo de posición puede ser copiada al portafolio destino.
- Tenga en cuenta que si el portafolio "Destino" ya contenía una posición igual, esta no se borra; simplemente la posición seleccionada se agrega al portafolio "Destino".
- Al copiar una posición esta se identifica con "C_" al inicio del número de negocio.
- Puede copiar una posición cuantas veces lo desee.

NOTAS – DISEÑO OPERACIONES INTERNACIONALES

Definiciones para desarrollos y ajustes varios a la operatividad de PWPREI en relación con la administración de operaciones en mercados externos. Básicamente debemos distinguir aquellas operaciones liquidadas en otras monedas, aunque el título forme parte del portafolio local del cliente. Lo anterior para:

- Incluirlas en el formato de liquidez con la afectación del valor por el haircut de la moneda correspondiente (F508).
- Facilitar al cliente la distinción en PWPREI del origen de las operaciones.

A continuación los temas y sus definiciones.

- Operaciones Externas. Las operaciones liquidadas en el exterior se identificarán en PWPREI en el campo "País" con el código de la moneda en la que se liquidó el negocio. Para facilitar el registro se han agregado los códigos USD (Dólares de los Estados Unidos) y EUR(Euros) a la lista de países, aunque se mantiene el código numérico de estados unidos y los de los países europeos. En el campo país de su hoja de cargue de operaciones o de su interfaz externa registre:
 - a. USD: para operaciones liquidadas en dólares.
 - b. EUR: para operaciones liquidadas en euros.
 - c. Moneda Correspondiente: para operaciones en otra moneda, distinta de la local (COP). Pero si este es su caso, deberá solicitar primero a PWP Software la inclusión de la nueva moneda en la lista de países antes de poder utilizarla.
 - d. Vacío o código numérico de país: para operaciones liquidadas en moneda local (COP) que no deben afectarse por el haircut de moneda en el IRL, a menos que


la norma lo establezca por la moneda del papel. Recuerde que lo que compra o vende aquí y liquida aquí ya tiene establecido normativamente lo que se debe hacer de acuerdo con la moneda del papel, así que no debe hacer cambios en su hoja de cargue en estos casos.

- Tipos de Operación para uso del cliente. Por solicitud del cliente se permitirá que en el campo "OrdenCpr" se ingresen los siguientes códigos, para su uso exclusivo. No se hará ningún reconocimiento especial de este campo en PWPREI, más allá de adicionarlo a alguna consulta:
 - a. COMPRA: Compra
 - b. COMPINT: Compra Internacional ADR
 - c. INGOTR: Ingreso otras firmas
 - d. INGETF: Ingreso ETF
 - e. EGROTR: Egreso otras firmas
 - f. EGRETF: Egreso ETF
 - g. VENTA: Venta
 - h. VENTINT: Venta internacional ADR
- 3. Operaciones Cruzadas. No se harán cambios al interior de PWPREI. En el tratamiento de las operaciones cruzadas por cuenta de terceros se procederá con el reconocimiento del conjunto, agrupando los fraccionamientos o adicionales de cada operación. Este procedimiento se aplicará en el proceso de armado del conjunto solución para cargue, bien sea al armar el Excel o al armar la vista o SP. Igualmente, al armar el conjunto solución se determinará cuál de las 2 puntas es la mayor y esa se incluirá en dicho conjunto, de forma que no se requiera hacer modificaciones al interior de PWPREI para estos efectos con respecto al funcionamiento actual.

NOTAS OPERATIVAS – DERIVADOS Y TASAS

A continuación, describimos las funciones dispuestas para administrar operaciones en derivados, OTC.

1. Registro de Tasas y Curvas SWAP y Forward.

Como se explicó en las definiciones o supuestos asumidos para la implementación, las tasas swap serán creadas automáticamente por el sistema al momento de la carga. EL propósito es manejar de forma estandarizada los códigos de dichas tasas o curvas para que sean fácilmente reconocibles visualmente, asegurar la correcta parametrización de las mismas, determinar el contenido de un archivo publicado a partir de su nombre y que el sistema tenga una forma estándar de componer especies autogeneradas para valorar, especialmente los SWAPS de tasa de interés.

Por otra parte, usted puede definir las tasas que desee y generar curvas para valorar con ellas, asociándolas a sus contratos a voluntad; sin embargo, en el caso de contratos SWAP deberá respetar la presunción de que se trata de tasas nominales periodo vencido aditivas, de forma que los cálculos del sistema sean los correctos.

Lo anterior no afecta las definiciones de las tasas tradicionales, ni los supuestos para



descontar forwards.

- 2. Registro de Especies.
 - a. Especies para SWAPS. Dado que estos contratos suponen la negociación de 2 bonos implícitos, es necesario conocer la forma de valorar cada punta del negocio separadamente, por lo tanto la especie del negocio no corresponde al mismo en su conjunto. Por ello PWPREI requiere 3 especies: una, genérica, para el registro del negocio, otra para la punta de "Recibir" y una tercera para la punta de "Entregar":
 - i. Especie estándar para registrar la operación. Cuando registre un SWAP de tasa de interés el sistema le sugerirá automáticamente la especie "SWAP_OTC", que se utilizará de forma genérica para el registro de este tipo de negocio; Aunque usted puede cambiarla por cualquiera, pues el sistema no hará nada con ella realmente, le sugerimos dejar la estándar por efectos de facilidad visual.
 - ii. Especie para los bonos implícitos. No es necesario que usted cree ninguna especie en particular para estos efectos, PWPREI las definirá automáticamente en la base de datos dependiendo de las condiciones faciales resultantes de cada punta del negocio. Cuando encuentre en su lista de especies códigos de la forma "PWPSWAP_SWDTF_C_P" o "PWPSWAP_SWIBR_C_A" no les cambie nada pues son especies autogeneradas.
 - b. Especies para Forwards. No sufren cambios con respecto a la definición tradicional de PWPREI.
- 3. Carga de información de PPV
 - a. Curvas SWAP. Las curvas SWAP son administradas por la opción "Mercado y Sociedad – Forwards/Opc – TasasFw". Utilice el botón "Cargar" para alimentar las curvas al sistema. Tenga en la cuenta que tanto la fecha de vigencia o de carga como el nombre de la tasa a cargar, se toman del nombre del archivo y por lo tanto no debe cambiar los nombres de los archivos a cargar. Se recomienda para cada tipo de curva cargar solo el archivo de nodos de la curva cero cupón, que sería la siguiente lista como ejemplo:
 - i. SwapCC_DTF_Nodos_20130125. Alimentará al sistema los nodos de la curva cc para la DTF del 25/01/2013. Al consultar usted verá en la columna Tasa el nombre SWDTF y en la columna FechaVigencia 25/01/2013.



- SwapCC_IBR_Nodos_20130125. Alimentará al sistema los nodos de la curva cc para el IBR del 25/01/2013. Al consultar usted verá en la columna Tasa el nombre SWIBR y en la columna FechaVigencia 25/01/2013.
- iii. SwapCC_IPC_Nodos_20130125. Alimentará al sistema los nodos de la curva cc para el IPC del 25/01/2013. Al consultar usted verá en la columna Tasa el nombre SWIPC y en la columna FechaVigencia 25/01/2013.
- iv. SwapCC_LIBORCOP_Nodos_20130125. Alimentará al sistema los nodos de la curva cc para la LIBOR pesos del 25/01/2013. Al consultar usted verá en la columna Tasa el nombre SWLIBORCOP y en la columna FechaVigencia 25/01/2013.
- v. SwapCC_LIBORUVR_Nodos_20130125. Alimentará al sistema los nodos de la curva cc para la LIBOR UVR del 25/01/2013. Al consultar usted verá en la columna Tasa el nombre SWLIBORUVR y en la columna FechaVigencia 25/01/2013.
- Puntos Forward. Cárguelos por la opción PIPS, desde el Excel o como siempre o desde el plano de la forma Fwd_USDCOP_Nodos_20130125 que cargará Nodos Puntos Forward del 25/01/2013.
- 4. Registro de Festivos. Como usted sabe en los contratos SWAP es posible acordar el calendario a utilizar. Para ello usted debe cargar o registrar los calendarios de festivos que desee, en caso de que utilice otros aparte del colombiano, el cual en adelante identificará con la sigla "COL". Para registrar o cargar un calendario de festivos particular ingrese a "Mercado y Sociedad Histórico Mercado Festivos". La pantalla le aparece ahora así:





Los botones de la derecha le permiten ubicar sus acciones en calendario "Local" o "Internacional". Si selecciona "Internacional" y le da "Ingresar", le aparece la pantalla así:

💐 Festivo - Ingresar 🛛 💌	J
CodPais USA 💌	
Fecha 01/01/2014 💌	
Aceptar 🛛 Cerrar	

Donde:

- CodPais es el código que le asigna usted al calendario. Los códigos son totalmente libres.
- Fecha es la fecha de festividad que desea agregar al calendario.



Si desea cargar un calendario, puede hacerlo desde un archivo texto(.txt) con la estructura Codpais Fecha; es decir una serie de líneas donde en cada una pone el código país seguido de la fecha y separados por un espacio. Por ejemplo:

USA 01/01/2013 USA 04/07/2013 USA 25/12/2013 Etc.

En caso de carga de los festivos locales es simplemente una lista de fechas, sin código país.

- 5. Registro de Operaciones
 - a. SWAPS de tasa de interés. Este tipo de posiciones no se define por si misma, por lo que la operación es una mera indicación a PWPREI de que hay un contrato establecido. Así que, antes de registrar posiciones en SWAPS de tasa de interés deberá registrar el contrato correspondiente donde defina las características del negocio.
 - i. **El Contrato**. Para registrar sus contratos ingrese por "Portafolios y Riesgo Carga Contratos SWAP". Le aparecerá una pantalla como esta:

	🚉 Contratos SWAP											
	Ng 🚨 🖥	λa Δa 🚰 es] 🚿										
ľ	FechaRegis	NumNegocio	NormaInt	FecOper	FechaComp	FechaComp	RecTasaRe	RecUsoTas	RecSpread	Reck		
	31/01/2013	SWAP20130131_001	SI	14/01/2013	15/01/2013	15/01/2015	DTF	PREVIA	.00	TV		
	31/01/2013	SWAP20130131_002	SI	31/01/2013	31/01/2013	31/01/2023	FS	ACTUAL	6.10	AV		
	31/01/2013	SWAP20130131_003	SI	31/01/2013	31/01/2013	31/01/2018	IBR	ACTUAL	.00	SV		
										- P		
	Registro(s) 4											

La pantalla contiene las funciones comunes para administrar sus contratos. Recuerde que los contratos al igual que las operaciones se administran en forma histórica; es decir, para cada fecha de registro habrá un registro del contrato con su estado ese día.

Los datos del contrato son como aparecen en la pantalla de registro:



📩 Contratos SWAP - Modificar 🛛 🗾										
Registro Nr 04/06/2015 □ Celebración L 04/05/2015 □	ro. Contrat WAP2015 Liquidació 4/05/2011	o 50504_002 n 5 _	Norma Int. Flujos							
	47037201									
REGIDE										
Tasa Ref. 🛛 🚽		Tasa Ref.	IBR 🚽							
Uso Tasa ACTUAL 🚽		Uso Tasa	PREVIA 🚽							
Spread 5.00		Spread	0.00							
Modalidad 📈 🚽		Modalidad	MV 📼							
Moneda COP 🚽		Moneda	COP -							
Cantidad 1,000,000,000.00	-	Cantidad	1,000,000,000.00							
Tasa Flujos FS	•	Tasa Flujos	SWLIBORCOP 💌							
Calen. FLujos COMERCIAL 💌		Calen, FLujos								
CodPais(Fest.)		CodPais(Fest.)	COL 🗸							
Calen. Val. CORRIDO 💌		Calen, Val.	CORRIDO 👻							
Curva Val. SWLIBORCOP	•	Curva Val.	SWLIBORCOP 💌							
Correr Sigte.		Correr Sigte.	0							
Con Tabla - Pulse para Quita	ar	Con Tabla -	Pulse para Quitar							
Ver Tabla Cargar Ta	bla	Ver Tabla	Cargar Tabla							
		Ac	eptar 🔀 Cerrar							

Al lado izquierdo están los datos que definen los flujos a recibir y al derecho los que definen los flujos a entregar o pagar.

La descripción de los campos es:

- Fecha Registro. La tradicional Fecha Portafolios de PWPREI.
- Nro. Contrato. Número del contrato SWAP. El sistema le sugiere un formato de número para que en la operación se identifique como un SWAP y un consecutivo diario.
- Norma Int. Flujos. Indica si se desea aplicar al contrato la norma internacional de corrimiento de flujos: Sábados, domingos y festivos se corren al día hábil siguiente, excepto si es de fin de mes, en cuyo caso se



adelantan al día hábil anterior. Adicionalmente indica si el tipo de SWAP es corriente o es OIS. Las opciones son:

- SI: SWAP corriente aplicando Norma Internacional.
- NO: SWAP corriente, no aplicar Norma Internacional
- OS: SWAP OIS aplicando Norma Internacional.
- ON: SWAP OIS, no aplicar Norma Internacional.
- Celebración es la fecha de la operación, cuando se constituyó el contrato.
- Liquidación. Fecha de Compra o de inicio del contrato y se asemeja a Fecha de Emisión para los bonos implícitos.
- Vencimiento. Fecha Compromiso o de fin del contrato y se asemeja a Fecha de vencimiento para los bonos implícitos.
- Tasa Ref. Tasa de Referencia de los flujos. Por ejemplo DTF
- Uso Tasa. Actual o Previa. Previa significa que el primer flujo se calculará con el valor de la Tasa Referencia al inicio del periodo anterior. Nótese que al decir Tasa de Referencia nos referimos a la tasa definida en el campo Tasa Ref. y no al definido en el campo Tasa Flujos.
- Spread. Spread a aplicar a la tasa de referencia en cada flujo. Recuerde que este debe estar en los términos de la modalidad de Tasa Ref. y no de la de Tasa Flujos.
- Modalidad. Modalidad de pago de los flujos.
- Moneda. Moneda de la punta respectiva.
- Cantidad. Valor nominal del contrato en la moneda de la punta respectiva
- Tasa Flujos. Tasa o Curva con la que se evaluarán los flujos futuros del contrato, por ejemplo SWDTF. Si Uso Tasa es ACTUAL, todos los flujos futuros se calcularán con esta tasa
- Calen. Flujos. Calendario de los flujos.
- CodPais(Fest.). Código del calendario de festivos a aplicar. La lista que le aparece corresponde a los códigos de los calendarios de festivos que haya cargado en la opción "Festivos". Se han reservado 2 códigos especiales:



- COL o vacío (el campo sin dato): Indica que se usará el calendario de festivos local.
- NOCORRER: indica que no se correrá ningún flujo futuro. Esto se aplica en concordancia con el campo Norma Int., en orden de prioridad así:
 - Si Norma Int. es SI:
 - Si CodPais = NOCORRER, se correrán sábados y domingos solamente
 - Si CodPais tiene un código distinto, se aplica ese calendario de festivos.
 - Si Norma Int. es NO:
 - Si CodPais = NOCORRER, no se correrán flujos futuros
 - Si CodPais tiene un código distinto, se aplica ese calendario de festivos, incluyendo sábados y domingos.
- Calen. Val. Calendario de valoración.
- Curva Val. Curva aplicable a la valoración, por ejemplo SWDTF.
- Correr Sigte. Este campo se usa para especificar acuerdos especiales para correr flujos y prima sobre los campos Norma int. y CodPais. Si usted especifica un número aquí, se aplicará ese corrimiento de días como una suma literal de días a la fecha del flujo. Si el dato es negativo la fecha se adelanta.
- Tabla de Flujos. Puede alimentar una tabla de flujos para cada punta del contrato. Esto le sirve por ejemplo cuando está cubriendo un crédito y quiere que el Swap refleje los saldos de capital a cubrir. Utilice la barra "Sin Tabla Pulse para asignar" para establecer que la punta se define con una tabla de flujos. Utilice el botón "Ver tabla" para consultar los flujos asociados a la punta y "Cargar Tabla" cuando quiera modificar la tabla asociada a la punta.



 Cierres. Los contratos con tabla de flujos asociadas serán actualizados al cierre. Es decir, si a la fecha ocurre una amortización, el contrato pasa al día siguiente por una cantidad disminuida en el valor amortizado.

NOTA IMPORTANTE. No olvide que, dado que los contratos son históricos, tienen fecha de registro, al valorar se aplican las condiciones de la fecha de registro correspondiente a la fecha de valoración. Por ejemplo, el dato Correr Sigte se aplica al siguiente flujo de esa fecha de registro, lo cual altera el número de días de pago del flujo en curso y del posterior, puesto que al cambiar la fecha fin del presente flujo se altera la fecha de inicio del siguiente.

- ii. La Operación.
 - Registrar. Para registrar una operación SWAP elija SWAP en las opciones de Tipo de Operación en la pantalla de Registro de Operaciones de PWPREI. Al elegir SWAP el sistema le sugiere el último contrato disponible. Si es otro contrato el que desea puede cambiar el Número de Negocio, pero recuerde que el contrato debe ya existir. En caso de que el contrato no exista en la Fecha de Registro de la operación, el sistema traerá los datos de la última fecha en la que haya sido registrado y cuando le de aceptar ingresará automáticamente el contrato en la misma Fecha de Registro de la operación.
 - 2. Cargar. Existen 2 formas de alimentar las operaciones:
 - a. Corriente. En esta modalidad usted utiliza la plantilla corriente PWPREI para carga de compromisos (Hoja "Compromisos" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls". Para cargar una operación siga las convenciones establecidos en el archivo de carga de compromisos, según el ejemplo adjunto "Ejemplo Carga Compromisos SWAPS.xls". El contrato asociado se traerá de la última fecha en que esté registrado y se ingresa en la actual, en el caso de que no esté.
 - b. Desde el Contrato. Puede utilizar la plantilla que está en la hoja "ContratosSwap" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls", registrando ahí los datos de cada contrato fuente de las operaciones a alimentar al sistema. El sistema utilizará los datos para:



- i. Registrar cada contrato, si este no existe ya en el sistema.
- ii. Ingresar la operación correspondiente, a la FechaRegistro indicada.
- iii. Lista la plantilla, ingrese a "Portafolios y Riesgo Carga y Contratos - Compromisos" y seleccione las opciones y el archivo, como se en la pantalla:

Archivo Méto	dos Políticas Contratos S	Р				
Carga y Contratos						
Sega y Contoor Composition Composition Contraction Swall Contraction Contracti	Orgenizer Por Grupo Por Linea Por Too Por Postafolo C Por Postafolo C DOOS Postafolo CLUMAR1 CLUM	PORTAFOLIO ID/01/200 Pombre Campos Pombre P	18 PWP SOFTWARE SAS. TE VCred/Corp1/2018/20171228 Carga Sweport Fecha Carga Fecha Carga Tipo Archivo = Excel Vista	Usar Lista Seleccionada PORTAFOUIO ACCIDIES ACCIDIES BP.RENTA FILA BRASIL Plandido dis Plandido dis Plandido dis Plandido cons Construction C	Seleccionar To	Ido
Mátorios		COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA COMPRA	Exportar Vista	ar 🐜 Errores 🕡 Aceptar 🗵	Cerrar	0.0 5.000,000 0.0 5.000,000 0.0 5.000,000 0.0 5.000,000 0.0 5.000,000
		COMPRA SWAP_01C 20140611203C COMPRA SWAP_0TC 20140806212C	20140611203C 20140611203C 11 20140906212C 20140906212C 06	/06/2014 11/06/2019 FURWARD	TV	0.0 7.000,000
Consultar		COMPRA SWAP_OTC 20140808212C	20140805212C 20140806212C 06	/08/2014 15/08/2024 FORWARD	TV	0.0 5,000,000
VeR POSPRO		COMPRA SWAP_OTC 20140829216C	20140829216C 20140829216C 29	/08/2014 29/08/2024 FORWARD	TV	0.0 5,000,000
VeR FONDO		COMPRA SWAP_OTC 20140905217C	20140905217C 20140905217C 05	/09/2014 06/09/2021 FORWARD	TV	0.0 10,000,000
VeB Beservas		COMPRA SWAP_0TC 20140910219C	20140910219C 20140910219C 10	/09/2014 10/09/2021 FORWARD	TV	0.0 10,000,000 ~
Saír		<				>

- iv. Una vez pulse Aceptar, el sistema validará primero los contratos y si es necesario los registrará o modificará según la plantilla.
- Validados los contratos, el sistema procederá a registrar las operaciones en el portafolio y FechaRegistro indicados. Debe tener en cuenta que la FechaRegistro debe corresponder, como siempre, a la Fecha Carga en pantalla.
- 3. **Pantalla**. La pantalla de una operación SWAP le aparecerá como sigue:



Modificar Inversiones y Compromisos Renta Fija Tipo de Operación C Normal C Contado+1a5 C Repo C Simultáneas C Tr. Temp. C Forward © SWAP C Opciones
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio 31/01/2013 31/01/2013 31/01/2013 31/01/2013 COMPRA LARGA SWAP20130131_002 2 OPCIONES Image: Compra Tipo Forward Emisor Especie Depósito Isin/NumEmisión Tipo Inversión Contraparte Hora Compra Tipo Forward Zuso Interno PWPREI SWAP_OTC DCV 2 NEGOCIABLE AEV Image: 11:20:55 IRS IRS
Datos Faciales Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 31/01/2013 31/01/2023 0.00 COMPLETO ANUAL T. Efect. Precio Obligación 1.0 0.00 Valor de Compra VENCIDA 0.00 0 1.420.520.000.00 Trader Adicional Modalidad Reinv. 0.00 0 1.420.520.000.00 TRADER1 0.0 NO APLICA NO APLICA S650.00 31/01/2023 FINAL
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen/A Cubrir 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado T ítulo 0 OTRO OTRO OTRO Image: Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv. A
Calcular Cerrar

En esta pantalla se han registrado las condiciones faciales del bono de recibir y los datos de registro muestran Derecho y Obligación en lugar de Valor Compromiso y Captación.

Note que como las condiciones del negocio están en el contrato, no se le habilitan los campos de la operación propiamente dichos sino solo los complementarios.

NOTA: Si usted va a cargar sus operaciones SWAP por Excel, no olvide lo siguiente:

- En el campo Tipo Compromiso indique "FORWARD".
- En el campo TipoFW indique "IRS".
- En el campo NumNegocio indique el número del contrato ASOCIADO a la operación.
- b. Forwards sobre divisas
- c. Forwards sobre títulos
- 6. Valoración
 - a. SWAPS de tasa de interés. Al valorar este tipo de derivados se aplicarán las condiciones del contrato, en particular los siguientes datos:



- i. La curva de valoración. Define cuál es la curva a utilizar para valorar cada punta del contrato, por ejemplo SWDTF.
- EL calendario de valoración. Define el calendario a utilizar: 365 o 360.
 Para efectos de formatos, si el calendario es 360 la tasa resultante será trasladada a 365.
- iii. Corrimiento de días establecidos para cada flujo. El corrimiento afecta tanto los días de pago como los días al vencimiento del flujo.
- iv. El código país. Para establecer los días festivos.

NOTA: No olvide que, dado que usted puede establecer las curvas, tasas y calendarios que desee, la forma de ajustarse a la norma es precisamente establecer en los parámetros del contrato las mismas curvas indicadas por la SFC.

- b. Forwards sobre divisas. Estos se siguen valorando de la forma ya definida, con excepción del hecho de que usted dispone de ahora de los PIPS y tasas publicadas por su PPV para valorarlos.
- c. Forwards sobre títulos. Estos se siguen valorando de la forma ya definida. No hay cambios en esta versión, con excepción del hecho de que ahora usted dispone de las curvas de su PPV para valorarlos.
- 7. Generación de formatos. Para generar sus formatos proceda de la forma corriente como lo ha hecho siempre.
- 8. Adelantos o Liquidación Anticipada. Usted puede adelantar el cumplimiento de la operación en cualquier momento. Debe distinguir entre la modificación de la fecha final del contrato para cualquier día y el adelanto para liquidar al día actual con sus respectivos efectos contables:
 - a. Adelanto para liquidar hoy. Para hacer esto simplemente modifique la operación y ponga como Fecha Compromiso la Fecha Registro actual. Cuando hace esto el sistema liquidará la operación y hará los movimientos contables que tenga establecidos para el evento "CUMPLIR". Esto no modifica las condiciones del contrato, simplemente lo calcula a la fecha anterior para liquidar hoy el Derecho, la Obligación y PyG, de acuerdo con lo que haya establecido en los parámetros del evento "CUMPLIR".
 - Modificar la fecha del contrato. Si lo que desea no es liquidar el contrato de forma anticipada, lo que debe hacer es modificar las condiciones del propio contrato. Puede ir a la opción "Carga – Contratos Swap", seleccionar el contrato y modificar



cualquiera de las condiciones, ente ellas la fecha de liquidación final, habilitadas para ello. Cuando modifica el contrato estas son las condiciones que se aplicarán al valorar. Tenga en cuenta que la fecha de liquidación del contrato debe ser consistente con la periodicidad de los flujos, si pone cualquier fecha eso podría llegar a producir resultados extraños en la valoración.

9. CARGA BOF

Para procesar archivos del mercado (MEC), ingrese al módulo "CargaBOF" desde el menú principal de PWPREI. Este módulo le permite procesar las operaciones realizadas en el mercado, a partir del archivo plano de liquidaciones.

Al ingresar al módulo se le solicitara la Fecha de Proceso y en seguida le aparece la siguiente pantalla:

CARGA OPERACION	NES MERCADO							_		
MEC										
Saîr	te Fecha de Ri Pottafolio	Depósito NumDo	vDvl Negocio No Orden No.	Punta	Posición	Especie	Cantidad	Fecha Registro	30/03/2015 💌	
< E	e Fecha de Fil (Potalolo	Depósito NumDa	vð vi <mark>Negacia No</mark> (Orden No	Punta	Posición	Especie	, Cariidad	Datos Venta Fecha Registro Portafolio No. Operación Punta Depósito N.DcvDvI/ISIN Contraparte	Cantidad Valor Compra Fecha Emisión Fecha Venne Tasa Nominal NumOrden Tipo Cpr.	
								Datos Compra Fecha Registro Portafolio No. Operación Especie Punta Depósito N.DcvDvI/JSIN Contraparte	Cantidad Valor Compra Fecha Emisión Fecha Vence Tasa Nominal NumOrden Tipo Cpr.	

Pulse el botón "MEC" para ver el menú de opciones:



9.1. OPCIÓN MEC



9.1.1. NOTAS CARGA MASTER TRADER

1. Consideraciones:

Para utilizar los nuevos archivos de la BVC, del sistema Master Trader, tenga en cuenta:



- a. Puede cargar las operaciones a partir de formato o csv, sin embargo le sugerimos utilizar el formato csv para obviar la pre carga del objeto Excel, que retarda el inicio del proceso.
- b. Debe revisar sus códigos de Trader, en caso de que no correspondan a los del sistema anterior. Posiblemente deba establecer nuevas equivalencias entre sus códigos internos y los de la BVC.
- c. Las contrapartes se leen con los códigos numéricos que vienen en el archivo, que pueden no corresponder a como las tiene creadas; aunque igual se conserva la función de asignar contraparte en su pantalla de administración de operaciones del mercado.
- 2. Carga de archivos Mater Trader.

Para cargar los archivos proceda:

- a. Ingrese al módulo CargaBOF.
- b. Abra la pestaña MEC
- c. Pulse la opción "Master Trader"
- d. En seguida le aparece la ventana de carga corriente:

Masterirader			Fecha Registro	01/10/2018 👤
CargaMESA			Contraction Dates Venta	
Cargar MEC			Fecha Registro	Cantidad
1			Portafolio	Valor Compra
Ventas/Calce		Cargue Automático	- • •	Fecha Emisión Fecha Vence
90 Procesar	¢	Archivo (*, bt) D-VProductos/REIVAAAAAClientes/AccionFiduciaria/2018/20181011	CargueMasterTrader\1-0	Tasa Nominal NumOrden
S TODAS		Tipo de Carga	FechaCarga	Tipo Cpr.
10000		C Excel	01/10/2018	
Reg. ISINES	co	L Borrar Fecha antes de cargar		
MiDia				Cantidad
I		-	Errores Aceptar 🔀 Cerrar	Valor Compra
1917			Especie	Fecha Emisión Fecha Vence
P/GCortos			Punta	Tasa Nominal
Jun			N.DcvDvl/ISIN	Tipo Cpr.
			Contraparte	
				CALZAR PyGCortos
	<		> Validar	

- e. Pulsa Aceptar y las operaciones en el archivo serán alimentados al sistema.
- f. En caso de errores, pulse el botón errores para ver la lista.
- 3. Procesamiento.

Para procesar las operaciones cargadas a partir de los archivos Master Trader, utilice las opciones corrientes disponibles en el sistema para el efecto. Todo el resto de la operatividad es trasparente para usted.



9.1.2. CARGAMESA

Las instrucciones para el procesamiento de las operaciones vía los archivos de liquidaciones de bolsa o SIOPEL. Recuerde que hay un archivo definido como de Proceso y otro de validación; consulte con su área de sistemas para conocer cuál es el de proceso. El de proceso se usa para asentar efectivamente las operaciones en el sistema, mientras que el de validación tiene como propósito verificar que todas las operaciones se hayan cargado. Para cargar operaciones, desde liquidaciones de bolsa o desde el archivo SIOPEL, proceda como sigue:

- 1. Ingrese al Módulo Carga BOF.
- 2. Desde archivo de Liquidaciones.
 - a. Seleccione la opción CargaMEC. Le aparecerá la pantalla para elegir el archivo, como se muestra en la figura:

MEC	Fuente	Fecha de Hi Portafolio	Depósito	NumDevDvI	legocio No	Urden No. Punta	Posición	Especie	Cantidad	
	MEC	06/10/2014 CLIMAR1	DCV	COL17CT02	1428	1428 VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000,0	Fecha Registro 06/10/2014 -
	MEC	06/10/2014 CLIMAR1	DUV	CULT/CTU2	1566	1566 VENTA	TUUNTA	TFIT162407	500,000,0	
CargaMESA										
🔼										Datos Venta
Cargar MEC										Fecha Registro
										Cantidad
										Valor Compra
Ventas/Calce			C							No. Operación Fecha Emisión
88				 Cargue ME 	C					Fecha Vence
탱명				Cargue Autor	nático					Tasa Nominal
Fiddesa				Archivo (*.ta	0					··· 📈 Validar NumOrden
\$		-								Tipo Cpr.
TODAS				Tipo de Carg						
1000				C MEC						FechaLarga
Reg. ISINES				C Excel						106/10/2014
				🔽 Borrar Fer	ha antes de	cargar				
MiDia										
Salir										Cantidad
									Errores 💊	Aceptar 🔀 Cerrar Valor Compra
			Į.							Fecha Emisión
										Especie Fecha Vence
										Punta Tasa Nominal
										Depósito NumOrden
										N.DcvDvl/ISIN Tipo Cpr.
										CAL 74D
										CALZAR
	-								•	

- b. Elija el archivo de liquidaciones y pulse Aceptar. Si los archivos de liquidaciones son los de validación, le aparecerá seleccionada la casilla "Validar" y al terminar la carga el sistema confrontará estas operaciones contra las de proceso(SIOPEL), por lo que es importante que antes se haya cargado el archivo de proceso. El sistema procesará las operaciones presentes en el archivo. Si se presentan errores pulse en el botón Errores y le aparecerá la lista de inconvenientes hallados en el archivo. Corríjalos e intente nuevamente.
- 3. Desde archivo SIOPEL.
 - a. Seleccione la opción CargaMESA. Le aparecerá la pantalla para elegir el archivo, como se muestra en la figura:

Software S.A.S

PWPREI – RIESGO E INVERSIONES

MEC	Fuente MEC	Fecha de Ri Portafolio 06/10/2014 CLIMAR1	Depósito DCV	NumDevDvl Neg COL17CT02	ocio No Orde 1428	n No. Punta 1428 VENTA	Posición CORTA	Especie TFIT162407	Cantidad 500,000,0	Fecha Registro	06/10/2014
CargaMESA	MEC	06/10/2014 CLIMAR1	DCV	COL17CT02	1566	1566 VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000,0		
b										Datos Venta	
Cargar MEC										Fecha Registro	Cantidad
1										Portafolio	Valor Compra
Ventas/Calce			ſ	Pt. Carque MEC						No. Operacion	Fecha Emisión
€/ē				Cargue Automáti	0				_		Fecha Vence
Procesar	•		_	Archivo (*.txt)						🗖 Validar	NumOrden
TODAS				- Tipo de Carga							Tipo Cpr.
1000				C MEC						FechaCarga	
Reg. ISINES				C Excel						106/10/2014	
Q				V DOIIal Fecha	antes de calç	a					
MiDia											Cantidad
Sair									Errores	Aceptar 🔀 Cerrar	Valor Compra
									V		Fecha Emisión
										Especie	Fecha Vence
										Depósito	Tasa Nominal NumOrden
										N.DcvDvl/ISIN	Tipo Cpr.
											CALZAR

- b. Elija el archivo de liquidaciones y pulse Aceptar. Si los archivos SIOPEL son los de validación, le aparecerá seleccionada la casilla "Validar" y al terminar la carga el sistema confrontará estas operaciones contra las de proceso(MESA), por lo que es importante que antes se haya cargado el archivo de proceso. El sistema procesará las operaciones presentes en el archivo. Si se presentan errores pulse en el botón Errores y le aparecerá la lista de inconvenientes hallados en el archivo. Corríjalos e intente nuevamente.
- 4. Asignar el Portafolio. Si el archivo SIOPEL es el de proceso, el campo portafolio estará vacío o sin definir (SINPOORTAFOLIO), por lo que una vez cargadas las operaciones deberá asignárselo a cada operación. Proceda:
 - a. Pulse Doble Click sobre la grilla, arriba o abajo. Si sobre esa línea el campo Portafolio aparece vacío o con la palabra "SINPORTAFOLIO", el sistema habilitará al lado derecho una casilla para elegirlo y un botón "ASIGNAR" para que una vez elegido el sistema lo asocie a la operación, como se ve en la pantalla:

Software S.A.S

PWPREI – RIESGO E INVERSIONES



- b. Elija el portafolio y luego pulse Asignar para que la operación quede asignada al portafolio seleccionado.
- 5. Calzar. Calce las operaciones de manera normal, como lo hace hoy.
- 6. Procesar las operaciones. Pulse el botón Procesar y en la pantalla siguiente Aceptar para hacer efectivas las operaciones en el sistema. Si hay errores pulse el botón Errores para que los identifique y pueda corregirlos. Algunos mensajes, como "Operación ya procesada", no son errores si no mensajes informativos.

9.1.3. CARGAR MEC

Esta opción le permite cargar un archivo plano de liquidaciones para agregarlas al conjunto de proceso. Para cargar un archivo pulse el botón "Cargar MEC". Le aparece lo siguiente:



	- Datoc Venta
🖏 Cargue MEC	
Cargue Automático	
Archivo (*.txt)	
Tipo de Carga	
	FechaCarga
C Excel	17/03/2014
Dirar Fecha antes de cargar	
Errores	Aceptar 🔀 Cerrar

Seleccione el archivo plano a cargar y pulse aceptar. Si se presentan errores en la carga se le habilitará el botón errores que le permite la lista de los mimos para que proceda a corregirlos y repita la carga. Los errores tienen que ver con temas como: Existencia de la Especie, existencia de la Contraparte, el Trader y similares. Una vez cargado el archivo pulse "Cerrar".

9.1.4. CALCE / VENTAS

Esta opción le permite calzar las ventas con títulos que tenga en el portafolio. Estos pueden venir en el mismo archivo o estar ya presentes de días anteriores. Al pulsar el Botón "Ventas/Calce" le aparece un apantalla con la lista de ventas en la grilla superior, como se ve en la imagen:



MEC	Fuente	Fecha de Ri Portafolio De	epósito NumDovDvINe	aocio No Order	No. Punta	Posición	Especie 0	antidad		
	MEC	17/03/2014 ACF EMPRE D0	TFIT162407	95	95 VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000,0		
Cargar MEC										
Ventas/Calce										
									Datos Venta	
×										
									Fecha Registro	Cantidad
Filocesai									Portafolio	Valor Compra
									No. Operación	Fecha Emisión
									Especie	Fecha Vence
									Punta	Taga Nominal
Salir										
									Datos Compra	
	•							F.	Fecha Registro	Cantidad
									Portafolio	Valor Compra
									No. Operación	Fecha Emisión
									Especie	Fecha Vence
									Punta	Tasa Nominal
										CALZAR
	-							•		

Para calzar una venta pulse doble click sobre la línea. En la grilla inferior le aparecen las operaciones cuyos títulos tienen las mismas características faciales y pueden calzar con esa venta:

MEC Cargor MEC Verstar/Calce Procesar	Fuerte Facha de Ri (Potada Depósito MEC 17/03/2014 (ACF EMPŘE OCV	NumDev2raf (Negocio No Claden No (Punta 1471168/200) 95 95 95 VENTA	(Poseón (Especie (Canidad ICORTA TETTIS240) 500.000,0	Patos Venta 500,000,000.0 Pecha Registro 17/03/2014 Cantidad Son,000,000.0 ACF EMPRESA Valor Compra Son,002,000.0 95 Fecha Emisión No. Operación 95 Fecha Emisión Especie TFT16240724 Fecha Vence Punta VENTA Tasa Nominal
	Fuerte [Fecha de Ri Portafolio Depósito MEC 17/03/2014 ACF EMPRE DCV MEC 17/03/2014 ACF EMPRE DCV	NumDevDvl [Negocio No [Orden No. Punta THT152407 158 158 00MPRA TRIT162407 26 26 COMPRA	Postción Especie Carridad LARGA TRITI62407 500.000,0 LARGA TRITI62407 500.000,0	Datos Compra Fecha Registro Cantidad Portafolio Valor Compra No. Operación Fecha Emisión Especie Fecha Vence Punta Tasa Nominal

Seleccione una con un doble click sobre la línea en la grilla inferior. Al lado izquierdo le aparecen: arriba los datos de la venta y abajo los datos de la compra que seleccionó para calce:



MEC	Fuente	Fecha de Ri Portafolio	Depósito	NumDevDvl N	egocio No Orden	No. Punta	Posición	Especie Car	ntidad	
Cargar MEC	MEC	17/03/2014 ACF EMPRE	DCV	TFIT162407	95	95 VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000,0	
Ventas/Calce										
1										Datos Venta
										Cantidad 500,000,000.0
Frocesar										Portafolio ACF EMPRESA Valor Compra 635,769,000.0
										No. Operación 95 Fecha Emisión 24/07/2008
										Especie TFIT16240724 Fecha Vence 24/07/2024
										Punta VENTA Tasa Nominal 10.0
Salir										
										Datos Compra
	•								•	Fecha Registro 17/03/2014 Cantidad 500,000,000.0
	Evente	Fecha de P. Portafolio	Denésito	NumDouDul N	erecio No Orden	No. Punta	Posición	Econocio Car	stidad	Portafolio ACF EMPRESA Valor Compra 635,769,000.0
	MEC	17/03/2014 ACF EMPRE	DCV	TFIT162407	158	158 COMPRA	LARGA	TFIT162407	500,000,0	No. Operación 158 Escha Emisión 24/07/2008
	MEC	17/03/2014 ACF EMPRE	DCV	TFIT162407	26	26 COMPRA	LARGA	TFIT162407	500,000,0	Especie TFIT16240724 Eacha Vanca 24/07/2024
										Punta COMPRA
										CALZAR
	•								F.	

Pulse el botón "CALZAR" para registrar el calce.

1. Procesar.

Está opción le permite vaciar al portafolio las operaciones cargadas desde el archivo. El sistema realizará también los calces que usted haya indicado. Al pulsar "Procesar" le aparece la pantalla:

🛓 Carga de Datos			x
Cargue Automático			
Archivo (*.txt)			
	Fecha Carga	17/03/2014 🗨	
I Tipo	Archivo = Excel 🔲 Vista 🔽 Pl	anoMercado	
2	Exportar Vista	Errores Aceptar	Cerrar

Pulse aceptar para que el sistema proceda a vaciar las operaciones en el portafolio. Si se presentan errores en el proceso se le activará el botón "Errores" para que los revise.



9.1.5. REG ISINES

Esta opción le permite actualizar el ISIN de una o varias operaciones desde un archivo Excel con la estructura descrita a continuación. Como siempre en PWPREI, la primera fila es el encabezado, los datos a partir de la segunda fila:

- **Fecha de registro**: Debe indicarse Fecha de Registro actual del sistema o del portafolio donde está la operación.
- **NumOrden (Folio)**: Corresponde al número que ha asignado a la operación en el campo NumOrden. Según su esquema operativo puede ser:
- 1. Operaciones cargadas de las liquidaciones de bolsa: El Folio o número de la operación en bolsa, registrado en el campo Nro. de Orden en PWPREI. Para el caso de las simultáneas se toma: ACTIVAs, el que referencia el registro de compra; PASIVAs, el que referencia el registro de venta.
- 2. Operaciones registradas libremente por usted manualmente, por Excel, por vista o por store procedure: Es simplemente el dato que haya registrado en ese campo para la operación.
- **Depósito**: Código del depósito en donde se encuentra la inversión: DCV, DVL, CLSTR, DOMESA, SETECSA, FISICO, NINGUNO, etc., los códigos utilizados en su instalación.
- **Cantidad:** Valor Nominal del título en la inversión.
- **Especie**: Nemotécnico del título de la inversión.
- **Portafolio**: Portafolio donde está registrada la inversión
- **ISIN**: ISIN que se asignará a la inversión.
- Archivo: La tabla siguiente es un ejemplo del archivo:

FechaReg istro	NumOrden(Folio)	Depo sito	Cantidad	Especie	Portaf olio	NUEVO ISIN/NUmdcvDv I
15/07/201			1,000,000,	TFIT152		COL58CT02334
4	201	DCV	000.00	40720	XXX	
15/07/201			29,712,000	BPEMINH	SANIT	
4	487	DVL	.00	TA4	AS	COL92CB61822

 Para procesar el archivo diríjase al módulo *Carga Operaciones Mercado - carga BOF*, seleccione la opción MEC > Reg. ISINES. Al seleccionar esta opción se habilitará la ventana para seleccionar el archivo para el cargue. Al pulsar Aceptar se procesará el archivo para cargar los ISINES a las inversiones indicadas.



CARGA OPERACIONES MERCADO	MT-1-5 Manual PM	Apple Copy & Black Street	- The other
MEC Fuente Fecha de Po Po	ntatolio Depósito NumDovDvi Negocio No Olden No. Punta	Posición Especie Carilidad	. Fecha Re
			Datos Venta
			Fecha Registro
Ventas/Calce			Portafolio
86			No. Operación
Processor	Cargue MEC		
	Cargue Automatico		
TODAS	Aichivo (1.04)		
335	Tipo de Carga		FechaCama
RegITERNES	C MEC		11/07/2014
Salı	Borrar Fecha antes de cargar		
Evente Eacha de B. Pr	stabile. [Passinte]	Enores	Aceptar 🔀 Cenar
Organizar V Nueva ca	II (C:) → exe pwp → 17072014 -	• 4 • Buscar 17072014 8☷ ▼	
-	Nombre	Fecha de modifica Tipo	
Descargas	Eigenen la Caraca Actualiza ISIN, Nume Dau Dat	17/07/2014/11/20 a Heis de	cálculo d
Descargas	EjempioCargaActualizatstiv_NumDevDvi	17/07/2014 11:29 a Hoja de	calculo d
		21/07/2014 11:00 a Hoja de	calculo d
 ⇒ Bibliotecas ⇒ Documentos ⇒ Imágenes ♦ Música ♦ Vídeos 			
Equipo			
Nomb	re: uebaCarque.xlsx	 Archivo (*.txt;*.xlsx;*.dat; 	*.csv) 🔻

Si la información registrada en el archivo es correcta y corresponde con una inversión del portafolio, se efectuara la descarga:

-

Abrir

Cancelar



A OPERACIONES	Fecha da Bi Potafolio	Denósto	NumDevDvl	Nettorio No.	Orden No.	Punta	Posición	Especie	Cantidad				
											Fecha	Registro	11/07/2014 💌
											- Datos Venta Fecha Registro		Cantidad
æ											Portafolio		Valor Compra Fecha Emisión
		Cargue	re MEC Automático										Fecha Vence Tasa Nominal NumOrden
s		Tipo de	vo(".txt) C:\e Carga	xxe pwp\1707	2014\Prueb	aCargue.xlsx BackOffice			<u> </u>		FechaCarga		Tipo Cpr.
		C ME © Exc □ Bor	C :el rar Fecha ante	s de cargar		1	Información	Cargada			11/07/2014		
•								Aceptar]	6			Cantidad Valor Compra
Fuente	Fecha de Bi Portafolio				L			-	d rores	Ace	sptar 🔀 Cerrar		Fecha Emisión Fecha Vence
											Punta Depósito		Tasa Nominal NumOrden
											N.DCVDVI/ISIN		Tipo Cpr.

Si hay errores en la información suministrada el sistema activa el botón Errores, púlselo para revisar y corregir:

		Teposito Hamberd	/I Negocio No Urden N	o, Punta	Posicion	Especie	Cantidad		Fecha Registro
Cargar MEC									
								-Datos Venta	
Ventas/Calce								Fecha Registr	0
₽@								No. Operació	n
Procesar		Cargue I	VIEC tomático						
TODAS		Archive	*.txt) C:\exe pwp\170	2014\PruebaC	argue.xlsx				
Reg. ISINES		Linea 3	CargaAutomaticaMEF	: No se enconti	ó la operación	, o hay más d	e una, para los datos de	la fila.	
Salir									
	Fuente Fecha de Ri Portafolio	Depósito					Errores	Aceptar 🗵	Cerrar



• Para verificar que el proceso haya asignado el ISIN correctamente a cada inversión relacionada en el archivo, simplemente consúltelas:

9.1.6. MI DIA

Seleccione la opción MiDia. Le aparecerá la pantalla como se ve a continuación:

MEC	🗧 Informe de Operac 💻 🔍 🗙	NumDovDvI Negocio No Urden No. Punta Posición	Especie Cantidad	
Cargar MEC	✓ Fecha Inicial ✓ Fecha Final 20/10/2014 20/10/2014			Fecha Hegistro 20/10/2014 💌
\swarrow	Nivel Nombre Nivel			Datos Venta
Ventas/Calce	Usuario Trader			Portafolio Valor Compra
影电 Procesar				No. Operación Fecha Emisión
\$	Tipo Operación			Especie Fecha Vence
TODAS				Punta Tasa Nominal
dada	Aceptar 🔀 Cerrar		4	N.DcvDvl/ISIN Tipo Cpr.
Reg. ISINES				
Q				
Salır				Datos Compra
				Fecha Registro Cantidad
				Portafolio Valor Compra
				No. Operación Fecha Emisión
				Punta
				Depósito NumOrden
				N.DcvDvl/ISIN Tipo Cpr.
				CALZAR
				CALLAN
	•		4	

- 1. En la pantalla "Informe de Operaciones" establezca los parámetros de búsqueda para generar el informe. Chequee la casilla arriba de cada parámetro para escribir en él la condición deseada; las casilla no chequeadas no se tendrán en cuenta para la búsqueda.
- 2. Una vez establecidas las condiciones, pulse Aceptar. La grilla inferior se llenará con las operaciones que cumplan con los criterios indicados y al lado derecho le aparecerá un botón para exportar el informe, tal como se ve en la figura:



MEC	Fuerte Fecha de R. Fontalolio Depósito NumDovDv/ Negocio No Orden No. Punta Posición Especie (Certidad	Fecha Registro 20/10/2014 💌
Ventas/Calce	Image: Postaclio NumNegoo: TipoOperac; NomContaf (NAContaPs (NomTindor TasaCalce (NonEmicor Maintegoo: NamNegoo: TipoOperac; NomContaf (NAContaPs (NomTindor TasaCalce (NonEmicor Maintegoo: NamNegoo:	Pactos Venta Fecha Registro Cantidad Portafolio Valor Compra No. Operación Fecha Emisión Especie Fecha Vence Punta Tasa Nominal Depósito NumOrden N.DcvDvI/ISIN Tipo Cpr.
Sair		Datos Compra Fecha Registro Cantidad Portafolio Valor Compra No. Operación Fecha Emisión Especie Fecha Vence Punta Tasa Nominal Depósito NumOrden N.DcvDvI/ISIN Tipo Cpr.

3. Exportar el Informe. Pulse en el botón Exportar y seleccione el archivo destino del informe; si no le aparece la pantalla para seleccionar el archivo pulse Alt + Tab y elija la ventana de seleccionar archivo. Pulse Aceptar y el informe quedará en Excel en el destino elegido por usted.

9.1.7. CUSTODIOS

Administrador de Custodios.

Lo primero que se debe hacer para manejar custodios en su instalación PWPREI es crear los custodios. Proceda como sigue:

a. Ingrese a "Mercado y Sociedad – Histórico Mercado – Custodios". Aparece una pantalla como la siguiente:



💻 😼 🚨 🧕	<u>' 🗟 🔗 🖉 💔 </u>		
Historico Medo	CodigoCustodio	NombreCustodio	NitCustodio
	NOCUSTODIO	SIN CUSTODIO	0
	PWP	PWP SOFTWARE SAS.	9003380734
E 3			
Alterna RF			
91			
N 🕅			
Precios			
Acciones			
17			
Festivos			
Deposito			
(Sal			
<u>e</u>			
Lustodios			
Mercado			
Valores de			
Especies			
Negocios			
INFOVAL			
Valores Super			
Forwards/Opc.			

- b. Utilice los botones ya conocidos para Ingresar, Modificar y Eliminar Custodios.
- c. No toque el custodio por defecto de código "NOCUSTODIO". Este es necesario para que el sistema procese portafolios que no lo requieren.

Una vez haya registrado sus custodios, proceda asignar un custodio a cada portafolio que usted administre. Para ello ingrese a "Definición de Parámetros – General – Portafolios". Seleccione cada portafolio y pulse Modificar. Le aparece una pantalla donde se incluye el campo "Custodio" para que lo asigne al portafolio:



🔒 Portafolio - Modificar	
Nombre	
Tipo GEN 💌	Linea de Negocio REAL 🗨
Beneficiarios 02	Custodio NOCUSTODIO NOCUSTODIO PWP
Tipo de Fondo/Fidecomiso OTROS Y DE GARANTÍA 💌 Bloquear NO 💌	Codigo Fondo/Fideicomiso 0 Estado ACTIV0
	Aceptar 🔀 Cerrar

A aquellos portafolios que no requieren custodio asígneles "NOCUSTODIO".

Se debe activar el manejo de Custodios en el sistema, de lo cual se ocupará su área de sistemas. Una vez hecho esto, PWPREI empezará a registrar cada operación que se realice en el día con su correspondiente control de estado frente al custodio de su portafolio. Una operación puede estar en los siguientes estados:

- NOCUSTODIO: Significa que el portafolio donde se encuentra la operación no está asociado a un custodio. Estas operaciones no serán involucradas en los archivos para custodios.
- SINGENERAR: Estas operaciones no se han incluido en ningún archivo de envío a custodios, por tanto están pendientes de completar su proceso.
- GENERADA: Significa que la operación ya fue incluida en un archivo de envío a custodios.
- CANCELADA: Operación que se envió inicialmente al custodio y luego se volvió a enviar para cancelarla.

Para la consulta de Estado y Generación de Archivos.

Utilice las siguientes funciones para consulta de estado y generación de archivos:

a. Consulta.



Para conocer el estado de las operaciones realizadas en el día, ingrese al módulo "CargaBOF" y utilice la opción "Custodios" para gestionar el estado de las operaciones y generar archivos. Le aparece la pantalla como sigue:

MEC	NumNegocio	EstadoCustodioUlt	IncluirComo	FechaRegistro	Portafolio	CodigoCustodio	Fecha Registro
	XXZ82	CANCELADA	NO INCLUIR	02/02/20	5 🔆	PWP	GENERADAS
	XXZ87	GENERADA	NO INCLUIR	02/02/20	<u>5 ××</u>	PWP	Nivel Nombre Nivel
CargaMESA	YYZ83	NUCUSTUDIU	NU APLICA	02/02/20	500	NUCUSTUDIU	
Lab.	11284	NOCUSTODIO	NO APLICA	02/02/20		NOCUSTODIO	Dates Venta
	112.00	NOCOSTODIO	NO AFEICA	02/02/20	2 11	NOCOSTODIO	
Cargar MEC			Λ				Fecha Registro
1			11				Portafolio Valor Compra
Ventas/Calce			u				No. Operación Fecha Emisión
AR							Especie Fecha Vence
Procesar							Punta Tasa Nominal
	•						▶ Depósito NumOrden
TODAS	NumNegocio	EstadoCustodioUlt	IncluirComo	FechaRegistro	Portafolio	CodigoCustodio	N.DcvDvl/ISIN Tipo Cpr.
	XXZ86	SINGENERAR	GENERADA	02/02/201	5 🔆	PWP	
20202	XXZ88	SINGENERAR	GENERADA	02/02/201	5 ××	PWP	
Reg. ISINES			Α				
			$\mathbf{\Lambda}$				
MiDia			זר				Datos Compra
हि			•				Fecha Registro
Custodios							Portafolio Valor Compra
Salir							No. Operación Fecha Emisión
							Especie Fecha Vence
							Punta Tasa Nominal
							Depósito NumOrden
							N.DcvDvl/ISIN Tipo Cpr.
							Generar CALZAR
							PENDIENTES
				V 1V	Y		

Se destaca en la pantalla:

- Grillas. El contenido de las grillas es:
 - La grilla de arriba muestra las operaciones que ya fueron generadas en algún archivo y las que están dentro de portafolios no asociados a un custodio.
 - La grilla inferior muestra las operaciones que se encuentran en portafolios asociados a un custodio y que aún no han sido generadas en un archivo.
- Área consulta. En la esquina superior derecha puede ver los componentes que le permiten definir y refrescar lo que desea consultar:
 - Fecha de Registro. Es la fecha de proceso en que desea pararse. Se mostrarán solo las operaciones que hayan sido realizadas en esa fecha; es decir, aquellas cuya Fecha de Operación es la indicada y no todas las vigentes a la fecha.
 - Nivel y Nombre Nivel. Estos datos le permiten establecer el grupo que desea consultar. Por ejemplo, puede indicar Nivel = "Portafolio" y en Nombre = "Nombre portafolio" a consultar. Debe seleccionar la casilla arriba de Nivel para poder hacer esta selección.
 - Botón Refrescar. Utilice este botón una vez haya establecido las condiciones de consulta, para refrescar la información en las grillas.
- Etiquetas. Las etiquetas al lado derecho de las grillas le indican la clase de información que hay en cada una: GENERADAS y PENDIENTES.
- Columnas 2 y 3 de las grillas. Estas columnas le indican los estados:
 - Columna 2. Indica el estado actual de las operaciones.



- Columna 3. Indica que se va a hacer en este paso de procesamiento con cada operación; es decir, el estado al que se va a llevar dicha operación.
- b. Selección de Operaciones. Puede generar los archivos con todas las operaciones de la grilla inferior, o puede establecer si desea excluir alguna de esa grilla y también puede incluir de las de la grilla superior. Para cambiar la acción a realizar con una operación particular, de arriba o de abajo, simplemente párese en la línea de la operación y pulse doble click. Si tiene permisos para ejecutar esta acción, la columna 3 cambiará de estado. Los estados de esta columna pueden ser:
 - i. Grilla de abajo:
 - 1. GENERADA: se va generar en el archivo y pasará a ese estado.
 - 2. NO INCLUIR: no se generará en el archivo, se excluye y seguirá en el estado indicado en la columna 2.
 - ii. Grilla de arriba:
 - 1. CANCELADA: se incluirá como una orden de cancelación.
 - 2. GENERADA: se incluirá como GENERADA. Esto aplica si el anterior archivo en que se incluyó realmente nunca se trasmitió al custodio.
 - 3. NO INCLUIR: no se generará en el archivo, se excluye y seguirá en el estado indicado en la columna 2.
 - 4. NO APLICA: este no se puede cambiar pues corresponde a portafolios sin custodio.
- c. Generación de archivos.

Utilice el botón Generar para producir el archivo. En el archivo se incluirán todas aquellas operaciones que usted dejó en la columna 3 como GENERADA o CANCELADA, las demás no se incluirán.

Los archivos quedarán en la carpeta "Custodios" del ambiente PWPREI respectivo, con un nombre de la siguiente forma: PWP_20150202_000012.xlsx, donde:

- PWP: Código del custodio.
- 20150202: Fecha de las operaciones.
- 000012: Número del archivo.

Cada vez que genere un nuevo archivo se le dará un número único que lo identifique. Una vez generado el archivo puede utilizar el botón "Refrescar" para ver el nuevo estado de las operaciones.

Para la consulta de Estado de ENVIO y Validación de Archivos.

Los archivos generados en el sistema deberán ser trasmitidos al custodio efectivamente.



Para mantener un control de sus trasmisiones, usted debe informarle al sistema lo ocurrido con tales archivos y sus correspondientes operaciones. Para ello utilice las siguientes funciones para consultar el estado y Validar el ENVIO de los archivos:

a. Consulta.

Para conocer el estado de las operaciones realizadas en el día, sobre el envío, utilice la opción "Custodios" y pulse Validar Archivo en la esquina superior derecha. Le aparece debajo el número del último archivo generado. Pulse Refrescar para ver los estados de las operaciones incluidas en él. Verá la pantalla como sigue:



Se destaca en la pantalla:

- Grillas. El contenido de las grillas es:
 - La grilla de arriba muestra las operaciones que ya fueron Validadas en algún momento y las que están dentro de portafolios no asociados a un custodio.
 - La grilla inferior muestra las operaciones que se encuentran en portafolios asociados a un custodio y que aún no han sido Validadas.
- Área consulta. En la esquina superior derecha puede ver los componentes que le permiten definir y refrescar lo que desea consultar:
 - Fecha de Registro. Es la fecha de proceso en que desea pararse. Se mostrarán solo las operaciones que hayan sido realizadas en esa fecha; es decir, aquellas cuya Fecha de Operación es la indicada y no todas las vigentes a la fecha.
 - Archivo. Puede seleccionar debajo de "Validar Archivo" el archivo que desea validar. Siempre le aparece el último por defecto.
 - Botón Refrescar. Utilice este botón una vez haya establecido las condiciones de consulta, para refrescar la información en las grillas.



- Etiquetas. Las etiquetas al lado derecho de las grillas le indican la clase de información que hay en cada una: ENVIADAS y NO ENVIADAS.
- Columnas 2 y 3 de las grillas. Estas columnas le indican los estados:
 - Columna 2. Indica el estado actual de las operaciones.
 - Columna 3. Indica qué se va a hacer en este paso de procesamiento con cada operación; es decir, el estado al que se va a llevar dicha operación.
 - b. Selección de Operaciones. Puede validar todas las operaciones de la grilla inferior, o puede establecer si desea excluir alguna de esa grilla y también puede incluir de las de la grilla superior. Para cambiar la acción a realizar con una operación en particular, de arriba o de abajo, simplemente párese en la línea de la operación y pulse doble click. Si tiene permisos para ejecutar esta acción, la columna 3 cambiará de estado. Los estados de esta columna pueden ser:
 - iii. Grilla de abajo:
 - 1. ENVIADA: se va a validar y pasará a ese estado.
 - 2. NO INCLUIR: no se validará, se excluye y seguirá en el estado indicado en la columna 2.
 - iv. Grilla de arriba:
 - 1. NOENVIADA: se marcará como NOENVIDA.
 - 2. NO INCLUIR: no se validará, se excluye y seguirá en el estado indicado en la columna 2.
 - 3. NO APLICA: este no se puede cambiar pues corresponde a portafolios sin custodio.
 - c. Validar de archivos.

Utilice el botón Validar para validar el estado de ENVIO de las operaciones que seleccionó; es decir, aquellas que en la columna 3 dejó en un estado distinto a "NO INCLUIR". Se validarán, pasándolas al estado indicado en la columna 3, todas las operaciones de la lista.

Al final del proceso pulse "Refrescar" para ver los nuevos estados de ENVIO.

Cada vez que genere un nuevo archivo, las operaciones quedarán en estado NO ENVIADA hasta que usted les valide el estado.

Para la Auditoría.

Consulte el movimiento completo de los archivos y operaciones, en relación a sus custodios, ingresando al módulo de Auditoría, opción Custodios.



9.1.8. SECUENCIAS - PYGCORTOS

Hemos implementado el control de operaciones en corto y en general el seguimiento de todas las operaciones que se arman a partir de un origen; es decir, hay un calce de por medio:

- 1. **Registro de secuencias**. Las secuencias son encadenamientos de operaciones que se generan en la siguientes circunstancias:
 - a. Al Vender un título.
 - b. Al hacer una simultánea.
 - c. Al cubrir una simultánea.
 - d. Al partir una operación.
 - e. Al unir dos operaciones.

Para cada una de las acciones anteriores se genera un conjunto de secuencias de control, agrupando cada acción con un identificador.

- 2. **Reversiones**. Las reversiones aplican para todos los casos en que se registre un conjunto de secuencias, como los mencionados en el punto anterior. De esta forma se puede reversar:
 - a. La acción de vender.
 - b. La acción de cubrir
 - c. La acción de partir.
 - d. La acción de unir.

Para reversar una acción seleccione reversar y en la lista que el sistema le presenta comúnmente seleccione cualquiera de los componentes de la acción. El sistema reversará la acción completa quitando el conjunto de operaciones que la generaron y recuperando la o las operaciones a su estado original.

- 3. **Informe**. Ingrese a CargaBOF para emitir informes asociados a las acciones anteriores. El informe le permite conocer la secuencia de operaciones que han ido participando. Cuando se trata de operaciones en CORTO el sistema procura asociar desde la operación inicial hasta la última que permite cubrir el corto final y el cumplimiento. Sin embargo para que se pueda ver el proceso completo este debe haber nacido con la versión VREI2016ROP_SEC ya instalada. Ingrese al módulo y seleccione:
 - a. MEC
 - b. PyGCortos
 - c. En la casilla amarilla (número de operación) indique la operación a consultar. El sistema le mostrará las secuencias asociadas a la operación. Los ingresos y egresos son un referencia de los valores involucrados en cada acción ejecutada. Luego pulse el botón PygCortos y en la pantalla le aparece el informe:





4. Recuperaciones. No se debe confundir la opción de reversar operaciones asociadas con la facilidad de recuperar operaciones eliminadas. Recuerde que dispone de la utilidad "RECUPERAR" para reinsertar cualquier operación que haya sido previamente eliminada; sin embargo, debe usarla exclusivamente para operaciones explícitamente eliminadas por la opción "Eliminar" no operaciones que hayan sido eliminadas producto de un calce, un cubrir, partir o un ir.

10.CONTABILIZAR



La Interfaz Contable permite tener un control sobre los movimientos contables.

Para llevar a cabo la contabilización de los movimientos se debe tener en cuenta:

 Parametrización de Movimientos. Para que PWPREI pueda conocer los movimientos que debe realizar cada vez que se afecte el portafolio, es necesario detallarle tales movimientos. Inicialmente nosotros le entregamos una tabla de parámetros debidamente cargada en su sistema. Usted puede adicionar o modificar esta tabla o asociar especies a otra ya parametrizada. Para ello ingrese por el módulo "Definición de Parámetros – PWPREI – Parámetros Contables". Aparece la siguiente pantalla:



DEFINICION D	E PARAMETRO	S - [Parametr	os Contables]									_ 2
Archivo Gener	ral Super Valores	PWPREI Con	traPartes Ventana									- 6
چ 🖻 🕼	V											
PWPREI	TipoPUC	Destino	TipoCompromiso	TipoContra	TipoInversion	Punta	Especie	FechaEmision	FechaVencimiento	Evento	ValorFuente	PUCBas
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	OBLIGACION	23652501
an l	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PERDIDA	34141501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PERDIDA	51380501
- A D	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PYGCPR	27959501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	DERECHO	15650501
4.44	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	DERECHO	23650501
A	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	OBLIGACION	15652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	OBLIGACION	23652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	NEGOCIAR	DERECHO	23650501
~	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	NEGOCIAR	OBLIGACION	23652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGCPRD	51390501
8.0	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGCPRI	41390501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDERD	23650501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDERI	23650501
<u> </u>	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDIFD	34141501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDIFI	34141501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGOBLD	23652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	COMPRA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGOBLI	23652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	DERECHO	23650601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	OBLIGACION	23652601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PERDIDA	34141501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PERDIDA	51380601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	CUMPLIR	PYGCPR	27959501
~	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	DERECHO	15650601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	DERECHO	23650601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	OBLIGACION	15652601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	MAYDER	OBLIGACION	23652601
80	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	NEGOCIAR	DERECHO	23650601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	NEGOCIAR	OBLIGACION	23652601
General	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALOBAR	PYGCPRD	51390601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGCPRI	41390601
aper Valores	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALOBAR	PYGDERD	23650601
ontrapartes	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDERI	23650601
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA.	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDIFD	34141501
Emisor	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA.	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALORAR	PYGDIFI	34141501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALOBAR	PYGOBLD	23652501
	FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	VENTA	COP/TRM	NA	NA	VALOBAB	PYGOBLI	23650601
						1	1		1		-	
	Registro(s) 13943											
	,()											

- 2 Generación de movimientos:
- a. Activación. Para que PWPREI genere los movimientos se deben activar los parámetros generales 8000 (Funciones de BackOffice), 8001 (Movimientos Contables), 8002 (Log del Portafolio) y 8003 (Notificaciones). Esto hará que PWPREI en su próximo ingreso empiece a generar los movimientos. Nota: La activación de estos parámetros se hace directamente en la base de datos de la aplicación
- b. Generación. Los movimientos se generan cuando:
 - Ingrese una nueva posición al portafolio.
 - Cuando utilice los botones Comprar y Vender.
 - Cuando valorice el portafolio, especificando la opción "Contabilizar".
- c Activación nueva interfaz con "Definición Contable". Para que la interfaz empieza a aplicarse con el nuevo formato, solicite a su área de TI la activación del parámetro general 8121; o si tiene acceso hágalo mediante la opción "SetParGen" ubicando el parámetro con el número 8121.
 - i. Generar la interfaz. Para generar la interfaz con esta definición al módulo "Contabilizar" y proceda:
 - i. Consulte los movimientos de la forma corriente, como siempre lo hace.
 - ii. Una vez tenga los movimientos en pantalla, utilice el botón "Grabar Plano" para armar el archivo.
 - iii. Una vez le salga la ventana con el archivo armado, pulse el botón "Guardar Archivo" para grabarlo en disco.



🔜 Doo	cumento Contable	- Tabla							- 0	×
	EVENTO	FECHACONTAB	FECHAREGISTRO	FECOPER	NUMNEGOCIO	DESCRIPCION	PUCBAS	MOVIMIENTO	DEBITOS	•
•	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13895	1: Compra de Tit	151606101001	DEBITO	719255000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13895	1: Compra de Tit	151626101001	CREDITO	0	7
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13896	1: Compra de Tit	151605101001	DEBITO	1439000000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13896	1: Compra de Tit	151625101001	CREDITO	0	1
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13897	1: Compra de Tit	151606101001	DEBITO	1151600000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13897	1: Compra de Tit	151626101001	CREDITO	0	1
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13898	1: Compra de Tit	151605101001	DEBITO	1728000000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13898	1: Compra de Tit	151625101001	CREDITO	0	1
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13899	18: Cobro de Re	151606101001	CREDITO	0	1
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13899	18: Cobro de Re	151626101001	DEBITO	1151600000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13899	18: Cobro de Re	168795101003	DEBITO	212000	0
	NEGOCIAR	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13899	18: Cobro de Re	413835101001	CREDITO	0	2
	REVERSA	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13900	18: Cobro de Re	151605101001	DEBITO	1728000000	0
	REVERSA	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13900	18: Cobro de Re	151625101001	CREDITO	0	1
	REVERSA	03/07/2018	03/07/2018	03/07/2018	XXZ13900	18: Cobro de Re	168795101003	CREDITO	0	2 🗸
<			-							>
Hegistros: 20 Total Débias: 9.646.027.000.00 Créditos: 9.646.027.000.00 Décreocia: 0.00										
Fyordar Grahar Plano Grahar Tahla Canodar										

- 3. Para contabilizar los movimientos generados por PWPREI utilice el presione el botón "Contabilizar" en el menú principal:
 - a. Debe seleccionar la fecha contable. El sistema mostrara la lista de movimientos que se van a contabilizar, como aparece en la figura:

🔡 Inte	erfaz Contable									
	Secuencia	SisPro	TipoPUC	Destino	FechaEvento	HoraEvento	Evento	Usuario	Estacion	Fec
•	2742	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:41	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2745	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:42	MODIFICA	PWPBEI	Peopleware1	01/0
	2748	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:42	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2751	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:43	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2754	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:43	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2757	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:43	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2760	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:43	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2763	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:44	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2766	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:44	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2769	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:53	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2772	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:54	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2775	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:54	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
	2778	PWPREI	FINANCIERO	PROPIO	04/03/2010	15:31:54	MODIFICA	PWPREI	Peopleware1	01/0
*										
<		III								>
	Parametros			Contabilizar		Cancelar	CancelarErrores			

b. El botón Parámetros permite modificar parámetros que se utilizan para armar el archivo de contabilización, como aparece en la figura:


💀 Parametros
Parametros Contables
Id Compañia 1 Centro de Operación 1 Tipo de Documento MPF
Tercero del Documento PWP Unidad de Negocio 01
Nro. del Documento 00000001 Fecha Interfaz: 01-08-2010
Aceptar

Presione aceptar para que guardar los cambios.

c. Presione el botón Contabilizar para grabar los movimientos en su sistema contable. Aparecerá la siguiente pantalla:

🖶 Login			
	Usuario		
Importar	Ver Movimientos	Ver Archivo Plano	Cancelar

d. Antes de hacer la importación al Sistema contable puede ver los movimientos en tabla presionando el botón Ver Movimientos

Software S.A.S

PWPREI – RIESGO E INVERSIONES

	frmE	xcel									
[F_NUMERO_REG	F_TIPO_REG	F_SUBTIPO_REG	F_VERSION_REG	F_CIA	F350_ID_C0	F350_ID_TIP0_DC	F350_CONSEC_D(F351_ID_AUXILIAF	F35
	•	0000003	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000004	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000005	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000006	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000007	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000008	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000009	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000010	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000011	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301031	0
		0000012	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301021	0
		0000013	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301021	0
		0000014	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301021	0
		0000015	0351	00	02	001	001	MPF	00000001	1301021	0
	*										
l	<		IIII]						>
				Euportar	1		Canaalar	_			
				Exportai	J		Cancelai				

O en archivo plano presionando el botón Ver Archivo Plano

📴 Documento Contable	
Documento Contable - Archivo Plano	
<linea>000000100000001001</linea> <linea>000000203500001001MPF00000000120100201PWP 0003010Interfaz PWP del dia 20100201</linea>	^
<linea> 000000303510002001001MPF00000001130101 0 00101 0000000000-0000000000000000</linea>	
CLinea>000000403510002001001MPF000000011301031 0 00101 O0101 O000000000000000	
<linea> 0000005051002001001MPF000000011301031 0 00101 000000000000000</linea>	
<linea> 000000603510002001001MPF000000011301031 0 00101 000000000000000</linea>	
<linea>000000703510002001001MPF000000011301031 0 00101 0000000000-0000000000000000000</linea>	
(Linea):000000000000000000000000000000000000	
(Linea):000000902510002001001MFF000000011301031 0 00101 0000000000+0000000000000000000	
(Linea: 00000100551002201001MFF000000011301031 0 00101 0000000000-0000000000000000000	~
Guardar Cerrar	

- e. Registre el Usuario y Clave definido por su sistema contable para procesar los movimientos, luego pulse el botón Importar. Después de hacer la importación, si la importación no fue exitosa el botón errores se habilitara: Presionando este botón le aparecerá la lista de errores que impidieron la contabilización.
- f. Si por el contrario el proceso es exitoso aparecerá el siguiente mensaje:



	Ĵ
Operación Exitosa	
Aceptar	

10.1. GENERAR MOVIMIENTOS CONTABLES

Esta actividad se relaciona con el proceso de Valoración y Contabilización del sistema.

Para generar los movimientos contables para exportar a su contabilidad:

- a. Ingrese a PWPREI.
- b. Previamente se debe haber realizado el proceso de Valoración para Contabilizar.
- c. Ingrese al módulo Contabilizar. Se presentará la Fecha de Registro o de Proceso actual en la que encuentra del sistema:

E Fecha	
Fecha Contable	04/08/2014 👻
Aceptar	Cancelar

d. En la ventana de Interfaz contable, seleccione la lupa que permite consultar los movimientos:

Interfaz Contable		
No 🖻 🖹 🚺 🖡		
🔜 Buscar Movimiento Contable	_	
Fechas Fecha Contable Fecha Inicial 03/02/2015 C	Origenes Nivel Nombre Niver (TODOS) V	~
Fecha Final 03/02/2015	Concepto (TODOS)	~
□ Numero de Operación □ Fecha Operación 16/05/2017	Aceptar	Kancelar



- e. Indique las condiciones de búsqueda. Si deja la pantalla por defecto el sistema le traerá todos los movimientos correspondientes a la fecha contable indicada. Tenga en cuenta que en una misma fecha de registro se pueden presentar movimientos para esa fecha y para la fecha contable hábil siguiente, por lo que siempre debe generar su interfaz dejando señalado "Fecha Contable" en lugar de Fecha Registro.
- f. Pulse Aceptar. Se le presentarán los movimientos de la fecha contable indicada:

EVENTO	FECHACONTAB	FECHAREGISTRO	FECOPER	NUMNEGOCIO	DESCRIPCION	PUCBAS	MOVIMIENTO	DEBITOS	
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	1: Compra de Tit	151505101001	DEBITO	4700000000	-
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	1: Compra de Tit	151525101001	CREDITO	0	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	15: Causacion V	151505101001	DEBITO	41628256.21	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	15: Causacion V	151525101001	DEBITO	33082147.87	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	15: Causacion V	412905101001	CREDITO	0	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	15: Causacion V	412905101001	CREDITO	0	
MAYOBL	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	29: Mayor Valor I	151506101001	CREDITO	0	
MAYOBL	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	29: Mayor Valor I	151526101001	DEBITO	708000000	
MAYOBL	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	29: Mayor Valor I	231506101001	DEBITO	708000000	
MAYOBL	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	29: Mayor Valor I	231526101001	CREDITO	0	
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	1: Compra de Tit	151506101001	DEBITO	708000000	
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	1: Compra de Tit	151526101001	CREDITO	0	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	15: Causacion V	231506101001	CREDITO	0	
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	15: Causacion V	231526101001	CREDITO	0	
	02/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CU13553	15: Courseign V	512906101001	DEBITO	23744933 99	

- g. Utilice el botón Exportar para grabar un archivo Excel de los movimientos. El archivo se generará:
 - **1.** Con estructura GENERICA si el parámetro general 8109 no está establecido o su valor es GENERAL.
 - **2.** Con estructura BASICA especial si el parámetro general está establecido en BASICA.
 - **3.** Se grabará en la ruta que usted elija si el parámetro general 8108 no está establecido.
 - **4.** Se grabará en la ruta en la ruta predefinida por el parámetro general 8108, si este está establecido.

10.2. CUMPLIMIENTO Y RECAUDO

Esta actividad se relaciona con el proceso de Valoración y Contabilización del sistema.



Para consultar los vencimientos y efectuar el recaudo de los mismos en PWPREI.Debe efectuar los siguientes pasos:

- a. Ingrese a PWPREI.
- b. Previamente se han verificado los vencimientos de rendimientos y capital que están programados para la fecha de proceso del sistema. Puede usar el Informe de Flujos Futuros para el efecto.
- c. Ingrese al módulo Contabilizar. Se presentará la Fecha de Registro o de Proceso actual en que encuentra del sistema:



d. En la ventana de Interfaz contable, seleccione la flecha indicada en la siguiente imagen:

Interfaz Contable	- T - 4 - F F	** > A-1;	Thomas Through.	National States	10.00	
i 🗞 🖻 🗉 🔬 🚺						
	Parametros	Contabilizar	Cancelar	Errores		
				_		

Verifique la fecha, seleccione la opción de Ver cumplimientos de hoy y pulse Aceptar.





e. Se generará el listado de inversiones con cumplimientos en la fecha seleccionada, mostrando cada afectación contable producida por el cumplimiento:

Evento	FechaCumple	NumNegocio	Descripcion	PUCBas	Sufijo	Movimiento	Valor	EstadoCum	F
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	130411101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	168700105011	07	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	817415101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	830500101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	111005101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	168700105001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	130411101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	168700105011	07	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	817415101001	01	CREDITO	78600000	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	830500101001	01	DEBITO	78600000	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	168700105001	01	CREDITO	78600000	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	111005101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	130411101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	168700105011	07	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	817415101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	0
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	830500101001	01	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	111005101001	01	DEBITO	9150000	CUMPLIDO	0
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	410805101001	01	CREDITO	8333.4	CUMPLIDO	0

La columna EstadoCum indica:

- PORCUMPLIR: Aún no se ha realizado el RECAUDO de ese cumplimiento.
- CUMPLIDO: Ya se efectuó el RECAUDO correspondiente.
- f. Para efectuar el cumplimiento se debe:
 - Seleccionar uno de los registros, verificando el NumNegocio o número de la inversión.
 - Dar click en el icono 😫 de la parte superior de la grilla.
 - Se presentará la siguiente vista en la que se indica el título sobre el cual se efectuará el recaudo y el estado actual del cumplimiento del recaudo, bajo esta vista se permite registrar el valor del recaudo, en el campo ContraValor:



🖳 C	umplir Vencimiento								
Fec	cha Cumpinto Num 08/2014 v ACC1	Negocio Descripti 10667 18: Col	ción pro de Rendimientos Fi Generar	nancieros	Valor 16	Dife	rencia 0.00	Contra Valor 16,914,72	Fecha Recaudo
	PUCBas	Movimiento	Valor	ContraValor	Valor	Movimiento	PUCBas	SufijoCum	
•	130411101001	CREDITO	16,914,720.00	16,914,720.00	16,914,720.00	DEBITO	111005101001	01	
	168700105011	DEBITO	16,914,720.00	16,914,720.00	16,914,720.00	CREDITO	168700105001	01	
	817415101001	CREDITO	16,914,720.00	16,914,720.00					
	830500101001	DEBITO	16,914,720.00	16,914,720.00					

- Una vez registrado el valor del recaudo pulse TAB para que se recalcule la diferencia entre el valor del recaudo (ContraValor) y el valor que registra la inversión.
- Luego pulse Generar, y el sistema mostrará la afectación contable que se aplicará al momento de efectuar el cumplimiento.
- Para efectuar el cumplimiento pulse Cumplir . Se efectuará el cumplimiento generando la contabilidad correspondiente.
- Para salir sin realizar el recaudo pulse Cancelar . Se cerrará la ventana y volverá a la pantalla de cumplimientos.

Al momento de efectuar el cumplimento se actualizará la vista de cumplimientos, cambiando el estado del cumplimiento de la inversión que fue procesada:

Evento	FechaCumple	NumNegocio	Descripcion	PUCBas	Sufijo	Movimiento	Valor	EstadoCum	Fe
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	130411101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	168700105011	07	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	817415101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	830500101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	111005101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re	168700105001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	130411101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	168700105011	07	DEBITO	78600000	CUMPLIDO	03
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	817415101001	01	CREDITO	78600000	CUMPLIDO	03
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	830500101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	168700105001	01	CREDITO	78600000	CUMPLIDO	03
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap	111005101001	01	DEBITO	78600000	CUMPLIDO	03
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	130411101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	168700105011	07	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	817415101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	830500101001	01	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	111005101001	01	DEBITO	9150000	CUMPLIDO	04
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re	410805101001	01	CREDITO	8333.4	CUMPLIDO	04

Cuando requiera consultar los cumplimientos efectuados, o pendientes por efectuarse, en un periodo de tiempo, seleccione *Periodo*, que se encuentra en la vista de cumplimientos,



como lo indica la siguiente imagen. Al seleccionar *Periodo*, se habilitará la fecha final para que se indique desde a hasta que día se hará la consulta.

ē	Cumplimientos
1111	
	Un momento por favor
	Fecha Inicial Fecha Final
	05/08/2014 Vendo 05/08/2014 V Cumplir O Cumplidos O Todos Informe Certar

10.3. NOTA OPERATIVA- DIFERENCIA EN CAMBIO TITULOS

A continuación se describe como incluir la Diferencia en Cambio en los cálculos PWPREI.

- Activación. Lo primero que debe hacer es activar las funciones de cálculo de la diferencia en cambio en el sistema. Comuníquese con su área de tecnología para activar el parámetro general 8112 o, si tiene acceso, actívelo en "Definición de Parámetros – PWPREI – SetParGen".
- Aplicabilidad. La diferencia en cambio de que tratan estas funciones se refiere a la causada por los títulos en posición (Spot o propios en el portafolio sin compromisos asociados) emitidos en moneda extranjera, no se refiere a aquella proveniente de negocios derivados pues esta se trata en el sistema junto con las coberturas asociadas y tiene un manejo particular.
- 3. **Operatividad**. A nivel operativo no necesita hacer nada especial, distinto de lo contable.
- 4. Contabilidad.
 - a. **Tratamiento**. Cuando se activa el parámetro el sistema trata la diferencia en cambio separada de la causación por mercado, de forma que:
 - i. Se genera una causación por diferencia en cambio.
 - ii. Se resta la causación por diferencia en cambio de la causación total del título y el resultado se trata como "Causación por Precio". Esta causación por precio se mueve contablemente en lugar de la causación total, de forma que no tiene que establecer nuevos



parámetros de causación total, simplemente tenga en cuenta que esta será la suma de la causación por precio mas lo que mueva por diferencia en cambio:

- iii. Lo que se contabiliza es la Causación por Precio (bajo los parámetros contables ya establecidos para causación) y la Causación por Diferencia en Cambio, que debe usted hacer que se sume (o reste) en la cuenta del título.
- b. Parámetros:
 - i. Deje los parámetros que ya tiene para mover la causación total.
 - ii. Agregue los parámetros para mover la diferencia en cambio, de forma que esta sume (o reste) en la cuenta del título. Utilice para ello los siguientes valores fuente, en el evento VALORAR:
 - DCAMNETAPOS: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva, para trasladarla del ingreso al gasto cuando por la causación del día se vuelva negativa.
 - DCAMNETANEG: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa, para trasladarla del gasto al ingreso cuando por la causación del día se vuelva positiva.
 - DCAMCAUPOS+: Para mover la causación del día, si da positiva, adicionándola a la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva.
 - DCAMCAUPOS-: Para mover la causación del día, si da negativa, restándola de la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva.
 - DCAMCAUNEG+: para mover la causación del día, si da positiva, adicionándola a la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa.
 - DCAMCAUNEG -: para mover la causación del día, si da negativa, restándola de la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa.



11.VALORIZADOR



Este módulo permite al usuario valorizar toda clase de instrumentos financieros así como los portafolios de inversión que tenga en la compañía. De la misma manera permite obtener informes que pueden ser enviados a la SUPERINTENDENCIA DE VALORES, en el momento que así se requiera.

Al dar clic en la opción correspondiente aparece la siguiente pantalla:



11.1. OPCIÓN VALORIZAR TITULOS

Con esta opción podrá valorizar los diferentes tipos de títulos que existen individualmente así como los portafolios de la empresa. Al dar clic en el botón azul aparecerá la descripción de cada uno de dichos títulos.





11.1.1. BUSCAR NEMO

Con esta opción podrá buscar los nemotécnicos o las especies por el nombre o por el emisor.



Al dar clic en el botón aceptar aparece la pantalla respectiva a esa especie para proceder a valorizarla. Dicha pantalla es la siguiente:



😼 Valorizar Títulos al Descuento por Tasa 🛛 🛛 🔀							
Información General	Opción Cantidad	Monto	Má	argen Prec	io Sucio	Precio Limpio	
					o Sacio		
	Tasa	I F	En años				
	Base 365 B	lase 360	Duración	Duración Mod.		aloracion.	-1
Valorización	10.0	0.0]				
15/07/2009	- Tasa - Margen Base 365	C	alcule		1		
Liquidación			Precio	Tasa Monto	Cantida	d Márgen	
15/07/2009 -	Tasa a Utilizar						
Facility	💿 Tasa Dada		😳 Usar Curva				
15/07/2009 -	C Tasa de Ref	erencia del Título ado al Título	C Tasa Alterna				
Vencimiento	C A Precios de	Mercado	Indice Alterno)			
15/07/2009 -							
	-Simulador Cantidad	Monto	Má	iraen Preci	io Sucio	Precio Limpio	
Días al Vencimiento							
360 Dias	Tasa		En años	Dama di da Mard	Tipe V	aloración	
00E D (Base 365 B	ase 360	Duración	Duración Mod.			
363 0148	-Taca - Margan		p alculo	p			
	Base 365		Bracia	Tasa Monto	Captida	d Márgan	
Completo / Cupon / Ppal.			TIECIO	Monto	Canada	u Margen	
COMPLETO 💽	Tasa a Utilizar						
	Tasa Dada	erencia del Título	Usar Curva Tasa Alterna				
Ver Eluies	C Indice Asocia	ado al Título	 Indice Alterno)			
Ver Flujos	C A Precios de	: Mercado					
		Diferencia					
Antiver		, Precio		Pesos			
360 Días 0 365 Días 0 Completo / Cupon / Ppal. COMPLETO Ver Flujos Ver Flujos Activar Acep	Tasa - Margen - Base 365 Base 365 Tasa a Utilizar Tasa a Utilizar Tasa Dada Tasa de Ref Indice Asoci A Precios de tar Cerra	erencia del Título ado al Título Mercado	En afios Duración Alcule Precio O Usar Curva O Tasa Alterna O Indice Alterno	Duración Mod. Tasa Monto	Cantida	d Márgen	

11.1.2. VALORIZAR TITULOS AL DESCUENTO POR TASA

Con esta opción podrá valorizar todos aquellos títulos que sean al descuento por tasa. Al dar clic en la opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresar el Nemotécnico, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir sí es completo, cupón o principal), el Tipo de Mercado (las opciones aparecen en el campo respectivo), la Constancia y el Calendario.

Para proceder a valorizar puede escoger las siguientes opciones y de acuerdo a lo que se vaya a calcular deberá oprimir los botones respectivos que se encuentra en la parte superior derecha:



- Para calcular Precio y Monto ingrese Tasa y Cantidad.
- Para calcular Precio y Cantidad ingrese Tasa y Monto.
- Para calcular Precio ingrese Tasa o Ingrese Monto y Cantidad.
- Para calcular Tasa y Monto ingrese Precio y Cantidad.
- Para calcular Tasa y Cantidad ingrese Precio y Monto.



- Para calcular solo Tasa Ingrese Precio o Monto y Cantidad.
- Para calcular Precio ingrese Tasa o Monto y Cantidad.
- Para calcular Precio y Tasa ingrese Monto y Cantidad.
- Para calcular solo el Monto ingrese Precio y Cantidad.
- Para calcular solo el Monto ingrese Tasa y Cantidad.
- Para calcular solo la Cantidad ingrese Precio y Monto.
- Para calcular solo la Cantidad ingrese Tasa y Monto.

NOTA: Estas opciones son iguales para los Títulos al Descuento por Tasa, para los Títulos con Intereses Periódicos, para los Títulos Amortizables y par los Títulos del Sistema Continuo de la BVC.

11.1.3. VALORIZAR TÍTULOS AL DESCUENTO POR PRECIO

💊 Valorizar Títulos al Descuento p	or Precio	X
- Información General Emisor BCO. CITIBANK Nemo ACITIBANK Comp. / Cup. / Ppal. COMPLETO Valorización Liquidación 15/07/2009 15/07/2009	Cantidad Monto Cantidad Monto En años Duración Duración Mod. Calcule Calcule Tasa a Utilizar Precio Dado C A Precios de Mercado	Precio Sucio Precio Limpio
	Simulador Cantidad Monto En años Duración Duración Mod Calcule Precio Mor Tasa a Utilizar Precio Dado A Precios de Mercado	Precio Sucio Precio Limpio
Kotivar 🔊 Aceptar 🗵	Cerrar Precio	Pesos

Una vez se haya ingresado la información correcta el sistema la valida, en caso de algún error por parte de información mal digitada, deberá corregir y nuevamente clic en aceptar. Después que se ha valorado aparece la siguiente pantalla:



nformación General	Jescuento por Ta	15d				
Emisor	Cantidad	Monto)	Márgen	Precio Sucio	Precio Limpio
BCO. CITIBANK 📃 💌	0.00	0.00	F #	0	0.0	0.0
Nemo	Base 365 B	ase 360	En anos Duración	Duració	n Mod. Tipo	¥aloración.
ACITIBANK 🗾	0.0	0.0	0	0		
Valorización	Tasa - Margen	[alcule			
15/07/2009 🔽	Base 365		Precio	Tasa	Monto Cantida	ad Márgen
.iquidación	Taxa a Ukitara					
15/07/2009 💌	 Tasa a Utilizal Tasa Dada 		C Usar Curva	а		
Emisión	🔘 Tasa de Ref	erencia del Título	C Tasa Alterr	- na		
15/07/2009 🗾	C Indice Asocia	ado al Título Moreado	Indice Alte	rno		
Vencimiento	T & A Flecios de	Melcado				
15/07/2009 💌	-Simulador	Manka		Márgon	Drocio Cucio	Procio Limpio
Días al Vencimiento	0.00	0,00		O	0.0	
360 Días	Tasa		En años	, -		
	Base 365 B	ase 360	Duración	Duració	n Mod.	Faloración.
365 Dias		0.0				
Ju	Base 365		alcule	-		
Completo / Cupon / Ppal.	0.0		Precio	Tasa	Monto Lantida	Margen
COMPLETO 🗸	Tasa a Utilizar					
	Tasa Dada		O Usar Curva	а		
Ver Elvier	C Indice Asocia	ado al Título	 Indice Alter 	ria rino		
VerFlujos	🔘 A Precios de	Mercado				
		Diferencia Precio	0.00	Pe	505 0.00	

Los resultados son los campos de color de fondo gris, como: El Precio, Monto, Tasa Base 360, los días al vencimiento a 360 y a 365 días, y en caso de ver escogido cálculo de retención en la compra y venta e información de comisión, aparecerán los respectivos datos.

La opción activar permite jugar con el simulador y mostrar diferentes escenarios, de valoración.

11.1.4. VALORIZAR OTROS TITULOS AL DESCUENTO

Con esta opción podrá valorizar todos aquellos títulos que no sean al descuento por tasa, solo por precio. Al dar clic en la opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresar el Nemotécnico, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir sí es completo, cupón o principal), el Tipo de Mercado (las opciones aparecen en el campo respectivo), la Constancia, el Calendario, la Modalidad de Emisión y la Modalidad de Reinversión.

Para proceder a valorizar puede escoger las siguientes opciones y de acuerdo a lo que se vaya a calcular deberá oprimir los botones respectivos que se encuentra en la parte superior derecha:



Calcule •			
	Precio	Monto	Cantidad

- Para calcular Precio ingrese Monto y Cantidad.
- Para calcular Monto ingrese Precio y Cantidad.
- Para calcular Cantidad ingrese Precio y Monto.

Una vez se halla ingresado la información correcta el sistema la valida, en caso de algún error por parte de información mal digitada, deberá corregir y nuevamente clic en aceptar. Después que se ha valorado aparece la siguiente pantalla:

😵 Valorizar Otros Títulos al Descuento 🛛 🔀							
Emisor BCO. CITIBANK	Opción Cantidad	Monto	Precio Sucio	Precio Limpio			
	En años Duración	Duración Mod.	Tipo Valoración.	_			
Valorizacion Liquidacion 15/07/2009 • 15/07/2009 • Emisión Vencimiento 23/11/1999 • 23/11/1999 •	Calcule	Precio Monto	Cantidad				
Dias al Vencimiento 360 Días 365 Días Tasa N.	 Tasa a Utilizar Preico Dado A Precios do 	o e Mercado					
Modalidad de Emisión	- Simulador Cantidad En años Duración	Monto	Precio Sucio	Precio Limpio			
Modalidad de Reinversión NO APLICA V NO APLICA V	Calcule —	Precio Monto	Cantidad				
Comp. / Cup. / Ppal. COMPLETO	Tasa a Utilizar Preico Dado A Precios d	o e Mercado					
Keptar 🔊	Cerrar Pre	rencias ecio	Pesos				

La opción activar permite jugar con el simulador y mostrar diferente escenarios, de valoración.



11.1.5. VALORIZAR OTROS TITULOS CON INTERESES PERIODICOS

Con esta opción podrá valorizar todos aquellos títulos que tengan intereses periódicos. Al dar clic en la opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresar el Nemotécnico, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir sí es completo, cupón o principal), el Tipo de Mercado (las opciones aparecen en el campo respectivo), la Constancia, el Calendario, la Modalidad de Emisión, la Modalidad de Reinversión y la Tasa de Emisión.

Una vez haya hecho esto deberá dar clic en el botón Aceptar para que aparezcan los resultados respectivos. La pantalla que se muestra es la siguiente:



11.1.6. VALORIZAR AMORTIZABLES

Con esta opción podrá valorizar todos aquellos títulos que sean amortizables. Al dar clic en la opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresar el Nemotécnico, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir sí es completo, cupón o principal), el Tipo de Mercado (las opciones aparecen en el campo respectivo), la Constancia, el



Calendario, la Modalidad de Emisión, la Modalidad de Reinversión y la Tasa de Emisión.

Una vez haya hecho esto deberá dar clic en el botón Aceptar para que aparezcan los resultados respectivos. La pantalla que se muestra es la siguiente:

📓 Valorizar Amortizables					X
Información General	Opción				
Emisor BCO. CITIBANK 📃	Cantidad	Monto	Márgen	Precio Sucio	Precio Limpio
			0		
Valorización Liquidación	Tasa	En años	D	Mad Tipe V	aloración
15/07/2000 - 15/07/2000 -	Base 365 Ba	se 360 Duración	Duracion		
	10.0	.0			
Emisión Vencimiento	Tasa - Margen	Calcule			
15/07/2009 💌 15/07/2009 💌	Dase 303	Precio) Tasa	Monto Cantidad	l Márgen
- Días al Voto,					
360 Días 365 Días	Tasa a Utilizar	<u> </u>			
0	 I asa Dada C Tasa de Refer 	Usar Lu 🕖 Usar Lu Alexa C Taxa Al	liva tema		
	C Indice Asocia	toal Título 🕤 Indice A	Alterno		
Modalidad de Emisión	C A Precios de N	/ercado			
MENSUAL - ANTICIPADA -					
	simulador				
Modalidad de Reinversión	Cantidad	Monto	Márgen	Precio Sucio	Precio Limpio
NO APLICA 🗨 NO APLICA 🗨					
	Tasa Daga 200 Da	En años	Dunasián	Mad Tipo V	aloración
Moneda	Dase 303 Da	se soo Duracion			
0.00					
	Tasa - Margen	Calcule			
Unidad de Referencia	buse 505	Precio) Tasa	Monto Cantidad	d Márgen
0.00					
	– Tasa a Utilizar –				
Completo / Cupon / Ppal. Tasa de Emisión	💿 Tasa Dada	🔘 Usar Cu	irva		
COMPLETO 🗨 0.000	🔘 Tasa de Refer	rencia del Título 🔘 Tasa Al	lterna		
	Indice Asociac	do al Título 💿 Indice A	Alterno		
Ver Flujos	A Precios de N	reicado			
	Diference	tias			
Activar 🔏 Aceptar 🔀	Cerrar Precio		Pesos		

11.1.7. VALORIZAR ESPECIES DEL SISTEMA CONTINUO / DEUDA PÚBLICA

Con esta opción podrá valorizar todos aquellos títulos que sean del sistema continuo de la BVC. Al dar clic en la opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresar el Nemotécnico, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, la fecha de Emisión y Vencimiento aparecen automáticamente al igual que el Tipo de Título (es decir sí es completo, cupón o principal), el Tipo de Mercado (las opciones aparecen en el campo respectivo), la Constancia, el Calendario, la Modalidad de Emisión, la Modalidad de Reinversión y la Tasa de Emisión.

Una vez haya hecho esto deberá dar clic en el botón Aceptar para que aparezcan los resultados respectivos. La pantalla que se muestra es la siguiente:



📕 Valorizar Especies del Sistema Conti	пио					
- Información General Emisor BCO. CITIBANK	Opción Cantidad	Monto	Márgen O	Precio Suci	o Precio Limpio	
Nemo ACITIBANK	Tasa Total Base 365 Bas	e 360 Du	años ración Dura	ación Mod.	Tipo ¥aloración.	
15/07/2009 🔹 15/07/2009 💌 Emisión Vencimiento	Tasa - Margen Base 365	Calcule	Precio Tasa	Monto Cant	idad Márgen	
15/07/2009 • 15/07/2009 •	Tasa a Utilizar —		Here Comes			
360 Días 365 Días	C Tasa Dada C Tasa de Refere C Indice Asociado	encia del Título O o al Título O	Tasa Alterna Indice Alterno			
Modalidad de Emisión MENSUAL VANTICIPADA V	A Precios de M	ercado				
Modalidad de Reinversión NO APLICA 💽 NO APLICA 💽	Cantidad	Monto	Márgen	Precio Sucio	Precio Limpio	
Moneda	Base 365 Bas	e 360 Du	ración Dura	ación Mod.	Tipo ¥aloración.	
Unidad de Referencia	Tasa - Margen Base 365	Calcule Pre	ecio Tasa	Monto Cantid	lad Márgen	
Completo / Cupon / Ppal. Tasa de Emisión COMPLETO 💽 0.000	Tasa a Utilizar Tasa Dada Tasa de Refere	encia del Título	Usar Curva Tasa Alterna			
Ver Flujos	C A Precios de M	ercado	maice Aitemo			
🚮 Activar 🔊 Aceptar 区 Ci	errar Diferencias		Pesos			

11.1.8. VALORIZAR PORTAFOLIOS

Con esta opción podrá valorizar los portafolios de la compañía completamente. Es decir estarán todos los títulos con su respectiva información como si se hiciera por cada uno. Al dar clic en esta opción aparece una pantalla similar a la pantalla principal de los módulos de Portafolios y Riesgo, Análisis de Sensibilidad y Backtesting, en cuanto al manejo y organización de los Grupos, Tipos, Líneas y Portafolios. La diferencia radica en que aquí no se pueden Agregar, Modificar o Eliminar inversiones y no se puede Valorizar títulos por separado. Una vez aparezca la pantalla, escoja el Grupo, Tipo, Línea o Portafolio respectivo, así mismo ingrese las fechas de valoración y liquidación respectivas.



Posteriormente clic en el botón Aceptar, y aparecerá la siguiente pantalla.



尾 Valoración de Portafolio			×
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO 06/01 Nombre PROFES Tipo GEN Linea de Negocio CLIENTES PEOPLE	/2009	Nits
E-II CLIENTES ↓ ↓ ↓ ↓ PRUEBA 513 ↓ ↓ ↓ JT E-II PWP ↓ ↓ PROFESIONALES	Especie Depósito BPEMINHTA4 DCV CDTBB010D DCV CDTBB010D DCV CDTBGA10D DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV	Número Image: Constraint of the second	Escoja el Tipo de Valoración Precios de Mercado Tasa de Referencia del Título Curva Tasa Alterna Indice Alterno Tasa Dada Tasa de Compra Precios PWPNOW
Nivel PORTAFOLIO Nombre PROFESIONALES	OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV OPCFTRM DCV C Contabilizar	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	Calcular Utilidad Portafolio: C SI © NO Saldo Caja Inicial 0 Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio C Por Especie
Fec Valorización 06/01/20	09 I Liquidar compromisos Fecha Liquidaciór Fecha Compromis	a: Precio Compra Sos NO Valora	a Mdo.

Se agregó también un registro de movimientos contables del portafolio. Para que esta función opere si es necesario parametrizar el PUC y las implicaciones de cada operación realizada sobre el portafolio. Con ello el sistema genera los registros contables que luego pueden ser enviados a la contabilidad. Cabe anotar que para cargar estos movimientos automáticamente en la contabilidad se requiere conocer la estructura del archivo plano que acepta dicha contabilidad. Si desea utilizar esta función por favor contáctenos para el desarrollo del archivo plano que le corresponde a su contabilidad particular.

Hemos agregado una interesante función de cálculo de la rentabilidad del portafolio por "Flujos de Caja". Para ello es necesario que se registren en el sistema todas las COMPRAS y VENTAS realizadas en el portafolio. El sistema toma las novedades del portafolio en el periodo que se le indique y:

- 1. Calcula la rentabilidad del portafolio en el periodo solicitado con base en los flujos del mismo.
- 2. Genera los movimientos monetarios del portafolio en el periodo.
- 3. Permite enviar estos movimientos a Excel para cualquier otra evaluación deseada.
- 4. Los movimientos considerados por el sistema para el cálculo de



la rentabilidad por flujos de caja incluyen:

- a. Compras
- b. Ventas
- c Rendimientos recibidos en el periodo por intereses de títulos.
- d. PyG de compromisos de liquidez (REPOS, SIMULTANEAS)
- e Vencimientos de títulos en el periodo.
- 5. El sistema ofrece la opción de tomar los valores del portafolio al inicio de dos formas:
 - a. A TIR de compra.
 - b. A Precios de Mercado

Para valorar a TIR de compra PWPREI aplica los siguientes conceptos:

- 5. Cuando se adquiere un papel de tasa fija, no indexado, la tasa del negocio, por consecuente su TIR, queda fija hasta el vencimiento del papel o su enajenación.
- 6. Si el papel adquirido está indexado a una tasa de referencia, la tasa del negocio, por consiguiente su TIR, tiene 2 componentes:
 - a. Un componente fijo que permanece hasta su vencimiento o enajenación, el cual llamamos "Margen Inicial".
 - b. Un componente variable que depende del valor de la tasa de referencia. Este componente se debe actualizar cada vez que cambia la tasa.

Con base en lo anterior PWPREI procede como sigue, para el cálculo de la TIR:

Calcular el margen inicial:

MarIni = (((TasaCompra + 1) / (1 + TasaRefCom)) - 1) * 100 Donde:

- TasaCompra=tasa de adquisición del papel, no la nominal sino la de negocio.
- TasaRefCom=valor de la tasa de referencia (DTF, IPC, etc) en la fecha de compra.
- *MarIni=margen inicial o distancia entre la tasa de compra y el valor de la tasa de referencia en la fecha de compra.*

Calcular la nueva tasa:

TasaRepreciada = (((1 + TasaRefVal) * (1 + MarIni)) - 1) * 100 Donde:

• TasaRefVal = valor de la tasa de referencia (DTF, IPC, etc) en la fecha de valoración.



• TasaRepreciada=tasa de compra actualizada en la fecha de valoración, con el nuevo valor de la tasa referencia.

Nota: La tasa de referencia correspondiente debe ser llevada a términos efectivos.

- 6. De otra parte también facilita el manejo de compromisos:
 - a. Se han incluido las posiciones de salida y de regreso. En este caso el sistema se limita a incluir todo movimiento que encuentre en el portafolio.
 - b. Solo se han registro las posiciones de regreso. En este caso el sistema deduce la posición inicial, cuando encuentra un REPO o una SIMULTANES, para completar el efecto en el portafolio.
 - c TRADING. Si estamos evaluando un portafolio donde se hace solo "Trading", el sistema permite que se le indique el monto que se está poniendo en riesgo para sobre ese valor calcular rentabilidad del periodo. Esto es particularmente para evaluar que rentabilidad se está generando por corredor por ejemplo, frente al monto autorizado de inversión.
 - d. Finalmente debemos reiterar, que el cálculo de la rentabilidad del portafolio solo es correcto si el sistema conoce todos los movimientos ocurridos en este en el periodo de evaluación. Cuando es así, el resultado es la TIR real de dicho portafolio.

• Botón Interfaz

Con esta opción se emite información para ser cargada por tesorería.



🗎 Interfaz Te	sorería						
	GRUPO			Fechas Valorización 15/07/2009 Liquidación 15/07/2009	Tota \$ 25 Tota \$ 0.0 PyG \$ 35 PyG -\$ 25	Resultados Finales al Valoración Mercado ,911,930.7224 al Valoración Mercado 2000 i + Interés ,308,911.8780 i sin Interés (Hoy - Aye 5,911,930.7220	(j
Portafolio	Emisor	Numero Negocio	Punta	Especie	V	/al. Nominal Uni./Mon. Emisión	Val 🔨
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	8	COMPRA	CDTCNFS	N I	23,183,985.00	
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	9	COMPRA	CDTCNFS	N	100,000,000.00	
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	10	COMPRA	CDTCNFS	N	80,000,000.00	
VAMCOL	BCO, DAVIVIENDA S.A	15	COMPRA	CDTDVISO	v L	4,620,774.60	
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A	13	COMPRA	CDTDVISO	V L	10,509,012.00	
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A	14	COMPRA	CDTDVISO	v L	6,000,000.00	
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	5	COMPRA	CDTFALSO	v L	3,308,982.00	
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	6	COMPRA	CDTFALSO	v L	24,127,015.00	
VAMCÓL	CMR FALABELLA S.A. C	4	COMPRA	CDTFALSO	v	2,930,079.00	~
		16		LODIEINIGU	<i>i</i> 1	2 500 710 00	
				Inter Tes	erfaz ; orería]	Exportar 🛛 C a Excel	errar

Cuando oprima el botón Interfaz Tesorería, el sistema le mostrará la siguiente pantalla.

🖺 Exportar Archivo 🛛 🛛 📔	<
Formato • Texto • Excel	
Aceptar 🔀 Cerrar	

Puede escoger la opción texto o en formato Excel, de acuerdo a su elección el sistema genera un archivo como el siguiente.



🔊 tesoreriatexto - Bloc de notas	
Archivo Edición Formato Ver Ayuda	
$ \begin{array}{l} \texttt{D1} = \texttt{04} \texttt{0921} = \texttt{0011}; \texttt{C}; \texttt{153395819}, \texttt{82}; \texttt{153366534}, \texttt{18}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{050204} = \texttt{0005}; \texttt{C}; \texttt{357923579}, \texttt{58}; \texttt{357855246}, \texttt{42}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{050204} = \texttt{0003}; \texttt{C}; \texttt{236725241}, \texttt{584}; \texttt{236677468}, \texttt{42}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{050204} = \texttt{0003}; \texttt{C}; \texttt{236725241}, \texttt{584}; \texttt{236677468}, \texttt{42}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{050204} = \texttt{0003}; \texttt{C}; \texttt{236725241}, \texttt{584}; \texttt{236677468}, \texttt{42}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040929} = \texttt{0003}; \texttt{C}; \texttt{1022597234}, \texttt{2}; \texttt{1022399161}, \texttt{8}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040329} = \texttt{0026}; \texttt{C}; \texttt{204560981}, \texttt{94}; \texttt{20451575}, \texttt{14}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040329} = \texttt{0026}; \texttt{C}; \texttt{9225812}, \texttt{231}; \texttt{9223461}, \texttt{194}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040329} = \texttt{0026}; \texttt{C}; \texttt{9225812}, \texttt{231}; \texttt{9223461}, \texttt{194}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040329} = \texttt{0026}; \texttt{C}; \texttt{50954306}, \texttt{62}; \texttt{50954300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040922} = \texttt{0012}; \texttt{C}; \texttt{50954306}, \texttt{25}; \texttt{50955300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040625} = \texttt{0014}; \texttt{C}; \texttt{50964306}, \texttt{25}; \texttt{50955300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040625} = \texttt{0014}; \texttt{C}; \texttt{50954306}, \texttt{25}; \texttt{50955300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040622} = \texttt{0001}; \texttt{C}; \texttt{5093440}, \texttt{22}; \texttt{50955300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040622} = \texttt{0001}; \texttt{C}; \texttt{509340}, \texttt{23}; \texttt{57955300}, \texttt{62}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040622} = \texttt{0001}; \texttt{C}; \texttt{509340}, \texttt{23}; \texttt{57955300}, \texttt{26}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{040622} = \texttt{0001}; \texttt{C}; \texttt{510239340}, \texttt{23}; \texttt{5795530}, \texttt{32}; \texttt{6}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{04072} = \texttt{0001}; \texttt{C}; \texttt{102972358}, \texttt{48}; \texttt{102949587}, \texttt{37}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{01} = \texttt{0404230} = \texttt{0003}; \texttt{C}; \texttt{26}/\texttt{04}/\texttt{2005}; \texttt{26}/\texttt$	25/04/2005; BBCB10 25/04/2005; BBCB10 25/04/2005; BBCB1041 25; 25/04/2005; BBCS03 25/04/2005; BBCS03 25/04/2005; BCS03 25/04/2005; BCSF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BCRF03 25/04/2005; BLOC 25/04/2005; BLOC 25/04/2005; BLOC 25/04/2005; BLOC 25/04/2005; BLSV10 5/04/2005; BLSV10 5/04/2005; BSOLPAZ; 365 24/2005; BSOLPAZ; 361 24/2005; BSOLPAZ; 361 25/04/2005; BSOLPAZ; 361
[] [

Una vez se hayan ingresado los datos, aparece la siguiente pantalla de resultados:

🗐 Valorización Po	r Portafoli) .					×
Exportar a Excel		• Archi	vo Plano		ortar Interes		
Exportar a Excei	Nombre	GRUPO	vo Plano	tinorme Jerarquico Εχρ	Valorizaci 15/07/21 Liquidacia 15/07/21	es Cerrar as	Resultados Finales alor Compra aloración T. Compra aloración Mercado 0 juste
Resultados							
Portafolio	Emisor		Especie	Val. Nominal Uni./M	on. Emisión	Val. Nominal	Val. Compra Uni./Mon. Err 🛧
VAMCOL	C.F.C. CON	FINANCIERA	CDTCNFS0V	23	,183,985.00	23,183,985.00	\$ 23,544,03
VAMCOL	C.F.C. CON	FINANCIERA	CDTCNFS0V	100	,000,000.00	100,000,000.00	\$ 100,000,0C
VAMCOL	C.F.C. CON	FINANCIERA	CDTCNFSOV	80	,000,000.00	80,000,000.00	\$ 80,000,00
VAMCOL	BCO. DAVIN	VIENDA S.A	CDTDVISOV	4	,620,774.60	4,620,774.60	\$ 4,628,67
VAMCOL	BCO. DAVIN	VIENDA S.A	CDTDVISOV	10	,509,012.00	10,509,012.00	\$ 10,580,22
VAMCOL	BCO. DAVIN	VIENDA S.A	CDTDVISOV	6	,000,000.00	6,000,000.00	\$ 5,956,05
VAMCOL	CMR FALA	BELLA S.A. C	CDTFALSOV	3	,308,982.00	3,308,982.00	\$ 3,315,05
VAMCOL	CMR FALA	BELLA S.A. C	CDTFALSOV	24	,127,015.00	24,127,015.00	\$ 24,497,25
VAMCOL	CMR FALA	BELLA S.A. C	CDTFALSOV	2	,930,079.00	2,930,079.00	\$ 3,077,52 🗸

En esta pantalla se podrá encontrar la información correspondiente al Portafolio en cuestión, las Fechas de Valoración y Liquidación, el Valor Total de la Compra, el Valor Total de Mercado, el Valor Total a la Tasa de Mercado y el Valor Total del ajuste. En la parte inferior se encuentran los títulos y su respectiva información.

• Exportar a Excel:





Utilidad para exportar la información suministrada por la valoración del portafolio.

• Informes:



Información para suministrar a la supervalores.

• Archivo Plano:



Con esta opción genere el archivo plano, para envió de información. 2.12.1.7.1. VALORACION DE PORTAFOLIOS CON VERIFICACION DE ISINES

A continuación describimos la función de verificación de ISINES.

6. Valorar con verificación.

Ingrese por "Valorizador – Títulos" . Pulse "Portafolios", seleccione la fecha y elija el portafolio, o los portafolios, a valorizar. Note en la pantalla el "check" para verificar ISINES:

Archivo Adm \	orizador Consultar
Valorizar Títulos	
Buscar Nemo	🛃 Valoración de Portafolio 🔤 🛃
Dcto. x Tasa	Organizar PORTAFOLIO 25/01/2016
Dcto. x Prec.	C Por Grupo C Por Línea Nombre
Otros. Tit. Doto.	C Por Tipo Tipo C C Por Portafolio Linea de Negocio
Amortizables	CLIMAR1 YY YY CLIMAR1 YY CLIMAR1 CLIMAR1 CLIMAR1 CLIMAR1 CLIMAR1 C
Deuda Pública	C Curva C Tasa Alterna C Indice Alterno
Portafolios	C Tasa Dada C Tasa de Compra C Precios PVIPNOW
Dur. MEC	Nivel Calcular Utilidad Portafolio: C SI C NO GRUPO Soldo Coio Inicipia Soldo Coio Final
PreValorar	Nombre Salub Caja Iniciai Salub Caja Iniciai Salub Caja Iniciai [CLIENTES 0 0
Val. HISTÓRICOS	Flujos FecMax: [25/01/201E.] Contabilizad C No
Derivados	
Salir	Fec Valorización 25/01/2016 Fecha Liquidación 25/01/2016 Fecha Compromisos NO Valora Mdo. Interfaz Aceptar Cerrar



Si está chuleado significa que la valoración se hará con verificación de ISINES **7. Valorar.**

Ejecute la valoración como siempre. Si hay alguna discrepancia de ISINES le saldrá el siguiente mensaje:

🙀 Valoración de Portafolio	23
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio TODOS	PORTAFOLIO 25/01/2016 Nombre
CLIENTES	Especie Depósito Número Diat Escoja el Tipo de Valoración VALORIZAR PORTAFOLIOS. X jel Título Image: No SE CONTABILIZÓ VERIFIQUE ISINES por favor. jel Título Aceptar Image: Aceptar jel Título
Nivel GRUPO Nombre CLIENTES Flujos FecMax: 25/01/2016.	Contabilizar © No Contabilizar Contabilizar © No Contabilizar Contabilizar © No Contabilizar
Fec Valorización 25/01/201 Fec Liquidación 25/01/201	Image: Second Equidation Precio Compra Image: Second Equidación Image: Second Equidación Image: Second Equidación Image:

EL proceso de valoración se interrumpe y no pasa a la fase de contabilizar. En seguida le aparece la pantalla de resultados como siempre, pero en la grilla del centro se le muestra la lista de operaciones con problemas de ISIN:



ort, Val.	Informes Export.Co) jinsol, Inf, Jerarq,	Export. Interés Mov. Periodo	Flujos Fut.	Cerrar	
	GRU Nombre CLIENTI	IPO ES	Valorizac 25/01/2 Liquidaci 25/01/2	as ión Vr. Com 016 Vr. a TI 016 Vr. a Me PyG Me	R \$ 10,825,865,485,4300 R \$ 10,864,340,513.6200 erc. \$ 10,457,591,543.6200	
		REVISE EL ISIN	DE ESTAS OPERACIONES	POR FAVOR:		
lumNegoci	o Especie C	Jpenilini Tro			Días	
YZ507	CDTBOC80	O COE	323CD35602 ELISIN en la Ope	eración difiere del ISIN	en Precio.	
					ľ	
					TIB	
					TIR	
					TIR	
					TIR PyG Flujos	
c					TIR PyG Flujos	
c					TIR PyG Flujos	
: esucacios Portafolio	Emisor	Especie	Val. Nominal Uni./Mon. Err	Val. Nominal	TIR PyG Flujos Val. Compra Uni./Mon. Emi[Val	1. (
: -sucauos otafolio LIMAR1	Emisor BBV. BCO. GANADE	E specie RO CDTBGA80	Val. Nominal Uni./Mon. Em 2.000,000,000.00	Val. Nominal 2,000,000,000.00	Val. Compra Uni./Mon. Emi Val. \$ 2,030,661,290,800 \$	1. C
: Suitados Yortafolio LiMAR1 Y	Emisor BBV, BCO, GANADE BCO, DE OCCIDENT	Especie RO CDTBGA80 E CDTB0C80	Val. Nominal Uni./Mon. En 2.000.000.000.00 2.000.000.000.000.00	Val. Nominal 2,000,000,000,000 2,000,000,000,000	Val. Compra Uni./Mon. Em Val \$ 2,030,861,290,800 \$ \$ 1,997,960,000.000 \$	1. C \$ 2,0
soncauos Sontafolio LIMAR1 Y LIMAR1	Emisor BBV. BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA	E specie IRO CDTBGA80 E CDTB0C80 A CDTCFC10	Val. Nominal Uni /Mon. En 2,000,000,000 2,000,000,000 2,000,000,0	Val. Nominal 2,000,000,000,000 2,000,000,000,00 2,000,000	Val. Compra Uni./Mon. Em Val \$ 2,030,861,290.800 \$ \$ 1,997,960,000.000 \$ \$ 1,993,723,025.400 \$	1. 0 5 2.0 5 1.3
sourceuoos Yortafolio LIMAR1 Y LIMAR1 X	Emisor BBV, BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA Zuso Interno PWPRE	Especie RO CDTBGA80 E CDTBC80 4 CDTCFC10 E DERMATIMBA5	Val. Nominal Uni./Mon. Er 2.000,000,000.00 2.000,000,000.00 2.000,000,000.00 97,086,031.00	Val. Nominal 2,000,000,000 2,000,000,000,000 2,000,000	Val. Compta Uni./Mon. Em Val \$ 2,030,661,290,800 \$ \$ 1,997,960,000 \$ \$ 1,992,3025,400 \$ \$ 2,213,168,900	1. 0 5 2.0 5 1.5 5 1.5 \$
soncadoos Portafolio LIMAR1 Y LIMAR1 X X	Emisor BBV. BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA Zuso Interno PW/PRE GOBIERNO NACION	Especie RO CDTBGA80 E CDTB0C80 CDTCFC10 I DERMATIMBA5 IAL TFIT15240720	Val. Nominal Uni./Mon. En 2,000,000,000.00 2,000,000,000 2,000,000,000 97,086,091.00 1,600,000,000.00	Val. Nominal 2,000,000,000,00 2,000,000,000,00 2,000,000	Val. Compra Uni. /Mon. Emi Val \$ 2,030,861,290.800 \$ \$ 1,997,960,000.000 \$ \$ 1,999,723,025.400 \$ \$ 22,913,168.900 \$ 1,946,244,808.160 \$	1. 0 \$ 2.0 \$ 1.9 \$ 1.9 \$ 1.9
souracios Portafolio CLIMAR1 Y CLIMAR1 X X X	Emisor BBV. BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA Zuso Interno PWPRE GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION	Especie RO CDTBGA80 FE CDTB0C80 A CDTCFC10 EI DERMATIMBA5 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240720	Val. Nominal Uni./Mon. En 2,000,000,000.00 2,000,000,000.00 2,000,000,000 97,086,091.00 1,600,000,000.00 2,400,000,000.00	Val. Nominal 2,000,000,000,000 2,000,000,000,00 97,080,000,000 1,600,000,000,00 2,400,000,000,00	Val. Compra Uni /Mon. Emi PyG Flujos Val. Compra Uni /Mon. Emi \$ 2,030,661,290.800 \$ \$ 1,997,960,000.000 \$ \$ 1,997,723,025.400 \$ \$ 92,913,168.900 \$ \$ 1,946,244,808.160 \$ \$ 2,885,555,164.320 \$	1.0 2.0 1.9 1.9 1.9 1.9 1.9 1.9 1.9 1.9
Climanna Contafolio Climanna Y Climanna X X X X X X	Enisor BBV. BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA Zuso Interno PWPRE GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION	Especie IRO CDTBGA80 FE CDTBC80 A CDTCFC10 EI DERMATIMBA5 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240724	Val. Nominal Uni./Mon. En 2.000,000,000,000 2.000,000,000,000 2.000,000,000,000 97,086,091.00 1,600,000,000,00 2.400,000,000,00 500,000,000,00	Val. Nominal 2,000,000,000,000 2,000,000,000,00 2,000,000	Val. Compra Uni./Mon. Em Val \$2,030,661,290,800 \$ \$1,997,960,000.000 \$ \$1,999,723,025,400 \$ \$2,282,513,168,300 \$ \$2,2855,5164,320 \$ \$2,2855,551,64,320 \$ \$2,2855,551,64,320 \$	1. 2.0 1.2 1.2 1.2 1.2 1.2 1.2 1.2 1.2
SUICACIOS Cortados Valtafolio LIMAR1 Y LIMAR1 X X X X X X	Enisor BBV. BCO. GANADE BCO. DE OCCIDENT CORFICOLOMBIANA Zuso Interno PWPRE GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION GOBIERNO NACION	Especie RO CDTBGA80 E CDTBOC80 A CDTCFC10 31 DERMATIMBA5 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240720 IAL TFIT15240724 IAL TFIT15240724	Val. Nominal Uni./Mon. En 2,000,000,000,000 2,000,000,000,000 2,000,000	Val. Nominal 2,000,000,000,000 2,000,000,000,000 2,000,000,000,000 97,086,091,00 1,600,000,000,000 2400,000,000,000 500,000,000,000 1,000,000,000	Val. Compra Uni./Mon. Em PyG Flujos Val. Compra Uni./Mon. Em \$ 2,030,861,290,800 \$ \$ 1,937,260,000.000 \$ \$ 1,937,250,000 \$ \$ 1,946,244,808.160 \$ \$ 2,885,555,164.320 \$ \$ 623,522,675.950 \$ 1,247,045,351.300 \$	<pre></pre>

Corrija o registre los ISINES correspondientes y vuelva a valorar. **8. Contabilizar sin Verificar ISINES.**

Para hacer esto proceda:

- Salga del Valorizador.
- Vaya al administrador de parámetros generales y desactive el parámetro 8091, asignándole el valor "INACTIVO".
- Regrese al Valorizador. Ahora la pantalla sin el con el check de verificar ISINES sin el chulo:



VALORIZADOR		
Archivo Adm Valorizador Consultar		
Valorizar Titulos Buccar Himna Dotes XI ana Dotes XI ana Otros Ta Dotes	Valorsción de Portafolio Portafolio Portunea C Por Troso C Por Portafolio Linea de Negodo	
Int. Protocolos Anomestics Deuda Protocolos Dirá. MEC Dirá. MEC		
PRFormation Ver HristORICOS Derivados Salr	Flujos • Contabilizar • Korupo, Linea, Tpo o Partafolo • Por Especie • VeifCar ISINEs • Echa Guadadaón • Fecha Guadadaón • Echa Guadadaón • Echa Guadadaón • Fecha Guadadaón • St • No Valora Mdo. • Cerrar • Cerrar	18:36

Valore como siempre. Si no hay errores de otro tipo la aparece el mensaje de simpre:

VALORIZAR PORTAFOLIOS.	×	ule
Movimientos en Valoración GENERADOS. Recuerde que debe CONTABILIZAR y CERRAR		l
_		l
Acepta	r	
Laiculai Otiliuau Poitait	JIIU.	

11.1.8.1. NOTAS OPERATIVAS RETENCIONES

Este apartado se refiere exclusivamente a las retenciones aplicadas al interior de la compañía sobre los rendimientos financieros de papeles de Rf. No hace referencia a las que se apliquen directamente en el sistema de negociación.

- 1. Activación. El sistema aplicará retenciones cuando se establezcan las siguientes condiciones:
 - a. Se ha activado el parámetro 8104. Por favor fije este parámetro general en el valor "ACTIVO".
 - b. Su licencia incluye funciones de back office.
 - c. Su licencia incluye movimientos contables.



- 2. **Cálculo** de retenciones. Las retenciones se calcularán en dos instancias: al valorar y al vender. Solo sobre títulos de Rf sujetos a rendimientos financieros por concepto de intereses.
 - a. Al Valorar. Cuando se valore el portafolio al cierre con propósito de contabilizar los movimientos del día, el sistema calculará y causará las retenciones respectivas, así:
 - i. Títulos en pesos. Para papeles en pesos la retención en la fuente se causará diariamente.
 - ii. Títulos en UVR y monedas externas. La retención para papeles emitidos en UVR o moneda extranjera se aplica por el total de los rendimientos del periodo. Dicha retención se calcula y aplica al cierre del día anterior a la fecha de cumplimiento del periodo en curso. No se aplica en otra fecha.
- 3. Contabilizar. Para contabilizar los movimientos por retenciones:
 - a. Establezca para cada tipo de título los parámetros que indiquen al sistema qué debe movimientos debe hacer con las retenciones calculadas.
 - b. Al cierre del día los movimientos por retenciones quedarán incluidos en la interfaz contable.
- 4. Informes. Puede utilizar los siguientes informes para ver las retenciones calculadas:
 - a. En el informe de valoración, cuando exporte la valoración por la opción "Export. Val." podrá ver las retenciones en las columnas BX y BY del informe.
 - b. En el informe de valoración, cuando exporte la valoración por la opción "Export. Consol.", en la Hoja "Renta Fija" podrá ver las retenciones en las columnas AT y AU del informe.
 - c. Inf. Retenciones. Podrá usar la opción "Retenciones" en la ventana de valoración para generar un informe especial de las retenciones generadas durante un periodo de tiempo. Las retenciones se listarán siempre que se haya valorado el portafolio durante el periodo indicado, usando la versión del sistema a partir de la inclusión de la opción citada. Para periodos antes de esta versión no podrá ver las retenciones en este informe. La siguiente pantalla muestra la opción:



N VALORIZADOR	
Archivo Adm Valorizador Consultar	
Valorizar T flulos	
Doto. x Tasa	Organizar PORTAFOLIO U4/10/2016
Dcto. x Prec.	C Por Grupo C Por Línea C Por Tao Tipo
Otros. Tit. Doto.	C Por Portafolio Linea de Negócio '
Int. Periódicos	Beceie Depósito Número Dis Escoja el Tipo de Valoración C Precios de Mercado
Amortizables	C Tasa de Referencia del Título C Indice Asociado al Título C Curva
Deuda Priblica	C Tasa Alterna C Indice Alterno C Tasa Dada
Portafolios	C Tasa de Compra C Precios PWPNOW
Dur. MEC	Nivel Calcular Utilidad Pontafolio: C si C NO Saldo Caja Inicial Saldo Caja Final
PreValorar	
Val. HISTÓRICOS	FecMax: 04/10/201E C Contabilizar © No Contabilizar © X Gr,Lín,Tip, Por C XEsp. V. ISINES O1 402001E V
Derivados	Facha Jainial Liquidar compromisos a:
Salir	Fecha Final IQU/10/2016 IP Fecha Compromisos
	Aceptar

Seleccione el portafolio o conjunto de portafolios, establezca las fechas inicial y final. Pulse el botón "Retenciones" y al terminar el proceso le aparece la pantalla de resultados:



			Ø		Ø		
	▼						
port. Val.	Informes	Export.Consol. Inf. Jerard	q. Export. Interes	Mov. Periodo	Flujos Fut.	Cerrar	
	Nombre	GRUPO		Fechas Valorización Liquidación	n Vr. Co Vr. a Vr. a PyG I	Resultados ompra TIR Merc. Mer-TIR	Portafolio Final
		FLUJ)S DEL PORTAFO	LIO EN EL PER			
Feeba Elui	ic Eluio Neto	Largas	ortae C	nr Lar/CaiaE	Cor/Caial	Intereses	Días
recha riu				pr. Lan Cajar I	spr.comcajai	Intereses	
							TIR
	+						
							PyG Flujos
< Resultado	s						, <u> </u>
	istro Portafolio	NumNegocio	ValMonFecVenta	BaseRete	PorRete	ReteFte	Observaciones
FechaReg	2016 CUMAB2	20141113-146876	0	6,328.77	4	253	
FechaReg 03/10/				5 752 42	4	230	
FechaReg 03/10/2 03/10/2	2016 CLIMAR2	20141113-147208	0	0,700.42			
FechaReg 03/10// 03/10// 03/10//	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147263	0 0	9,589.04	4	384	
FechaReg 03/10// 03/10// 03/10// 03/10//	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147263 20141113-149882	0 0 0	9,589.04 7,671.23	4	384 307	
FechaReg 03/10/2 03/10/2 03/10/2 03/10/2 03/10/2	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147263 20141113-149882 20141113-153454	0 0 0 0	9,589.04 7,671.23 9,589.04	4 4 4	384 307 384	
FechaReg 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147263 20141113-149882 20141113-153454 20141113-153454	0 0 0 1	9,589.04 7,671.23 9,589.04 3,693,534.22	4 4 4 4 4	384 307 384 147,741	
FechaReg 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 04/10/ 03/10/	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147263 20141113-147882 20141113-153454 20141113-153454 20141113-153551	0 0 0 1 0	9,589.04 7,671.23 9,589.04 3,693,534.22 19,178.08	4 4 4 4 4 4	384 307 384 147,741 767	
FechaReg 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 03/10/ 04/10/ 03/10/ 03/10/	2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2 2016 CLIMAR2	20141113-147208 20141113-147208 20141113-147882 20141113-153454 20141113-153454 20141113-153551 CLI13302	0 0 0 1 0 0	9,733.42 9,589.04 7,671.23 9,589.04 3,693,534.22 19,178.08 3,687.15	4 4 4 4 4 4 4	384 307 384 147,741 767 148	

Utilice el botón "Retenciones" para exportar los resultados a Excel.

11.1.9. VALORIZAR DURACION MEC

VALORIZADOR	sent times when the party sent to built a value of the sent to a		
Archivo Adm Valorizador Consu	ultar		
Valorizar Títulos			
Burgershiere			
	🤔 Fecha Portafolios		
	Fecha Medicion / ////2012		
Dicto x Prec			
X	Aceptar 🔀 Cerrar		
Otros. Tit. Deto.			
Int Periodicos			
Amortizables			
Deuda Pública			
Pottatolios			
DURMEC			
Val HISTÓRICOS			
Derivados			
Salr			

Seleccione la fecha de portafolios, como lo hace normalmente y elija el Grupo,



Línea o Portafolio al que le va a realizar la medición y la fecha de valoración, como se ve en la figura:

🙀 Valoración de Portafolio		x
Organizar	PORTAFOLIO 04/07/2012	1
Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	Nombre CARLOS 5555555555555555 Tipo GNA	
E-3- PRUEBA 513	Especie Depósito Número Dia ECOPETROL DVL 0 TFIT16240724 DVL 0 TFIT16240724 DVL 0 TFIT16240724 DVL 0 C Tasa de Referencia del Título C Curva C Tasa Alterna C Tasa Dada C Tasa de Compra C Precios PWPNOW	
Nivel PORTAFOLIO	Calcular Utilidad Portafolio: C SI © ND	
Nombre CARLOS	Saldo Caja Inicial Saldo Caja Final	-
Flujos	C Contabilizar C No Contabilizar	
Fec Valorización 04/07/20	Liquidar compromisos a: Precio Compra C Fecha Liquidación C Fecha Compromisos C SI NO Valora Mdo. Interfaz Aceptar Ce	man

Pulse "Aceptar". Le aparecerán los resultados: En la grilla del centro de la pantalla lo correspondiente a la Duración MEC y abajo la valoración corriente:



port. Val. Info	rmes Arch. Nombre CAF	Plano Inf RTAFOLIO BLOS	Jerarq. Ex	port. Interés Mov	Periodo FI — Fechas— Valorización 04/07/2012 Liquidación 04/07/2012	ujos Fut. Cerr Re Vr. Compra Vr. a TIR Vr. a Merc. PyG Mer-TI	ar sultados Po \$ 7,85 \$ 7,85 \$ 13,6 \$ 13,6 \$ 0.00	ortafolio Final 2,352,000.0000 2,352,000.0000 21,060,000.0000 00
ESPECIE	TIPO CPB.	PUNTA	POSICION	PORTAFO			E FEI	Días
ECOPETROL	BEPO	COMPRA	CORTA	CABLOS		209	4355 14	
TFIT16240724	NINGUNO	VENTA	CORTA	CARLOS		210	7598 01	
TFIT16240724	NINGUNO	VENTA	CORTA	CARLOS		2	2335 01	
TFIT16240724	NINGUNO	COMPRA	LARGA	CARLOS		33	6655 01	TIR
<							Þ	PyG Flujos
Portafolio	Emisor	Especie	e Va	. Nominal Uni./M	on. Err Val. I	Nominal Val.	Compra L	lni./Mon. Emi Val. C
CARLOS	ECOPETROL	ECOPET	ROL	1,910),000.00	1,910,000.00		\$ 0.000 \$ 4,0
CARLOS	GOBIERNO NAC	CIONAL TFIT162	40724	1,000,000),000.00 1,1	000,000,000.00	\$1,2	65,284,000.000 \$1,3
CARLOS	GOBIERNO NAC	CIONAL TFIT162	40724	1,000,000),000.00 1,1	000,000,000.00	\$1,2	65,284,000.000 \$1,2
CARLOS	GOBIERNO NAC	CIONAL TFIT162	40724	1,000,000),000.00 1,1	000,000,000.00	\$1,2	65,284,000.000 \$1,2

Exportar: Para exportar los resultados de la Duración MEC, pulse el primer botón de la pantalla de resultados: "Export. Val.". Se exportarán a Excel los datos correspondientes a la Duración MEC.

11.1.10. PREVALORIZADOR

Para valorizar un portafolio desde una hoja Excel, sin cargarlo en PWPREI, proceda como sigue:

- 1. Seleccione la opción "PreValorar" de la lista de opciones de la izquierda.
- 2 Indique la Fecha de Valoración en la pantalla:





3. El sistema le mostrará la pantalla de Valoración:



Organizar	PORTAFOLIO	03/02/2012		- Nits
 Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Por tafolio 	Nombre Tipo Linea de Negocio	 		
				Escoja el Tipo de Valoración Precios de Mercado Tasa de Referencia del Título CIndice Asociado al Título COurva Tasa Alterna Indice Alterno Tasa Dada Tasa de Compra Precios PWPNOW
Nivel				Calcular Utilidad Portafolio: C SI C NO
Nombre	C Contabilizar	A No Contabil	721	Saldo Caja Inicial Saldo Caja Final 0 Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio C Por Especie
Fec Valorización 03/02/2012	2 V Contabilization	mpromisos a:	io Compra SI	Mide

4. Pulse el botón "Aceptar" y seleccione el archivo en la pantalla y pulse "Abrir":

rganizar 🔻 🛛 Nueva carpeta								(
🗧 Favoritos		Â	Nombre	Fec	ha de modifica	Тіро		
 Bibliotecas Documentos Imágenes Música Vídeos 		Е	Portafolio cargue.xls	23/	11/2013 11:08 a	Hoja de	cálculo	o d
 Grupo en el hogar Equipo ™ I1106033W0C (C:) № Nuevo vol (E:) 								
👝 Nuevo vol (G:)		-	•	III				
Nombre: Port	tafolio cargue.xls				Archivo (*.xls;	*.xlsx)	ancelar	



5. Inmediatamente se inicia el proceso de Valoración:

👩 Valoración de Portafolio			
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO 03/02/2012 Nombre		
	Espere un momento Valorizando Validando Datos		
Nivel	Calcular Utilidad Portafolio: C SI @ NO		
Flujos FecMax: 03/02/2012	Saldo Caja Inicial Saldo Caja Final C Contabilizar Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio Por Especie		
Fec Valorización 03/02/2012 Liquidar compromisos a: Precio Compra Fec Liquidación 03/02/2012 Fecha Liquidación SI Fecha Compromisos NO Valora Mdo. Interfaz Aceptar			

6. Al terminar el sistema le mostrará la pantalla de resultados:

kport. Val. Inf	formes	Arch. Plano	• Difinition Inf. Jerarq.	Export. Interés Mov. Periodo Valorizaci	Flujos Fut. as	Cerrar - Resultados Portafolio Final pra \$ 69.410.087.682.0200)
	Nombre			03/02/21 Liquidack 03/02/21	012 Vr. a TIF 012 Vr. a Me PyG Mer	k \$ 69,410,087,682.0200 rc. \$ 46,563,660,269.2200 -TIR -\$ 22,846,427,412.800)) 0
			FLUJOS D	EL PORTAFOLIO EN EL PE	RIODO		
recha riujo ra	ujo Neto	Largas	Loitas	s Upr.Lar/Cajar			
Resultados						PyG Flujos	
Resultados	Emisor		Especie	Val. Nominal Uni./M <u>on.</u> En	Val. Nominal	Yyb Flujos	
Resultados -	Emisor POF GOBIERN	IO NACIONAL	Especie TFIT16240724	Val. Nominal Uni./Mon. Eff 1,500,000,000.00	Val. Nominal	Val. Compra Uni /Mon. Em Val. \$ 1,900,651,500.000	1. ^
Resultados Portafolio PWP_PREVAL_I PWP_PREVAL_I	Emisor POF GOBIERN POF GOBI <u>E</u> RN	IO NACIONAL IO NACIONAL	Especie TFIT16240724 TFIT16240724	Val. Nominal Uni./Mon. En 1,500,000,000.00 3,000,000,000.00	Val. Nominal 1,500,000,000,00 3,000,000,000,00	Pyis Flujos // /	s.
Resultados Portafolio PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO	IO NACIONAL IO NACIONAL ILTEFINANCIEI	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD	Val. Nominal Uni /Mon. Ed. 1,500,000,000,00 3,000,000,000 63,600,000.00	Val. Nominal 1,500,000,000,000 3,000,000,000,00 63,600,000.00	Yel. Compta Uni/Mon. Em V \$1,900,651,500,000 \$3,801,303,000,000 \$64,550,820,000	■ <mark>1.</mark> ▲ \$: \$:
Resultados Potafolio PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO POF C.F.C. CO	IO NACIONAL IO NACIONAL ILTEFINANCIEI ILTEFINANCIEI	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD CDTCTFS0VD	Val. Nominal Uni /Man. En 1,500,000,000,00 3,000,000,00 63,600,000,00 12,622,940,00	Val. Nominal 1,500,000,000,000 3,000,000,000 63,600,000.00 12,622,948.00	Val. Compta Uni /Mon. Em V/ \$ 1,900,651,500,000 \$ 3,801,303,000,000 \$ 44,550,820,000 \$ 12,771,773,000	s. \$∶ \$∶
Resultados Portefolio PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL PWP_PREVAL	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO POF C.F.C. CO POF C.F.C. FIN	IO NACIONAL IO NACIONAL LTEFINANCIEI LTEFINANCIEI IAMERICA	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD CDTCTFS0VD CDTCFSLS0VD	Val. Nominal Uni /Mon. Err 1.500.000.000.00 3.000.000.000 63.800.000.00 12.622,948.00 200.187.116.00	Val. Nominal 1,500,000,000,00 3,000,000,000 63,600,000,00 12,622,948,00 200,187,116.00	Yol Flups Val Compra Uni /Mon. Em V/ \$ 1,900,651,500.000 \$ 3,807,000,000 \$ 64,550,820.000 \$ 12,771,773.000 \$ 200,903,766.000	\$
Resultados Portafolio PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO POF C.F.C. CO POF C.F.C. FIN POF BCO. POF	IO NACIONAL IO NACIONAL LTEFINANCIEI LTEFINANCIEI IAMERICA PULAR	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD CDTCTFS0VD CDTCFS0VD BBP005129C5	Val. Nominal Uni /Mon. Ett 1.500.000.000.00 3.000.000.000 63.600.000.00 12.622.948.00 2200.187.116.00 1.000.000.000.00	Vel. Nominal 1,500,000,000,00 3,000,000,000 12,622,948,00 200,187,116,00 1,000,000,000,00	Yol Flups Yol Flups	\$ \$ \$ \$
Resultados Portafolio PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_ PWP_PREVAL_	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO POF C.F.C. FIN POF BCO. SAN POF BCO. SAN	IO NACIONAL IO NACIONAL LTEFINANCIEI LITEFINANCIEI LITEFINANCIEI JAMERICA PULAR TIANDER	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD CDTCTFS0VD CDTFSLS0VD BBP005129C5 CDTFSLS0VD BBP005129C5	Val. Nominal Lini /Mon. En 1,500,000,000,00 63,800,000,00 12,622,948,00 200,187,116,00 1,000,000,000,00 1,000,000,000,00 1,000,000,000,00	Val Nomoal 1,500,000,000,00 3,000,000,000,00 63,600,000,00 12,622,948,00 200,187,116,00 1,000,000,000,00 1,000,000,000,00 1,000,000	Val. Compta Uni /Mon. Em V \$ 1,900,651,500,000 \$ 3,801,303,000,000 \$ 4,650,820,000 \$ 12,771,773,000 \$ 200,903,766,000 \$ 1,009,806,376,200 \$ 1,009,805,376,200	■
Resultados Potrafolio PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL PwP-PREVAL	Emisor POF GOBIERN POF GOBIERN POF C.F.C. CO POF C.F.C. FIN POF BCO. SAN POF BCO. SAN POF GOBIERN POF GOBIERN	IO NACIONAL IO NACIONAL LTEFINANCIEI LIEFINANCIEI LIEFINANCIEI LAMERICA PULAR UTANDER IO NACIONAL IO NACIONAL	Especie TFIT16240724 TFIT16240724 CDTCTFS0VD CDTFSLS0VD BBP005129C5 CDTBSA90P TFIC10280412 TFIC10280412	Val. Nominal Uni /Mon. Err 1.500.000.000.00 3.000.000.00 12.622,948.00 200.187.116.00 1.000.000.000.00 1.50.000.000.00 1.50.000.000.00 1.50.000.000.00	Val Nominal 1,500,000,000,000 63,600,000,00 12,622,948,00 1,000,000,000,00 1,000,000,000,00 1,000,000,000,00 150,000,000,000 150,000,000,000	Yols Flups	■



- 7. Revise la columna "Observaciones" en la grilla de resultados de la parte inferior para verificar que todas las posiciones hayan sido valoradas. En caso de presentarse error en alguna posición, le aparecerá un mensaje en esta columna indicándole el tipo de problema presentado; corríjalo en el Excel y reinicie el proceso.
- 8. Finalmente, puede utilizar la opción "Export. Val." Para exportar los resultados a Excel.

11.1.10.1. NOTAS OPERATIVAS – VALORAR PERIODO

Para utilizar la funcionalidad de "Valorar Periodo" en PWPREI, proceda por favor:

- 1. Ingrese al Valorizador:
 - a. Seleccione "Valorizar Títulos"
 - b. Seleccione "Portafolios".
 - c. Seleccione el GRUPO, LINEA o PORTAFOLIO a valorar.
 - d. Seleccione la opción "Valorar Periodo"
 - e. Seleccione "Contabilizar". Valorar Periodo solo es admisible cuando es para "Contabilizar".
- 2. Hecho lo anterior se le activarán las casillas para seleccionar el periodo a valorar, como se ve en la pantalla:

🙀 Valoración de Portafolio	
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio TODOS	PORTAFOLIO 18/10/2017 Nombre Tipo Linea de Negocio
B-E- CLIENTES CLIMAR1 CLIMAR2 CLIMAR2 CLIMAR3	Especie Depósito Dia Escoja el Tipo de Valoración Precios de Mercado Tasa de Referencia del Título C Indice Asociado al Título C Curva Tasa Alterna C Indice Alterno C Tasa Dada C Tasa de Compra C Precios PWPNOW
Nivel GRUPO Nombre CLIENTES	Calcular Utilidad Portafolio: Saldo Caja Inicial OC
Flujos FecMax: 18/10/2017 -	Contabilizar No Contabilizar O X Gr,Lín,Tip, PorO XEsp. V. ISINES 31/12/2016
Fec Valorización 18/10/201 Fec Liquidación 18/10/201	Image: Liquidar compromisos a: Image: Liquidar compromisos a: Image: Fecha Liquidación Image: Liquidación Image: Fecha Compromisos Image: Fecha Compromisos

3. Pulse "Aceptar" para iniciar el proceso. En la parte inferior izquierda, en las casillas "Fecha Valoración" y "Fecha Liquidación" se le muestra el progreso por fechas.


- 4. Al terminar con la valoración de la "Fecha Final" del periodo se le mostrará la pantalla de resultados. En la grilla podrá ver para cada fecha los datos:
 - a. FechaVal: Fecha valorada.
 - b. EstadoPre: Estado del portafolio, a la fecha, al iniciar el proceso
 - c. EstadoPos: Estado del portafolio, a la fecha, al finalizar el proceso. Se supone que el sistema cerrará cada fecha al terminar el proceso.
 - d. EstadoVal: Estado de la valoración, a la fecha.
 - e. EstadoCon: Estado de la contabilización, a la fecha.
 - f. Observaciones: Muestra el error general presentado, a esa fecha, cuando se presenta.
- 5. La pantalla de resultado se ve como sigue:

🗊 Valorización Por Portafolio.					×
Export. Val. Informes • E	Export.Consol. Inf. Jer GRUPO [CLIENTES	rarq. Export. Interé	is Mov. Periodo Fechas Inicial 01/10/201 Final	Flujos Fut. Cerrar Resultados 1 Vr. Compra Vr. a TIR	Portafolio Final
			18/10/201	7 Vr. a Merc. PyG Mer-TIR	
	FLI	JJOS DEL PORTAF	OLIO EN EL PER	IODO	_ Días
Fecha Flujo Flujo Neto	Largas	Cortas	Cpr.Lar/CajaF (Cpr.Cor/Cajal Intereses	
					TIB
<				\$	PyG Flujos
Resultados	EstadoDes	E ana de Mal	Extende Com	01	
05/10/2017 CERRADO 06/10/2017 CERRADO 07/10/2017 CERRADO	CERRADO CERRADO CERRADO CERRADO	VALORADO VALORADO VALORADO	CON ERROR I CONTABILIZADO CON ERROR I	EI2016ROP)-1:No es posible CONT.	ABILIZAR porque hay r
09/10/2017 CERRADO				1.100 C3 posible Contra 1.100 C3 posible Contra 1.100 C3 posible Contra	
10/10/2017 CERRADO	CERRADO	CON ERROR	SINDEFINIR	(VREI2016ROP)-1:NO SE	CONTABILIZÓ, VERIF
11/10/2017 CERRADO	CERRADO	CON ERROR	SINDEFINIR I	EI2016ROP)-1:No es posible CONT.	ABILIZAR porque hay p
12/10/2017 CERRADO	CERRADO	CON ERROR	SINDEFINIR	(VREI2016ROP)-1:NO SE	CONTABILIZÓ, VERIF
<			SINDEFINIR	ELZUIGHUMJ-TINO es posible CUNTA	ABILIZAH porque hay t

a. Puede usar el botón "Errores" para exportar los resultados.



11.2. OPCIÓN VAL HISTÓRICOS

El usuario puede ver la información de cada especie separadas por Renta Fija o Acciones.



11.2.1. HISTORICO RF



Si en la Fecha de Registro actual hay datos de valoración histórica la grilla de datos aparecerá llena con las especies valoradas exitosamente en esa fecha, de lo contrario aparece vacía como se ve en la figura anterior. Normalmente usted ingresará cada día y pulsará "Valorar" para hacer la valoración del día, la primera vez que ingrese ese día.

- 1. La pantalla está divida en tres partes así:
 - a. En la parte superior está la ventana de Acción y Consulta.
 - b. La ventana de la mitad es la Ventana de Datos, de valoración o consulta.
 - c. La ventana inferior muestra el número de registros cargados en la Ventana de Datos
- 2 Ventana de Datos. Consta de los siguientes cuadros de control:
 - a. Mostrando. Indica que tipo de información se está desplegando en la ventana de datos. Esta puede ser:



- i. Las especies valoradas correctamente. Aparece inmediatamente después de terminada una valoración o al pulsar el botón "Valorados".
- i. Históricos. Estos datos se despliegan cuando usted consulta, mediante el botón "Históricos".
- ii. Errores. Las especies con error.
- b. Datos de Consulta o de Condiciones de Valoración:
 - i. Fecha Inicial. Establece la fecha de inicio del periodo de datos a consultar o del periodo a valorar. Debe marcar en la recuadro de la izquierda arriba de esta fecha para que el sistema la tome en cuenta, de lo contrario la consulta o valoración se hará para los datos de la fecha en "Fecha Val/Final"
 - ii. Fecha Val/Final. Establece la fecha final del periodo de datos a consultar o del periodo a valorar.
 - ii. Especie. Establece la especie que se quiere consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema entiende que quiere consultar todas las especies.
 - Vencimiento. Establece la fecha de vencimiento de las especies a consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema no tiene en cuenta este dato.
 - v. Modalidad. Establece la modalidad de pago de intereses de las especies a consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema no tiene en cuenta este dato.
 - vi. Spread. Establece el spread de las especies a consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema no tiene en cuenta este dato.
 - vi. CQP. Establece la condición (Completo, Q:cupón o Principal) de las especies a consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema no tiene en cuenta este dato.
 - vii. Reinversión. Establece la modalidad de reinversión, si la especie la tiene, de intereses de las especies a consultar. Si no marca el recuadro a la izquierda arriba del campo, el sistema no tiene en cuenta este dato.
- c. Botones de acción:
 - Valorar. Lee las especies cargadas en Márgenes y Precios durante el periodo comprendido entre Fecha Inicial y Fecha Val/Final, sin más condiciones. Recuerde que si no está marcada la Fecha Inicial, el



sistema lee solo lo de Fecha Val/Final. Dado que el proceso es bastante pesado se recomienda valorar una sola fecha cada vez. Una vez leído el conjunto de especies el sistema procede a valorarlas, dejando rastro de aquellas que no fue posible valorar por alguna inconsistencia en su definición. Al terminar el proceso, si una o varias especies no se pudieron valorar se muestra el mensaje:

revisarlos.
Aceptar

Los resultados de las especies valoradas se muestran en la pantalla como se ve en la figura:

🖪. Valor	rizac	dor General														X
	,	Mostrando	Fecha In 27/02/201	icial Fe 1 🗸	cha Val/Fi 27/02/20	inal 011 -	Valore	ar 🔊	√alorados	😽 Err	ores	Histórico	🔀 Exp	ortar 🔀	Cerrar	
	Co	onsulte Aquí:	Especie	•	Vencimie 26/02/2	nto 1011 -	Mo	dalidad •	•	Sprea	ad	CQP	Reinv	ersión • •		
FechaR	egis	trc Especie	Tasaref	Spread	DiasVcto	Tasa	Margen	Precio	PreLimpio	Duracion	Modalida	d ValMon	TipoVal	FechaEmisio	FechaVencin	Cqp 🔺
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	15	3.468	-0.0192	99.86	99.86	0.0411	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/14	CE
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	16	3.484	0.0338	99.85	99.85	0.0438	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/15	С
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	17	3.498	0.0462	99.84	99.84	0.0466	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/16	С
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	18	3.51	0.0142	99.83	99.83	0.0493	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/17	C
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	19	3.323	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	С
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	20	3.532	0.0693	99.81	99.81	0.0548	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/19	C
2011/02	/27	AALIADAS	FS	0.00	21	3.721	0.2309	99.79	99.79	0.0575	PV	1.00	CEC - MV	2011/02/27	2011/03/20	С
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	15	3.468	-0.0192	99.86	99.86	0.0411	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/14	С
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	16	3.484	0.0338	99.85	99.85	0.0438	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/15	C
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	17	3.498	0.0462	99.84	99.84	0.0466	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/16	С
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	18	3.51	0.0142	99.83	99.83	0.0493	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/17	С
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	19	3.323	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	С
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	20	3.532	0.0693	99.81	99.81	0.0548	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/19	C
2011/02	/27	ABANCAFE	FS	0.00	21	3.721	0.2309	99.79	99.79	0.0575	PV	1.00	CEC - MV	2011/02/27	2011/03/20	С
2011/02	/27	ABANCOLOMB	FS	0.00	15	3.468	-0.0192	99.86	99.86	0.0411	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/14	С
2011/02	/27	ABANCOLOMB	FS	0.00	16	3.484	0.0338	99.85	99.85	0.0438	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/15	С
2011/02	/27	ABANCOLOMB	FS	0.00	17	3.498	0.0462	99.84	99.84	0.0466	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/16	С
2011/02	/27	ABANCOLOMB	FS	0.00	18	3.51	0.0142	99.83	99.83	0.0493	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/17	C
2011/02	/27	ABANCOLOMB	FS	0.00	19	3.323	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	lc *
Registro	s: 3,3	339														

- Valorados. Muestra las especies correctamente valoradas. Utilícelo después de haber usado el botón "Errores", para volver a los resultados de la valoración.
- Errores. Carga en pantalla las especies con error. Muévase hacía la derecha para ver en el campo "Observaciones" los errores presentados por cada



especie no valorada. La figura siguiente muestra estos resultados.

🖪. Valo	rizador General											_ 🗆 <mark>_ X</mark>
	Mostrando ERRORES	Fecha Inicial 27/02/2011 ▼	Fecha Val/Final	Valora	,	Valorad	os	😽 Errores	Histórico	Exportar	Cerrar	
	Consulte Aquí:	Especie	 ✓ Vencimiento ✓ 26/02/2011 		dalidad •	•		Spread	CQP	Reinversión	•	
Modali	dad ValMon Tipo'	Val FechaEmisic	FechaVencin Cqp	Calend	ar Moneo	Fuente	Viger	nt Estado	Observaciones			GruMo Gru 🔺
TV	0.00	2010/04/29	2014/04/29 C	N	COP	М	S	ERROR	8821: La especie	no tiene definida la Fe	ormula de Calci	1 =
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/03 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/04 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/05 C	N	COP	М	Ν	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/14 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/15 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/16 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/17 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/18 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/19 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/20 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/21 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/03 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/04 C	N	COP	М	S	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/05 C	N	COP	М	N	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/06 C	N	COP	М	N	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/07 C	N	COP	М	N	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/08 C	N	COP	М	N	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1
NO	0.00	2011/02/27	2011/03/09 C	N	COP	М	N	ERROR	-8128: Modalidad	de pago incorrecta		1 7
					111							
Registro	os: 12,051											

 Mistóricos. Permite consultar en un periodo de uno o más días, una o todas las especies valoradas. No olvide marcar el recuadro a la izquierda arriba de Fecha inicial para que el sistema la tome en cuenta. Como una facilidad, cada vez que usted hace click en una fila el sistema le establece en los campos de consulta las condiciones particulares de la especie que está en esa fila. Esta acción no establece la Fecha Inicial, así que no olvide registrarla y marcar el recuadro para que el sistema la tome en cuenta. La figura muestra un ejemplo de consulta de la especie TFIT15240720 valorada durante el periodo 01/02/2011 a 27/02/2011



🖪 Valori:	zador	General															X
	M HIS	lostrando 🔽	Fecha In)1/02/201	icial Fe 1 -	cha Val/F 27/02/2	inal 011 🗸	Valore	" 🔊	Valorados	😽 Errores	His	III stórico	X E	xportar	×	Cerrar	
	Cons	vite Aquí: ∏	Especie FIT1524072	· ·	Vencimie 24/07/2	nto 020 🔻	Mo A	dalidad ▼V	•	✓ Spread 11.00	▼ C	QP ▼	Rei	inversiói ▼0	n •		
FechaRe	gistro	Especie	Tasaref	Spread	DiasVcto	Tasa	Margen	Precio	PreLimpio	Duracion Mod	alidad	ValMon	TipoVal	Fech	aEmisio	FechaVencir	r Cqp
2011/02/2	27	TFIT15240720	FS	11.00	3432	8.327	0.00	123.43	116.86	6.2177 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005/	07/24	2020/07/24	C
2011/02/	26	TETT15240720	FS	11.00	3433	8.327	0.00	123.40	116.86	6.2204 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005	07/24	2020/07/24	C
2011/02/	25	TEIT15240720	FS	11.00	3434	8 3717	0.00	123.37	116 5555	6.2232 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005	07/24	2020/07/24	C
2011/02/	24	TEIT15240720	FS	11.00	3436	8 3144	0.00	123.033	116 9647	6 23 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005	07/24	2020/07/24	C
2011/02/	22	TEIT15240720	FS	11.00	3437	8 3386	0.00	123,717	116 7958	6 2303 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005	07/24	2020/07/24	c
2011/02/	01	TFIT15240720	FS	11.00	3458	8.0022	0.00	125.077	119,2907	6.3226 AV		1.00	PRECIO IN	IFC 2005	07/24	2020/07/24	c
•																	
Pogietroe	. 7																

- v. Exportar. Este botón exporta a Excel la información desplegada en la ventana de datos, ya sea las especies valoradas, las especies con error o la consulta histórica.
- 3. Grabar Resultados. Cada vez que usted ejecuta el proceso de valoración, el sistema guarda los resultados de las especies valoradas correctamente, de forma que usted pueda luego hacer consultas históricas.
- 4. Recomendaciones.
 - a. Tenga en cuenta que al grabar los resultados se consume bastante espacio en la base de datos, dado el número de datos que se graban. El archivo de Márgenes contiene aproximadamente 15.000 registros,, por lo tanto el consumo máximo de las grabaciones es equivalente al consumo de los márgenes.
 - b. Cuando valore, preferiblemente hágalo una fecha a la vez, para que el proceso no se demore excesivamente. Si desea valorar un periodo significativo la primera vez para acumular datos históricos asegúrese de:
 - i. Ejecutar el proceso en horas libres, por ejemplo dejarlo ejecutando en la noche.
 - i. Que su equipo tenga suficiente memoria disponible, algo así como 1 Gb. Para ello cierre las demás aplicaciones.
 - ii. Asegúrese con Tecnología de tener espacio suficiente en la base de datos.
 - c. Si valora uno o dos días a la vez, no requerirá de las precauciones citadas en el punto anterior.
 - d. Cuando consulte históricamente, si la consulta comprende



todas las especies, limite el periodo de consulta porque su equipo será cargado con todos los datos consultados. Recuerde que un día de márgenes son aproximadamente 15.000 registros.

- e. Si su consulta se limita a una especie no tendrá problemas con la longitud del periodo consultado.
- f. Al exportar tenga en cuenta el número de registros desplegados en su pantalla de datos. Recuerde que:
 - i. Excel 2003 soporta hasta 65.000 filas
 - ii. Excel 2007 soporta hasta 1.048.000

11.2.2. HISTORICO ACC/DIV

valoriza	X
Valoracion Todas aún no implementada par	a Acciones.
	Aceptar

11.3. OPCIÓN DERIVADOS





11.3.1. VALORIZAR OPCIONES

🖏 Valorizar Opciones			-	
Opción de COMPRA Especie Curv	a TLR Curv	A <mark>ctivar</mark> 'a T. Foránea Mat	riz Volatilidades - Ca	antidad/Nominal
	_		_ 0.	.00
Datos Valorización Vencimi	ento Base Opc. 019 • 365 •	Valoración Base Val 365 🗸	RESU	LTADOS
Spot (Hoy)		Prima X Unidad	Call	Put
Strike (Pactado)	0.00	Delta	0.000000	0.000000
Días Voto.	0	Gamma	0.000000	0.000000
Volatilidad	50.00	Theta	0.000000	0.000000
Tasa Libre Riesgo	0.00	Vega	0.000000	0.000000
Divid/Cuón Interm.	0.00	Rho	0.000000	0.000000
Aceptar 🔀	Cerrar	\$Prima	0.00	0.00

11.3.2. VALORIZAR LOS DERIVADOS / TEORICO

🛄 Valorizar DERIVADOS - Contrato y Entregab	les 🛛 🔀
Linformanián General Emisio	Valoración Entregables
0.00	Aceptar 🗹 Cerrar 😥 Exportar a Excel

INFORME DE FLUJOS FUTUROS O VENCIMIENTOS

2. DESCRIPCION DEL PROCESO



Este proceso con la valoración de sus portafolios, el recaudo y contabilización de vencimientos. El informe incluye:

- Cobro de rendimientos de títulos de Rf.
- Cobro de capital de títulos de Rf.
- Vencimiento de compromisos de liquidez (simultáneas, repos)
- Vencimiento de compromisos en general (futuros, derivados)

3. FUNCIONALIDAD

 a. Ingrese al módulo Valorizador. En el menú seleccione la opción de Valorizar títulos > Portafolios. Se debe verificar la fecha del portafolio desde la que desea generar los vencimientos:

🤧 Fecha Portafolios 📃 💌
Fecha Medición 🔽/06/2014 💌
Aceptar 🔀 Cerrar

b. Seleccione el portafolio del cual requiere generar los vencimientos. Seleccione la opción Flujos en la parte inferior izquierda y la fecha hasta la cual desea determinar los vencimientos. Para ejecutar el proceso pulse Aceptar. Si desea generar los vencimientos de todos los portafolios a la vez, seleccione la opción TODOS



뤥 Valoración de Portafolio	
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio TODOS	PORTAFOLIO 16/07/2014 Nombre
ACCION UNO ACCION UNO CONSERVADOR FACTUBAS FACTUBAS GARANTIAS GARANTIAS ODISEA PENSIONES B	Especie Depósito Número Dia: Escoja el Tipo de Valoración Image: Construction of the second of the se
Nivel GRUPO Nombre CAR Elujos FecMax: 16/07/2014	Calcular Utilidad Portafolio: C SI © NO Saldo Caja Inicial O Contabilizar © No Contabilizar Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio © Por Especie
Fec Valorización 16/07/201 Fec Liquidación 16/07/201	Image: Aceptar Sector Components Precio Compra Image: Components Image: Components Image: Component

- c. Para obtener el PUC de los vencimientos seleccione Contabilizar, de lo contrario la columna saldrá vacía.
- d. Al terminar el proceso de generación se presentará la siguiente ventana, en la que debe seleccionar la opción Flujos Fut.



🗻 Valorización Por	Portafolio.						x
Export. Val. In	iformes Arch	n. Plano Inf.	Jerarq. Export. Int	erés Mov. Periodo	Flujos Fut. Cer	T rar	
Portafolio ACI	PO CION UNO	Nits 800193	848-8	Fechas Valorización 27/06/2014 Liquidación	Vr. Compra	esultados Portafolio Final \$ 372,248,198,852.4500 \$ 373,326,856,546.4500	
		<u> </u>		27/06/2014	Yr. a Merc. PyG Mer-T	\$ 373,326,856,546.4500 (R \$ 0.0000	
		FI	UJOS DEL PORTA	FOLIO EN EL PERI	ODO	Días	
Fecha Flujo F	lujo Neto L	Largas	Cortas	Cpr.Lar/CajaF C	pr.Cor/Cajal Intere	Dias	
						I	
						TIB	
						D O FL	
						Py& Flujos	_
•						4	
Provide data						,	
Resultados			la companya da		in the second second		_
ACCIONUMO	E misor	Especie DAVA 010	Val. Nomi	Tai Uni./Mon. En Va	so oco oco	• EE1 102 400 000	_
ACCION UNO		COTA DODO10	J33A 0A10A\/	1 000 000 000 00	1 000 000 000 00		
ACCION UNO	DANCO DE BOU	COTA DODO10	0011417	500.000.000.00	500,000,000,000	\$ 1,131,120,000,000 \$ \$ 534,965,000,000	
				500,000,000.00	500,000,000.00	⊕ 524,363,000.000 ⊕ €24,005,000,000 ⊕ €24,000,000,000 ⊕ €24,000,000,000 ⊕ €24,000,000,000 ⊕ €24,000	
	- BUDU LLUC BUU			51011001100110000			

e. Esto permitirá exportar a Excel el resultado. Si no aparece la ventana para guardar el archivo pulse ALT+TAB para ubicarla.

🔀 Guardar como				×					
Buscar Documentos									
Organizar 🔻 Nueva carpeta									
Microsoft Excel	Biblioteca Docu Incluye: 2 ubicaciones	mentos	Organizar po	or: Carpeta 🔻					
☆ Favoritos	■ Nombre		Fecha de modifica	Тіро					
Uescargas	Archivos de Outlook		26/05/2014 08:35 a	Carpeta de archivos					
🔠 Sitios recientes									
 Bibliotecas Documentos Imágenes 									
Nombro do probinou	vios Euturos iupio 27-2014 visv								
Tino:	crosoft Excel (*.xls) (*.xlsv)								
Autores: Al	kandra Patiño	Etiquetas: Agregar ur	na etiqueta						
 Ocultar carpetas 		<u>H</u> erramientas	▼ Guardar	Cancelar					



	🗓 🔚 🖤 🕶 😢 Flujos Futuros julio-13-2014.xlsx - Microsoft Excel															
Arc	Archivo Inicio Insertar Diseño de página Fórmulas Datos Revisar Vista															
	🎽 🔏 Cortar		Calibri		× 8	· A A	= = >	Ajust	ar texto	General		Ψ				
Pe	gar 🗸 🛷 Copiar f	ormato	NĂ	<u>s</u> -	⊞ *	<u>⊘</u> • <u>A</u> •		Coml	oinar y centrar *	\$ - %	o 000	4 0 00 00 → 0	condici	onal v como tab	ato Estilos de la ≠ celda ≠	Insertar El
	Portapapeles	G.		Fue	ente	Est.		Alineación	G.	N	imero	- Gi	Estilos			(
	F31 - fs SERFINDATA S.A.															
	А	В		С		D	E	F	G	н	1	J	K	L	М	N
1	FLUJOS FUTUROS I	DEL PORTA	FOLIO													
2	FECHA REGISTRO			41	,833.00											
3																
4	FECOPER	NUMNEGO	DCIO	CANTIDAD		VALMER	TASMER	EMISOR	ESPECIE	FECVEN	MODAL	TASAREF	SPREAD	TASA CUPON(%)	CONTRAPARTE	TRADER
5	12/09/2013	ACC9453		500,000	,000.00	505,530,000.00	4.18104773	BANCO DE BOGOTA	CDTBB010	14/07/2014	TV	DTF	0.70	101.11734668	860503748	CCASAS
6	05/12/2013	ACC9972		1,500,000	,000.00	1,517,175,000.00	3.93806167	BANCO CORPBANO	CDTBSA10	14/07/2014	TV	DTF	0.85	101.15570392	890905375	CCASAS
/	13/03/2014	ACC10702	2	2,000,000	,000.00	2,027,320,000.00	3.68075937	FACTORING BANCO	CDTCOMSOV	14/07/2014	PV	FS	4.094	101.37603889	800128735	CCASAS
8	10/08/2011	FAC5736		2,213	,100.00	2,211,745.01	25.05	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	900185214	EVARON
9	11/10/2011	FAC7325		2,214	,400.00	2,213,044.21	25.05	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	860508679	EVARON
10	12/06/2012	FAC8966		2,856	650.00	2,855,067.25	22.42	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	860508679	EVARON
11	13/08/2012	FAC9745		2,197	,450.00	2,196,232.48	22.42	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	800180704	EVARON
12	12/09/2012	FAC10114		1,977	,672.00	1,976,576.25	22.42	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	800180704	EVARON
13	06/02/2013	FAC11842		2,004	,944.40	2,003,898.50	20.98	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	900030747	EVARON
14	03/09/2013	FAC16933		1,768	,776.00	1,767,967.95	18.15	SERFINDATA S.A.	CHESERF	14/07/2014	PV	FS	0.00	100.00	800180704	EVARON
15	05/00/0040	C+04 C004			004.00	040 774 00	10.15	CONTRACTO O D	0000000	e e lors loos e		TO	0.00	100.00	0000000000	

f. Visualice la información en el archivo de excel generado:

12.ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD



Por medio de esta opción el sistema le permite al usuario, simular lo que pasaría con el **VaR** de un portafolio si se venden o compran determinadas posiciones del mismo en un determinado momento del mercado.

Así mismo se podrán hacer valoraciones sobre portafolios ficticios creados por los traders de la compañía, elaborar pruebas de *Stress Testing* en determinados escenarios del mercado, hacer uso de precios y tasas de cierre, máximas, mínimas y promedios.

La pantalla de análisis de sensibilidad esta conformada por:

NOTA: Las inversiones que se creen en Análisis de Sensibilidad serán "ficticias", ya que no quedarán establecidas como inversiones o portafolios principales de la compañía, puesto que su registro se lleva a cabo en una base de datos local a cada equipo donde está instalado el sistema. Es decir que si se crean portafolio e inversiones una vez se salga de este módulo, estas se eliminarán automáticamente.

Así mismo las Pantallas de resultados de cada uno de los métodos tienen la misma funcionalidad que las pantallas del módulo PORTAFOLIOS Y RIESGO. A excepción de que en ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD, no se pueden grabar valoraciones. Del mismo modo en las pantallas de ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD aparece un nuevo componente y es el que indica que tipo de variabilidad en Stress Testing se aplicó



El Stress Testing solo se puede aplicar para Grupos, Tipos, Líneas o Portafolios. No se podrá hacer para inversiones individuales. La escogencia de procedencia de datos para la información histórica si aplica para todo tipo de inversiones.

Aplicar StressTesting a	PORTAFO	110		Bene	ficiarios	
Todo el Portafolio	Nombre	PROFESIONAL	ES	02		YY S.A.
C Cada Título	Tipo	GEN				
Organizar	Lines Mag			<u> </u>		
Por Grupo	Linea Ney.	PWPCLI				
C Por Línea	(Construction)					**********************
C Por Tipo						
C Por Portafolio						
	Monodo	Malor 2		non Valor	<u> </u>	Curus 2 AZ
E CLIENTES	TBM	2197 72	D	TF	918	CEC
VAMCOL	UVR	181.7891	<u> </u>	2P 7	7.67	CECUVR
PRUEBA 513		1 contract	IF	20	7.67	CRCDT
			> <		>	
	Especie	Deposit	<u>^</u>	Especie	Fecha Vto 🔨	Variaciones de Stress en
	BPEMINHT.	A4 DCV		BPEMINHTA4	04/12/20	Volatilidad %
	CDTBB010		>>	CDTRGA10D	03/06/20	VaR %
	CDTBGA10			CDTCNESIV	17/03/20	Stress a
	OPCFTRM	DCV		CDTCNFS0V	23/06/20	Precio
	OPCFTRM	DCV	6	CDTCNFS0V	25/06/20	C Tir% -4
E 1	OPCFTRM	DCV		CDTDVISOV	06/04/20	Adit/Mult
	OPCFTRM	DCV	题	CDTDVISOV	05/02/20	
	OPCFTRM	DCV		CDTDVISOV	25/02/20	TNUEDCTONEC
	OPCETRM	DCV		CDTFALSOV	14/01/20	INVERSIONES
	OPCETPM			CDTEINSON	14/01/20	
	UPCPTRM		~	COTFINSOV	13/01/20	
ß		>			>	Ingresar
	37			73 Titulos		·····

AREA 1: Aquí se encuentran los portafolios y sus inversiones reales para conformar en este módulo los portafolios ficticios. Si desea hacerlo deberá escoger las inversiones y oprimir el botón que se encuentra en la mitad de las dos cuadrículas para agregar o quitar inversiones.

<u> </u>	
>>	

AREA 2: Aquí se muestra la información relacionada con el PORTAFOLIO

AREA 3: Aquí se define si la variación del Stress se da por la volatilidad o por el VaR.

AREA 4: Aquí se define si el Stress va a Precio o a Tir, adicionalmente se define como se va a calcular el castigo es decir si es Aditivo o Multiplicativo.

AREA 5: En esta opción se ingresan las inversiones.



AREA 6: En esta área se encuentra el botón aplicar castigo, el cual se utiliza solo cuando el castigo se aplica por título.

AREA 7: En esta área se muestran los castigos aplicados por Moneda, Tasa

o por Curva. Los métodos de medición funcionan igual que en el módulo





 \sim

12.1. SIMULACIÓN HISTÓRICA

Método - Simulación Histórica (Grupo : CLIENTES) X
Fecha Medición	07/03/2018 •
Número de Observaciones	45
Nivel de Confianza	95
- Seleccione la Fuente de Información -	Seleccione Precio -
C ALTERNA	Precio Sucio
(* INFOVAL	Precio Limpio
-Seleccione	tardar unos minutos.
C Sim	r espere.
	Acepta 🔀 Cerrar

12.2. MONTECARLO ESTRUCTURADO

Metodo - Montecano Estructurat	io (orupo : cere	
Fecha Medición	07/03/2018 💌	-
Número de Observaciones	45	_
Horizonte Temporal	1	
Nivel de Tolerancia	0.01	-
Nivel de Confianza	95	_
Número de Simulaciones	2000	_
Seleccione la Fuente de Información -		Seleccione Precio -
C ALTERNA		Precio Sucio
INFOVAL		C Precio Limpio
Seleccione el tipo de la Moneda		
C Simulada C Histórica	Actual	
	Actual	
		. 57
	Ace	otar 🔟 Cerrar

12.3. DURACIÓN MODIFICADA

📓 Método - Duración Modificada (Grupo : CLIENTES) ×
Fecha Medición Número de Observaciones Horizonte Temporal Nivel de Tolerancia Nivel de Confianza	007/03/2018 ▼ 45 1 0.01 ▼ 95
Seleccione la Fuente de Información - C ALTERNA INFOVAL	
	Aceptar 🔀 Cerrar



Fecha Medición 07/03/20	018 🔻
Número de Observaciones 45	
Horizonte Temporal	
Nivel de Tolerancia 0.01	👻 🗌 VaR Factores
Nivel de Confianza 95	
Seleccione la Fuente de Información	Seleccione Precio -
C ALTERNA	Precio Sucio
INFOVAL	C Precio Limpio

12.5. ARQUEO

Después de elegir el portafolio o los portafolios a los que desea hacer arqueo. Adicionalmente tiene la opción de agregar títulos desde la parte derecha, quitarlos de la parte izquierda o registrarlos, exactamente igual que cuando va a ejecutar un proceso de "Stress Testing". Lo que seleccione aquí será lo que el sistema utilice como referencia para hacer el arqueo, como se ve en la figura:

Archivo Mét	odos							
Sind School Sind S	Aplicar StressTesting a . Todo el Portafolio Cada Título Organizar Por Grupo Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre 🔀 Tipo GNA Linea Neg. PUBLI	04/08	;/2012	Benefit	iarios	XX S.A.	
Duración Modificada	CLIENTES	Moneda Valor UVR 202 < Especie	2.5213 Deposito		sa Valor 5. 3 3 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5	276 .43 .43 .43 .43 .43 .43 .43 .43	CEC CECUVR CECUVR CRCDT	de Stress en
Arqueo D	lepósitos	BAAA1033VA BBCB1079C60V BPEMINHTA3 CDTBCB80P TFIC07240712 TFIT06141113 TFIT06141113 TFIT06141113	DVL DVL DCV DCV DCV DCV DCV		BAAA1039VA BBCB1079C60V BPEMINHTA3 CDTBCB80P IBRH13F TFIC07240712 TFIC06141113 TFIT06141113	20/05/2013 26/09/2012 27/12/2013 14/06/2013 15/09/2012 24/07/2012 14/11/2013 24/07/2020	Volatilidad % VaR % Stress a Precio C Tir % Adit/Mult	
Salir		TUVT06200313 TUVT06200313 (*	DCV DCV	9	TTI 13240720 TUVT06200313	24/07/2020 20/03/2013	INVERS	, IONES



Una vez hecho lo anterior, pulse el botón "Arqueo" de la parte izquierda. Le aparece la siguiente pantalla:

S ARQUEO		
Fecha Registro Tipo Filtro Dep. Depósito Cuenta W/06/2012	Nivel PORTAFOLIO	Nombre Nivel

La opción "Cargar" le permite cargar los archivos de los depósitos para el arqueo. El sistema cargará los archivos a la fecha indicada en el campo "Fecha Registro" y con código de depósito según el campo "Depósito". La estructura de los archivos es como la que se muestra en FormatosTodasEntrada.xls en las hojas "ArqDeceval", "ArqDCV" y ArqCLSTR", para el depósito respectivo.

El botón "Procesar" le permite realizar el arqueo. Antes de pulsarlo defina las condiciones:

- a. Fecha Registro: Deje la que está porque a esa fecha y con las posiciones seleccionadas antes de entrar será realizado el proceso.
- b. Tipo Filtro Dep. Este campo le permite determinar si desea que de las posiciones seleccionadas se tomen solo los que tengan como depósito lo mismo que selecciones en el "Depósito":
- i. SINFILTRO: Significa tome todo lo que encuentre en los portafolios seleccionados.
- i. FILTREDEP: Significa tome sólo lo del mismo depósito.
- c. Depósito:
- i. TODOS: Significa que el arqueo se hará a todos los depósitos.
- i. DCV, DVL o CLSTR: Instruye al sistema para busque los datos cargados, a la fecha registro indicada, de ese depósito.
- d. Cuenta:
- i. TODAS: Se incluirán todas las cuentas
- i. Cualquier otra: Se tomará solo esa.



Una vez definido lo anterior pulse el botón "Procesar" y le aparecerá la pantalla así:

ARQUEO		-	Same."									-	• X
Cargar P	rocesar	Exportar Consulta	r Cerrar										
Facha Ba	nistro	Tino Eiltro Den	Denésito	Cuenta					Nival	Nombre Nive	al		
DAV0E/20											51		
04700720	512 •			TODAO					l' on				
Tipo	FechaR	eg ISINoNumEmi	Especie	Moneda	Deposito	Depositan	Cuenta	Estado	SaldoPortafolio	S aldoD eposito	ArqueoTotal	ArqueoDisponible	PrtD 🔺
DETALLE	06/04/20	12 USC71058AB42	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279-	CEROPRT	0	1,150,000	1,150,000	1,150,000	
DETALLE	06/04/20	12 USP09645AG07	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279-	CEROPRT	0	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 USP93077AA61	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279-	CEROPRT	0	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 ×S0479889007	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279-	CEROPRT	0	1,500,000	1,500,000	1,500,000	
DETALLE	06/04/20	12 ×\$0749067020	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279-	CEROPRT	0	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 48298	TFIC07240712	COP	DCV			BALANCE	1,320,000,000	1,320,000,000	0	0	1,3
DETALLE	06/04/20	12 51371	TUVT06200313	UVR	DCV			BALANCE	465,000,000	465,000,000	0	-40,000,000	4
DETALLE	06/04/20	12 51927	TFIT15240720	COP	DCV			CERODEP	1,600,000,000	0	-1,600,000,000	-1,600,000,000	1,6
DETALLE	06/04/20	12 51932	TFIT06141113	COP	DCV			BALANCE	170,005,200,000	170,005,200,000	0	-59,505,200,000	170,0
DETALLE	06/04/20	12 SINISIN000000	1 CDTBCB80P	COP	DCV			CERODEP	1,000,000,000	0	-1,000,000,000	-1,000,000,000	1,0
DETALLE	06/04/20	12 35695	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	8,000,000,000	8,000,000,000	8,000,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 44616	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	16,085,000,000	16,085,000,000	16,085,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 47798	SINESPECIE	UVR	DCV	23	23	CEROPRT	0	19,539,700	19,539,700	19,539,700	
DETALLE	06/04/20	12 48273	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	18,403,000	18,403,000	18,403,000	
DETALLE	06/04/20	12 51176	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	3,048,041	3,048,041	3,048,041	
DETALLE	06/04/20	12 54689	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	500,000,000	500,000,000	0	
DETALLE	06/04/20	12 54706	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	33,014,789,000	33,014,789,000	0	
DETALLE	06/04/20	12 54796	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	1,132,289,000	1,132,289,000	0	
DETALLE	06/04/20	12 COB07CB00090	BBCB1079C60V	COP	DVL			BALANCE	8,833,000,000	8,833,000,000	0	0	8,8
DETALLE	06/04/20	12 COE07CB00011	BAAA1039VA	COP	DVL			BALANCE	1,000,000,000	1,000,000,000	0	0	1,0
DETALLE	06/04/20	12 COL17CB0BBF9	BPEMINHTA3	COP	DVL			BALANCE	138,269,000	138,269,000	0	0	1
DETALLE	06/04/20	12 COB01CD51266	SINESPECIE	COP	DVL	23	21276	CEROPRT	0	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 COB12CD31539	SINESPECIE	COP	DVL	23	23	CEROPRT	0	9,000,000,000	9,000,000,000	9,000,000,000	
DETALLE	06/04/20	12 COT80CH00849	IRST10131216	COP	DVL	23	23	CEROPRT	0	474,883,013	474,883,013	474,883,013	
DETALLE	06/04/20	12 COV37CB00046	SPAT1097D37	UVR	DVL	23	23	CEROPRT	0	80,100,000	80,100,000	80,100,000	
TOTALGRAL	06/04/20	12 GENERAL	GENERAL	GENERAL				ROJOPRT	184,361,469,000	250,600,170,754	66,238,701,754	-27,953,576,246	184,3
TOTALMON	06/04/20	12 COP	COP	COP				ROJOPRT	183,896,469,000	250,024,881,054	66,128,412,054	-28,023,865,946	183,8 🚽
1	1		1	1									•
Registro(s	s): 29												
<u> </u>													

Resultados del arqueo. Algunos datos importantes del arqueo:

- a. Tipo. Este campo indica la clase de información que contiene la línea de resultados:
 - i. DETALLE. Es el resultado de una posición en particular.
 - ii. TOTALGRAL. Es el resultado del total de posiciones revisadas y del total de datos de depósitos tomados.
 - iii. TOTALMON. Indica que la línea contiene los resultados de la moneda referenciada en el campo Moneda.
- b. Estado. En el campo "Estado" encontrará unos código que el indican que tipo de resultado se obtuvo para cada papel, cada moneda o en total:
 - i. CEROPRT. Para esa posición, encontrada en el depósito, no hay datos en el portafolio seleccionado.
 - ii. CERODEP. Para esa posición, encontrada en el portafolio, no hay datos en el depósito.
 - iii. BALANCE. Eureka, lo mismo que hay en el portafolio se encontró en el depósito.
 - iv. ROJOPRT. Hay más en el depósito que en el portafolio.
 - v. ROJODEP. Hay más en el portafolio que en el depósito.
- c. Valores para el arqueo:
 - i. SaldoPortafolio. Total encontrado en el portafolio.
 - ii. SaldoDepósito. Total hallado en depósito.
 - iii. ArqueoTotal. SaldoDepósito SaldoPortafolio.
 - iv. ArqueoDisponible. DepDisponible PrtDisponible
 - v. Aplique la lógica para los demás campos.
 - El botón Exportar, exporta a Excel lo que está en la grilla,



tal como está. Si la grilla contiene los resultados de "Procesar", exporta esos resultados; y si contiene los resultados de "Consultar", exporta lo consultado.

 El botón Consultar. Le permite consultar la información cargada de los depósitos. Los parámetros de consulta son los que están en los campos Fecha Registro, Depósito y Cuenta. Una vez pulse "Consultar" le aparece la pantalla así:

ARQUEO	-	-	ingroup of the										
) r	1										
Fecha Registro	Tipo Filtro	Dep. Depč	isito Cuenta				Niv	el	Nombre Niv	el			
04/06/2012 👻	SINFILTE		OS TODAS				PO	RTAFOLIO	×				
FechaReg Deposito	Depositan	Cuenta	ISINoNumEmi	Secuencia	TipoSaldo	Saldo Moneda	TasaRef	Spread	Modalidad	FechaEmi	Fecha¥en	TipoldTitu	NitTitular
04/06/2012 CLSTR	23	890300279-4	USC71058AB42	1	DI	1,150,000.00 TRM	FS	7.2500	NO		12/11/2021	N	890300279-4
04/06/2012 CLSTR	23	890300279-4	USP09645AG07	2	DI	2,000,000.00 TRM	FS	4.7500	NO		16/11/2016	N	890300279-4
04/06/2012 CLSTR	23	890300279-4	USP93077AA61	3	DI	2,000,000.00 TRM	FS	5.7000	NO		20/12/2022	N	890300279-4
04/06/2012 CLSTR	23	890300279-4	×S0479889007	4	DI	1,500,000.00 TRM	FS	6.2500	NO		20/10/2013	N	890300279-4
04/06/2012 CLSTR	23	890300279-4	×\$0749067020	5	DI	4,000,000.00 TRM	FS	2.7000	NO		26/12/2013	N	890300279-4
04/06/2012 DCV	23	23	35695	10	0	8,000,000,000.00 COP	IPC	8.2800	AV	25/02/1998	25/02/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	44616	11	0	16,085,000,000.00 COP	IPC	8.2800	AV	25/03/1998	25/03/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	47798	13	0	19,539,700.00 UVR	FS	.0000	AV	13/01/2005	13/01/2015	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	48273	12	0	18,403,000.00 COP	IP4	.0000	AV	08/07/2005	08/07/2012	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	48298	5	0	1,320,000,000.00 COP	FS	.0000	PV	24/07/2005	24/07/2012	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	51176	1	0	3,048,041.00 COP	IPS	.0000	AV	02/10/2007	02/10/2012	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	51371	6	0	425,000,000.00 UVR	FS	.0000	AV	20/03/2007	20/03/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	51371	7	4	40,000,000.00 UVR	FS	.0000	AV	20/03/2007	20/03/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	51932	8	0	110,500,000,000.00 COP	FS	.0000	AV	14/11/2007	14/11/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	51932	9	4	59,505,200,000.00 COP	FS	.0000	AV	14/11/2007	14/11/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	54689	3	4	500,000,000.00 COP	DTF	.0000	AV	20/01/2012	20/01/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	54706	4	4	33,014,789,000.00 COP	DTF	2.0000	AV	28/01/2012	28/01/2013	N	890300279
04/06/2012 DCV	23	23	54796	2	4	1,132,289,000.00 COP	DTF	4.0000	AV	27/04/2012	27/04/2013	N	890300279
04/06/2012 DVL	23	21276	COB01CD51266	3	DI	500,000,000.00 COP	IPC	3.6000	TV	18/08/2011	18/02/2015	N	8600048756
04/06/2012 DVL	23	23	COB07CB00090	1	DI	8,833,000,000.00 COP	IPC	6.1000	TV	26/09/2007	26/09/2012	N	8903002794
04/06/2012 DVL	23	23	COB12CD31539	2	DI	9,000,000,000.00 COP	FS	.0000	PV	15/02/2012	16/05/2012	N	8903002794
04/06/2012 DVL	23	23	COE07CB00011	4	DI	1,000,000,000.00 COP	IPC	8.5000	TV	20/05/2003	20/05/2013	N	8903002794
04/06/2012 DVL	23	23	COL17CB0BBF9	5	DI	138,269,000.00 COP	IPC	3.0000	PV	13/09/2007	27/12/2013	N	8903002794
04/06/2012 DVL	23	23	COT80CH00849	6	DI	474,883,012.67 COP	FS	.0000	MV	13/12/2006	13/12/2016	N	8903002794
04/06/2012 DVL	23	23	COV37CB00046	7	DI	80,100,000.00 UVR	FS	.0000	AV	18/06/2009	15/02/2013	N	8903002794
< []													
Registro(s): 25													
ncgistro(3). 25													

• El botón Cerrar. Utilice este botón para salir de la función Arqueo.



12.6. VER INVERSIONES

Se ingresa la fecha del portafolio donde se desea ver las inversiones.

🍠 Fecha Portafolios	\times
Fecha Medición 07/03/2018	
Aceptar 🛛 Cerrar	

Se visualiza a continuación las inversiones realizadas en fecha especificada.

Aplicar StressTesting a Todo el Portafolio Cada Título Organizar Por Grupo Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Por Tafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea Neg.	07/03	/2018	Beneficia	arios ———			
B CLIENTES	Moneda Val	or X	Tasa	Valor	*	Curva <	%	Adit./
	Especie		<	cie // /TRM // A // 32133CG63 /	Fecha Vto. 16/04/2018 26/02/2018 11/02/2023	Variacion Volatilidad VaR % Stress a. © Precio © Tir % Adit/Mul	nes de Stra % 	255 en
	<	>	3 Tibul			Ing	gresar	



13.BACKTESTING



Este módulo permite validar su modelo *VaR*, verificando la eficiencia de los resultados estimados. Utilizando el **BACKTESTING** teórico, el cual supone que la composición de la cartera no varía, se puede validar si los parámetros utilizados para medir el riesgo son representativos y estables y ajustar dichos parámetros a partir de la observación obtenida. El **BACKTESTING** solo se puede aplicar a Grupos, Tipos, Líneas o Portafolios.

Al dar clic en el botón respectivo aparece la siguiente pantalla:



13.1. SIMULACIÓN HISTORICA BACKTESTING

A partir de los datos seleccionados el sistema despliega la siguiente pantalla con la información correspondiente al Portafolio, los Datos Suministrados por el Usuario y los resultados obtenidos los cuales corresponden a: Variación Fuera de Control y *VaR* Promedio del Período.

En la cuadricula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, perdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

Cuando se da clic en el Modulo Backtesting aparece la pantalla donde se selecciona



la fecha del Portafolio.

🔊 Fecha Portafolios 🛛 🛛 🔀
Fecha Medición 🕕/01/2009 💌
Aceptar 🔀 Cerrar

Después de seleccionar la fecha se debe dar Aceptar y aparece la siguiente pantalla.

📓 Método - Simulación Histórica (Grupo :	CLIENTES) 🛛 🔀
Fecha Inicio 05/01/2009	•
Fecha Fin 06/01/2009	•
Número de Observaciones 20	
Nivel de Confianza 95	
Seleccione la Fuente de Información	- Seleccione Precio -
 INFOVAL 	C Precio Limpio
Seleccione el tipo de la Moneda Bac	kTesting
C Simulada 💿 Histórica C Actual	Histórico
	cepta 🔀 Cerrar

Nota: Se debe tener en cuenta que esta pantalla es la misma que aparece en los cuatro métodos. Por esa razón esta descripción es general para los cuatro métodos

Los métodos de medición se manejan de la misma forma que en el módulo PORTAFOLIOS Y RIESGO Los datos de entrada se describen a continuación:

Fecha Inicio: Fecha de Inicio de la medición.Fecha Fin: fecha final de la mediciónNúmero de Observaciones: Es la cantidad de datos históricos que se va a tomar de



cada una de las posiciones del Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio que se vaya a valorar. Este rango de observaciones deber ser mayor a 20 y menor a 999. En caso de que se encuentren rangos menores a 20 no se valora la posición; así mismo cuando sé este valorando un Grupo, Línea de Negocio, Tipo de Portafolio o Portafolio se trabajará con la cantidad de rangos de la posición que menos tenga. Esto solo aplica para este método.

Nivel de Confianza: Es la certeza con la cual, la perdida probable del portafolio este considerado en el *VaR*.

Seleccione la Fuente de Información: La información puede ser:

Alterna: Información diferente a la suministrada por INFOVAL

Infoval: Información suministrada por la Bolsa de Valores.

Seleccione Precio: El precio puede ser:

Precio Sucio: Precio actual del papel

Precio Limpio: Precio descontando los rendimientos pendientes de pago.

Seleccione el Tipo de moneda: El tipo de Moneda puede ser:

Simulada: Proceso de simulación que determina la volatilidad de la moneda.

Histórica: Se toma el valor histórico que la moneda registró ese día.

Actual: La de hoy

Backtesting: El Backtesting puede ser:

Actual: Se toma el portafolio del día y a ese mismo portafolio se le mide el VaR en el rango de fechas dado.

• **Histórico:** Se toma el portafolio de cada día y se le mide el VaR en rango de fechas dado.

Después de dar clic en el Botón Aceptar se genera la pantalla que se muestra a continuación.



🌃 Método de Simulación Histórica por G	гиро.	
GRUPO Grupo CLIENTES Descripción PORTAFOLIOS CLIENTES	DATOS SUMINISTRADOS Fecha Fecha 05/01/2009 06/01/2009 Nro. Observaciones Solicitado Real 20 20 20 2 Niveles Confianza 95	Resultados Obtenidos Nivel Eficiencia Eficiencia Modelo 0.5 0.5 Obs. Out Total Obs. 1 2 Decisión de Calibración del Modelo Nivel Eficiencia (1-P) 0.5 0.05
Fecha Lim. Inferior VaR \$ Proyect L 05/01/2009 \$ 220,658,07600002 \$ 06/01/2009 \$ 1,700,496,12100002 \$	im. Superior VaR \$ Proyet Pérdida o Ganancia Real Vir. Port \$ 1,087,643.58739393	afolio <u> § 892,025,541,59</u> § 888,656,649,84
	5 📈 Total 😿 Diario 🌃 Gr	áfico 😥 Exportar 🔀 Cerrar

En la pantalla anterior se muestran las siguientes áreas:

Área 1: En esta área se encuentra la información general del Grupo, Tipo, Línea o Portafolio.

Área 2: En esta área se encuentra la información que se suministró para llevar a cabo la medición del **BACKTESTING**.

Área 3: En esta área se encuentran los resultados finales tales como Nivel de eficiencia, la eficiencia del modelo, observaciones fuera de límite, el total de observaciones etc.

Área 4: En esta área se encuentran datos tales como cada una de las fechas hábiles en la que se hizo la medición, el límite inferior del VaR en Pesos, el límite superior del VaR en pesos, la pérdida o ganancia real y el valor del portafolio en ese día.

Área 5: En esta área se encuentran utilidades tales como:

• TOTAL





👫 Información d	del Total del B	ackTestin	g por Activ	0			
PORTAFOLIOS							
	Nivel Eficier	Eficiencia	Obs Out	(1-P)	Observaciones		
CNEC	0.5	0.5	1	0.05			
CNEC	0.5	0.5	1	0.05			
GRUPUAVAL	0.0	1.0	0	0.05			
GROPUSURA	0.0	1.0	U	0.05			
							>
						Euroday	
						Resultado	Cerrar

Esta pantalla muestra el total del Backtesting por activo, la información puede ser llevada a Excel para presentar diversos informes.

• DIARIO.





5	🖁 Información del BackTesting por Activo						
	ACTIVOS						
		Fecha	Limite Inferic	Limite Super	PYG Real	Observaciones	
	CNEC	03/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00		
	CNEC	03/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00		
	GRUPOAVAL	03/11/2010	(,413,667.18	1,485,702.38	-,000,000.00		
	GRUPOSURA	03/11/2010	,641,007.25	499,710.725	,500,000.00		
	CNEC	04/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	1,500,000.00		
	CNEC	04/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	1,500,000.00		
	GRUPOAVAL	04/11/2010	1,369,333.84	1,362,511.44	:,000,000.00		
	GRUPOSURA	04/11/2010	,618,640.95	473,206.095	,000,000.00		
	<					>	
	,						
-							
							1
						Exportar 🔽 cause	
						📈 Resultado 🔼 Cerrar	

Información discriminada por día del Backtesting por activo, adicionalmente puede llevar la información a Excel para diversos informes.

• **GRAFICO**

Con esta opción se puede observar el gráfico de los límites inferior y superior del **VaR** en pesos versus las pérdidas o ganancias reales de la fecha en cuestión. El gráfico se muestra como sigue:





Como se puede observar en la pantalla anterior se puede visualizar el gráfico respectivo al portafolio. La línea verde es el límite superior o el VaR en pesos positivo, la Línea roja es el límite inferior o el VaR en pesos negativo. Las barras azules son las pérdidas o ganancias reales. Si son Ganancias las barras van hacia arriba, si son Pérdidas las barras van hacia abajo. Para ver el valor posicione el Mouse en el punto y vea el valor en la casilla Valor Miles.

EXPORTAR RESULTADO



Con esta opción se puede exportar a Excel los resultados de la medición respectiva. Debe hacer clic en el botón e inmediatamente aparece una pantalla que le pide el nombre y la ubicación del archivo. Usted deberá hacerlo y dar clic en guardar. Seguido aparecerá un mensaje de Transacción Exitosa.

13.2. MONTECARLO ESTRUCTURADO BACKTESTING

Al dar clic en este Método se despliega la siguiente pantalla, la cual ya se describió en el Método de Simulación Histórica.

📓 Método - Montecarlo Estructi	urado (Grupo : CLIENTES) 🛛 🔀			
Fecha Inicio	05/01/2009 🔻			
Fecha Fin	06/01/2009 💌			
Número de Observaciones	20			
Horizonte Temporal	1			
Nivel de Tolerancia	0.01 🗨			
Nivel de Confianza	95			
Número de Simulaciones	200			
Seleccione la Fuente de InformaciónSeleccione Precio				
C ALTERNA	Precio Sucio			
INFOVAL	C Precio Limpio			
Seleccione el tipo de la Moneda BackTesting				
C Simulada C Histórica C Actual C Histórico				
Aceptat Cerrar				

A partir de los datos seleccionados el sistema despliega la siguiente pantalla con



la información correspondiente al Portafolio, los Datos Suministrados por el Usuario y los resultados obtenidos los cuales corresponden a: Variación Fuera de Control, **VaR** Promedio del Período y el Lambda.

En la cuadricula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, perdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

La pantalla final de resultados se muestra a continuación:

👫 Método de Montecarlo Estructurado	por Grupo.
GRUPO Grupo CLIENTES Descripción PORTAFOLIOS CLIENTES 1 BACKETESTING ACTUAL	DATOS SUMINISTRADOS Fecha Fecha Resultados Obtenidos 05/01/2009 06/01/2009 1.0 0.0 Nro. Observaciones 200 0bs. Out Total Obs. 3 20 20 1 0.0 0bs. Out Total Obs. 3 Niveles 0 0.0 0.0 0bs. Out Total Obs. 3 0 20 20 1 0.0 0.0 0.0 0.0 Niveles 0.79432823 1.0 0.05 0.0 0.0 0.0
Lim. Inferior VaR \$ Proyect 05/01/2009 \$ 119,248,983473683 06/01/2009 \$ 926,642.772693833	Lim. Superior VaR \$ Proyet Pérdida o Ganancia Real VII. Portafolio \$ 738,521,413502336 \$ 738,880,44999999 \$ 882,025,541,59 \$ 1,183,803,06341043 \$ 77,098,033,43 \$ 888,656,649,84
	4 5 💌 Total 💌 Diario 🕅 Gráfico 🖉 Exportar

En la pantalla anterior se muestran las siguientes áreas:

Área 1: En esta área se encuentra la información general del Grupo, Tipo, Línea o Portafolio y los correspondientes beneficiarios.

Área 2 En esta área se encuentra la información que se suministró para llevar a cabo la medición del **BACKTESTING**.

Área 3: En esta área se muestran los resultados obtenidos en la medición del Backtesting.

Área 4: En esta área se encuentran datos tales como cada una de las fechas hábiles en la que se hizo la medición, el límite inferior del VaR en Pesos, el límite superior del VaR en pesos, la pérdida o ganancia real y el valor del portafolio en ese día.



Área 5: En esta área se encuentran utilidades tales como en el módulo anterior el sistema proporciona las siguientes utilidades para Información del total del Backtesting por activo, Información diaria, Gráficos y Exportar a Excel.

13.3. DURACIÓN MODIFICADA BACKTESTING

Al dar clic en este Método se despliega la siguiente pantalla, la cual ya se describió en el Método de Simulación Histórica.

📓 Método - Duración Modificad	a (Grupo : CLIENTES) 🛛 🛛 🔀
Fecha Inicio	05/01/2009 💌
Fecha Fin	06/01/2009 💌
Número de Observaciones	20
Horizonte Temporal	1
Nivel de Tolerancia	0.01 👻
Nivel de Confianza	95
	,
Seleccione la Fuente de Información –	
C ALTERNA	
INFOVAL	
Seleccione el tipo de la Moneda	BackTesting
🔿 Simulada 💿 Histórica 🔿 Actu	Jal C Histórico
	Aceptar 🔀 Cerrar

A partir de los datos seleccionados el sistema despliega la siguiente pantalla con la información correspondiente al Portafolio, los Datos Suministrados por el Usuario y los resultados obtenidos.

En la cuadricula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, perdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

La pantalla final de resultados se muestra a continuación:



🌃 Método de Duración Modificada por G	irupo. 🔲 🗖 🔀
GRUPO Grupo CLIENTES Descripción PORTAFOLIOS CLIENTES 1 BACKETESTING ACTUAL	DATOS SUMINISTRADOS Fecha Fecha
Fecha Lim. Inferior VaR \$ Proyect [L] 05/01/2009 \$ 774,114,682440967 06/01/2009 \$ 4,224,506,70105397	Superior VaR \$ Proyec Pérdida o Ganancia Real Vir. Portafolio \$ 774,114.682440967 \$ 814,198,470000001 \$ 892,025,541,59 \$ 4,224,506,70105397 \$ 3,368,891,75000002 \$ 888,656,649,84

En la pantalla anterior se muestran las siguientes áreas:

Área 1: En esta área se encuentra la información general del Grupo, Tipo, Línea o Portafolio y de los beneficiarios.

Área 2: En esta área se encuentra la información que se suministró para llevar a cabo la medición del **BACKTESTING**.

Área 3: En esta área se encuentran los resultados finales tales como Nivel de eficiencia, eficiencia del modelo, Observaciones fuera, total de observaciones etc.

Área 4: En esta área se encuentran datos tales como cada una de las fechas hábiles en la que se hizo la medición, el límite inferior del VaR en Pesos, el límite superior del VaR en pesos, la pérdida o ganancia real y el valor del portafolio en ese día.

Área 5: En esta área se encuentran utilidades tales como ver el Total, el Diario, el Grafico y Exportar los Datos a Excel

13.4. DELTA NORMAL BACKTESTING

Al dar clic en este Método se despliega la siguiente pantalla, la cual ya se describió en el Método de Simulación Histórica.



Método - Delta Normal (Grupo : CLIENTES	5) 🛛 🔀			
Fecha InicioImage: 20Fecha Fin06/01/2009Número de Observaciones20Horizonte Temporal1Nivel de Tolerancia0.01Nivel de Confianza95	▼ ▼ VaR Factores			
Seleccione la Fuente de Información C ALTERNA C INFOVAL	Seleccione Precio – Precio Sucio Precio Limpio			
Seleccione el tipo de la Moneda BackTesting C Simulada • Histórica Actual C Histórico • Histórico				
Ac	eptar 🔀 Cerrar			

A partir de los datos seleccionados el sistema despliega la siguiente pantalla con la información correspondiente al Portafolio, los Datos Suministrados por el Usuario y los resultados obtenidos.

En la cuadricula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, perdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.



🌃 Método de Delta Normal por Grupo.		
GRUPO Grupo CLIENTES Descripción PORTAFOLIOS CLIENTES BACKETESTING ACTUAL	DATOS SUMINISTRADOS Fecha Fecha 05/01/2009 06/01/2009 Nro. Observaciones 200 Solicitado Real 1 20 20 Niveles 0.79432823 95 0.01 2	Resultados Obtenidos Nivel Eficiencia Eficiencia Modelo 1.0 0.0 Obs. Out Total Obs. 2 2 Decisión de Calibración del Modelo Nivel Eficiencia (1-P) 1.0 0.05
Lim. Inferior VaR \$ Proyect 05/01/2009 \$ 787,398,437685515 06/01/2009 \$ 3,343,146,19478635	Lim. Superior VaR \$ Proyec(Pérdida o Ganancia Real Vir. Porta \$ 787.398.437685515 \$ \$14,198.470000001 \$ 3,343,146.19476635 -\$ 3,368.891.75000002 4	folio \$ 892,025,541,59 \$ 888,656,649,84
s	5 📈 Total 😿 Diario 🔝 Gré	áfico 😥 Exportar Resultado 🖸 Cerrar

En la pantalla anterior se muestran las siguientes áreas:

Área 1: En esta área se encuentra la información general del Grupo, Tipo, Línea o Portafolio y sus beneficiarios.

Área 2: En esta área se encuentra la información que se suministró para llevar a cabo la medición del **Backtesting**.

Área 3: En esta área se encuentran los resultados finales tales como Variación fuera de control, es decir todas aquellas pérdidas y/o ganancias que se salen del límite inferior y superior del *VaR*, el *VaR* en pesos promedio del periodo, es decir, del rango de días que se solicitó y el lambda.

Área 4: En esta área se encuentran datos tales como cada una de las fechas hábiles en la que se hizo la medición, el límite inferior del VaR en Pesos, el límite superior del VaR en pesos, la pérdida o ganancia real y el valor del portafolio en ese día.

Área 5: En esta área se encuentran utilidades tales como ver el Total, el Diario, el Grafico y Exportar los Datos a Excel.



FRONTERA EFICIENTE



Herramienta muy útil que nos sugiere una composición optima del portafolio para obtener la mejor tasa con el mínimo riesgo.



OPERACIÓN

Para el uso del Módulo de Frontera debe ingresar al módulo principal y presionar el Botón "Frontera Eficiente". Inmediatamente aparecerá una pantalla en la que deberá ingresar la fecha con la cual se cargarán en pantalla sus portafolios.

Al igual que en el Módulo de Stress, Frontera le facilita al usuario la conformación del portafolio a evaluar mediante la escogencia desde los portafolios que tiene en el sistema, o modificarlo agregando y quitando posiciones de izquierda a derecha.





- **1.** Cuando el usuario se sitúa en un portafolio específico, aparecerán en la lista de la derecha las posiciones que se encuentran dentro de ese portafolio, filtradas por condiciones faciales de manera que no se repita ningún papel.
- 2. Si el usuario se encuentra ubicado en un determinado portafolio y desea adicionar posiciones desde otro portafolio de la misma fecha, lo puede hacer oprimiendo éste botón. Inmediatamente aparecerá la pantalla de ingreso de compromisos con los datos del título donde se puede modificar, en caso de ser necesario. Al lado izquierdo no se pueden agregar posiciones que tengan características faciales iguales.
- **3.** Este botón se usa para quitar las posiciones que el usuario no quiere incluir en el proceso de Frontera Eficiente.
- **4.** En ésta grilla se encuentran todas las posiciones que hay para la fecha de portafolios dada cuando ingresó al módulo.
- **5.** Las Inversiones pueden ser ingresadas manualmente, tanto para acciones para renta fija o divisas.





En esta ventana puede escoger el tipo de inversión en la que trabajar ya sea Renta Fija, acciones y Divisas.

🗒 Renta Fija 🛛 🔀		
C Op. Plazo sción Normal C Contado+1a5 C Repo C Simultáneas C Trans. Temp. C Forward C Opciones C Op. Plazo		
Datos Compromiso Fecha Der Fec Cumplimiento Punta Posición Nro. Negocio Nro. de Orden Portafolio [#/11/201C [04/11/201C [04/11		
Valoración Emisión Vencimiento Tasa Nominal Completo-Cup-Ppal Modalidad Emisión 12/02/2002 12/02/2002 0.00 COMPLETO Modalidad Emisión 12/02/2002 12/02/2002 0.00 COMPLETO Modalidad Emisión Cantidad Valor de Compra Modalidad Reinv. 0.00 0.00 0.00 Trader Adicional Modalidad Reinv. Dias Cpr Fec Cpr. Orden CPR 0.00 0.00 04/11/2010 FINAL Image: Final		
Comisión Base Comisión Retención Base Retención Traslado Base Traslado Operación Origen		
PUC Nit Cliente Sistema Usuario Estación MEC		
Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA Cal. Crediticio Inv.		
Calcular Aceptar 🔀 Cerrar		

• Renta Fija



FRONTERA EFICIENTE – DELTA NORMAL

Después de escoger el portafolio de Frontera debe pulsar el botón "Frontera Ef." para ejecutar el proceso. Luego aparecerá una pantalla donde debe digitar los parámetros con los cuales desea correr el modelo.

📓 Método - Delta Normal (Grupo : CLIENTES)	X
Fecha Medición 102/01/2009 💌 Número de Observaciones 20	
Nivel de Confianza 05	
TLR Mínimo Iter. Monto a	Invertir
7.0 46,116,860,184,273,900,000 1,000,0	00,000.0
Multiplo Pesos M ínimo Pesos Multiplo Dif. Pesos 1,000,000.0 1,000,000.0 1,000,000.0	Mínimo Dif. Pesos 1,000,000.0
-Seleccione la Fuente de Información C ALTERNA C INFOVAL	-Seleccione Precio Precio Sucio Precio Limpio
Seleccione el tipo de la Moneda C Simulada C Histórica I Actual 0.0	ad Máxima lidad Mínima
Ace	otar 🔀 Cerrar

Esta pantalla se asemeja a la mostrada en los módulos Portafolios y Riesgo, Backtesting y Sensibilidad. Adicional a los parámetros que normalmente se solicitan se deberán ingresar los siguientes datos:

TLR: Tasa Libre de Riesgo.

Número Iteraciones: Cantidad de iteraciones que desea ejecute el proceso. El sistema por defecto le indica el mínimo de iteraciones que se deben ejecutar para obtener un resultado razonable y el número de iteraciones adecuado para correr el modelo. Se debe tener en cuenta que el número de iteraciones requeridas crece exponencialmente con el número de activos, así que a mayor número de activos a analizar mayores son los recursos de CPU, de memoria y de disco requeridos para ejecutar el proceso.

Monto a Invertir: Es el valor en pesos que se desea invertir en el portafolio establecido. **Múltiplo Pesos**: Factor que se utiliza para racionalizar los valores nominales de títulos emitidos en pesos.

Mínimo Pesos: Monto mínimo de inversión por activo, para títulos emitidos en pesos. **Múltiplo No Pesos**: Factor que se utiliza racionalizar los valores nominales de títulos emitidos en monedas diferentes al peso.


Mínimo No Pesos: Monto mínimo de inversión por activo, para títulos emitidos en monedas diferentes al peso.

Volatilidad Máxima: Usted puede indicarle al modelo la máxima volatilidad que espera, de forma que el sistema solo considerará en su búsqueda del punto óptimo las composiciones del portafolio que ofrezcan volatilidades menores a esa y elegirá la composición de mayor rentabilidad.

Rentabilidad Mínima: Usted puede indicarle al modelo la rentabilidad mínima que espera obtener, de forma que el sistema solo considerará en su búsqueda del punto óptimo las composiciones del portafolio que ofrezcan rentabilidades mayores a esa y elegirá la composición de menor volatilidad.

Luego de pulsar aceptar deberá esperar un tiempo ya que depende de la capacidad de su PC, del número de activos incluidos en el portafolio de evaluación y del número de iteraciones seleccionadas. Tres activos y 2.000 iteraciones se ejecutan típicamente en un par de minutos; sin embargo 30 activos pueden requerir tantas iteraciones que el proceso necesite hasta un par de horas si su PC no es de última generación. En otras palabras PWP le suministra un modelo que funciona con condiciones reales de mercado pero usted debe suministrar los recursos de procesamiento adecuados o racionalizar su portafolio o tener la paciencia suficiente. Recuerde que cuando hablamos de activos nos referimos a papeles con características faciales diferentes, en este sentido 50 TES2012 se consideran un solo activo. Al final el sistema le mostrará la pantalla con los resultados.

		Datos			Gráfi	0	
Óptimo Esperado	Rentabilidad 31.976 32.605	Volatilida 0.75211 0.76041 0.76041	d Tasa 19109861 0 58639443 7 Natilidad M finima 3042791166488	Libre Indice Shar 1.931 1.4651663 Rentabilida 01 0.1419495	Saldo Inversión \$ 1,159,659,4700 \$ 771,621,27999 Máxima 53693269	Error 9.049576812541 9.9.149491810623	57E-04 351E-04
Especie		Fecha Vcto.	eso Optimo %	Cantidad Optimo	Monto Optimo	Cant. Inv Optimo	Monto
TBFC05030	506	03/05/2006	54.733	\$ 661,316,015.02	00 \$ 547,328,782.691275	\$ 661,000,000.0	\$ 547,0
TBFC07220	808	22/08/2008	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBFT10250	112	25/01/2012	0.0	\$0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10260	110	26/01/2010	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10260	710	26/07/2010	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10290	310	29/03/2010	45.267	\$ 419,832,961.93	23 \$ 452,671,217.308725	\$ 419,000,000.0	\$ 451,7
TRST07210	1906	21/09/2006	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TUST05150	1306	15/03/2006	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TUST08180	1809	18/08/2009	0.0	\$0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0

La cual consta de dos partes:

Datos. Se especifican los siguientes resultados del portafolio, tanto para punto esperado como para el óptimo:

- Rentabilidad, Volatilidad, Índice Sharpe, Saldo de la inversión y el Error.
 - Volatilidad Mínima y Rentabilidad máxima de acuerdo a los



parámetros dados.

En los resultados detallados por inversión, se especifican tanto para el punto Óptimo como para el Esperado, lo siguiente: Especie, Fecha Vcto, Peso, Cantidad, Monto, Cantidad a Invertir, Monto a Invertir.



• **Grafico.** El gráfico se expresa de la siguiente manera:

▲ Son cada uno de los activos que se utilizaron para determinar la Frontera. ◆ Representan los puntos evaluados por el Modelo.

Es el punto Óptimo que encontró el modelo.

El Botón de exportar solo se utiliza para exportar los datos a un archivo de Excel, el grafico no se exporta. El gráfico solo se pinta hasta el número de puntos que soporta Excel (64.000), mas iteraciones quedan fuera del gráfico por ahora.

Acciones



Acciones	
Tipo de Operación	
⊙ Normal C Contado+1a3 C Repo C Oper. a Plazos C	Forward C OPCFTRM C Opciones C InterBancarios
Datos Compromiso Fecha Registro Fecha Registro Fecha Qper Fecha Quert Fecha Quert	nta Posición Número del Negocio DMPRA I LARGA I 0
Número de Orden Portafolio Em	isor Especie
O ACCIONES 🔽	Especie
Tipo Inversión Contraparte H	ora Compra Tipo Forward Depósito Isin/NumEmisión
TipoInversion 💌	🖬 12:04:16 p.m. 🛨 NDV 🔽 DVL 🔽 0
Valoración	
Cantidad Precio Valor de Compra Val	or Giro/Recom Valor Captación Tasa Repo
0.0 0.0000000 0.00 0.0	0.00000000 0.000
Fec Compromiso Dias Comprom. Orden Comprom. Adici	onal Trader
04/11/2010 💌 0.000 FINAL 🗨 0.00	0 Trader
Comisión Base Comisión Operación Origen	PUC Nit Cliente Sistema
	I MEC _
Usuario Estación Nombre Cliente	;
Mercedo Einelided Compenseción For	ma de Pago Deol de Cambio Nral Cambiario
Lugar de la transacción NA(NA) (PWP=0000)	✓ Pais Origen
Calcular 📢	Aceptar 🔀 Cerrar



Divisas

🔜 Divisas	\mathbf{X}
Tipo de Operación	
● Normal C Contado+1a3 C Repo C Oper, a Plazos C	C Forward C OPCFTRM C Opciones C InterBancarios
Datos Compromiso	
Fecha Registro Fecha Oper Fec Cumplimiento Pur	unta Posición Número del Negocio
04/11/2010 ▼ 04/11/2010 ▼ 04/11/201C ▼ CC	OMPRA 🔽 LARGA 🔽 🛛
Número de Orden Portafolio Em	misor Especie
0 ACCIONES	Especie
Tipo Inversión Contraparte H	Hora Compra Tipo Forward Depósito Isin/NumEmisión
TipoInversion 💌	💌 12:05:01 p.m. 芸 NDV 🚽 DVL 💌 0
Valeración	
Cantidad Precio Valor de Compra Val	alor Giro/Recom Valor Captación Tasa Repo
	00 0.0000000 0.000
Fee Compromise Dias Comprom Orden Comprom Adici	sional Trader
04/11/2010 V 0.000 FINAL V 0.00	00 Trader
	,
Comisión Base Comisión Operación Origen	PUC Nit Cliente Sistema
	MEC 🗸
Usuario Estación Nombre Cliente	e
Mercado Finalidad Compensación For	orma de Pago Decl. de Cambio Nral. Cambiario
SECUNDARIO - ESPECULA - DVP - TF	RA 🔽 0 0
Lugar de la transacción NA(NA). (75./(7-0000)	Pais Origen
Calcular 🛛	Aceptar 🛛 Cerrar

VER INVERSIONES

Con esta opción se pueden consultar inversiones de fechas anteriores y realizar las respectivas mediciones. Para ello solo debe seleccionar la fecha de la cual desee ver la información.





14.MARGINAL AND INCREMENTAL VAR



Una pregunta común de los administradores de portafolios y de riesgos es ¿Qué efectos tiene en el nivel de riesgo del portafolio cuando se adiciona o se quita un activo del mismo? Para resolver esta pregunta existen dos medidas muy útiles: el VaR Marginal y el VaR Incremental. PWPREI incluye ahora estas nuevas herramientas, que a continuación describimos.

• VaR Marginal.

El VaR Marginal mide la contribución al riesgo del portafolio de una posición en particular; es decir, cuanto cambia el VaR diversificado al comprar o vender un activo.

• VaR Incremental.

El VaR incremental mide el cambio del VaR del portafolio ante pequeñas variaciones de los activos; es decir, que efectos sobre el VaR tienen las variaciones de las diferentes posiciones del portafolio.

🛤 VAR MARGI	NAL E INCREMENTAL
Archivo Método	s
Métodos	
Salir	



14.1. OPCIÓN METODOS



14.1.1. DURACION MODIFICADA

Para evaluar el VaR Marginal y e VaR Incremental, proceda:

- 1. Acceso. Ingrese al módulo VaRMEi desde el menú principal
 - a. Seleccione el portafolio o grupo de portafolios para hacer la medición.
 - b. Seleccione el método de evaluación para el VaR.
 - c. Establezca las condiciones en la pantalla de medición, como se ve en la figura:

VAR MARGIN	IAL E INCREMENTAL		
Archivo Métod	los		
Métodos Duración Modificada	Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo C Por Por Partafolio	PORTAFOLIO 06/04/2016 Nombre Beneficiarios COOMEVA EMP01 F 01 Tipo 01 GEN 01	
saan Saliraaaan	Por Portafolio Por Portafolio CUENTES GECC COOMEVA EMP01 P01 COOMEVA EMP02 P01 COOMEVA EMP02 P02 COOMEVA EMP02 P02	Linea de Negodo [C00MEVAE01] INVERSIONES Ingresar Modificar Eliminar Punta Especie Número de Observaciones Horizonte Temporal OMPRA BALP1091A10 COMPRA BBCB03119010 COMPRA BBCB1099B15 COB CMPRA BBGA2133120 COB COMPRA BBGA2133120 COB CMPRA COMPRA BBGA2133120 COB CMPRA COMPRA BBGA2133920 COB CMPRA COMPRA BBGA2133920	rtal rtal rres

 Tipo Cálculo. La opción tipo cálculo le permite seleccionar la metodología para calcular el VaR Marginal y el Incremental. El proceso corriente consiste en calcular el VaR para el portafolio resultante de eliminar una posición del mismo y comparar



el resultado con el del portafolio antes de quitar la posición. Dado que este procedimiento requiere múltiples de ciclos puede resultar demasiado costoso en términos de tiempo de procesamiento; puede optar por el método que hemos denominado "Aproximación Derivada" que reduce el tiempo de proceso significativamente, con resultados igualmente válidos. Las opciones son:

- a. Aprox. Derivada.
- b. Recálculo del VaR.
- 3. **Resultados**. Pulse Aceptar para procesar el portafolio. Al final le aparece la pantalla de resultados:

🐇 Resultados del VaR por Factores 🗾 🗾 🗠							
Datos Históricos Exportar a Excel Cerrar							
		MEDICIO	N				
- General PORTAFOLIO COOMEV/	A EMP01 P01		-Resultados Ob Neto Portafolio \$ 102,327	tenidos	pra ,776,534,353.00		
-Datos Suministrados			\$ 106,546,	524,078.116	3.80737		
Niveles Solicitado Real	za 38	Volat. Portafo	lio PyG Rea 0.073716899 \$4 /aR (%)	l ,219,385,578.92 VaR (\$)			
			\$ 102,327,13	8,499.1	6 \$ 154.919.109.80		
Factor VaR %	VaR \$	VaR Marginal %	VaR Marginal \$	VaR Incremental Ջ VaR	Incremental \$		
BALP1091A10 0.335045	\$ 5,358,045.0	0.000124	\$ 1,983.01	0.000001	\$ 19.83		
BAVA01099B 0.494419	\$ 15,107,231.6	0.00016	\$ 4,888.88	0.000002	\$ 48.89		
BBCB03119D12 0.244353	\$ 4,837,419.6	0.00033	\$ 6,532.95	0.000003	\$ 65.33		
BBCB1000015 1.989958	\$ 4,547,070.2	0.001141	\$ 2,507.2L	0.000012	\$ 25.07		
PRGA2129120 0.200152	\$ 11,033,076.1 \$ 5 764 541 7	0.001551	\$ 8,703.05 ¢ 2,555.12	0.000016	\$ 87.03 ¢ 25.55		
BB0C01129B15 0.263409	\$ 5,764,941.7	0.00024	\$ 3,000.13 \$ 1 597.92	0.000002	\$ 30.00 \$ 15.98		
BB0C04129B10 0.268713	\$ 4.101.989.1	0.000189	\$ 2,885,15	0.000002	\$ 28.85		
					-		

Datos Históricos



Información histórica suministrada para realizar la medición.



Facha	CDTCNESOU	CDTCNESOU	CDTCNESOU	CDTDUISOU	CDTDUISOU	CDTDUISOU	CDTEAL SOU	CDTEALS
reuna Inclasticação	10.01470400	11.00400007	LDTCNP50V	0.10701104	14 50400014	14 50(00026	CDTPALSOV	CUTFAL:
06/01/2009	12,91476492	11.83422387	11.8311/64/	0.19781194	14.53466911	14.53629276	11.83024312	0.75
05/01/2009	10.26176293	10.95293462	10.95734711	10.41924427	9.82397056	9.89011079	10.48964294	10.40
02/01/2009	10.31690159	10.97259033	10.97640112	10.09685286	9,9003705	9,95535447	10.58049946	10.5
31/12/2008	10.37823341	11.23984771	11.24365851	10.24004257	9.71111402	9,90/14392	10.19129958	10.1
30/12/2008	10.38552529	11.241/5312	11.24546362	10.24592164	9./218/16/	9.91600907	10.20443679	10.20
29/12/2008	10.37313906	11.31315546	11.31867109	10.2485124	9.68621174	9.89060881	10.16141522	10.16
26/12/2008	10.49020886	11.40331096	11.14830829	10.41447275	9.59425589	9.79995614	10.27242889	10.2.
24/12/2008	10.53595799	11.43199225	11.18650053	10.45175758	9.58273583	10.44459782	10.37140858	10.3
23/12/2008	10.57231752	11.17848037	11.22852041	10.47947196	9.63777167	10.5252181	10.43849821	10.43
22/12/2008	10.62585799	11.31373843	11.22549279	10.80092005	9.79000446	10.71308262	10.52042977	10.52
19/12/2008	10.68958708	11.32813549	11.22149862	10.77337049	9.86522094	10.75741269	10.67235912	10.6
18/12/2008	10.97238274	11.3311315	11.20206413	10.93949044	9.86144447	10.78991403	10.66152851	10.66
17/12/2008	10.97979317	11.31669561	11.2128153	10.86456194	10.24099989	10.87577541	10.70515173	10.70
16/12/2008	10.9674758	11.29363628	11.21807825	10.89744264	10.12378819	10.8341504	10.67025316	10.6
15/12/2008	11.03957752	11.31666746	11.21598982	10.96364868	10.25889221	10.81062411	10.7150798	10.73
12/12/2008	12.91478492	11.31725327	11.21408922	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	0.79
11/12/2008	11.51180264	11.31507682	11.21260734	10.97067815	10.45877153	10.84475649	10.63050723	10.63
10/12/2008	11.53863156	11.31186589	11.21471599	10.9925973	10.4909714	10.91670073	10.64203015	10.64
09/12/2008	11.53863154	11.31089994	11.21509612	11.04853491	10.51870625	10.9627429	10.67740033	10.6
05/12/2008	11.54677067	11.31435268	11.2144997	11.01095152	10.79483313	10.96436817	10.693332	10.69
<								
Interpo Promed	lación A	sociado Histórico sociado Interpolad	Asociado P	romediado		Expo Resi	ortar ultado	Cerrar

• Exportar a Excel



Exportar a Excel strada puede ser llevada a f

La información suministrada puede ser llevada a formato Excel, para realizar diversos informes.

• Informe Jerárquico



Este informe muestra el valor del portafolio por niveles y el VaR total.



14.1.2. DELTA NORMAL

8	Método - Delta Normal (Grup	o : CLIENTES)
	Fecha Medición Número de Observaciones Horizonte Temporal Nivel de Tolerancia Nivel de Confianza	06/01/2009 VaR 20 Incremental 1 Ambos 0.01 Xarticle 95 2.00
	Seleccione la Fuente de Información – C ALTERNA C INFOVAL	Seleccione Precio — Precio Sucio Precio Limpio
		Aceptar 🔀 Cerrar

Al presionar el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla:

atos Históricos Exp	ortar a Excel Ce	rrar					
			MEDICION				
-General GRUPO -Datos Suministr Fecha 06/0	CLIENTES			-Resultados Obter Neto Portafolio \$ 888,65 Vir. A Tasa Cmp \$ 888,794,85 Volat. Portafolio 0.22	Nidos Valor C 56,649.84 Duració 9,632973 9 28714576 9	ompra \$ 876,941,088.00 in Prom. 0.347294 teal -\$ 138,209.81	
Solicitado Re	al Confianz.	a 5		Monto VaR (\$)	VaR (%) 49.85 0.376	VaR (\$) 202 \$ 3,343,146.194	4786
Factor	22 102 905 n	10000 1 22 011 025 05	0 201057779	Van & 0.420719	Vari 3 12 562 204220102	Vari Marginai %	van /
CDTCNESOV	20,100,000.0	\$ 100 429 925 43	0.201007773	0.430710	10 949 553842307	0.0	
CDTCNFS0V CDTCNFS0V		+ 100,120,020.40	0.200000140	0.00040	10,010,000012001	0.0	
CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V	100,000,000.0	\$ 80,196,308,75	0.206415778	0.339524	272.285.71532035	il 0.01	
CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V	100,000,000.0 80,000,000.0 4,620,774.6	\$ 80,196,308.75 \$ 4,629,146.17	0.206415778 1.400983975	0.339524 2.304414	272,285.71532035 36,674.692421944	i 0.0 0.0	
CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V	100,000,000.0 80,000,000.0 4,620,774.6 10,509,012.0	\$ 80,196,308.75 \$ 4,629,146.17 \$ 10,623,587.35	0.206415778 1.400983975 0.201959696	0.339524 2.304414 0.332194	272,285.71532035 36,674.692421944 35,290.919761459	i 0.0 0.0 0.0	
CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTCNFS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V CDTDVIS0V	100,000,000.0 80,000,000.0 4,620,774.6 10,509,012.0 6,000,000.0	\$ 80,196,308.75 \$ 4,629,146.17 \$ 10,623,587.35 \$ 5,998,323.55	0.206415778 1.400983975 0.201959696 0.328241287	0.339524 2.304414 0.332194 0.539909	272,285.71532035 36,674.692421944 35,290.919761459 32,385.48869557	i 0.0 0.0 0.0	
CDTCNFSOV CDTCNFSOV CDTCNFSOV CDTDVISOV CDTDVISOV CDTDVISOV CDTFALSOV	100,000,000,0 80,000,000,0 4,620,774.6 10,509,012.0 6,000,000,0 27,435,997.0	\$ 80,196,308,75 \$ 4,629,146.17 \$ 10,623,587,35 \$ 5,998,323,55 \$ 28,849,753,32	0.206415778 1.400983975 0.201959696 0.328241287 0.027187916	0.339524 2.304414 0.332194 0.539909 0.04472	272,285.71532035 36,674.692421944 35,290.919761459 32,385.48869557 12,901.609684704	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0	



Datos Históricos



Información histórica suministrada para realizar la medición.

Datos Históricos								
Fecha	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V	CDTFALS
06/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249	105.39
05/01/2009	103.15034662	100.76760663	100.58365647	97.78359961	101.41379589	100.51480955	105.15198296	105.15
02/01/2009	103.05711345	100.67315701	100.48950895	97.77757493	101.32915209	100.42810591	105.06296746	105.06
31/12/2008	102.98976289	100.50043167	100.3157616	97.69265114	101.29396783	100.38264853	105.01928597	105.02
30/12/2008	102.96047016	100.47028166	100.28569204	97.66517718	101.26724409	100.35540779	104.99085233	104.99
29/12/2008	102.93506997	100.40988887	100.22425712	97.63846438	101.24493268	100.33310066	104.96470289	104.96
26/12/2008	102.82740862	100.28165249	100.37977524	97.51959857	101.17755829	100.26918168	104.87574581	104.8
24/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774	104.8:
23/12/2008	102.72556981	100.29366424	100.308897	97.42388448	101.0965623	100.07657011	104.78198627	104.78
22/12/2008	102.68571224	100.33300538	100.30752408	97.31591831	101.05379193	100.01888148	104.74859186	104.75
19/12/2008	102.58627308	100.30555013	100.31189049	97.24107032	100.9671523	99.92779959	104.65226531	104.65
18/12/2008	102.49394441	100.28468238	100.32941716	97.17032207	100.94159568	99.89429053	104.62395238	104.62
17/12/2008	102.46302653	100.28528836	100.31934554	97.16247005	100.86792281	99.85141524	104.59175563	104.59
16/12/2008	102.43662043	100.3004381	100.31541485	97.12625913	100.85597273	99.83046768	104.56523658	104.56
15/12/2008	102.39065353	100.30179287	100.31671842	97.08095831	100.81171873	99.80651671	104.53271645	104.50
12/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032	105.3
11/12/2008	102.1591297	100.29355042	100.31989065	96.96838892	100.67590234	99.68790878	104.42360755	104.42
10/12/2008	102.12210864	100.29532402	100.31798535	96.93460103	100.64388813	99.64615201	104.3936663	104.39
09/12/2008	102.09156029	100.29733116	100.31771331	96.89112366	100.61237067	99.60903573	104.36145609	104.36
05/12/2008	101.96737896	100.29670977	100.318173	96.79086223	100.45956431	99.49521949	104.24384975	104.24
<								>
Interpo Prome	lación A diado A	sociado Histórico sociado Interpolad	Asociado P o	romediado		Expo Reso	ortar ultado	Cerrar

Exportar a Excel



La información suministrada puede ser llevada a formato Excel, para realizar diversos informes.



15.DIVISAS IMC / SUPERBANCARIA - CIRCULAR 031



15.1. OPCIÓN PARÁMETROS



Para el funcionamiento del módulo correspondiente a la circular 031 se deben definir primero los parámetros que se describen a continuación.

1. Definir los portafolios a manejar y agruparlos por fideicomiso o empresa. Cada fideicomiso o empresa puede estar a nivel de línea o portafolio y dentro de cada línea o portafolio se colocan entonces las posiciones correspondientes.



- 2. Asignar a cada portafolio el Tipo de Fideicomiso al que pertenece. Esto permite determinar.
- Parametrizar, de acuerdo a cada tipo de fideicomiso, que formato o grupo de formatos aplican para cada uno de ellos. Esto con el fin de que al ejecutar el procedimiento de Súper Bancaria, el sistema identifique que formatos(s) debe sacar según el tipo de fideicomiso al que pertenezca.
- 4. Se deben indicar los parámetros para los decimales con los cuales se desea que el sistema trabaje. El campo Nivel Agrupa determina como se debe sacar cada grupo de formatos, según el ejemplo mostrado en la siguiente figura se debe sacar un juego de archivos por cada línea que haya en el nivel en el cual se éste situado el usuario.

×	🕸 Parametro Si	8 - Modificar 🛛 🔀
Γ	Ingresar Datos	
	Duración	E
	Moneda	6
	Monto	10
	Puntos Basicos	100 💌
	Tasa Costo	5
	Nivel Agrupa	PORTAFOLIO -
	Act	eptar 🔀 Cerrar

- 5. Se debe ingresar la información para cada formato, con el fin de identificar los factores de riesgo que se deben aplicar a cada posición del formato. Además permite al sistema identificar si la posición es activa, pasiva o corresponde a un derivado. De acuerdo a los parámetros dados en ésta opción el sistema calcula el VeR de cada posición, esta información es muy importante porque de ello depende que los valores se calculen correctamente.
- 6. Para los formatos 269, 270, 329 y 330, existen dos procedimientos con los cuales el sistema determina en que unidad de captura y subcuenta ubica la inversión, cada una de las inversiones que se encuentran dentro del portafolio. Por ejemplo la siguiente figura muestra el filtro que se debe hacer para el tipo de compromiso NINGUNO. Según la información dada el sistema debe buscar, en la información sobre los



formatos en qué unidad de captura y subcuenta debe ubicar la información, y para ello debe comparar características como son el tipo de inversión, el mercado al que pertenece, Tipo de emisor, tipo de deuda, la tasa y la moneda que tenga amarrada cada inversión y su posición.

1	🖗 Parámetro Filt	ro - Modificar 🔀				
	Ingresar Datos					
	Tipo Compromiso	NINGUNO 🖃				
	Tipo Inversion	5				
	Mercado	SI 🗨				
	Tipo Emisor	SI 🗨				
	Tipo Deuda	SI 👻				
	Tasa	SI 👻				
	Moneda	SI 🗨				
	Posicion	SI 🗨				
	Swap	NO 💌				
	Aceptar 🔀 Cerrar					

7. La siguiente figura muestra un ejemplo de la información de los formatos. Con esto el sistema determina, de acuerdo a la inversión (punto 4), en que formato, unidad de captura y subcuenta se debe poner su resultado.



🔁 Formato 031 -	Modificar	×
Ingresar Datos		
Fecha Registro	05/07/2005	-
Tipo Compromiso	NINGUNO	v
Tipo Inversion	NEGOCIABLE	-
Mercado	RENTA FIJA	-
Tipo Emisor	SB	-
Tipo Deuda	INTERNA	-
Tasa	VUVR	-
Moneda	UVR	-
Posicion	LARGA	-
Swap	NO APLICA	-
Formato	270 SB	-
Unidad Captura	001	_
SubCuenta	008	_
	-	
X	Aceptar 🔀	Cerrar

- Existe algún tipo de información que se reconoce como 8. externa, donde la entidad debe ingresar todo lo que no haga parte de su portafolio. Al ejecutar el proceso de Súper Bancaria el sistema busca que información se ingreso para cada formato y la ubica en la posición que se indique. El sistema le da al usuario la facilidad de calcular los campos de Valor presente, Duración, Cambio Tasa, VeR, esto si el campo Calcular dice SI, de lo contrario el sistema toma los valores indicador por el usuario y así mismo los pone en el formato correspondiente. Cuando el campo calcular dice SI y no se ha especificado valor en el campo tasa el sistema busca en la opción de Formatos externos, de acuerdo al formato, unidad de captura y subcuenta que código de tasa se ha indicado y con esto busca el valor de la tasa, si esta información no se encuentra en ninguna de las dos partes se muestra un mensaje de error.
- 9. Para el saldo contable se debe especificar en que formato, unidad de captura y subcuenta debe ir cada cuenta PUC, y si su valor es positivo o negativo.



🗊 Parámetro PUC - Mod	ificar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/12/2004 💌
Tipo Fondo Fidecomiso	FID. DE INVERSION
Codigo Fondo Fidecomiso	0
Formato	269 SB 💌
Unidad Captura	001
SubCuenta	115
Consecutivo	1
Cuenta PUC	456
Signo	+
	Aceptar 🔟 Cerrar

10. Los valores del Saldo Contable de la compañía son tomados, ya sea por una vista o por una tabla. En la tabla Interconexión de base de datos bdlocal se crearon unos campos los cuales determinan de dónde se debe tomar ésta información, si en el campo OrigenCont aparece EXTERNO, es porque los datos se tomarán desde una vista externa, si por el contrario dice PWPREI, es porque se tomarán de una tabla.

Para ejecutar el proceso de Súper Bancaria el usuario debe pararse en algún nivel (GRUPO, LINEA, PORTAFOLIO) y según el parámetro indicado (Punto 3) y los formatos que tenga parametrizados para el tipo de fideicomiso al cual pertenece el sistema saca un juego de archivos. El sistema asume que todo lo que se encuentra dentro del nivel indicado como parámetro pertenece al mismo tipo de fideicomiso, es decir si en el parámetro dice que es por Línea, todo lo que este dentro de cada línea debe pertenecer al mismo tipo de fideicomiso.

La información que el sistema muestra para cada tipo de formato, esta determinada de la siguiente manera:

- 269, 329. Todas las inversiones que hay dentro del nivel en el que se ha situado, y todas las inversiones que se ingresaron como información externa para éstos formatos.
- 270, 330. Todo lo que hay en el nivel en el que se ha situado, en moneda UVR y lo que se haya ingresado como información externa.
- 271, 331. Todo lo que hay en el nivel en el que se ha situado, en



moneda Extranjera.

Existe una tabla dada por PWP, en la cual se especifican las columnas que no aplican para cada formato, con esto y después de correr el proceso de Súper Bancaria se puede generar el archivo plano.

15.1.1. TIPO DE ENTIDAD

1.4	🕅 Circular	031 - [Tipo Ent	idad]						F	X
Archivo Eárametros Eormatos Informes								- 8	x	
I	- 🔊 🔊 -	芝 🔈 🗠 🖉								
ì	Parámetros	Ente Regulador	Nombre	Tipo Entidad	Codigo Tipo Entidad	Palabra Clave	Area Informacion	Tipo Informe		Ē
f		SF	SUPER FINANCIERA	04	33	CFCFININTER	SUBSISTEMA CONTABLE Y ESTAD			
I	2.	SB	SUPER BANCARIA	03	055	SA	CALIFICACION DE ACTIVOS			
	Tipo Entidad									

15.1.1.1. MODIFICAR EL TIPO DE ENTIDAD

ŧ	Tipo Entidad - Mo	odificar 🛛 🔀
	Ingresar Datos	
	Ente Regulador	SF
	Nombre	SUPER FINANCIERA
	Tipo Entidad	04
	Código Tipo Entidad	33
	Palabra Clave	*****
	Area Información	SUBSISTEMA CONTABLE 💌
	Tipo Informe	21
	Tipo Información	FORMATOS -
	Oficina	0000
	Tipo Moneda	EXTRANJER -
		Aceptar 🔀 Cerrar

15.1.1.2. ELIMINAR EL TIPO DE ENTIDAD



🖬 Tipo Entidad - E	liminar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Ente Regulador	SF
Nombre	SUPER FINANCIERA
Tipo Entidad	04
PWPREI - RESC	LUCION 513
Esta S	eguro de Eliminar el Registro ?
Oficina Tipo Moneda	0000 EXTRANJER
	Aceptar Cerrar

15.1.1.3. DETALLE EL TIPO DE ENTIDAD

🙀 Tipo Entidad - De	etalle 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Ente Regulador	SF
Nombre	SUPER FINANCIERA
Tipo Entidad	04
Código Tipo Entidad	33
Palabra Clave	******
Area Información	SUBSISTEMA CONTABLE
Tipo Informe	21
Tipo Información	FORMATOS 👻
Oficina	0000
Tipo Moneda	EXTRANJER 🚽
	Cerrar
	·



15.1.2. SUPERBANCARIA



15.1.2.1. MODIFICAR PARAMETROS SUPERBANCARIA

翰 Parametro Si	8 - Modificar 💦 🔀
Ingresar Datos —	
Duración	3
Moneda	6
Monto	10
Puntos Basicos	100 👻
Tasa Costo	5
Nivel Agrupa	PORTAFOLIO -
	spiar 🖸 Cerrar

15.1.3. FONDO FIDEICOMISO

ኛ Circular 031 - [Fondo Fideicomiso]								
Narchivo <u>P</u> á	🍓 Archivo Párametros Formatos Informes							
📕 😼 🚨 🧾	📕 🗞 🏂 🚰 🌒 🔗 💋 🚿							
Parámetros	Codigo	Descripcion						
	0	NINGUNO						
	1	FID. DE INVERSION						
	2	FID. DE INMOBILIARIO						
Tipo Entidad	3	FID. DE ADMINISTRACION						
	4	OTROS Y DE GARANTÍA						
	5	FONDO DE CESANTIA						
Súper Banc	6	FONDO DE PENSIONES						
Capor Dano.	7	PRIMA MEDIA						
	8	PRIMA MEDIA - CAXDAC						
	9	FONDO DE VALORES						
Fondo								
Fideicomiso								
_								



15.1.3.1. INGRESAR FONDO FIDEICOMISO

🙀 Fondo Fideicomiso - Ingresar				
lngresar Datos Código Descripcion				
	Aceptar 🔀 Cerrar			

15.1.3.2. MODIFICAR FONDO FIDEICOMISO

🙀 Fondo Fideicomiso - Modificar 🛛 🛛 🔀					
Ingresar Datos Código Descripcion	0 NINGUNO				
	Aceptar 🔀 Cerrar				

15.1.3.3. ELIMINAR FONDO FIDEICOMISO





15.1.3.4. DETALLE FONDO FIDEICOMISO

🝓 Fondo Fide	icomiso - Detalle	×
-Ingresar Datos-		
Código	0	
Descripcion	NINGUNO	
	Cerrar	

15.1.4. PUC

🕴 Circular 031 - [Parámetro PUC] 📃 🖻 🔀										
🚰 Archivo Párametros Formatos Informes 🛛 🗕 🗗 🗙										
🄊 😼 🖧 💆	🗶 🔗 🖉	I								
Parámetros	Fecha Vigencia	Fondo Fideicomiso	Codigo Fondo	Formato	Unidad Captu	ira	SubCuenta	Consecutivo	Cuenta PUC	igno
	15/12/2004	FID. DE INVERSION	0	269 SB		001	115	1	456	+
	15/12/2004	FID. DE INVERSION	0	269 SB		001	110	1	789	-
	15/12/2004	FID. DE INVERSION	0	269 SB		001	031	1	123	+
Lipo Entidad										
Súper Banc.										
N										
Fondo Fideicomiso										

15.1.4.1. INGRESAR PARAMETRO PUC

Parámetro PUC - Ingre	esar 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/07/2009 💌
Tipo Fondo Fidecomiso	▼
Codigo Fondo Fidecomiso	
Formato	•
Unidad Captura	
SubCuenta	
Consecutivo	
Cuenta PUC	
Signo	
	Aceptar 🔀 Cerrar



15.1.4.1. MODIFICAR PARAMETRO PUC

🗊 Parámetro PUC - Mod	ificar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/12/2004 💌
Tipo Fondo Fidecomiso	FID. DE INVERSION
Codigo Fondo Fidecomiso	0
Formato	269 SB 👻
Unidad Captura	001
SubCuenta	031
Consecutivo	1
Cuenta PUC	123
Signo	+
	Aceptar 🛛 Cerrar

15.1.4.2. BUSCAR PARAMETRO PUC

🗊 Buscar Parámetro P	uc 🛛 🔀
Buscar Por	
15/07/2009 💌	🔲 Fecha Vigencia
V	Formato
_	Tipo Fondo Fideicomiso
	Todos los Registros
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
	Aceptar 🔀 Cerrar

15.1.4.3. ELIMINAR PARAMETRO PUC



🗊 Parámetro PUC - Elim	inar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/12/2004 💌
Tipo Fondo Fidecomiso	FID. DE INVERSION
	1 031
U 😲 Esta Seguro	de Eliminar el Registro ?
C Sí	No
Signo	+
	Aceptar Cerrar

15.1.4.4. DETALLE PARAMETRO PUC

🗊 Parámetro PUC - Detalle 🛛 🔀		
Ingresar Datos		
Fecha Registro	15/12/2004 💌	
Tipo Fondo Fidecomiso	FID. DE INVERSION	
Codigo Fondo Fidecomiso	0	
Formato	269 SB 💌	
Unidad Captura	001	
SubCuenta	031	
Consecutivo	1	
Cuenta PUC	123	
Signo	+	
	Cerrar	



15.1.5. FILTROS

🕏 Circular 031 - [Parámetro Filtro]									
🖗 Archivo Párametros Formatos Informes 🛛 💷 🗗 🗙									
Parámetros	Tipo Compromiso	Tipo Inversion	Mercado	Tipo Emisor	Tipo Deuda	Tasa	Moneda	Posicion	Swap
	CALLSB	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
	CALLST	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
	CONTADOMAS	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
Tipo Entidad	FORWARD	NO	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
	FORWDIVISA	NO	SI	NO	NO	NO	SI	NO	NO
	GARANTIA	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
Súper Banc	NINGUNO	SI	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO
caper cane.	OPCFTRM	NO	SI	NO	NO	NO	SI	NO	NO
	PLAZOEFEC	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
	PUTSB	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
Fondo	PUTST	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
Fideicomiso	REPO	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
-	SIMULTANEA	NO	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
	SWAP	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
PUC									
1 8 1									
Filtros									

15.1.5.1. INGRESAR FILTROS

🏶 Parámetro Filtro - Ingresar 🛛 🔀				
Ingresar Datos				
Tipo Compromiso	NINGUNO	-		
Tipo Inversion	NO	-		
Mercado	NO	-		
Tipo Emisor	NO	-		
Tipo Deuda	NO	-		
Tasa	NO	-		
Moneda	NO	-		
Posicion	NO	-		
Swap	NO	•		
Aceptar 🔀 Cerrar				



15.1.5.2. MODIFICAR FILTROS

-	Parámetro Filt	ro - Modificar 🔀	
	Ingresar Datos		
	Tipo Compromiso	CALLSB 🚽	
	Tipo Inversion	NO 👻	
	Mercado	SI 🖵	
	Tipo Emisor	NO 👻	
	Tipo Deuda	NO 👻	
	Tasa	NO V	
	Moneda	SI 👻	
	Posicion	SI 🖵	
	Swap	SI 🖵	
		,	
	Aceptar 🗵 Cerrar		

15.1.5.3. ELIMINAR FILTROS

3	🖇 Parámetro Filtro - Eliminar 🛛 🛛	
[Ingresar Datos	
	Tipo Compromiso CALLSB 🚽	
	Tipo Inversion NO 💌	
PV	VPREI - CIRCULAR 031]
(Esta Seguro de Eliminar el Registro ?	
	Swap SI	
	Aceptar 🔀 Cerrar	



15.1.5.4. DETALLE DE FILTROS

🀬 Parámetro Filt	ro - Detalle	. 🛛
Ingresar Datos		
Tipo Compromiso	CALLSB	-
Tipo Inversion	NO	-
Mercado	SI	-
Tipo Emisor	NO	-
Tipo Deuda	NO	-
Tasa	NO	-
Moneda	SI	-
Posicion	SI	-
Swap	SI	-
	×	Cerrar

15.1.6. COLUMNAS

ኛ Circular 031 - [Parámetros Columnas]						
🍇 Archivo Bá	🙀 Archivo Párametros Eormatos Informes					
P 💫 🌬 📅 🇶 🕼 🖉 💷						
Parámetros	Formato	Unidad Captura	Subcuenta	Columna		
	269 SB	002	005	3		
	269 SB	002	005	4		
	269 SB	002	005	5		
Lipo Entidad	269 SB	002	005	6		
	269 SB	002	005	7		
	269 SB	002	005	8		
Súper Banc.	269 SB	002	005	9		
~	269 SB	002	005	10		
	269 SB	002	005	11		
	269 SB	002	005	12		
Fondo	269 SB	002	005	13		
Fideicomiso	269 SB	002	005	14		
	269 SB	002	005	15		
	269 SB	002	005	16		
PUC	269 SB	002	005	17		
	269 SB	002	005	18		
	269 SB	002	005	19		
	269 SB	002	005	20		
Filtros	269 SB	002	005	21		
	269 SB	002	005	22		
	269 SB	002	005	23		
Columnas	269 SB	002	005	24		
	269 SB	002	005	25		



15.1.6.1. BUSCAR PARAMETROS COLUMNAS

🏴 Buscar Parámtros Columnas 🛛 🛛 🔀		
Buscar Por	 Formato Tipo Fondo Fideicomiso Tipo Fondo Fideicomiso Tipo Fondo Fideicomiso Todos los Registros 	
J. A.	Aceptar 🔀 Cerrar	

15.1.6.2. INGRESAR PARAMETROS COLUMNAS

ļ	e Parámetros Columnas - I 🔀
	Ingresar Datos
	Formato 🗾 💌
	Unidad Captura
	SubCuenta
	Columna
	Aceptar 区 Cerrar

15.1.6.3. ELIMINAR PARAMETROS COLUMNAS

Fraction Columnas - E Ingresar Datos					
PWPREI - RESOLUCION 513					
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?					
<u> </u>					
Aceptar 🔀 Cerrar					



15.1.6.4. DETALLE PARAMETROS COLUMNAS



15.1.6.5. CARGAR DATOS DE PARAMETROS COLUMNAS

🗈 Carga de Datos - Parámetros Columnas
Cargue Automático Archivo (*.txt)
Tipo de Carga C Archivo Plano Archivo Excel
Errores Aceptar Cerrar

15.2. OPCIÓN FORMATOS





15.2.1. FORMATOS

-	🖇 Circular 031 - [Formatos]								X				
	👷 Archivo 🛛	arametros <u>F</u> ormatos	; Informes									- 8	х
110	P 💫 🕼 🔐 🌒 🖉 🖤												
	Formatos	Fecha	Código	Unidad Captura	SubCuenta	Descripcion	Aplicación	Tipo Riesgo	Factor Riesgo	Factor Riesgo2	Periodo		^
ī		18/11/2004	332 SB	002	005	VALOR EN RIESGO TOTAL	ACTIVO	3	0			0	
		18/11/2004	332 SB	001	020	VeR(f) = ACTIVO - PASIVO + DERIVADO	ACTIVO	3	0	0		0	_
		18/11/2004	332 SB	001	015	DERIVADOS (ECUACIÓN 1)	DERIVADO	3	0	0		0	
	Formatos	18/11/2004	332 SB	001	010	PASIVOS (ECUACIÓN 1)	PASIVO	3	0	0		0	
	 _	18/11/2004	332 SB	001	005	ACTIVOS (ECUACIÓN 1)	ACTIVO	3	0	0		0	
		18/11/2004	331 SB	003	090	Valor en riesgo	ACTIVO	3	15	0		0	
	Formatos	18/11/2004	331 SB	003	018	Inversiones en fondos de inversión en el	ACTIVO	3	15	0		0	
	Externos	18/11/2004	331 SB	003	016	Inversiones en fondos de inversión en el	ACTIVO	3	14	0		0	
		18/11/2004	331 SB	003	013	Inversiones en fondos de inversión nacic	ACTIVO	3	13	0		1	
1		10/11/2004	201 CD	002	012	Touoveionoe baeta al unorimianto - tikulae	ACTIVO	· ·	10	<u>ہ</u>		- 1	

15.2.1.1. INGRESAR FORMATOS

🕸 Formatos - Ingresar 🛛 🔀					
Ingresar Datos					
Fecha Vigencia	15/07/2009 💌				
Código	•				
Unidad de Captura					
SubCuenta					
Descripcion					
Aplicación					
Tipo Registro					
Factor Riesgo					
Factor Riesgo 2					
Periodo					
Periodo 2					
Método Carga	•				
	Aceptar 🛛 Cerrar				



15.2.1.1. MODIFICAR FORMATOS

🕸 Formatos - Modificar 🛛 🛛					
Ingresar Datos					
Fecha Vigencia	18/11/2004 💌				
Código	332 SB 🔍				
Unidad de Captura	002				
SubCuenta	005				
Descripcion	VALOR EN RIESGO TOTAL				
Aplicación	ACTIVO -				
Tipo Registro	3				
Factor Riesgo	0				
Factor Riesgo 2	0				
Periodo	0				
Periodo 2	0				
Método Carga	AUTOMATIC -				
	Aceptar 区 Cerrar				

15.2.1.2. BUSCAR FORMATOS

翰 Buscar Formatos	×
Buscar Por	
Aceptar 🔀 Cerrar	



15.2.1.3. ELIMINAR FORMATOS

🗞 Formatos - Eliminar 🛛 🛛 🔀					
Ingresar Datos					
Fecha Vigencia	18/11/2004 💌				
Código	332 SB 🚽				
Unidad de Captura	002				
SubCuenta	005				
Descripcion	VALOR EN RIESGO TOTAL				
Aplicación	ACTIVO				
Tipo Registro	3				
Factor Riesgo	0				
Factor Riesgo 2	0				
Periodo	0				
Periodo 2	0				
Método Carga	AUTOMATIC 💌				
	Aceptar 🛛 Cerrar				

15.2.1.4. DETALLE FORMATOS

翰 Formatos - Detalle	• 🛛
Ingresar Datos	
Fecha Vigencia	18/11/2004 💌
Código	332 SB 🚽
Unidad de Captura	002
SubCuenta	005
Descripcion	VALOR EN RIESGO TOTAL
Aplicación	
Tipo Registro	3
Factor Riesgo	0
Factor Riesgo 2	0
Periodo	0
Periodo 2	0
Método Carga	AUTOMATIC 🚽
	Cerrar



15.2.1.5. CARGAR DATOS DE FORMATOS

Carga de Datos - Parámetros Formatos
Cargue Automático Archivo (*.txt)
Tipo de Carga C Archivo Plano C Archivo Excel
Errores Aceptar Cerrar

15.2.2. FORMATOS EXTERNO

🌮 Circular 031 - [Parámetro Formato Externo]								
🔁 <u>A</u> rchivo 🛛	🚰 Archivo Párametros Eormatos Informes							
御 🖗 🕸 🕄 🍬 🔌 👘 🐗								
Formatos	Fecha	Formato	Unidad Captura	SubCuenta	Código Tasa			
Formatos Externos								

15.2.2.1. INGRESAR FORMATOS EXTERNO

쭴 Parametro Fo	rmato Exte 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/07/2009 💌
Formato	_
Unidad Captura	
SubCuenta	
Código Tasa	
	tar 🔀 Cerrar



15.2.2.1. MODIFICAR FORMATOS EXTERNO

1	Parametro Fo	rmato Exte 🔀
	Ingresar Datos	
	Fecha Registro	15/07/2009 💌
	Formato	269 SB 🖵
	Unidad Captura	2
	SubCuenta	2
	Código Tasa	2
		5 7
	Acep	tar 🔟 Cerrar

15.2.2.2. BUSCAR FORMATOS EXTERNO

🖀 Buscar Parametro Formato Externo			
Buscar Por			
15/07/2009 💌	🥅 Fecha Vigencia		
	Formato		
_	🗌 SubCuenta		
	Todos los Registros		
		_	
	Aceptar 🔀 Cerra	r	

15.2.2.3. ELIMINAR FORMATOS EXTERNO

	쭴 Parametro Formato Exte 🔀				
	Ingresar Datos				
P	WPREI - RESOLUCION 513				
	Esta Seguro de Eliminar el Registro ?				
	<u>Sí</u> <u>N</u> o				
	Aceptar Cerrar				



15.2.2.4. DETALLE FORMATOS EXTERNO

쭴 Parametro Formato Exte 🔀					
	Ingresar Datos				
	Fecha Registro	15/07/2009 🖵			
	Formato	269 SB 🖵			
	Unidad Captura	2			
	SubCuenta	2			
	Código Tasa	2			
Cerrar					

15.2.3. INFORMACION EXTERNA

🏼 Circular 0)31 - [Informació	in Formato Externo]						JJX
📂 Archivo Eárametros Eormatos Informes 💷 🗗								
🧊 🗞 🦓 🥫	7 🗶 💊 🖉	《						
Formatos	Fecha	Portafolio	Formato	Unidad Captura	SubCuenta	Calcular	Banda	Valor F
Formatos								
Formatos Externos								
Información Externa								

15.2.3.1. INGRESAR INFORMACION EXTERNA

🕂 Info Formato	Externo - Ingresar 🛛 🔀				
Ingresar Datos —					
Fecha Registro	12/07/2009 💌				
Portafolio	•				
Formato	•				
Unidad Captura					
SubCuenta					
Calcular	•				
Banda					
Valor Futuro					
Código Tasa					
Valor Tasa					
Valor Presente					
Duracion					
Cambio Tasa					
VeR					
~					
🖌 Aceptar 🔀 Cerrar					



15.2.3.1. MODIFICAR INFORMACION EXTERNA

🕂 Info Formato	Externo - Modificar 🛛 🔀
Ingresar Datos —	
Fecha Registro	15/07/2009 🔽
Portafolio	CTA PROPIA OTROS
Formato	269 SB 🚽
Unidad Captura	2
SubCuenta	23
Calcular	SI 👻
Banda	07
Valor Futuro	23
Código Tasa	22
Valor Tasa	1
Valor Presente	0
Duracion	0
Cambio Tasa	0
VeR	0
N.	Aceptar 🔀 Cerrar

15.2.3.2. BUSCAR INFORMACION EXTERNA

🕂 Información Formato Externo			
Buscar Por			
15/07/2009 💌	🔲 Fecha Vigencia		
-	Formato		
	🔲 SubCuenta		
	Todos los Registros		
_		_	
Jan Karala 🗸	Aceptar 🔀 Cerra	r	



15.2.3.3. ELIMINAR INFORMACION EXTERNA

💾 Info Formato	Externo - Eliminar 🛛 🔀
Ingresar Datos	
Fecha Registro	15/07/2009 💌
Portafolio	CTA PROPIA OTROS 📃
Formato	269 SB 🚽
Unidad Captura	2
SubCuenta	23
PWPREI - RESO	LUCION 513
Esta Se	iguro de Eliminar el Registro ?
Valor Presente	0
Duracion	0
Cambio Tasa	0
VeR	0
V	Aceptar 🔀 Cerrar

15.2.3.4. DETALLE INFORMACION EXTERNA

🕂 Info Formato	Externo - Deta	lle 🛛 🔀
Ingresar Datos		
Fecha Registro	15/07/2009 💌	
Portafolio	CTA PROPIA OTF	105 🔽
Formato	269 SB 💌	
Unidad Captura	2	
SubCuenta	23	
Calcular	SI 💌	
Banda	07	
Valor Futuro	23	
Código Tasa	22	
Valor Tasa	1	
Valor Presente	0	
Duracion	0	
Cambio Tasa	0	
VeR	0	
		Cerrar



15.2.3.5. CARGAR DATOS DE INFORMACION EXTERNA

🖻 Carga de Datos - Información Formato Externo	
Cargue Automático Archivo (*.txt)	
Tipo de Carga C Archivo Plano C Archivo Excel	
Errores Aceptar	Cerrar

15.2.4. INFORMACION FORMATO 031

😻 Circular	031 - [Informac	ión Formato 031]					X
🚹 Archivo 🛛	<u>P</u> árametros <u>F</u> ormat	os Informes					_ 8 ×
🗾 💊 🔔 I	3 🗶 🔌 🖉						
Formatos	Fecha Registro	Tipo Compromiso	Tipo Inversion	Mercado	Tipo Emisor	Tipo Deuda	Tasa 🔨
	16/11/2004	REPO	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
K	16/11/2004	REPO	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	REPO	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Formatos	16/11/2004	OPCFTRM	NO APLICA	DIVISA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	OPCFTRM	NO APLICA	DIVISA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	OPCFTRM	NO APLICA	DIVISA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Formatos	16/11/2004	OPCFTRM	NO APLICA	DIVISA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Externos	16/11/2004	NO APLICA	VENCIMIENTO	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	PERMANENTE	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	PERMANENTE	NO BURSATIL	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Información	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Externa	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Info	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
Formato	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
031	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA


ŋ	Formato 031 -	Ingresar	×		
	Ingresar Datos				
	Fecha Registro	16/07/2009 💌			
	Tipo Compromiso	NINGUNO			
	Tipo Inversion	-			
	Mercado	•			
	Tipo Emisor	-			
	Tipo Deuda	-			
	Tasa	-			
	Moneda	-			
	Posicion	-			
	Swap	-			
	Formato	-			
	Unidad Captura				
	SubCuenta				
		,			
	Aceptar 🔀 Cerrar				

15.2.4.1. INGRESAR INFORMACION FORMATO 031

15.2.4.2. MODIFICAR INFORMACION FORMATO 031

🔁 Formato 031 -	Modificar	×		
Ingresar Datos				
Fecha Registro	16/11/2004 📃 💌			
Tipo Compromiso	REPO			
Tipo Inversion	NO APLICA 📃 👻			
Mercado	NO APLICA 📃 💌			
Tipo Emisor	NO APLICA 📃 💌			
Tipo Deuda	NO APLICA 📃 💌			
Tasa	NO APLICA 📃 💌			
Moneda	COP			
Posicion	LARGA			
Swap	NO APLICA 📃 👻			
Formato	329 SB 👻			
Unidad Captura	001			
SubCuenta	010			
Aceptar 🔀 Cerrar				



15.2.4.3. ELIMINAR INFORMACION FORMATO 031

🔁 Formato 031 -	Eliminar 🛛 🔀		
Ingresar Datos			
Fecha Registro	16/11/2004 🔽		
Tipo Compromiso	REPO		
Tipo Inversion	NO APLICA		
Mercado	NO APLICA		
Tino Emisor			
PWPREI - CIRCUL	.AR 031 🛛 🔄		
Esta Seg	uro de Eliminar el Registro ?		
Formato	329 SB 🚽		
Unidad Captura	001		
SubCuenta	010		
Aceptar Cerrar			

15.2.4.4. DETALLE INFORMACION FORMATO 031

🔁 Formato 031 -	Detalle	×
Ingresar Datos		
Fecha Registro	16/11/2004	-
Tipo Compromiso	REPO	-
Tipo Inversion	NO APLICA	-
Mercado	NO APLICA	-
Tipo Emisor	NO APLICA	-
Tipo Deuda	NO APLICA	-
Tasa	NO APLICA	-
Moneda	COP	-
Posicion	LARGA	-
Swap	NO APLICA	-
Formato	329 SB	-
Unidad Captura	001	_
SubCuenta	010	_
		Cerrar



15.2.4.5. CARGAR DATOS DE INFORMACION FORMATO 031

🖻 Carga de Datos - Formato 031	
Cargue Automático Archivo (*.txt)	
Tipo de Carga C Archivo Plano Archivo Excel	
Errores Aceptar Cerra	ır

15.2.5. FORMATO FIDEICOMISO

ኛ Circular 031 - [Formato Fideicomiso]				
🗿 Archivo Párametros Formatos Informes				
■ 3				
Formatos	Tipo Fideicomiso	Formato		
	NINGUNO	269 SB		
	NINGUNO	270 SB		
	NINGUNO	271 SB		
Formatos	NINGUNO	280 SB		
E Competition	FID. DE INVERSION	329 SB		
	FID. DE INVERSION	330 SB		
Formatos	FID. DE INVERSION	331 SB		
Externos	FID. DE INVERSION	332 SB		
Información Externa				
Info Formato 031				
Formato Fideicomiso				



15.2.5.1. INGRESAR FORMATO FIDEICOMISO



15.2.5.2. ELIMINAR FORMATO FIDEICOMISO



15.3. OPCION INFORMES





15.3.1. GEN IMC / FORMATO 230



Primero se debe seleccionar la fecha del Portafolio y a continuación aparece la siguiente pantalla.

🕵 Informe Súper Bancaria			×
Organizar Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio C Por Portafolio C POR PORTAFOLIO C POR PORTAFOLIO C POR PORTAFOLIO C POR PORTAFOLIO PORTAFOLIO POR	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio Especie Depósito Número Dias al Voto. Úl Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio
Fecha de Valorización> Fecha de Liquidación>	06/01/2009 -	Aceptar	Cerrar



15.3.2. **F-DIVISAS**

Por Grupp Por Linea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIC Nomb Linea de Neg	pore pocio		07/0	3/2019		
	Especie	Depósito	Número	Dias al Vcto. Úľ	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio
	<						>

15.3.3. INFORME SUPERBANCARIA

🤌 Fecha Portafolios 🛛 🛛	×
Fecha Medición 🕕/01/2009 💌	
Aceptar 🔀 Cerrar	

Primero se debe seleccionar la fecha del Portafolio y a continuación aparece la siguiente pantalla.

Por Grupo Por Línea Por Tipo Por Portafolio	PORTAFOLIO Nombre Tipo Linea de Negocio		
* =- CLIENTES * =- PRUEBA 513 * =- PWP	Especie Depósito Número Dias al Veto. Úl Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio



15.3.4. PLANO



Primero se debe seleccionar la fecha del Portafolio y a continuación aparece la siguiente pantalla.



TRACKING VAR AND PERFORMANCE ATTRIBUTION



El Tracking VaR es el proceso comparativo de una entidad en particular contra la industria en la que se encuentra. En el proceso a implementar se obtendrá un portafolio resultante de la comparación, al que se le podrán aplicar los modelos de riesgo y valoración disponibles en PWPREI en forma corriente.

En el Performance Attribution, además, se calculan las rentabilidades de los portafolios en el periodo indicado y se produce un resultado comparativo de tales rentabilidades.





15.3.4.1. INSERTAR DATOS PARA TRACKING

El usuario tendrá la facilidad de seleccionar dos listas de portafolios para la comparación. El sistema supone que la lista 1 corresponde al portafolio propio de la entidad y que la lista 2 corresponde al portafolio de la industria o competencia contra la que se desea comparar, sin embargo es posible evaluar cualquier par de portafolios a voluntad. Así pues, el portafolio

indicado en la lista 1 se enfrenta contra el indicado en la lista 2. Se le facilitará la conformación de cada lista así

Podrá indicar tres fechas:

- Inicio de periodo de comparación.
- Fin de periodo de comparación.
- Mitad de periodo. Esta es de carácter opcional.





Las tres fechas permiten dos cosas:

- Determinar un portafolio promedio en el periodo, para cada lista indicada. Para ello el sistema lee las posiciones presentes en cada fecha, para cada lista, y genera un portafolio promedio. Los portafolios promedio de cada lista son los que finalmente se comparan
- Calcular una rentabilidad promedio del periodo a evaluar.

El usuario podrá indicar si desea tomar cada uno de los portafolios a una fecha, a dos fechas o a tres fechas. De acuerdo con esto se evalúa el portafolio promedio.



Para armar las listas el usuario podrá seleccionar si va escoger por Grupo, por Línea o por Portafolio.

Una vez elige esto se le muestra la lista de Grupos, Líneas o Portafolios que haya en el sistema.





Selección Propios		
Nivel GRUPO	Nombre ASVALORES	
<	>	

Selección Competencia	
Nivel GBUP0	Nombre FIDU
	>

En la lista anterior el usuario podrá marcar aquellos Grupos, Líneas o Portafolios que desea incluir en la lista respectiva.

Las dos listas seleccionadas en el punto anterior, cada una de las cuales es un conjunto de parejas "Nivel" y "Nombre", conforman los dos portafolios a enfrentar.



Los botones de Limpiar y aplicar ubicados tanto en Selección Propios como en Selección Competencia, son utilizados tanto para borrar la información seleccionada como para que el sistema tome los datos seleccionados.



15.3.4.2. EJECUCION DE TRACKING

Una vez suministrada la información debe dar clic en el botón de Ejecutar

- 1. El proceso de generación, toma los dos portafolios y:
 - Obtiene la lista de posiciones que conforman cada portafolio.
 - Valora cada posición.
 - Agrupa las posiciones por factor de riesgo.
 - Totaliza por factor de riesgo.
 - Calcula la rentabilidad promedio, por factor de riesgo, en el periodo.
- 2 El proceso de comparación:
 - Calcula el total para cada portafolio.
 - Calcula los subtotales por factor de riesgo.
 - Calcula la participación de cada factor de riesgo en el total de su portafolio respectivo.



- Hace la diferencia de los porcentajes de cada factor en el portafolio 1 (El del usuario) menos el correspondiente en el portafolio 2 (El de la industria).
- A partir de estas diferencias porcentuales calcula el monto por factor en el portafolio resultante, multiplicando la diferencia porcentual por el total del portafolio 1.
- Se muestra una pantalla de resultados con:
 - Totales por factor (Pesos y Participación) del portafolio 1.
 - Totales por factor (Pesos y Participación) del portafolio 2.
 - Totales por factor (Pesos y Participación) del portafolio resultante (La diferencia).

Para ver los datos obtenidos de clic en el botón correspondiente **a Ver Tracking**, el sistema mostrará la siguiente pantalla.

ą	Resultados Trac	king:						
	Factor	Monto	Participación	Factor	Monto	Participación	Diferencia \$	Diferencia %
	CDTLBV10D	1,036,201.12	0.17	CDTLBV10D	0.0	0.0	-1,037,112.54	-0.17
	TBFT07220808	609,030,000.0	99.83	TBFT07220808	0.0	0.0	-609,029,088.58	-99.83
	TBVT10250613	0.0	0.0	TBVT10250613	65,579,065.62	100.0	610,066,201.12	100.0
						-		
						۵ 🔊	centar	

PARA EL PORTAFOLIO 1:

- **Factor:** Lista de posiciones involucradas en los portafolios evaluados, si las especies están agrupadas por factores de Riesgo se muestra dichos factores.
- Monto: Total por especie o por factor de riesgo.
- **Participación**: % de participación de cada especie o factor de riesgo.



PARA EL PORTAFOLIO 2:

Factor: Lista de posiciones involucradas en los portafolios evaluados, si las especies están agrupadas por factores de Riesgo se muestra dichos factores.

Monto: Total por especie o por factor de riesgo.

Participación: % de participación de cada especie o factor de riesgo.

Diferencia (\$-%): Muestra la diferencia en pesos y en % de participación de los dos portafolios.

ł	Resultados Performance										
				F .		D ()	N Y 1.4	NY 1 00			
	Factor CDTL PV(10D	Monto 1 026 201 12	Perf. Anual	Factor CDTLPV(10D	Monto	Perf. Anual	Diferencia \$	Diferencia %			
	TBFT07220808	609.030.000.0	0.0	TBFT07220808	0.0	0.0	-1,037,112.04	0.0			
	TBVT10250613	0.000,000,000,000	0.0	TBVT10250613	65 579 065 62	0.0	610 066 201 12	0.0			
ľ		0.0	0.0			0.0	0.0,000,001.10	0.0			

PARA EL PORTAFOLIO 1:

Factor: Lista de posiciones involucradas en los portafolios evaluados, si las especies están agrupadas por factores de Riesgo se muestran dichos factores.

Monto: Total por especie o por factor de riesgo.

Rentabilidad Anual: Es la rentabilidad anual del portafolio calculada a partir de la rentabilidad en el periodo de evaluación dado.



PARA EL PORTAFOLIO 2:

Factor: Lista de posiciones involucradas en los portafolios evaluados, si las especies están agrupadas por factores de Riesgo se muestra dichos factores.

Monto: Total por especie o por factor de riesgo.

Rentabilidad Anual: Es la rentabilidad anual del portafolio calculada a partir de la rentabilidad en el periodo de evaluación dado.

Diferencia (\$-%): Muestra la diferencia en pesos y en % de participación de los dos portafolios.

🛱 Guardar Portafo	lio resultante	×
GUARDAH	R PORTAFOLIO RESULTANTE	
Linea	Portafolio	
Fecha Registro	13/12/2005	
	Aceptar 💟 Cerrar	

Se da la opción de grabar este portafolio resultante, para que el usuario le aplique luego a voluntad los modelos disponibles en PWPREI. Para grabar se solicita:

- Línea en la que se desea grabar el portafolio resultante. Dicha línea debe existir previamente en PWPREI.
 - Nombre del portafolio. Si no existe se crea.
- Fecha de registro en la que se desea grabar el portafolio.



16.ACERCA DE



Como se puede observar al dar Clic en Acerca de aparece la anterior pantalla donde hace una pequeña descripción de la Aplicación PWPREI.

Al presionar el Botón Información del Sistema muestra una ventana en la cual aparecen las características del Sistema en el cual se encuentra instalado PWPREI

17.PARAMETRIZACION CONTABLE

TIPOPUC	TIPODES T	TIPOCPR	TIPCONTR A	TIPOINVER	PUNTA	ESPECIE	FECEMI	FECVEN	EVENTO	VALFTE	PUCBAS	SUFIJO
FINANCIER O	PROPIO	REPO	BAN	NEGOCIABL E	ACTIVA	NA	NA	NA			12200501	01

TIPOPUC: Se selecciona el tipo de PUC de acuerdo a la Entidad

TIPODEST: Se selecciona PROPIO si es el portafolio de la entidad o PATRIMONIO si es el portafolio de un Fondo

TIPOCPR: Se selecciona el tipo de compromiso de acuerdo a los eventos de negociación que son: NINGUNO, FORWARDP (Esta dando perdida), FORWARDU (Está dando Utilidad), FUTUROP (Está dando perdida), FUTUROU (Está dando Utilidad), SWAPP (Esta dando perdida), SWAPU (Está dando Utilidad), REPO, SIMULTANEA, CALLU,CALLP, PUTU,PUTP, NA (RETES)

CASOS ESPECIALES:

FUTUROP: Indica que se deben hacer los movimientos correspondientes a un futuro que



viene en pérdida (No que da pérdida en esta operación, sino que ya viene dando pérdida; al día de ayer cerró en pérdida)

FUTUROU: Indica que se deben hacer los movimientos correspondientes a un futuro que viene en utilidad (No que da utilidad en esta operación, sino que ya viene dando utilidad; al día de ayer cerró en utilidad)

FUTUROP_CV: Indica que se deben hacer los movimientos correspondientes a vender o comprar un futuro que viene dando pérdida, con independencia de que la operación de venderlo(uno de compra) o de comprarlo(uno de venta) de pérdida o utilidad.

FUTUROU_CV: Indica que se deben hacer los movimientos correspondientes a vender o comprar un futuro que viene dando utilidad, con independencia de que la operación de venderlo(uno de compra) o de comprarlo(uno de venta) de pérdida o utilidad.

TIPCONTRA: Se selecciona el tipo de entidad con la que se hizo el negocio, la cual puede ser:

BAN	BANCOS
CFI	CORPORACIONES FINANCIERAS
CFC	COMPAÑIAS DE FINANCIAMIENTO COMERCIAL
FIN	OTRAS ENTIDADES FINANCIERAS
BVC	BOLSA DE VALORES
BAG	BOLSAS DE PRODUCTOS AGROPECUARIOS Y AGROINDUSTRIALES
BRP	BANCO DE LA REPÚBLICA
GNA	TESORERÍA GENERAL DE LA NACIÓN
PUB	ENTIDADES DEL SECTOR PÚBLICO
REX	RESIDENTES DEL EXTERIOR
FID	SOCIEDADES FIDUCIARIAS
PEN	SOCIEDADES ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES Y DE CESANTÍAS
SCA	SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSAS AGROPECUARIAS
SCB	SOCIEDADES COMISIONISTAS DE BOLSAS DE VALORES
SAI	SOCIEDADES ADMINISTRADORAS DE INVERSIÓN
SCP	SOCIEDADES DE CAPITALIZACIÓN
SEG	COMPAÑÍAS DE SEGUROS Y DE REASEGUROS
CCA	CÁMARAS DE COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE BOLSAS DE PRODUCTOS
	AGROPECUARIOS Y AGROINDUSTRIALES.
OTR	OTRAS
NA	NO APLICA

TIPOINVER: Es la clasificación contable de la Inversión

NEGOCIABLE: Disponible para negociar en cualquier momento VENCIMIENTO: No se pueden negociar

PERMANENTE: Disponible para la venta después de un año

COBERTURA: Para forward de cobertura ESPECULA: Para Forward de Especulación NA



(RETES): No aplica

PUNTA: Se define la operación que se está realizando COMPRA: Compra de un titulo para el portafolio de la Entidad VENTA: Venta de un titulo del portafolio

ACTIVA: Cuando es una operación en posición activa PASIVA: Cuando es una operación en posición pasiva

GARANT: Se debe asignar cuando un título ha sido dado en garantía por la opción "Garantía" en Portafolios y Riesgo. A partir de ahí todos los movimientos del título deben establecerse con parámetro Punta="GARANT", incluyendo "VALORAR" y "LIBERAR". Una vez liberado se vuelven a usar los parámetros con Punta="COMPRA".

NA (RETES): No Aplica

ESPECIE: Se selecciona el Nemotécnico según el tipo de Titulo adquirido o vendido FECEMI: Es la fecha de la Emisión del titulo

FECVEN: Es la fecha del Vencimiento del titulo

EVENTO:Se selecciona el momento en que se va a aplicar el movimiento contable NEGOCIAR: Es para la compra o venta de títulos

CUMPLIR: Cumplimiento de operaciones Repo y simultaneas VALORAR: Valoración de los títulos del portafolio MODIFICA: Modificación de una operación

INCUMPLIR: Incumplimiento de las operaciones Repo activas, repo pasivas y simultaneas CUBRIR: Cubrimiento de las operaciones repo o simultaneas pasivas en corto

MAYDER: Para trasladar los forwards que al valorizar generan utilidad desde las cuentas 23 a las cuentas 15

MAYOBLI: Para trasladar los forwards que al valorizar generan perdida desde las cuentas 15 a las cuentas 23

ANULA: Desaparece los registros si no se han contabilizado NA: No aplica

RECAUDO: Recaudo de intereses, capital, o valor compromiso de operaciones REPO, SIMULTANEA, FORWARDS, SWAPS

GARANTIA: Evento para los movimientos de dar un título en garantía. El Valor Fuente asociado a este evento debe ser VALTIT. Recordar que una vez el título ha sido dado en garantía se ejecutarán los movimientos con parámetro Punta="GARANT"; esto se hace por ejemplo en el evento "VALORAR" o "LIBERAR".

LIBERAR: Evento para los movimientos de liberar un título de su estado de garantía. El Valor Fuente asociado a este evento debe ser VALTIT

PROVISION+: Evento de generar provisión para un cumplimiento no recaudado, al que se ha ordenado provisionar.

PROVISION-: Evento de generar un movimiento que lleve a cero la provisión acumulada sobre un vencimiento.

PREPAGO: Evento para contabilizar el prepago de arrendamientos. Este evento es equivalente a la acción de vender en el evento negociar, parametrice de forma equivalente.

NOTA IMPORTANTE: Tenga en cuenta que es libre de mover o no cualquiera de los valores aquí establecidos, de forma que si no quiere contabilizar algo simplemente no lo parametrice.



VALFTE: VALOR A CONTABILIZAR

Valor Fuente	Descripción
VALCAP	Valor de la Inicial de la operación Repo
VALTIT	Valor de mercado a la fecha, del título recibido en garantía
VALOPE	Valor de la Operación
COMIS	Comisión pagada en la operación
IVACOM	IVA de la Comisión
RETEIVAC	Retención en el IVA a la Comisión
RETECOM	Retención en la Fuente de la Comisión
RETEFTE	Retención en la fuente trasladada por rendimientos financieros Retención en la fuente de los rendimientos financieros
RENCPR	Rendimientos del Compromiso
RENDIS	Intereses del titulo
RENDISPAG	Flujo Neto del SWAP cuando da negativo (Pago)
RENDISREC	Flujo Neto del SWAP cuando da positivo (Recibo)
DERECHO	Derechos en los compromisos Forward
OBLIGACION	Derechos en los compromisos Forward



PYGOBLI	Incremento de la obligación
PYGDERI	Incremento del derecho
PYGOBLD	Disminución de la obligación
PYGDERD	Disminución del derecho
PYGCPR	Diferencia entre el Derecho y la obligación
PYGCPRD	Gasto no cubierto por la diferencia en cambio
PYGCPRI	Ingreso por mayor valor derecho que la obligación
PYGDIFD	Perdida no realizada cargada a la cuenta de patrimonio
PYGDIFI	Utilidad no realizada cargada a la cuenta de patrimonio
LIN_PRIMAACUM	Prima Acumulada a la fecha
LIN_PRIMAHOY	Causación de la prima hoy (al valorar)
LIN_DESCTOACUM	Descuento Acumulado a la fecha
LIN_DESCTOHOY	Causación descuento hoy (al valorar)
LIN_INTERESACUM	Intereses lineales acumulados a la fecha
LIN_INTERESHOY	Causación intereses lineales hoy (al valorar)
LIN_UTILIDAD	Valor VENTA – Costo fiscal, si da positivo
LIN_PERDIDA	Valor VENTA – Costo fiscal, si da positivo
CONTRAVALR	Recaudo de intereses, SWAPS (Flujo neto del SWAP en ese peridodo)
PYGR+	Mayor Valor en RECAUDO de intereses títulos
PYGR-	Menor Valor en RECAUDO de intereses títulos
CONTRAVALK	Recaudo de capital
PYGK+	Mayor Valor en RECAUDO de capital
PYGK-	Menor Valor en RECAUDO de capital
CONTRAVALC	Recaudo REPO, SIMULTANEA
PYGC+	Mayor recaudado por un REPO o SIMULTANEA
PYGC-	Menor recaudado por un REPO o SIMULTANEA
CONTRAVALW	Recaudo FORWARDS NDV, FUTUROS y SWAPS (La diferencia o PYG del compromiso)
PYGCPRW	PYG del forward NDV o FUTURO, en lugar de usar PYGCPR, para recaudarlo al final y poner el concepto de tipo CUMPLIR. Este Valor Fuente se debe poner en lugar de PYGCPR en el evento CUMPLIR para que el sistema lo tome como valor a recaudar; y en RECAUDO para moverlo donde se quiera. Recordar que la contrapartida o contravalor debe ser CONTRAVALW
PYGCPRW+	Para la acción de VENTA o COMPRA en el evento NEGOCIAR con Tipo Compromiso FUTUROU_CV o FUTUROP_CV, mueve el PyG neto si este da positivo.
PYGCPRW-	Para la acción de VENTA o COMPRA en el evento NEGOCIAR con Tipo Compromiso FUTUROU_CV o FUTUROP_CV, mueve el PyG neto si este da negativo.



PYGW+	Mayor Valor en RECAUDO de PYG Forwards NDV y FUTUROS
PYGW-	Menor Valor en RECAUDO de PYG Forwards NDV y FUTUROS
PROVISION+	Valor fuente aplicado al provisionar. Opera en el evento PROVISION+ para causar la provisión.
PROVISION-	Valor fuente aplicado para cancelar la provisión. Opera en el evento PROVISION- para cancelar la provisión, total o parcialmente; y en el evento RECAUDO cuando se paga todo para cancelar toda la provisión. No olvide hacer esta parametrización en el evento RECAUDO también.
INTMORA	Aplica en el evento RECUADO para asentar los intereses de mora cobrados por valores en mora; es decir, cuando se recaude lo adeuda se deberán mover también los intereses cobrados por la mora.
DCAMNETAPOS	Utilice este valor fuente en el evento: VALORAR: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva, para trasladarla del ingreso al gasto cuando por la causación del día se vuelva negativa. VENDER o COMPRAR (no ingreso sino botón "Comprar"): Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva. RECAUDO: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva.
DCAMNETANEG	Utilice este valor fuente en el evento: VALORAR: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa, para trasladarla del gasto al ingreso cuando por la causación del día se vuelva positiva. VENDER o COMPRAR (no ingreso sino botón "Comprar"): Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa. RECAUDO: Para mover la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa.
DCAMCAUPOS+	En el evento VALORAR utilice este valor fuente para mover la causación del día, si da positiva, adicionándola a la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva.
DCAMCAUPOS-	En el evento VALORAR utilice este valor fuente para mover la causación del día, si da negativa, restándola de la diferencia en cambio neta acumulada que está positiva.
DCAMCAUNEG+	En el evento VALORAR utilice este valor fuente para mover la causación del día, si da positiva, adicionándola a la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa.
DCAMCAUNEG -	En el evento VALORAR utilice este valor fuente para mover la causación del día, si da negativa, restándola de la diferencia en cambio neta acumulada que está negativa.

PUCBAS:Es la cuenta del PUC del tipo de entidad SUFIJO: Es la cuenta auxiliar del PUC de la Entidad

MOVTO: Selecciona si es Crédito o Debito

CONCEPTO: Selecciona el concepto el Evento que podrían ser:



1: Compra de Títulos
2: Venta de Títulos
3: Simultanea Activa
4: Simultanea Pasiva
5: Repo Activo
6: Repo Pasivo
7: Transferencia Temporal de Origen
8: Transferencia Temporal - Recepción
9: Retefuente de Rendimiento Financiero
10: Traslado por Retención de Rendimiento Financiero
11: Retefuente de Comisión
12: IVA de Comisión
13: Comisión por Operación
14: ReteIVA Comisión
15: Causación Valoración
16: Unificación
17: Fraccionamiento
18: Cobro de Rendimientos Financieros
19: Cobro de Capital
20: Dar en Garantía
21: Liberar Garantía
22: Causación rendimientos por Pagar
23: Pagos rendimientos por Pagar
24: Cobro dividendos en Especie
25: Cobro dividendos en Dineros
26: Mayor Valor de la obligación que el derecho
27: Saldo por Pagar Incumplimiento
28: Mayor Valor el derecho que obligación
29: Mayor Valor la obligación que el derecho

30: Venta en corto operaciones repo activas

31: Compra cubrimiento ventas operaciones repo activas

32: Valorización Pasivo operaciones repo activas

NOTA IMPORTANTE: Recordar que los conceptos para los que se debe hacer un RECAUDO deben ser de tipo CUMPLIMIENTO. Comúniquese con su área de tecnología para establecer los conceptos de tipo CUMPLIMIENTO.

CCOSTO Centro de costo único 01

CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LAS OPERACIONES REPO Y DE LAS OPERACIONES



SIMULTÁNEAS.

Código	Nombre de la Cuenta
1220	Compromisos de Transferencia en operaciones de repo abierto

Contabilización en Operaciones de Repo Abierto

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems TIPCONTRA y PUCBAS, se selecciona la opción de acuerdo a la "contraparte" con quien se hace la Operación Repo, para el Item SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON		PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
L	E21	РК	IKA	VER	A	10	III		10	IC	5	U
FINANC IERO	PROPI O	REPO	XXXX	NEGOCI ABLE	ACTI VA	NA	NA	NA			1220X XXX	01

Contabilización Compromisos de Transferencia en operaciones de repo abierto el día de entrega del dinero por parte del Banco "adquiriente", y recepción del título en garantía entregado por la Contraparte "enajenante".

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimier	nto
NEGOCIAR	VALCAP	1220XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALCAP	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	62081001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	61080501	01	DEBITO	

Contabilización diaria de los rendimientos del compromiso pactados en el Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	1220XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENCPR	41042101	01		CREDITO

Contabilización del cumplimiento de la operación Repo, el día del cumplimiento



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimier	nto
CUMPLIR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	1220XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	62081001	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización de cobro de cupones o rendimientos para el enajenante.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	2226XXXX	01		CREDITO

Contabilización de "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	2232XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51230501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41230501	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	62081001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización de la valorización a valor del Mercado del Título del Compromiso de la Operación Repo del título vendido en la "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	2232XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	41071201	01	DEBITO	

Contabilización la desvalorización por disminución en el valor del Mercado del Título del Compromiso de la Operación Repo del título vendido en la "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
--------	--------------	---------------	--------	------------



VALORAR	VALORIZAD	2232XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	41070601	01		CREDITO

Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" - Operación Repo Activa

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUBRIR	VALTIT	2232XXXX	01	DEBITO	
CUBRIR	VALTIT	27959501	01		CREDITO

Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo - Activa

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
INCUMPLIR	VALOPE	1220XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1228XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	16879501	07	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	62081001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización En Operaciones De Repo Cerrado

Código	Nombre de la Cuenta
1222	Compromisos de Transferencia en operaciones de repo cerrado

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems TIPCONTRA y PUCBAS, se selecciona la opción de acuerdo a la "contraparte" con quien se hace la Operación Repo, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU C	TIPOD FST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VFR	PUNT A	espec Tf	FECE MI	FECV FN	EVEN TO	VALF	pucba S	SUFIJ O
			~~~~				ΝΙΛ				- 1222V	vv
IERO	0	REPU	~~~~	ABLE	VA	INA	INA	NA			XXX	^^

Contabilización Compromisos de Transferencia en operaciones de repo abierto el día de entrega del dinero por parte del "adquiriente", y recepción del título en garantía entregado por la Contraparte "enajenante".

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	1222XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALCAP	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	



NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	62082001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	61080501	01	DEBITO	

Contabilización diaria de los rendimientos del compromiso pactados en el Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	1222XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENCPR	41042101	01		CREDITO

Contabilización del cumplimiento de la operación Repo, el día del cumplimiento

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	1222XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	62082001	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización de cobro de cupones o rendimientos para el enajenante.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	2226XXXX	01		CREDITO

Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo - Activa

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1222XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1228XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	16879501	07	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	62082001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización en operaciones de operaciones simultánea

Código	Nombre de la Cuenta
1232	Compromisos de Transferencia en operaciones simultaneas

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones



requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems TIPCONTRA y PUCBAS, se selecciona la opción de acuerdo a la "contraparte" con quien se hace la Operación Repo, para el Item SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON		PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN		PUCBA	SUFIJ
L	L31	ĸ	IKA	VLR	А		111		10	IL	3	0
FINANC	PROPI	SIMULT	XXXX	NEGOCI	ACTI	NA	NA	NA			1232X	01
IERO	0	ANEA		ABLE	VA						XXX	

Contabilización Compromisos de Transferencia en operaciones simultaneas el día de entrega del dinero por parte del Banco "adquiriente", y recepción del título en garantía entregado por la Contraparte "enajenante".

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	1232XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALCAP	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	62083001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	61080501	01	DEBITO	

Contabilización diaria de los rendimientos del compromiso pactados en simultánea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	1232XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENCPR	41042301	01		CREDITO

Contabilización del cumplimiento de la operación simultánea, el día del cumplimiento

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	1232XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	62083001	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

Contabilización de cobro de cupones o rendimientos para el enajenante.



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	2226XXXX	01		CREDITO

Contabilización de "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	2244XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51230501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41230501	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	62083001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	61080501	01	DEBITO	

Contabilización de la valorización a valor del Mercado del Título del Compromiso de la Operación Simultanea del título vendido en la "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	2244XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	41071201	01	DEBITO	

Contabilización la desvalorización por disminución en el valor del Mercado del Título del Compromiso de la Operación Repo del título vendido en la "venta en corto" - Venta de un título que han entregado en garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	2244XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	41070601	01		CREDITO

Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" - Operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUBRIR	VALTIT	2244XXXX	01	DEBITO	
CUBRIR	VALTIT	27959501	01		CREDITO



Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea - Activa

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
INCUMPLIR	VALOPE	1232XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALOPE	1238XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	62083001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	61080501	01		CREDITO

# CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS DE DEUDA

Código	Nombre de la Cuenta
1304	Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda que deben llevar cuentas de orden 8

#### 130401 130402 130403 130404 130405 130406 130407 130408 130409 130410 130411

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	NINGU NO	NA	NEGOCI ABLE	COMP RA	xxxx	NA	NA			1304X XXX	xx

Contabilización Compra de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
NEGOCIAR	VALOPE	1304XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO



NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	8174XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALOPE	83050101	01		CREDITO

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1304XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO
INCUMPLIR	VALOPE	8174XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	83050101	01		CREDITO

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	VALTIT	8174XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" - Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	8174XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1304XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8174XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1304XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	8174XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del cobro de rendimientos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	RENDIS	1304XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	



Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1304XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	CAPITAL	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	83050101	01	DEBITO	

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda que no requieren llevar cuenta de orden

# 130414 130415 130416 130417 130418 130442 130495

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOIN	PUNT	espec	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCB	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	VFR	A	If	MI	FN	TO	TF	AS	O
FINANC IERO	PROPI O	NING UNO	NA	NEGOCI ABLE	comp Ra	xxxx	NA	NA			1304X XXX	xx

Contabilización Compra de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
NEGOCIAR	VALOPE	1304XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9



(Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
INCUMPLIR	VALOPE	1304XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -

Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	10
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1304XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1304XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO



NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización del cobro de rendimientos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1304XXXX	01	CREDITO	
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	

Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1304XXXX	01	CREDITO	
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	

# CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LAS INVERSIONES PARA MANTENER HASTA EL VENCIMIENTO

Código Nombre de la Cuenta 1308 Inversiones para mantener hasta el vencimiento

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de inversiones permanentes que deben llevar cuentas de orden 8

130801 130802 130803 130804 130805 130806 130807 130808 130809 130810 130811

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	pucba	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	NINGU NO	NA	VENCIMI ENTO	COMP RA	xxxx	NA	NA			1308X XXX	xx



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	1308XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	8176XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	83050101	01		CREDITO

Contabilización Compra de inversiones permanentes

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1308XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO
INCUMPLIR	VALOPE	8176XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	83050101	01		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
REPO	CUBRIR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -Operación simultánea)



TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1308XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41110601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8176XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41111201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del cobro de rendimientos.



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	CAPITAL	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	83050101	01	DEBITO	

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de inversiones permanentes que no requieren llevar cuenta de Orden

|--|

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC PR	TIPCON	TIPOINV FR	PUNT	ESPEC	FECE MT	FECV	EVEN	VALF	PUCBA S	SUFIJ
					<u> </u>	*-	1 11				5	×
FINANC IERO	PROPI O	NINGU NO	NA	VENCIMI ENTO	Comp Ra	XXXX	NA	NA			1308X XXX	XX

Contabilización Compra de inversiones permanentes.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	1308XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALCAP	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO



Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
INCUMPLIR	VALOPE	1308XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1308XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41110601	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41111201	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"


Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización del cobro de rendimientos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	

Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1308XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	

CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS PARTICIPATIVOS

Código	Nombre de la Cuenta
1313	Inversiones negociables en títulos participativos

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de inversiones permanentes en títulos participativos que deben llevar cuentas de orden 8

#### 131301 131302 131303 131304 131305 131306 131307 131308 131309 131310 131311

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.



TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	NINGU NO	NA	PERMAN ENTE	Comp Ra	xxxx	NA	NA			1313X XXX	xx

Contabilización Compra de inversiones permanentes en títulos participativos

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	1313XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	8177XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	83050101	01		CREDITO

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1313XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO
INCUMPLIR	VALOPE	8177XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	83050101	01		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO



REPO	CUBRIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	8177XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -Operación simultánea)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
CUBRIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
CUBRIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
CUBRIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
CUBRIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
CUBRIR	VALTIT	8177XXXX	01		CREDITO
CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
	Evento CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR CUBRIR	EventoValor FuenteCUBRIRVALTITCUBRIRVALTITCUBRIRPERDIDACUBRIRPERDIDACUBRIRPERDIDACUBRIRUTILIDADCUBRIRUTILIDADCUBRIRVALTITCUBRIRVALTIT	EventoValor FuenteCódigo CuentaCUBRIRVALTIT1313XXXXCUBRIRVALTIT27959501CUBRIRPERDIDA51250901CUBRIRPERDIDA41160501CUBRIRPERDIDA34130501CUBRIRUTILIDAD34130501CUBRIRUTILIDAD41160501CUBRIRUTILIDAD41250901CUBRIRVALTIT8177XXXXCUBRIRVALTIT83050101	EventoValor FuenteCódigo CuentaSufijoCUBRIRVALTIT1313XXXX01CUBRIRVALTIT2795950101CUBRIRPERDIDA5125090101CUBRIRPERDIDA4116050101CUBRIRPERDIDA3413050101CUBRIRUTILIDAD3413050101CUBRIRUTILIDAD4116050101CUBRIRVALTIT8177XXXX01CUBRIRVALTIT8305010101	EventoValor FuenteCódigo CuentaSufijoMovimientCUBRIRVALTIT1313XXXX0101DEBITOCUBRIRVALTIT2795950101DEBITOCUBRIRPERDIDA5125090101DEBITOCUBRIRPERDIDA4116050101DEBITOCUBRIRPERDIDA3413050101DEBITOCUBRIRUTILIDAD3413050101DEBITOCUBRIRUTILIDAD4116050101CUBRIRCUBRIRUTILIDAD4125090101CUBRIRCUBRIRVALTIT8177XXXX01DEBITOCUBRIRVALTIT8305010101DEBITO

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1313XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41090601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8177XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41091201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	34130501	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona



<b>"VENT</b>	Α″
--------------	----

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	8177XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del cobro de rendimientos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	

Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	
VALORAR	CAPITAL	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	83050101	01	DEBITO	

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de inversiones permanentes en títulos participativos que no requieren llevar cuenta de orden



Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC IERO	PROPI O	ningu No	NA	PERMAN ENTE	Comp Ra	XXXX	NA	NA			1313X XXX	xx

Contabilización Compra de inversiones permanentes en títulos participativos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	1313XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01		CREDITO

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1313XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	



Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1313XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41110601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41111201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	34130501	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título de Deuda, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO



Contabilización del cobro de rendimientos.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	

Contabilización del cobro de la inversión al final por redención del título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	CAPITAL	1313XXXX	01		CREDITO
VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	

# CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS PARTICIPATIVOS

Código	Nombre de la Cuenta
1306	Inversiones negociables en títulos participativos

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de inversiones permanentes en títulos participativos.

#### 130601 130602

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPUC	TIPODEST	TIPOCPR	TIPCONTRA	TIPOINVER	PUNTA	ESPECIE	FECEMI	FECVEN	EVENTO	VALFTE	PUCBAS	SUFIJO
FINANCIER O	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	Compra	xxxx	NA	NA			1306XXX X	хх

Contabilización Compra de inversiones permanentes en títulos participativos

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	1306XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO



Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	1306XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1306XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" -Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1306XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1306XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41080601	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1306XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41081101	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título participativo, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"



NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	1306XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PERDIDA	51250601	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41250601	01		CREDITO

#### CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LAS INVERSIONES DISPONIBLES PARA LA VENTA EN TÍTULOS PARTICIPATIVOS

Código	Nombre de la Cuenta
1316	Inversiones disponibles para la venta en títulos participativos

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Inversiones disponibles para la venta en títulos participativos de alta y media bursatilidad

#### 131601 131602

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	то	TE	S	0
FINANC	PROPI	NINGU	NA	PERMAN	COMP	XXXX	NA	NA			1316X	XX
IERO	0	NO		ENTE	RA						XXX	

Contabilización Compra de Inversiones disponibles para la venta en títulos participativos

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	1316XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO



Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento		
INCUMPLIR	VALOPE	1316XXXX	01	DEBITO		
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO	

Contabilización entrega de título de para cubrir "Operación Repo en Corto incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
REPO	CUBRIR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	34131001	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	34131001	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral

1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" - Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	34131001	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	34131001	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
--------	--------------	---------------	--------	------------



VALORAR	VALORIZAI	1316XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34131001	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1316XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	34131001	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título participativo, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	34131001	01		CREDITO
NEGOCIAR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	34131001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO

Contabilización de acuerdo al PUC financiero de las siguientes cuentas de inversiones disponibles para la venta en títulos participativos de baja o ninguna bursatilidad

#### 131604

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCB	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	то	TE	AS	0
FINANC	PROPI	NINGU	NA	PERMAN	COMP	XXXX	NA	NA			13160	XX
IERO	0	NO		ENTE	RA						401	

Contabilización Compra de Inversiones disponibles para la venta en títulos participativos



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	13160401	01	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización recibo de título de una Operación Repo o simultanea incumplida por parte del "Enajenante" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Repo – Activa) y numeral 1.3.9 (Contabilización incumplimiento por parte del "Enajenante" en operación Simultanea – Activa)

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	13160401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	16879501	07		CREDITO

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación Repo en Corto" incumplida por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral 1.1.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto – Operación repo)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
REPO	CUBRIR	VALTIT	13160401	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	PERDIDA	34165001	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	34155001	01	DEBITO	
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
REPO	CUBRIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO

Contabilización entrega de título para cubrir "Operación simultánea en Corto" por parte del "Adquirente" del título. Esta contabilización complementa el numeral

1.3.8 (Contabilización cubrimiento del título vendido en la "venta en corto" - Operación simultánea)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	13160401	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	



SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	34165001	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	34155001	01	DEBITO	
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	13160401	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34155001	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del titulo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	13160401	01	CREDITO	
VALORAR	VALORIZAD	34165001	01	DEBITO	

Contabilización Venta de un título participativo, en el ítem PUNTA se le selecciona "VENTA"

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALOPE	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	25351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
NEGOCIAR	PERDIDA	34165001	01		CREDITO
NEGOCIAR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
NEGOCIAR	UTILIDAD	34155001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO

CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS O VALORES DE DEUDA

#### CódigoNombre de la Cuenta 1331 Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de



transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda que deben llevar cuentas de Orden 8, para Operaciones Repo y Simultaneas

## 133101 133102 133103 133104 133105 133106 133107 133108 133109 133110 133111

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	negoci Able	PASI VA	xxxx	NA	NA			1331X XXX	хх

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1331XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1304XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO



NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1331XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8174XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento Valor Fuente Código Cuenta Sufijo Movimiento



VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	8174XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133101 133102 133103 133104 133105 133106 133107 133108 133109 133110 133111

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	то	TE	S	0
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	NEGOCI	PASI	XXXX	NA	NA			1331X	XX
IERO	0	ANEA		ABLE	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1331XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	



NEGOCIAR VALTIT 63070501 01	CREDITO
-----------------------------	---------

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1304XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01	CREDITC	
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1331XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8174XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO



VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8174XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	8174XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

133114  133115  133116  133117  133118  133142  133	195
-----------------------------------------------------	-----



Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	pucba	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	NEGOCI ABLE	PASI VA	xxxx	NA	NA			1331X XXX	xx

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1331XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	13041XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1304XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO



NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06	CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1331XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41070601	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO



INCUMPLIR	VALOPE	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Item TIPOCPR - SIMULTÁNEA

#### 133114 133115 133116 133117 133118 133142 133195

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	negoci Able	PASI VA	xxxx	NA	NA	-		1331X XXX	XX

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	VALTIT	1331XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1304XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1304XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.



NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1331XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1331XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO



VALORAR RENDIS	63070501	01	DEBITO	
----------------	----------	----	--------	--

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALOPE	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1331XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

# CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS O VALORES DE DEUDA

Código	Nombre de la Cuenta						
1333	Derechos de transferer	ncia de	inversiones	negociables	en	títulos	0
	valores de deuda						

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda que deben llevar cuentas de Orden 8, para Operaciones Repo y Simultaneas

#### 133301 133302 133303 133304 133305 133306 133307 133308 133309 133310 133311

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC	PROPI	REPO	NA	VENCIMI	PASI	XXXX	NA	NA			1333X	XX
IERO	0			ENTO	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1333XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1308XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01	CREDITO	
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1333XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8176XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO



INCUMPLIR	VAI TIT	63070501	01	DEBITO	
P. 10001 II E111	• • • • • • • • •	0007 0001	<b>~</b>		

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Item TIPOCPR - SIMULTÁNEA

# 133301 133302 133303 133304 133305 133306 133307 133308 133309 133310 133311

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	R	TRA	ER	A	IE	MI	EN	то	TE	S	0
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	VENCIMI	PASI	XXXX	NA	NA			1333X	XX
IERO	0	ANEA		ENTO	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1333XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1308XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	

NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	



NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01	CREDIT	
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1333XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8176XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO



VALORAR	RENDIS	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8176XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

133314 133315 133316 133317 133318 13	3342 133395
---------------------------------------	-------------

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	VENCIMI ENTO	PASI VA	xxxx	NA	NA			1333X XXX	xx

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1333XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	13081XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1308XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuer	nte	Código Cu	ienta	Sufijo	Μ	ovimient	0	]
	CUMPLIR	VALC	OPE	2220X	XXX		01	DEBITO	
	CUMPLIR	VALO	OPE	27959	501		01		CREDITO



Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
VALORAR	VALORIZAI	1333XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	VALORIZAD	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMLTANEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTANEA



τιροριι				ΤΙΟΛΙΝΙΛ								
С	EST	R	TRA	ER	A	IE	MI	EN	TO	TE	PUCDA S	0 0
											-	-
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	VENCIMI	PASI	XXXX	NA	NA			1333X	XX
IERO	0	ANEA		ENTO	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	VALTIT	1333XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1308XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1308XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
VALORAR	VALORIZAI	1333XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41070601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	VALORIZAD	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41071201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1333XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento Valor Fuente Código Cuenta Sufijo Movimiento
-----------------------------------------------------



INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250401	01		CREDITO

# CONTABILIZACIÓN Y VALORACIÓN DE LOS DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS O VALORES DE DEUDA

Código	Nombre de la Cuenta
1335	Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda que deben llevar cuentas de Orden 8, para Operaciones Repo y Simultaneas

#### 133501 133502 133503 133504 133505 133506 133507 133508 133509 133510 133511

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	xxxx	NA	NA			1335X XXX	xx

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
NEGOCIAR	VALTIT	1335XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	



NEGOCIAR VALTIT 63070501 01	CREDITO
-----------------------------	---------

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1313XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1335XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41090601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO



VALORAR	VALORIZAI	8177XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41091201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	34130501	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51252901	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	8177XXXX	01		CREDITO



INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133501 133502 133503 133504 133505 133506 133507 133508 133509 133510 133511

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	R	TRA	ER	A	IE	MI	EN	то	TE	S	0
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA			1335X	XX
IERO	0	ANEA		ENTE	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1335XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1313XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01	CREDITO	
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	


NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01	CREDIT	
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1335XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41090601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	8177XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	83050101	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41091201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	8177XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	83050101	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	8177XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización de acuerdo al PUC Financiero de las siguientes cuentas de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0



FINANC	PROPI	REPO	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA		1335X	XX
IERO	0			ENTE	VA					XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1335XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1313XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	19901001	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
--------	--------------	---------------	--------	------------	--



CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1335XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41090601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41091201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	



INCUMPLIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
INCUMPLIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
INCUMPLIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133514 133515 133516 133517 133518 133542 133595

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	R	TRA	ER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA			1335X	XX
IERO	0	ANEA		ENTE	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	VALTIT	1335XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1313XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1313XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.



NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO
NEGOCIAR	RETEFTE	19901001	01	DEBITO	

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1335XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41090601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41091201	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34130501	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO



VALORAR	RENDIS	1335XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34130501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41160501	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250901	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO	

CONTABILIZACIÓN DE ACUERDO AL PUC FINANCIERO DE LAS SIGUIENTES CUENTAS DE DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES NEGOCIABLES EN TÍTULOS O VALORES PARTICIPATIVOS

133201 133202 133208 133209

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - REPO

TIPOPU	TIPOD FST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VFR	PUNT A	espec Tf	FECE MT	FECV FN	EVEN TO	VALF	pucba S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	NEGOCI	PASI VA	xxxx	NA	NA			- 1332X XXX	XX

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores



paracipativo		ci cicalo	Constitut	compi	
Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1332XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1306XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1332XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1306XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores participativos al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimie	ento
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
VALORAR	VALORIZAI	1332XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41080601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
VALORAR	VALORIZAD	1332XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41081101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1332XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1332XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250601	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250601	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133201	133202	133208	133209
--------	--------	--------	--------

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ



С	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
											1 2 2 2 1	
FINANC	PROPI	SIMULI	NA	NEGOCI	PASI	XXXX	NA	NA			1332X	XX
IERO	0	ANEA		ABLE	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
NEGOCIAR	VALTIT	1332XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1306XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía – Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
CUMPLIR	VALTIT	1332XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1306XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores participativos al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO



Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1332XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	41080601	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1332XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	41081101	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1332XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1332XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51250601	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41250601	01		CREDITO



CONTABILIZACIÓN DE ACUERDO AL PUC FINANCIERO DE LAS SIGUIENTES CUENTAS DE DERECHOS DE TRANSFERENCIA DE INVERSIONES DISPONIBLES PARA LA VENTA EN TÍTULOS O VALORES PARTICIPATIVOS.

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIDODU	TIDOD	TIDOC	TIDCON									
TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEIN	VALF	PUCBA	SOFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	0
FINANC	PROPI	REPO	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA			1336X	XX
IERO	0			ENTE	VA						XXX	

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – REPO Cuentas 133601 - 133602

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1336XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía

- Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1316XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.



NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
VALORAR	VALORIZAI	1336XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34131001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34131001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO



VALORAR	RENDIS	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34131001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34131001	01	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – SIMULTÁNEA Cuentos 122601 – 122602

Cuentas 133601 - 133602

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	К	IKA	ER	A	IE	MI	EIN	10	IE	5	0
FINANC	PROPI	SIMULT	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA			1336X	XX
IERO	0	ANEA		ENTE	VA						XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	0
NEGOCIAR	VALTIT	1336XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO



Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía

- Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1316XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1336XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34131001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	



VALORAR	VALORIZAI	63070501	01	CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34131001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34131001	01		CREDITO
INCUMPLIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34131001	01	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES REPO – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – REPO Cuentas 133604 - 133695

TIPOPU	TIPOD	TIPOC	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
С	EST	PR	TRA	ER	A	IE	MI	EN	то	TE	S	0



FINANC	PROPI	REPO	NA	PERMAN	PASI	XXXX	NA	NA		1336X	XX
IERO	0			ENTE	VA					XXX	

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1336XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía

– Cancelación Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1316XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640710XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso Repo de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2220XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	01		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso Repo

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2220XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso Repo – Entrega de dinero



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1336XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34155001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64071001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Para la Cuenta 133695 la cuenta de valorización es la cuenta 34130501

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	34165001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64071001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Para la Cuenta 133695 la cuenta de desvalorización es la cuenta 34130501

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1226XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64071001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación Repo por Parte del

"ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	СХР	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO



INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34155001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34165001	01	DEBITO	

Para la Cuenta 133695 la cuenta de valorización o desvalorización es la cuenta 34130501

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – SIMULTÁNEA Cuentas 133604 - 133695

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOINV	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	R	TRA	ER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	xxxx	NA	NA			1336X XXX	xx

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de dar en garantía el título – Constitución Compromiso operación simultanea

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALTIT	1336XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	1316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640730XX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	VALTIT	63070501	01		CREDITO

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones disponibles para la venta en títulos o valores participativos al momento de liberar el título dado en garantía

- Cancelación Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	1316XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	VALTIT	640730XX	01		CREDITO
CUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Compromiso SIMULTANEA de inversiones negociables en títulos o valores de deuda al momento de recibir el dinero.



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	VALCAP	2234XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	VALCAP	16879501	07	DEBITO	
NEGOCIAR	COMIS	51159501	01	DEBITO	
NEGOCIAR	IVACOM	23351001	03	DEBITO	
NEGOCIAR	RETEIVAC	25550501	26		CREDITO
NEGOCIAR	RETECOM	25550501	06		CREDITO

Contabilización de los Rendimientos financieros por pagar del Compromiso SIMULTANEA

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENCPR	2234XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENCPR	51042101	01	DEBITO	

Contabilización cancelación Compromiso SIMULTANEA – Entrega de dinero

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	Movimiento	
CUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO		
CUMPLIR	VALOPE	27959501	01		CREDITO	

Contabilización del incremento del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAI	1336XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	34155001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAI	64073001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAI	63070501	01		CREDITO

Para la Cuenta 133695 la cuenta de Valorización es la cuenta 34130501

Contabilización de la disminución del valor del título entregado en Garantía

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	VALORIZAD	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	34165001	01	DEBITO	
VALORAR	VALORIZAD	64073001	01		CREDITO
VALORAR	VALORIZAD	63070501	01	DEBITO	

Para la Cuenta 133695 la cuenta de desvalorización es la cuenta 34130501

Contabilización cobro de intereses al adquirente del título valor entregado en Garantía



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	RENDIS	1236XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	RENDIS	1336XXXX	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	64073001	01		CREDITO
VALORAR	RENDIS	63070501	01	DEBITO	

Contabilización Incumplimiento de la Operación SIMULTANEA por Parte del "ENAJENANTE", salida definitiva del título valor entregado en Garantía.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimien	to
INCUMPLIR	VALOPE	2234XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2240XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1336XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64073001	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	41161001	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	51251101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	PERDIDA	34165001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41251101	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	41161001	01		CREDITO
INCUMPLIR	UTILIDAD	34155001	01	DEBITO	

Para la Cuenta 133695 la cuenta de valorización o desvalorización es la cuenta 34130501

## CONTABILIZACIÓN DE ACUERDO AL PUC FINANCIERO DE LAS SIGUIENTES CUENTAS DE CONTRATOS FORWARD Y FUTUROS ACTIVOS

DERECHO							
151505	151506	151507	151508	151510	151515	151516	151520
OBLIGACION							
151525	151526	151527	151528	151530	151535	151536	151540

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ



С	EST	R	TRA	VER	А	IE	MI	EN	то	TE	S	0
FINANC	PROPI	FORWA	NA	ESPECU	xxxx	xxxx	NA	NA			1515X	XX
IERO	0	RDU		LA							XXX	

CONTABILIZACION OPERACIONES FORWARD DE ESPECULACIÓN – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDU

Contabilización Contratos Forward de Especulación al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	DERECHO	1515XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	1515XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4129XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contrato Forward de Especulación - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
VALORAR	PYGOBLI	1515XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGOBLI	4129XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	1515XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	4129XXXX	01		CREDITO

Contabilización Contrato Forward de Especulación - disminución del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	1515XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGOBLD	4129XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	1515XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	4129XXXX1	01	DEBITO	

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en el Contrato Forward de Especulación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	1515XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	1515XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	2315XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	2315XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contrato Forward de Especulación



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	1515XXXX	01	CREDITO	
CUMPLIR	OBLIGACION	1515XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	PYGCPR	16879501	07	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES FORWARD DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDU

DERECHO							
156505	156506	156507	156508	156510	156515	156516	156520
OBLIGACION							
156525	156526	156527	156528	156530	156535	156536	156540

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPUC	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUN	espe	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFI
	EST	R	TRA	VER	TA	Cie	MI	EN	TO	TE	S	JO
FINANCI ERO	PROPI O	FORWA RDU	NA	COBET URA	xxx x	xxxx	NA	NA			1565X XXX	xx

Contabilización Contratos Forward de Cobertura al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	DERECHO	1565XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	1565XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4139XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Forward de Cobertura - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	1565XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGCPRD	5139XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDIFD	34141501	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	1565XXXX	01	DEBITO	



Contabilización Contratos Forward de Cobertura - disminución del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	1565XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGCPRI	4139XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDIFI	34141501	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	1565XXXX	01		CREDITO

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en el Contratos Forward de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	1565XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	1565XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	2365XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	2365XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contratos Forward de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	1565XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	1565XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	UTILIDAD	34141501	01	DEBITO	
CUMPLIR	UTILIDAD	41380501	01		CREDITO
CUMPLIR	PYGCPR	16879501	07	DEBITO	

CONTABILIZACION OPERACIONES FUTURO DE ESPECULACIÓN – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDU

DERECHO							
151605	151606	151607	151608	151610	151615	151616	151620
OBLIGACION							
151625	151626	151627	151628	151630	151635	151636	151640

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.



TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	espec	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	R	TRA	VER	A	Ie	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	forwa Rdu	NA	especu La	xxxx	xxxx	NA	NA			1516X XXX	xx

Contabilización Contratos Futuros de Especulación al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	DERECHO	1516XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	1516XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4129XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Futuros Especulación - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	1516XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGOBLI	4129XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	1516XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	4129XXXX	01		CREDITO

Contabilización Contratos Futuros de Especulación - disminución del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	151605XX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGOBLD	41290501	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	151625XX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	41290501	01	DEBITO	

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en los Contratos Futuros de Especulación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	1516XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	1516XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	2316XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	2316XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contratos Futuros de Especulación



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
CUMPLIR	DERECHO	1516XXXX	01	CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	1516XXXX	01	DEBITO
CUMPLIR	PYGCPR	16879501	07	DEBITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FUTURO DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDU

DERECHO							
156605	156606	156607	156608	156610	156615	156616	156620
OBLIGACION							
156625	156626	156627	156628	156630	156635	156636	156640

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	pucba	SUFIJ
C	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	forwa Rdu	NA	COBETU RA	xxxx	xxxx	NA	NA			1566X XXX	xx

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
NEGOCIAR	DERECHO	1566XXXX	01	DEBITO
NEGOCIAR	OBLIGACION	1566XXXX	01	CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4139XXXX	01	DEBITO

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	1566XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGCPRD	5139XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDIFD	34142001	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	1566XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura - disminución del Derecho y la Obligación



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
VALORAR	PYGOBLD	1566XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGCPRI	4139XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDIFI	34142001	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	1566XXXX	01		CREDITO

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en los Contratos Futuros de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	1566XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	1566XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	2366XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	2366XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contratos Futuros de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	1566XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	1566XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	UTILIDAD	341415011	01	DEBITO	
CUMPLIR	UTILIDAD	41380501	01		CREDITO
CUMPLIR	PYGCPR	16879501	07	DEBITO	

# CONTABILIZACIÓN DE ACUERDO AL PUC FINANCIERO DE LAS SIGUIENTES CUENTAS DE CONTRATOS FORWARD Y FUTUROS PASIVOS

DERECHC	)						
231505	231506	231507	231508	231510	231515	231516	231520
OBLIGAC	ION						
231525	231526	231527	231528	231530	231535	231536	231540

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU T	IPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ



С	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC IERO	PROPI O	Forwa Rdp	NA	especu La	xxxx	xxxx	NA	NA			2315X XXX	xx

CONTABILIZACION OPERACIONES FORWARD DE ESPECULACIÓN – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDP

Contabilización Contrato Forward de Especulación al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	DERECHO	2315XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	2315XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4129XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contrato Forward de Especulación - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	2315XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGOBLI	4129XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	2315XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	4129XXXX	01		CREDITO

Contabilización Contrato Forward de Especulación - disminución del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	2315XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGOBLD	4129XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	2315XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	4129XXXX1	01	DEBITO	

Contabilización traslado por mayor valor del derecho que la obligación en el Contrato Forward de Especulación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYDER	DERECHO	2315XXXX	01		CREDITO
MAYDER	OBLIGACION	2315XXXX	01	DEBITO	
MAYDER	DERECHO	1515XXXX	01	DEBITO	
MAYDER	OBLIGACION	1515XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contrato Forward de Especulación



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	2315XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	2315XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	PYGCPR	27959501	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FORWARD DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDP

DERECHO							
236505	236506	236507	236508	236510	236515	236516	236520
OBLIGACION							
236525	236526			236530	236535	236536	236540

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	tipocp	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	forwa Rdp	NA	COBETU RA	XXXX	xxxx	NA	NA			2365X XXX	xx

Contabilización Contrato Forward de Cobertura al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
NEGOCIAR	DERECHO	2365XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	2365XXXX	01	CREDITO	
NEGOCIAR	PYGCPR	4139XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contrato Forward de Cobertura - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	2365XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGCPRD	5139XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDIFD	34141501	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	2365XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contrato Forward de Cobertura - disminución del Derecho y la Obligación



Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	2365XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGCPRI	4139XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDIFI	34141501	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	2365XXXX	01		CREDITO

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en el Contrato Forward de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYDER	DERECHO	2365XXXX	01		CREDITO
MAYDER	OBLIGACION	2365XXXX	01	DEBITO	
MAYDER	DERECHO	1565XXXX	01	DEBITO	
MAYDER	OBLIGACION	1565XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contrato Forward de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	2365XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	2365XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	PERDIDA	34141501	01		CREDITO
CUMPLIR	PERDIDA	51380501	01	DEBITO	
CUMPLIR	PYGCPR	27959501	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FUTURO DE ESPECULACIÓN – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDP

DERECHO							
231605	231606	231610	231615	231616	231617	231618	231620
OBLIGACION							
231625	231626	231630	231635	231636	231637	231638	231640

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ



С	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	ТО	TE	S	0
FINANC	PROPI	FORWA	NA	ESPECU	xxxx	xxxx	NA	NA			2316X	xx
IERO	0	RDP		LA							XXX	

Contabilización Contratos Futuros de Especulación al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	to
NEGOCIAR	DERECHO	2316XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	2316XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	4129XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Futuros Especulación - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	2316XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGOBLI	4129XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	2316XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	4129XXXX	01		CREDITO

Contabilización Contratos Futuros de Especulación - disminución del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLD	2316XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGOBLD	4129XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	2316XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	4129XXXX	01	DEBITO	

Contabilización traslado por mayor valor del derecho que la obligación en los Contratos Futuros de Especulación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	2316XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	2316XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	1516XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	1516XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contratos Futuros de Especulación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	2316XXXX	01		CREDITO



CUMPLIR	OBLIGACION	2316XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	PYGCPR	27959501	01		CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FUTURO DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR – FORWARDP

DERECHO							
236605	236606	236610	236615	236616	236617	236618	236620
OBLIGACION							
236625	236626	236630	236635	236636	236637	236638	236640

Se selecciona al inicio de la operación de acuerdo con la siguiente tabla, las opciones requeridas de cada uno de los Items de la primera línea, en los ítems ESPECIE y PUCBAS se selecciona la opción de acuerdo al nemotécnico del título de la inversión, para el Ítem SUFIJO, se tiene en cuenta el PUC propio de la entidad y en los ítems EVENTO Y VALFTE, se selecciona de acuerdo al registro contable que se efectúa.

TIPOPU	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNT	espec	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBA	SUFIJ
C	EST	R	TRA	VFR	A	If	MI	FN	TO	TF	S	O
	PROPI	FORWA	NA	COBETU	xxxx	xxxx	NA	NA			2366X	xx

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimient	:0
NEGOCIAR	DERECHO	2366XXXX	01	DEBITO	
NEGOCIAR	OBLIGACION	2366XXXX	01		CREDITO
NEGOCIAR	PYGCPR	5139XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura - incremento del Derecho y la Obligación

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
VALORAR	PYGOBLI	2366XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGCPRD	5139XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDIFD	34141501	01	DEBITO	
VALORAR	PYGDERI	2366XXXX	01	DEBITO	

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura - disminución del Derecho y la Obligación



VALORAR	PYGOBLD	2366XXXX	01	DEBITO	
VALORAR	PYGCPRI	4139XXXX	01		CREDITO
VALORAR	PYGDIFI	34142001	01		CREDITO
VALORAR	PYGDERD	2366XXXX	01		CREDITO

Contabilización traslado por mayor valor de la obligación que el derecho en los Contratos Futuros de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
MAYOBL	DERECHO	2366XXXX	01		CREDITO
MAYOBL	OBLIGACION	2366XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	DERECHO	2366XXXX	01	DEBITO	
MAYOBL	OBLIGACION	2366XXXX	01		CREDITO

Contabilización cancelación Compromiso Contratos Futuros de Cobertura

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento	
CUMPLIR	DERECHO	2366XXXX	01		CREDITO
CUMPLIR	OBLIGACION	2366XXXX	01	DEBITO	
CUMPLIR	PERDIDA	34141501	01		CREDITO
CUMPLIR	PERDIDA	41380501	01	DEBITO	
CUMPLIR	PYGCPR	27959501	01		CREDITO

#### ESPECIES ESPECIALES NECESARIAS PARA LOS MOVIMIENTOS CONTABLES

Para los parámetros contables es necesario crear las siguientes especies:



## 1. LIQBAJ

Especies/Renta Var	iable - Detalle	×
Código LIQBAJ Calificación Estado ACTIVO Emisor ZPW Tipo Título Acciones Descripción USADA PA Categoría	Cod. Super ISIN Tipo Especie ACCION Moneda RA PARAMTRS CONTABLES Grupo de Calíficación	
Estado de Negociación	Fecha Patrimonial       Valor Patrimonial         Image: Constraint of the second s	
Superfinanciera	Aval Emisión Fungible	
	Cen	ar

## 2. LIQMED

📕 Especies/Renta Variable - Detalle	
Código LIQMED Cod. Calíficación Estado ACTIVO Tipo E Emisor ZPW M Tipo Título Acciones Descripción USADA PARA PARAMTRS CONTA Categoría Grupo de Calífi	Super ISIN specie ACCION Sector BLES Cación
Estado de Negociación ACTIVO Bursatilidad Tipo NINGUNA Porcentaje 0.000 Factor1 Factor 2 Fecha Patri 03/08/201 Fecha Fisc- 29/12/1 Acc. Circula Portafolio D	imonial Valor Patrimonial 0.0000000 inal Valor Nominal 0  0.0000000 al Valor Fiscal 1899 0 ación 0 eestino
- Superfinanciera Aval E Código SF Aval E Calificadora Otra	misión Fungible
	Cerrar



#### 3. LIQALT

📕 Especies/Renta Variable - Detalle	
Código     LIQALT     Cod. Super       Calificación     ISIN       Estado     ACTIVO     Tipo Especie       Emisor     ZPW     Moneda       Tipo Título     Acciones       Descripción     USADA PARA PARAMTRS CONTABLES       Categoría     Grupo de Calificación	
Estado de Negociación ACTIVO Bursatilidad Tipo ALTA Porcentaje 0.000 Factor 1 Factor 2 Fecha Patrimonial Valor Patrimonial 0.0000000 Fecha Nominal 0.00000000 Fecha Nominal 0.00000000 Fecha Patrimonial 0.00000000 Fecha Nominal 0.00000000 Potafolio Destino Factor 1 Factor 2 Valor Patrimonial 0.00000000 Fecha Patrimonial 0.00000000 Fecha Patrimonial 0.00000000 Fecha Patrimonial 0.00000000 Fecha Patrimonial 0.00000000 Fecha Nominal 0.00000000 Fecha Fiscal Valor Fiscal Potrafolio Destino	
Superfinanciera Aval Emisión Fungible Código SF Collificadora Otra	
C	errar

#### **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES**

#### 4. COP/TRM

Especies/R	lenta Variable	- Deta	lle		
Código Calificación Estado Emisor Tipo Título Descripción Categoría	COP/TRM ACTIVO FORWD FAVOR ASIGNAR FORWARD PESO	NOMBF /DOLAF	Cod. Super ISIN Tipo Especie Moneda RE TITULO	DIVISA TRM	4
Estado de Neg ACTIVO Bursatilidad Tipo NINGUNA Porcentaje [0.000 Factor1	jociación	Fe Fe Fe Au Po	echa Patrimonial 104/08/2010 echa Nominal 14/08/2010 echa Fiscal 130/12/1899 cc. Circulación ortafolio Destino	Valor Patri 0.000000 Valor Nom 0.0000000 Valor Fisca	monial 00 inal 00 al
-Superfinanciera Código SF Calificadora 미	Ax Ita	val	Emisión	Fun	gible



🗐 Especies/Renta Fija - Detalle				X
Código BBP002108D1 Descripción Calificación Estado ACTIVO FecMaxReinv 01/01/4000	Emisor BPO Moneda COP Indicador IRFBVC S Cod. Super Titulo BONOS ORDIN	Nemo Equiv Ro	enta Fija ISIN1 COB02CB00117 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo C	alificación
Superfinanciera Código SF Aval Er	misión Fungible F	Calificadora		T
Fecha Emisión Vencimie III 09/06/2010 III III 09/11 Tasa Referencia III Spread 1.20 Uso PRE	ento 2/2011 💌 000 VIA	Calculo CALCULO Caja CAJA SIN Calendario COMERO Fabla de Desarrollo NO TIEN Rendimiento INTERES Comisión VALOR Datos Faciales SI	D SIN DEFINIR	tor 1
Flujo       Número de Fluio         Día       Mes         O       O         Modalidad       Periodicia         Mensual       Vencio	újos Aplica Capitaliza	Amortización 100.000 Retefuente > 5 0.000 Retefuente < 5 0.000 Modalidad Pago de Reinversión Modalidad NO APLICA	Periodicidad	tor 2 Destino
				Cerrar


📕 Especies/Renta Fija - Detalle	
Código BBP002108D2 Emisor BP0   Descripción Moneda COP   Calificación Indicador IRFBVC   Estado ACTIVO Cod. Super   FecMaxReinv 01/01/4000 Titulo BONOS OR	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Superfinanciera	
Fecha   Vencimiento     Emisión   Vencimiento     Imigory 09/06/2010   Imigory 09/06/2012     Tasa   Referencia     Imigory 00000   Imigory 00000     Uso   PREVIA     Día   Mes     O   O     Número de Flújos     Cantidad   Aplica     Modalidad de Pago de Intereses     Modalidad   Periodicidad     MENSUAL   VENCIDA	Calculo   CALCULO SIN DEFINIR     Caja   CAJA SIN DEFINIR     Calendario   COMERCIAL     Tabla de Desarrollo   NO TIENE     Rendimiento   INTERESES     Comisión   VALOR     Datos Faciales   SI     Amotización   100.000     Retefuente > 5   0.000     Retefuente < 5   0.000     Modalidad   Periodicidad     NO APLICA   NO APLICA
	Cerrar



📕 Especies/Renta Fija - Detalle	
Código CDTFDT80 Emisor FDT   Descripción Moneda COP   Calificación Indicador IRFBVC   Estado ACTIVO Cod. Super   FecMaxReinv 01/01/4000 Titulo CDT FINDE	Nemo Equiv Renta Fija ISIN1 ISIN2 CurCDT Categoria Grupo Calificación
Código SF Aval Emisión Fungibl	le Calificadora
Fecha   Emisión   Vencimiento     I 12/02/2002   I 12/02/2002     Tasa   Referencia     Image: Spread   0.00000     Uso   PREVIA     Image: Flujo   Número de Flújos     Día   Mes     Image: Día   Número de Flújos     Cantidad   Aplica     Image: Modalidad de Pago de Intereses     Modalidad   Periodicidad     Image: Cualquiera   Image: Vencida	Calculo   CALCULO SIN DEFINIR     Caja   CAJA SIN DEFINIR     Calendario   COMERCIAL     Tabla de Desarrollo   NO TIENE     Rendimiento   INTERESES     Comisión   VALOR     Catación   IO0.000     Retefuente > 5   0.000     Retefuente < 5   0.000     Modalidad   Periodicidad     NO APLICA   NO APLICA
	Cerrar



🗐 Especies/Renta Fija - Detalle							
Código SIMULA Emisor GN   Descripción ESPECIE PAR CONTABLE SIM Moneda CO   Calificación Indicador IRF   Estado ACTIVO Cod. Super VA   FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo BO	Nemo Equiv Renta Fija   P ISIN1   ISIN2 ISIN2   CIO CurCDT   NOS ORDINARIOS Categoria						
Superfinanciera							
Fecha   Emisión   Vencimiento     Imisión   Imisión   Imisión     Imisión   Imisión   Imisión     Tasa   Imisión   Imisión     Referencia   Imisión   Imisión     Imisión   Imisión   Imisión     Spread   0.00000   Imisión     Uso   ACTUAL   Imisión     Imisión   Cantidad   Aplica     Imisión   Imisión   Imisión     Modalidad   Periodicidad   Imisión     Imisión   Imisión   Imisión     Imisión   Imisión   Imisión	Calculo   CALCULO SIN DEFINIR     Caja   CAJA SIN DEFINIR     Calendario   CORRIDO     Tabla de Desarrollo   NO TIENE     Rendimiento   INTERESES     Comisión   VALOR     Case Factor 1     Datos Faciales   NO     Amortización   0.000     Retefuente > 5   0.000     Retefuente < 5   0.000     Modalidad   Periodicidad     DIARIA   ANTICIPADA						
	Cerrar						

REPOC



🗐 Especies/Renta Fija - Detalle							
Código REPOC Emisor GNA   Descripción ESPECIE PAR CONTABLE REP Moneda COP   Calificación Indicador IRFBVC   Estado ACTIVO Cod. Super VACIO   FecMaxReinv 17/09/2003 Titulo BONOS ORD	Nemo Equiv Renta Fija     ISIN1     ISIN2     CurCDT     CurCDT     Categoria     Grupo Calíficación						
Superfinanciera							
Fecha   Vencimiento     Emisión   Vencimiento     Imisión   Imisión     Imisión   Imisión	Calculo CALCULO SIN DEFINIR Caja CAJA SIN DEFINIR Calendario CORRIDO Tabla de Desarrollo NO TIENE Rendimiento INTERESES Comisión VALOR Clase Factor 1 Datos Faciales NO Clase Factor 2						
Flujo Número de Flújos   Día Mes   0 0   0 No Capitaliza	Retefuente > 5 0.000 Portafolio Destino   Retefuente < 5 0.000 Image: Construction of the second						
Modalidad de Pago de Intereses	Modalidad Pago de Reinversión						
NO APLICA	NO APLICA						
	Cerrar						

INTERBANC



Especies/	Renta Variab	le - Deta	lle		
Código Calificación Estado Emisor Tipo Título Descripción Categoría	INTERBANC ACTIVO USA Divisas ESPECIE PAR	CONTABLE	Cod. Super ISIN Tipo Especie Moneda EINTERBANC o de Calificación	VACIO DIVISA TRM	
Estado de Ne ACTIVO Bursatilidad - Tipo NINGUNA Porcentaje 0.000 Factor1	egociación	Fe Fe Ac 2	echa Patrimonial 30/11/2010 echa Nominal 0/11/2010 echa Fiscal 30/12/1899 cc. Circulación ortafolio Destino	Valor Patrimonia 0.00000000 Valor Nominal 0.00000000 Valor Fiscal 0	
-Superfinanciera Código SF Calificadora	) Dtra	Aval	Emisión	Fungible	
				×	Cerrar



#### **18.GLOSARIO PWPREI**

A continuación se presenta una lista de Palabras con su respectivo significado

#### В

**Backtesting:** Método de comparación entre el valor en riesgo observado con las pérdidas y/o ganancias reales. Lo que se mide es la eficiencia del modelo, contando las observaciones de pérdidas y/o ganancias que fueron mayores al VaR y, en consecuencia, decidir sobre la conveniencia de calibrarlo.

# С

Clasificación Del Riesgo: Una clasificación del riesgo, de acuerdo al tipo es la siguiente:

- Riesgo de Mercado
- Riesgo de Crédito
- Riesgo de Liquidez
- Riesgo Operacional y Legal

A su vez los tres primeros son cuantificables y los dos últimos no cuantificables.

**Correlación:** Para una mayor claridad en la interpretación de la magnitud de la COVARIANZA, se puede utilizar la correlación para medir el grado de movimiento conjunto entre dos variables o la relación lineal entre ambas. La correlación se encuentra entre -1 y +1 y se determina de la siguiente manera :

Corr (i,j) = COV (i,j) / (si * sj) i = Activo 1 j = Activo 2

si = Volatilidad del activo 1 sj = Volatilidad del activo 2

El signo positivo en el coeficiente de correlación significa que los rendimientos de los dos activos se mueven en la misma dirección, mientras más cercano a la unidad, mayor será el grado de dependencia mutua. El signo negativo indica que los rendimientos de los dos activos se mueven en sentidos opuestos. Asimismo, mientras más cercano a cero sea el coeficiente de correlación, mayor será el grado de independencia de los rendimientos de los dos dos activos.

**Covarianza:** Es una medida de relación lineal entre dos variables aleatorias describiendo el movimiento conjunto entre éstas. Dichas variables pueden ser los rendimientos de un portafolio.

COV(i,j) = SUMA(Ri - R1) * (Rj - R2) / (n - 1)

i = Activo 1 j = Activo 2 Ri = Rendimiento del activo 1

Rj = Rendimiento del activo 2

R1 = Rendimiento promedio del activo 1 R2 = rendimiento promedio del activo 2

n = Número de observaciones del activo 1 y del activo 2



### D

**Duración:** Es el cambio en el valor de precio un instrumento cuando se registra un cambio en las tasas de interés del mercado. La duración modificada se define como el cambio porcentual en el precio del instrumento, cuando las tasas cambian1% (cien puntos básicos). Por ejemplo, si un bono tiene una duración de 3.5 años y las tasas suben 1%, este bono sufrirá una pérdida de 3.5%. Así, conociendo la duración modificada del bono, es posible identificar de manera inmediata la pérdida potencial de este instrumento por cada 100 puntos básicos.

# Е

**EWMA:** (EXPONENTIAL WEIGHTED MOBILE AVERAGE) Promedios Móviles Exponenciales Ponderados. Método de estimación que permite obtener información acerca de las volatilidades de una serie histórica de observaciones, de tal manera que las observaciones recientes tengan el mayor peso.

#### F

**Factor de Riesgo:** Es un parámetro cuyos cambios en los mercados financieros causarán un cambio en el valor presente neto del portafolio. Los factores de riesgo más comunes son: los precios de las acciones, las tasas de interés, las sobretasas en instrumentos de mercado de dinero, los tipos de cambio, los precios de los commodities, etc.

### Ι

**Intervalos de Confianza:** Por lo general, para un grupo de rendimientos de un activo se puede definir una función de probabilidad para estudiar su comportamiento. Definida la función de probabilidad, el área contenida bajo la curva entre dos valores de posibles rendimientos, se dice que es la probabilidad de ocurrencia. El intervalo de confianza es el área de probabilidad en el cual se estima sucederá un posible valor del rendimiento.

Inversión: Valor a precios de mercado de la posición de un portafolio.

#### Ρ

**Portafolio:** Forma de organizar las posiciones de una empresa para lograr un adecuado manejo de sus inversiones, ya sea realizado por disposiciones legales y reglamentarias, por directivas trazadas o combinación de éstas, con el fin de realizar un adecuado manejo del capital, y así optimizar sus rendimientos.

Posición: Tomar un título valor o equivalente por un período de tiempo, buscando la mayor rentabilidad posible.

### R

**Rendimiento:** El rendimiento de un activo o portafolio es el cambio de valor que registra en un período con respecto a su valor inicial. Por ejemplo, considere que el valor de ayer de un portafolio fue de 103.5 millones de pesos y hoy tiene un valor de 104.2 millones, el rendimiento de un día será:



R = (104.2 - 103.5) / 103.5 = 0.68%.

El rendimiento también se puede definir el logaritmo de la razón del rendimiento de un valor anterior contra otro actual.

Ri = ln (Pt / Pt-1).

**Riesgo:** Es la incertidumbre acerca de un evento futuro. Está asociado tanto a un resultado favorable como a un resultado adverso Desde el punto de vista del análisis financiero, el interés es observar aquellos eventos que como resultado de la incertidumbre, producen pérdidas a una institución.

**Riesgo de Crédito:** El riesgo de crédito se refiere a la pérdida potencial en la que incurre quien otorga un crédito, debido a la posibilidad de que la contraparte no cumpla con sus obligaciones (probabilidad de no-pago).

**Riesgo de Liquidez:** El riesgo de liquidez se refiere a las posibles pérdidas en el valor del portafolio debidas a la necesidad de liquidar instrumentos en condiciones financieras no propicias.

**Riesgo de Mercado:** El riesgo de mercado es la incertidumbre acerca de los rendimientos futuros de una inversión, como resultado de movimientos adversos en las condiciones de los mercados financieros. Pérdida potencial de los activos que de acuerdo al mercado susciten variabilidad por los efectos del mercado.

**Riesgo Operativo Y Legal:** El riesgo operativo y legal se refiere a las pérdidas potenciales en las que puede incurrir una institución, debidas al incumplimiento de disposiciones legales y administrativas.

**RMSE:** (ROOT MEAN SQUARED ERROR) Error de Pronóstico de la Varianza. La estimación para el factor lambda se basa en encontrar el menor RMSE para diferentes valores de dicha lambda, es decir, se debe buscar el factor de decaimiento que produzca la mejor estimación (que minimice la medida del pronóstico).

#### S

**Stresstesting:** Prueba de valores extremos consistente en crear escenarios que respondan a la pregunta "qué pasaría si...", que obliga a los administradores de riesgos a predecir pérdidas en condiciones de desastres financieros o por de crisis provocadas por problemas políticos o desequilibrios en la economía. Es complementario al método VaR.

#### Т

**Título Valor:** Condiciones de los derechos adquiridos en una negociación por parte de un vendedor y de un comprador.



# V

**VaR: (VALOR EN RIESGO)** Es una medida estadística de riesgo de mercado que estima la pérdida máxima que podría registrar un portafolio en un intervalo de tiempo y con cierto nivel de probabilidad o confianza. La definición de VaR es válida únicamente en condiciones normales de mercado, ya que en momentos de crisis y turbulencia la pérdida esperada se define por pruebas de stress o valores extremos.

El VaR no otorga certidumbre respecto a las pérdidas que se podrían sufrir en una inversión, son una expectativa de resultados basada en estadística (series de datos en el tiempo) y en algunos supuestos de los modelos o parámetros que se utilizan para su cálculo.

**Varianza:** Es una medida de dispersión similar a la volatilidad o desviación estándar, la diferencia radica en que sus valores están elevados al cuadrado.

**Volatilidad:** Es la desviación estándar (o raíz cuadrada de la varianza) de los rendimientos de un activo o un portafolio. Es un indicador fundamental para la cuantificación de riesgos de mercado porque representa una medida de dispersión de los rendimientos con respecto al promedio. La mayor parte de los rendimientos se sitúan alrededor de un punto (generalmente el promedio de los rendimientos) y con valores extremos, para algunas situaciones.

**VaR Marginal:** El VaR Marginal mide la contribución al riesgo del portafolio de una posición en particular; es decir, cuanto cambia el VaR diversificado al comprar o vender un activo.

**VaR Incremental:** El VaR incremental mide el cambio del VaR del portafolio ante pequeñas variaciones de los activos; es decir, que efectos sobre el VaR tienen las variaciones de las diferentes posiciones del portafolio.