

INDICE GENERAL

INDICE GENERAL.....	1
EJECUCIÓN DEL PROGRAMA PWPREI	10
0. OPCIONES GENERALES.....	11
0.1. INGRESAR.....	12
0.2. MODIFICAR	12
0.3. ELIMINAR	12
0.4. BUSCAR	12
0.5. DETALLE	12
0.6. CARGAR.....	12
0.7. EXPORTAR A EXCEL	12
0.8. SALIR	12
0.9. CALCULAR	12
1. DEFINICIÓN DE PARÁMETROS	13
1.1. OPCIÓN GENERAL.....	14
1.1.1. EMPRESA	14
1.1.2. TRADERS	15
1.1.3. MERCADOS	17
1.1.4. GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO	18
1.1.5. LINEAS DE NEGOCIO	20
1.1.6. TIPOS DE PORTAFOLIO.....	22
1.1.7. PORTAFOLIOS	24
1.2. OPCIÓN SUPER FINANCIERA	27
1.2.1. TIPOS FACTORES RIESGOS	27
1.2.2. PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO	30
1.2.3. PARAMETROS APNR	33
1.2.4. RELACION DE FACTORES.....	36
1.2.5. PARAMETROS COMPROMISOS.....	39
1.2.6. PARAMETRO RIESGO DE CREDITO	43
1.2.7. PARAMETRO INFORME SUPERVALORES.....	46
1.2.8. PARAMETRO GRADUALIDAD SUPERVALORES	49

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 defined.
1.3.	NOTAS OPERATIVAS DERECHOS	59
1.4.	OPCIÓN PWPREI	71
1.4.1.	PARAMETRO RIESGO	72
1.4.2.	PARAMETRO VALORIZADOR	74
1.4.3.	VALORAR A PRECIO DE COMPRA	76
1.4.4.	TASAS DE VALORAR DINERO	77
1.4.5.	ENTIDADES REGULADORAS	78
1.4.6.	FACTORES DE RIESGO PWPREI	79
1.4.7.	PARAMETROS CONTABLES	81
1.4.8.	PARAMETROS MONEDA / TASAS FWD	89
1.4.9.	CUPOS	91
1.4.10.	FUNCIONES PARA ADMINISTRACION Y CONTROL DE CUPOS	96
1.4.11.	PARAMETROS GENERALES DE PWPREI	99
1.5.	OPCIÓN CONTRAPARTES	102
1.5.1.	CONTRAPARTE	102
1.5.2.	AGENTES EXTERIOR	105
1.6.	OPCION EMISOR	107
1.6.1.	PONDERACION	108
1.6.2.	CUENTAS BANCARIAS	111
1.6.3.	CONCENTRACION	113
2.	MERCADO Y SOCIEDAD	115
2.1.	OPCIÓN MERCADO	116
2.1.1.	EMISORES	117
2.1.2.	GRUPO EMISORES	122
2.1.3.	INDICADORES	124
2.1.4.	MONEDAS	127
2.1.5.	TASAS	131
2.1.6.	TITULOS	134
2.2.	OPCIÓN VALORES DE INDICADOR	145
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	160
2.3.	OPCIÓN ESPECIES	164
2.3.1.	ESPECIES/RENTA VARIABLE ACCIONES Y DIVISAS	164

2.3.2.	ESPECIES DE RENTA FIJA	169
2.3.3.	ISINES.....	179
2.3.4.	ESPECIES ASOCIADAS.....	183
2.3.5.	ESPECIES EQUIVALENTES	187
2.3.6.	ISIN ANNA	190
2.4.	OPCIÓN HISTORICO DE MERCADO.....	194
2.4.1.	PRECIO ALTERNA RF	194
2.4.2.	PRECIOS DE ACCIONES.....	197
2.4.3.	FESTIVOS.....	200
2.4.4.	DEPOSITOS.....	202
2.4.5.	CUSTODIOS	205
2.5.	OPCION NEGOCIOS.....	205
2.5.1.	BENEFICIARIOS.....	206
2.5.2.	NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE	209
2.5.3.	NEGOCIOS DE RENTA FIJA	212
2.5.4.	NEGOCIOS DE DIVISAS	215
2.6.	OPCIÓN INFOVAL	218
2.6.1.	MARGEN PROMEDIO	218
2.6.2.	MARGEN PROPIO	220
2.6.3.	PRECIO	221
2.6.4.	CURVAS.....	224
2.6.5.	BETAS.....	225
2.6.6.	PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL / TODOS.....	227
2.6.7.	CANASTA DERIVADOS.....	229
2.6.8.	PRECIOS DERIVADOS	231
2.6.9.	MARGEN INICIAL.....	231
	INFOVALMER.....	231
2.7.	OPCIÓN VALORES SUPER.....	233
2.7.1.	VALOR FACTORES	234
2.7.2.	MATRIZ DE CORRELACION	236
2.7.3.	CUENTAS PATRIMONIO TECNICO	239
2.7.4.	VALOR CUENTAS APNR	240
2.7.5.	DATOS NETOS	242
2.7.6.	MATRICES SFC.....	245
2.8.	OPCIÓN FORWARD /OPCF	246
2.8.1.	TASAS FORWARD	247
2.8.2.	PIPS	255
2.8.3.	MONEDA VS DÓLAR.....	259
3.	CIERRE.....	262
4.	INFORMES.....	265
4.1.	OPCIÓN FORWARD.....	265

4.1.1.	INFORME FORWARD CONTRAPARTE.....	266
4.1.2.	INFORME FORWARD.....	266
4.1.3.	INFORME OPCIONES.....	267
4.1.4.	INFORME GAP.....	267
4.1.5.	VANILLA.....	268
4.2.	OPCION INFORMES DE RIESGO.....	269
4.2.1.	INVERSIONES.....	269
4.2.2.	PARTICIPACION.....	269
4.2.3.	HISTORICO.....	271
4.2.4.	REPORTE VaR.....	272
4.2.5.	CONTRAPARTES.....	273
4.2.6.	P&G.....	274
4.2.7.	RIESGO DE LIQUIDEZ.....	276
4.2.8.	RLQFIC – FORMATO 519.....	288
4.2.9.	GENERAR DESDE EXCEL.....	304
4.3.	OPCIÓN VALORACION.....	306
4.3.1.	SUPERVALORES – Informe Perdida/Ganancia.....	306
4.3.2.	REPsSIMS.....	308
4.3.3.	NOTIFICACION.....	310
4.3.4.	MOVIMIENTOS CONTABLES.....	311
4.3.5.	MOVIMIENTOS PORTAFOLIOS.....	313
4.4.	OPCIÓN CONCENTRACION.....	314
4.4.1.	CONCENTRACION DE RIESGO.....	314
4.4.2.	CONCENTRACION PORTAFOLIO.....	316
5.	ADMINISTRACION DE SEGURIDAD.....	318
5.1.	OPCIÓN ÚNICA / ADMINISTRACIÓN DE SEGURIDAD.....	318
5.1.1.	GESTION DE USUARIOS.....	319
5.1.2.	CONSULTA DE USUARIOS.....	323
5.1.3.	RESTRICCIONES DE MODULOS.....	323
5.1.4.	RESTRICCIONES DE OPCIONES.....	324
5.1.5.	INFORME DE USUARIOS.....	326
5.1.6.	CONTROL USUARIOS.....	327
6.	LOGS DE AUDITORIA.....	330
6.1.	OPCIÓN AUDITORIA.....	331
6.1.1.	ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE.....	332
6.1.2.	RENTA FIJA.....	334
6.1.3.	ESPECIE ASOCIADA.....	336
6.1.4.	ESPECIES EQUIVALENTES.....	338
6.1.5.	PARAMETROS DE RIESGO.....	340
6.1.6.	PARAMETROS DE VALORACIÓN.....	340
6.1.7.	PARAMETROS CONTABILIDAD.....	343
6.1.8.	CUSTODIOS.....	344

6.1.9.	PARAMETROS GENERALES.....	344
6.1.10.	CUPOS.....	344
7.	CIRCULAR 016.....	345
7.1.	OPCION CIRCULAR 016.....	345
7.1.1.	FORMATOS.....	346
7.1.2.	GENERAR FORMATOS.....	351
7.1.3.	FORMATOS EN EXCEL.....	353
7.1.4.	FORMATO 351 DESDE EXCEL.....	353
7.2.	OPCION CIRCULAR 008.....	354
7.3.	OPCION BRP.....	356
7.3.1.	EXCEL BRP.....	356
8.	PORTAFOLIOS Y RIESGO.....	357
8.1.	OPCIÓN METODOS.....	385
8.1.1.	SIMULACIÓN HISTÓRICA.....	385
8.1.2.	MONTECARLO ESTRUCTURADO.....	394
8.1.3.	DURACIÓN MODIFICADA.....	403
8.1.4.	DELTA NORMAL (VAR RISKMETRICS).....	413
8.1.5.	SUPERVALORES.....	420
8.1.6.	VALORIZADOR EXTERNO.....	423
8.1.7.	BORRAR HISTORIAL.....	424
8.2.	OPCIÓN CARGA.....	425
8.2.1.	PARÁMETROS DE LA CARGA MANUAL DE PORTAFOLIOS.....	425
8.2.2.	DISTRIBUCION.....	431
8.2.3.	COMPROMISOS.....	432
8.2.4.	PROVEEDOR EXTERNO.....	436
8.3.	OPCIÓN CONSULTAR.....	442
8.3.1.	MEDICION.....	442
8.3.2.	INFORME SUPERVALORES.....	444
8.3.3.	VER INVERSIONES.....	444
8.4.	OPCIÓN VeR POSPRO.....	445
	GENERAR VeR POSPRO.....	449
	CONSULTAR VeR POSPRO.....	449
	FORMATOS.....	450
	INFORME FORMATOS.....	450
8.5.	OPCIÓN VeR FONDO.....	450
8.5.1.	CONSULTAR.....	451
8.5.2.	GENERAR.....	451
8.5.3.	FORMATOS.....	452
8.5.4.	INFORME DE FORMATOS.....	452

8.5.5.	LIMPIAR FONDOS.....	452
8.5.6.	VaR MODELO CARTERAS COLECTIVAS.....	453
8.6.	OPCIÓN VeR RESERVAS	454
8.6.1.	GENERAR	455
8.6.2.	CONSULTAR	455
8.6.3.	FORMATOS	456
8.6.4.	INFORME FORMATOS.....	457
	ELIMINACION Y RECUPERACION DE OPERACIONES.....	457
	GARANTIAS ADICIONALES Y PARAMETROS CVA.....	459
	INFORME DE VAR POR PORTAFOLIO APTS.....	465
	SINCRONIZACION DE PORTAFOLIOS	466
	NOTAS – DISEÑO OPERACIONES INTERNACIONALES.....	468
	NOTAS OPERATIVAS – DERIVADOS Y TASAS	469
9.	CARGA BOF.....	481
9.1.	OPCIÓN MEC	482
9.1.1.	NOTAS CARGA MASTER TRADER	482
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	493
9.1.7.	CUSTODIOS	494
9.1.8.	SECUENCIAS - PYGCORTOS	501
10.	CONTABILIZAR	502
10.1.	GENERAR MOVIMIENTOS CONTABLES	507
10.2.	CUMPLIMIENTO Y RECAUDO	508
10.3.	NOTA OPERATIVA- DIFERENCIA EN CAMBIO TITULOS	512
11.	VALORIZADOR	514
11.1.	OPCIÓN VALORIZAR TITULOS	514
11.1.1.	BUSCAR NEMO	515
11.1.2.	VALORIZAR TITULOS AL DESCUENTO POR TASA.....	516
11.1.3.	VALORIZAR TÍTULOS AL DESCUENTO POR PRECIO	517
11.1.4.	VALORIZAR OTROS TITULOS AL DESCUENTO.....	518
11.1.5.	VALORIZAR OTROS TITULOS CON INTERESES PERIODICOS	520
11.1.6.	VALORIZAR AMORTIZABLES.....	520
11.1.7.	VALORIZAR ESPECIES DEL SISTEMA CONTINUO / DEUDA PÚBLICA.....	521
11.1.8.	VALORIZAR PORTAFOLIOS	522
11.1.9.	VALORIZAR DURACION MEC.....	534
11.1.10.	PREVALORIZADOR	536

11.2. OPCIÓN VAL HISTÓRICOS	542
11.2.1. HISTORICO RF	542
11.2.2. HISTORICO ACC/DIV.....	547
11.3. OPCIÓN DERIVADOS.....	547
11.3.1. 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
FRONTERA EFICIENTE.....	573
FRONTERA EFICIENTE – DELTA NORMAL.....	576
Acciones	578
Divisas	580
VER INVERSIONES	580
14. MARGINAL AND INCREMENTAL VAR	581
14.1. OPCIÓN METODOS.....	582
14.1.1. DURACION MODIFICADA	582
14.1.2. DELTA NORMAL	585

15. DIVISAS IMC / SUPERBANCARIA - CIRCULAR 031	587
15.1. OPCIÓN PARÁMETROS	587
15.1.1. TIPO DE ENTIDAD	592
15.1.2. SUPERBANCARIA.....	594
15.1.3. FONDO FIDEICOMISO	594
15.1.4. PUC	596
15.1.5. FILTROS	599
15.1.6. COLUMNAS.....	601
15.2. OPCIÓN FORMATOS	603
15.2.1. FORMATOS	604
15.2.2. FORMATOS EXTERNO	607
15.2.3. INFORMACION EXTERNA	609
15.2.4. INFORMACION FORMATO 031	612
15.2.5. FORMATO FIDEICOMISO	615
15.3. OPCION INFORMES	616
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
TRACKING VAR AND PERFORMANCE ATTRIBUTION	619
16. ACERCA DE	626
17. PARAMETRIZACION CONTABLE	626
18. GLOSARIO PWPREI.....	726
B.....	726
C.....	726
D.....	727
E.....	727
F.....	727
I.....	727
P.....	727
R.....	727
S.....	728

T 728

V 729

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:

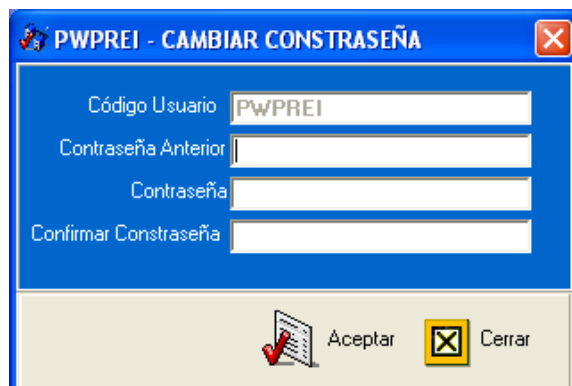


En esta pantalla deberá ingresar el Código de Usuario y Contraseña suministrados por el Administrador del Sistema. Si estos datos son válidos podrá ingresar al menú principal de **PWPREI – RIESGO E INVERSIONES**. En caso de que digite tres veces datos incorrectos el programa se saldrá.

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

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

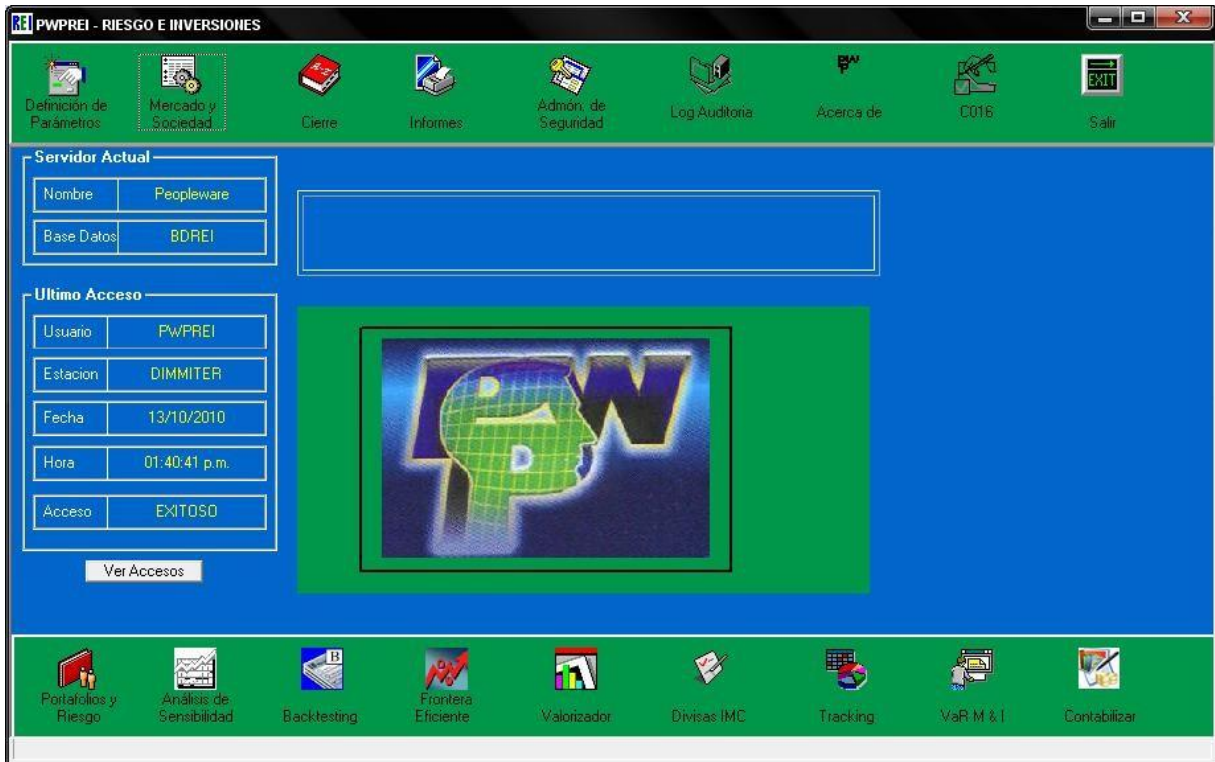
Cambiar Contraseña: El sistema le pedirá cada mes que se cambie la contraseña.



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, borrará 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

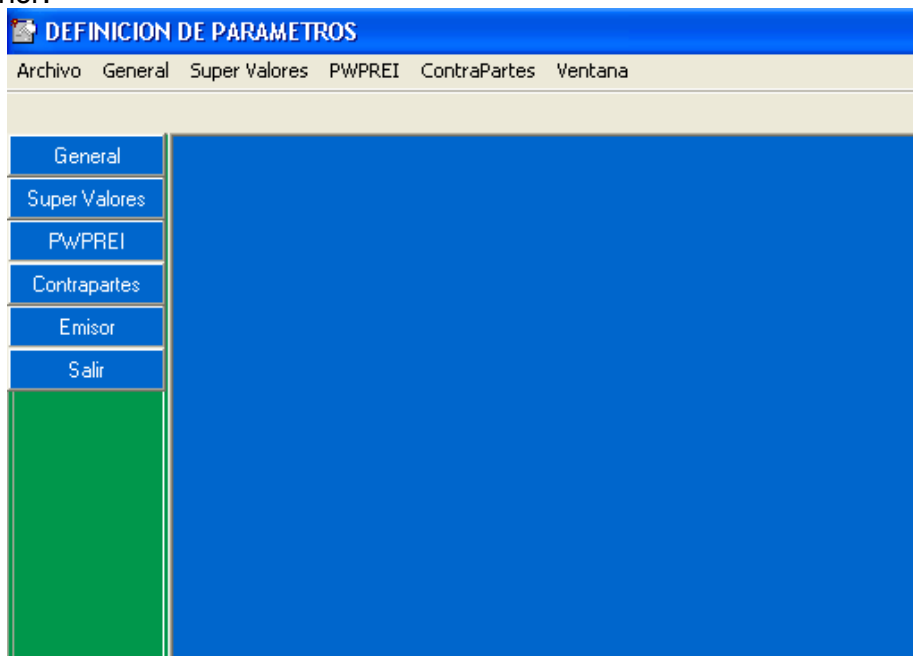
Esta opción se utiliza para calcular Datos en el Modulo Infoval.

1. DEFINICIÓN DE PARÁMETROS

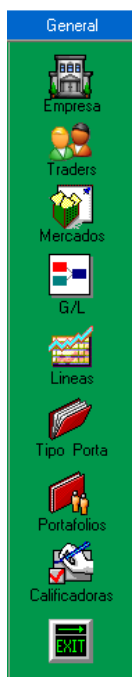


Al dar clic en este Icono el sistema lo llevará a la pantalla para manejo de los parámetros con los cuales debe alimentarse el sistema para organizar sus portafolios, conocer el modelo de riesgo a utilizar, con que parámetros realizar las evaluaciones, como mostrar la información etc. Estos parámetros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



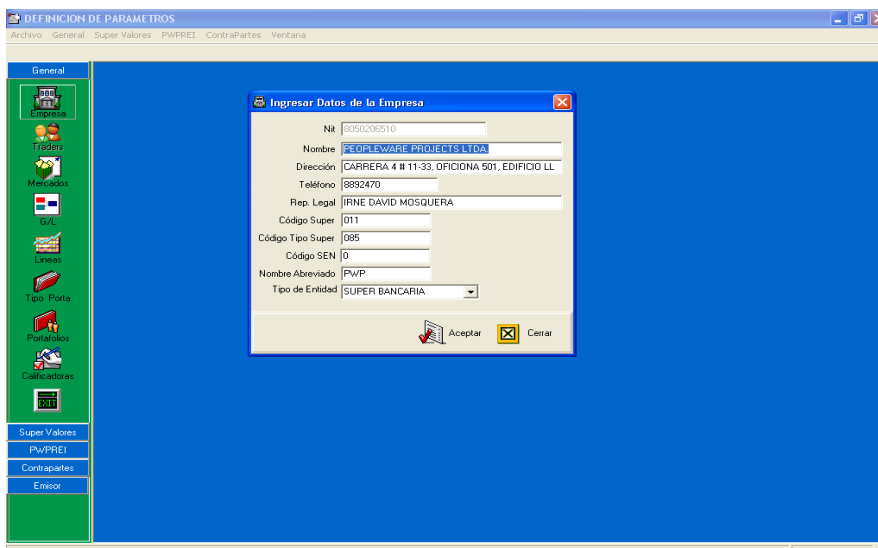
1.1. OPCIÓN GENERAL



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

General	Código	Identificación	Nombre	Mesa	Portafolio	Asociado	Código BVC	Código Sen	Código SET	Tipo Línea	Dire	Ciudad	Telefono	Email	Celular
	AV	AV	AV	MESA1	MESA 01	NO		:6134CNN		POSPRO					
	BL	BL	BERNARDO LOPEZ	MESA1	MESA 12	NO		:6017CNN	01SL	POSPRO					
	CAL	CAL	CARLOS LOPEZ	MESADOLAR	MESA 14	NO		N16		POSPRO					
	CAL1	ID CAL1	NOMBRE CAL1	MESADOLAR	MESA 14	NO		01026013		POSPRO					
	CAL2	ID CAL2	NOMBRE CAL2	MESADOLAR	MESA 15	NO		01026020		POSPRO					
	CO	CO	CO	MESA1	MESA 04	NO		:6210CNN		POSPRO					
	JB	JB	JB	MESARF	MESA 05	NO		01026004		POSPRO					
	JR	JR	JR	MESA1	MESA 06	NO		01026001		POSPRO					
	JS	JS	JS	MESA1	MESA 07	NO		:6020CNN		POSPRO					
	LD	LD	LD	MESA1	MESA 09	NO		:6213CNN		POSPRO					

Al ingresar a esta opción se despliega una cuadrícula 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 - Ingresar

Código

Identificación

Nombre

Mesa

Portafolio

Asociado

Código BVC

Código SEN

Código SETFX

Tipo Línea

Dirección

Ciudad

Telefono

Email

Celular

1.1.2.2. MODIFICAR TRADERS

The screenshot shows a dialog box titled "Traders - Modificar" with a close button (X) in the top right corner. The dialog contains the following fields:

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

At the bottom of the dialog, there are two buttons: "Aceptar" (Accept) with a checkmark icon and "Cerrar" (Close) with a close icon.

Para modificar un Trader sitúese en la cuadrícula 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 Línea	POSPRO
Dirección	123
Ciudad	CALI
Teléfono	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.

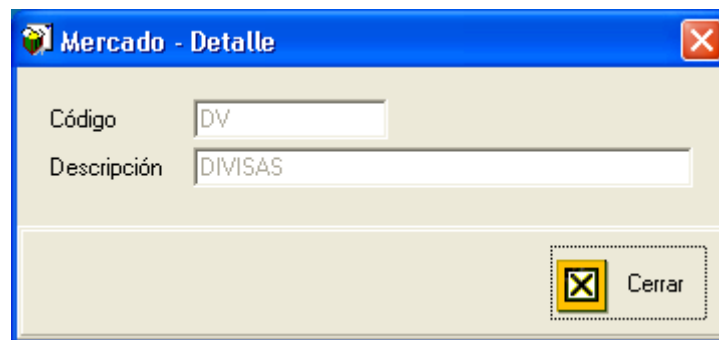
1.1.3. MERCADOS

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







1.1.3.1. Detalle mercados

Ubique el cursor sobre la cuadrícula 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.

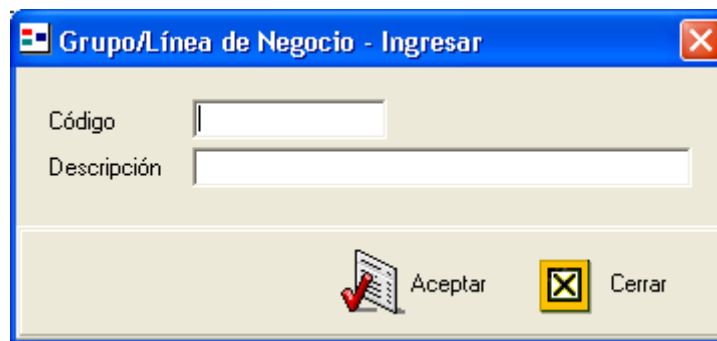


1.1.4. GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO

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

DEFINICION DE PARAMETROS - [Grupo/Línea]																													
Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana																													
General																													
 Empresa	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Código</th> <th>Descripción</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ASVALORES</td> <td>ASVALORES S.A. COM. BOLSA</td> </tr> <tr> <td>BANCA</td> <td>BANCA DE INVERSION IDP</td> </tr> <tr> <td>CLIENTES</td> <td>PORTAFOLIOS CLIENTES</td> </tr> <tr> <td>EJEMPLO</td> <td>GRUPO DE PRUEBAS</td> </tr> <tr> <td>FIDU</td> <td>FIDUCIARIA CORFIVALLE</td> </tr> <tr> <td>GFRONT</td> <td>GRUPO FRONT</td> </tr> <tr> <td>GRUPO CB</td> <td>PORTAFOLIO CASA DE BOLSA</td> </tr> <tr> <td>GRUPOBPT</td> <td>PORTAFOLIO BANCO PANAMÁ TEORII</td> </tr> <tr> <td>GRUPOCFV</td> <td>PORTAFOLIO CORFIVALLE</td> </tr> <tr> <td>GRUPOCFVT</td> <td>PORTAFOLIO TEORICO CFV</td> </tr> <tr> <td>HORIZONTE</td> <td>PORTAFOLIO DE HORINZONTE</td> </tr> <tr> <td>LEASING</td> <td>PORTAFOLIO LEASING VALLE</td> </tr> <tr> <td>NEGOCIO</td> <td>DESCRIPCION NEGOCIO</td> </tr> </tbody> </table>	Código	Descripción	ASVALORES	ASVALORES S.A. COM. BOLSA	BANCA	BANCA DE INVERSION IDP	CLIENTES	PORTAFOLIOS CLIENTES	EJEMPLO	GRUPO DE PRUEBAS	FIDU	FIDUCIARIA CORFIVALLE	GFRONT	GRUPO FRONT	GRUPO CB	PORTAFOLIO CASA DE BOLSA	GRUPOBPT	PORTAFOLIO BANCO PANAMÁ TEORII	GRUPOCFV	PORTAFOLIO CORFIVALLE	GRUPOCFVT	PORTAFOLIO TEORICO CFV	HORIZONTE	PORTAFOLIO DE HORINZONTE	LEASING	PORTAFOLIO LEASING VALLE	NEGOCIO	DESCRIPCION NEGOCIO
Código	Descripción																												
ASVALORES	ASVALORES S.A. COM. BOLSA																												
BANCA	BANCA DE INVERSION IDP																												
CLIENTES	PORTAFOLIOS CLIENTES																												
EJEMPLO	GRUPO DE PRUEBAS																												
FIDU	FIDUCIARIA CORFIVALLE																												
GFRONT	GRUPO FRONT																												
GRUPO CB	PORTAFOLIO CASA DE BOLSA																												
GRUPOBPT	PORTAFOLIO BANCO PANAMÁ TEORII																												
GRUPOCFV	PORTAFOLIO CORFIVALLE																												
GRUPOCFVT	PORTAFOLIO TEORICO CFV																												
HORIZONTE	PORTAFOLIO DE HORINZONTE																												
LEASING	PORTAFOLIO LEASING VALLE																												
NEGOCIO	DESCRIPCION NEGOCIO																												
 Traders																													
 Mercados																													
 G/L																													

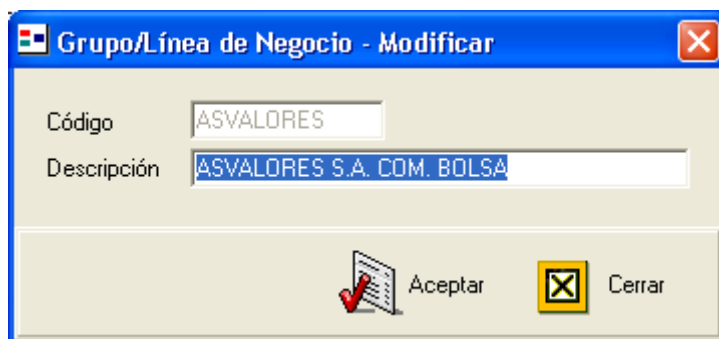
1.1.4.1. INGRESAR GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO



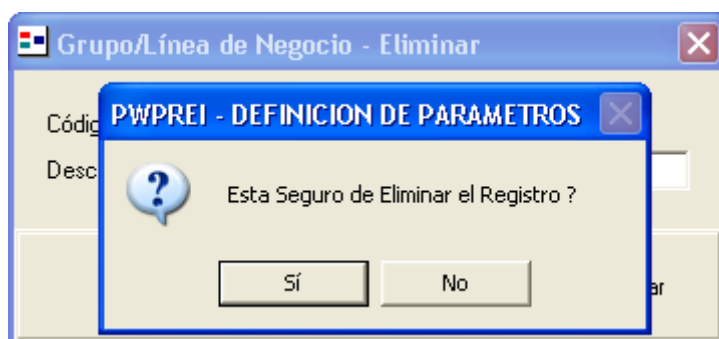
Para ingresar un grupo de líneas de negocio haga clic sobre el botón de ingreso arriba descrito. El sistema despliega la pantalla para digitar el Código y la Descripción del grupo de líneas de negocio.

1.1.4.2. MODIFICAR GRUPOS/LINEAS DE NEGOCIO

Para modificar un registro sitúese en la cuadrícula 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 cuadrícula 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 cuadrícula 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 DE PARAMETROS - [Línea de Negocio]

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

Código	Descripción	Grupo
513 LINEA	PRUEB JOSE NIVEL II	PRUEBA 513
ABIERTOS	FONDOS ABIERTOS	SOCIEDAD
BOG	BOGOTA	PP
BONACCION	BONO YANKE-ACCIONES	HORIZONTE
CERRADOS	FONDOS CERRADOS	SOCIEDAD
CLIENTES	CLIENTES	CLIENTES
CORPORATIV	CORPORATIVO	CLIENTES
CPINTER	CP. INTER	SCINTER
CTA PROPIA	CTA PROPIA BCD	CLIENTES
FID	FIDUCIARIA	FIDU
FONDO	FONDO ASVALORES	ASVALORES
FONDO BCD	FONDO BANCO	POSICIONES
LEASING VA	LINEA PORTAFOLIO LEASING	LEASING
LFRONT	LINEA FRONT	GFRONT
LICORERA	IND LICORES	HORIZONTE
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 Negocio - Ingresar

Linea

Descripción

Grupo

Aceptar Cerrar

1.1.5.2. MODIFICAR LINEAS DE NEGOCIO

Línea de Negocio - Modificar

Linea

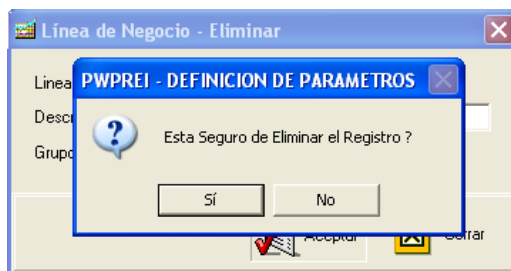
Descripción

Grupo

Aceptar Cerrar

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 cuadrícula 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 cuadrícula 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 General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana			
General	Código	Mercado	Moneda
	513 TPORTA	GEN	GEN
	BONOS	RF	COP
	CDT	RF	COP
	EXTERNO	GEN	TRM
	GARANAC	GEN	GEN
	GARANDR	GEN	GEN
	GARANDV	GEN	GEN
	GARANRF	GEN	GEN
	GEN	GEN	GEN
	GNA	GEN	GEN
	MARGEN	GEN	GEN
	MARPROPIO	GEN	COP
	OTROS	GEN	GEN
	PORTAFOLIO	GEN	GEN
	TES FJA	RF	COP
	TES USD\$	RF	TRM
	TES UVR	RF	UVR
	TFID	GEN	GEN
	TFRONT	GEN	GEN
	TIPO EJEMP	RF	COP

1.1.6.1. INGRESAR TIPOS DE PORTAFOLIO

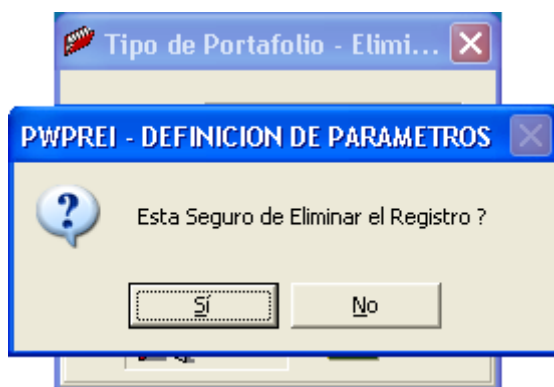
Para ingresar Tipos de Portafolio haga clic en el Icono descrito arriba, el sistema despliega la pantalla para ingreso de datos, los campos de mercado y moneda se pueden seleccionar por medio de las opciones que ahí se muestran.

1.1.6.2. MODIFICAR TIPOS DE PORTAFOLIO

Para modificar un registro seleccione el que desea modificar de la cuadrícula 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 cuadrícula, 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

General	Nombre	Nr1	Nr2	Nr3	Tipo	Linea de Negocio	Tipo de Fideicomiso	CodigoFF	Bloqueo	Estado
	ACCIONES	01			MARPROPI	CTA PROPIA	NINGUNO	0000		ACTIVO
	BP-RENTA FIJA BRASIL	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	BP-RENTA FIJA COLOMB	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	BP-RENTA FIJA MEXICO	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	BP-RENTA FIJA U.S.A.	01			EXTERNO	ABIERTOS	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	CARLOS	55555555555555			GNA	513 LINEA	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	CLIMAR1				MARGEN	PUBLICO			SI	ACTIVO
	CLIMAR2				MARGEN	PUBLICO			SI	ACTIVO
	CTA PROPIA OTROS	02			CDT	CTA PROPIA	NINGUNO	0		
	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		
	DIVISAS	01			GEN	CTA PROPIA	FID. DE INVERSION	1		ACTIVO
	EMISOR GNA	8903229051			OTROS	SCB	NINGUNO	0		
	EMISORES PRIV.	8903229051			OTROS	SCB	NINGUNO	0		
	EXT	01			EXTERNO	PUBLICO	NINGUNO	0000	NO	ACTIVO
	FIDPRU2	11			TIPOSB	LINEA SB	NINGUNO	0000		
	FIDPRU3	11			TIPOSB	LINEA SB	FID. DE INVERSION	0		
	FIDU1	11			TIPOSB	LINEA SB	FID. DE INVERSION	0		
	FIDUCIA	11			TFID	FID	NINGUNO	0000		
	FONDO BCO.	02			BONOS	FONDO BCO	PRIMA MEDIA - CAJADA	0		
	FONDOSCARLOS	02			CDT	PRUEBA CAR	FID. DE INVERSION	0001		
	FONDORENTAFIJA	02			GEN	ABIERTOS	FID. DE ADMINISTRAC	0		

Al dar clic en el botón Portafolios aparecerá la cuadrícula 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/Fideicomiso Codigo Fondo/Fideicomiso

Bloquear Estado

Aceptar Cerrar

1.1.7.2. MODIFICAR PORTAFOLIOS

Portafolio - Modificar

Nombre

Tipo Linea de Negocio

Beneficiarios

Tipo de Fondo/Fideicomiso Codigo Fondo/Fideicomiso

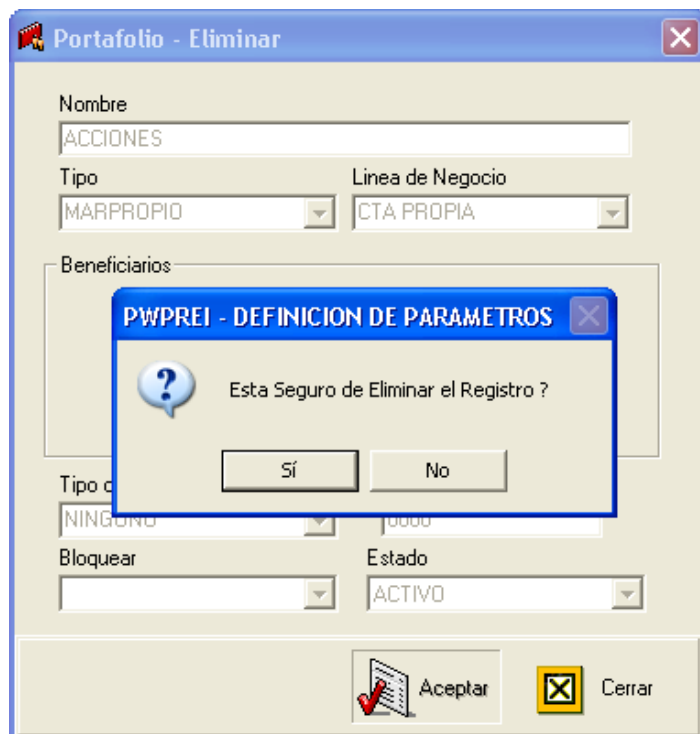
Bloquear Estado

Aceptar Cerrar

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



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.

DEFINICION DE PARAMETROS - [Tipo Factores]		
Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana		
Super Valores	CodSuper	Clase Factor
	17	MONEDA
	NO DEFINIDO MONEDA	

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.

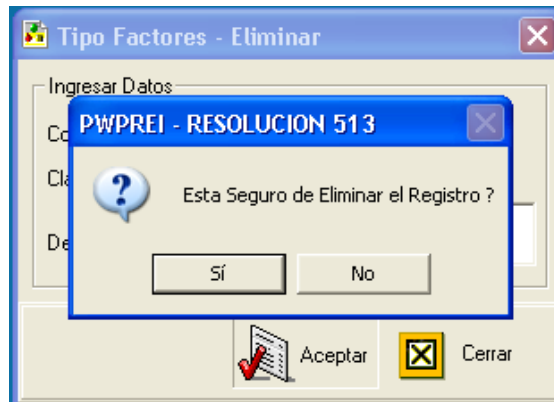
The screenshot shows a dialog box titled "Tipo Factores - Ingresar". It has a blue title bar with a close button. The main area is labeled "Ingresar Datos" and contains three input fields: "CodSuper" (a text box), "Clase Factor" (a dropdown menu), and "Descripcion" (a text area). At the bottom of the dialog, there are two buttons: "Aceptar" with a checkmark icon and "Cerrar" with a close icon.

1.2.1.2. MODIFICACION TIPO FACTOR RIESGO.

The screenshot shows a dialog box titled "Tipo Factores - Modificar". It has a blue title bar with a close button. The main area is labeled "Ingresar Datos" and contains three input fields: "CodSuper" (a text box with the value "17"), "Clase Factor" (a dropdown menu with the value "MONEDA"), and "Descripcion" (a text area with the value "NO DEFINIDO MONEDA"). At the bottom of the dialog, there are two buttons: "Aceptar" with a checkmark icon and "Cerrar" with a close icon.

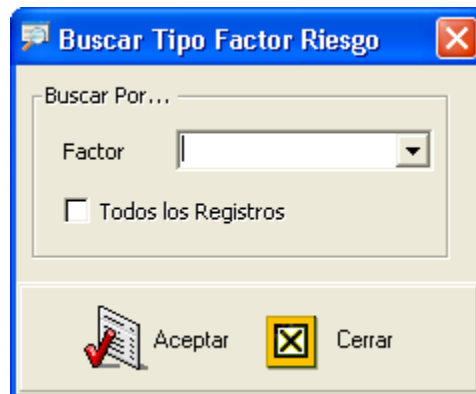
Para modificar un tipo de factor puede hacer clic sobre el registro a modificar o utilizando el icono ubicado en la parte superior, solo se puede modificar la clase de factor y la descripción, en caso de querer modificar el código súper debe eliminar el registro.

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



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 General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana						
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	1532	Propiedades y equipo- depreciación acumulada	100	+
	29/03/2007	CP	1596	Propiedades y equipo- 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: 18/06/2009

Tipo: []

Cuenta: []

Descripcion: []

Pocentaje Aplica: []

Signo: []

Aceptar Cerrar

1.2.2.2. MODIFICACION PARAMETROS PATRIMONIO TECNICO.

Parametro Patrimonio Tecnico - ...

Datos del Parametro

Fecha: 29/03/2007

Tipo: CP

Cuenta: 1504

Descripcion: Propiedades y equipo-terrenos

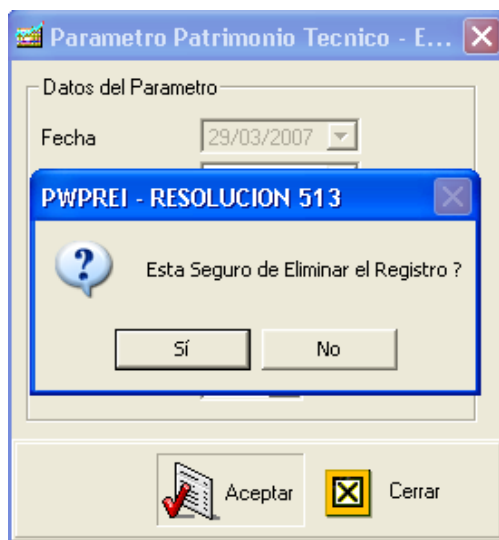
Pocentaje Aplica: 100

Signo: -

Aceptar Cerrar

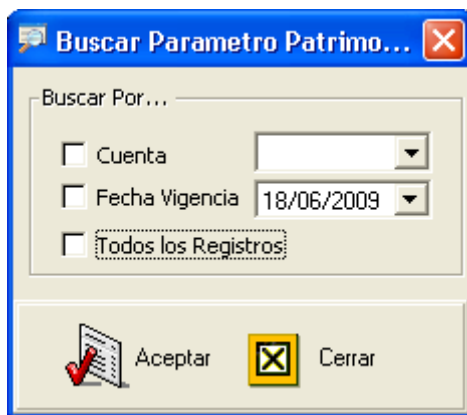
Para modificar seleccione un registro de la grilla o haga clic sobre el Icono de modificación. Solo puede modificar la descripción, el porcentaje que aplica y el signo. Para cambiar el tipo y la cuenta debe eliminar el registro.

1.2.2.3. ELIMINACION PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO.



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

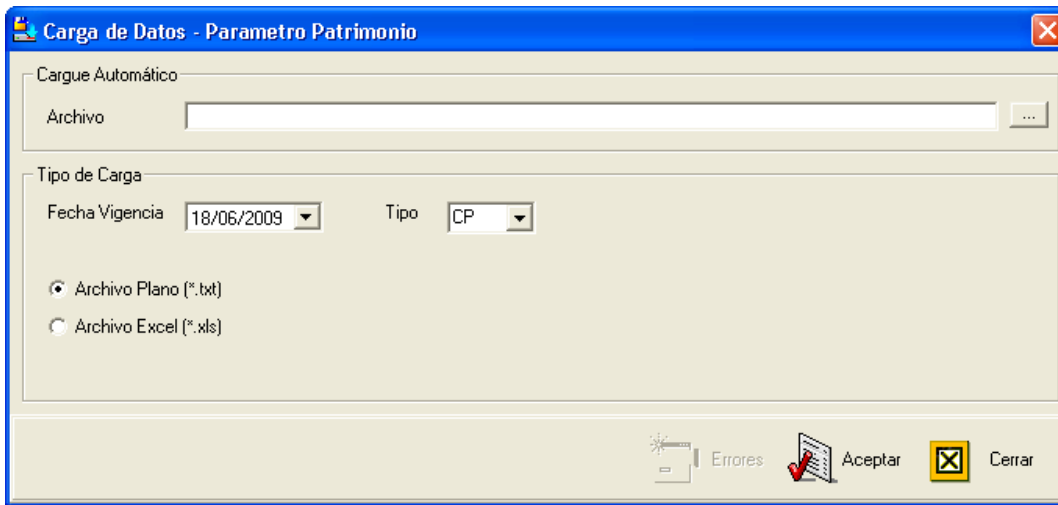
1.2.2.4. BUSCAR PARAMETRO PATRIMONIO TECNICO



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.



1.2.3. PARAMETROS APNR

Super Valores	Fecha Vigencia	Cuenta	Descripcion	Ponderacion	Signo
	18/05/2005	1	ACTIVO	0	+
	18/05/2005	11	DISPONIBLE	0	+
	18/05/2005	12	INVERSIONES Y DERIVADOS	0	+
	18/05/2005	13	DEUDORES	0	+
	18/05/2005	19	VALORIZACIONES	0	+
	18/05/2005	1105	CAJA	0	+
	18/05/2005	1110	BANCOS	0	+
	18/05/2005	1115	REMESAS EN TRANSITO	0	+
	18/05/2005	1120	CUENTAS DE AHORRO	0	+
	18/05/2005	1125	PARTICIPACION EN FONDOS A LA VISTA	0	+

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

The screenshot shows a dialog box titled "APNR - Ingresar". It has a blue title bar with a close button. The main area contains several input fields: "Fecha Vigencia" with a dropdown menu showing "18/06/2009", "Cuenta" (empty text box), "Descripcion" (empty text box), "Ponderacion" (empty text box), and "Signo" (dropdown menu). At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

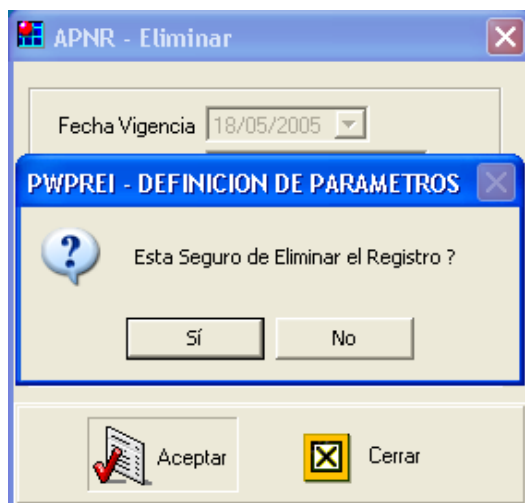
1.2.3.2. MODIFICACION PARAMETROS APNR.

The screenshot shows a dialog box titled "APNR - Modificar". It has a blue title bar with a close button. The main area contains several input fields: "Fecha Vigencia" with a dropdown menu showing "18/05/2005", "Cuenta" with the value "1", "Descripcion" with the value "ACTIVO", "Ponderacion" with the value "0", and "Signo" with the value "+". At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

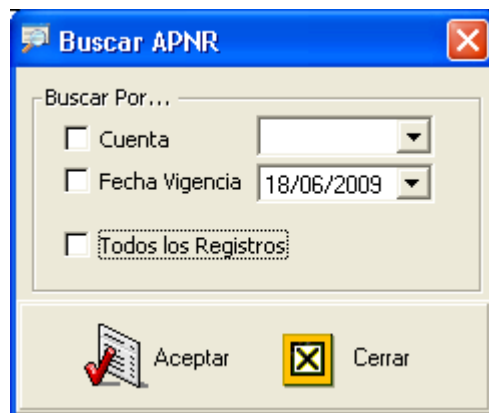
Para modificar un registro puede hacer doble clic sobre el registro en la grilla o seleccionando el icono en la parte superior. El sistema solo le permite modificar la Descripción de la cuenta, la ponderación y el signo. En caso de necesitar cambiar la cuenta debe eliminar el registro.

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.



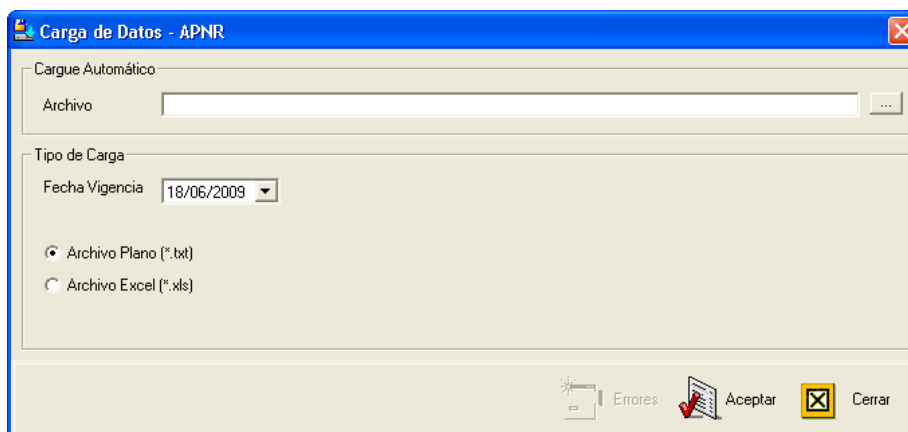
1.2.3.4. BUSCAR PARAMETROS APNR.



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.



1.2.4. RELACION DE FACTORES

Super Valores	Fecha Vigencia	Tipo Emisor	Mercado	Tasa	Moneda	Tipo Inversión	Factor Tasa	Factor Moneda
	18/06/2009	NACION	RF	DTF		272 NEGOCIABLE	Tasa Credito Consu	FCO - RENTABILIDAD

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 - Modificar

Ingresar Datos

Fecha Vigencia: 18/05/2005

Tipo Emisor: NACION

Mercado: RF

Tasa: DTF

Moneda: 272

Tipo Inversión: NEGOCIABLE

Factor Tasa: Tasa Credito Consumo

Variación a Aplicar: NINGUNO

Factor Moneda: FCO - RENTABILIDA

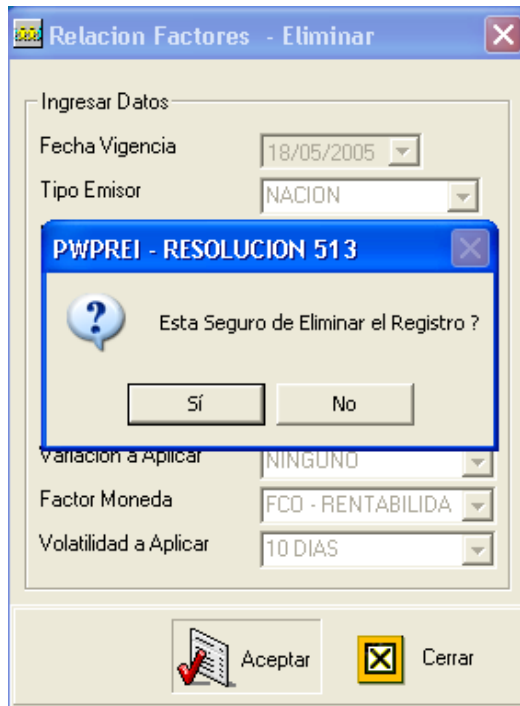
Volatilidad a Aplicar: 10 DIAS

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

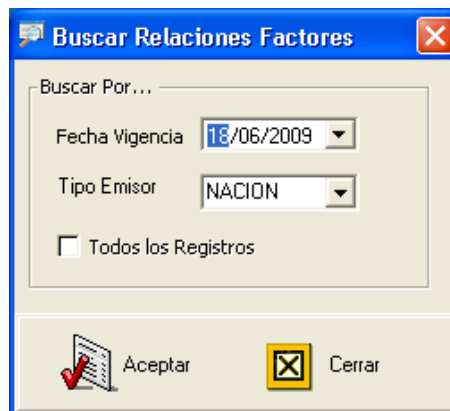
el Factor tasa, la Variación a Aplicar, el Factor moneda, o la volatilidad a Aplicar, el cambiar cualquiera de los otros datos implica eliminar el registro.

1.2.4.3. ELIMINAR RELACION FACTORES



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

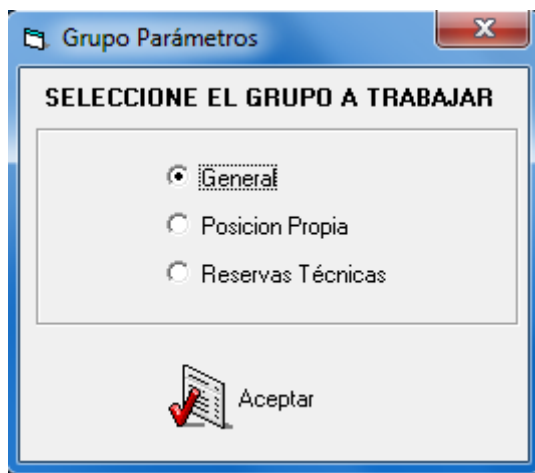
1.2.4.4. BUSCAR RELACION FACTORES



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 nacionales. Para establecerlos ingrese por "Definición de Parámetros – Súper Financiera – Parámetros Compromisos". Le aparece la siguiente pantalla:



General:

Super Valores	Tipo Compromiso	Punta	Posicion	PosicionLarga	PosicionCorta	ValorLarga	ValorCorta	FactorTasal	FactorMonedal
	CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacent	Descuento del Capit	Subyacente	Subyacente
	CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capit	Como el Subyacent	Subyacente	Ninguno
	CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacent	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 Subyacent	No Valora	Subyacente	Subyacente
	FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacent	No Valora	Subyacente	Subyacente
	FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacent	Subyacente	Subyacente
	FORWDIVISA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacent	No Valora	Ninguno	Subyacente
	FORWDIVISA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacent	Ninguno	Ninguno
	NINGUNO	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacent	No Valora	Subyacente	Subyacente
	NINGUNO	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno
	OPCFTRM	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacent	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 DE PARAMETROS - [Parametro Compromisos]

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

Super Financiera	Tipo Compromiso	Punta	Posicion	PosicionLarga	PosicionCorta	ValoraLarga	ValoraCorta	FactorTasaL	FactorMonedal	FactorTasaC	FactorMonedaC
	CALLSB	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CALLSB	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	CALLST	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CALLST	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno
	CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Subyacente	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	N	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	CONTADOMAS	VENTA	CORTA	N	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	FONIDEO	COMPRA	CORTA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FONIDEO	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	FORWIDIVISA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	FORWIDIVISA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	FUTUROA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROD	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROD	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROT	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROT	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROW	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	FUTUROW	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	NINGUNO	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	NINGUNO	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	OPOFIRM	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	OPOFIRM	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	PLAZOEPEC	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	PLAZOEPEC	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
	PUTSB	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	PUTSB	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	PUTST	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
	PUTST	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	REPO	COMPRA	CORTA	NO	SI	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
	REPO	VENTA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	SIMULINTRA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	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 Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
	SIMULTANEA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	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.

Tipo Compromiso	Punta	Posicion	PosicionLarga	PosicionCorta	ValoraLarga	ValoraCorta	FactorTasaL	FactorMonedal	FactorTasaC	FactorMonedaC
CALLSB	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CALLSB	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
CALLST	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CALLST	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
CARRUSEL	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Subyacente	Subyacente	Subyacente	Ninguno
CARRUSEL	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Subyacente	Ninguno	Subyacente	Subyacente
CONTADOMAS	COMPRA	LARGA	SI	N	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
CONTADOMAS	VENTA	CORTA	N	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
FONIDEO	COMPRA	CORTA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FONIDEO	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWARD	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWARD	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWIDIVISA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
FORWIDIVISA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
FUTUROA	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROA	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROD	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROD	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROT	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROT	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROW	COMPRA	LARGA	SI	SI	Como el Subyacenti	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
FUTUROW	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
NINGUNO	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
NINGUNO	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
OPOFIRM	COMPRA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
OPOFIRM	VENTA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PLAZOEPEC	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
PLAZOEPEC	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	Como el Subyacenti	Ninguno	Ninguno	Subyacente	Subyacente
PUTSB	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PUTSB	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
PUTST	COMPRA	CORTA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Subyacente
PUTST	VENTA	LARGA	SI	SI	Descuento del Capil	Descuento del Capil	Ninguno	Subyacente	Ninguno	Ninguno
REPO	COMPRA	CORTA	NO	SI	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno
REPO	VENTA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
SIMULINTRA	COMPRA	LARGA	SI	NO	Como el Subyacenti	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 Subyacenti	No Valora	Subyacente	Subyacente	Ninguno	Ninguno
SIMULTANEA	VENTA	CORTA	NO	SI	No Valora	No Valora	Ninguno	Ninguno	Ninguno	Ninguno

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.

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 Moneda Larga: Factor moneda que se debe aplicar en la posición larga

Factor Tasa Corta: Factor tasa que se debe aplicar en la posición corta.

Factor Moneda Corta: Factor moneda 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.

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.

1.2.5.4. BUSCAR COMPROMISOS



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 General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

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

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

1.2.6.1. INGRESO PARAMETRO RIESGO DE CREDITO.

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

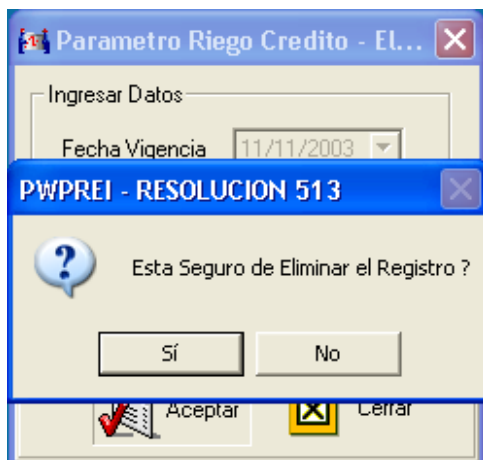
Tipo de Emisor: Nación, No nación

Ponderador: Ponderador

1.2.6.2. MODIFICACION PARAMETRO RIESGO DE CREDITO

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

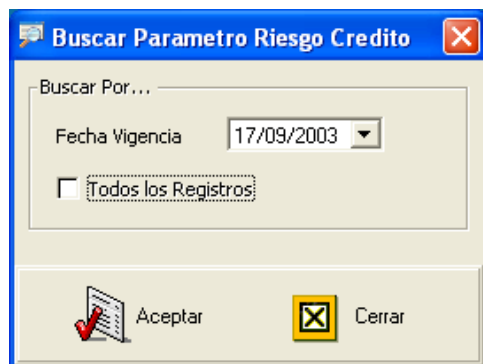
1.2.6.3. ELIMINAR PARAMETRO RIESGO CREDITO.



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.



1.2.7. PARAMETRO INFORME SUPERVALORES.

FechaVigencia	RenGlon	Descripcion
01/08/2003	1	IN - EMITIDAS POR LA
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
01/08/2003	9	IN - OTROS TITULOS
01/08/2003	10	IN - BURSATILES
01/08/2003	11	IN - NO BURSATILES - NO INCRITAS EN BOLSA
01/08/2003	12	DIVISAS
01/08/2003	13	COMPROMISOS
01/08/2003	14	OPERACIONES DE LIQUIDEZ
01/08/2003	999	VALOR EN RIESGO EN PESOS

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

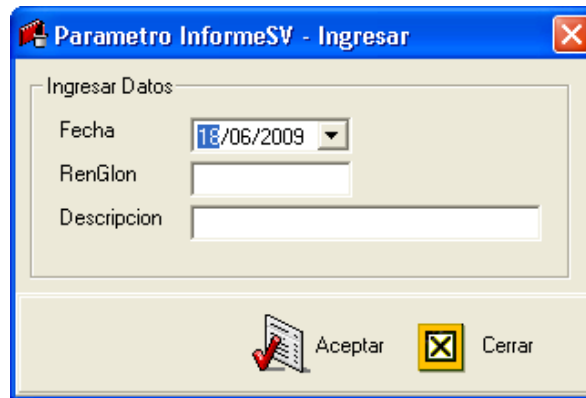
1.2.7.1. INGRESO PARAMETROS INFORME SUPERVALORES

Para ingresar información sobre Parámetro informe Supervalores digite:

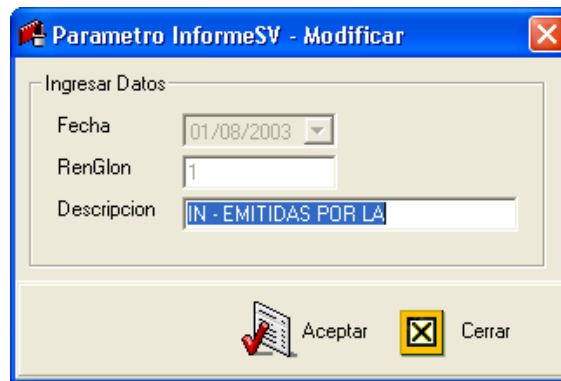
Fecha: En que ingresa el parámetro.

Reglón: 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.



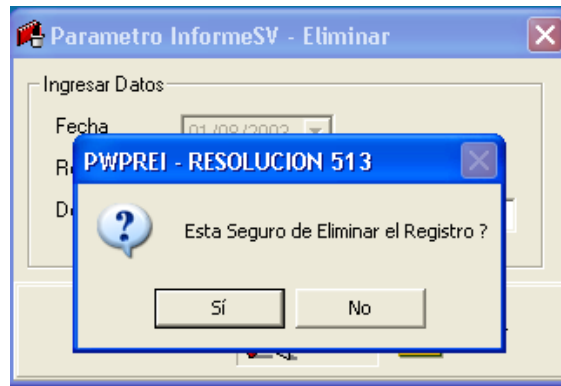
1.2.7.2. MODIFICACION PARAMETROS INFORME SUPERVALORES



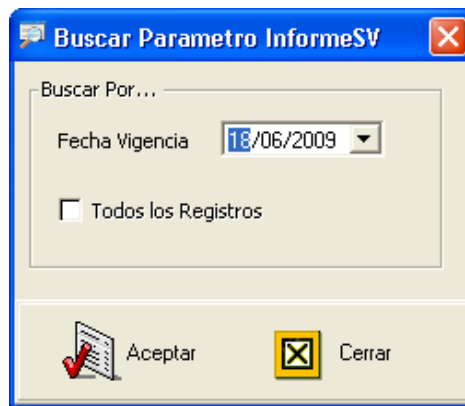
Para modificar los parámetros del Informe de la Supervalores, haga doble clic sobre el registro seleccionado, o escoja el botón de Modificar ubicado en la parte superior, solo se permite modificar la descripción, en caso de necesitar modificar otro dato debe eliminar el registro.

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.

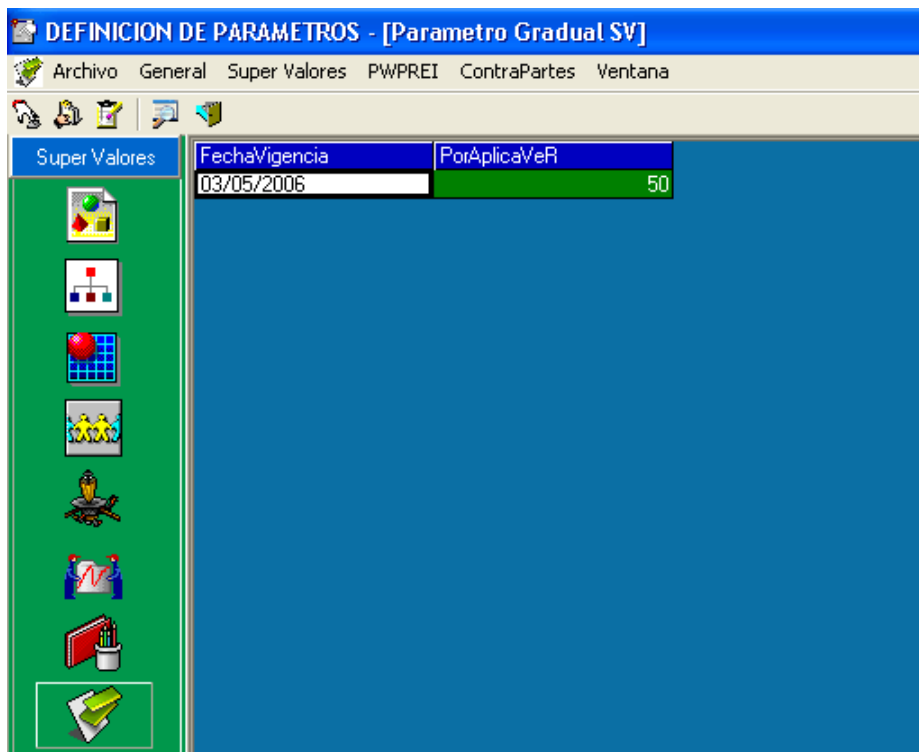


1.2.7.4. BUSCAR PARAMETROS INFORME SUPERVALORES



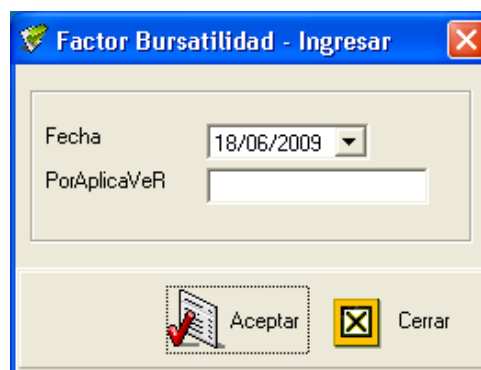
Para consultar información sobre los parámetros del informe Supervalores, lo puede realizar haciendo clic en todos los registros o por fecha de vigencia.

1.2.8. PARAMETRO GRADUALIDAD SUPERVALORES.



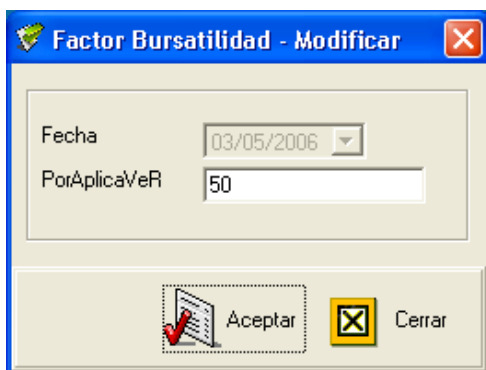
Establece los porcentajes a aplicar del VeR según la gradualidad definida por la Supervalores.

1.2.8.1. INGRESO GRADUALIDAD SUPERVALORES.



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

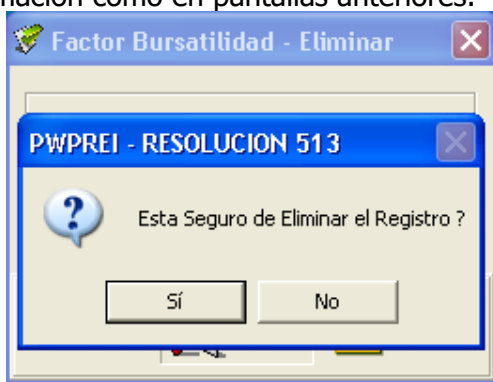
1.2.8.2. MODIFICACION GRADUALIDAD SUPERVALORES.



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.



1.2.8.4. BUSCAR GRADUALIDAD SUPERVALORES.



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.

FechaVigencia	Bursatilidad	Multiplicador
05/08/2007	NO INSCRIT	4.7
05/08/2007	MINIMA	1.2

1.2.9.1. INGRESO FACTOR BURSATILIDAD

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.

The image shows a Windows-style dialog box titled "Factor Bursatilidad - Modificar". It has a "Cerrar" button in the top right corner. The main area is labeled "Ingresar Datos" and contains three input fields: "Fecha" with a dropdown menu showing "05/08/2007", "Bursatilidad" with a dropdown menu showing "NO INSCRITA EN BOLSA", and "Multiplicador" with a text box containing "4.7". At the bottom of the dialog, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

1.2.9.3. ELIMINAR FACTOR BURSATILIDAD

The image shows a Windows-style dialog box titled "Factor Bursatilidad - Eliminar". It has a "Cerrar" button in the top right corner. The main area is labeled "Ingresar Datos" and contains a confirmation message: "PWPREI - RESOLUCION 513" and "Esta Seguro de Eliminar el Registro?". Below the message are two buttons: "Sí" and "No".

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

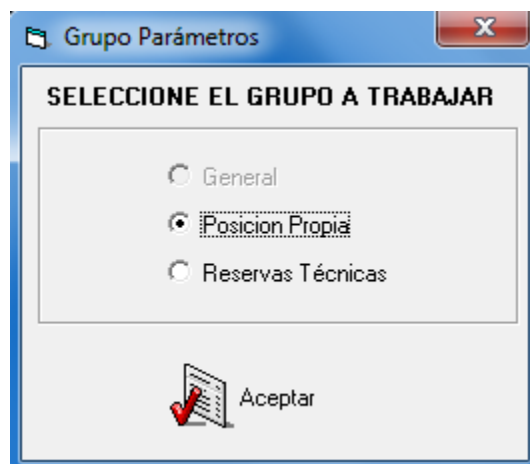
1.2.9.4. BUSCAR FACTOR BURSATILIDAD



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

Super Valores	FechaVigenc	Zona	Banda	Límite Inferik	Límite Super	Moneda	Val. Factor
	01/01/2003	1	1	0	0.08	COP	221
	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
	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	COP	221
	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	EXT	100
	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	TRM	100
	01/01/2003	1	3	0.25	0.5	UVR	221
	01/01/2003	1	4	0.5	1	COP	221
	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
	01/01/2003	2	6	1.9	2.8	UVR	195
	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.

Fecha Vigenc	Zona	Banda	Limite Inferi	Limite 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: 18/06/2009

Zona: []

Banda: []

Dur. Inferior: []

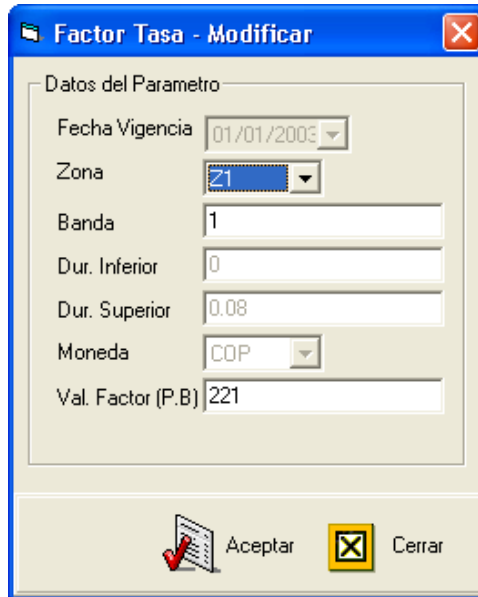
Dur. Superior: []

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 0

Dur. Superior 0.08

Moneda COP

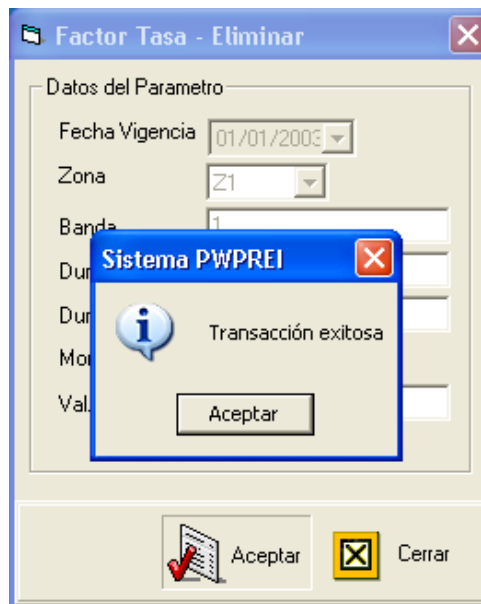
Val. Factor (P.B.) 221

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.



1.2.11. FACTOR RIESGO ACCIONES Y TASAS DE CAMBIO

DEFINICION DE PARAMETROS - [Form1]

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

Super Valores	FechaVigenc	Moneda	ValFac
	01/01/2003	ACC	14.7
	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

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 Moneda Acciones - Modif...

Fecha Vigencia 01/01/2003

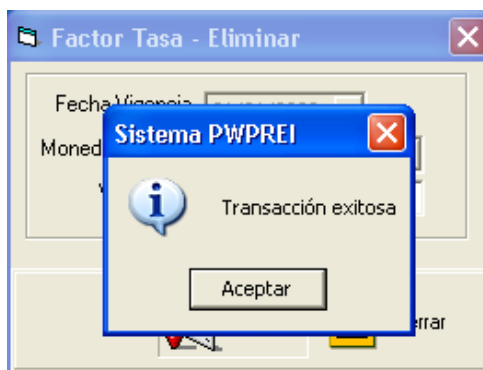
Moneda/Especie ACC

ValFac (%) 14.7

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
2. **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:

Código	ACF	Grupo Emisor	
Nombre	ACCION FIDUCIARIA	Calificadora	Otra
Nit	800155413	Calif. Corto	BRC 1+
Calificación	AAA	CIU	11111
Sector	FIN	Vinculado	NO
SubSector		Natural	SOCIEDADES PRIVADAS NACIONALES
Entidad	SUPER FINANCIERA	Tipo de Id.	NIT SOCIEDAD
Es Pagador	SI	Días Costbre	15

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 PAGADOR**

Código	FACTURA-PWP-PWCAB	Emisor	PWP	Pagador	PWCAB	Nemo Eqv R. Fija	
Descripción	Especie subordinada de FACTUF	Moneda	COP	ISIN1	0	ISIN2	0
Calificación		Indicador	RFC	Curva Anterior		Curva Nueva	
Estado	ACTIVO	Título	FACTURAS	Categoría	0	Grupo Calificación	0
FecMaxReinv	17/09/2003						

Superfinanciera

Código SF	FACT	Aval		Emisión		Fungible		Calificadora	Otra
-----------	------	------	--	---------	--	----------	--	--------------	------

Fecha		Emisión		Vencimiento	
		02/11/2016		02/11/2016	

Tasa	
Referencia	FS
Spread	0.000
Uso	ACTUAL

Flujo		Número de Flujos	
Día	Mes	Cantidad	Aplica
0	0	0	No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses	
Modalidad	NO APLICA
Periodicidad	NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión	
Modalidad	NO APLICA
Periodicidad	NO APLICA

Calculo	Descuento Tasa
Caja	Descuento Tasa
Calendario	CORRIDO
Tabla de Desarrollo	TIENE
Rendimiento	DESCUENTO
Comisión	VALOR
Datos Faciales	NO
Amortización	100.000
Retefuente > 5	0.000
Retefuente < 5	0.000
Clase Factor 1	
Clase Factor 2	
Portafolio Destino	

Aceptar
 Cerrar

Especies/Renta Fija - Modificar ESPECIE SIN PAGADOR

Código: FACALIA | Emisor: FACAJ | Pagador: NOPAG | Nemo Eqv R. Fija: FACALIA

Descripción: FACTURAS | Moneda: COP | ISIN1: | ISIN2: |

Calificación: 0 | Indicador: |

Estado: ACTIVO | Curva Anterior: | Curva Nueva: |

FecMaxReinv: 17/09/2003 | Título: FACTURAS | Categoría: | Grupo Calificación: |

Superfinanciera

Código SF: TDERECON | Aval: | Emisión: | Fungible: | Calificadora: 0

Fecha

Emisión: 02/11/2016 | Vencimiento: 02/11/2016

Tasa

Referencia: FS | Spread: 0.000 | Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 | Mes: 0 | Número de Flujos: Cantidad: 0 | Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA | Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA | Periodicidad: NO APLICA

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

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1: | Clase Factor 2: | Portafolio Destino: |

 Aceptar
  Cerrar

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

DEFINICION DE PARAMETROS

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

Súper Financiera Parámetros Provisiones Vencimientos en Mora

Fecha Vigencia 30/06/2016 Refrescar Cargar Exportar Eliminar Prvs Salir

FechaVigencia	DiasMoraHasta	CalCredito	PorProvision
30/06/2016	0	A	0
30/06/2016	5	B	1
30/06/2016	20	C	10
30/06/2016	60	D	50
30/06/2016	90	E	75
30/06/2016	999,999,999	F	100

Provisiones

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:

The screenshot shows the 'Renta Fija' form with the following data:

- Tipo de Operación:** Normal
- Datos Compromiso:** Fecha Registro: 01/07/2016, Fecha Oper: 01/07/2016, Fec Cumplimto: 01/07/2016, Punta: COMPR, Posición: LARGA, Nro. Negocio: CLI13296, Nro. de Orden: 0, Portafolio: CLIMAR1, Hora Compra: 17:01:23
- Emisor:** PWP SOFTWARE SA
- Pagador:** BCO. DE OCCIDENTE
- Especie:** FACTURA
- Depósito:** FISICO
- Tipo Inversión:** NEGOCIABLE
- Tipo Fw:** NDV
- Datos Faciales:** Emisión: 01/07/2016, Vencimiento: 01/07/2016, Tasa Nominal: 0.000, Completo-Cup-Ppal: COMPLETO, Modalidad Emisión: NO APLICA, NO /
- Valoración:** T. Efect.: 0.00, Precio: 0.00, Captación/Salida: 0.00

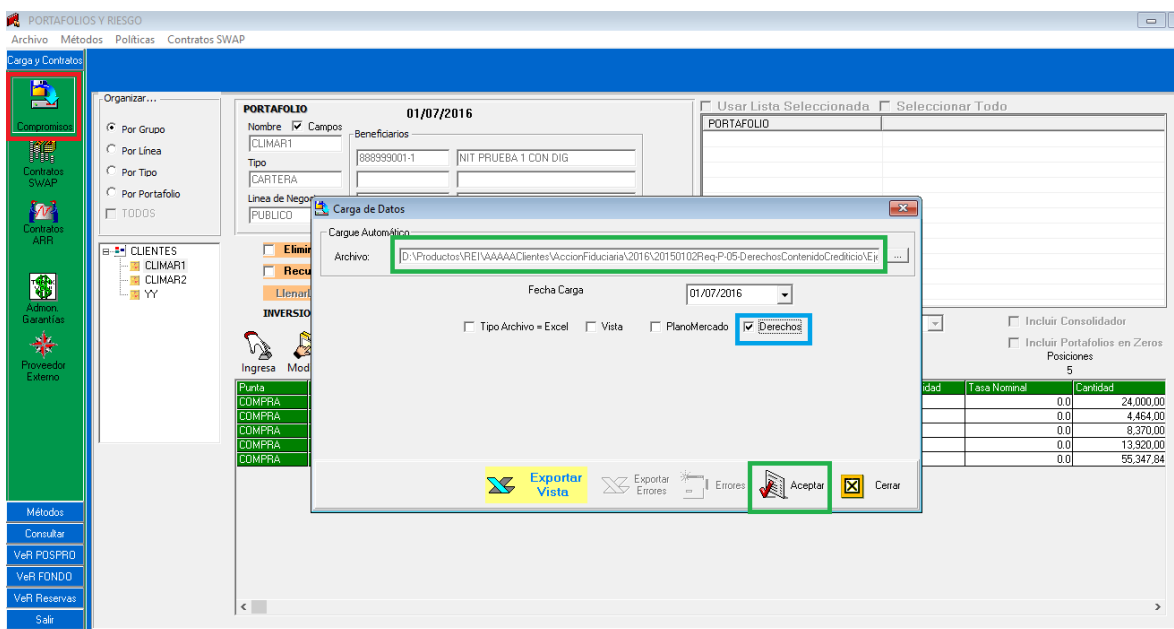
Una vez pasamos de la especie, esta es compuesta y creada por el sistema, como se ve en la pantalla:

The screenshot shows the 'Renta Fija' form with the following data:

- Tipo de Operación:** Normal
- Datos Compromiso:** Fecha Registro: 01/07/2016, Fecha Oper: 01/07/2016, Fec Cumplimto: 01/07/2016, Punta: COMPR, Posición: LARGA, Nro. Negocio: CLI13296, Nro. de Orden: 0, Portafolio: CLIMAR1, Hora Compra: 17:01:23
- Emisor:** PWP SOFTWARE SA
- Pagador:** BCO. DE OCCIDENTE
- Especie:** FACTURA-PWP-BOI
- Depósito:** FISICO
- Tipo Inversión:** NEGOCIABLE
- Tipo Fw:** ACCION FIDUCIARI
- Datos Faciales:** Emisión: 01/07/2016, Vencimiento: 01/08/2016, Tasa Nominal: 0.000, Completo-Cup-Ppal: COMPLETO, Modalidad Emisión: NO APLICA, NO /
- Valoración:** T. Efect.: 6.00, Precio: 99.0151089, Captación/Salida: 0.00
- Nominal Adquirido:** 2,000,000.0
- Costo Adquisición:** 1,980,302.18
- Nominal Derechos:** 2,000,000.0
- Trader:** TRADER1
- Fec. Compromiso:** 01/09/2016
- Orden CPR:** FINAL
- C.C. Banco:** 0

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:



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:

The screenshot shows a window titled 'Cumplimientos' with a table of data. The table has the following columns: 'ene', 'PagoCapHoy', 'Saldo', 'TasaMora', 'DiasMora', 'InteresMora', 'ProvisionViene', 'ProvisionHoy', 'ProvisionAcu', and 'Provisionar'. The data rows show values for these fields, with the first row highlighted in blue. Below the table, there is a control panel with a date selector set to '30/06/2016', a 'Periodo' checkbox, a 'Sel. Provisiones' checkbox (highlighted with a red box), and a set of radio buttons for selection: 'XCumpli', 'Vencidos', 'SIProvisión', 'NOProvisión', 'DESProvisión', 'Cumplidos', and 'Todos'. The 'Vencidos', 'SIProvisión', and 'DESProvisión' options are highlighted with a blue box. Below the radio buttons are three buttons: 'Actualizar', 'Informe', and 'Cerrar'.

ene	PagoCapHoy	Saldo	TasaMora	DiasMora	InteresMora	ProvisionViene	ProvisionHoy	ProvisionAcu	Provisionar
0	0	7000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0	7000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0	7000000	15	2	0	0	0	0	SI
0	0	7000000	15	2	0	0	0	0	SI
00	0	120000000	15	2	0	0	0	0	SI
00	0	120000000	15	2	0	0	0	0	SI
00	0	120000000	15	2	0	0	0	0	SI
00	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):

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.

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

- o 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:
 - 1. **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+**
 - 2. **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-**

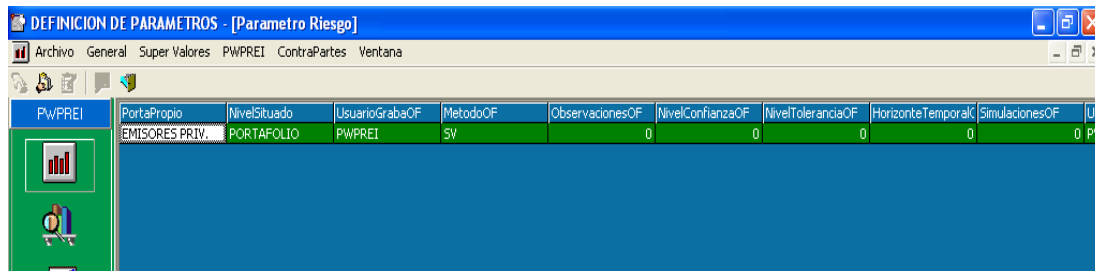
3. **RECAUDO.** En este evento, acerca de la provisión, debe indicar los movimientos a realizar para matar la provisión acumulada cuando ocurre el pago del saldo en mora. Note que difiere del anterior en que para este caso se trata de la ocurrencia del pago; por tanto ocurre en el recaudo. El evento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

1.4. OPCIÓN PWPREI



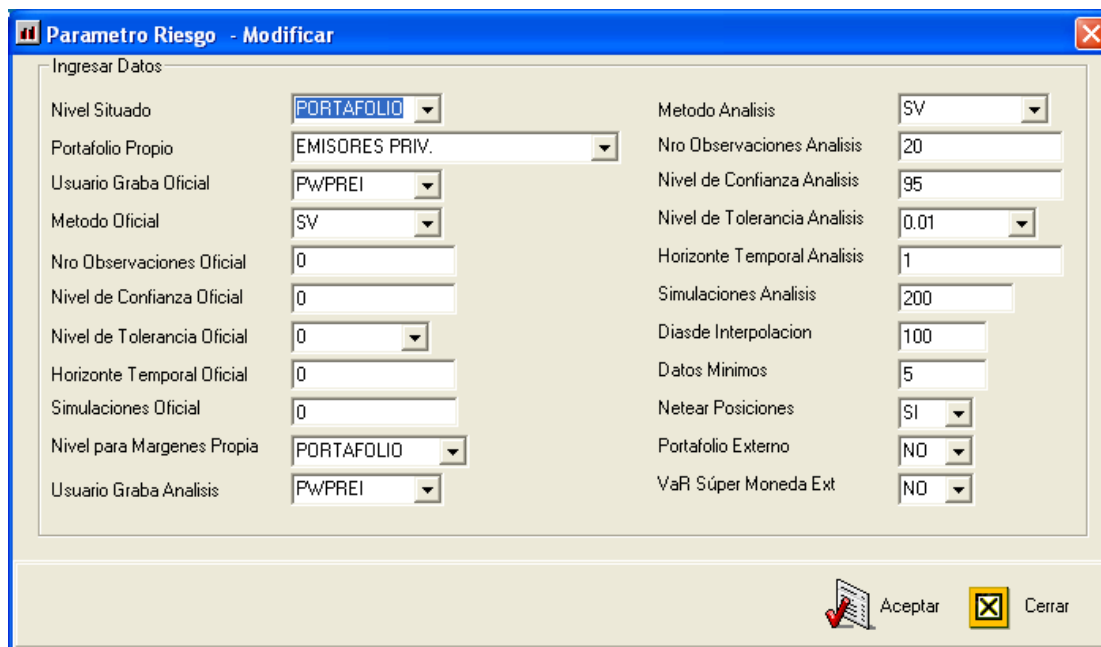
En este módulo se encuentran los parámetros necesarios tanto para la valoración del modelo oficial, como los modelos que escoja el usuario.

1.4.1. PARAMETRO RIESGO



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



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.

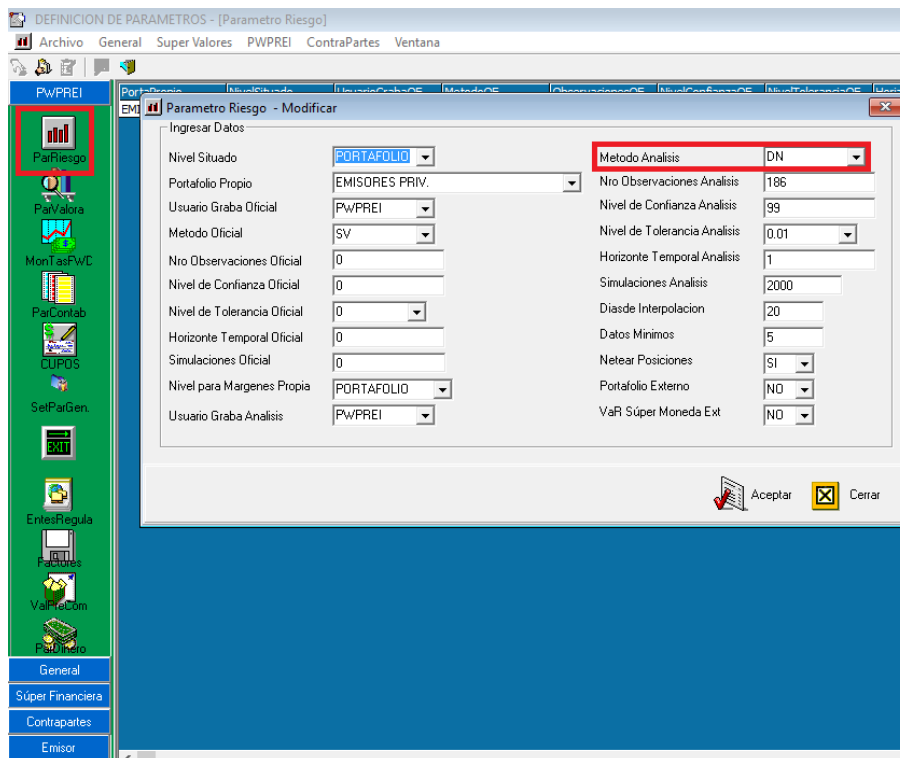
Para hacer lo anterior solicite a su área de tecnología que le configure el parámetro 8092, según las mediciones de qué métodos desea guardar, así:

- 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:



- 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

PWPREI	Nro Decimales Tasa	Nro Decimales Preci	Nro Decimales Nomi	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	

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: 8

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

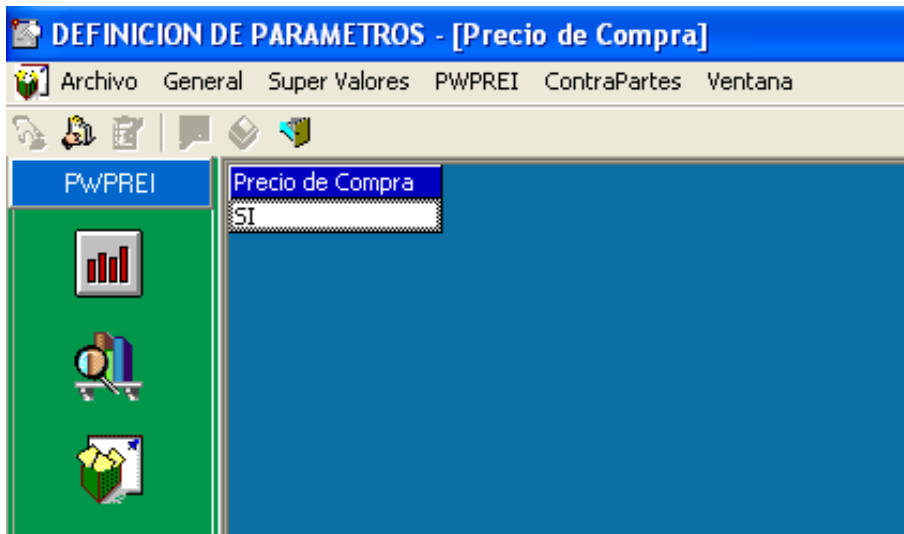
Aceptar Cerrar

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

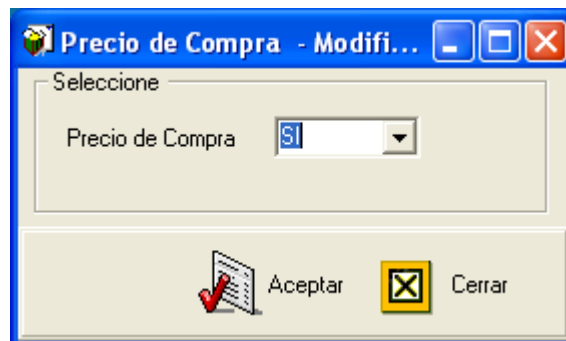
- en bolsa.
- El parámetro "Tipo de Valoración para OPCF" establece cómo se van a valorar estos contratos. Hay 2 formas posibles:
 - TRM, que indica que se valoren con el valor diario de la TRM.
 - Precio, que establece que se deben valorar con el precio publicado por la BVC para el vencimiento respectivo de cada contrato. Tenemos entendido que esta es la forma establecida por la SFC.
2. 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".
3. 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

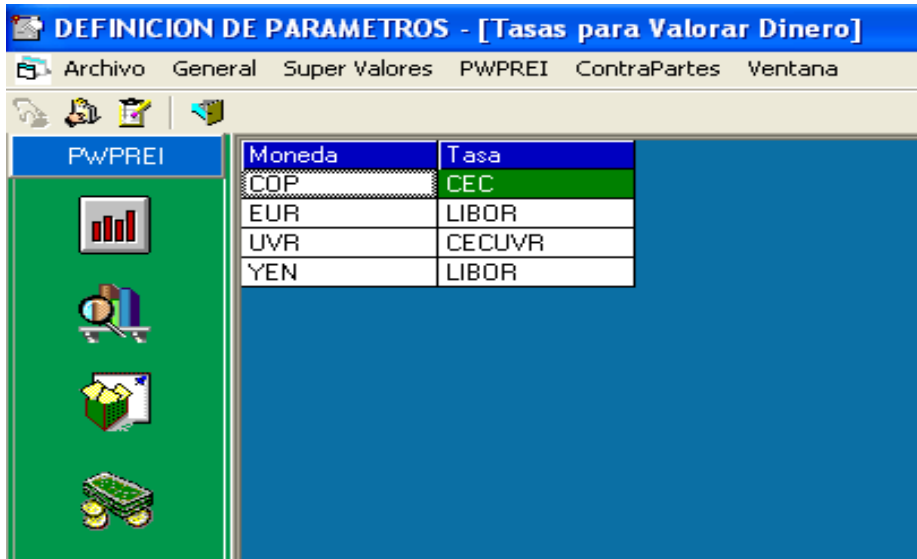


En esta opción se define si un título se debe valorar con el precio de compra del día que se adquirió o de lo contrario se valora con el precio de mercado. Contiene un solo registro y solo se puede modificar.

1.4.3.1. Modificación valorar a precio de compra



1.4.4. TASAS DE VALORAR DINERO

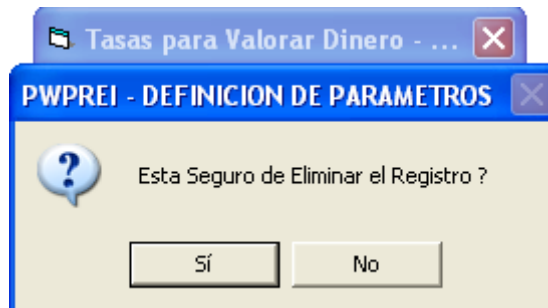


Se definen las tasas para valorar el Dinero

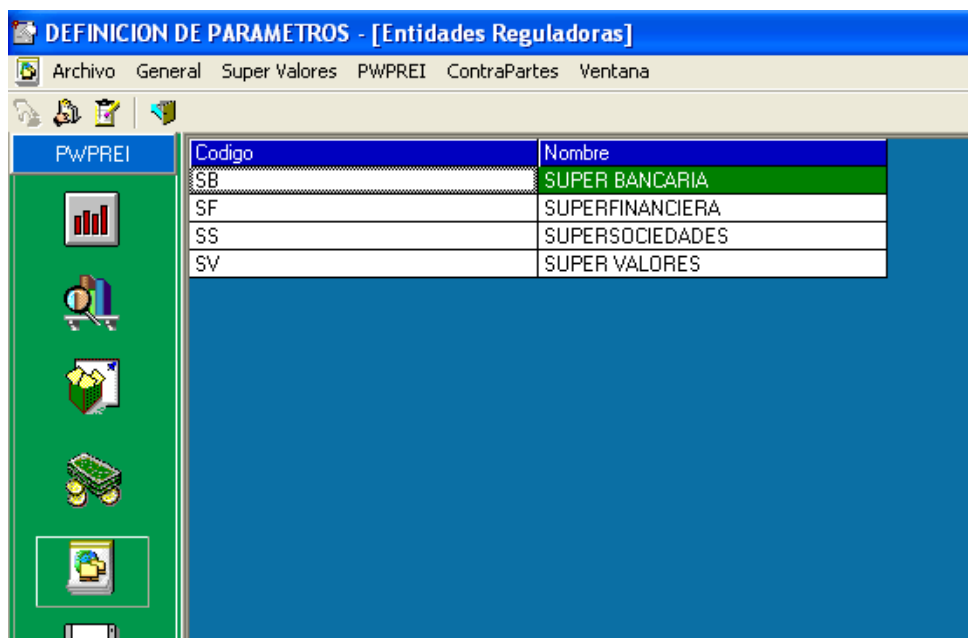
1.4.4.1. Modificación tasas de valorar dinero



1.4.4.2. Eliminar tasas de valorar dinero



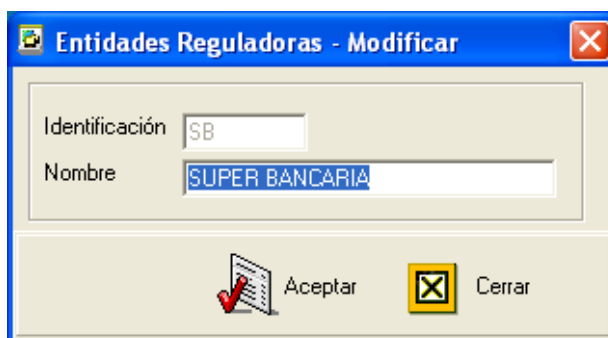
1.4.5. ENTIDADES REGULADORAS



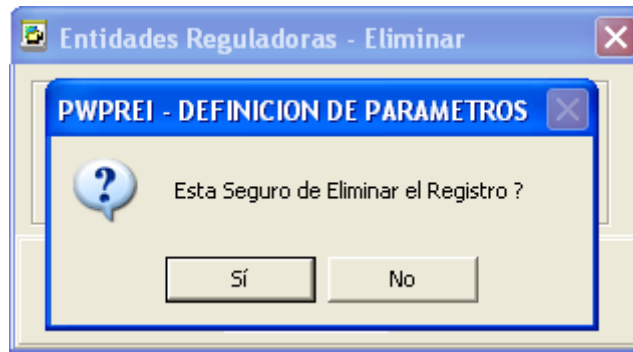
Esta opción permite registrar las entidades encargadas de vigilar el mercado, como pueden ser Supervalores, Superbancaria u otra que se requiera.

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.



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.

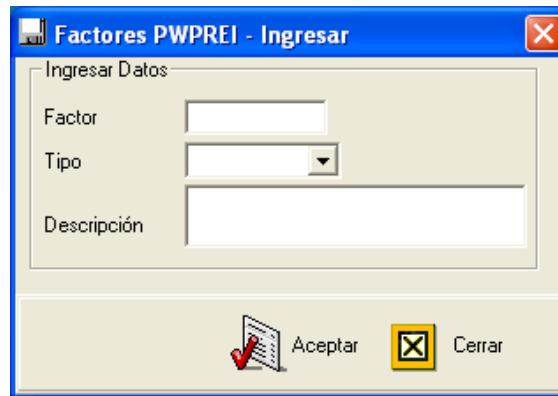
1.4.6. FACTORES DE RIESGO PWPREI

Nombre	Descripcion	Tipo Factor
EURO/TRM	FORWARDS	MONEDA
NINGUNO	NINGUN FACTOR DD	NINGUNO
PWP	PRUEBA	INDICE
TRM/EURO	FORWARDS	MONEDA

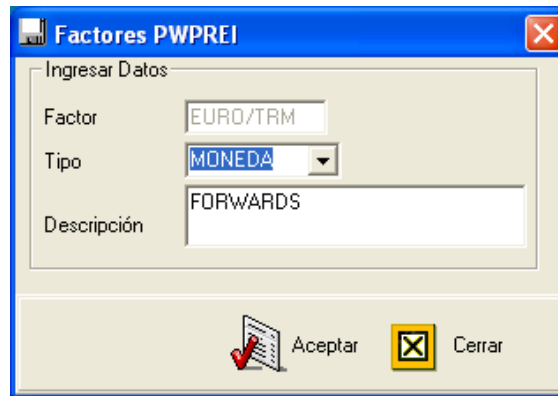
Se definen los Factores de Riesgo de PWPREI.

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.

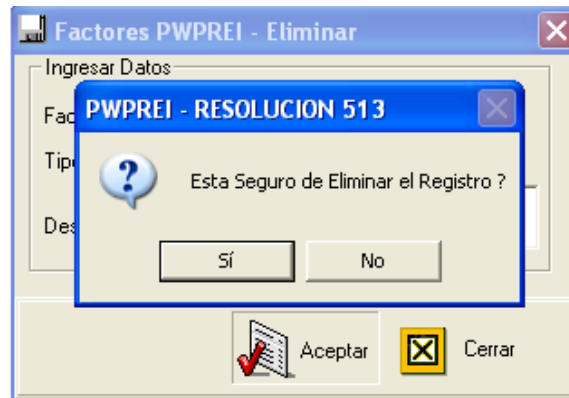


1.4.6.2. Modificación factores de riesgo PWPREI



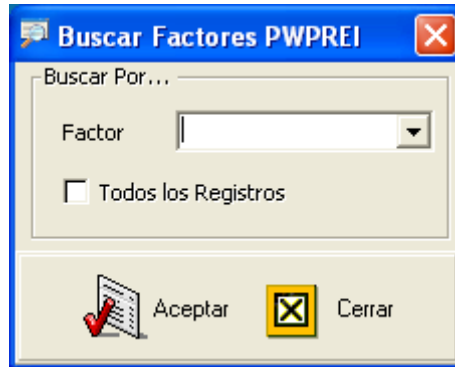
Haga clic sobre la casilla Tipo y escoja la opción, la casilla Descripción es la única que se puede modificar completamente.

1.4.6.3. Eliminar factores de riesgo PWPREI



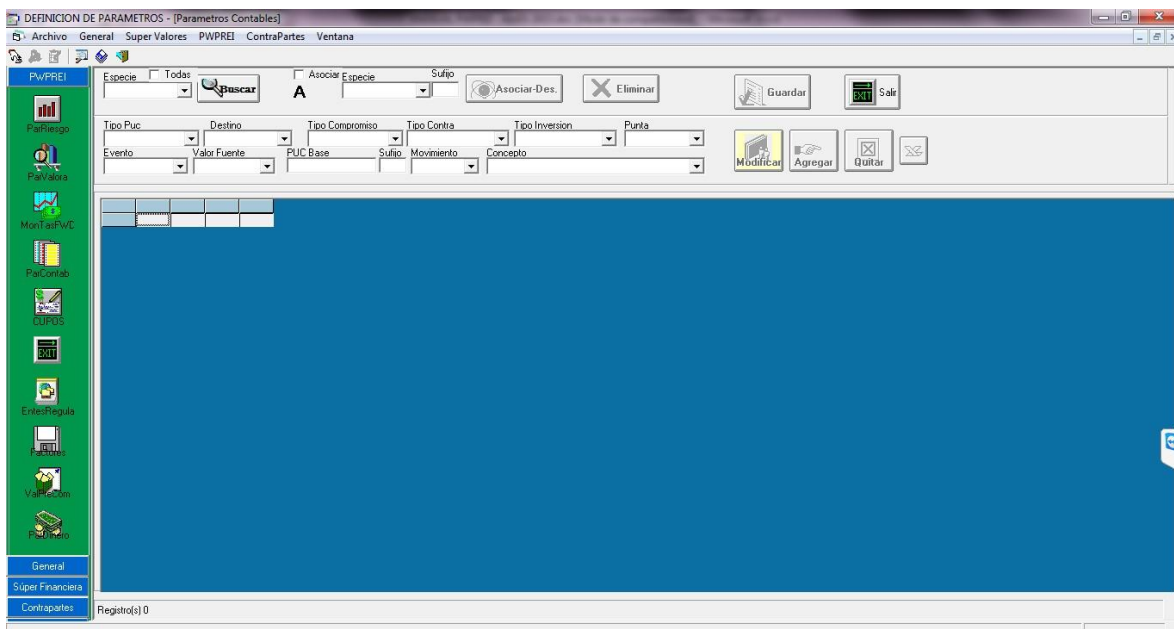
Para eliminar un registro escoja el ítem deseado y oprima la opción eliminar, el sistema le pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

1.4.6.4. Buscar factores de riesgo PWPREI

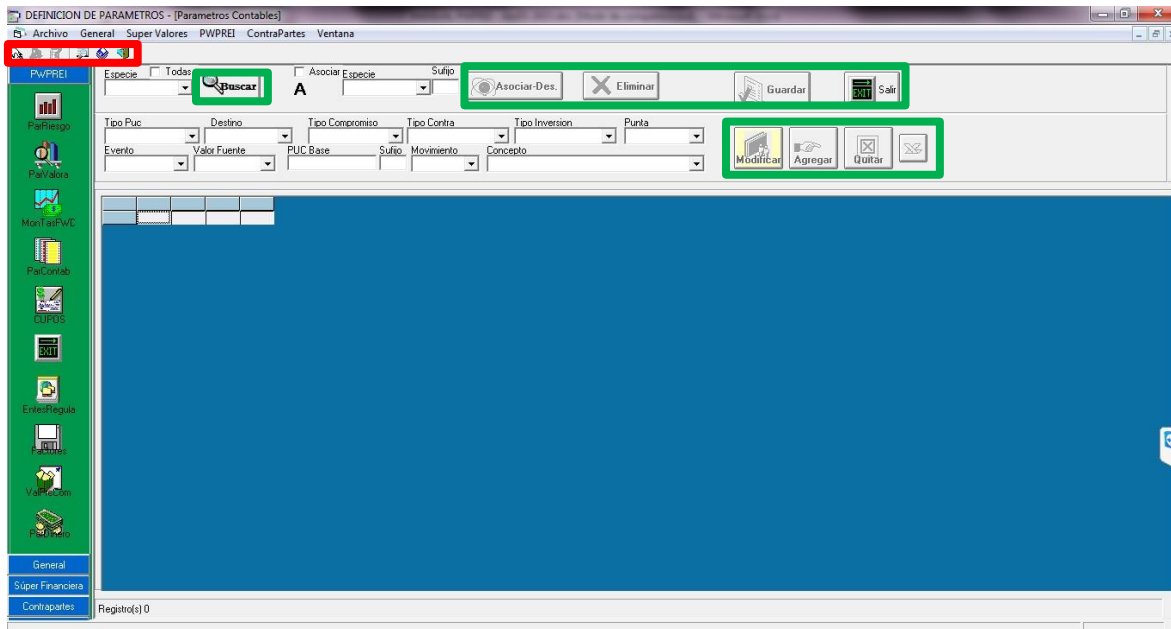


La consulta de información la puede realizar por la Fecha o señalando todos los registros.

1.4.7. PARAMETROS CONTABLES



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



1. 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 en la parte superior izquierda de la pantalla y pulse el botón "Buscar".
2. 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:

Espece: Todas | Buscar | A | Asociar | Espece | Suje | Disociar | Eliminar | Guardar | Salir

Tipo Puc: Destino: Tipo Compromiso: Tipo Contra: Tipo Inversion: Punta:

Evento: Valor Fuente: PUC Base: Suje: Movimiento: Concepto:

TipoPUC	Destino	TipoCompromiso	TipoContra	TipoInversion	Punta	Especie	Evento	ValorFuente	PUCBas	Suje	Movimiento	Concepto	CentroCosto
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13041801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81741501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13131801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81771501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13081801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81761501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDAX	34130501	01	CREDITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	13131801	01	CREDITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	81771501	02	CREDITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	83050001	02	CREDITO	18	1

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:

Espece: 8BC11063AV | Buscar | A | Asociar | Espece | Suje | Disociar | Eliminar | Guardar | Salir

Tipo Puc: Destino: Tipo Compromiso: Tipo Contra: Tipo Inversion: Punta:

Evento: Valor Fuente: PUC Base: Suje: Movimiento: Concepto:

TipoPUC	Destino	TipoCompromiso	TipoContra	TipoInversion	Punta	Especie	Evento	ValorFuente	PUCBas	Suje	Movimiento	Concepto	CentroCosto
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13041801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81741501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13131801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81771501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	13081801	01	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	16879501	07	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	81761501	02	CREDITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	CAPITAL	83050001	02	DEBITO	19	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	COMIS	51195001	01	DEBITO	13	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	IVACOM	25350001	33	DEBITO	12	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	VENCIAMIENTO	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	NEGOCIABLE	COMPRA	8BC11063AV	NEGOCIAR	PERDIDA	51250401	01	DEBITO	1	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	CUBRIR	PERDIDAX	34130501	01	CREDITO	31	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	13131801	01	CREDITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	16879501	07	DEBITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	81771501	02	CREDITO	18	1
FINANCIERO	PROPIO	NINGUNO	NA	PERMANENTE	COMPRA	8BC11063AV	VALORAR	RENDIS	83050001	02	CREDITO	18	1

Registro(s) 1088

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 así:

- 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:

FechaEvento	HoraEvento	Usuario	Estacion	EventoLg	TipoPUC	Destino	TipoCompro	TipoContra	TipoInverso	Punta	Especie	FechaEmiso	FechaVenon	Evento	ValorFuente
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENDIS
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENCPR
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	CUMPLIR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENDIS
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENCPR
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	CUMPLIR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENDIS
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENCPR
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	NEGOCIAR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABL	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	CUMPLIR	VALOPE
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SCP	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENDIS
2015-01-09	10:49:02	DAVID	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SCP	VENCIMIEN	PASIVA	88CI1069A	NA	NA	VALORAR	RENCPR

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

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

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: 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

Especie Nueva: DOLAR/PESO Sufijo: A Especie:

Asociar

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: 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

Especie Nueva: Sufijo: A Especie: COP/TRM

Asociar

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

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

2.1.4.7.4. NOTAS OPERATIVAS – CAUSACION LINEAL

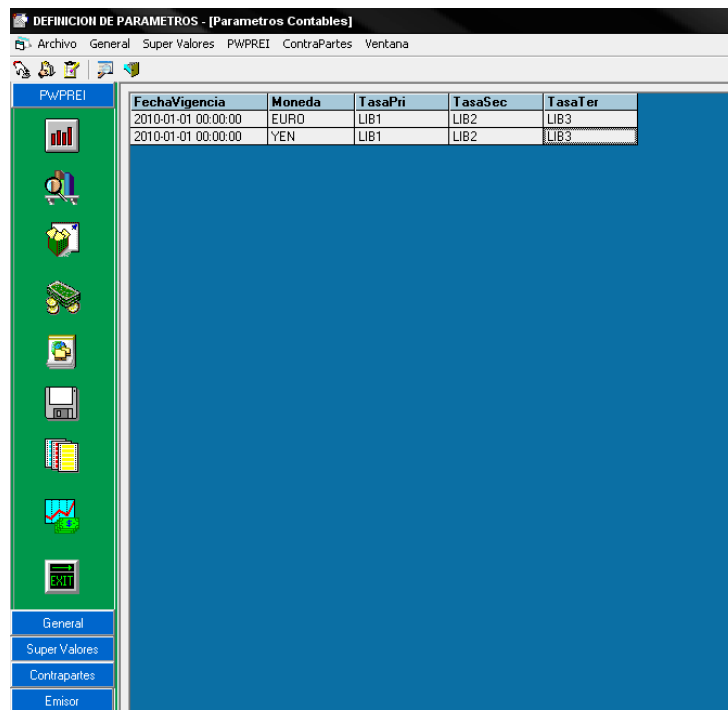
Para utilizar las funcionalidades de "Causación Lineal" en PWPREI, proceda por favor:

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



FechaVigencia	Moneda	TasaPri	TasaSec	TasaTer
2010-01-01 00:00:00	EURO	LIB1	LIB2	LIB3
2010-01-01 00:00:00	YEN	LIB1	LIB2	LIB3

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.

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



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

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.

1.4.9. CUPOS

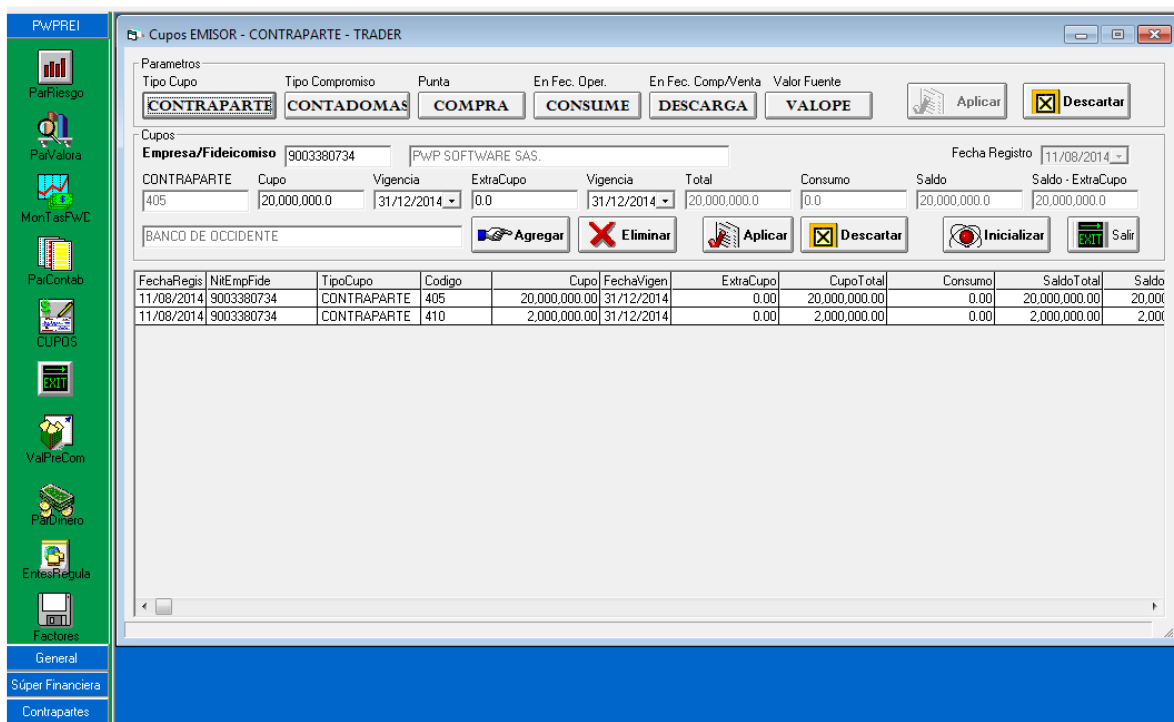
Con las funcionalidades que permiten el manejo de cupos de Emisor, Contraparte y Trader en PWPREI, se incluye la lista de parámetros que es posible establecer para que el sistema cargue y descargue los respectivos cupos. Los parámetros comprenden los conceptos que afectan los cupos y los factores que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



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:

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.

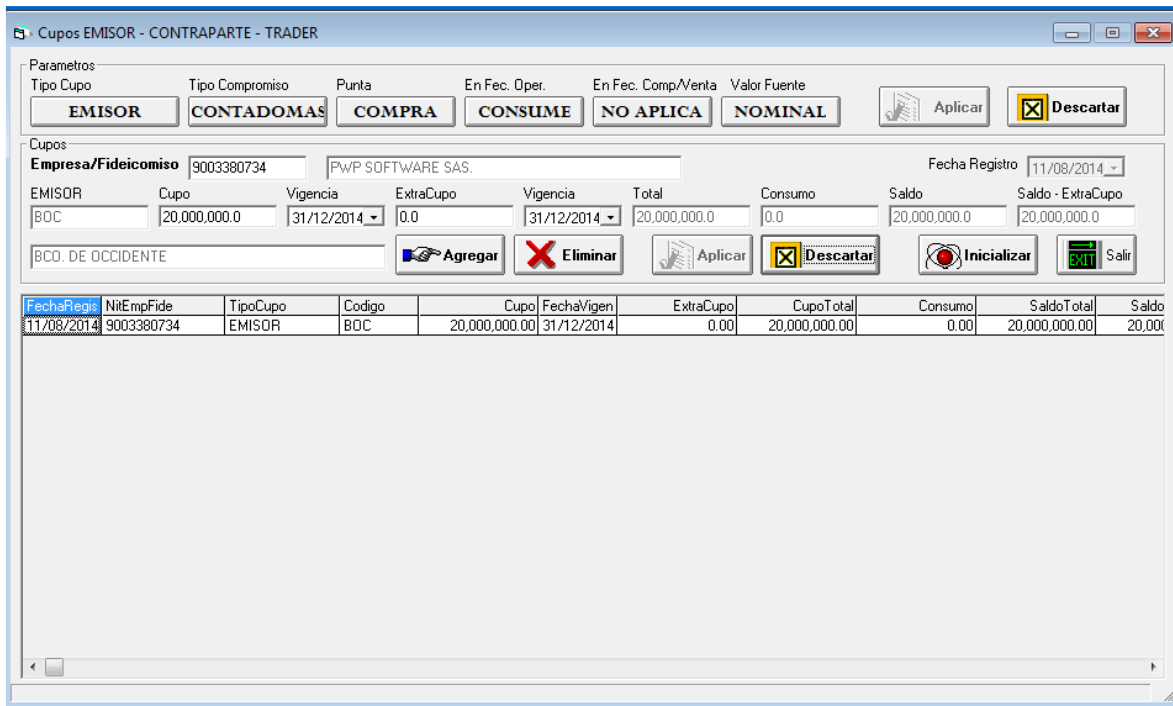
Como en el cuadro de la mitad siempre aparece el primer registro o el que usted haya seleccionado de la grilla inferior, cuando necesite agregar un nuevo cupo pulse prime Agregar y luego registre los datos y pulse Aplicar.

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:



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 decir, 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 amplíe 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 amplíe 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:

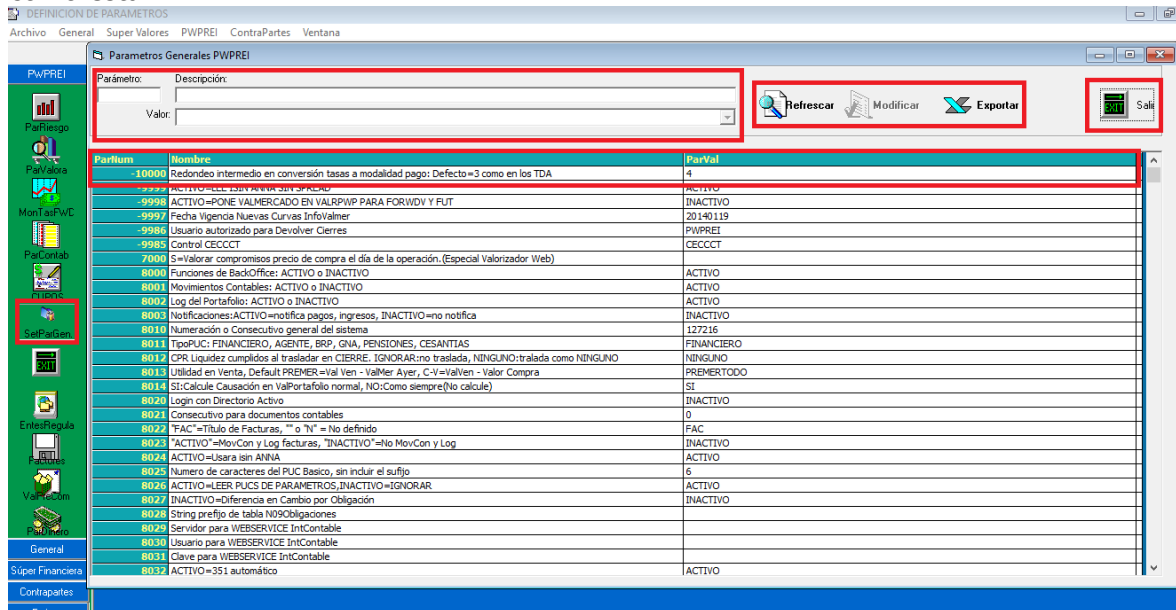
- Cuáles dejar visibles a los usuarios
- Cuáles de los visibles pueden ser modificados por los usuarios.

- 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.

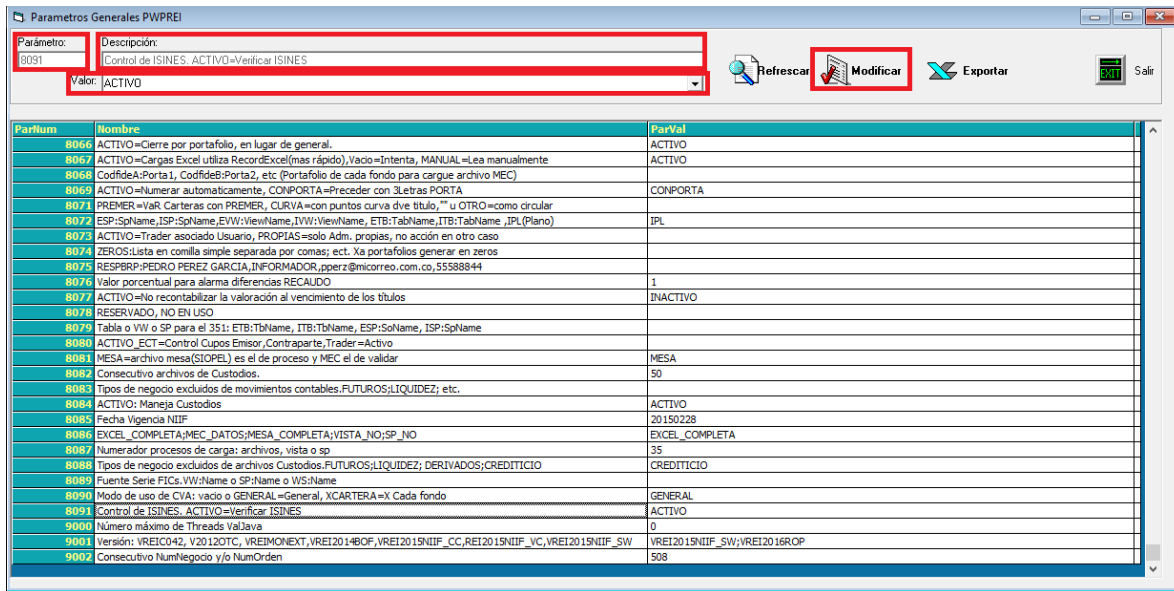
Ingrese por "Definición de Parámetros – PWPREI. Pulse "SetParGen". Verá una pantalla como esta:



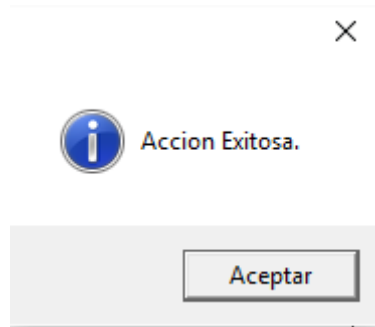
2. Modificar.

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:



- 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

DEFINICION DE PARAMETROS - [Contra Partes]

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

Contrapartes	Codigo Super	Nombre	Tipo Entidad	Codigo BVC	Codigo SEN	Codigo SET	Grupo Emp.	Cod. Contra.	Supervisado	Calidad Trib.	Direccion	Telefono	Ciudad	Email	Tipo de Ider	Nit	Tipo
	101	BOLSA DE VALORES D	NACION	101	0	0			SF	AUTORETE	CRA 7 No. 7	3139800	BOGOTA		NIT SOCIED	830085426	
	423	ACCION FIDUCIARIA	NACION	423	0	0			SF	AUTORETE	CALLE 85 N	6915030	BOGOTA		NIT SOCIED	800155413	
	22	ACCIONES DE COLOMBIA	NACION	0	0	CFI	0		SV	AUTORETE	Calle 80 No.	3318200	BOGOTA		NIT SOCIED	800073493	
	7	ACCIONES Y VALORES S	NACION	7	0	0	0		SF	AUTORETE	Carrera 16 N	5300310	BOGOTA		NIT SOCIED	850071562	
	606	ADM.CARTERAS COL.SU	NACION	606	0	0	0		SF	AUTORETE	CARRERA 1	2602100	MEDELLIN		NIT SOCIED	890903279	
	AEV	AEV	NACION	0	0	BCL	CORFVALL	1	SV	AUTORETE		1	1	1	NIT SOCIED	0	
	3	AFIN S.A.	NACION	3	0	0	0		SF	AUTORETE	CARRERA:	6372055	BOGOTA		NIT SOCIED	860051175	
	18	ALIANZA VALORES S.A.	NACION	18	0	0	0		SF	AUTORETE	AV. 15 No.	6447730	BOGOTA		NIT SOCIED	860000185	
	344	ALIANZA FIDUCIARIA S.A	NACION	344	0	0	0		SF	AUTORETE	Avenida 15	6447700	BOGOTA		NIT SOCIED	860531315	
	1	ASESORIAS EN VALORES	NACION	0	0	CLIA			SV	AUTORETE	Calle 72 No.	3122888	BOGOTA		NIT SOCIED	890931609	
	13	ASESORIAS E INVERSION	NO NACION	13	0	UNI			SF	AUTORETE	Cile 72 N 10	3138888	BOGOTA		NIT SOCIED	860079981	
	38	ASVALORES S.A.	NO NACION	38	0	BBV			SF	AUTORETE	CLL 10 No.	4853340	CALI		NIT SOCIED	890323905	
	AYV	AYV	NACION	0	0	BCL	CORFVALL	1	SV	AUTORETE		1	1	1	NIT SOCIED		
	447	BANCA DE INVERSION B.	NACION	447	0	0	0		SF	AUTORETE	Calle 30 A N	2891028	BOGOTA		NIT SOCIED	800235426	
	376	BIANCO AGRARIO	NACION	376	0	0	0		SF	AUTORETE	Carrera 8 No.	3821400	BOGOTA		NIT SOCIED	800037800	
	998	GRANPO AGRARIO	NACION	998	0	0	0		CE	AUTORETE	CARRERA 13A	9976601	BOGOTA		NIT SOCIED	820058077	

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

1.5.1.1. INGRESO CONTRAPARTES

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.

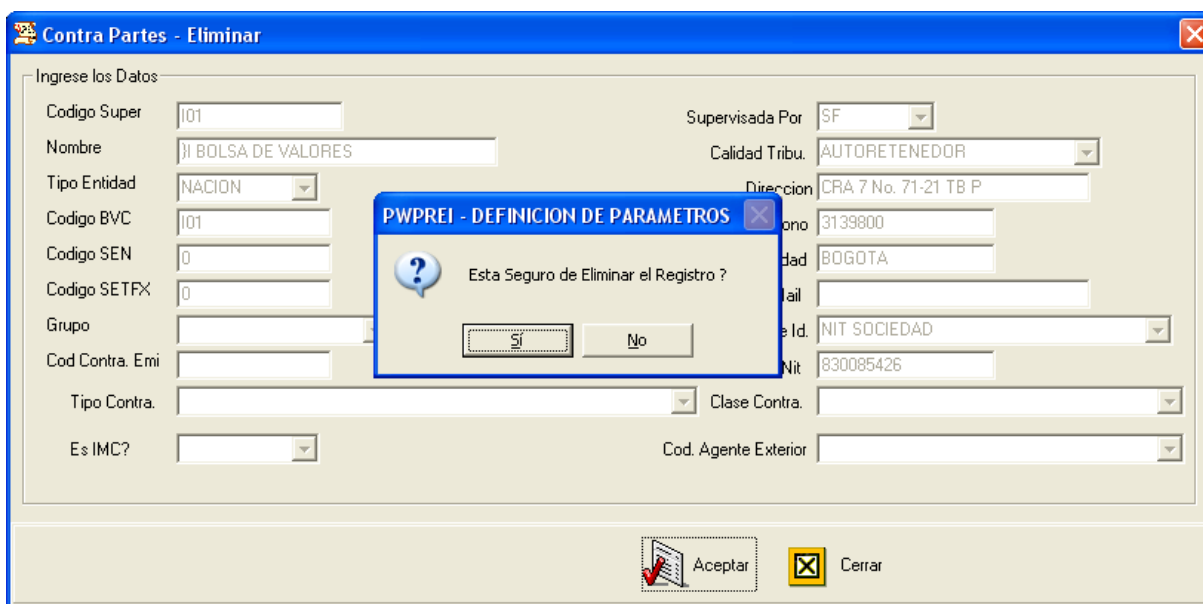
Código Agente del Exterior: Si la contraparte es una agente del exterior seleccione el código definido por la SFC para él.

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

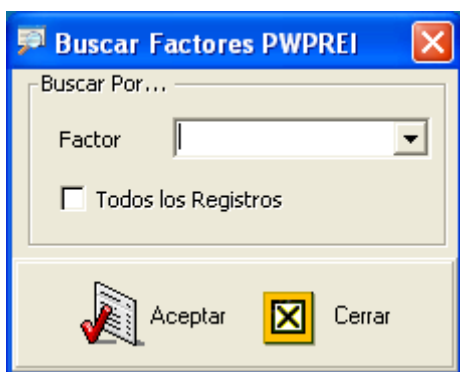
Para modificar haga doble clic sobre la grilla ó haga clic en el Icono ubicado en la parte superior, el campo código súper es el único que no se puede modificar.

1.5.1.3. ELIMINAR CONTRAPARTES



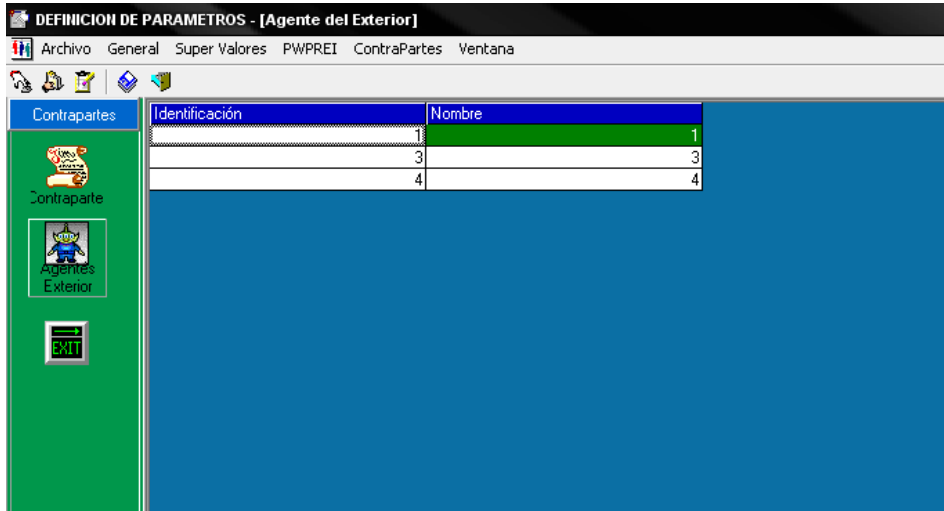
Para eliminar un registro haga clic en el botón ubicado en la parte superior, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

1.5.1.4. BUSCAR CONTRAPARTES

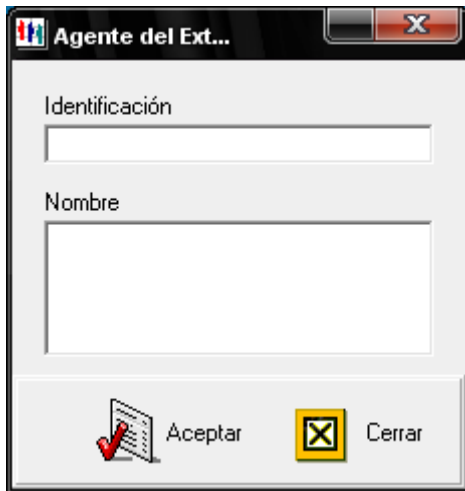


La información se puede consultar por el factor o dando clic en todos los registros.

1.5.2. AGENTES EXTERIOR



1.5.2.1. INGRESAR AGENTE EXTERIOR



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

1.5.2.2. MODIFICACION AGENTE EXTERIOR



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



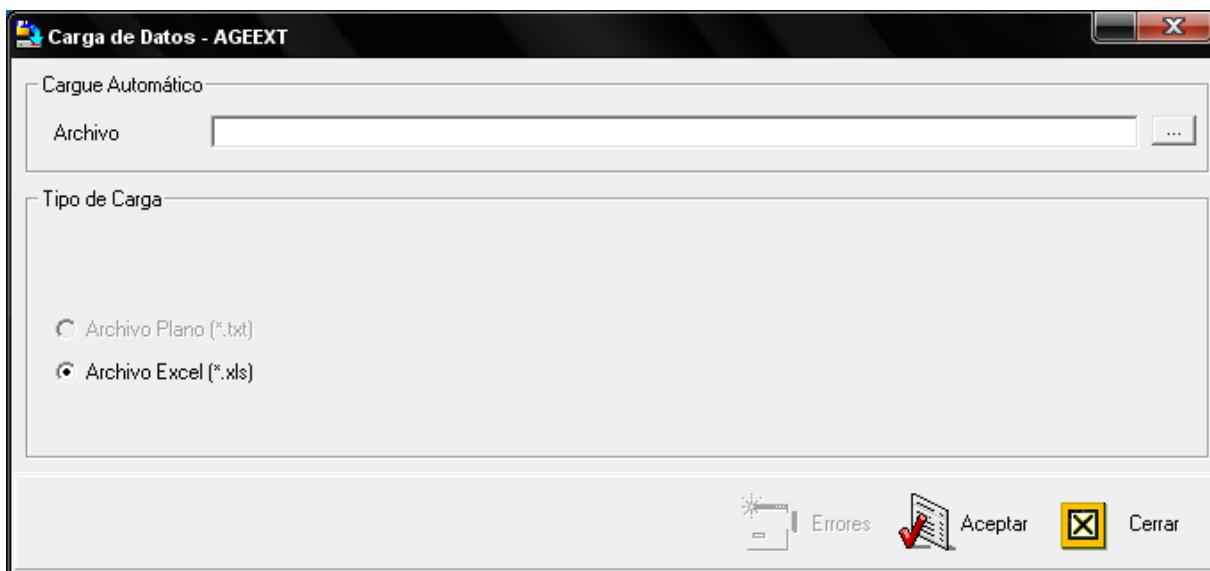
Para Eliminar un registro, debe seleccionar el registro y presionar el botón eliminar y luego presionar el botón aceptar

1.5.2.4. CARGA DE DATOS AGENTE EXTERIOR

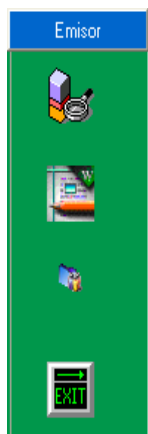
Para cargar agentes del exterior los pasos son:

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



1.6. OPCION EMISOR



Se definen los Emisores de los Títulos Valores

1.6.1. PONDERACION

Emisor	Fecha de Vigencia	Tipo	Grupo Calificación	Calificación	Ponderación
	01/04/2005	Categoría	10	NA	0
	01/04/2005	Categoría	58	NA	20
	01/04/2005	Categoría	59	NA	20
	01/04/2005	Categoría	60	NA	20
	01/04/2005	Categoría	70	NA	20
	01/04/2005	Categoría	90	NA	0

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.

Ponderación - Ingresar

Fecha de Vigencia: 30/06/2009

Tipo: []

Grupo Calificación: []

Calificación: []

Ponderación: []

Aceptar Cerrar

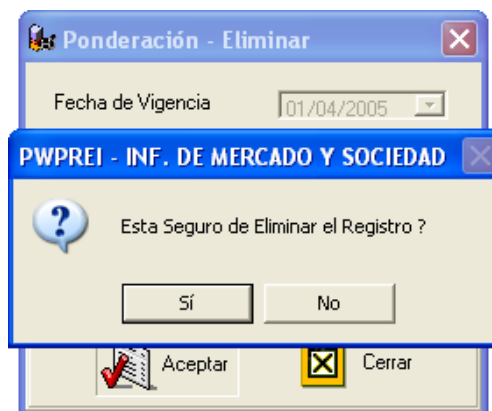
1.6.1.2. MODIFICACIÓN PONDERACIÓN



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

The screenshot shows a dialog box titled "Ponderación - Detalle". It contains the following fields and values:

Fecha de Vigencia	01/04/2005
Tipo	Categoria
Grupo Calificación	10
Calificación	NA
Ponderación	0

At the bottom right, there is a button labeled "Cerrar" with a close icon.

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

1.6.1.5. BUSCAR PONDERACIÓN

The screenshot shows a dialog box titled "Buscar Ponderación". It contains the following search criteria:

- Tipo
- Grupo Calificación
- Calificación
- Todos los Registros

At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" (with a checkmark icon) and "Cerrar" (with a close icon).

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

1.6.2. CUENTAS BANCARIAS

Cuenta	Emisor	Tipo
2222	PRUEBA CARLOS	Corriente
56536	PROTECCION S.A.	Corriente
111111	PRUEBA CASABOLSA	Corriente
132141	ABONOS COLOMBIANOS	Corriente
432423	GOBIERNO NACIONAL	Corriente
5345345	GOBIERNO NACIONAL	Ahorro

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

1.6.2.1. INGRESO CUENTAS BANCARIAS

Cuentas Bancarias - Ingresar

Cuenta:

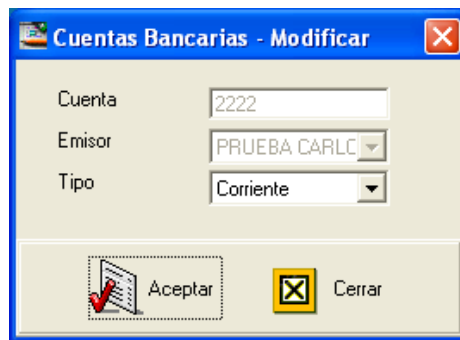
Emisor:

Tipo:

Aceptar Cerrar

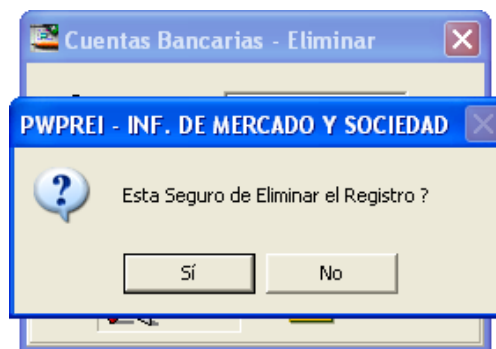
Para ingresar información de Cuentas Bancarias digite el número de la cuenta, la entidad a la cual pertenece y el tipo (corriente/ahorro).

1.6.2.2. MODIFICACION CUENTAS BANCARIAS



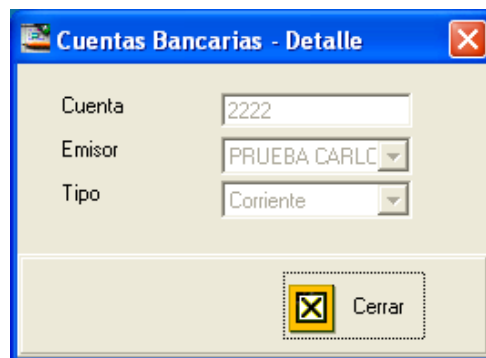
Solo puede modificar el Tipo de Cuenta (corriente/ahorro), en caso de requerir otro cambio, debe eliminar el registro.

1.6.2.3. ELIMINAR CUENTAS BANCARIAS



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



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

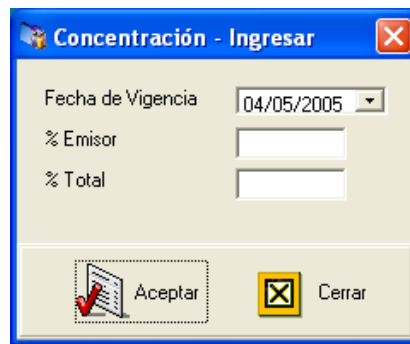
DEFINICION DE PARAMETROS - [Concentración]

Archivo General Super Valores PWPREI ContraPartes Ventana

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
	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



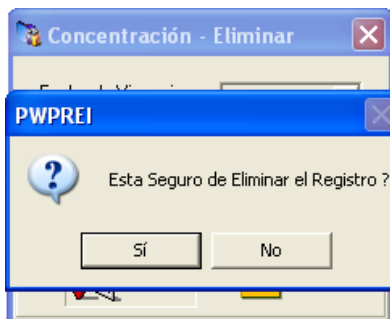
Ingrese la fecha de vigencia a partir de la cual se establecieron los porcentajes, el porcentaje por Emisor no debe exceder el 10% y el total de los riesgos de todos los emisores no debe exceder el 30%.

1.6.3.2. MODIFICACION CONCENTRACION



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

1.6.3.3. ELIMINAR CONCENTRACION



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

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

1.6.3.5. BUSCAR CONCENTRACION

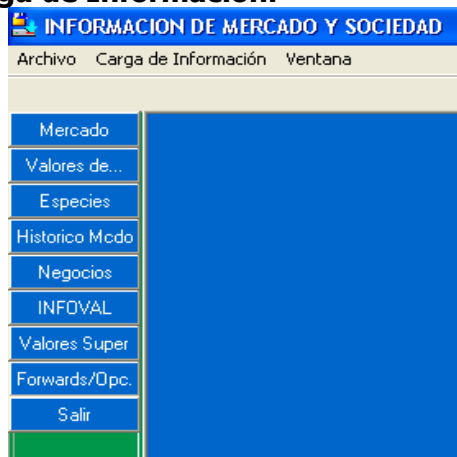
La información puede ser consultada por Fecha de Vigencia, % Emisor, % Total o escogiendo por todos los registros.

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**.

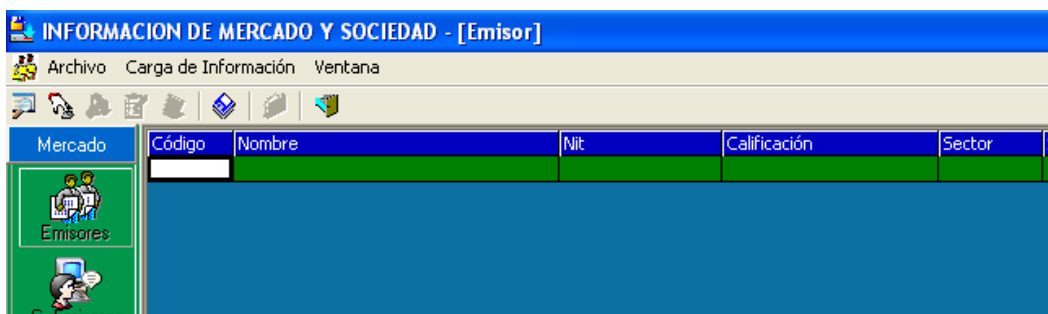


2.1. OPCIÓN MERCADO



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



Al dar clic en la opción de Emisores aparecerá la cuadrícula 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.

2.1.1.2. MODIFICACIÓN EMISORES

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

Mercado	Emisor	Especie	Moneda	Indicador	Estado	Código Súper	Tasa de Referencia	Spread	Modalidad	Fecha de Emisión	Fecha de
	ADMINEGOCIOS S.A	BAAP197A	COP	RFC	C	COBAAP000008	DTF	0	0A		
	ADMINEGOCIOS S.A	BAAP197V	COP	RFC	C	COBAAP000008	DTF	0	0V		
	ADMINEGOCIOS S.A	BAYP197A	COP	RFC	C	COBAYP000008	DTF	0	0A		
	ADMINEGOCIOS S.A	BAYP197V	COP	RFC	C	COBAYP000008	DTF	0	0V		
	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSAL2A	COP	RFC	C	COBACC000001	DTF	0	0A		
	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSAL2V	COP	RFC	C	COBACC000001	DTF	0	0V		
	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSALA	COP	RFC	C	COBACC000001	DTF	0	0A		
	ADMINEGOCIOS S.A	CEOLCSALV	COP	RFC	C	COBACC000001	DTF	0	0V		

2.1.1.3. BUSCAR EMISORES

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.

The screenshot shows a window titled "Emisor - Eliminar" with the following fields: Código (ADM), Nombre (ADMINEGOCIOS S.A), Nit (830113598-9), Sector (SER), and others. A confirmation dialog box is overlaid on top, asking "Esta Seguro de Eliminar el Registro?" with "Sí" and "No" buttons. The main window has "Títulos", "Aceptar", and "Cerrar" buttons at the bottom.

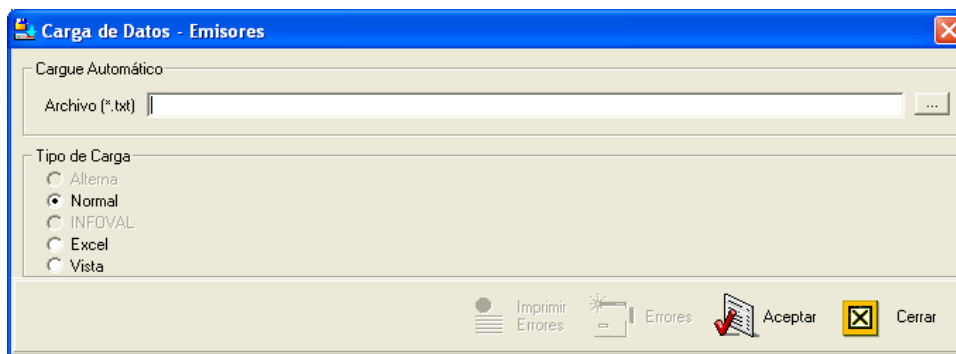
2.1.1.5. DETALLE EMISORES

The screenshot shows a window titled "Emisores - Detalle" with the following fields: Código (ADM), Nombre (ADMINEGOCIOS S.A), Nit (830113598-9), Sector (SER), and others. The "Cerrar" button at the bottom right is highlighted with a dashed border.

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

2.1.1.6. CARGAR DATOS EMISORES

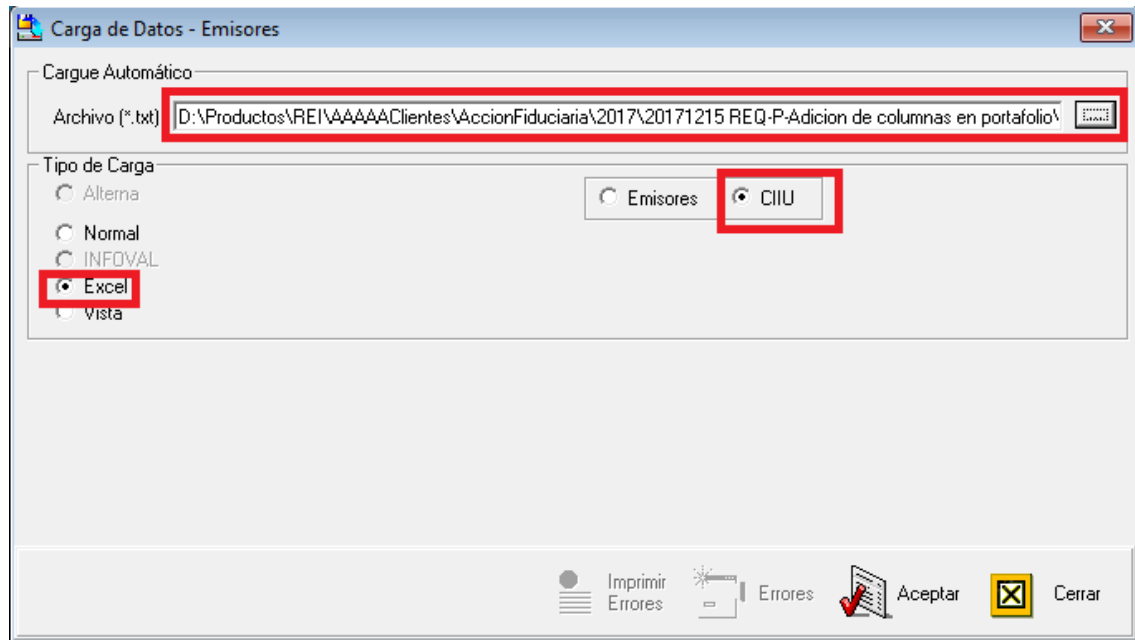
Al dar clic en el botón carga de datos el sistema muestra la pantalla que aparece a continuación. Oprimiendo el botón del lado derecho superior (el que tiene los 3 puntos) podrá buscar el archivo de extensión *.txt para proceder a cargarlo. Una vez seleccionado el archivo de clic en Aceptar para cargar 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 oprimir. Si no hay errores este botón queda desactivado y aparecerá un mensaje de "Transacción Exitosa".



2.1.1.7. CARGA TABLA DE ACTIVIDADES ECONOMICAS EMISORES

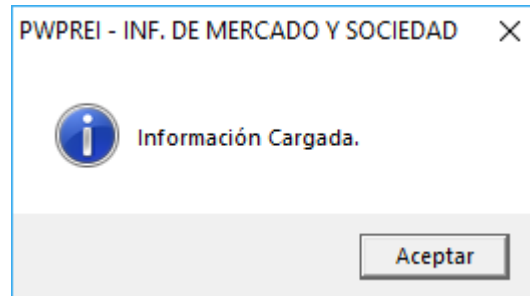
Para agregar la actividad económica del emisor del papel a su informe de valoración proceda:

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":

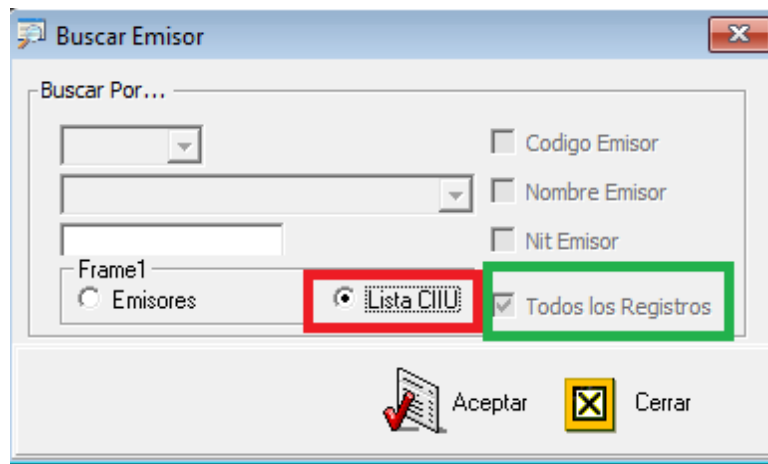


NOTA: Utilice la platilla "CargaCIUU" que está en el archivo Excel "FormatosTodasEntrada" para organizar los datos a cargar.

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



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



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

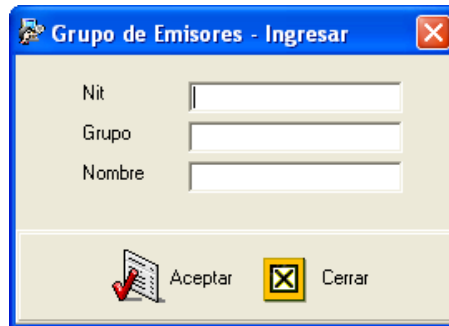
- Informe de Valoracion. Valore su portafolio como siempre y al exportarlo, al final de las hojas "Renta Fija" y "Simultaneas" le apareceran las columnas "CIU" y "ActEcono"

2.1.2. GRUPO EMISORES

Grupo	Nombre	Nit
BCO SUDAM.	BCO SUDAMERIS	8600507501
BNA	BNA	12345678
BOG D.C	BOGOTA DISTRITO CAPITAL	
CELCARIB	CELCARIBE S A	
COLP.S.A	MERC.COLP. SA	860034594
COOMEVA	FINANCIERA COOMEVA	111111111
CORFIVALLE	CORP.FINANCIERA DEL VALLE	8600052475
ETB	ETB	111111
FIDCOMCART	F.C.CART	830054539C
FUND. SOC.	FUNDACION SOCIAL	8600073354
GEA	GRUP EMP ANTIOQ	
GOB. NAL	GOBIERNO NACIONAL	899999083C
GR. AVAL	GRUPO AVAL	800216181
GR. S.DOM.	GRUPO EMPRESARIAL SANTO DOMINGO	
INVERARGOS	INVERARGOS	8909002663
ISAGEN	ISAGEN	
IVS	INVALSIME	123256236
MEG	MEGABANCO	8600349215
OCCIDEN54	OCCIDEN54	

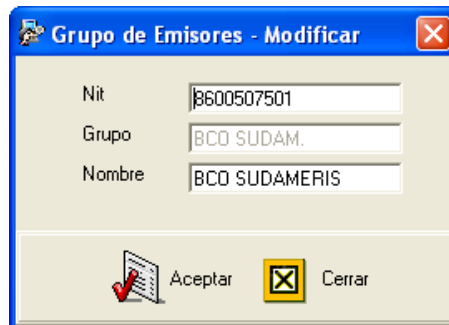
Categoría bajo la cual se agrupan los emisores de cada entidad.

2.1.2.1. INGRESO GRUPO EMISORES



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



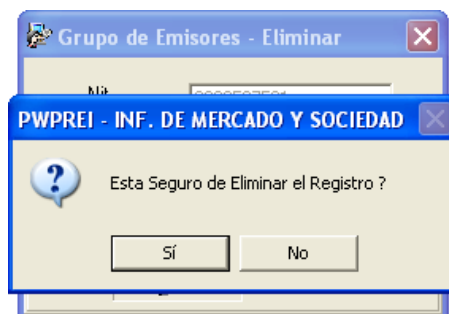
Solo se permite modificar el nombre del grupo de emisores, un cambio en el grupo implica eliminar el registro.

2.1.2.2. BUSCAR GRUPO EMISORES



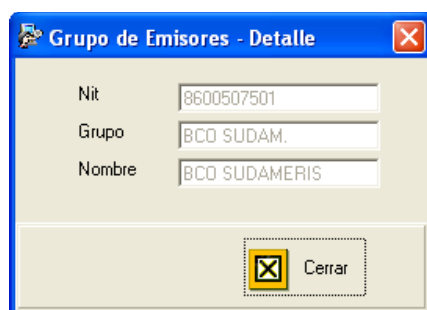
La consulta de información por Grupos de Emisores, se puede realizar seleccionando por grupo, nombre o todos los registros.

2.1.2.3. ELIMINAR GRUPO EMISORES



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



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 cuadrícula 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 Carga de Información Ventana				
Mercado	Código	Descripción	Mercado	Tipo de Rango
	AGR	SEC.AGRICOLA	ACC	GRUPO IRTES
	CEC	CURVA TES TF. PESOS	RF	GENERAL RF
	CECLVR	CURVA TES TF. DOLARES	RF	GENERAL RF
	COMC	SEC.COMERCIAL	ACC	GRUPO IRTES
	DTF	DTF	RF	GRUPO AC-NO RAN
	DTFA	DTF Semana Anterior	RF	GRUPO AC-NO RAN
	DTFE	DTF Efectiva	RF	GRUPO AC-NO RAN
	EXT	IND. PARA TITULOS EXTRANJEROS	RF	SIN RANGOS
	FINC	SEC.FINANCIERO	ACC	GRUPO IRTES
	FOGANSA	FOGANSA	ACC	SIN RANGOS
	IGASB	IGASB	GEN	GRUPO ITUS,ITEE
	IGASC	IGASC	GEN	GRUPO ITUS,ITEE

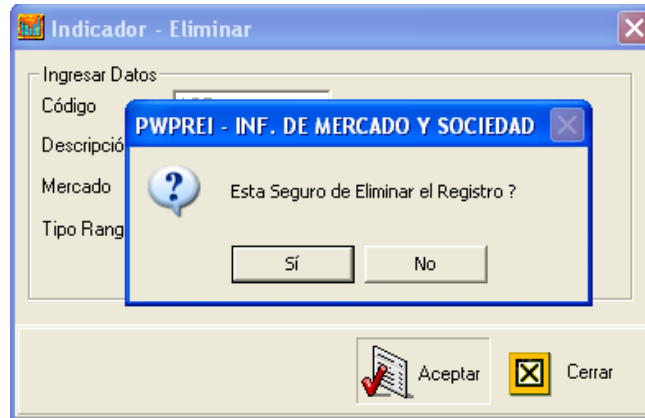
2.1.3.1. INGRESO INDICADORES

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

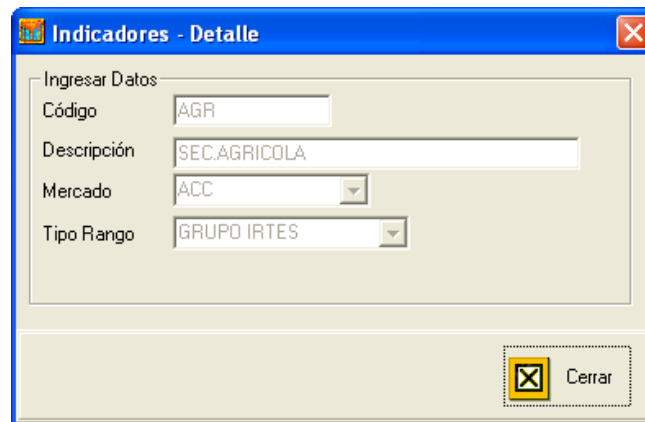
Al dar clic en el botón de Modificación o doble clic en la grilla, aparece la pantalla anterior donde podrá modificar los datos del Indicador que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar.

2.1.3.3. ELIMINAR INDICADORES



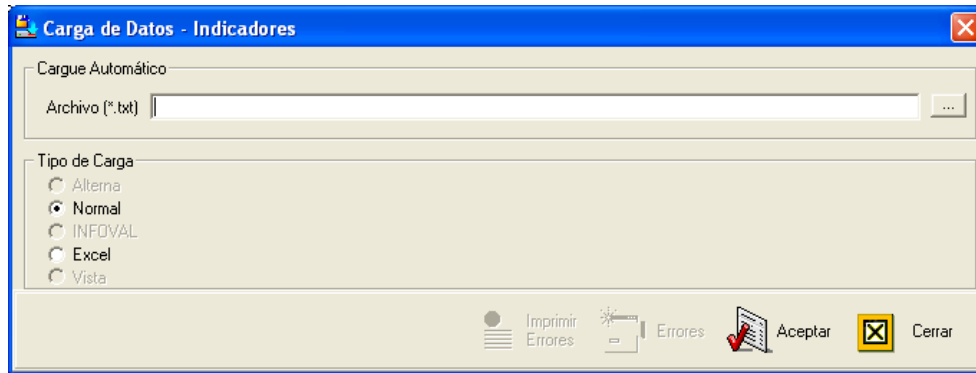
Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del Indicador a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Es importante señalar que hay que tener cuidado a la hora de eliminar Indicadores ya que son de vital importancia para la Valoración y la Medición de Riesgo.

2.1.3.4. DETALLE INDICADORES



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

2.1.3.5. CARGA DATOS 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.

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

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Moneda]				
Archivo Carga de Información Ventana				
Mercado	Código	Descripción	Tipo Moneda	Solicitado Por
	00001CSPVS	N021407.0028300854261200702140		
Emisores	00002D2006	0924TRM +000002417.2300		
	00002D2007	0214UVR +000000160.5584		
G. Emisores	00003D2006	0924TIF +001000000.0000		
	00003D2007	0214TIS +001860511.0000		
Indicador	00004D2006	0924YOK +000000002.0157		
	00004D2007	0214PAC +000447698.5200		
Monedas	00005D2006	0924TIS +001860511.0000		
	00005D2007	0214MAC +000213750.3290		
	00006D2006	0924PAC +000447698.5200		
	00006D2007	0214IRS +031644270.8100		
	00007D2006	0924MAC +000209936.1046		
	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 cuadrícula 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

The screenshot shows a dialog box titled "Moneda - Ingresar". It has a blue title bar with a close button. The main area is light beige and contains several input fields: "Código" (text box), "Cód. SuperFin" (text box), "Descripción" (text box), "Grupo Moneda" (text box), "Tipo Moneda" (dropdown menu), and "Solicitada por" (dropdown menu). At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

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.

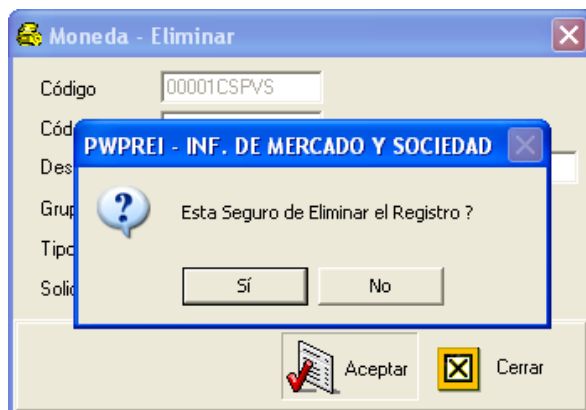
The screenshot shows a dialog box titled "Moneda - Modificar". It has a blue title bar with a close button. The main area is light beige and contains several input fields: "Código" (text box with "00001CSPVS"), "Cód. SuperFin" (text box), "Descripción" (text box with "N021407.0028300854261200702140"), "Grupo Moneda" (text box), "Tipo Moneda" (dropdown menu), and "Solicitada por" (dropdown menu). At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

2.1.4.3. BUSCAR MONEDAS



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.

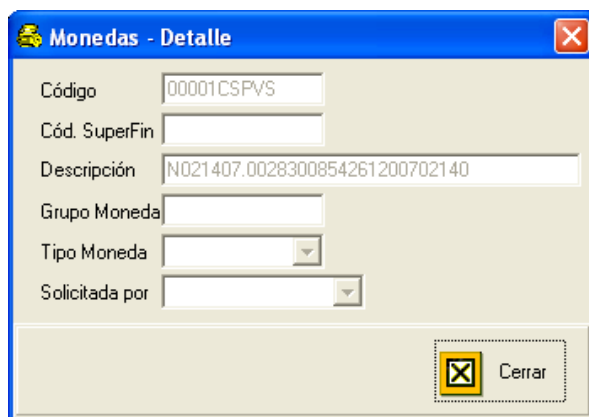
2.1.4.4. ELIMINAR MONEDAS



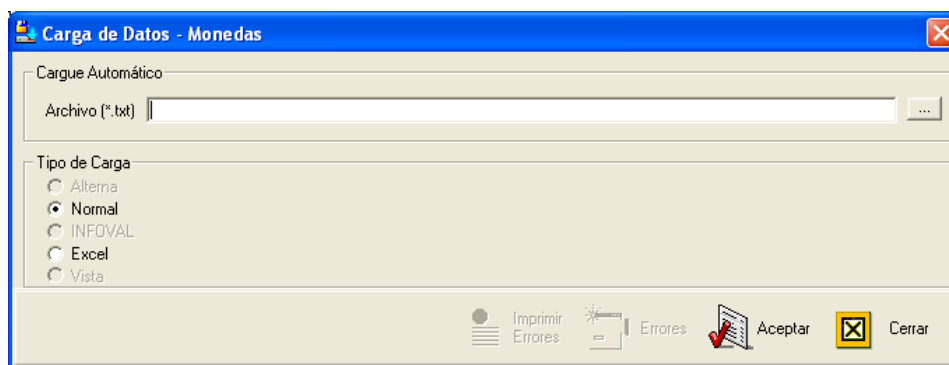
Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información de la moneda a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Recuerde que las monedas también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.

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.



2.1.4.6. CARGA DATOS



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 cuadrícula donde posteriormente se despliega la información de las tasas.

Mercado	Código	Descripción	Modalidad	Función
	CM	CORRECCION MONETARIA	ANUAL VENCIDA	MULTIPLICATIVA
	CMTG	CORR. MONETARIA THG	ANUAL VENCIDA	ADITIVA
	DTF	TASA DEP. TER. FIJO	TRIMESTRAL ANTICIPADA	ADITIVA
	-DTF	TASA DEP. TER. FIJO(-)	TRIMESTRAL ANTICIPADA	ADITIVA
	DTFE	DTF EFECTIVO O A.V +	ANUAL CUALQUIERA	MULTIPLICATIVA
	DTFP	DTF PENSIONAL	TRIMESTRAL VENCIDA	ADITIVA
	EUDO	TASA CAMBIO EU-DO	DIARIA VENCIDA	MULTIPLICATIVA
	F5	FIJA SIMPLE	NO APLICA	ADITIVA
	IPC	INDICE PRECIO CONSUM	ANUAL VENCIDA	MULTIPLICATIVA
	IPC1	80% INDICE PRE. CON	SEMESTRAL VENCIDA	ADITIVA
	IPC2	80% IPC ING. MED. 2M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA
	IPC3	IPC3 SALAR. MED. 12M	ANUAL VENCIDA	ADITIVA
	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
	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.

Nombre
 Cód. SuperFin
 Descripción
 Modalidad: Periodicidad:
 Función:
 Grupo Tasa:

2.1.5.2. MODIFICACION TASAS

Tasa - Modificar

Nombre:

Cód. SuperFin:

Descripción:

Modalidad: Periodicidad:

Función:

Grupo Tasa:

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:

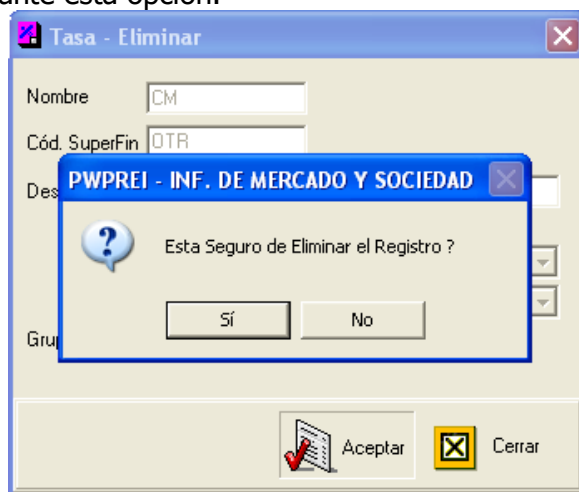
Todos los Registros

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

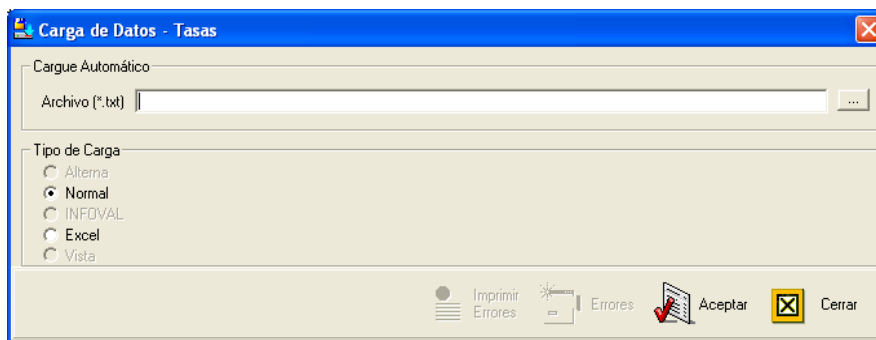
también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.



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



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

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Títulos]			
Mercado	Título	Nombre	Tipo Deuda
	013	FONDO INVERSION NACIONAL	NO APLICA
	016	FONDO INVERSION EN EL EXTRANJERO PORCION ACCIONES	EXTERNA
	ACC	Acciones	INTERNA
	ACP	ACCIONES PREFERENCIALES	INTERNA
	ACV	ACCIONES PRIVILEGIADAS	INTERNA
	APB	ACEPTACION BANCARIA	NO APLICA
	APF	ACEPTACION FINANCIERA	NO APLICA
	B55	BONOS LEY 55	
	BAA	BONOS AGRARIOS	INTERNA
	BCE	BONOS DE CESANTIA LEY 413	
	BCR	BONOS REPUBLICA DE COLOMBIA	
	BCX	CERT.DEP.TERM.CORP.FINANCIERA	INTERNA
	BD7	BONOS COLOMBIA DECRETO 700	
	BDE	BONOS DEUDA PUBLICA EXTERNA	NO APLICA
	BDS	BONO DESARROLLO Y SEG.INTERNA	
	BFC	TESB FORZOSA CONVENIDA	
	BFO	BONOS FORESTALES	NO APLICA
	BFV	BONOS FINANCIAMIENTO VENCIDOS	
	BGG	BONOS DE GARANTIA GFNFRAI	INTERNA

2.1.6.1. INGRESAR TITULOS

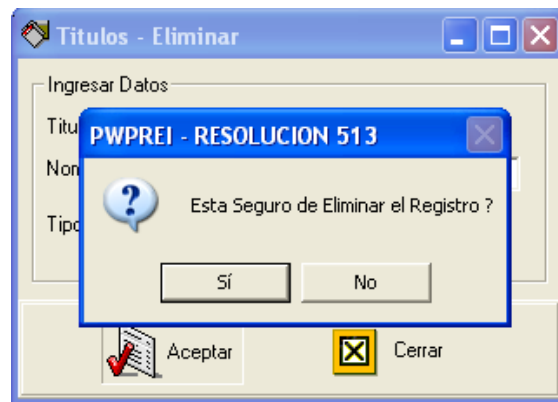
Al dar clic en el botón de ingreso aparece la pantalla mostrada anteriormente en la cual deberá ingresar la información correspondiente a los títulos y posteriormente clic en Aceptar.

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.

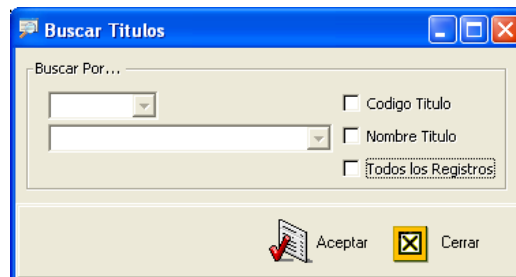


2.1.6.3. ELIMINAR TITULOS



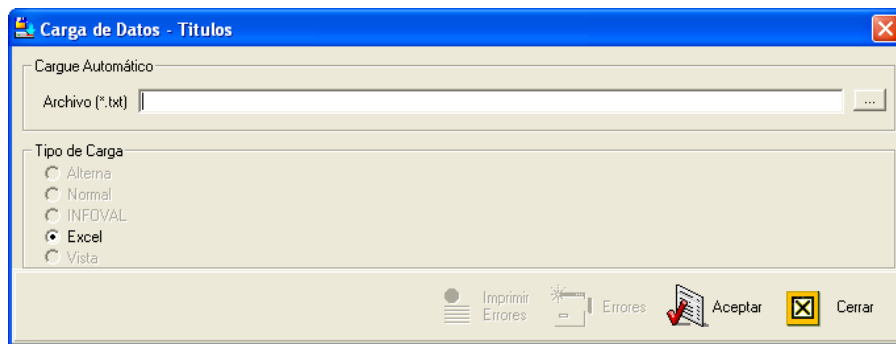
Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del título a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Recuerde que los TITULOS también son vitales en el manejo de la valoración y el riesgo, es por eso que debe proceder con cuidado ante esta opción.

2.1.6.4. BUSCAR TITULOS



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

2.1.6.5. CARGAR DATOS DE TITULOS

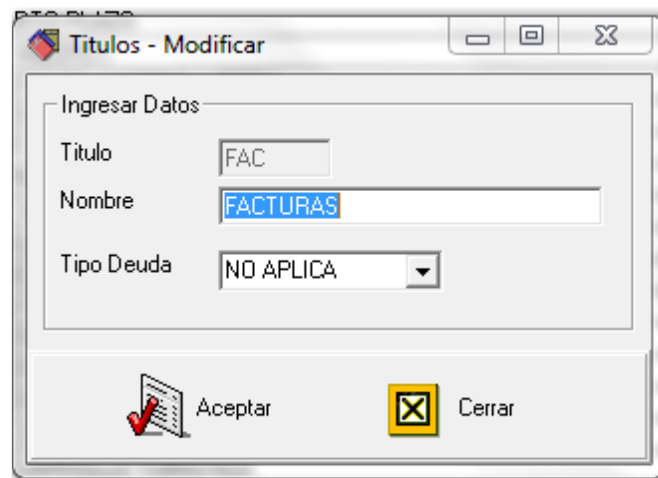


En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

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:



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

Especies/Renta Fija - Modificar

Código: FACTURA Emisor: ZPW Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: ESPECIE PARA FACTURAS Moneda: COP ISIN1:

Calificación: Indicador: RFC ISIN2:

Estado: ACTIVO Cod. Super: 0 CurCDT:

FecMaxReinv: 17/09/2003 Título: FACTURAS Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: DTR Aval: Emisión: Fungible: Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 18/03/2014 Vencimiento: 18/03/2014

Tasa

Referencia: FS

Spread: 0.00000

Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 Mes: 0

Número de Flújos: Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo: Descuento Tasa

Caja: Descuento Tasa

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: DESCUENTO

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:

Aceptar Cerrar

2. CHEQUES.

- a. Crear un título para identificarlos como tales.

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

Titulos - Ingresar

Ingresar Datos:

Titulo:

Nombre:

Tipo Deuda:

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

Especies/Renta Fija - Modificar

Código: Emisor: Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: Moneda: ISIN1:

Calificación: Indicador: ISIN2:

Estado: Cod. Super: CurCDT:

FecMaxReinv: Titulo: Categoria: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora:

Fecha

Emisión: Vencimiento:

Tasa

Referencia: Spread: Uso:

Flujo

Día: Mes: Número de Flújos: Cantidad: Aplica:

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: Periodicidad:

Calculo: Caja:

Calendario: Tabla de Desarrollo:

Rendimiento: Comisión: Clase Factor 1:

Datos Faciales: Amortización: Clase Factor 2:

Retefuente > 5: Retefuente < 5: Portafolio Destino:

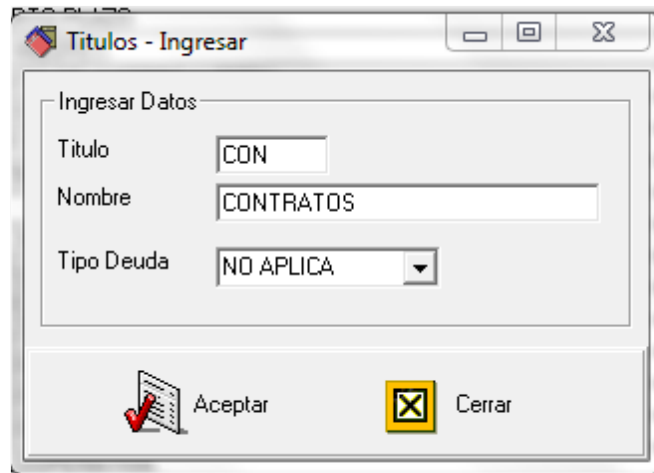
Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: Periodicidad:

3. CONTRATOS.

- a. Crear un título para identificarlos como tales.

Ingresa por "Mercado y Sociedad – Mercado – Títulos – Ingresar" y crea el título para contratos, igual al de la figura:



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

Especies/Renta Fija - Modificar

Código: CONTRATO Emisor: ZPW Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: ESPECIE DE CONTRATOS Moneda: COP ISIN1:

Calificación: Indicador: RFC ISIN2:

Estado: ACTIVO Cod. Super: 0 CurCDT:

FecMaxReinv: 17/09/2003 Título: CONTRATOS Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: DTR Aval: Emisión: Fungible: Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 18/03/2014 Vencimiento: 18/03/2014

Tasa

Referencia: FS

Spread: 0.00000

Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 Mes: 0

Número de Flújos: Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo: Descuento Tasa

Caja: Descuento Tasa

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: DESCUENTO

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Aceptar Cerrar

4. LETRAS

- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresa por "Mercado y Sociedad – Mercado – Títulos – Ingresar" y crea el título para letras, igual al de la figura:

Titulos - Modificar

Ingresar Datos

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 Nemo Equiv Renta Fija: []

Descripción: ESPECIE DE LETRAS Moneda: COP ISIN1: []

Calificación: [] Indicador: RFC ISIN2: []

Estado: ACTIVO Cod. Super: [] CurCDT: []

FecMaxReinv: 17/09/2003 Título: LETRA Categoría: [] Grupo Calificación: []

Superfinanciera

Código SF: OTR Aval: [] Emisión: [] Fungible: [] Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 19/03/2014 Vencimiento: 19/03/2014

Tasa

Referencia: FS Spread: 0.00000 Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 Mes: 0 Número de Flujos: 0 No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo: Descuento Tasa

Caja: Descuento Tasa

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: DESCUENTO

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1: []

Clase Factor 2: []

Portafolio Destino: []

Modalidad Pago de Reinversión

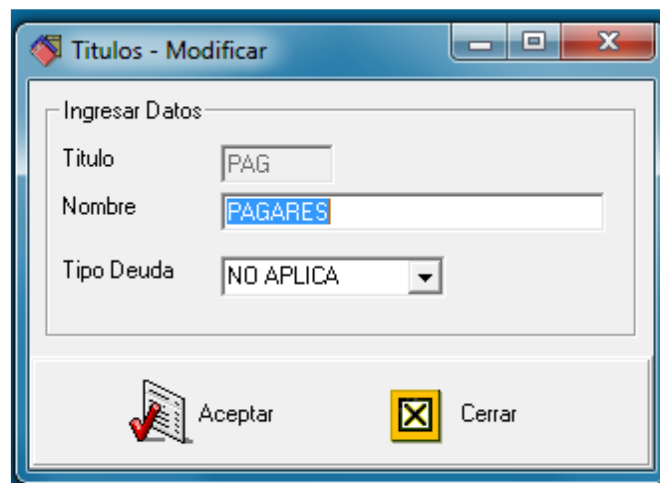
Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Aceptar Cerrar

5. PAGARES

- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresa por "Mercado y Sociedad – Mercado – Títulos – Ingresar" y crea el título para pagarés, igual al de la figura:



- 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 Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: ESPECIE DE PAGARES Moneda: COP ISIN1:

Calificación: Indicador: RFC ISIN2:

Estado: ACTIVO Cod. Super: CurCDT:

FecMaxReinv: 17/09/2003 Titulo: PAGARES Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: OTR Aval: Emisión: Fungible: Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 19/03/2014 Vencimiento: 19/03/2014

Tasa

Referencia: FS

Spread: 0.00000

Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 Mes: 0

Número de Flujos

Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo

Calculo: Descuento Tasa

Caja: Descuento Tasa

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: DESCUENTO

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:

Modalidad Pago de Reinversión

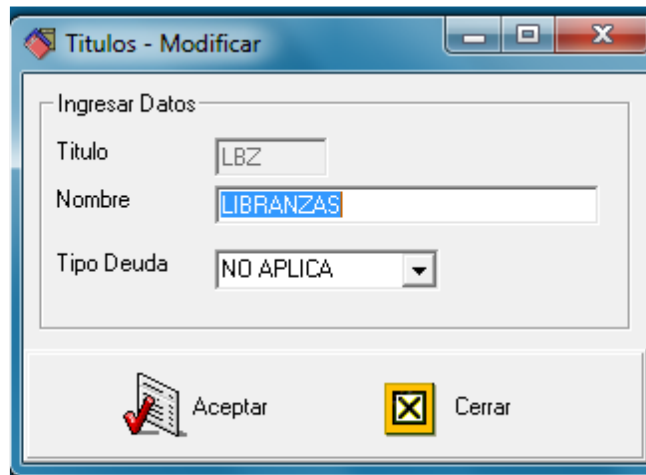
Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Aceptar Cerrar

6. LIBRANZAS

- a. Crear un título para identificarlas como tales.

Ingresa por "Mercado y Sociedad – Mercado – Títulos – Ingresar" y crea el título para libranzas, igual al de la figura:



Titulos - Modificar

Ingresar Datos

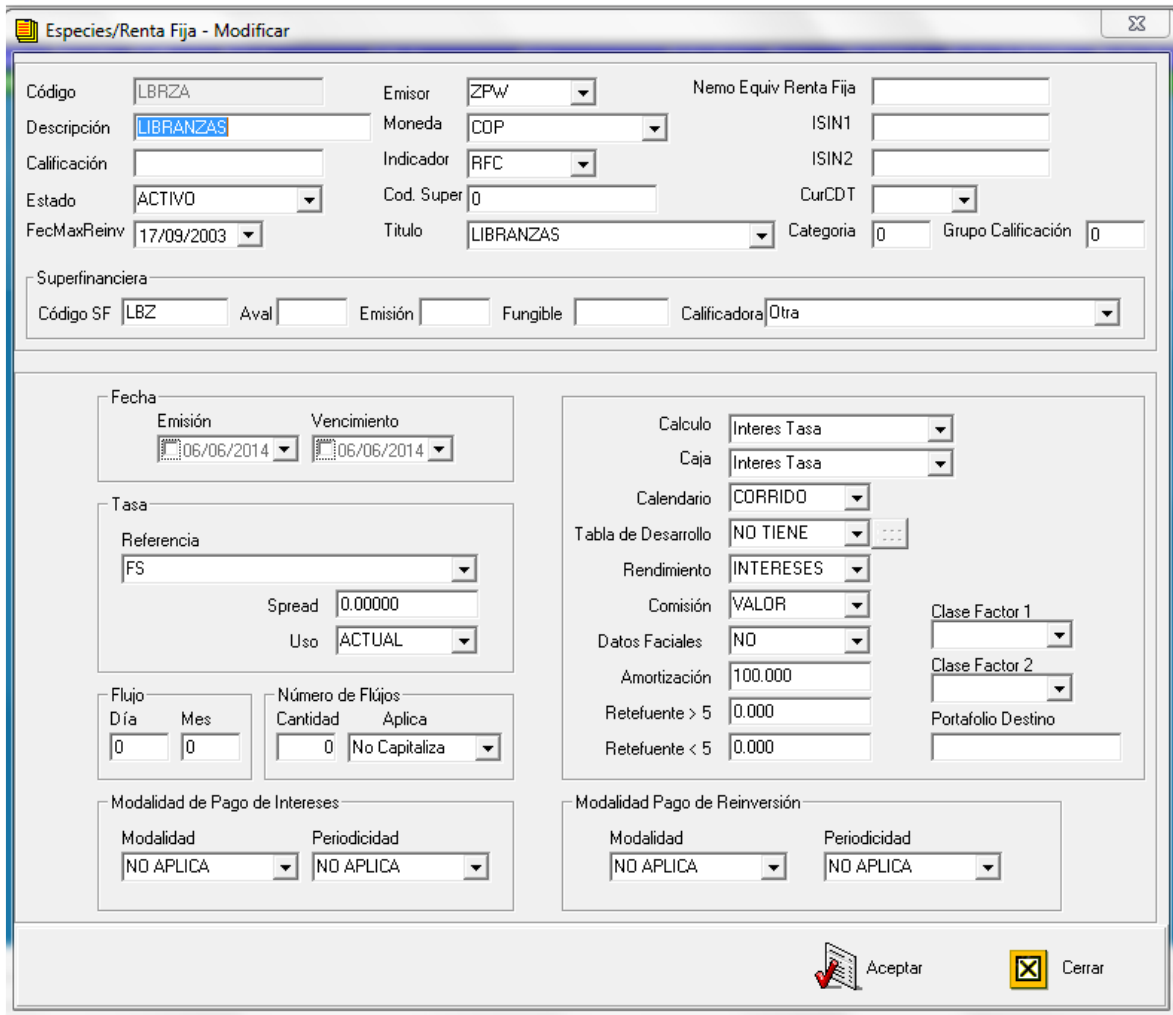
Titulo: LBZ

Nombre: LIBRANZAS

Tipo Deuda: NO APLICA

Aceptar Cerrar

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



Especies/Renta Fija - Modificar

Código: LBZA Emisor: ZPW Nemo Equiv Renta Fija: []

Descripción: LIBRANZAS Moneda: COP ISIN1: []

Calificación: [] Indicador: RFC ISIN2: []

Estado: ACTIVO Cod. Super: 0 CurCDT: []

FecMaxReinv: 17/09/2003 Titulo: LIBRANZAS Categoría: 0 Grupo Calificación: 0

Superfinanciera

Código SF: LBZ Aval: [] Emisión: [] Fungible: [] Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 06/06/2014 Vencimiento: 06/06/2014

Tasa

Referencia: FS

Spread: 0.00000

Uso: ACTUAL

Flujo

Día: 0 Mes: 0

Número de Flujos

Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Calculo: Interes Tasa

Caja: Interes Tasa

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: INTERESES

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Modalidad de Pago de Intereses

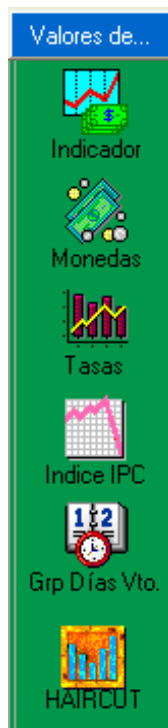
Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

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:

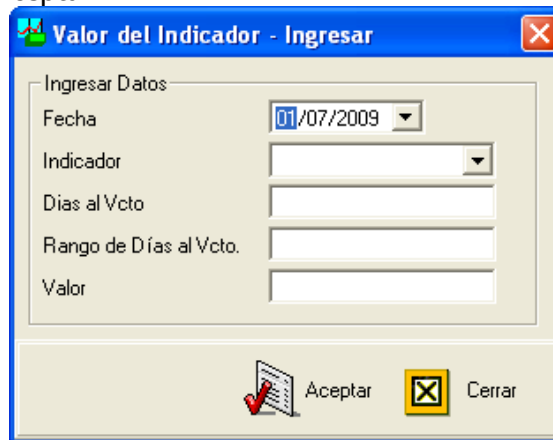
2.2.1. VALORES DE INDICADORES

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

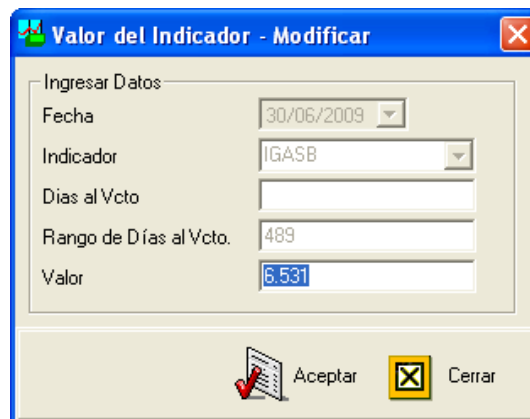
INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Valor del Indicador]				
Archivo Carga de Información Ventana				
Valores de...	Fecha	Indicador	Rango de Días al Vcto.	Valor
 Indicador  Monedas	30/06/2009	IGASB	489	6.531
	30/06/2009	IGASC	489	7.331
	30/06/2009	IIPLC	361-720	7.443
	30/06/2009	INBAV	489	5.816
	30/06/2009	ISCOG	700	3.425
	30/06/2009	ITUS	49	3.026
	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.



2.2.1.2. Modificación valores de indicadores

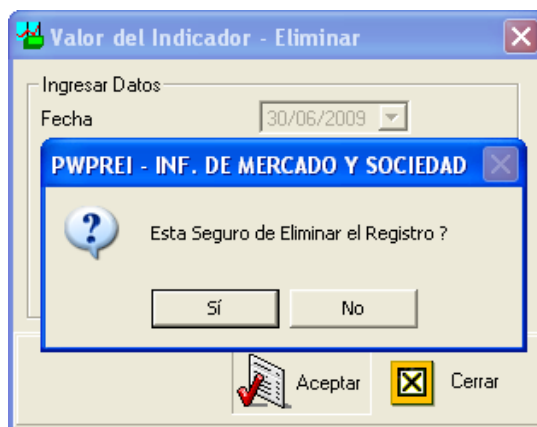


Al dar clic en el botón de Modificación aparece la pantalla siguiente donde podrá modificar los datos del valor de indicador que haya escogido. Solo los campos activos o de fondo blanco son los que se pueden modificar. Recuerde que puede modificar registros escogiéndolos y oprimiendo el botón de modificación 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

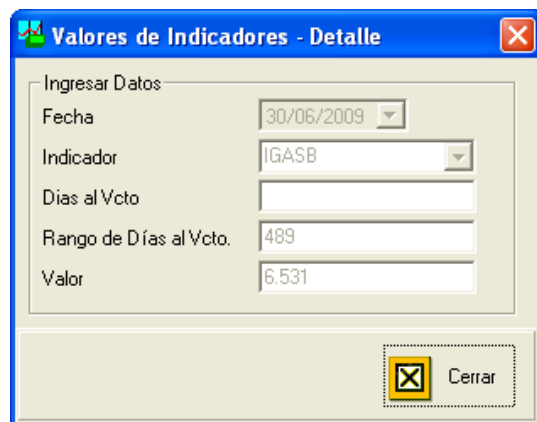
En esta opción se podrán buscar los Valores de Indicadores por la Fecha en la cual se registro dicho indicador, por el nombre del Indicador, por el Rango de Días al vencimiento en el cual se encuentra clasificado o podrá hacerlo buscando todos los registros que se encuentren en el sistema. Una vez se 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



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.

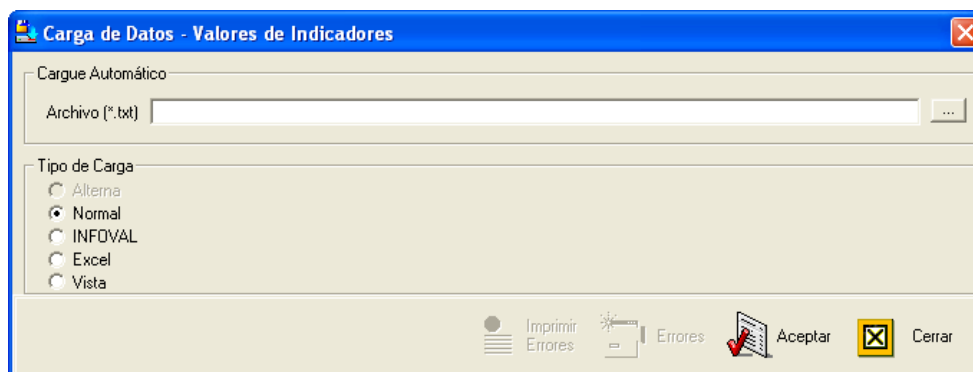
2.2.1.5. Detalle valores de indicadores



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.



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

Fecha	Moneda	Valor
30/06/2009	018	14,185.1676
30/06/2009	180	19,206.3195
30/06/2009	272	13,474.48
30/06/2009	901	2,281.48
30/06/2009	A75	25,369.92
30/06/2009	C90	2,235.56
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 cuadrícula 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

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.

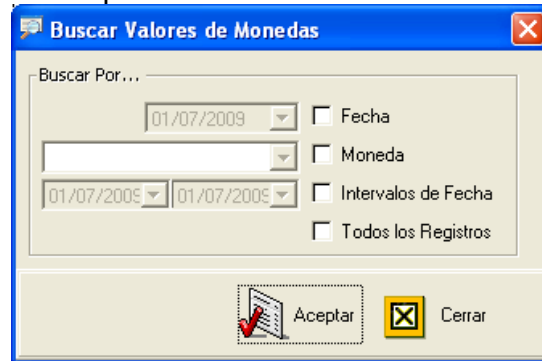
2.2.2.1. MODIFICACION VALORES DE MONEDAS

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.

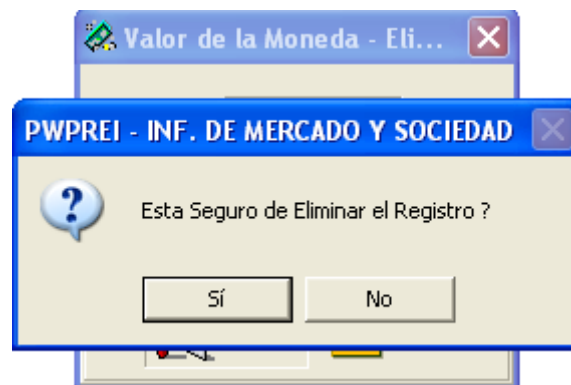
2.2.2.2. BUSCAR VALORES DE MONEDAS

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.



2.2.2.3. ELIMINAR VALORES DE MONEDAS



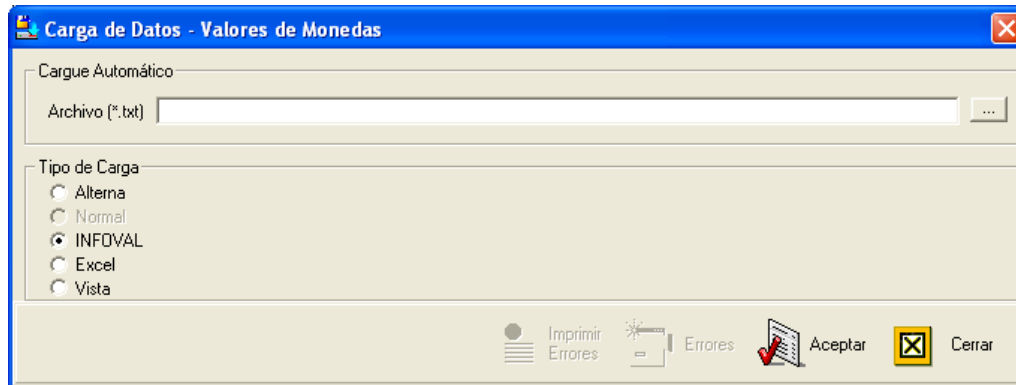
Al dar clic en el botón de eliminación aparece la información del valor de la Moneda a eliminar y la reconfirmación por parte del usuario para proceder. Si desea eliminar haga clic en Aceptar, sino clic en Cerrar.

2.2.2.4. DETALLE VALORES DE MONEDAS



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



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

Fecha	Tasa	Valor
30/06/2009	DFF	5.4
30/06/2009	-DT	-5.22
30/06/2009	DTE	5.4
30/06/2009	DTF	5.22
30/06/2009	EUD	1.4134
30/06/2009	IB1	4.41
30/06/2009	IBE	4.536
30/06/2009	IBR	4.376
30/06/2009	ICP	4.77
30/06/2009	IP2	4.68
30/06/2009	IP4	6.135

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

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

2.2.3.1. INGRESO VALORES DE TASAS

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

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

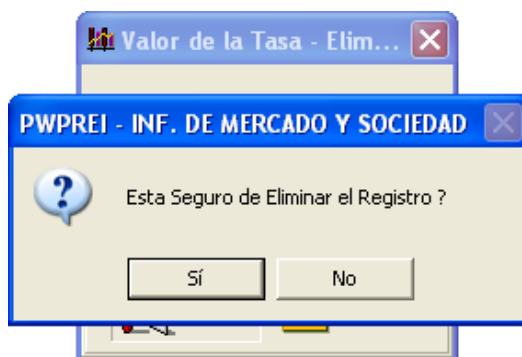
podrá hacerlo con el valor.

2.2.3.3. BUSCAR VALORES DE TASAS



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.

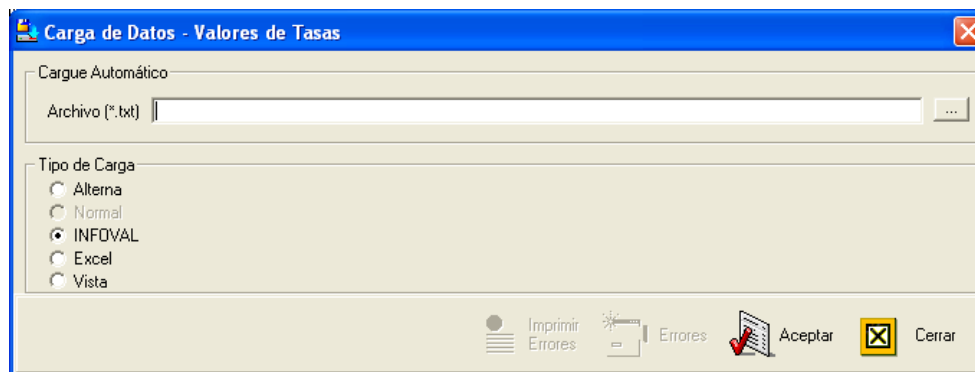
2.2.3.5. DETALLE VALORES DE TASAS



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.



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 - [Índice 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	
	01/11/1954	05/11/1954	0.984586	
	01/12/1954	05/12/1954	0.989805	
	01/01/1955	05/01/1955	0.988122	
	01/02/1955	05/02/1955	0.987430	
	01/03/1955	05/03/1955	0.991380	
	01/04/1955	05/04/1955	0.998320	
	01/05/1955	05/05/1955	0.994027	
	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	
	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.

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.

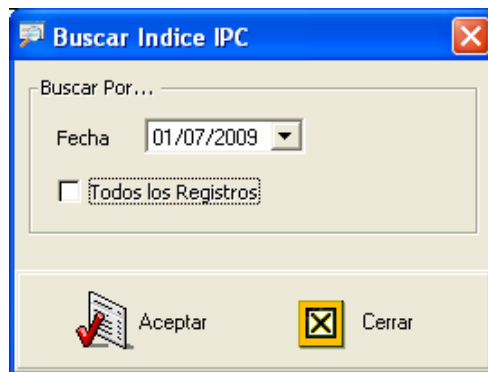


2.2.4.3. ELIMINAR INDICE IPC

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.



2.2.4.4. BUSCAR INDICE IPC



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

todos los registros.

2.2.5. GRUPO DIAS VENCIMIENTO

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Grupos Días al Vencimiento]						
Archivo Carga de Información Ventana						
Valores de...	Fecha Vigencia	Tipo Rango	Rango	Días Mínimos	Días Máximo	Grupo DíasV
	01/01/2003	GRUPO AC-NO RANGOS	0-9999	0	9999	
Indicador	01/01/2003	GRUPO SISVAL	0-30	0	30	15
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	31-61	31	61	16
Monedas	01/01/2003	GRUPO SISVAL	62-92	62	92	17
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	93-181	93	181	18
Tasas	01/01/2003	GRUPO SISVAL	182-273	182	273	19
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	274-365	274	365	20
Indice IPC	01/01/2003	GRUPO SISVAL	366-548	366	548	21
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	549-730	549	730	22
Grp Días Vto.	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
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	1826-2190	1826	2190	7
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2191-2555	2191	2555	8
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2556-2920	2556	2920	9
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	2921-3285	2921	3285	10
	01/01/2003	GRUPO SISVAL	3286-3650	3286	3650	11

2.2.5.1. INGRESO GRUPO DIAS AL VENCIMIENTO

Días al Vcto - Ingresar

Ingresar Datos

Fecha Vigencia: 01/07/2009

Tipo Rango: []

Rango: []

Días Mínimos: []

Días Máximos: []

Grupo DíasV: 0

Aceptar 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

FechaVigencia: 01/01/2003

Tipo Rango: GRUPO AC-NO RANGOS

Rango: 0-9999

Dias Minimios: 0

Dias Maximos: 9999

Grupo DiasV: 0

Aceptar 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 ?

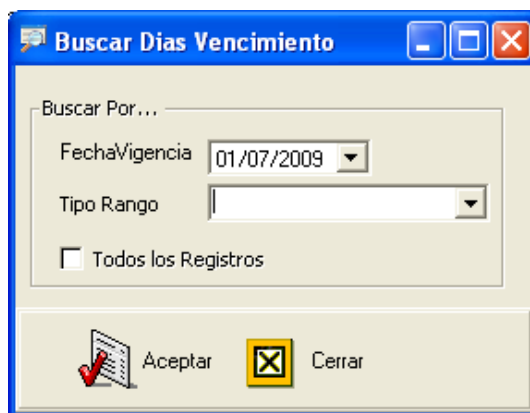
Sí No

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.



2.2.5.5. EXPORTAR A EXCEL DIAS AL VENCIMIENTO

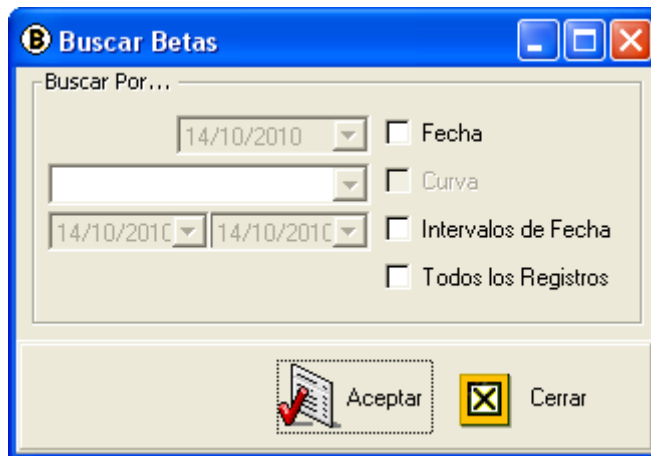
Con esta opción puede manejar la información de días al vencimiento en Excel.

2.2.6. HAIRCUT

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [HAIRCUTS BRP]				
Archivo Carga de Información Ventana				
Valores de...	Fecha Vigenc	Num. Emisor	Plazo.	HAIRCUT
	01/02/2010	35695	1	0.05
	01/02/2010	35695	2	0.05
	01/02/2010	35695	7	0.05
	01/02/2010	35695	8	0.05
	01/02/2010	35695	19	0.05
	01/02/2010	35695	23	0.05
	01/02/2010	35695	33	0.05
	01/02/2010	41970	1	0.05
	01/02/2010	41970	2	0.05
	01/02/2010	41970	7	0.05
	01/02/2010	41970	8	0.05
	01/02/2010	41970	19	0.05
	01/02/2010	41970	23	0.05
	01/02/2010	41970	33	0.05
	01/02/2010	41993	1	0.1
	01/02/2010	41993	2	0.1
	01/02/2010	41993	7	0.1
	01/02/2010	41993	8	0.1
	01/02/2010	41993	19	0.1
	01/02/2010	41993	23	0.1
	01/02/2010	41993	33	0.1

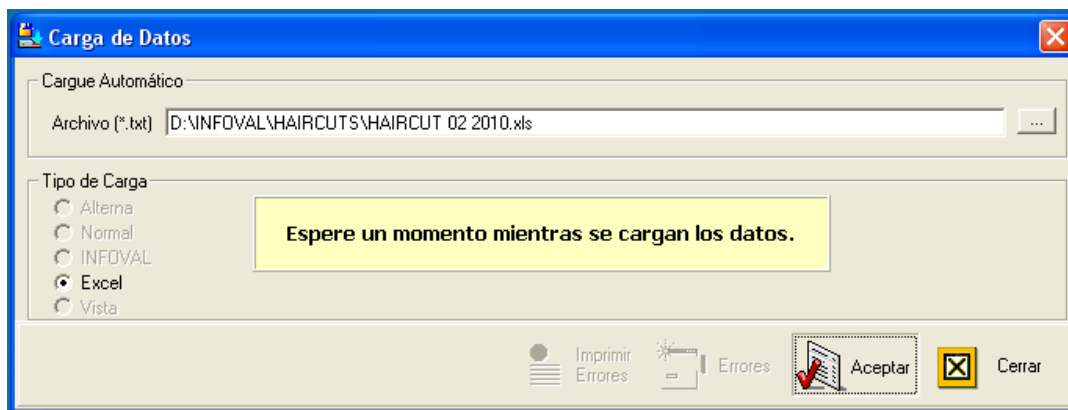
Los Haircuts son márgenes de las operaciones Repo que calcula y publica el banco de la República, estos Haircuts se utilizan en el sistema para castigar los activos líquidos incluidos en el formato 475 y en el futuro podrán utilizarse también para la evaluación de garantías de los negocios de futuros.

2.2.6.1. BUSCAR HAIRCUT



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



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

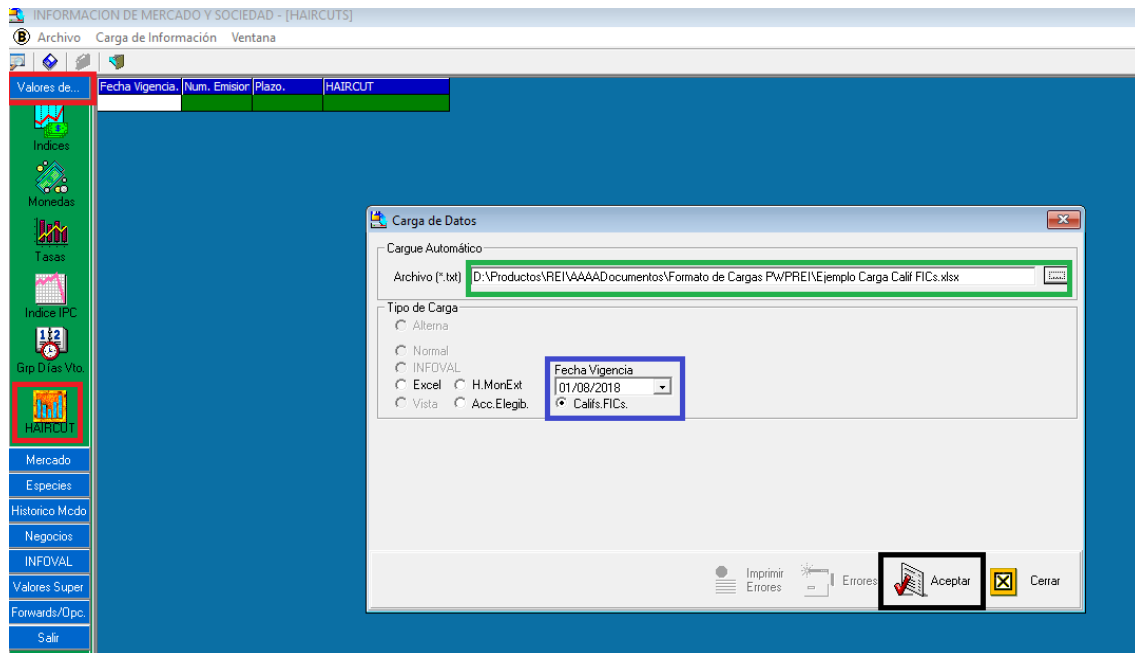
Al generar formatos del IRL se debe tener en cuenta lo siguiente:

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:



3. 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/RENDA 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 cuadrícula donde posteriormente vera la información que se encuentre registrada en su sistema.

Especies	Especie	Descripción	Tipo Especie	Emisor	Moneda	Calificacon	Estado	Estado de Suspension	Tipo de Bursatidad	% Bursatidad	Fecha Patrimonial
	56	56	ACCION	AAA	COP	656	A	A	A	123 %	25/08/2002
	AAJFAO	AAJFAO	ACCION	AC7	TRM		A	A	N	0 %	08/07/2005
	ACASA		ACCION	ACA	COP		A	P	I	0 %	30/06/1996
	ACASA1		ACCION	ACA	COP		A	P	I	0 %	30/06/1996
	ACC.CEMENTOS		ACCION	INV	COP		A	A	A	0 %	03/02/2006
	ACC.INVERSI0		ACCION	CE	COP		A	A	A	0 %	03/02/2006
	ACES		ACCION	AEC	COP	2333	A	P	I	0 %	30/09/1998
	ACES1		ACCION	AEC	COP		A	P	I	0 %	30/09/1998
	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.

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.

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.

The screenshot shows a software window titled "Especies/Renta Variable - Modificar". The fields are organized as follows:

- Top Section:**
 - Código: 56
 - Cod. Super: 23
 - Calificación: 656
 - ISIN: (empty)
 - Estado: ACTIVO
 - Tipo Especie: ACCION
 - Emisor: AAA
 - Moneda: COP
 - Tipo Título: Acciones
 - Descripción: 56
 - Categoría: 0
 - Grupo de Calificación: (empty)
- Middle Section:**
 - Estado de Negociación: ACTIVO
 - Fecha Patrimonial: 25/08/2002
 - Valor Patrimonial: 123.00000000
 - Fecha Nominal: 25/08/2002
 - Valor Nominal: 23.00000000
 - Fecha Fiscal: 25/08/2002
 - Valor Fiscal: 123
 - Acc. Circulación: 123
 - Portafolio Destino: (empty)
 - Factor 1: (empty)
 - Factor 2: (empty)
- Bottom Section (Superfinanciera):**
 - Código SF: AA EVS
 - Aval: (empty)
 - Emisión: (empty)
 - Fungible: (empty)
 - Calificadora: (empty)
- Bottom Right:**
 - Buttons: Aceptar (with checkmark icon) and Cerrar (with close icon).

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.

The screenshot shows a software window titled "Especies/Renta Variable - Eliminar". The window contains several input fields and dropdown menus for data entry. A modal dialog box is overlaid on top, asking for confirmation to delete the record.

Form Fields:

- Código: 56
- Cod. Super: 23
- Calificación: 656
- ISIN: [Empty]
- Estado: ACTIVO
- Tipo Especie: ACCION
- Emisor: AAA
- Moneda: COP
- Tipo Título: Acciones
- Descripción: 56
- Categoría: 0
- Grupo de Calificación: Null
- Estado de: ACTIVO
- Bursatilidad: [Empty]
- Tipo: ALTA
- Porcentaje: 123.000
- Factor1: [Empty]
- Factor 2: [Empty]
- Superfinanciera:
 - Aval: [Empty]
 - Emisión: [Empty]
 - Fungible: [Empty]
- Código SF: AA-EVS
- Calificadora: [Empty]

Confirmation Dialog:

PWPREI - INF. DE MERCADO Y SOCIEDAD

Esta Seguro de Eliminar el Registro ?

Sí No

Buttons: 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 Variable - Detalle

Código: 56 Cod. Super: 23
 Calificación: 656 ISIN:
 Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION
 Emisor: AAA Moneda: COP
 Tipo Título: Acciones
 Descripción: 56
 Categoría: 0 Grupo de Calificación:
 Estado de Negociación: ACTIVO Fecha Patrimonial: 25/08/2002 Valor Patrimonial: 123.00000000
 Bursatilidad: Fecha Nominal: 25/08/2002 Valor Nominal: 23.00000000
 Tipo: ALTA Fecha Fiscal: 25/08/2002 Valor Fiscal: 123
 Porcentaje: 123.000 Acc. Circulación: 123
 Portafolio Destino:
 Factor1: Factor 2:
 Superfinanciera: Aval: Emisión: Fungible:
 Código SF: AAEVS Calificadora:
 Cerrar

2.3.1.6. CARGA DE DATOS ESPECIE DE RENTA VARIABLE

Carga de Datos - Especies/Renta Variable

Cargue Automático
 Archivo (*.txt)
 Tipo de Carga
 Alterna
 Normal
 INFOVAL
 Excel
 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

Especies	Especie	Descripción	Emisor	Moneda	Calificación	Estado	Cálculo	Caja	Calendario	Tasa	Modalidad	Fecha de Emisión
	0112847446		GNA	EUR		INACTIVO	ALCULO SIN DEFINI	CAJA SIN DEFINIR	C	F5	AV	30/06/20
	0118953107		GNA	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	20/10/20
	0123152521		BAN	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	31/01/20
	0129675350		BAN	EUR		INACTIVO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	31/05/20
	112847446		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	30/06/20
	118953107		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	20/10/20
	123152521		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	31/01/20
	129675350		GNA	EUR		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	AV	31/05/20
	195325AA92		GNA	TRM		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	SV	15/02/19
	195325AA92		GNA	TRM		VENCIDO	Otros Precios	Otros Precios	C	F5	SV	23/02/19

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 cuadrícula donde posteriormente vera la información que se encuentre registrada en su sistema.

2.3.2.1. BUSCAR ESPECIES DE RENTA FIJA

Buscar Por...

Seleccione Emisor
 Especie
 Emisor
 Moneda
 Todos los Registros

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.

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.
 - 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 intereses 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: $Vfi = TasaEmi * Dpa / 360$
- **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...	Tipo	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:

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:

Fecha 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

Registro[s] 121. La Tabla esta asociada a la Especie: TIPN5A22

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

Carga de Datos - Tabla Alterna

Cargue Automático

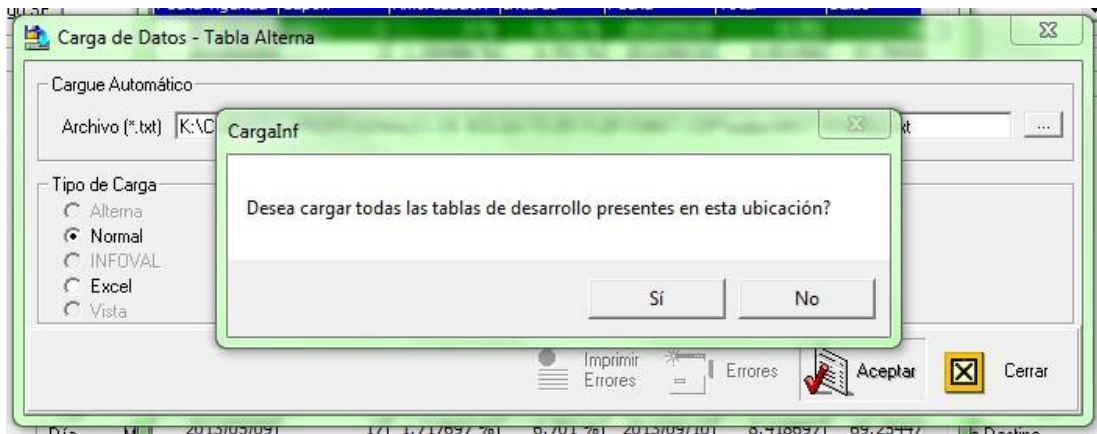
Archivo (*.txt) K:\CLIENTES\PROFESIONALES DE BOLSA\TD2013\2013\INST-COP\todos\INST10100522.txt

Tipo de Carga

- Alterna
- Normal
- INFOVAL
- Excel
- Vista

Imprimir Errores Errores Aceptar Cerrar

5. Al presionar Aceptar, el sistema pregunta:



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

2.3.2.4. MODIFICACION ESPECIES DE RENTA FIJA

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.

The screenshot shows a software window titled "Especies/Renta Fija - Eliminar". It contains a form with the following fields and values:

- Código: 0123152521
- Emisor: BAN
- Nemo Equiv Renta Fija: [Empty]
- Descripción: [Empty]
- Moneda: EUR
- ISIN1: [Empty]
- Calificación: [Empty]
- Indicador: RFC
- ISIN2: [Empty]
- Estado: INACTIVO
- Cod. Super: CORBAN000005
- CurCDT: [Empty]
- FecMaxReinv: 17/09/2003
- Título: ACEPTACION BANCARIA
- Categoría: 0
- Grupo Calificación: [Empty]

Below these fields are sections for "Superfinanciera" (Código SF, Aval, Emisión, Fungible, Calificadora), "Fecha" (Emisión: 31/01/2001, Vencimiento: 12/12/2012, Calculo: Otros Precios), "Tasa" (Referencia: FS, Spread: 0.00, Uso: ACTUAL), "Flujo" (Día: 0, Mes: 0, Número de Flujos: Cantidad: 0, Aplica: No Capitaliza), "Modalidad de Pago de Intereses" (ANUAL, VENCIDA), and "Modalidad Pago de Reinversión" (NO APLICA, NO APLICA). A modal dialog box is open in the center with the text "Esta Seguro de Eliminar el Registro?" and buttons for "Si" and "No".

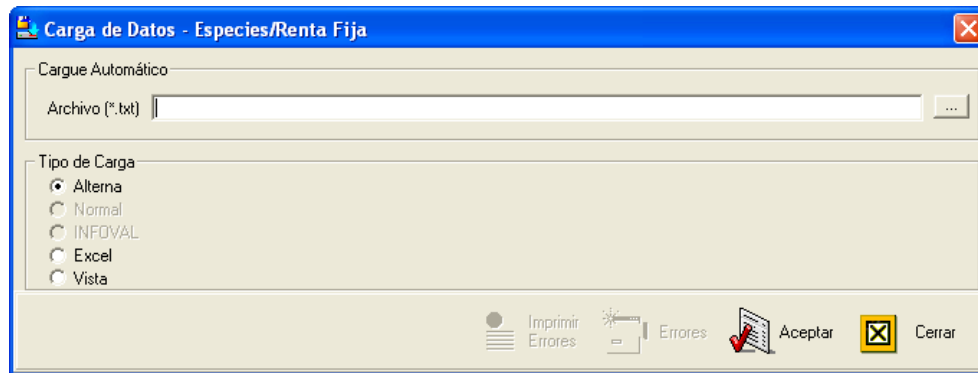
2.3.2.6. DETALLE ESPECIES DE RENTA FIJA

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.

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 Pública como muestra la imagen.

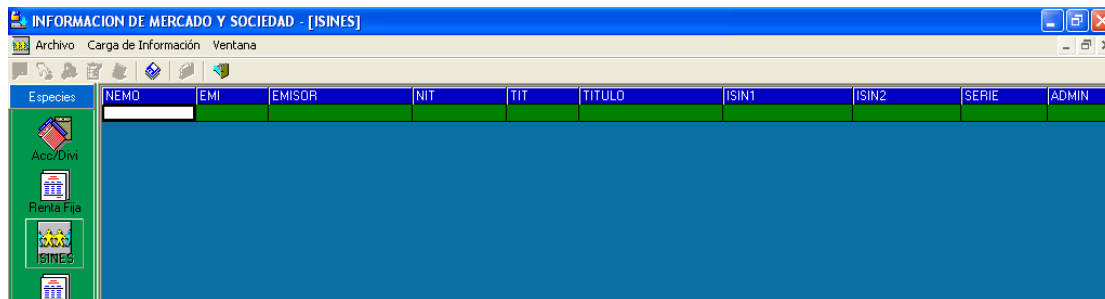
Y a continuación en el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



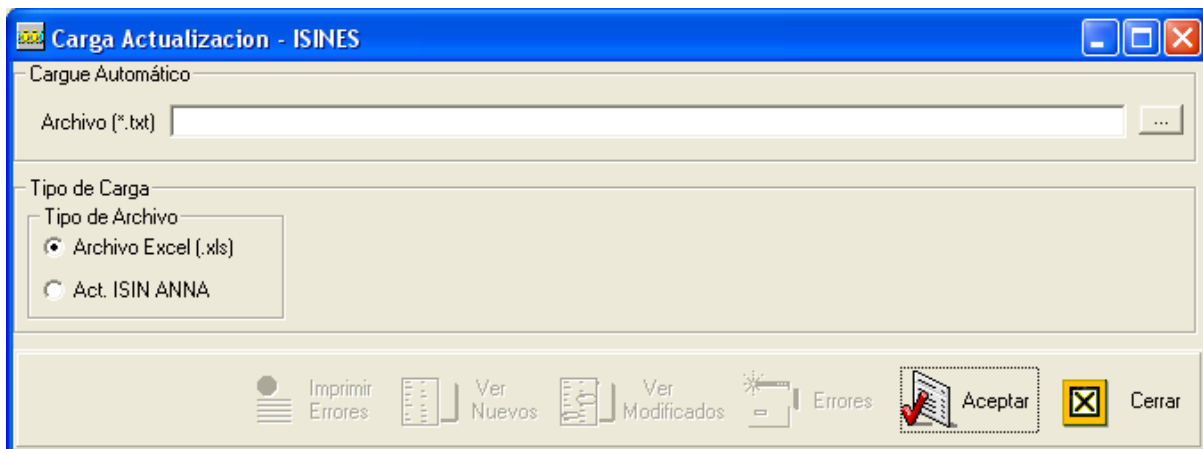
2.3.2.8. EXPORTAR A EXCEL ESPECIES DE RENTA FIJA

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

2.3.3. ISINES



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.



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

Cambios en el archivo de Nemos-ISIN para el día
Martes, 07 de Septiembre de 2010

Con motivo de la salida a producción de la Agencia Numeradora Nacional - ANNA- en este archivo únicamente se publicará ISIN ANNA para nemotécnicos estandarizados.

En consecuencia, para la consulta de los ISIN de nemotécnicos NO estandarizados, por favor realizar la consulta del archivo plano **Equivalencias ISIN** en la página de www.infoval.com.co, ingresando por la opción de Renta Fija.

Cambios Nemos-ISIN			
Nemotécnico	Campo Modificado	Valor Anterior	Valor Actual
Categorización Títulos Creados			
Nemotécnico	Clase	Calificación	Valoran por
CDTCLP809	11	EMISOR	PRECIO
CDTCLP80A	11	EMISOR	PRECIO
CDTCLP80B	11	EMISOR	PRECIO
CDTCLP80	11	EMISOR	PRECIO

Comentarios: 1. Este archivo reemplaza completamente cualquier fecha anterior.
2. Si en la modalidad de reinversión hay un cero "0", significa que en la operación estos pueden tomar diferentes valores.

CÓDIGO MEC	NEMO NUEVO	NEMO ANTIGUO	EHL	EMISOR	NIT	TIT	TITULO	ISIN 1	IS
113AB	BAGRA1605Q	BAGRA1605Q	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AD	BAGRA1606Q	BAGRA1606Q	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AE	BAGRA605Q2	BAGRA605Q2	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AF	BAGRA605Q3	BAGRA605Q3	GNA	GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AG	BAGRA605Q4	BAGRA605Q4	GNA	GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AH	BAGRA605Q5	BAGRA605Q5	GNA	GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AI	BAGRA606Q2	BAGRA606Q2	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AJ	BAGRA606Q4	BAGRA606Q4	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AK	BAGRA606Q5	BAGRA606Q5	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
113AL	BAGRA606Q6	BAGRA606Q6	INC	INCORA	899999116-5	BAA	BONOS AGRARIOS		
211A0	BCMN197A6A	BCMN197A6A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211A8	BCMN197A5A	BCMN197A5A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211A9	BCMN197A5V	BCMN197A5V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AA	BBBO1041BV	BBBO1041BV	BBO	ECO. DE BOGOTA	860002964-4	BOR	BONOS ORDINARIOS SUBORDINADOS		
211AB	BBCB1041AV	BBCB1041AV	BCB	BCO. BANCOLOMBIA	890803938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AC	BBCB1041BV	BBCB1041BV	BCB	BCO. BANCOLOMBIA	890803938-8	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AN	BCFD196BA	BCFD196BA	DVI	BCO. DAVIVIENDA S.A	860034313-7	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AO	BCFD196BV	BCFD196BV	DVI	BCO. DAVIVIENDA S.A	860034313-7	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AP	BCFD196CA	BCFD196CA	DVI	BCO. DAVIVIENDA S.A	860034313-7	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AQ	BCFD196EA	BCFD196EA	DVI	BCO. DAVIVIENDA S.A	860034313-7	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211AR	BCFD196EV	BCFD196EV	DVI	BCO. DAVIVIENDA S.A	860034313-7	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211E1	BCMN97C7V	BCMN97C7V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211B2	BCMN97A10A	BCMN97A10A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211B3	BCMN97A10V	BCMN97A10V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211B4	BCMN97C10A	BCMN97C10A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211B5	BCMN97C10V	BCMN97C10V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BA	BCMN197A6V	BCMN197A6V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BB	BCMN197A7A	BCMN197A7A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BC	BCMN197A7V	BCMN197A7V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BD	BCMN197A8A	BCMN197A8A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BE	BCMN197A8V	BCMN197A8V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BF	BCMN197A9A	BCMN197A9A	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		
211BG	BCMN197A9V	BCMN197A9V	CSA	BCO. CAJA SOCIAL	860007335-4	BOR	BONOS ORDINARIOS		

NEMOS-ISINSEP072010.xls [Modo de compatibilidad] - Microsoft Excel

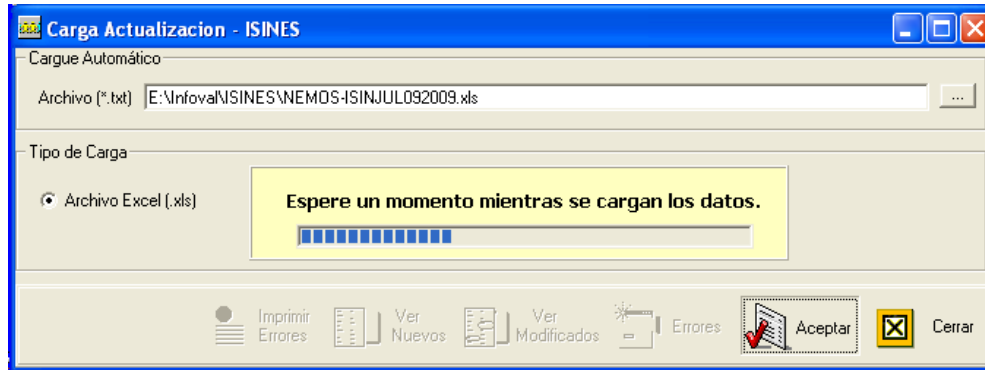
	A	B	C	D	E	F	G	H	I
1									
2									
3	NEMO NUEVO	EMI	EMISOR	NIT	TIT	TITULO	ISIN 1	ISIN 2	ISIN 3
1007	BODS1089A10	ODS	ORGANIZACION DE INGENIERIA INTERNACIONAL	ORGANIZACION DE INGENIERIA INTBOR	BONOS ORDINARIOS		COP11CB00028		
1008	BODS108810	ODS	ORGANIZACION DE INGENIERIA INTERNACIONAL	ORGANIZACION DE INGENIERIA INTBOR	BONOS ORDINARIOS		COP11CB00036		

NEMOS-ISINSEP072010.xls [Modo de compatibilidad] - Microsoft Excel

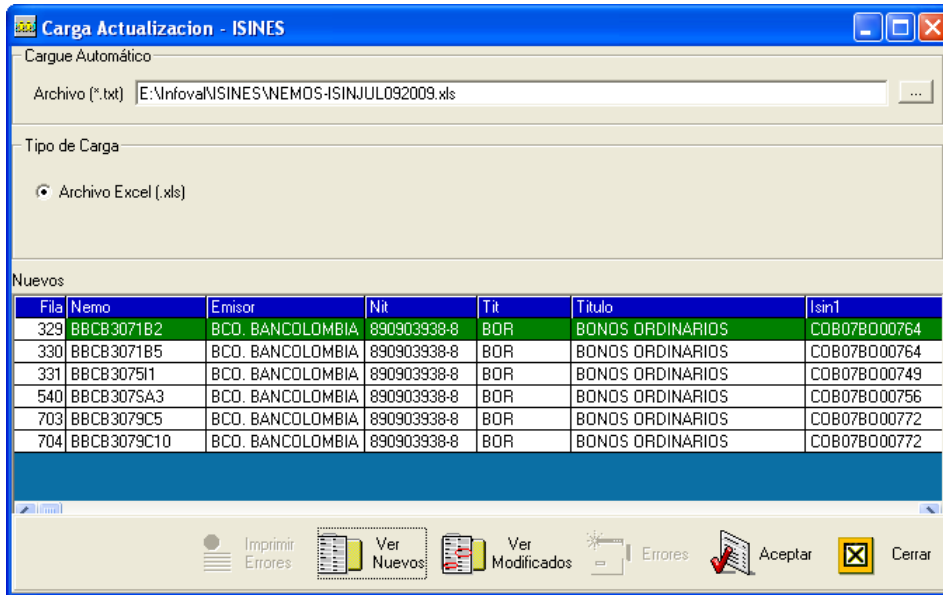
	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S
1										
2										
3	SERIE	ADMINISTRADOR	PLAZO MINIMO	PLAZO MAX	MONEDA	CUPON	TASA REFERENCIA	USO TASA ACTUAL	TASA B	PERIODICIDAD
1016	A	DVL	0	#N/A	COP		0 DTF	PREVIA		360 SV
1018	B	DVL	0	#N/A	COP		0 DTF	PREVIA		360 SV

PERIODICIDAD	REINVERSION	ESTADO	Curva Referencia	Amortizable	FECHA EMISION	FECHA VTO	Método Valoración	CLASE	TIPO TASA
4 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
5 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
6 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
7 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
8 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
9 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
10 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
11 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
12 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
13 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
124 OV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	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	NOMINAL APLIC
148 MV	NO	A		NO	15/02/2010	15/02/2012	PRECIO	NO APLICA	NOMINAL APLIC
149 MV	NO	A		NO	15/02/2010	15/02/2013	PRECIO	NO APLICA	NOMINAL APLIC
239 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
277 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 OV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
289 OA	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
290 OV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
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			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
361 TV	NO	A		NO	25/03/2010	25/03/2013	PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
378 SV	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL
391 OA	NO	A		NO			PRECIO	NO APLICA	NOMINAL

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.



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.



- 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

Especies	Especie	Emisión	Vencimiento	Modalidad	Reinversión	Moneda	Tasa Ref.	Spread	Cap	
	BBVT10200115	20/01/2005	20/01/2015	AV	NO	COP		6.52	COMPLETO	BBAV1
	BCOS04988V	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
	BWWB105CV	24/02/2005	24/02/2008	TV	NO	COP	FS	10.37	COMPLETO	BFAN1
	cdtbc10d	11/08/2004	11/11/2007	TV	NO	COP	DTF	2.05	COMPLETO	CDTBC
	CDTCLP55V	01/06/1996	01/06/2006	AV	NO	COP	FS	7.59	COMPLETO	SCMTJ
	CDTIVCS0V	29/09/2006	29/09/2007	PV	NO	COP	FS	8.33	COMPLETO	CDTME
	cdtlc10	30/07/2004	12/08/2005	PV	NO	COP	DTF	1.74	COMPLETO	hbf10
	CDTLOC10	06/08/2004	01/03/2005	PV	NO	COP	DTF	1.74	COMPLETO	TBFT1
	CDTLOYS0ND	30/11/2008	03/06/2009	PV	NO	COP	FS	10.85	COMPLETO	CDTLC
	CDTLOYS0ND	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
	SBVT10261014	26/10/2004	26/10/2014	SV	NO	COP	IPC	7.5	COMPLETO	SBAVA
	TIDISDVLO2	22/06/2005	22/06/2006	NO	NO	COP	FS	0	COMPLETO	TIDIS2
	TIDISDVLO5	23/06/2005	23/06/2006	AV	NO	COP	FS	0	COMPLETO	TIDIS5

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

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.

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.

The screenshot shows a dialog box titled "Especie Asociada - Modificar". It contains two main sections for editing associated species data.

Información de la Especie:

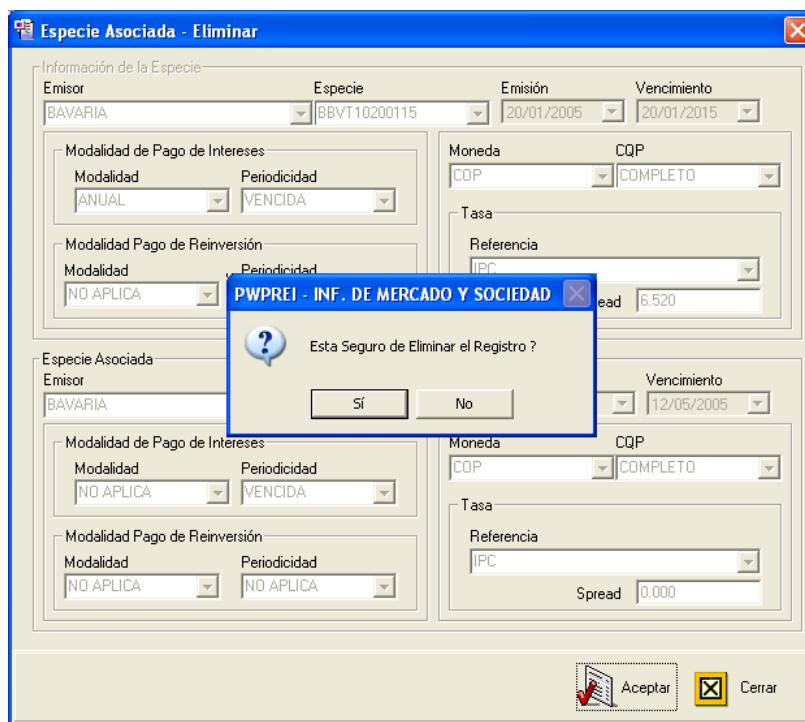
- Emisor: BAVARIA
- Especie: BBVT10200115
- Emisión: 20/01/2005
- Vencimiento: 20/01/2015
- Modalidad de Pago de Intereses: Modalidad: ANUAL, Periodicidad: VENCIDA
- Modalidad Pago de Reinversión: Modalidad: NO APLICA, Periodicidad: NO APLICA
- Moneda: COP, CQP: COMPLETO
- Tasa: Referencia: IPC, Spread: 6.520

Especie Asociada:

- Emisor: BAVARIA
- Especie: BBAV1049BV
- Emisión: 12/02/2002
- Vencimiento: 12/05/2005
- Modalidad de Pago de Intereses: Modalidad: NO APLICA, Periodicidad: VENCIDA
- Modalidad Pago de Reinversión: Modalidad: NO APLICA, Periodicidad: NO APLICA
- Moneda: COP, CQP: COMPLETO
- Tasa: Referencia: IPC, Spread: 0.000

At the bottom right, there are buttons for "Aceptar" (Accept) and "Cerrar" (Close).

2.3.4.4. ELIMINAR ESPECIES ASOCIADAS



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

The screenshot shows a software window titled "Especie Asociada - Detalle" with a close button in the top right corner. The window is divided into two main sections, each containing a form for an associated species.

Section 1: Información de la Especie

- Emisor:** BAVARIA
- Especie:** BBVT10200115
- Emisión:** 20/01/2005
- Vencimiento:** 20/01/2015
- Modalidad de Pago de Intereses:**
 - Modalidad: ANUAL
 - Periodicidad: VENCIDA
- Modalidad Pago de Reinversión:**
 - Modalidad: NO APLICA
 - Periodicidad: NO APLICA
- Moneda:** COP
- CQP:** COMPLETO
- Tasa:**
 - Referencia: IPC
 - Spread: 6.520

Section 2: Especie Asociada

- Emisor:** BAVARIA
- Especie:** BBAV1049BV
- Emisión:** 12/02/2002
- Vencimiento:** 12/05/2005
- Modalidad de Pago de Intereses:**
 - Modalidad: NO APLICA
 - Periodicidad: VENCIDA
- Modalidad Pago de Reinversión:**
 - Modalidad: NO APLICA
 - Periodicidad: NO APLICA
- Moneda:** COP
- CQP:** COMPLETO
- Tasa:**
 - Referencia: IPC
 - Spread: 0.000

At the bottom right of the window, there is a "Cerrar" button with a close icon.

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.

Especies	Especie	Emisión	Vencimiento	Modalidad	Reinversión	Moneda	Tasa Ref.	Spread	Cgp	
	TFPC05140307	14/03/2002	14/03/2007	AV	NO	COP	FS	15	CUPON	TFPC0

2.3.5.1. INGRESAR ESPECIES EQUIVALENTES

En esta opción ingrese la información de la especie equivalente.

Especie Equivalente - Ingresar

Información de la Especie

Emisor: [] Especie: [] Emisión: 12/02/2002 Vencimiento: 12/02/2002

Modalidad de Pago de Intereses: Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión: Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Moneda: CQP Tasa: [] Referencia: [] Spread: []

Especie Equivalente

Emisor: [] Especie: [] Emisión: 12/02/2002 Vencimiento: 12/02/2002

Modalidad de Pago de Intereses: Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión: Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Moneda: CQP Tasa: [] Referencia: [] Spread: []

Aceptar Cerrar

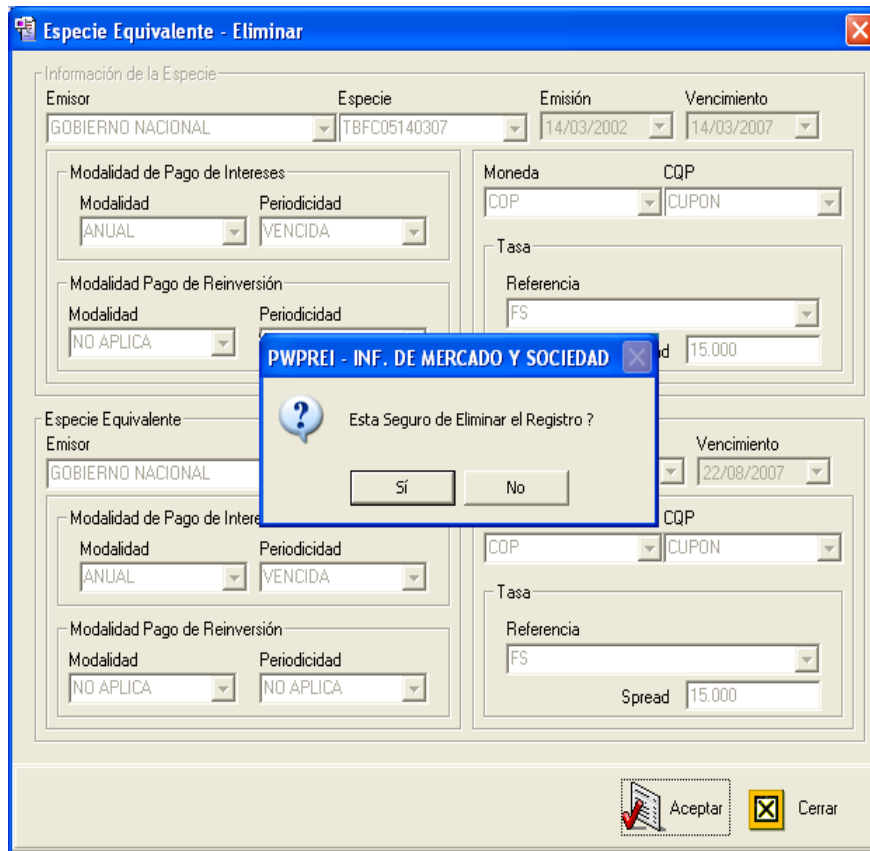
2.3.5.2. MODIFICAR ESPECIES EQUIVALENTES

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

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



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]										
Especies	Especie	Emisor	Título	Serie	Año	IsinANNA	Descripcion	FechaExpedicion	FechaVencimiento	TipoTasa
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00081	CARTERA COLECTIVA ES	20/04/2010	21/06/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00065	CARTERA COLECTIVA ES	23/04/2010	22/06/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00073	CARTERA COLECTIVA ES	26/04/2010	25/06/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00107	CARTERA COLECTIVA ES	10/05/2010	09/07/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00099	CARTERA COLECTIVA ES	14/05/2010	13/07/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00123	CARTERA COLECTIVA ES	31/05/2010	30/07/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00164	CARTERA COLECTIVA ES	01/06/2010	02/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00131	CARTERA COLECTIVA ES	10/06/2010	09/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00198	CARTERA COLECTIVA ES	15/06/2010	17/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00149	CARTERA COLECTIVA ES	18/06/2010	17/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00180	CARTERA COLECTIVA ES	21/06/2010	20/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00156	CARTERA COLECTIVA ES	28/06/2010	27/08/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00172	CARTERA COLECTIVA ES	06/07/2010	06/09/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00214	CARTERA COLECTIVA ES	13/07/2010	13/09/2010	SIN RENDIMIENTO
	AGRO60	CDR98	PT	TPOGRALF0001	GRAL	COR98PT00206	CARTERA COLECTIVA ES	23/07/2010	21/09/2010	SIN RENDIMIENTO

2.3.6.1. INGRESAR ISIN ANNA

The screenshot shows a software window titled "Isines ANNA - Ingresar". The window contains a form with the following fields:

- Datos:**
 - Isin ANNA (text box)
 - Especie (text box)
 - Emisor (text box)
 - Título (text box)
 - Serie (text box)
 - Año Emisión (text box)
 - Descripción (text box)
 - Fecha Expedición (dropdown menu, value: 10/09/2010)
 - Fecha Vencimiento (dropdown menu, value: 10/09/2010)
 - Tipo Tasa (dropdown menu)
 - Periodicidad (dropdown menu)
 - Modalidad (dropdown menu)
 - Valor Tasa (text box)
 - Tasa Referencia (dropdown menu)
 - Vigencia Inicial (text box)
 - Vigencia Final (text box)
 - Spread (text box)
 - Calendario (dropdown menu)
 - Moneda (dropdown menu)
 - Deposito (dropdown menu)
 - Código CFI (text box)
 - Tipo Registro (dropdown menu)
 - Código Super (text box)
- Buttons:**
 - Aceptar (with a red checkmark icon)
 - Cerrar (with a yellow 'X' icon)

Isin ANNA: Código asignado por la Agencia Numeradora Nacional

Emisor: Código asignado del emisor

Especie: Código de la Especie

Título: Tipo de título asignado por Metodología ANNA

Serie: Serie de la emisión en la cual fue emitido el título

Descripción: Descripción del Isin

Fecha de Expedición: Fecha de emisión del Título

Fecha Vencimiento: Fecha de vencimiento del Título

Tipo Tasa: Identifica el tipo de tasa con la que fue emitido el título (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 título es Anticipado o Vencido.

Tasa Referencia: Identifica el tipo de tasa con la que fue emitido el título

Vigencia Inicial: Periodo de tiempo Inicial en el cual se pagan intereses de un título.

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

un título

Spread: Puntos que se adicionan a la tasa para el pago de rendimientos

Calendario: Base calculo intereses equivalentes

Deposito: Código del depósito origen del título

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.

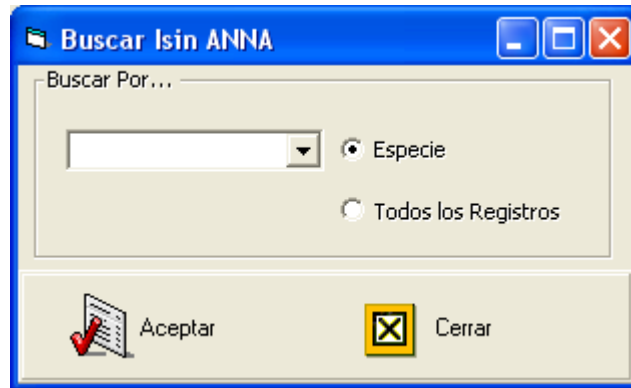
The screenshot shows a software window titled "Isines ANNA - Modificar". The window contains a form with the following fields and values:

- Datos:**
 - Isin ANNA: COA36PA00012
 - Especie: AGROCHAL
 - Emisor: COA36
 - Título: PA
 - Serie: A00G
 - Año Emisión: GRAL
 - Descripción: ACCIONES ORDINARIAS
- Fecha Expedición: 05/06/2010
- Fecha Vencimiento: 30/11/1999
- Tipo Tasa: ACCIONES
- Periodicidad: AL PLAZO
- Modalidad: SIN MODALIDAD
- Valor Tasa: 0
- Tasa Referencia: FS
- Vigencia Inicial: 99
- Vigencia Final: 99
- Spread: 0
- Calendario: 360
- Moneda: COP
- Deposito: DVL
- Código CFI: ESVUFR
- Tipo Registro: NUEVO
- Código Super: COA36PA00005

At the bottom of the window, there are two buttons: "Aceptar" (with a checkmark icon) and "Cerrar" (with a close icon).

Puede modificar todos los campos menos el Isin ANNA

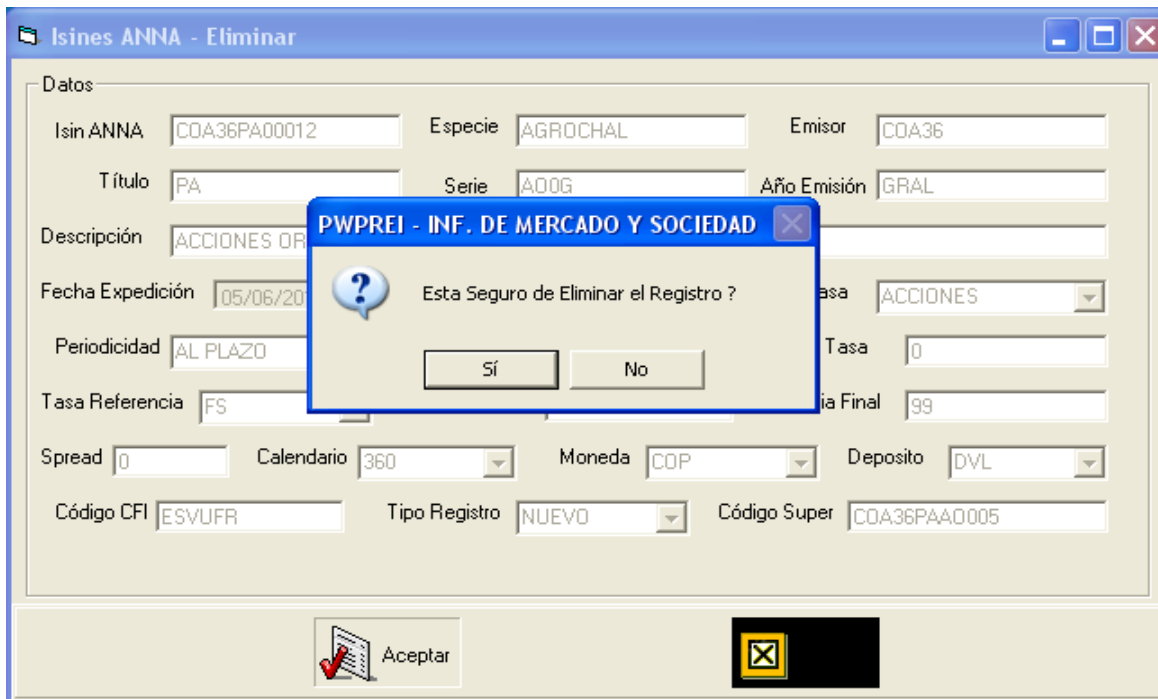
2.3.6.3. BUSCAR ISIN ANNA



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

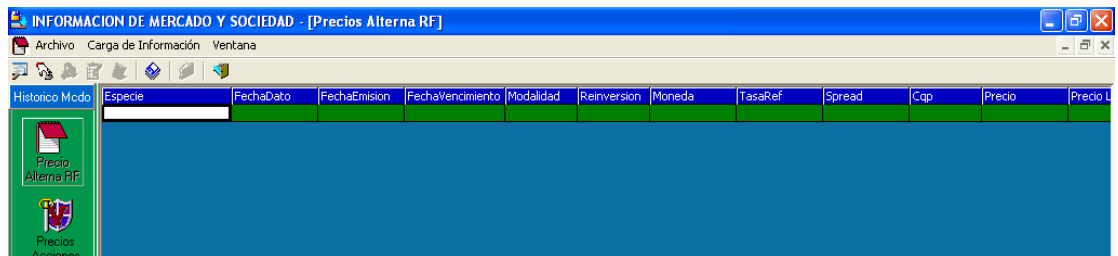


2.4. OPCIÓN HISTORICO DE MERCADO.



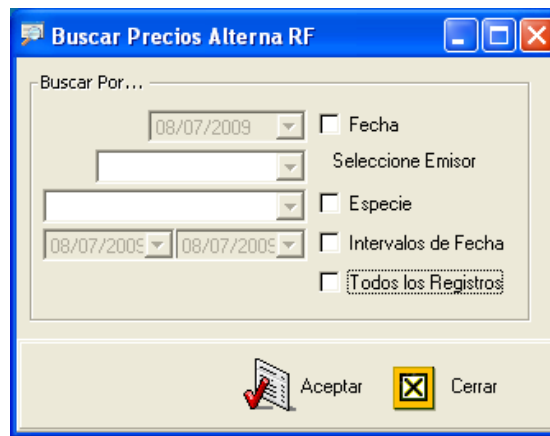
Se refiere a la Información Histórica del Mercado distinta de INFOVALMER.

2.4.1. PRECIO ALTERNA RF



Precios Históricos de Renta Fija diferente al de Infoval.

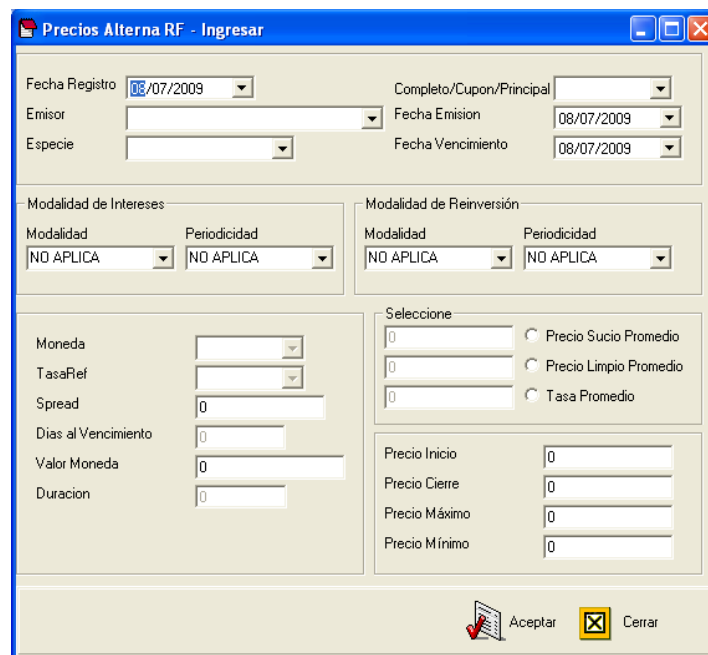
2.4.1.1. BUSCAR PRECIO ALTERNA RF



Para consultar 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.



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.

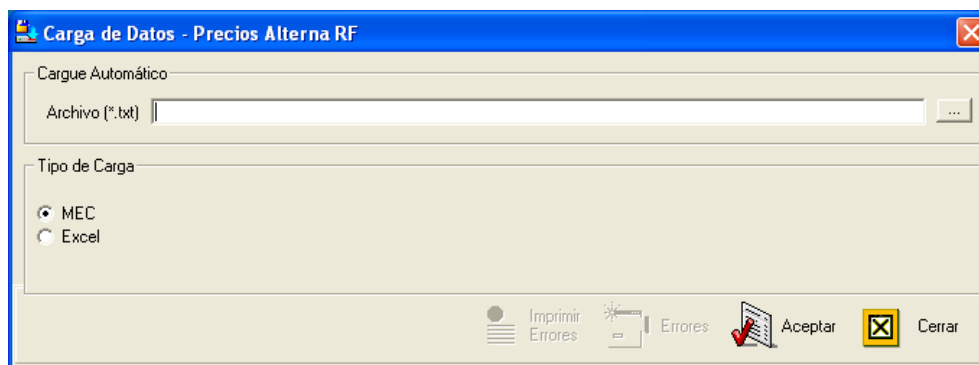
2.4.1.4. ELIMINAR PRECIOS ALTERNA RF

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



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

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Precios Acciones]					
Archivo Carga de Información Ventana					
Historico Modo	Fecha	Especie	Bursabilidad	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
	10/08/2009	BELLSOUTH	NINGUNA	2055.73	BAJA
	10/08/2009	BNA	ALTA	2273.66	ALTA
	10/08/2009	BOGOTA	MEDIA	30015.67	ALTA
	10/08/2009	BRIO	NINGUNA	366	BAJA
	10/08/2009	BVC	ALTA	26.86	ALTA
	10/08/2009	CARACOLTV	NINGUNA	691.57	BAJA
	10/08/2009	CARTON	BAJA	12636.18	BAJA
	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: 08/07/2009

Especie: []

Bursatilidad: []

Precio: []

Aceptar Cerrar

2.4.2.2. MODIFICAR PRECIOS DE ACCIONES

Precios Acciones - Modificar

Ingresar Datos

Fecha: 07/07/2009

Especie: AGROCHAL

Bursatilidad: NINGUNA

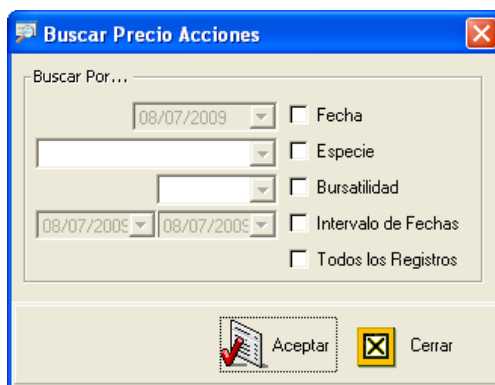
Precio: 222.16

Aceptar 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

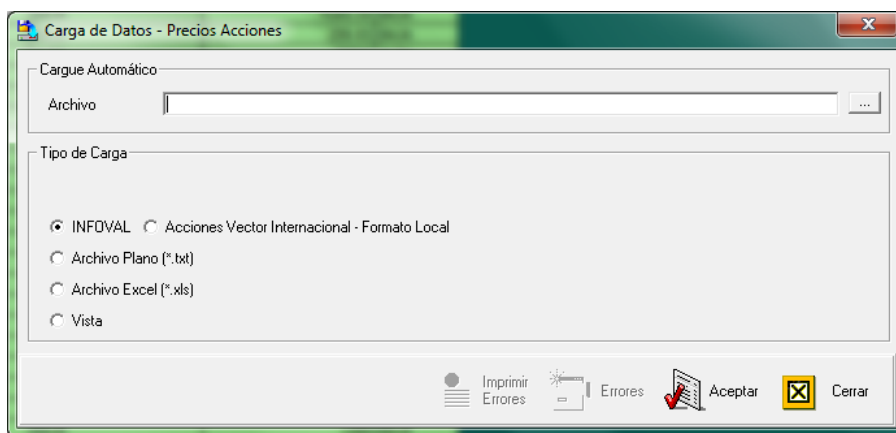
Para consultar información sobre precio de acciones, puede hacerlo por fecha, Especie, Bursatilidad, Intervalo de Fechas ó por Todos los registros.



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.

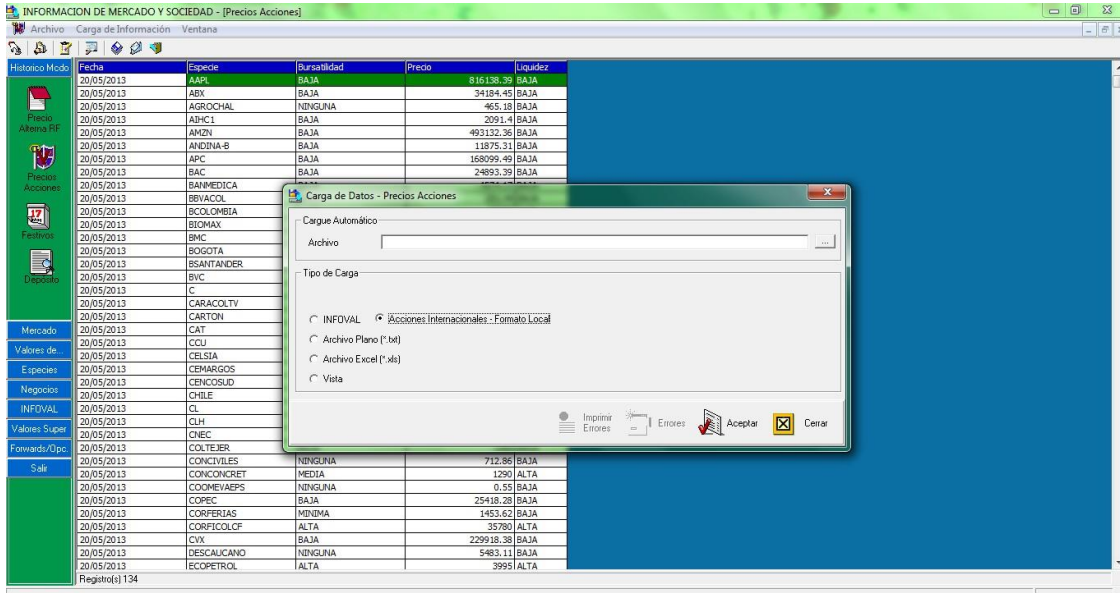
2.4.2.5. CARGA DATOS DE LOS PRECIOS DE ACCIONES



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

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



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



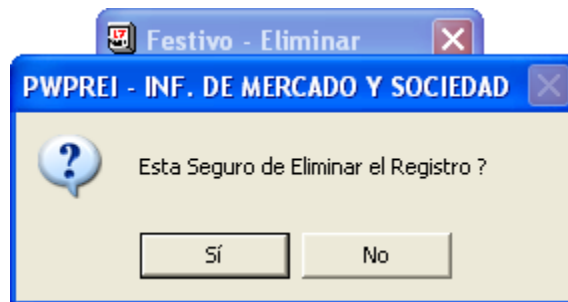
La información de festivos se puede consultar por fecha o por todos los registros, una vez se consulta la información se activan los botones de Eliminar, Detalle, Carga de Datos, Exportar a Excel.

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

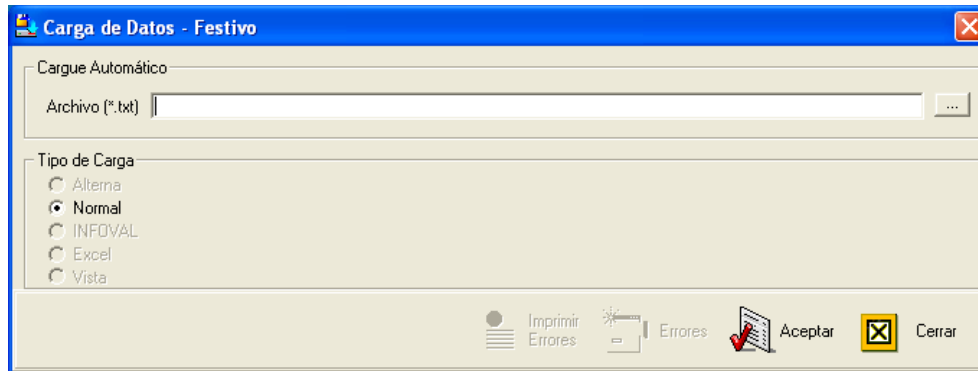


Esta opción permite ver la información de festivos, no permite modificar.

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.



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

Deposito	Descripcion	Nit
DC	DEPOSITO DCV	
DCV	DEPOSITO DCV	
DV	DECEVAL	
DVL	DECEVAL	
EX	EXTRA	
FISICO	FISICO	
NINGUN	NINGUN DEPOSITO	
OTRO	OTROS DEPOSITOS	

Se definen los depósitos de Valores

2.4.4.1. INGRESAR DEPOSITOS

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.



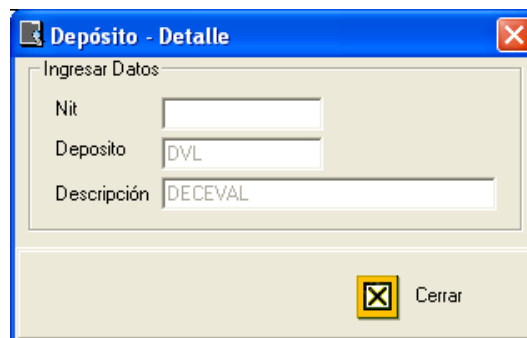
2.4.4.1. ELIMINAR DEPOSITOS

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

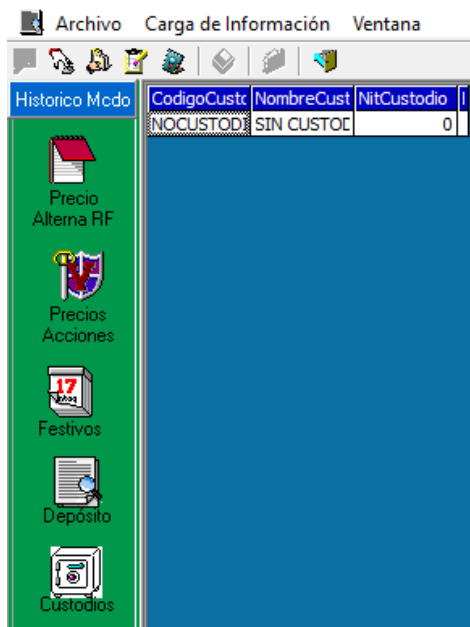


2.4.4.1. DETALLE DE DEPOSITOS

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



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.

Identificación	Apellidos y Nombres y/o Razón Social
13	AMANDA
8903229051	ASVALORES S.A. COMISIONISTA DE BOLSA
CLIMAR1	CLIENTE DE MARGEN 01
CLIMAR2	CLIENTE DE MARGEN 02
77777777777777777777	FGGGGGGFG
888	FONDO 1
30391341	Jaqueline Toro Villarreal
0001	Jota
0004	JT1
11	JUAN
12	MARTA

2.5.1.1. BUSCAR BENEFICIARIOS

Buscar Clientes

Buscar Por...

Identificación

Todos los Registros

Aceptar Cerrar

2.5.1.2. INGRESAR BENEFICIARIOS

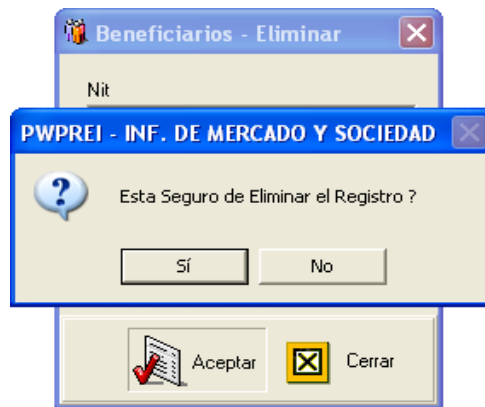
Se debe ingresar la identificación, el tipo de ID y el nombre.

2.5.1.3. MODIFICAR BENEFICIARIOS

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.

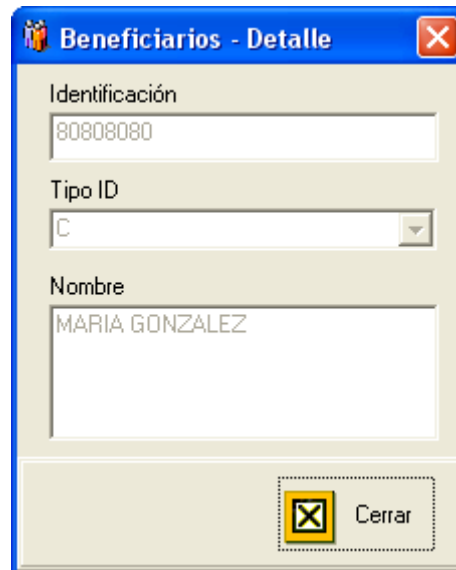
2.5.1.4. ELIMINAR BENEFICIARIOS

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



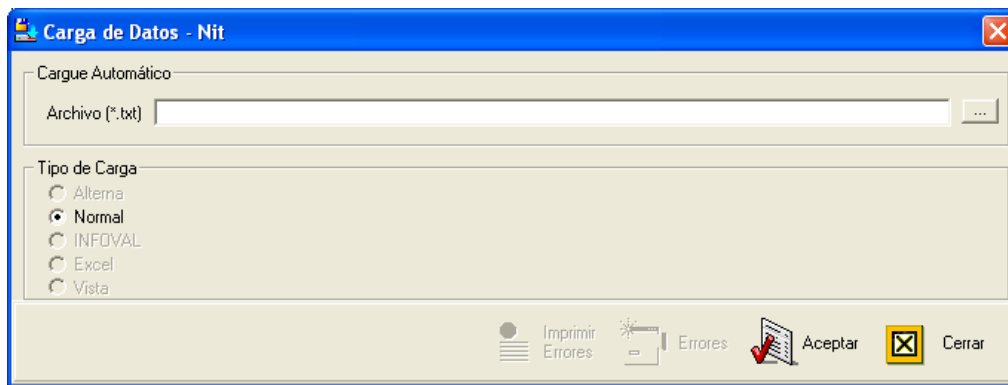
2.5.1.5. DETALLE DE BENEFICIARIOS

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



2.5.1.6. CARGA DE DATOS DE BENEFICIARIOS

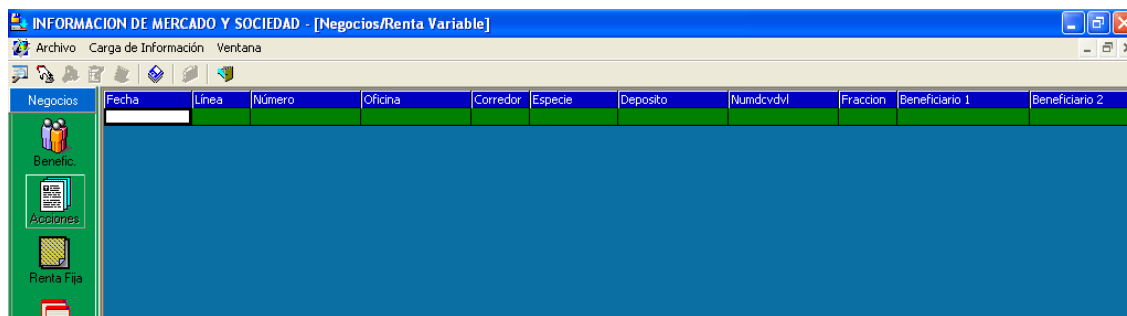
En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.



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.

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

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.

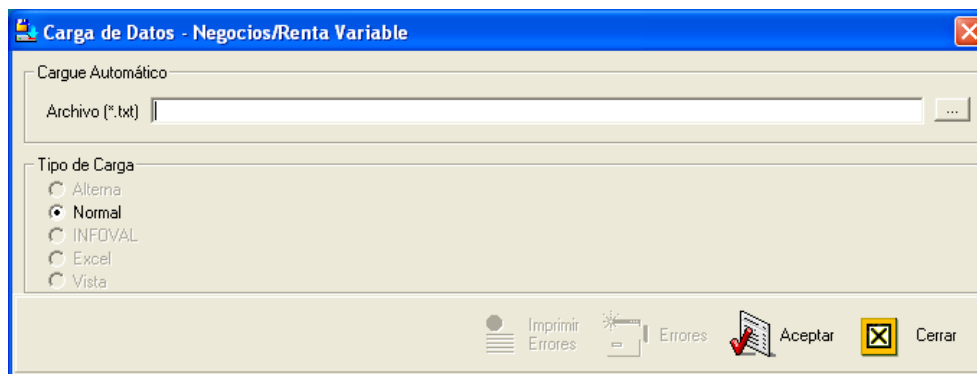
2.5.2.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE RENTA VARIABLE

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

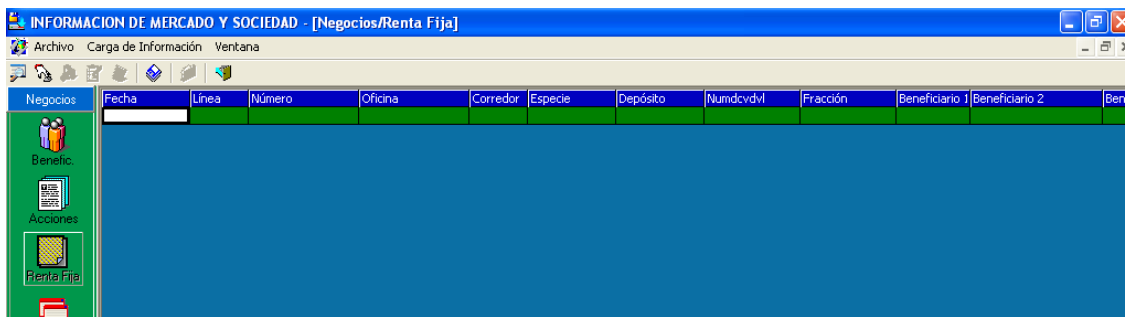


En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

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

Seleccione Emisor: [dropdown]
 Especie: [dropdown]

Fecha:
 de Emisión: 12/02/2002 [dropdown] de Vencimiento: 12/02/2002 [dropdown]
 de Negociación: 08/07/2009 [dropdown]
 Días al Vcto. a Fecha de Neg.: 0 [input]
 a Última Valoración: [input]

Beneficiarios:
 [dropdown]
 [dropdown]
 [dropdown]

Oficina: [input]
 Depósito: [dropdown] Número: [input]

Tasa Nominal: 0.000 [input]
 Tipo de Operación: [dropdown]
 Completo/Cupon/Principal: [dropdown]

Modalidad de Emisión:
 Modalidad: [dropdown] Periodicidad: [dropdown]

Modalidad de Reinversión:
 Modalidad: [dropdown] Periodicidad: [dropdown]

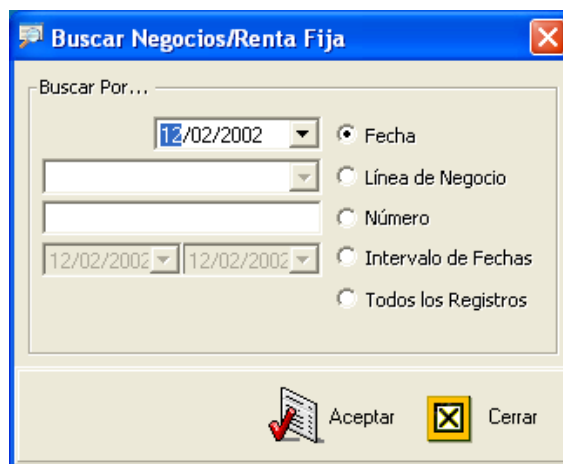
Negocio:
 Número: [input] Tasa: 0.000 [input]
 Nro. Fracción: 0 [input] Precio: 0.000 [input]
 Línea: [dropdown] Cantidad: 0.00000000 [input]
 Corredor: [dropdown] Monto: 000.00 [input]

Aceptar [icon] Cerrar [icon]

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



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.

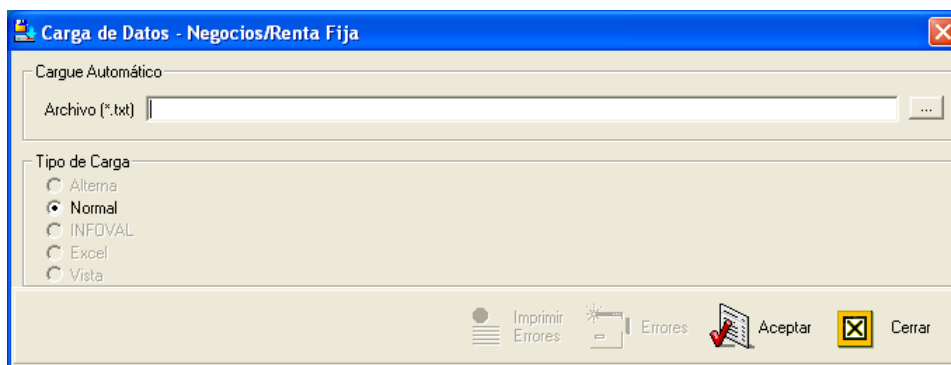
2.5.3.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE RENTA FIJA

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

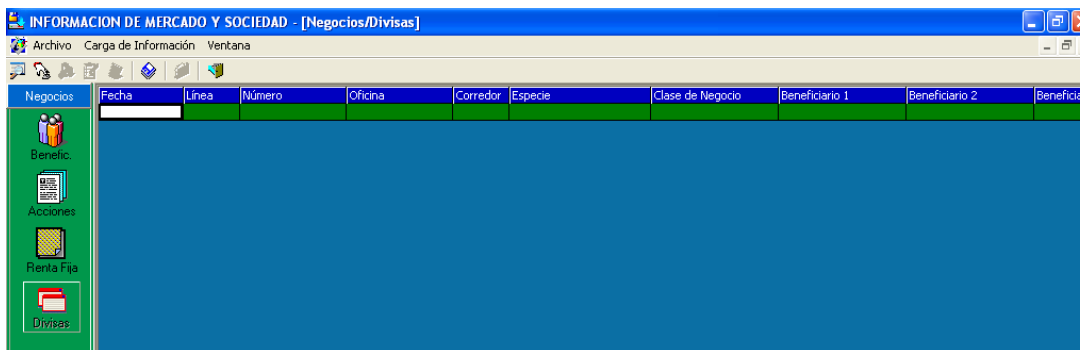
Al dar clic en la opción de Detalle aparecerá la misma pantalla mostrada anteriormente con todos los campos bloqueados y en la cual solo se podrá observar la información de la especie seleccionada. En este módulo no se pueden hacer operaciones de eliminación y modificación.

2.5.3.6. CARGA DATOS DE NEGOCIOS DE RENTA FIJA



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



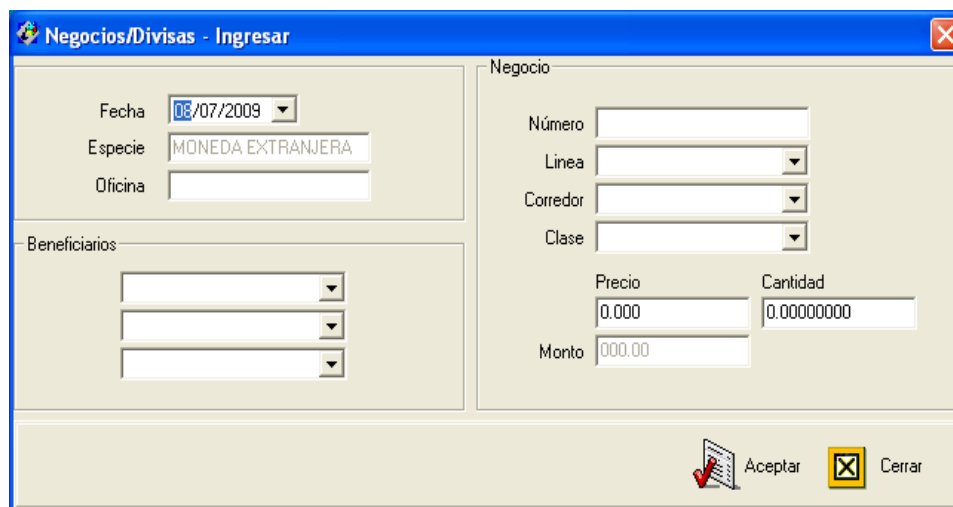
Al dar clic en esta opción aparecer la pantalla anteriormente mostrada en la cual se podrá visualizar la información respectiva a los negocios de divisas que se hayan cargado.

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.



2.5.4.2. INGRESAR NEGOCIOS DE DIVISAS



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.

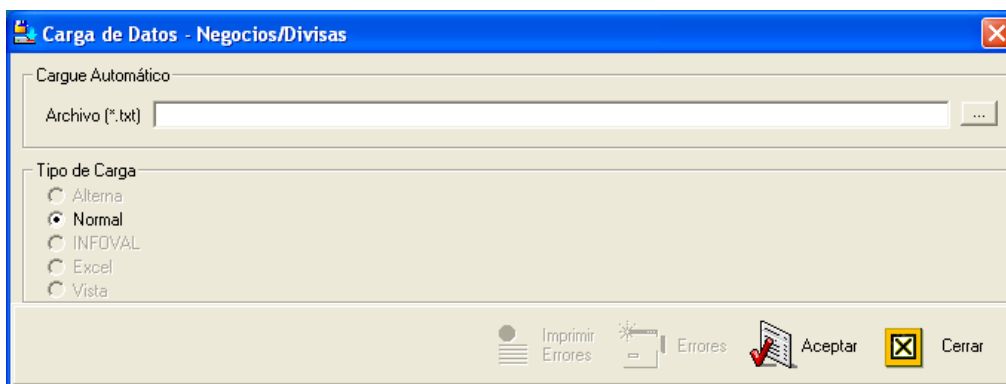
2.5.4.4. ELIMINAR NEGOCIOS DE DIVISAS

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



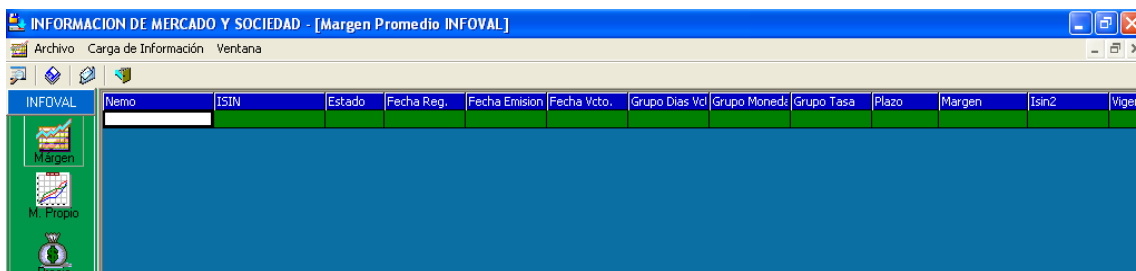
En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.6. OPCIÓN INFOVAL



En esta opción encuentra las opciones por medio de las cuales puede cargar al sistema la información que en cuanto a Tasas, Curvas, Márgenes etc. Publica la Bolsa de Valores.

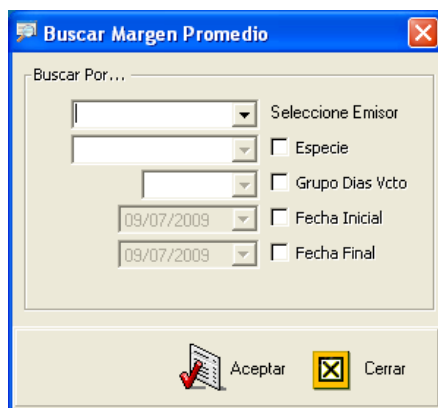
2.6.1. MARGEN PROMEDIO



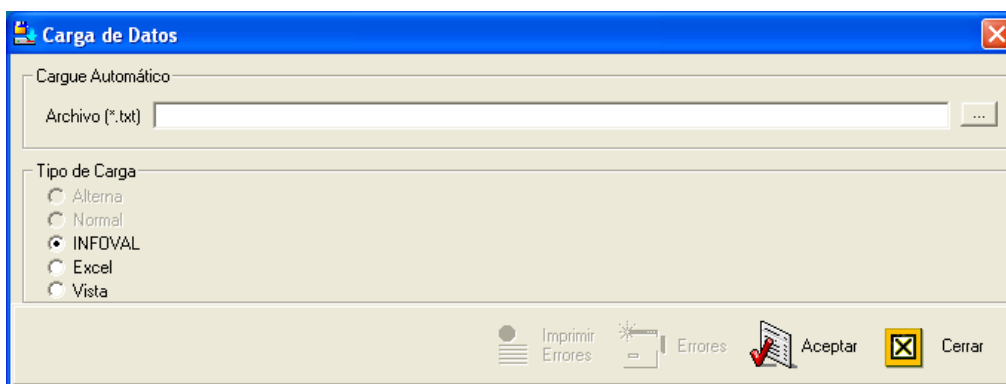
Son los márgenes de los títulos que se carga a partir de la información de Infoval.

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.



2.6.1.2. CARGAR DATOS DE MARGEN PROMEDIO



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

INFOVAL	FechaRegistro	Nivel Medido	GrupoCal	Moneda	Tasa	DiasVeto	Plazo	MargenCota	FechaVigencia	MargenPropio	Tip
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	5	2	-999.99999	2006/01/13	0.72712	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	6	2	-999.99999	2006/01/13	0.6976	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	7	2	-999.99999	2006/01/13	0.85547	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	8	2	-999.99999	2006/01/13	0.15865	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	10	2	-999.99999	2006/01/13	-0.01241	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	2	22	2	-999.99999	2006/01/13	0.0753	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	6	2	-999.99999	2006/01/13	1.64517	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	7	2	-999.99999	2006/01/13	2.53543	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	9	2	-999.99999	2006/01/13	3.8484	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	10	2	-999.99999	2006/01/13	4.98037	PRC
	2006/01/13	513 LINEA	0	1	3	11	2	-999.99999	2006/01/13	2.49971	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

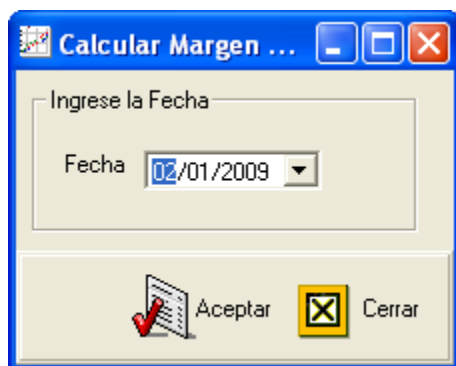
09/07/2009 Fecha Final

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

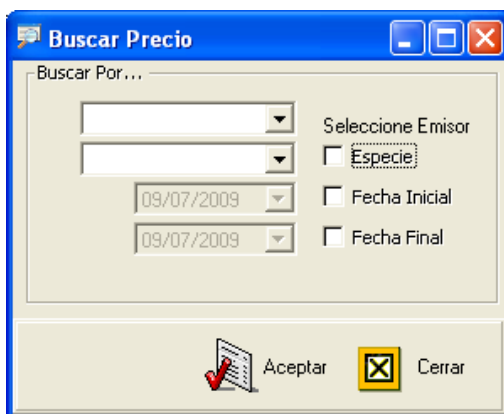
La información de margen propio, puede ser exportada a Excel para realizar diferentes informes.

2.6.3. PRECIO

El precio de cada especie se carga a partir de la información de Infoval.

INFOVAL	Especie	ISIN	Fecha Reg.	Fecha Emision	Fecha Vcto.	Modalidad	Dias Vcto.	Moneda	Tipo Tasa	Spread	Fecha Cierre	Precio Cierre
	BBCE1071B24V	CO8078000699	08/07/2009	26/09/2007	26/09/2009	TV	80	COP	3	2.2		100.7
	BBCE405985A	CO831800277	08/07/2009	22/09/2005	22/09/2010	TV	441	COP	3	3.25		100.2
	BBGA108860A	CO8138000465	08/07/2009	26/08/2008	26/08/2013	TV	1509	COP	3	6.2		106.1
	BCAF108D5	COC308000020	08/07/2009	16/12/2008	16/12/2013	SV	1621	COP	1	11.25		109.5
	BCCB109A5	COH048000024	08/07/2009	28/04/2009	28/04/2014	AV	1754	COP	1	9.7		102.2
	BDV11089G5	CO8518000853	08/07/2009	05/08/2008	05/08/2013	TV	1488	COP	3	6.24		107.3
	BEMG1099B12	COI148000088	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2021	TV	4374	COP	3	6.1		100.7
	BEMG1099B9	COI148000088	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2018	TV	3279	COP	3	5.9		101.2
	BEMG1099E5	COI148000096	08/07/2009	02/07/2009	02/07/2014	AV	1819	COP	1	9.27		101.3
	CDTBCB50VD	CO807CT02890	08/07/2009	29/04/2009	29/09/2009	PV	83	COP	1	7.39		101.8
	CDTBCB50VD	CO807CT02890	08/07/2009	30/04/2009	30/10/2009	PV	114	COP	1	7.509		102.0
	CDTBCB50VD	CO823CT03010	08/07/2009	22/01/2009	22/07/2010	PV	379	COP	1	10.8236		109.6

2.6.3.1. BUSCAR PRECIO



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.

Seleccione Emisor	<input type="text"/>	Fecha de Emision	12/02/2002
Especie	<input type="text"/>	Fecha de Vencimiento	12/02/2002
Estado	<input type="text"/>	ISIN	<input type="text"/>
Fecha de Registro	09/07/2009	Numero Emisor	0
Modalidad de Intereses			
Modalidad	<input type="text"/>	Periodicidad	<input type="text"/>
Moneda	<input type="text"/>	ISIN2	0
Tasa Ref.	0	ISIN3	0
Spread	0	Dias Vencimiento	0
Precio	0	Vigente	SI
Precio Limpio	0	Fecha Vigencia	12/02/2002

2.6.3.3. MODIFICAR PRECIO

Precio - Modificar

Seleccione Emisor		Fecha de Emision	26/09/2007
Especie	BBCB1071B24V	Fecha de Vencimiento	26/09/2009
Estado	ACTIVO	ISIN	COB07B000699
Fecha de Registro	08/07/2009	Numero Emisor	0
Modalidad de Intereses			
Modalidad	TRIMESTRAL	Periodicidad	VENCIDA
Moneda	COP	ISIN2	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

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 - Eliminar

Seleccione Emisor		Fecha de Emision	26/09/2007
Especie	BBCB1071B24V	Fecha de Vencimiento	26/09/2009
Estado	A	ISIN	COB07B000699
Fecha de Registro	08/07/2009	Numero Emisor	0
Modalidad de Intereses			
Modalidad	TRIMES	Periodicidad	VENCIDA
Moneda	COP	ISIN3	0
Tasa Ref.	DTF	Dias Vencimiento	80
Spread	2.2	Vigente	SI
Precio	100.775	Fecha Vigencia	08/07/2009
Precio Limpio	100.775		

Carga de Información - DiasVen

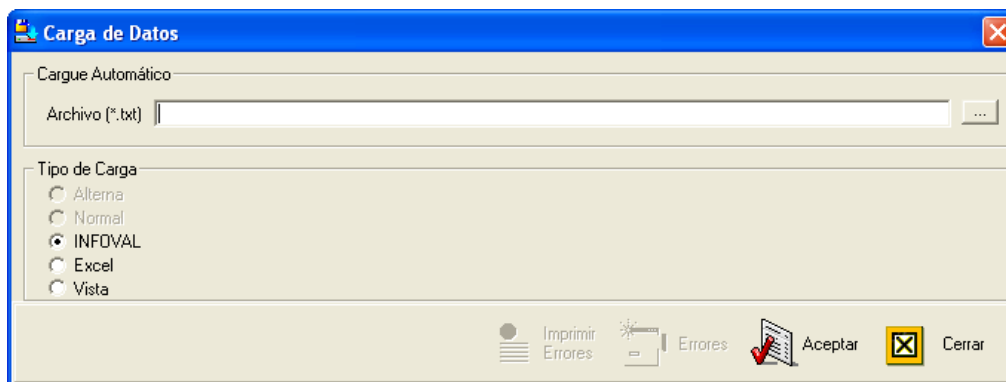
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?

Sí No

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



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

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Curvas INFOVAL]					
Archivo Carga de Información Ventana					
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
	08/07/2009	CEC	5709	0	9.5392
	08/07/2009	CECUVR	5709	0	5.3593
	08/07/2009	CEC	5710	0	9.5391
	08/07/2009	CECUVR	5710	0	5.3594
	08/07/2009	CEC	5711	0	9.539
	08/07/2009	CECUVR	5711	0	5.3594
	08/07/2009	CEC	5712	0	9.5389
	08/07/2009	CECUVR	5712	0	5.3594
	08/07/2009	CEC	5713	0	9.5387
	08/07/2009	CECUVR	5713	0	5.3594
	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

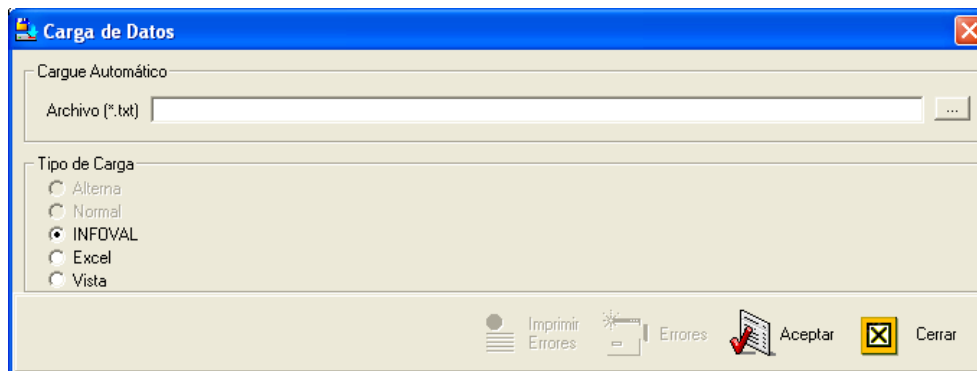
presentan precios de cotización, sino solamente margen.

2.6.4.1. BUSCAR CURVA CERO CUPON



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



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 puede ser exportada a Excel para manejos de informes.

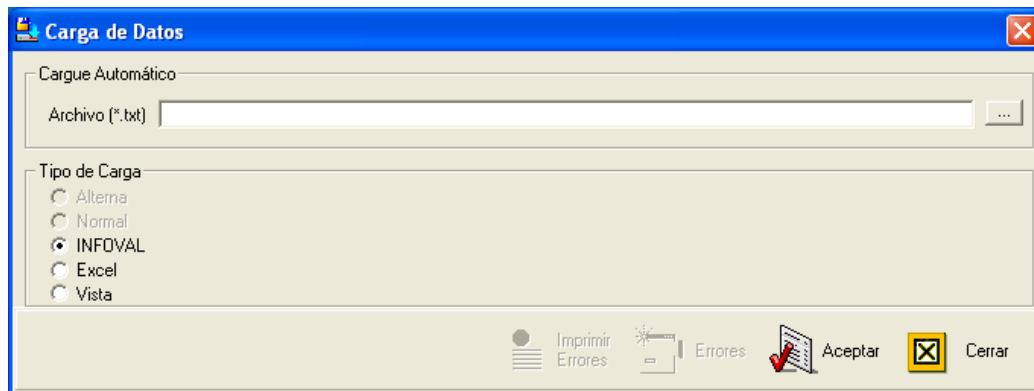
2.6.5. BETAS

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
08/07/2009	CRCDT	5.638294	-0.766596	5.702955	1.631462

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



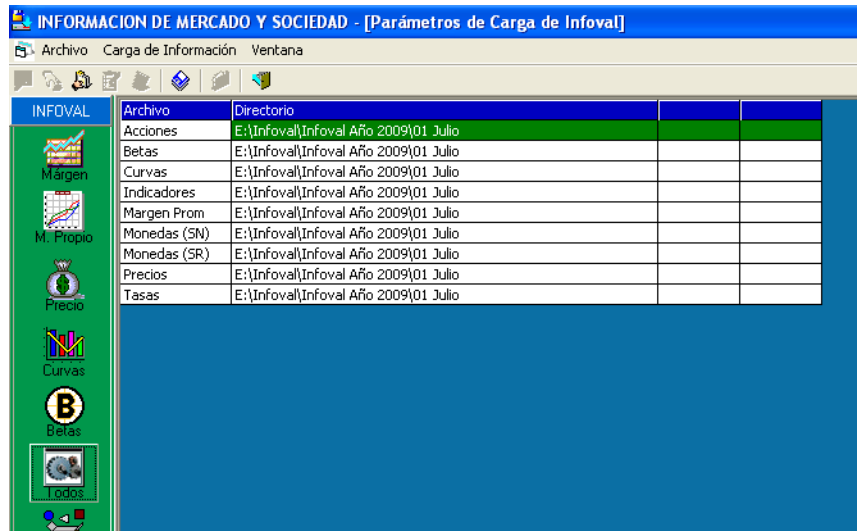
En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar. El punto **2.2.1.1.6** tiene una mejor explicación de cómo es la Carga de Datos.

2.6.5.3. EXPORTAR A EXCEL BETAS

Con esta opción puede cargar la información de betas en Excel, para ser utilizada

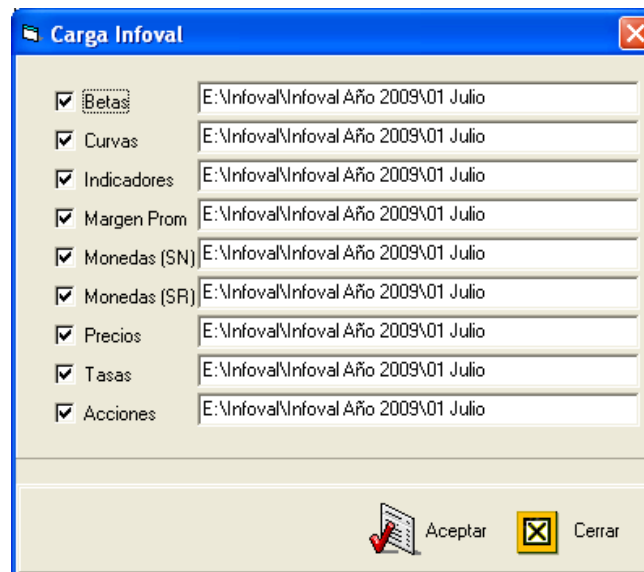
en diversos informes.

2.6.6. PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL / TODOS



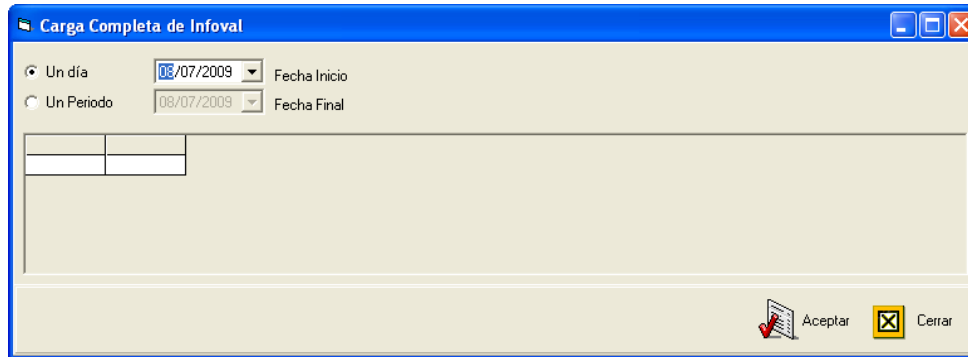
Es la Carga de Todos los archivos de Infoval una vez hayan sido descargados de la pagina Web de Infoval.

2.6.6.1. MODIFICAR PARAMETROS DE CARGA DE INFOVAL



En cada una de las casillas se debe colocar la ubicación de donde se encuentran los archivos descargados desde la página Web de Infoval.

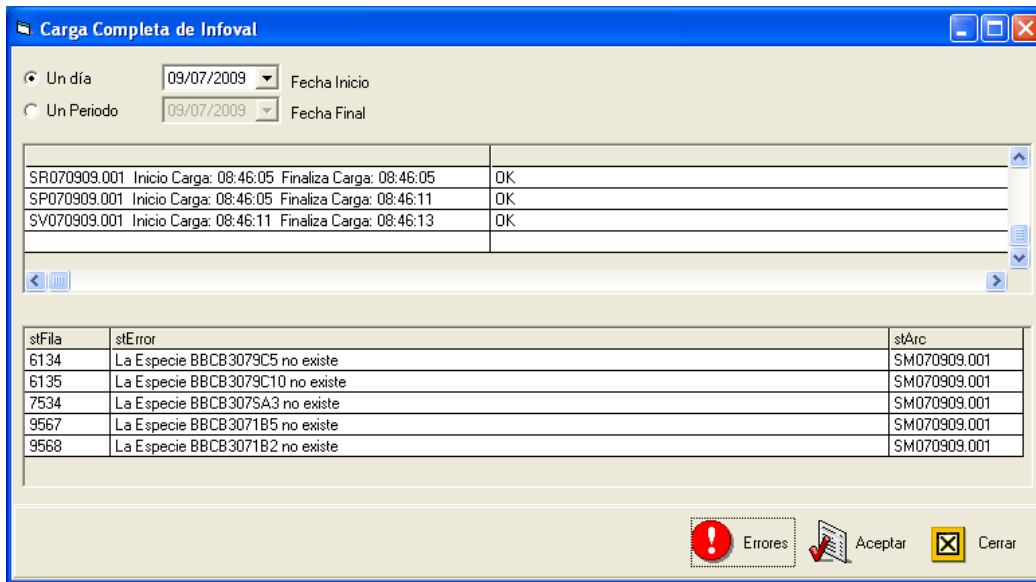
2.6.6.2. CARGAR DATOS DE PARAMETROS DE INFOVAL



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.



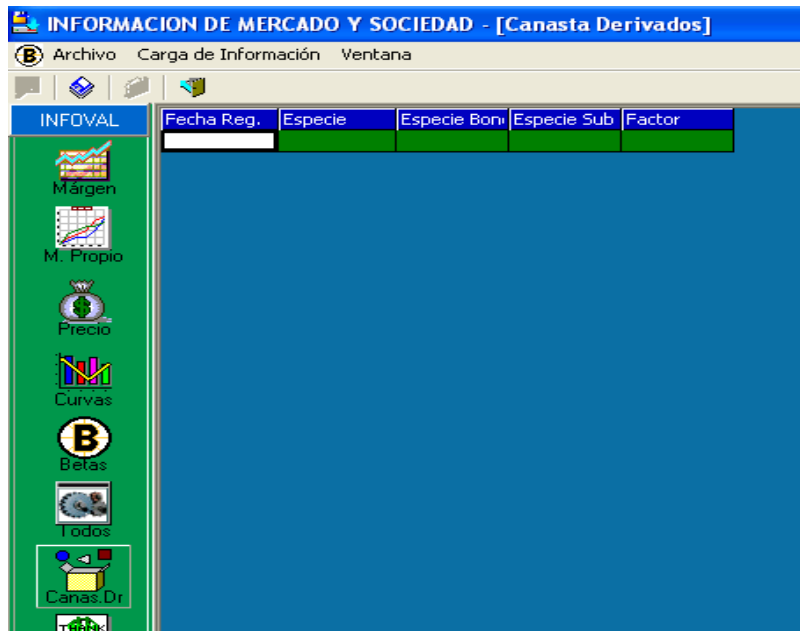
Se debe dar aceptar y presionar el botón Errores que se encuentra habilitado.



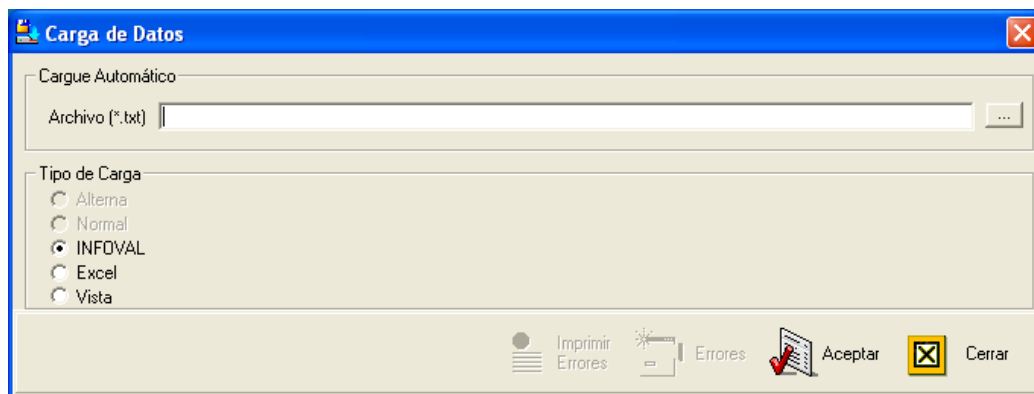
Esta imagen muestra cuales son las especies que faltan por cargar. Para solucionar este error debe descargar los ISINES y NEMOS de la página de Infoval las cuales contienen la respectiva información y luego cargar en Especies ISINES.

2.6.7. CANASTA DERIVADOS

Es la lista de especies que conforman los contratos de derivados.

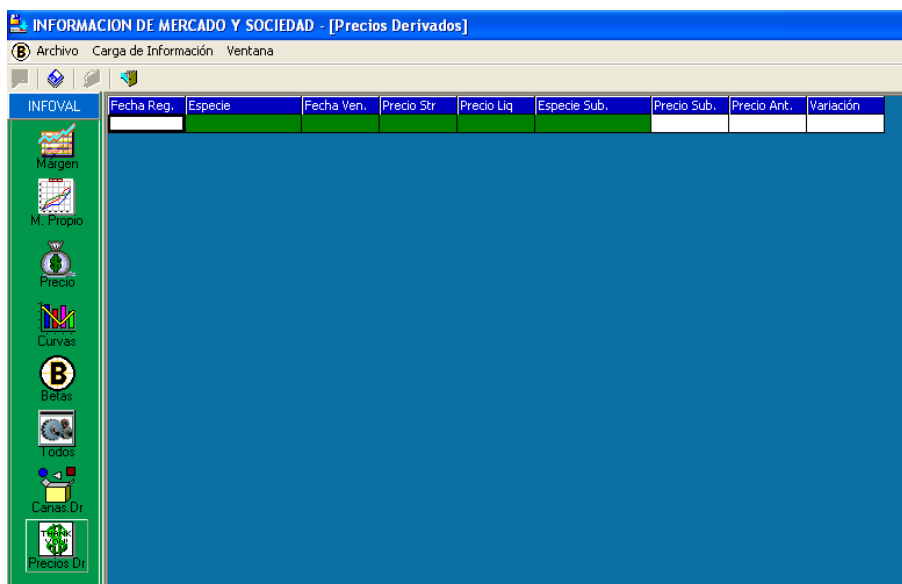


2.6.7.1. CARGA DE DATOS DE CANASTA DERIVADOS



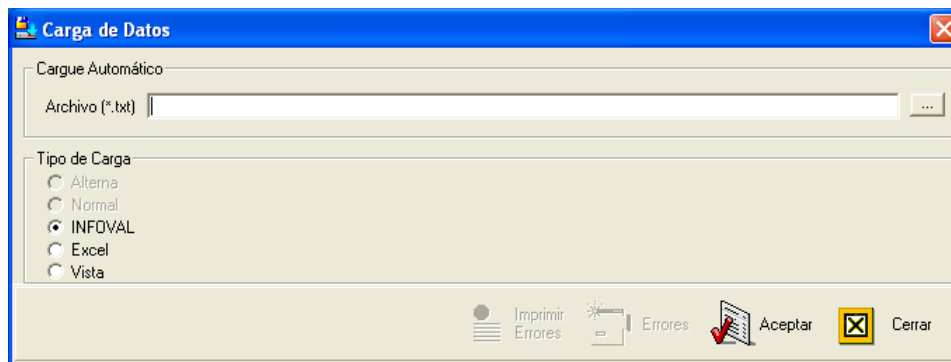
En el Botón que tiene tres puntos se escoge el Documento que se desea cargar.

2.6.8. PRECIOS DERIVADOS



Es la lista que conforman los precios de los Productos derivados.

2.6.8.1. CARGA DE DATOS DE PRECIOS DERIVADOS



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:

- 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

Valores Super	Fecha	Factor	Valor 10 Días	Valor 1 Año
	02/10/2003	DTF	30	126
	02/10/2003	Tasa de Repos	250	0
	02/10/2003	Tasa Interbancaria	135	0
	02/10/2003	Tasa Real	3.33	12.4
	02/10/2003	Libor	6.86	41.18
	02/10/2003	Tasa Credito Consumo	222	0
	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
	02/10/2003	EURO	5.45	0
	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 Factores - Ingresar

Ingresar Datos

Fecha: 02/07/2009

Factor: [Dropdown]

Valor Dias: [Text Box]

Valor Año: [Text Box]

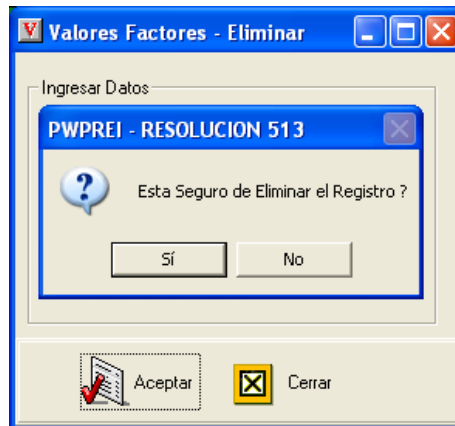
Acceptar Cerrar

2.7.1.2. MODIFICAR VALORES DE FACTORES



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



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.

Valores Super	Fecha	Factor	Valor1	Valor2	Valor3	Valor4	Valor5	Valor6	Valor7	Valor8	Valor9	Valor10	Va
	01/08/2003	-1	0	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	
	01/08/2003	2	0.925	1	0.973	0.612	0.845	0.961	0.843	0.647	0.86	-0.27	
	01/08/2003	3	0.948	0.973	1	0.627	0.857	0.962	0.858	0.654	0.898	-0.259	
	01/08/2003	4	0.804	0.612	0.627	1	0.613	0.676	0.617	0.499	0.424	-0.781	
	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	
	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

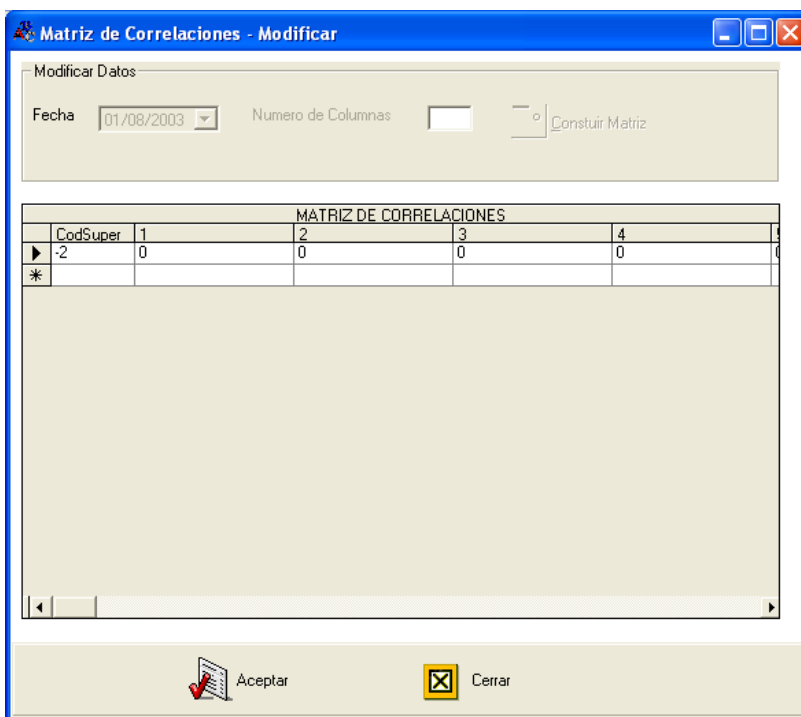
Fecha: 03/07/2009 Numero de Columnas: Constuir Matriz

MATRIZ DE CORRELACIONES

*			
---	--	--	--

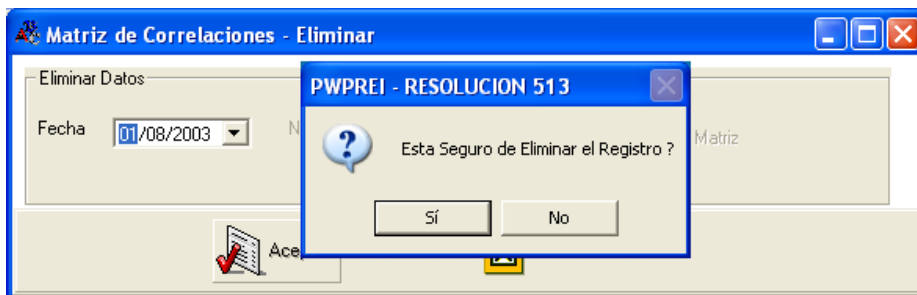
Aceptar Cerrar

- **MODIFICAR MATRIZ DE CORRELACION**



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



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.

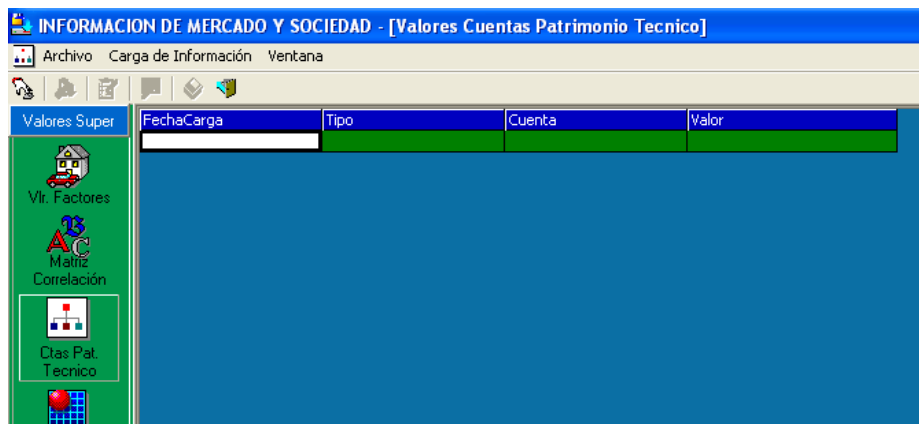
2.7.2.3. BUSCAR MATRIZ DE CORRELACION

La información sobre la Matriz de Correlación se puede consultar por una fecha específica o por todos los registros.

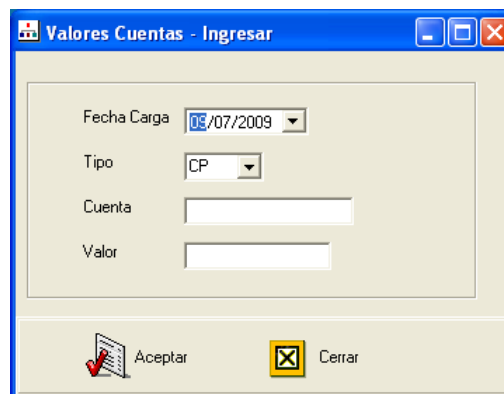


2.7.3. CUENTAS PATRIMONIO TECNICO

En esta opción se registran todas las cuentas del patrimonio técnico, estas cuentas se utilizan para calcular el nivel de solvencia.



2.7.3.1. INGRESAR CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO



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).

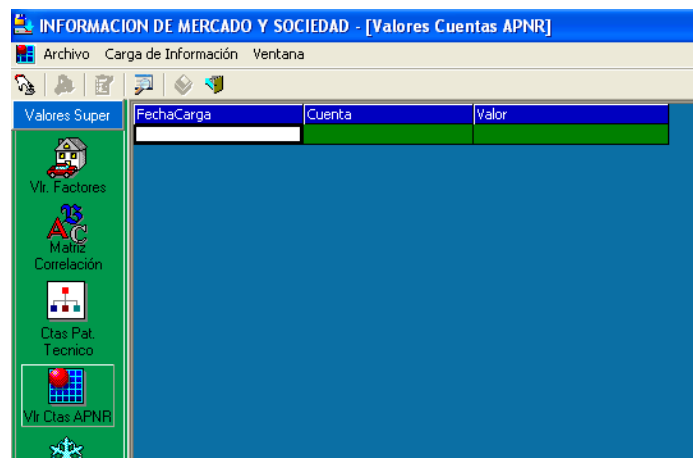
2.7.3.5. CARGA DATOS DE CUENTA DE PATRIMONIO TECNICO

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



The screenshot shows a dialog box titled "Valores Cuentas - Ingresar". It has a blue title bar with standard window controls. The main area is light beige and contains three input fields: "Fecha Carga" with a dropdown menu showing "09/07/2009", "Cuenta" with an empty text box, and "Valor" with an empty text box. At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

Ingrese los valores correspondientes a la Fecha de Carga, la cuenta y el valor.

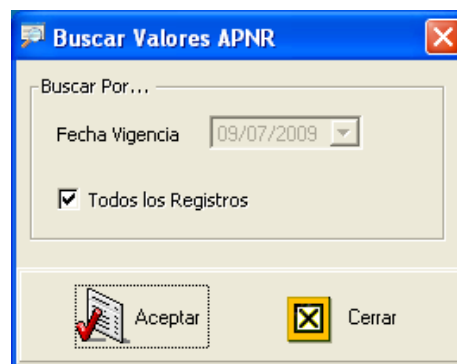
2.7.4.2. MODIFICAR VALORES CUENTA APNR

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



The screenshot shows a dialog box titled "Buscar Valores APNR". It has a blue title bar with a close button. The main area is light beige and contains a "Buscar Por..." dropdown menu, a "Fecha Vigencia" dropdown menu showing "09/07/2009", and a checked checkbox labeled "Todos los Registros". At the bottom, there are two buttons: "Aceptar" with a red checkmark icon and "Cerrar" with a yellow 'X' icon.

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.

INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Datos Netos]

Archivo Carga de Información Ventana

Valores Super	Fecha Dato	PatTecnico	APNR	Rle	R.Derivados
	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
	18/04/2007	\$ 100,000,000.0	\$ 1,236.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	25/04/2007	\$ 100,000,000.0	\$ 1,236.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	29/06/2007	\$ 100,000,000.0	\$ 1,236.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	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
	17/12/2007	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	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
	30/06/2008	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	05/12/2008	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$ 0.0	\$ 0.0
	31/12/2008	\$ 1,000,000,000.0	\$ 500,000,000.0	\$ 0.0	\$ 0.0

2.7.5.1. INGRESAR DATOS NETOS

Datos Netos - Ingresar

Ingresar Datos

Fecha Carga: 06/07/2009

PatTecnico:

APNR:

Rle:

Riesgo Derivados:

La información perteneciente a los datos netos puede ser registrada de manera

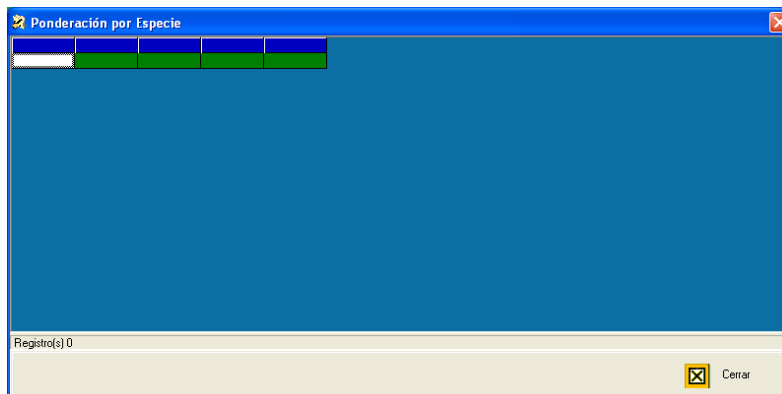
manual digitando la fecha de carga, el Patrimonio Técnico, el valor de los Activos Ponderados por nivel de riesgo, el Riesgo de Liquidez y el Riesgo de Derivados. Una vez digitada esta información puede dar clic en el botón APNR el cual le mostrará la ponderación por especie de cada título que conforma el portafolio.

2.7.5.2. MODIFICAR DATOS NETOS

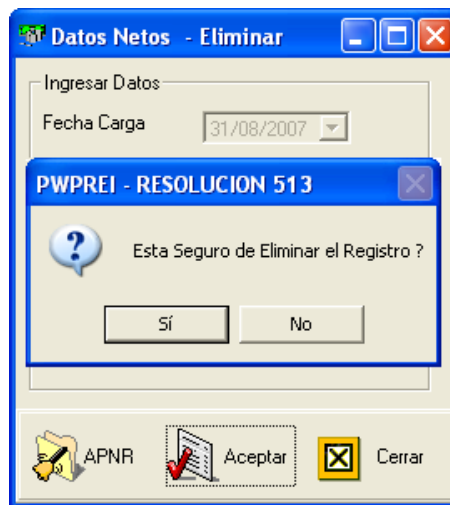
En esta opción puede modificar toda la información correspondiente a valores, la fecha de carga no se puede modificar.



Al presionar el Botón APNR aparece la siguiente tabla.



2.7.5.3. ELIMINAR DATOS NETOS



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.



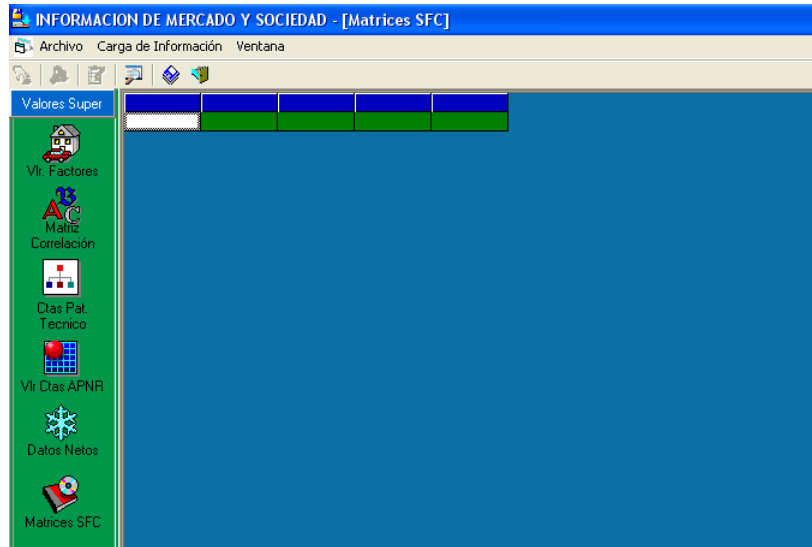
2.7.5.5. CALCULAR DATOS NETOS



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



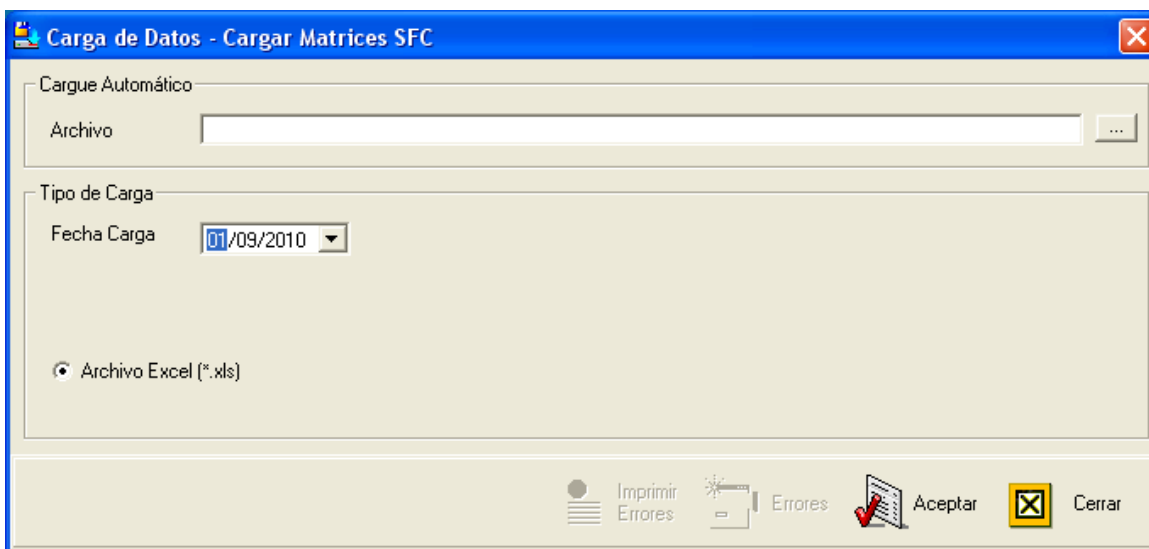
Las Matrices de la SF son los valores de los factores de riesgo y las correlaciones para el cálculo del riesgo de mercado de las carteras colectivas.

2.7.6.1. BUSCAR MATRICES SFC



Si desea buscar debe seleccionar la Fecha de Vigencia y la Matriz que desea ver.

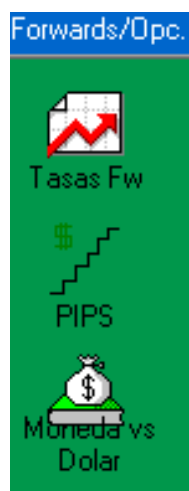
2.7.6.2. CARGAR DATOS MATRICES SFC



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

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
	2010/05/06	IBR	30	2.7
	2010/05/06	LIB1	1	1.8
	2010/05/06	LIB1	30	2.2
	2010/05/06	LIB1	360	12.7
	2010/05/07	IBR	1	2
	2010/05/07	IBR	7	2.23
	2010/05/07	IBR	15	2.5
	2010/05/07	IBR	30	2.8
	2010/05/07	LIB1	1	1.9
	2010/05/07	LIB1	30	2.3
	2010/05/07	LIB1	360	12.86
	2010/05/08	IBR	1	1.9
	2010/05/08	IBR	30	2.1
	2010/05/08	LIB1	270	2.8
	2010/05/08	LIB1	360	2.9
	2010/05/08	LIB1	9999	3.257
	2010/05/08	LIB1	99999	3.015

Son las Tasas internas y externas para determinar el precio de los Forwards

2.8.1.1. BUSCAR TASAS FORWARD

Buscar Por...

FechaVigencia 05/07/2009

Dias 0

Todos los Registros

Aceptar Cerrar

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)

Tasas Forward/Vain - Ing...

Fecha: 08/05/2010

Tasa: [Empty]

Plazo: 0

Digite la Tasa para los días

Tasa (EFFECTIVA): 0

Aceptar Cerrar

2.8.1.3. MODIFICAR TASAS FORWARD

Tasas Forward/Vain - Mo...

Fecha: 06/05/2010

Tasa: LIB1

Plazo: 1

Digite la Tasa para los días

Tasa (EFFECTIVA): 1.8

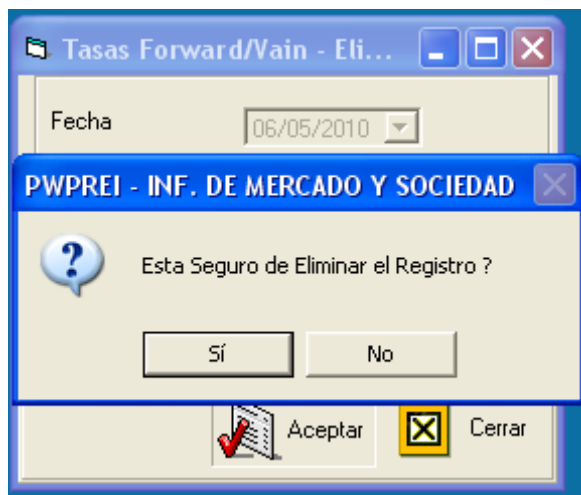
Aceptar Cerrar

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.

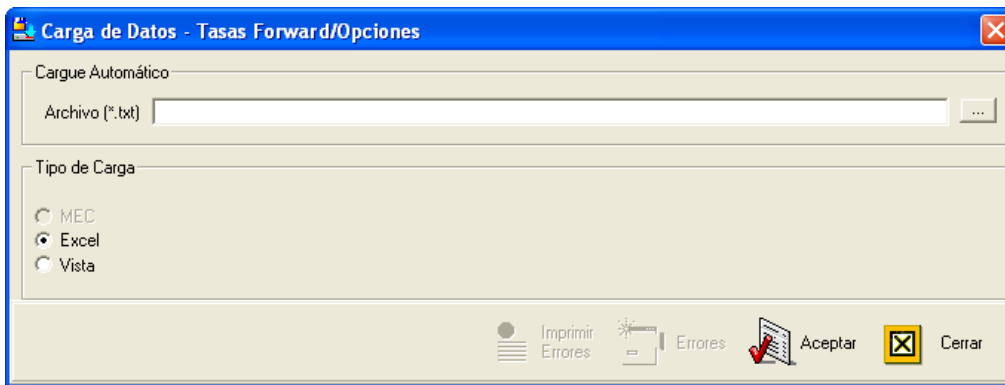


2.8.1.5. DETALLE TASAS FORWARD



Esta opción es solo informativa, no se puede modificar ningún campo.

2.8.1.6. CARGA DATOS DE TASAS FORWARD



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.

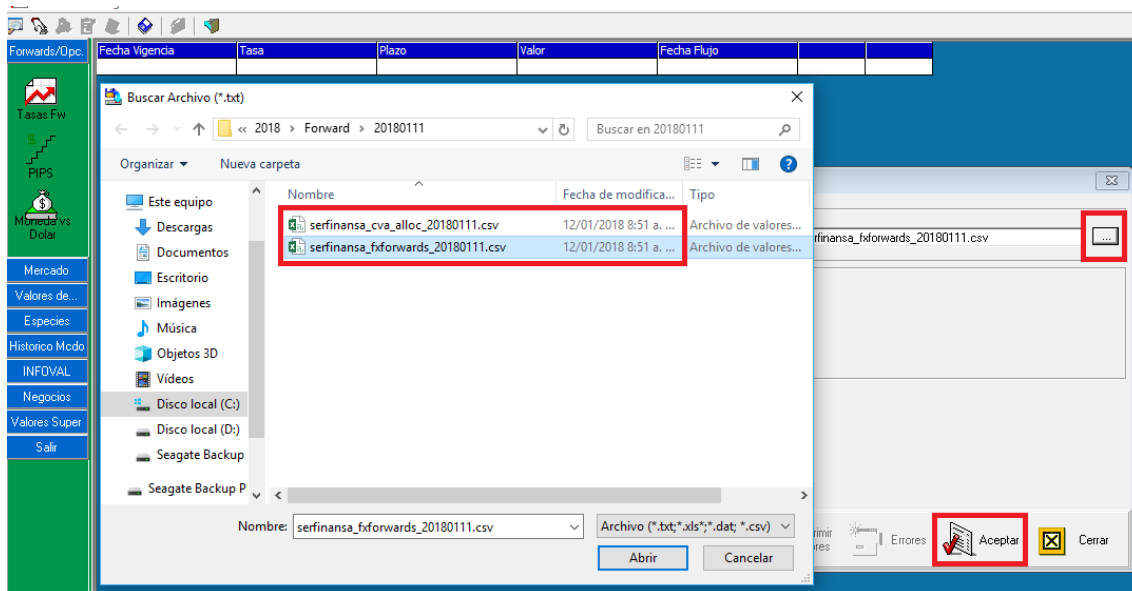
NOTAS OPERATIVAS – VALORAR FORWARD POR PRECIO PPV

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

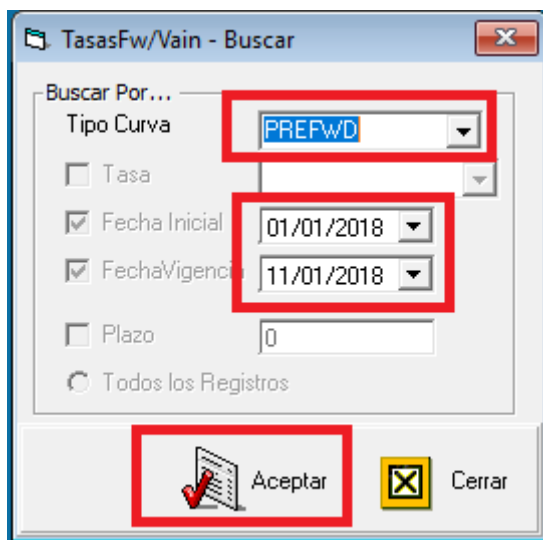
de negocio en PWPREI de cada forward con el número de operación con el que se lo publica su PPV. Utilice la plantilla "RelFwd_NumNeg.xls" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls" de PWPREI.

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):



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:



INFORMACION DE MERCADO Y SOCIEDAD - [Tasas Forward/Vain]

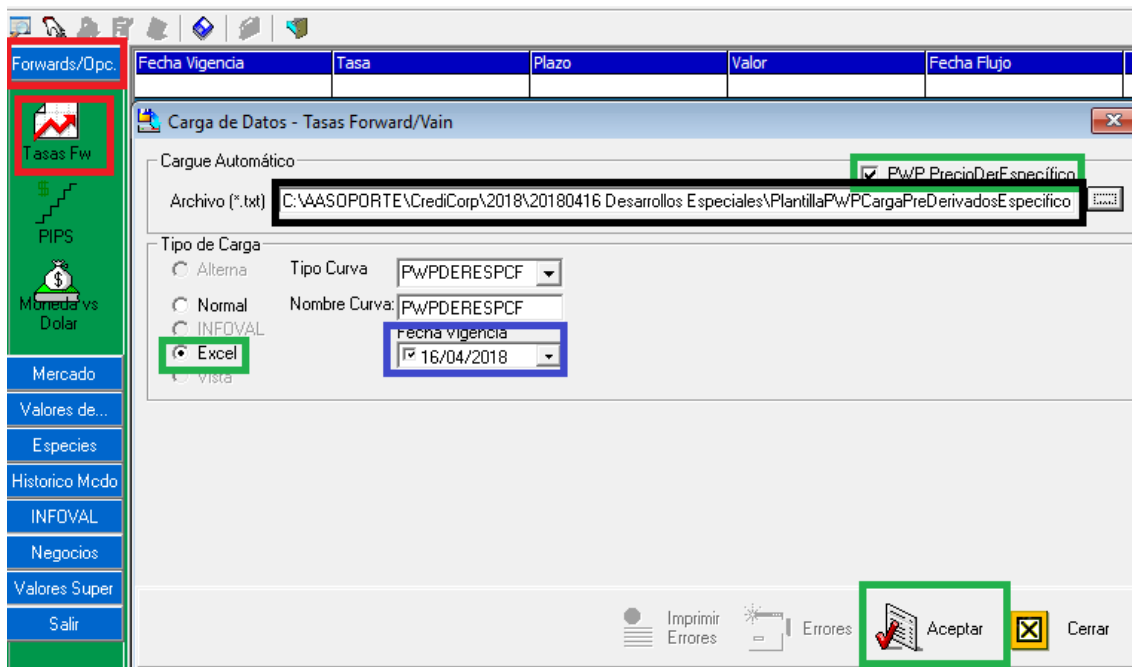
Forward/Opc.	FechaRegistro	NumPPV	GrpNumPPV	Curva	Derecho	Obligacion	PSpot	PIPS	TasaX	TasaY	CVA	DVA	CVADVANet
	11/01/2018	1		1 BAAA2	2001926299.0265	58726.5213	2865.79	22.24	1.44836712	4.41370978	9.93952558	371690962	432165382
	11/01/2018	2		1 BAAA2	401431179.430454	353.307022	2865.79	13.68	1.43353033	4.48487332	1549818158	284286267	329304489
	10/01/2018	1		1 BAAA2	2022369486.653	5240.95699	2895.69	22.43	1.51589734	4.43238756	257077468	383609888	1263324792
	10/01/2018	2		1 BAAA2	405578574.131346	319.074418	2895.69	13.36	1.49224737	4.4889139	1409601228	387975077	478373849
	09/01/2018	1		1 BAAA2	2035312615.97794	9135.86872	2914.37	22.77	1.5191472	4.43068988	685042509	97.2097026	7533990847
	09/01/2018	2		1 BAAA2	408190055.292566	392.774934	2914.37	13.77	1.44091213	4.4851324	3448798692	1249971101	1988275914
	08/01/2018	1		1 BAAA2	2022807138.63578	8071.21911	2898.32	22.45	1.557038	4.41519195	617224133	664621042	1473969088
	08/01/2018	2		1 BAAA2	405862487.610145	465.326844	2898.32	13.48	1.53900449	4.48442095	1022166755	2515407857	4932411024
	07/01/2018	1		1 BAAA2	2023715545.053	2013.83393	2898.32	22.66	1.5584994	4.41371056	617224133	664621042	1473969088
	07/01/2018	2		1 BAAA2	405846818.104766	213.099401	2898.32	13.72	1.53723288	4.48271609	1022166755	2515407857	4932411024
	06/01/2018	1		1 BAAA2	2023617210.1135	6175.49451	2898.32	22.86	1.5604831	4.441222916	617224133	664621042	1473969088
	06/01/2018	2		1 BAAA2	405829827.129282	011.070249	2898.32	13.95	1.53678747	4.448101122	1022166755	2515407857	4932411024
	05/01/2018	1		1 BAAA2	2023519062.6361	2556.03639	2898.32	23.06	1.56239604	4.441074777		0	0
	05/01/2018	2		1 BAAA2	405812876.404654	359.194203	2898.32	14.18	1.53629638	4.447930638		0	0

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:

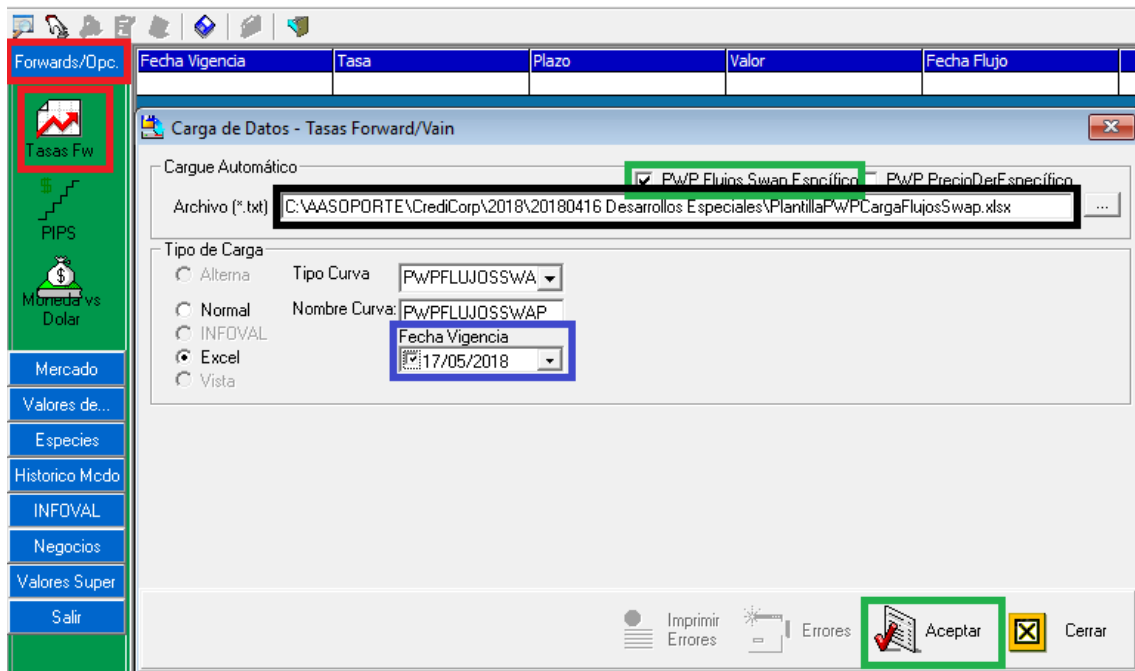
6. Carga del archivo. Para alimentar el archivo proceda:
 - a. Ingrese a "Mercado y Sociedad – Forwards/Opc – TasasFw"
 - b. Pulse el botón "Cargar".

- 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":

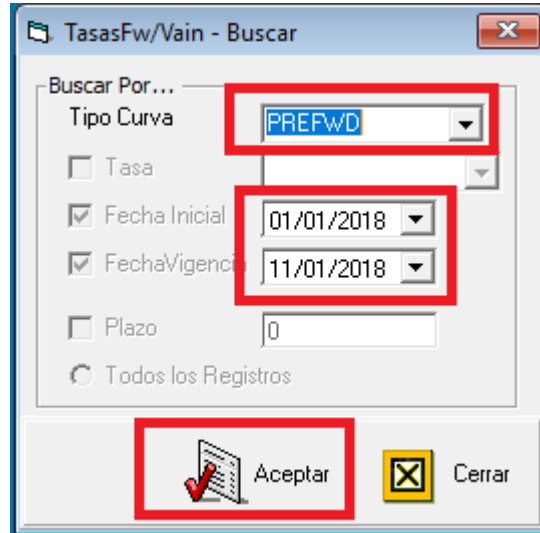


- g. La información quedará registrada en el sistema.

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":



8. Consulta de la Información. Para consultar lo cargado simplemente utilice el botón "Buscar" y seleccione "PREFWD" en la casilla "Tipo Curva":



FechaRegistro	NumPV	GrpNumPV	Curva	Derecho	Obligacion	Spot	PIPS	TasaX	TasaY	CVA	DVA	CVA/DVA Neto
13/04/2018	YYZ13875		NA	1,268,000,000	1,267,000,000	0	0	0	0	0	1,457,000	1,268,000 189,000
22/04/2018	4	1	BAAA2	1,922,588,130.39874	2,033,193,114.69224	27,737.90	4.79	2.9608349	4.11484218	8,345.7092894145	-171,633.879555636	-863,230.170266222
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	-124,517.209605228
22/04/2018	5	5	BAAA2	1,235,898,005.90311	1,259,860,320.94814	2,757.96	4.49	2.9608349	4.11484218	23,365.9662884369	-140,105.624651661	-116,739.658363224
21/04/2018	1	1	BAAA2	1,925,977,828.99522	2,032,693,590.82721	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	8,345.7092894145	-471,635.879555636	-463,290.170266222
21/04/2018	4	4	BAAA2	1,922,364,002.02278	1,944,297,691.31121	2,757.96	4.59	2.95997511	4.11308407	8,345.7092894145	-471,635.879555636	-463,290.170266222
21/04/2018	5	5	BAAA2	1,235,805,429.87179	1,259,720,348.43651	2,757.96	4.59	2.95997511	4.11308407	48,975.3907821418	-173,492.60038267	-124,517.209605228
20/04/2018	1	1	BAAA2	1,925,977,828.99522	2,032,693,590.82721	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	23,365.9662884369	-140,105.624651661	-116,739.658363224
20/04/2018	4	4	BAAA2	1,922,220,213.47726	1,944,081,888.44325	2,757.96	4.69	2.95122877	4.11132596	48,975.3907821418	-173,492.60038267	-124,517.209605228
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
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
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
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	-643,083.878296172	-639,254.578737021
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	-277,819.815641587	-273,487.710265995
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	-228,016.041665594	-216,623.176050711
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	6,106.8500941784	-584,226.346633114	-578,119.487538936
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	36,748.219655036	-248,915.14581355	-212,166.930848046
17/04/2018	5	5	BAAA2	1,221,302,558.74882	1,259,176,079.77875	2,725.66	5.65	2.76051704	4.098813	17,592.7162382417	-194,419.463417941	-176,826.747195699
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	-601,383.97250637	-593,804.081458385
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
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	-202,192.001609475	-183,080.317037736
16/04/2018	YYZ13876		NA	1,210,000,000	2,115,000,000	0	0	6.23	5.48	1,457,000	1,268,000	189,000
15/04/2018	1	1	BAAA2	1,896,903,943.10282	2,039,005,294.23478	2,705.34	0.09	3.06926554	4.287	0	0	0
15/04/2018	4	4	BAAA2	1,893,576,558.57846	1,930,115,857.10105	2,705.34	0.09	3.06926554	4.287	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	2.9152654	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	1,213,466,673.83883	1,258,358,081.48936	2,710.03	5.52	2.94084609	4.14892806	15,702.1423433749	-252,302.80134548	-236,600.659020105
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	0.1489251777	-3,014.1246412029
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	-15,229.480948266	-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

Fecha Vigencia	Moneda1	Moneda2	Plazo	Valor
2010/05/07	PESO	USD	1	2.4
2010/05/07	PESO	USD	7	2.42
2010/05/07	PESO	USD	15	2.501
2010/05/07	PESO	USD	30	2.78
2010/05/07	PESO	USD	60	2.97
2010/05/07	PESO	USD	180	3.257
2010/05/07	PESO	USD	360	3.924
2010/05/08	PESO	USD	1	2.035
2010/05/08	PESO	USD	7	2.36
2010/05/08	PESO	USD	15	2.525
2010/05/08	PESO	USD	30	2.8723
2010/05/08	PESO	USD	60	2.9873
2010/05/08	PESO	USD	180	3.147
2010/05/08	PESO	USD	360	3.96

2.8.2.1. BUSCAR PIPS

PIPS/Vain - Buscar

Buscar Por...

FechaVigencia 08/10/2010

Plazo 0

Todos los Registros

Aceptar Cerrar

2.8.2.2. INGRESAR PIPS

PIPS/Vain - Ingresar

Fecha 08/05/2010

Moneda1

Moneda2

Plazo

Digite la Tasa para los días

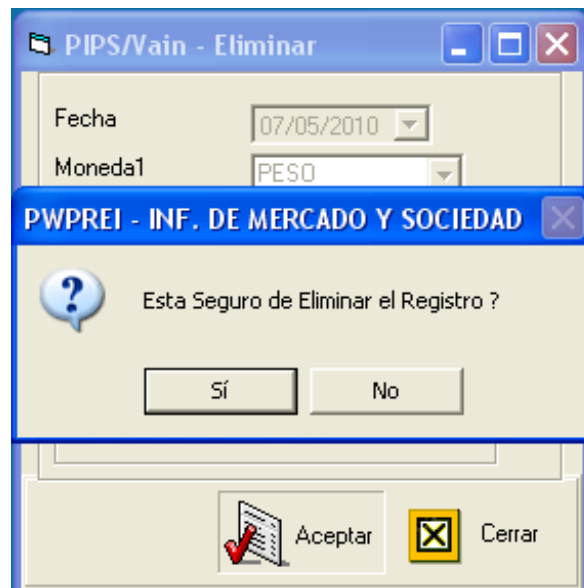
Valor 0

Aceptar Cerrar

2.8.2.3. MODIFICAR PIPS

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.

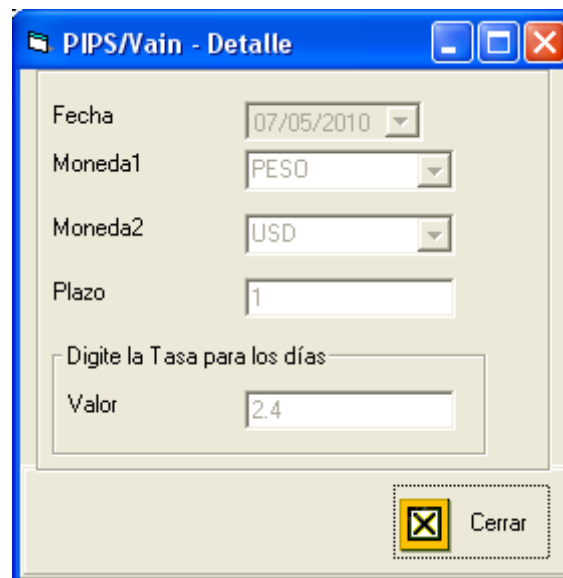
2.8.2.4. ELIMINAR PIPS



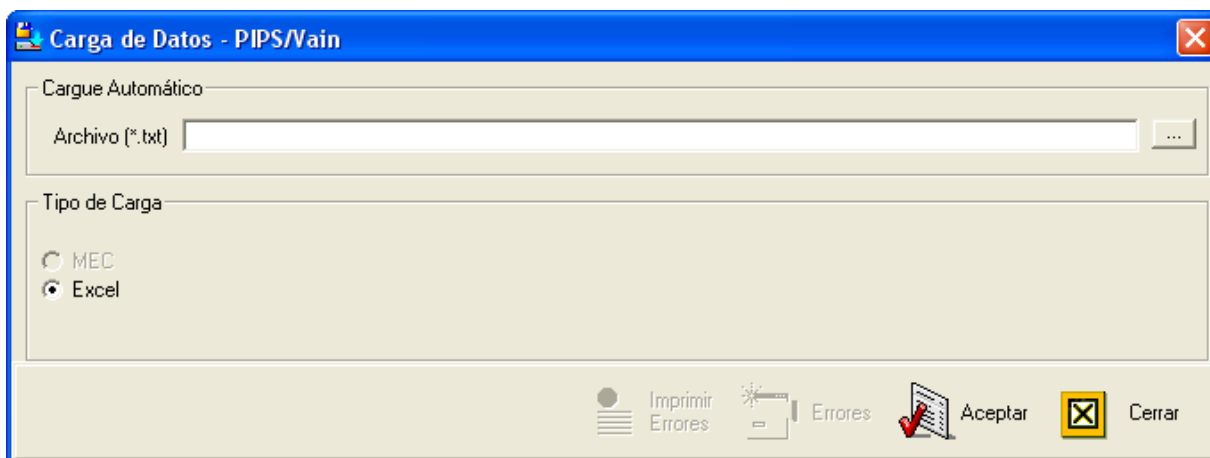
Al eliminar un registro, el sistema pedirá reconfirmación como en pantallas anteriores.

2.8.2.5. 2.2.8.2.1. DETALLE PIPS

Esta opción es solo informativa, no se puede modificar ningún campo.



2.8.2.6. CARGAR DATOS PIPS



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

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
	30/06/2006	YEN	USD	114.5475	114.4165	114.482
	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
	31/07/2006	YEN	TRM	114.5475	114.4165	114.482
	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
	31/08/2006	YEN	TRM	117.3709	117.3709	117.3709
	31/08/2006	YEN	USD	117.3709	117.3709	117.3709
	13/09/2006	DOLAR	PESO	2,406.5	2,407.28	2,406.89
	14/09/2006	DOLAR	PESO	2,399.82	2,400.01	2,399.915
	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
	29/09/2006	YEN	USD	118.0638	117.9245	117.99415
	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
	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

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

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 - Modificar

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

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

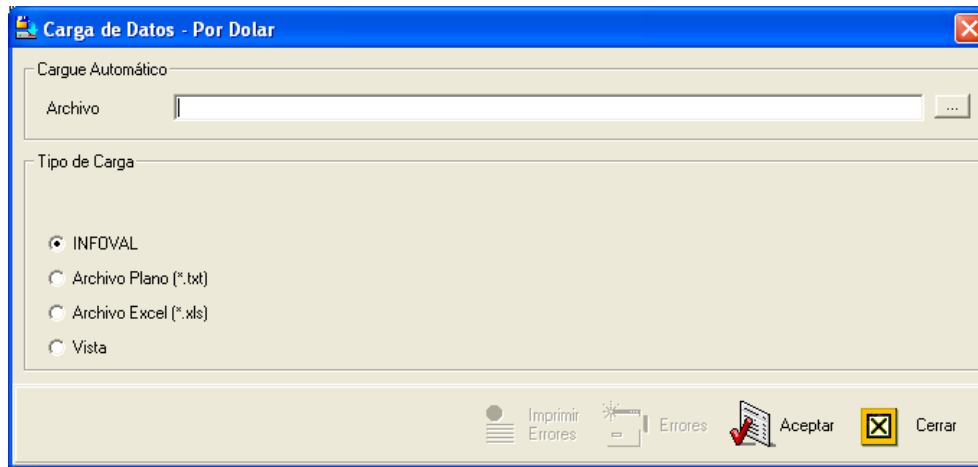
Esta Seguro de Eliminar el Registro ?

Si No

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



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.

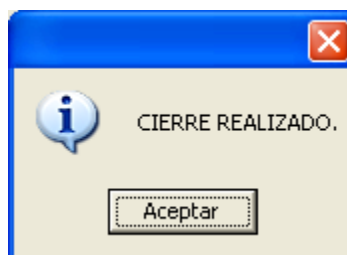
Tipo de Cierre

- 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.

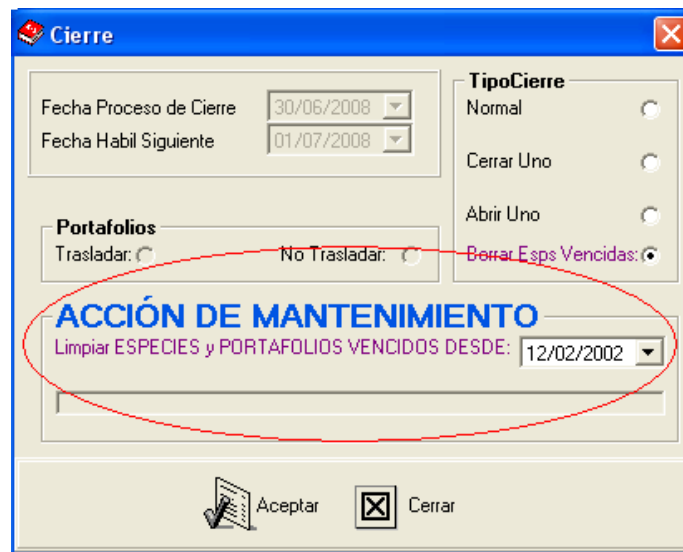
Cuando se presiona el botón aceptar se realiza el cierre como se muestra en la imagen.



Borrar Especies Vencidas

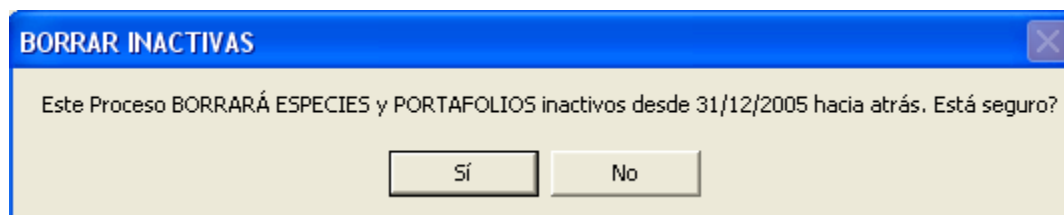
Es el mantenimiento de Especies, cuyo propósito es permitir el borrado de las especies que no presenten movimiento sobre los portafolios desde una cierta fecha indicada por el usuario. Su funcionamiento es el siguiente:

1. Pulsar el botón "Borrar Esp. Vencidas" para que la pantalla de Cierres cambie:



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 "Sí" si esta seguro, de lo contrario pulse "No" para descartar la operación. Al pulsar "Sí" se da inicio el proceso. Cuando la barra de progreso llegue al final el sistema mostrará el mensaje: "Proceso terminado con éxito."

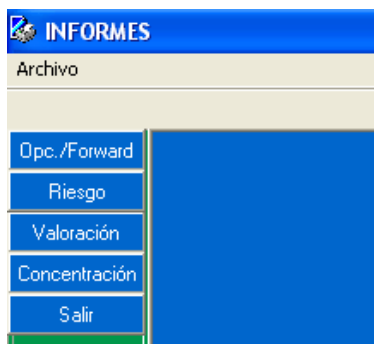
Se debe tener en cuenta que el proceso es bastante pesado y dependiendo del tamaño de su portafolio (Movimientos diarios del mismo) y los recursos de su instalación podría llegar a tardar un par de horas en ejecutarse; por lo que usted deberá elegir una hora

de poca o ninguna actividad para ejecutarlo a fin de no afectar los demás procesos.

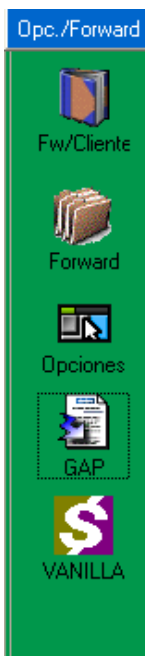
4. INFORMES



Al dar clic en esta opción aparecerá la pantalla del Módulo Informes, donde se verán los informes de Riesgo, Valoración y Concentración.



4.1. OPCIÓN FORWARD



4.1.1. INFORME FORWARD CONTRAPARTE

Inf. Forward Contrapartes

Buscar Por...

Contraparte

09/07/2009 Fecha Registro

Fecha Valoración 09/07/2009

Aceptar Cerrar

4.1.2. INFORME FORWARD

Informe Foward

Buscar Por...

09/07/2009 Fecha Registro

Fecha Valoración 09/07/2009

Aceptar Cerrar

4.1.3. INFORME OPCIONES

Informe Opciones

Buscar Por...

Contraparte

09/07/2009 Fecha Registro

Fecha Valoración 09/07/2009

Aceptar Cerrar

4.1.4. INFORME GAP

Informe GAP

Buscar Por...

Contraparte

27/10/2010 Fecha Registro

27/10/2010 27/10/2010 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

Datos Básicos

Fec de Medición: 25/08/2010

Tipo Entidad: 085

Código Entidad: 123

Clave: xxxxxxxx

UBICACION PORTAFOLIOS

NIVEL	NOMBRE
Portafolio: PORTAFOLI	CLIMAR

Aceptar Ver 468 Cerrar

de su ambiente PwpRei respectivo.

4.2. OPCION INFORMES DE RIESGO



4.2.1. INVERSIONES

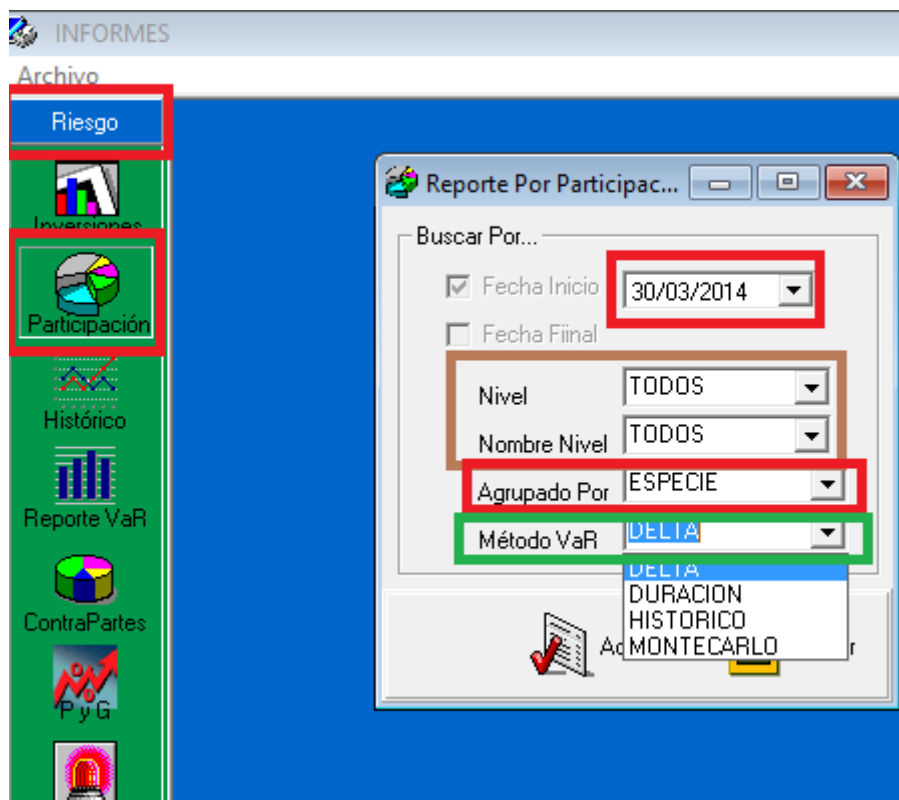
Este botón se encuentra deshabilitado

4.2.2. PARTICIPACION

Las funcionalidades descritas a continuación corresponden a:

- Informe Riesgo-Participación.

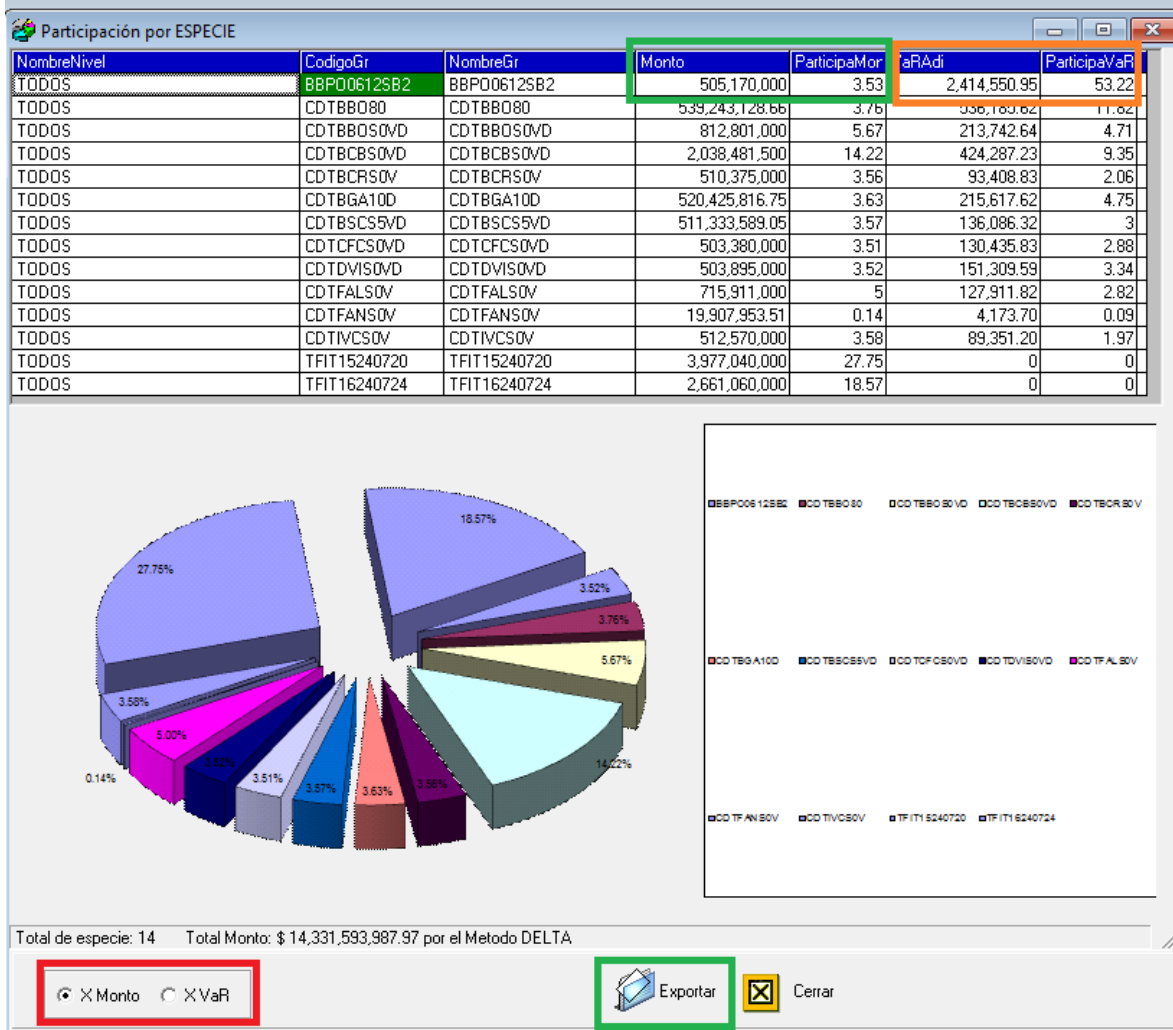
Observe la siguiente pantalla en el módulo de Informes:



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:



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



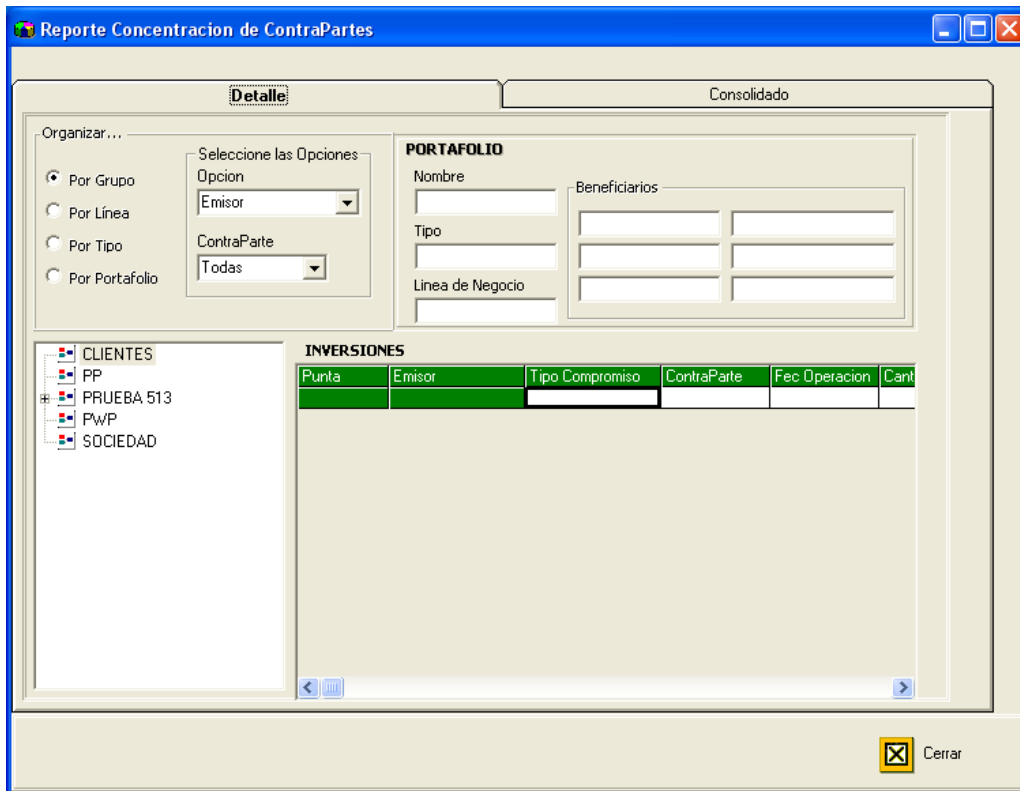
4.2.4. REPORTE VaR

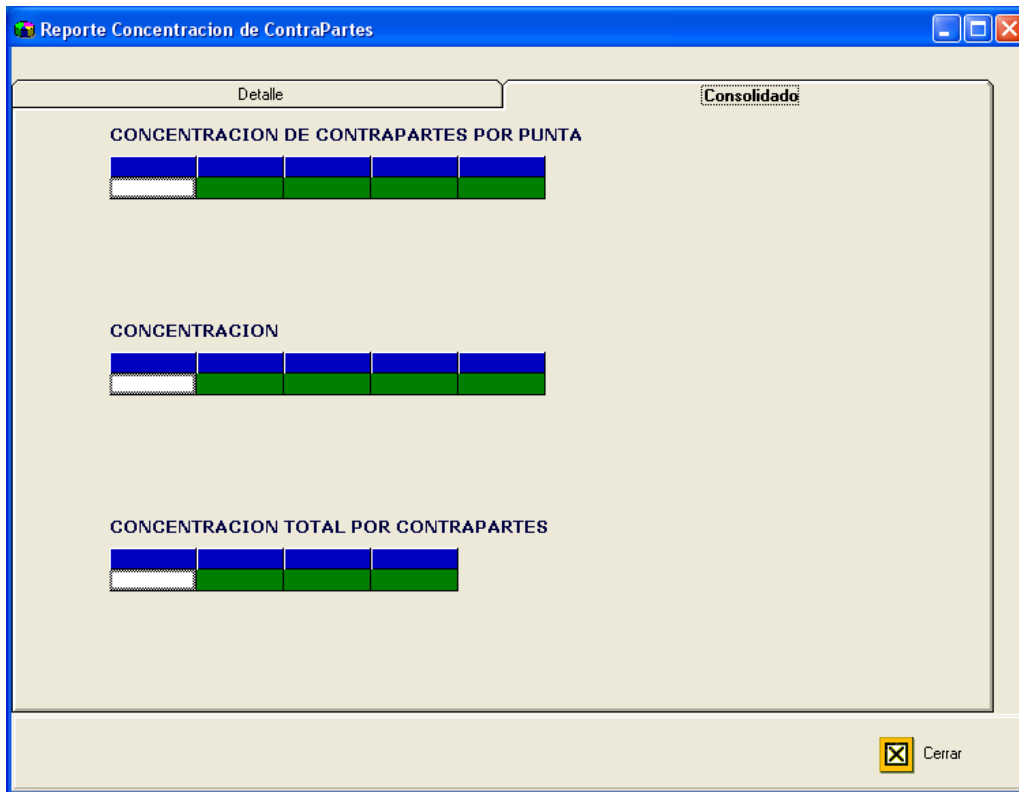


4.2.5. CONTRAPARTES



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.





4.2.6. P&G



Después de seleccionar la fecha aparece el informe de Pérdida y Ganancia como la siguiente imagen.

Informe Pérdida/Ganancia

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO

Nombre: Nits:
 Tipo:
 Línea de Negocio:

Especie	Depósito	Número	Días al Vcto. Úl	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

Fecha de Valorización --> 09/07/2009 Liquidar compromisos a: Fecha Liquidación Fecha Compromisos

Fecha de Liquidación --> 09/07/2009

Aceptar Cerrar

Al presionar el botón Aceptar aparece la siguiente pantalla donde muestra tres pestañas TIR de Compra, Precios de Mercado y Utilidad en Venta.

Valorización Por Portafolio.

TIR DE COMPRA PRECIOS DE MERCADO UTILIDAD EN VENTA

GRUPO

Nombre: CLIENTES

Fechas...
 Valorización: 09/07/2009
 Liquidación: 09/07/2009

Resultados Finales

Total Valor Compra	\$ 0.0000
Total Valoración Mercado	\$ 0.0000
Total Ajuste	\$ 0.0000

Portafolio	Emisor	Especie	Val. Nominal Uni./Mon. Emisión	Val. Nominal	Val. Compra Uni./Mon. Em.
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	23,183,985.00	23,183,985.00	\$ 23,544.03
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	100,000,000.00	100,000,000.00	\$ 100,000.00
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	80,000,000.00	80,000,000.00	\$ 80,000.00
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A.	CDTDVISOV	4,620,774.60	4,620,774.60	\$ 4,628.67
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A.	CDTDVISOV	10,509,012.00	10,509,012.00	\$ 10,580.22
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A.	CDTDVISOV	6,000,000.00	6,000,000.00	\$ 5,956.09
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	3,308,982.00	3,308,982.00	\$ 3,315.09
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	24,127,015.00	24,127,015.00	\$ 24,497.29
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	2,930,079.00	2,930,079.00	\$ 3,077.52
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PICI	CDTFINSOV	3,500,710.00	3,500,710.00	\$ 3,650.41
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PICI	CDTFINSOV	1,000,000.00	1,000,000.00	\$ 1,012.17
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PICI	CDTFINSOV	2,207,980.00	2,207,980.00	\$ 2,207.98

Exportar Resultado Cerrar

Valorización Por Portafolio.

TIR DE COMPRA **PRECIOS DE MERCADO** UTILIDAD EN VENTA

GRUPO

Nombre:

Fechas...
 Valorización: 09/07/2009
 Liquidación: 09/07/2009

Resultados Finales

Total Valoración Mercado
\$ 42,780,500.8280

Total Valoración Mercado
\$ 0.0000

PyG + Interés
\$ 16,986,620.9800

PyG sin Interés (Hoy - Ayer)
-\$ 42,780,500.8300

Portafolio	Emisor	Especie	Val. Nominal	Un./Mon. Emisión	Val. Nominal	Val. Compra	Un./Mon. Emisión
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	23,183,985.00		23,183,985.00		\$ 23,544,037.1
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	100,000,000.00		100,000,000.00		\$ 100,000,000.1
VAMCOL	C.F.C. CONFINANCIERA	CDTCNFSOV	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
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A.	CDTDVISOV	10,509,012.00		10,509,012.00		\$ 10,580,227.1
VAMCOL	BCO. DAVIVIENDA S.A.	CDTDVISOV	6,000,000.00		6,000,000.00		\$ 5,956,095.1
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	3,308,982.00		3,308,982.00		\$ 3,315,092.1
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	24,127,015.00		24,127,015.00		\$ 24,497,298.1
VAMCOL	CMR FALABELLA S.A. C	CDTFALSOV	2,930,079.00		2,930,079.00		\$ 3,077,526.1
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PICI	CDTFINSOV	3,500,710.00		3,500,710.00		\$ 3,650,419.1
VAMCOL	C.F.C. INVERSORA PICI	CDTFINSOV	1,000,000.00		1,000,000.00		\$ 1,012,177.1

Exportar Resultado Cerrar

Valorización Por Portafolio.

TIR DE COMPRA PRECIOS DE MERCADO **UTILIDAD EN VENTA**

GRUPO

Nombre:

Fechas...
 Valorización: 09/07/2009
 Liquidación:

Resultados Finales

Precios de Mercado
\$ 0.0000

Valor en Venta
\$ 0.0000

PyG Total
\$ 0.0000

Portafolio	Emisor	Especie	Val. Nominal	Un./Mon. Emisión	Val. Nominal	Val. Compra	Un./Mon. Emisión

Opciones

Tipo Cpr.	Punta	Strike	Spot	Diferencia	Prima	P&G	Se ejer

Exportar Resultado Cerrar

4.2.7. RIESGO DE LIQUIDEZ

Para generar los informes de riesgo de liquidez simplemente siga, diariamente, las siguientes instrucciones en forma ordenada:

1. **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

Dónde:

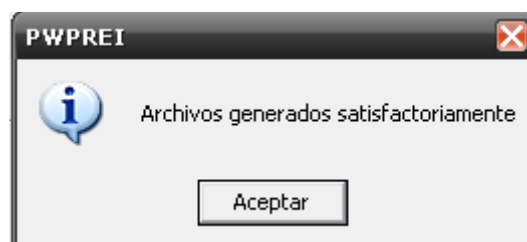
Fecha de Medición es la fecha para tomar los portafolios.

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 (+)
2. 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.
4. Para utilizar estas funciones Ingrese normalmente por "Informes – Riesgo –RIESLIQ". Obtendrá una pantalla ampliada, como se muestra en la figura:

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:

Stress Testing

DATOS DE ENTRADA				RESULTADOS BACK TESTING				
STRESS (%):	Fec de Medición	Act. Liq.	Obligacs.	Terceros	IRL	Minimo IRL	Media IRL	Máximo IRL
	07/11/2009	10	10	10	5			
BACK TEST:	Fecha Inicial	Niv. Conf.	Datos Encontrados			Varianza	Desv. Std.	Percentil
	23/01/2011	95						
Concepto	UniCap	SubCuent	Columna 01	Columna 02	Columna 03	Columna 04		
	1	5	990,000.00					
	1	15	1,080,068.00					
	1	20	724.00					
TOTAL ACTIVOS LÍQUIDOS (AL)	1	999	2,070,792.00					
	2	5		873,000.00				
TOTAL OBLIGACIONES ACTIVAS EN CUENTA PROPIA	2	999		873,000.00				
	3	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				
REQUERIMIENTO DE LIQUIDEZ DE OBLIGACIONES POR CUENTA DE TERCEROS	7	5						
FLUJO OBLIGACIONES NETAS DERIVADOS (FOND=FOAd-FOPd)	10	5						
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:

DATOS DE ENTRADA				RESULTADOS BACK TESTING					
STRESS (%):	Fec de Medición: 07/11/2009	Act. Liq:	Obligacs:	Terceros:	IRL:	Minimo IRL:	Media IRL:	Máximo IRL:	
		0	0	0	0	1.964.464.00	2.543.289.00	4.184.961.00	
BACK TEST:	Fecha Inicial: 01/11/2009	Niv. Conf: 95	Datos Encontrados: 7			Varianza:	Desv. Std:	Percentil(5%):	Percentil(95%):
						513.611.015.074.00	716.666.60	1.975.124.80	3.736.841.10

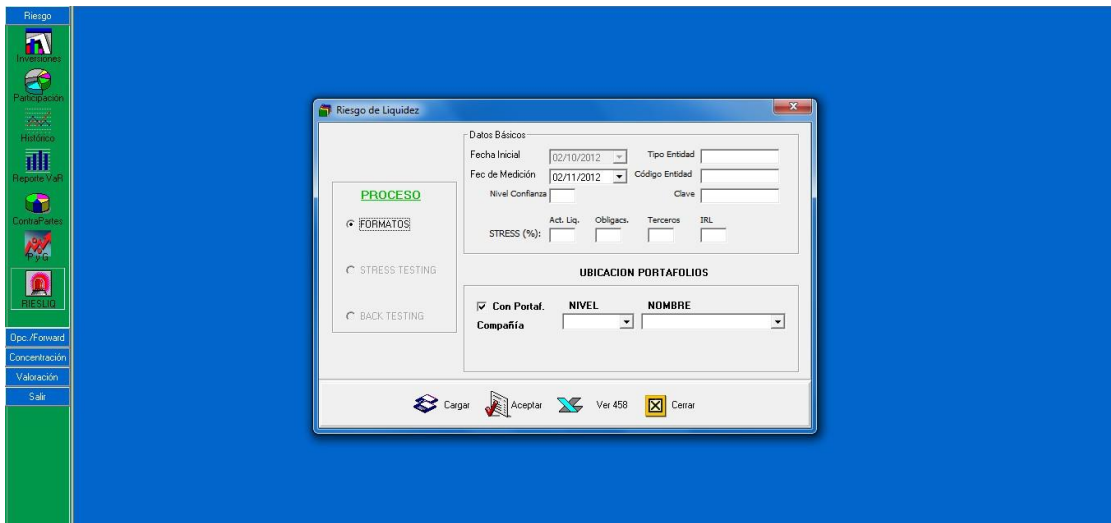
(Fecha Dato)	(Numero Dato)	(Dias Al Dato)	(Valor Dato)	(Distancia A Media)	(Distancia A Media)^2
2009/11/01	1	0	1.964.464.00	-578.825.00	335.038.380.625.00
2009/11/02	2	1	2.000.000.00	-543.289.00	295.162.937.521.00
2009/11/03	3	2	4.184.961.00	1.641.672.00	2.695.086.955.584.00
2009/11/04	4	3	2.691.228.00	147.939.00	21.885.947.721.00
2009/11/05	5	4	2.391.766.00	-151.523.00	22.959.219.529.00
2009/11/06	6	5	2.499.812.00	-43.477.00	1.890.249.529.00
2009/11/07	7	6	2.070.792.00	-472.497.00	223.253.415.009.00
RESULTADOS -->	Media: 2.543.289.00	Varianza: 513.611.015.074.00	Desv Std: 716.666.60	Perc.Lzq(5%): 1.975.124.80	Perc.Der(95%): 3.736.841.10

vi. Puede exportar esos resultados a Excel para sus posteriores análisis.

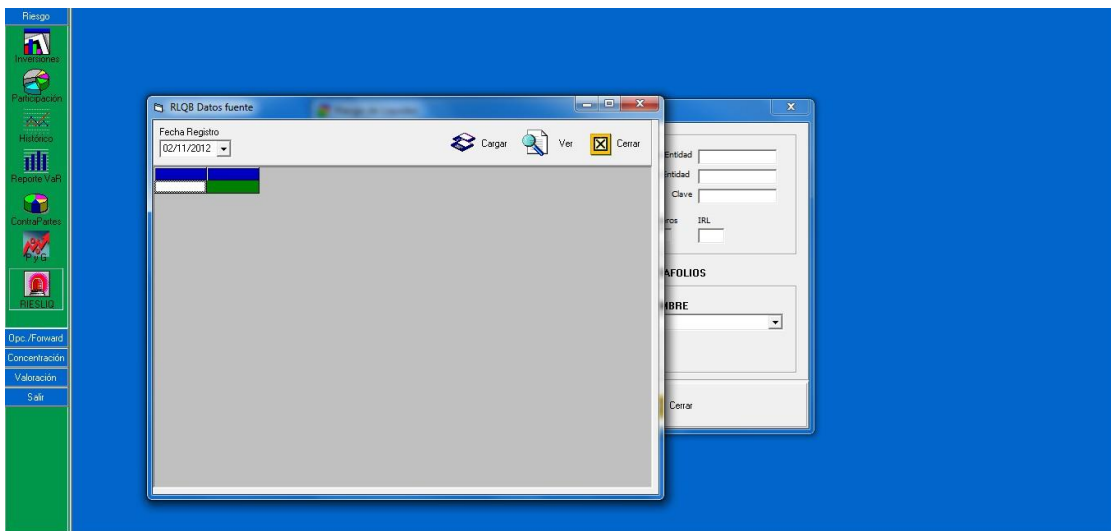
4.2.7.1. RIESGO DE LIQUIDEZ BANCOS

Para generar el formato 458, por favor proceda:

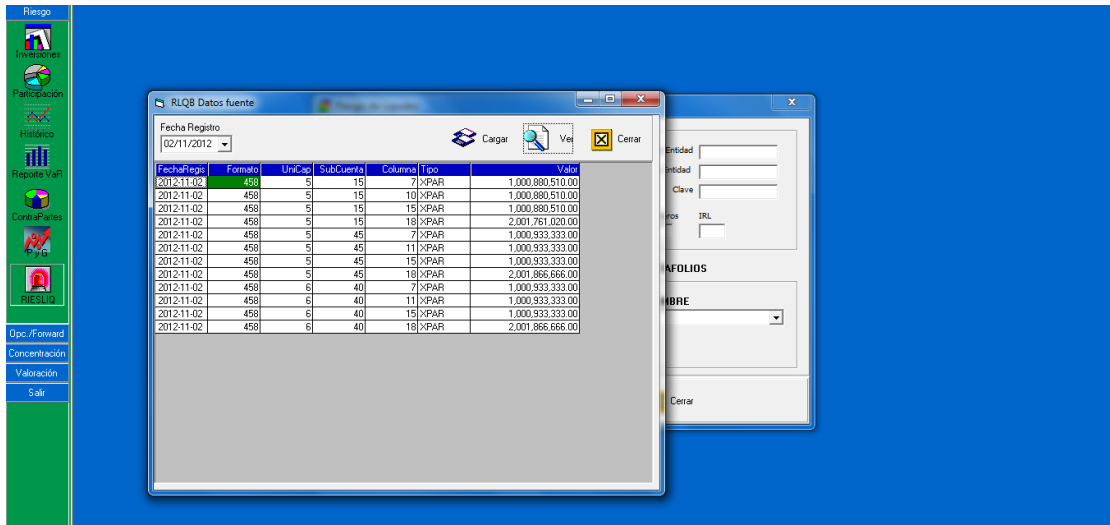
1. Ingrese al módulo "Informes - Riesgo"
2. Pulse en el ícono "RIESLIQ". Le aparece la pantalla:



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 registre 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":
 - i. Bajo "Nivel" seleccione Grupo, Línea o Portafolio. Esto indica a qué nivel va a tomar el portafolio.
 - ii. 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

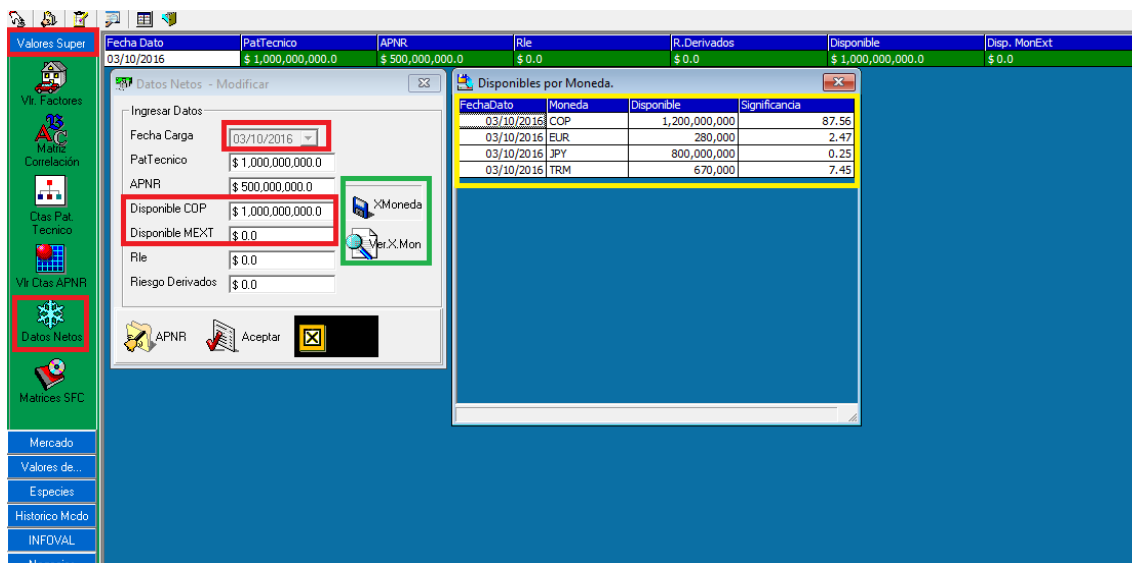
A continuación describimos el proceso operativo para generar el formato 531, Riesgo de Liquidez. Siga los pasos siguientes:

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.
6. **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"

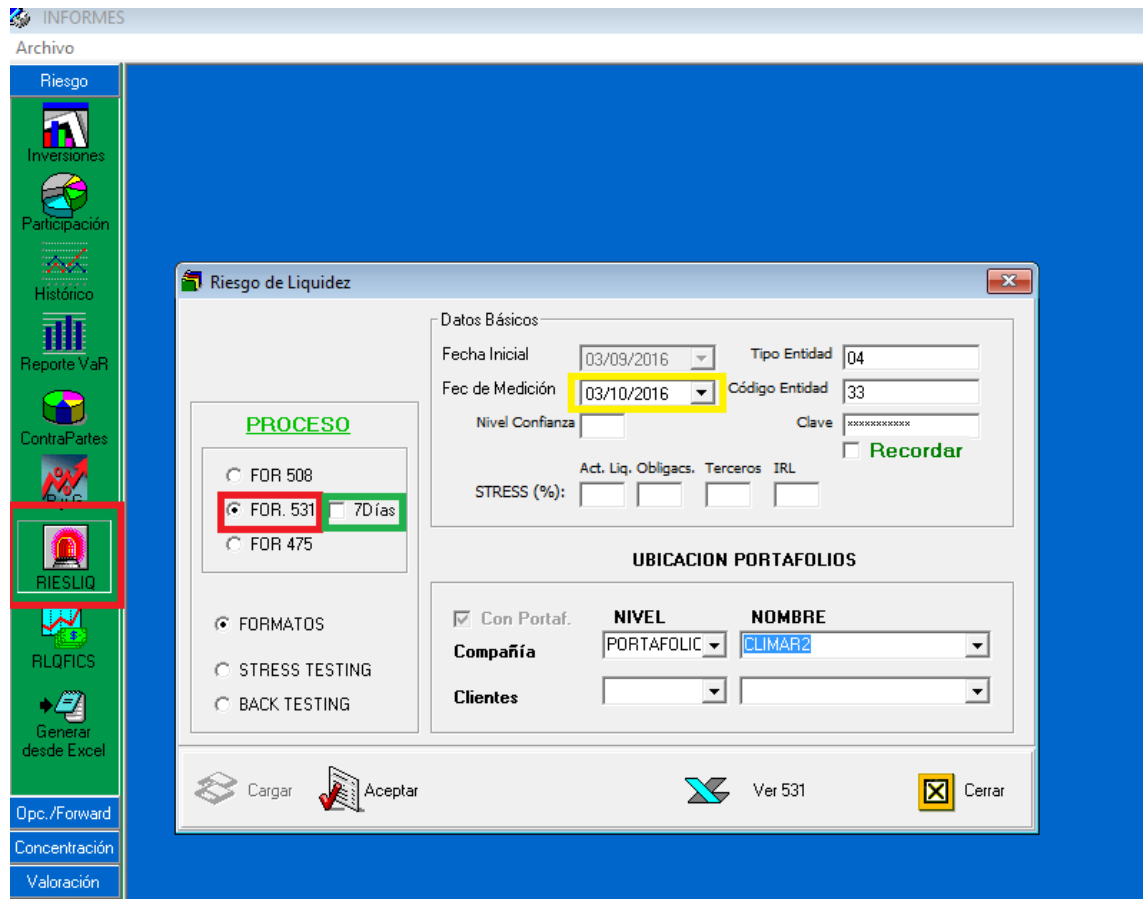
- d. Seleccione la pestaña "Valores Súper"
- e. Seleccione la Opción "Datos Netos"
- f. Si no ha ingresado los datos a la fecha de proceso, pulse "Ingresar". De lo contrario pulse "Modificar" para cambiar el registro a la fecha de proceso.
- g. A la derecha de "Disponible COP" y "Disponible MExt" seleccione "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:



7. **Haircuts.** Son los mismos datos alimentados para el 508

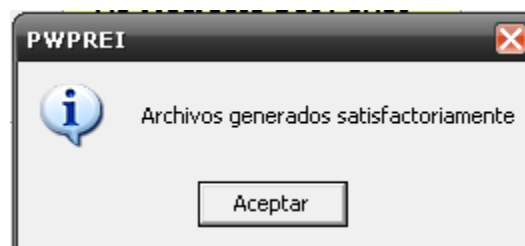
8. **GENERAR EL FORMATO.** Para generar el informe proceda:

- a. Ingrese por "Informes".
- b. Seleccione la pestaña "Riesgo".
- c. Seleccione la opción "RIESLIQ". Le aparecerá la siguiente pantalla:



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: MARGEN Linea de Negocio: PUBLICO

Beneficiarios: 900338073-4 Custodio: SIN CUSTODIO

Cuenta Custodio: [Empty]

Categoria del FIC: MONETARIO

Tipo de Fondo/Fidecomiso: FONDO DE VALORES Codigo Fondo/Fidecomiso: 3

Estado: NO ACTIVO

Aceptar Cerrar

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/Renta Variable - Modificar

AAAAAMDD

Código: FIC01 Fec. Evento:

Calificación: ISIN:

Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION

Emisor: ZPW Moneda: COP

Tipo Título: FONDOS DE VALORES

Descripción: MI FIC MOENTARIO SIN PERMAN.

Categoría: 0 Grupo de Calificación: 0

Estado de Negociación:
 Fecha Patrimonial: 24/11/2015 Valor Patrimonial: 1.00000000

Bursatilidad:
 Tipo: NINGUNA Fecha Nominal: 24/11/2015 Valor Nominal: 1.00000000

Porcentaje: 0.000

Fecha Fiscal: 29/12/1899 Valor Fiscal: 0

Acc. Circulación: 0

Portafolio Destino:

Factor1: Factor 2:

Superfinanciera:

Código SF: CCV Aval: Emisión: Fungible:

Calificadora: Otra

- Extranjero

Especies/Renta Variable - Modificar

Código: FONEXT Fec. Evento: AAAAMMDD

Calificación: ISIN:

Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION

Emisor: ZPW Moneda: TRM

Tipo Título: FONDOS DE VALORES

Descripción: FONDO EXTRANJERO

Categoría: 0 Grupo de Calificación: 0

Estado de Negociación: **MERCADO EXTERNO** Fecha Patrimonial: 24/11/2015 Valor Patrimonial: 0.00000000

Bursatilidad: Fecha Nominal: 24/11/2015 Valor Nominal: 0.00000000

Tipo: NINGUNA Fecha Fiscal: 29/12/1899 Valor Fiscal: 0

Porcentaje: 0.000 Acc. Circulación: 0

Factor1: Factor 2: Portafolio Destino:

Superfinanciera

Código SF: CCV Aval: Emisión: Fungible:

Calificadora: Otra

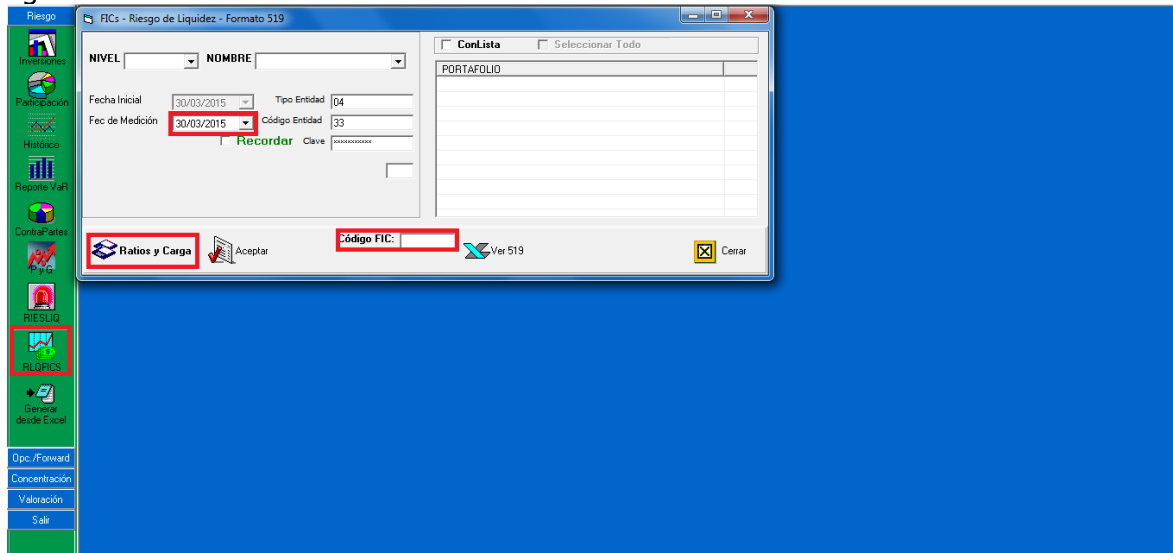
Aceptar Cerrar

3. Serie Histórica del FIC.

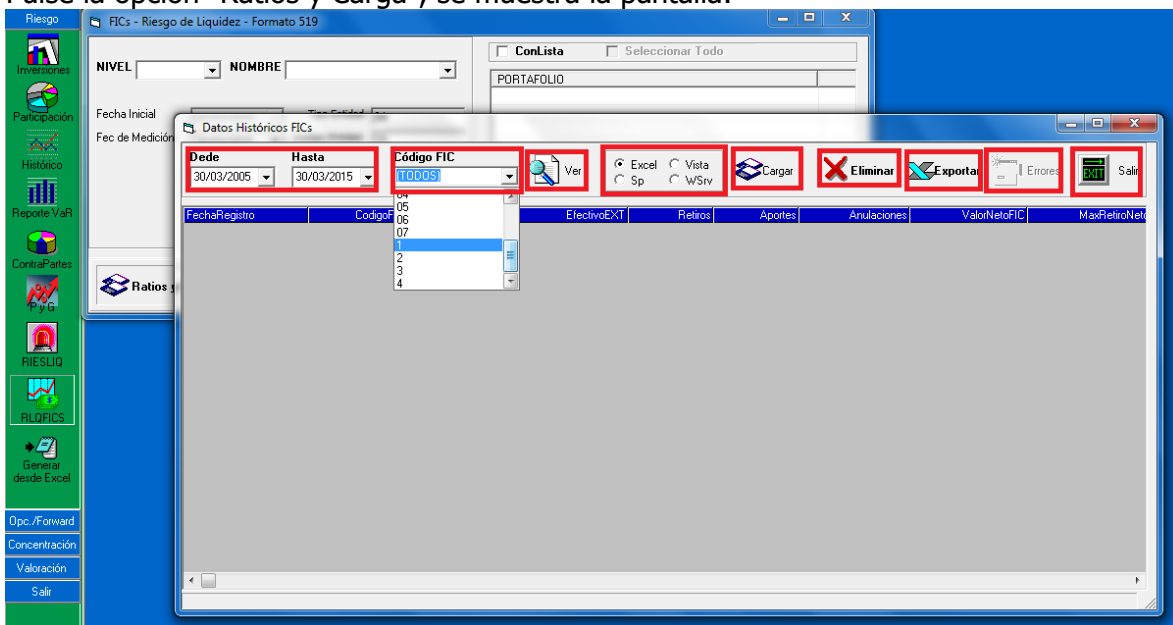
Es necesario alimentar en PWPRE la serie histórica del FIC, correspondiente a los retiros netos y al valor del FIC, diarios. La primera vez cargue la serie desde el nacimiento del FIC hasta la Fecha Registro o de proceso actual y en subsiguientes veces solo alimente lo de la Fecha Registro en proceso 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:



Pulse la opción "Ratios y Carga", se muestra la pantalla:



Para cargar la información puede elegir:

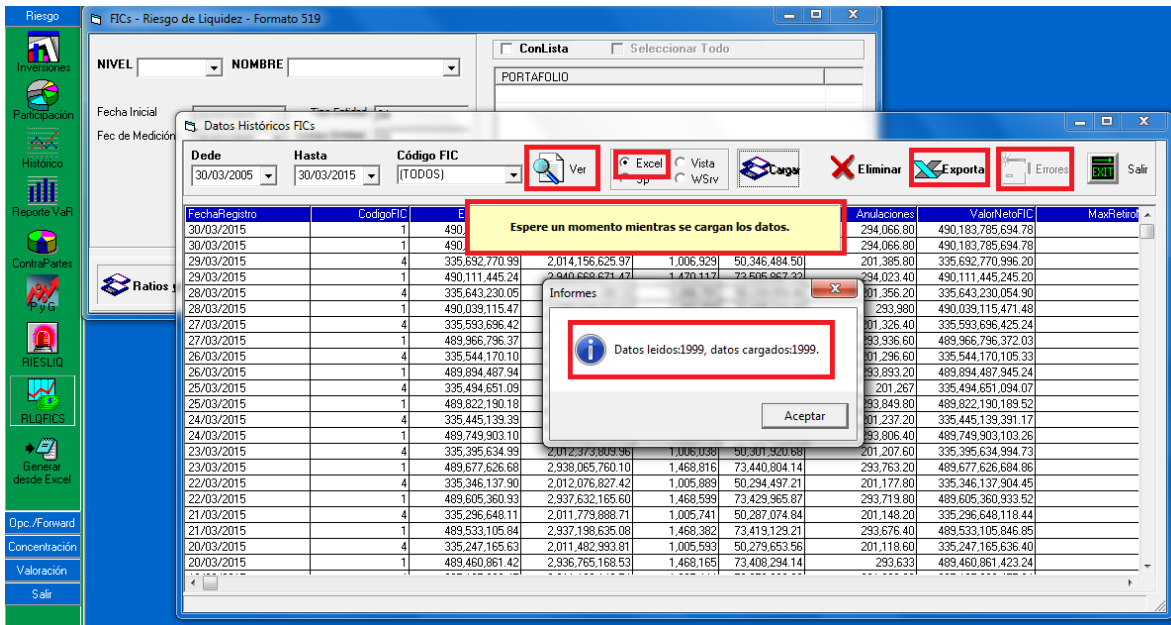
- Carga por Excel. Seleccione el archivo Excel con la información del o los FICs a alimentar, use la plantilla "FormatoCargaSerieFIC.xlsx" o use la hoja "SerieFICS" del archivo "FormatosTodasEntrada.xls".
- Carga por Vista. Esta opción se muestra por defecto en caso de que su área de tecnología haya 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:



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. Permite 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.

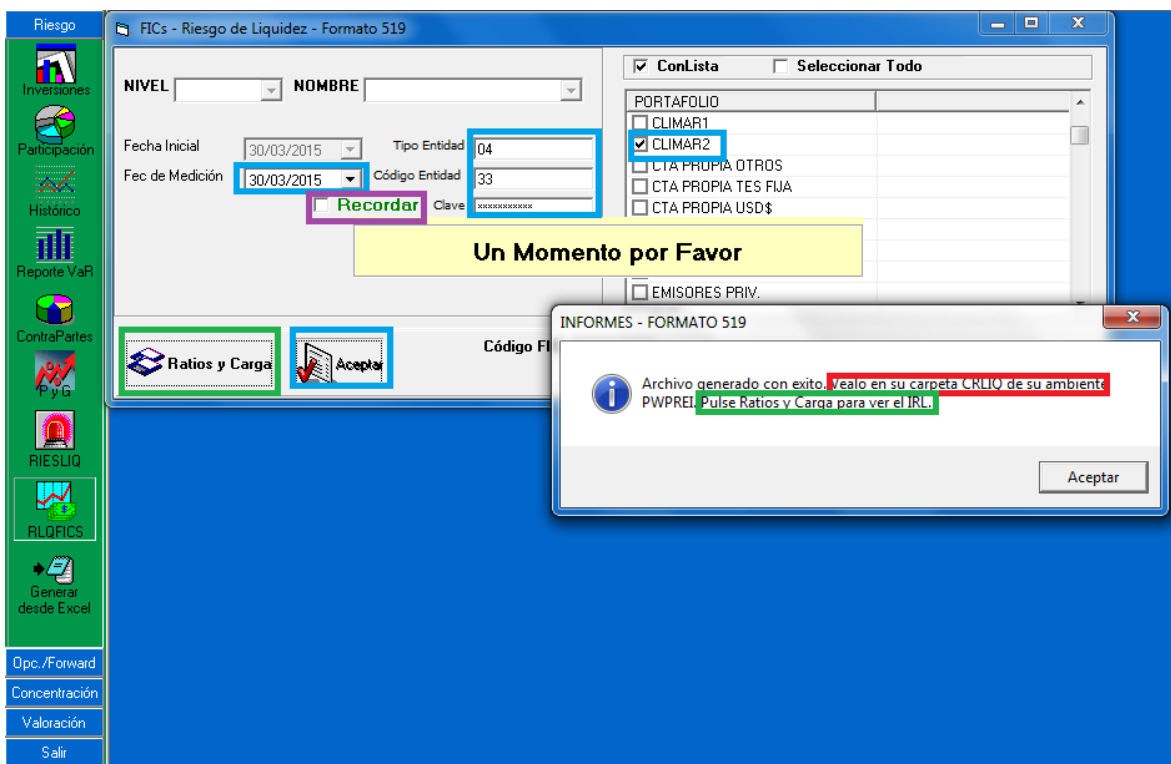
Pulse "Salir" para volver a la pantalla de generación del formato.

4. Procesos Previos.

- Portafolio. Debe cargar el portafolio de los fondos diariamente. Utilice la opción regular que normalmente usa para alimentar sus portafolios.
- 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.
- 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:



- 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 transmisiones 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:

FechaRegistro	CódigoFIC	EfectivoODP	EfectivoEXT	Retiros	Aportes	Anulaciones	ValorNetoFIC	MaxRetiroNeto	MaxRetLiq	NivelEfectivo	PropRetLiq	PropLiq30	IRL FIC
30/03/2015	4	335.742.319.24	2.014.453.915.49	1.007.078	50.353.915.64	201.415.60	335.742.319.249.44	-0.01	33.574.231.92	0.67	0.67	0.67	0
30/03/2015		1.490.183.785.69	2.941.102.714.16	1.470.334	73.516.716.78	294.066.80	490.183.785.694.78	-0.01	49.018.378.57	0.67	0.67	4.71	47.11

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.

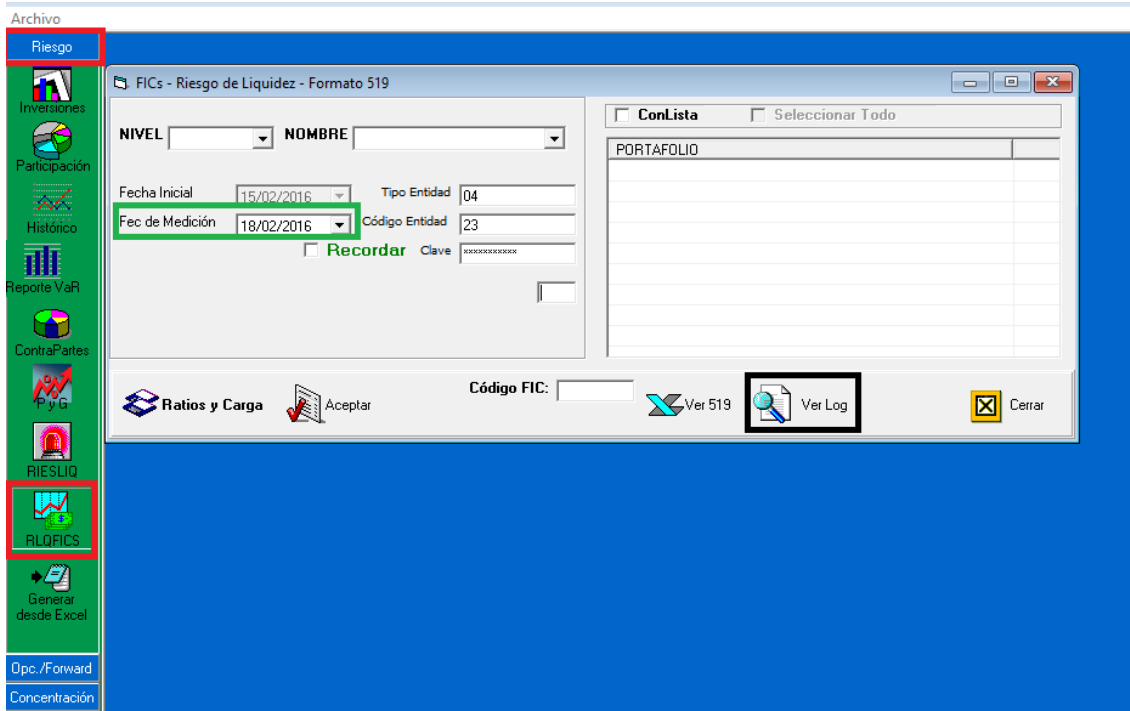
El archivo para transmitir lo podrá ver en su carpeta CRLIQ de su PWPREI. Si dese ver el archivo en Excel pulse "Ver 519".

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.
2. Variación Máxima. Establezca el porcentaje de variación máxima aceptable entre sus mediciones durante la semana y la medición del día viernes (corte de transmisión). 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":



En seguida le aparece la lista de sus resultados anteriores, desde esa fecha y hasta el lunes anterior:

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

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 manera 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.



- 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". Carguelo por la opción "Mercado y Sociedad – Valores de – HAIRCUTS", seleccionando "Acc.Elegibles".

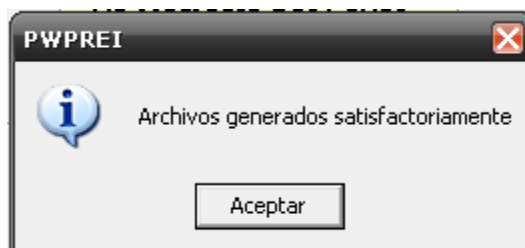
5. **Agregar registros manuales al formato.** Si requiere agregar registros para que aparezcan en el formato tal cual usted desea, como por ejemplo insertar un registro para créditos (Unidad de captura 3, subcuenta 60 "Obligaciones financieras"), utilice la plantilla "Fto_Manual" que está en el archivo "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".
 - c. Seleccione la opción "RIESLIQ". Le aparecerá la siguiente pantalla:

Donde:

- 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:



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 "RLQ508CLIdMMaaaa.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:

1. 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:

	A	B	C	D	E	F	G	H
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	
37	440	7	82	105	3	31	SFC-DTP-001	

2. 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.

- 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.
3. 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

Informe Pérdida/Ganancia

-Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO



Nombre Mts
 Tipo
 Línea de Negocio

Especie	Depósito	Número	Días al Vcto. Úl	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

CLIENTES
 PWP

Fecha de Valorización --> 09/07/2009
Fecha de Liquidación --> 09/07/2009

Liquidar compromisos a:
 Fecha Liquidación Fecha Compromisos

 Aceptar  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 por Portafolio

GRUPO

Nombre: CLIENTES

Fechas...
 Valorización: 09/07/2009
 Liquidación: 09/07/2009

Resultados Finales
Total Valoración Compra
 \$ 0.0000
Total Valoración Mercado
 \$ 0.0000
PyG Vir. Mercado
 \$ 0.0000

INFORME 01 | INFORME 02 | INFORME 03 | INFORME 04 | INFORME 05 | INFORME 06 | INFORME 07 | INFORME 08

INVERSIONES EN RENTA FIJA EMITIDOS POR ENTIDADES DISTINTAS DE LA NACIÓN

Emisor	Especie	Nemotécnico	Cantidad Nominal	Valor Nominal	Cantidad de Compra	Valor de Compra
C.F.C. CONFINANCIERA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTCNFSOV	23,183,985.00	\$ 23,183,985.000	23,544,037.00	\$ 23,544,037.00
C.F.C. CONFINANCIERA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTCNFSOV	100,000,000.00	\$ 100,000,000.000	100,000,000.00	\$ 100,000,000.00
C.F.C. CONFINANCIERA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTCNFSOV	80,000,000.00	\$ 80,000,000.000	80,000,000.00	\$ 80,000,000.00
BCD. DAVIVIENDA S.A	CERT.DEPOSITO TERMI	CDTDOVISOV	4,620,774.60	\$ 4,620,774.600	4,628,670.00	\$ 4,628,670.00
BCD. DAVIVIENDA S.A	CERT.DEPOSITO TERMI	CDTDOVISOV	10,509,012.00	\$ 10,509,012.000	10,580,227.00	\$ 10,580,227.00
BCD. DAVIVIENDA S.A	CERT.DEPOSITO TERMI	CDTDOVISOV	6,000,000.00	\$ 6,000,000.000	5,956,095.00	\$ 5,956,095.00
CMR FALABELLA S.A. CIA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	3,308,982.00	\$ 3,308,982.000	3,315,092.00	\$ 3,315,092.00
CMR FALABELLA S.A. CIA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	24,127,015.00	\$ 24,127,015.000	24,497,298.00	\$ 24,497,298.00
CMR FALABELLA S.A. CIA	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFALSOV	2,930,079.00	\$ 2,930,079.000	3,077,526.00	\$ 3,077,526.00
C.F.C. INVERSORA PACHI	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	3,500,710.00	\$ 3,500,710.000	3,650,419.00	\$ 3,650,419.00
C.F.C. INVERSORA PACHI	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	1,000,000.00	\$ 1,000,000.000	1,012,177.00	\$ 1,012,177.00
C.F.C. INVERSORA PACHI	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTFINSOV	2,207,858.00	\$ 2,207,858.000	2,283,570.00	\$ 2,283,570.00
C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE C	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTGMAOV	1,483,403.00	\$ 1,483,403.000	1,495,930.00	\$ 1,495,930.00
C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE C	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTGMAOV	4,928,558.00	\$ 4,928,558.000	4,987,704.00	\$ 4,987,704.00
C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE C	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTGMAOV	4,171,643.00	\$ 4,171,643.000	4,187,176.00	\$ 4,187,176.00
C.F.C. G.M.A.C. FIN. DE C	CERT.DEP.TERM. CIA.FC	CDTGMAOV	6,499,269.00	\$ 6,499,269.000	6,691,556.00	\$ 6,691,556.00

Exportar | Exportar Todo | Cerrar

4.3.2. REPsIMS

Seleccionar la fecha de medición

Fecha Portafolios

Fecha Medición: 04/11/2010

Aceptar | Cerrar

Informe Vencimientos Compromisos Liquidez

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio

PORTAFOLIO

Nombre: Nits:

Tipo:

Línea de Negocio:

Espece	Depósito	Número	Días al Vcto. UI	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio
[Empty Table]						

Fecha de Valorización --> 11/11/2010

Fecha de Liquidación --> 11/11/2010

Liquidar compromisos a:

- Fecha Liquidación
- Fecha Compromisos

Acceptar Cerrar

Luego de presionar el botón aceptar aparece la pantalla con el respectivo informe de Vencimientos Compromisos Liquidez

Informe Vencimientos Compromisos Liquidez

PORTAFOLIO

Portafolio:

Nits:

Fechas...

Valorización:

Liquidación:

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



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.

Eventos del Portafolio.

NOTIFICACIONES POR COMPRAVENTAS

22/08/2009

FechaEvento	HoraEvento	Evento	FechaRegistro	FechaCumple	No.Oper.	TipoNoti	NitContab	Beneficiario	Valor	Retefuente	BaseRetefuente	Traslado	BaseTraslado
24/08/2009	16:14:23	REGISTRA	20/08/2009	21/08/2008	1	EGRESO	01		0 \$ 600,000,000.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00
24/08/2009	16:14:29	REGISTRA	20/08/2009	05/08/2008	2	EGRESO	01		0 \$ 437,200,000.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00
24/08/2009	16:14:29	REGISTRA	20/08/2009	25/11/2008	3	EGRESO	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

Exportar 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

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	HoraEvento	Evento	FechaRegistro	FechaContab	No.Oper	Concepto	Descripción	CentroCosto	Nombre	Documento	Asiento	PUCBas
13/11/2009	16:06:13	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	122	1	COMPRA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
13/11/2009	16:06:11	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	222	1	COMPRA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	16:29:50	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	16:30:44	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	16:31:18	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	33	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	17:14:59	MODIFICA	01/10/2009	03/11/2009	34	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	17:26:25	MODIFICA	01/10/2009	12/10/2009	34	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	17:31:10	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	36	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	17:33:12	MODIFICA	01/10/2009	16/11/2009	36	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
03/11/2009	18:05:19	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	37	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
06/11/2009	15:14:27	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	78	1	COMPRA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
06/11/2009	15:16:53	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	79	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
06/11/2009	15:13:25	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	87	1	COMPRA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:39:32	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:38:26	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:38:44	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:39:07	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:39:17	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	14:57:48	NEGOCIAR	01/10/2009	01/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:02:33	MODIFICA	01/10/2009	26/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:31:56	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:32:16	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:33:27	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:34:02	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:34:29	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:34:47	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:35:03	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:35:33	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:36:04	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C
26/10/2009	15:36:28	MODIFICA	01/10/2009	09/10/2009	S1C	2	VENTA DE TITULOS		1 UNICO	0	0	13C

Esta información puede ser exportada a Excel para una mejor manipulación de datos

4.3.5. MOVIMIENTOS PORTAFOLIOS

Fecha Portafolios

Fecha Medicion: 07/03/2019
 Periodo: 07/03/2019

Num. Negocio
 Usuario
 Evento

Nivel(Grp, Lin, Port.): TODO
 Nombre Nivel:

Tipo Portafolio: Actual

TipoFecha: Registro Evento N/A

Eventos del Portafolio.

MOVIMIENTOS DEL PORTAFOLIO

07/03/2014

FechaRegistro	Portafolio	Deposito	Numdcvdl	NumNegocio	NumOrden	Punta	Posicion	Especie	FecOper
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0020	010-140226-0020	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0021	010-140226-0021	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0022	010-140226-0022	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0023	010-140226-0023	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014
07/03/2014	CARLOS	DVL	0	010-140226-0024	010-140226-0024	VENTA	CORTA	ECOH14F	26/02/2014

Registros: 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 de Riesgo

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO
 Nombre:
 Tipo:
 Línea de Negocio:
 Nits:

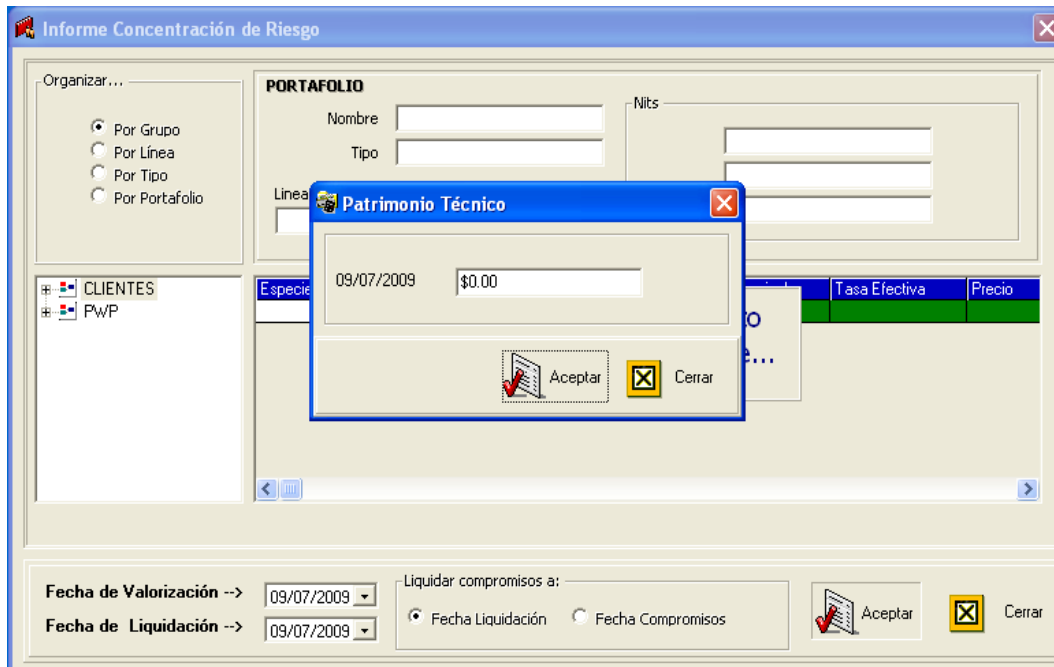
Especie	Depósito	Número	Días al Vcto. Úl	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

CLIENTES
 PWP

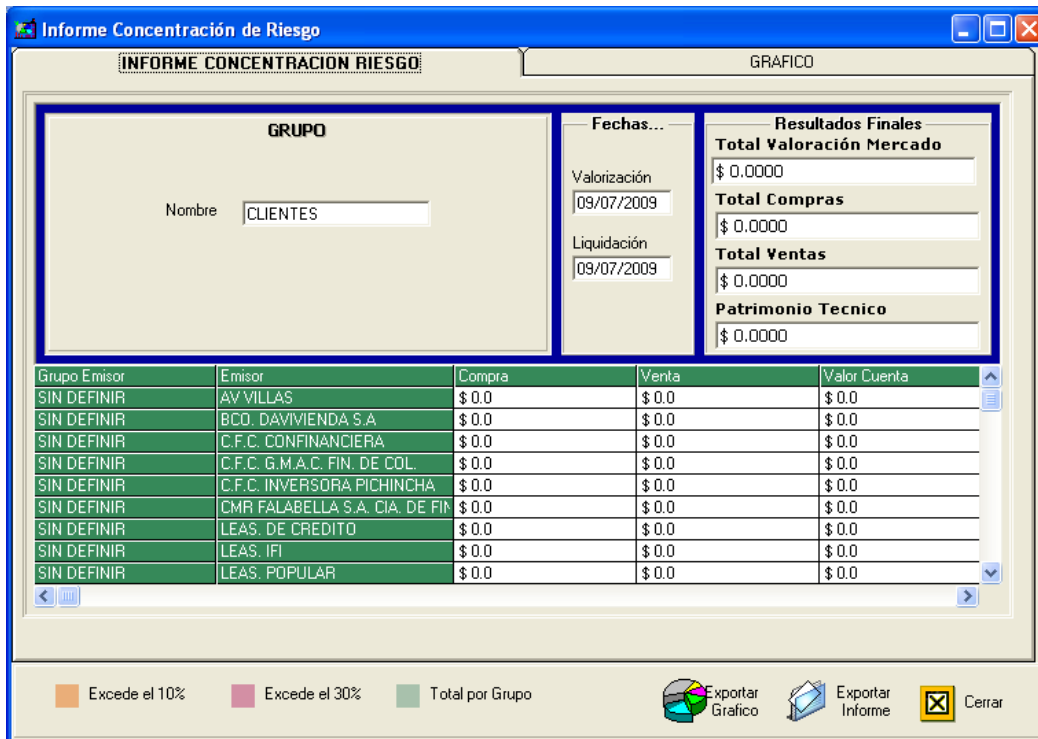
Fecha de Valorización --> 09/07/2009
 Fecha de Liquidación --> 09/07/2009

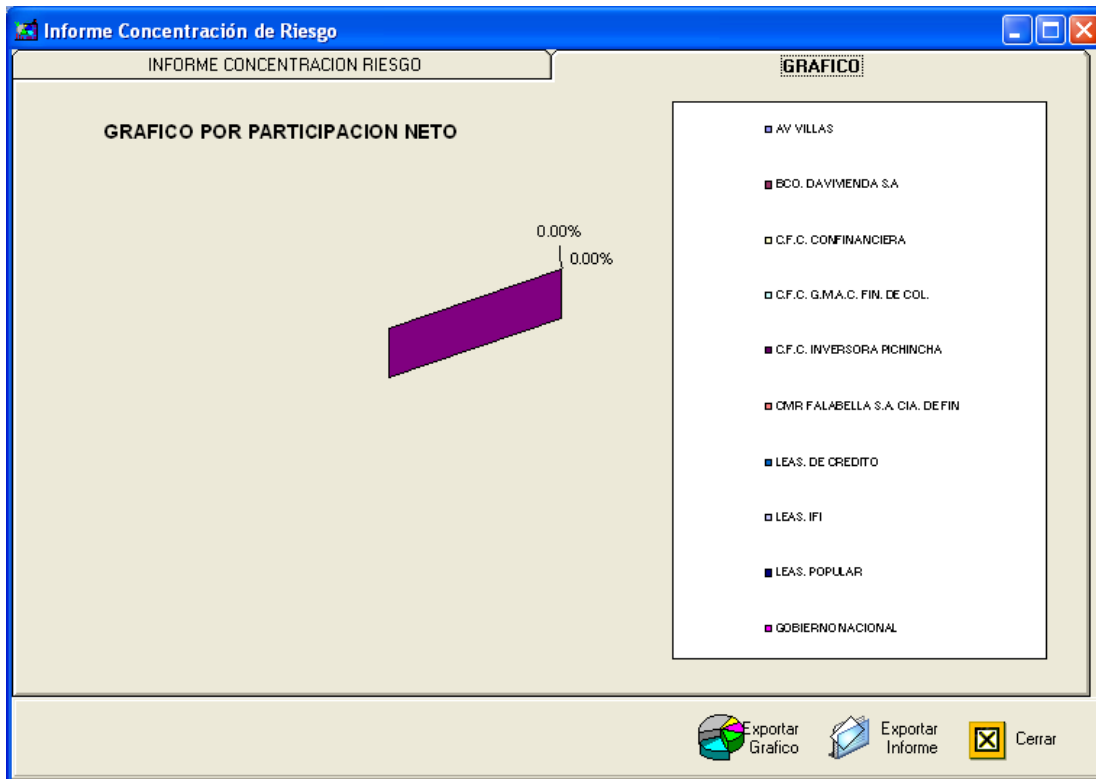
Liquidar compromisos a:
 Fecha Liquidación Fecha Compromisos

Al presionar el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla



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.





4.4.2. CONCENTRACION PORTAFOLIO

The screenshot shows a dialog box titled 'Fecha Portafolios'. It contains a date selection field labeled 'Fecha Medición' with the value '06/01/2009'. Below the field are two buttons: 'Aceptar' (with a checkmark icon) and 'Cerrar' (with a close icon).

Se debe seleccionar primero la fecha.

Informe Concentración de Portafolios

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO
 Nombre:
 Tipo:
 Línea de Negocio:

Nits:

Especie	Depósito	Número	Días al Voto. Úl	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

Fecha de Valorización --> 09/07/2009
 Fecha de Liquidación --> 09/07/2009

Liquidar compromisos a:
 Fecha Liquidación Fecha Compromisos

Aceptar Cerrar

Al presionar el Botón aceptar se aparece la siguiente pantalla.

Informe Concentración de Portafolios

GRUPO
 Nombre: CLIENTES

Fechas...
 Valorización: 09/07/2009
 Liquidación: 09/07/2009

Resultados Finales

Total Valoración Mercado	\$ 0.0000
Total Posición	\$ 0.0000
Total Compr. Largas	\$ 0.0000
Total Compr. Cortas	\$ 0.0000

Grupo Emisor	Emisor	Pésiciones	Compr. Largas	Compr. Cortas
SIN DEFINIR	AV VILLAS	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
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 COL.	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
SIN DEFINIR	C.F.C. INVERSORA PICHINCHA	\$ 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

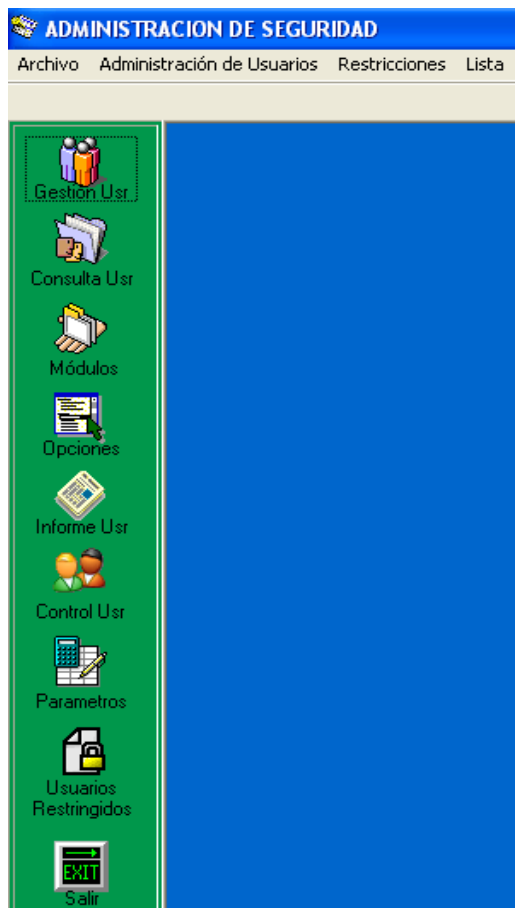
Exportar Cerrar

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.

The screenshot shows a window titled 'Administración de Usuarios'. The main section is 'DATOS GENERALES' with a green background. It contains the following fields:

- Código del Usuario: FWPREI
- Nombre: pwprei
- Nivel Acceso: Nivel (dropdown)
- Level: NIVEL (dropdown)
- Nombre: NOMBRE (text input)
- Password: [masked]
- Calidad: NORMAL (dropdown)
- Fecha de Creación: 10/03/2015 (dropdown)
- Fecha Cambio: 01/03/2011 (dropdown)
- Estado: ACTIVO (dropdown)

Below the form is a 'Navegador' section with a 'Registro: 1 de 11' display and 'Existen 11 Registros' text. At the bottom is a toolbar with icons for 'Todos los Usuarios', 'Nuevo Usuario', 'Ingresar Usuario', 'Modificar Usuario', 'Inhabilitar Usuario', and '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:

Código	Nombre	Calidad	Fecha Creación	Fecha Ult. Cambio	Estado
PWPREI	pwprei	NORMAL	01/04/2008	01/04/2008	ACTIVO
PRUEBA13	PRUEBA COLFONDOS MODIFICADO Y	NORMAL	01/04/2008	01/04/2008	INACTIVO
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.

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.

Datos Generales del Usuario		Módulos Restringidos	
Código del Usuario	CARLOS	Módulo	ADMINISTRACION DE SEGURIDAD
Nombre	CARLOS		CIRCULAR 031
Password	XXXXXXXXXX		FRONTERA
Calidad	NORMAL		
Fecha de Creación	13/01/2005		
Fecha Cambio	01/06/2005		
Estado	ACTIVO		
Opciones Restringidas para el Usuario			

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

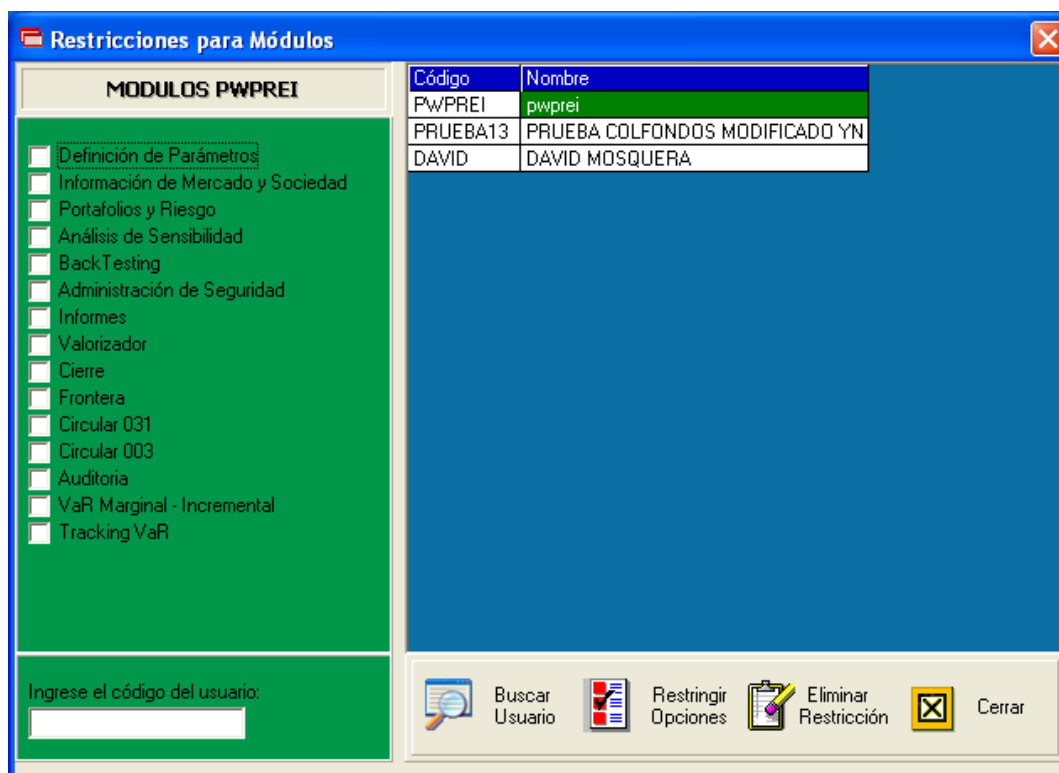
Al dar clic en esta opción aparece la siguiente pantalla en la cual deberá ingresarse el código de usuario para que aparezca la información respectiva.

Dicha información se muestra a continuación:

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.



Inmediatamente aparece un mensaje de Transacción Exitosa.

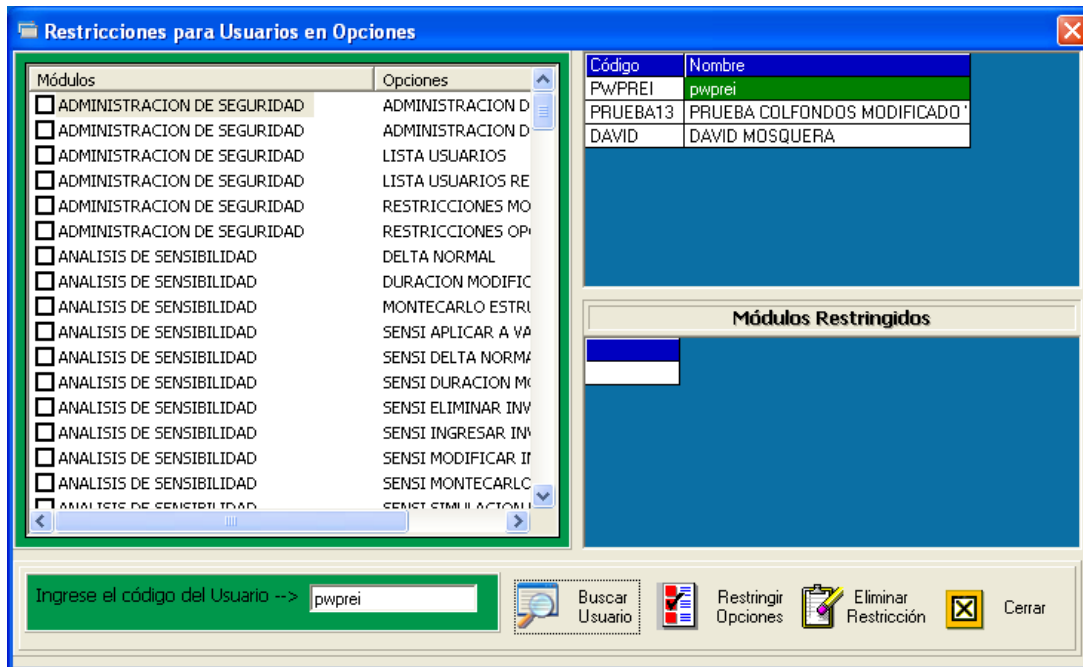
Si desea quitar la restricción deberá quitar las marcas de los módulos a los que no tenga acceso y oprimir el botón Eliminar Restricción.

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 cuadrícula 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.



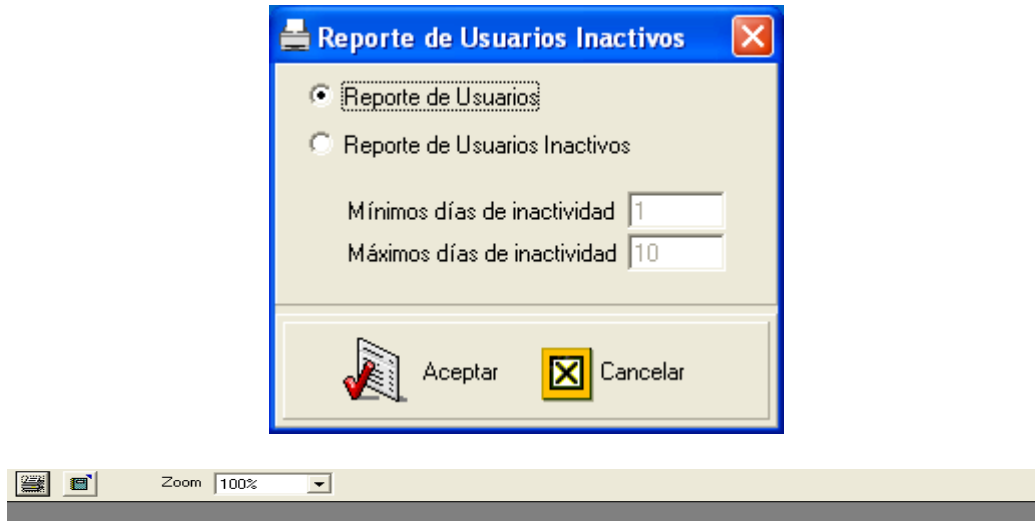
Inmediatamente aparece un mensaje de Transacción Exitosa.

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 cuadrícula 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

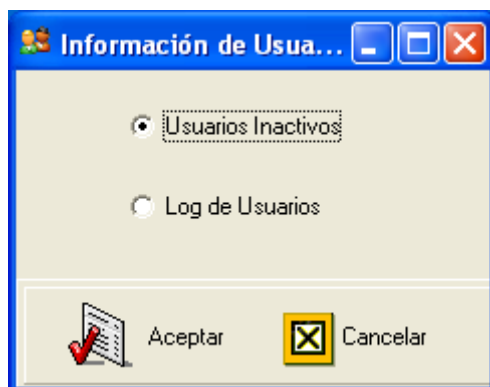


INFORME USUARIOS PWPREI

Código de Usuario	Nombre	Calidad	Estado	Fecha de Creación	Fecha de l
PWPREI	pwppei	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	I	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

Código	Nombre	Calidad	Estado	Fecha de Creación	Fecha de Cambio
PRUEBA13	PRUEBA COLFONDOS MI	N	Inactivo	01/04/2008	01/04/2008

5.1.6.2. Log de Usuarios



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	EÜÖÜY
01/06/2005	09:02:05 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	09:01:24 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	09:01:21 a.m.	Modificación	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	09:00:59 a.m.	Modificación	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	09:00:44 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	08:59:40 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
01/06/2005	08:59:33 a.m.	Acceso	Fallido	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
31/05/2005	12:13:54 p.m.	Consulta	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY
31/05/2005	12:13:17 p.m.	Consulta	Exitoso	CARLOS	CARLOS	N	EÜÖÜY

Adicionalmente puede exportar la información del Log de Usuarios, para manejo de informes.

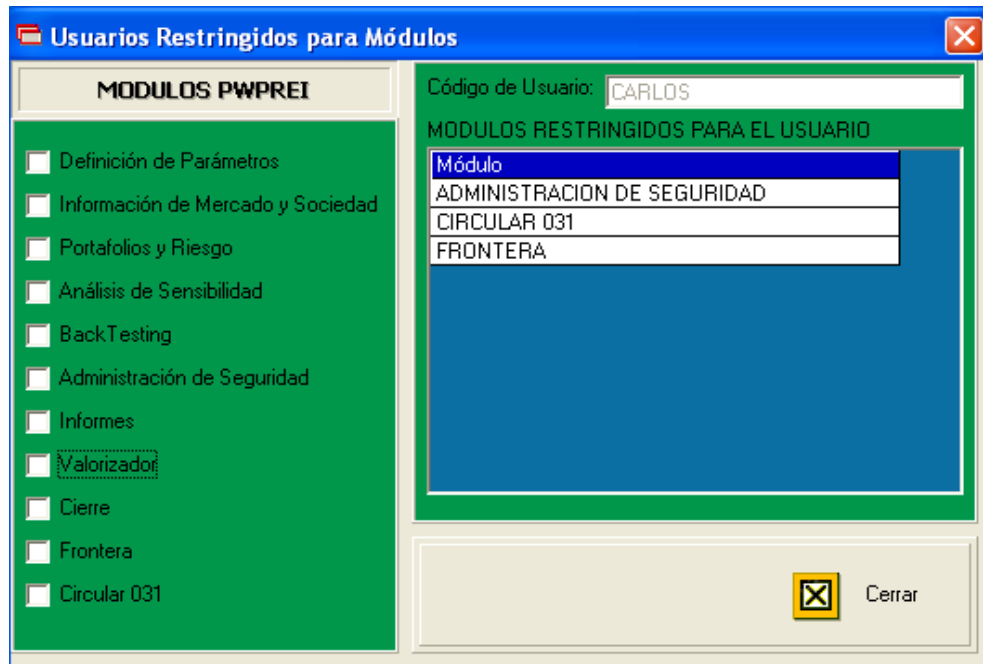
6.1.6.2.1. Parámetros

Con este modulo el administrador del sistema, controla todos los posibles eventos que tienen relación con el Password de los usuarios.

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

6.1.6.2.2. Usuarios restringidos

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**.

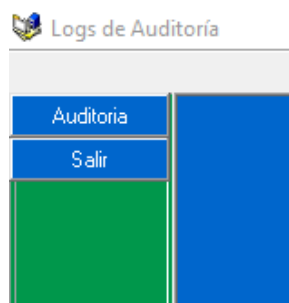


6. LOGS DE AUDITORIA



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.



6.1. OPCIÓN AUDITORIA



6.1.1. ACCIONES/DIVISAS ESPECIES RENTA VARIABLE

Logs de Auditoria - [ESPECIES RENTA VARIABLE]

Auditoria	Fecha	Hora	Usuario	Evento	Especie	Descripcion	Accof	Emisor	Moneda	Calificado	Indicador	Estado	CodSuper	Titulo	ISIN1	ISIN2	Cur CDT	Categ
	05/11/2010	:31:41 p.m.	00001	PWPREI	M	CNEC	CANACOL ENERGY	ACCION	CNE	COP	IGBYC	A	CAC13PAAO	ACC	CA13480810			
	05/11/2010	:32:20 p.m.	00001	PWPREI	M	GRUPOSUR	ACCION DE SURAM	ACCION	SIS	COP	IGBYC	A	COAC35000	ACC	COT13PA001			
	30/11/2010	:02:03 p.m.	00001	PWPREI	I	PROENERG	PROENERGI S.A.	ACCION	PEN		IGBYC	A	COT78PAAO					
	30/11/2010	:08:16 p.m.	00001	PWPREI	I	INTERBAN	INTERBAN - PARA	DIVISA	USA	TRM	IGBYC	A	VACIO	DIV				
	22/12/2010	:06:37 a.m.	00001	PWPREI	I	AAPL	APPLE INC	ACCION	HT		IGBYC	A	US03783310		US03783310			
	22/12/2010	:11:26 a.m.	00001	PWPREI	M	AAPL	APPLE INC	ACCION	APP		IGBYC	A	US03783310	ACC	US03783310			
	29/12/2010	:25:30 p.m.	00001	pwprei	I	ABX	BARRICK GOLD CO	ACCION	BGA		IGBYC	A	CA06790110		CA06790110			
	29/12/2010	:33:45 p.m.	00001	pwprei	I	AMZN		ACCION	AZN		IGBYC	A	US02313510		US02313510			
	29/12/2010	:36:20 p.m.	00001	pwprei	I	APC	ANADARKO PETROL	ACCION	ANA		IGBYC	A	US03251110		US03251110			
	29/12/2010	:38:54 p.m.	00001	pwprei	I	BAC	BANK OF AMERICA	ACCION	BOA		IGBYC	I	US06050510		US06050510			
	29/12/2010	:46:52 p.m.	00001	pwprei	I	C	CITIGROUP INC	ACCION	CTG		IGBYC	I	US17296710		US17296710			
	03/01/2011	:59:55 p.m.	00001	pwprei	I	GTE	GRAN TIERRA ENER	ACCION	GTI		IGBYC	A	US38500110		US38500110			
	03/01/2011	:01:45 p.m.	00001	pwprei	I	JNJ	JOHNSON & JOHNS	ACCION	JON		IGBYC	I	US47816010		US47816010			
	03/01/2011	:03:12 p.m.	00001	pwprei	I	JPM	JP MORGAN CHASE	ACCION	JPC		IGBYC	I	US46629410	ACC	US46629410			
	03/01/2011	:04:40 p.m.	00001	pwprei	I	MUR	MURPHY OIL CORP	ACCION	MOC		IGBYC	I	US62671710		US62671710			
	03/01/2011	:11:44 p.m.	00001	pwprei	I	PFE	PFIZER INC	ACCION	PHZ		IGBYC	I	US71708110		US71708110			
	03/01/2011	:13:00 p.m.	00001	pwprei	I	PG	THE PROCTER & GA	ACCION	PYG		IGBYC	I	US74271810		US74271810			
	03/01/2011	:14:37 p.m.	00001	pwprei	I	RIM	RESEARCH IN MOTI	ACCION	RML		IGBYC	A	CA76097510		CA76097510			
	03/01/2011	:16:04 p.m.	00001	pwprei	I	SLB	SCHLUMBERGER NV	ACCION	SCH		IGBYC	I	AN80685710		AN80685710			
	03/01/2011	:16:14 p.m.	00001	pwprei	M	SLB	SCHLUMBERGER NV	ACCION	SCH		IGBYC	I	AN80685710	ACC	AN80685710			

Este botón corresponde a la auditoria de las Especies de Acciones y Divisas.

6.1.1.1. BUSCAR ESPECIES ACCIONES/DIVISAS.

Espece Acciones

Buscar Por...

24/02/2011 Fecha

Usuario

Evento

Especie

Todos los registros

Aceptar 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.

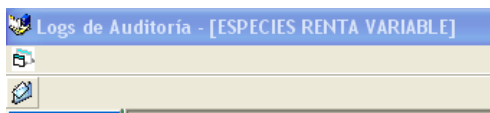
El Sistema suministrará la siguiente información:

- **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.
 - A = Activo
 - I = Inactivo
 - P = Suspensión en proceso
 - L = No hay suspensión
- **TipoBursa:** Tipo de Bursatilidad
 - A = Alta
 - M = Media
 - B = Baja
 - I = Mínima
 - N = Ninguna
 - 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
- **Accircula:** 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.

Auditoría	Fecha	Hora	Usuario	Evento	Especie	Descripcion	Acrof	Emisor	Moneda	Calificado	Indicador	Estado	CodSuper	Titulo	ISIN1	ISIN2	Cur CDT	Col
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	ANDIN272E	RENTA FIJA	L27		272	IRFBVC	A		TJM				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	APOPULAR	RENTA FIJA	BPO	COP		IRFBVC	A		APB			CRCDT	
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BAGRA605K	RENTA FIJA	GNA	COP		IRFBVC	A		BAA				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BALF101B1	RENTA FIJA	ALF	COP		IRFBVC	A		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBAV1991C	RENTA FIJA	BAY	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBO1047C	RENTA FIJA	BBO	UVR		IRFBVC	A		BOS			CECLWR	
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBO1047C	RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC8049D1	RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC1041B	RENTA FIJA	BCB	COP		IRFBVC	A		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC1069A	RENTA FIJA	BCI	COP		IRFBVC	A		BOR	CO052CB001			
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC02A7Z	RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	C		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC041A3S	RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC041A4E	RENTA FIJA	BCX	COP		IRFBVC	I		BOR				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC1049A	RENTA FIJA	BOC	COP		IRFBVC	A		BOS	COB23CB001			
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBBC205WZ	RENTA FIJA	BOC	COP		IRFBVC	A		BOS	COB23CB001			
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBPO1049S	RENTA FIJA	BPO	COP		IRFBVC	A		BOS	COB02CB001			
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBSA1059V	RENTA FIJA	BSA	COP		IRFBVC	A		BOS	COB06CB001			
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBTA1199A	RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBTA1199B	RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBTA1199A1	RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI				
	10/09/2010	14:44:41 p.m.	00001	PWPREI	M	BBTA1199V	RENTA FIJA	BOG	COP		IRFBVC	A		BPI	COG14880Z			

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.

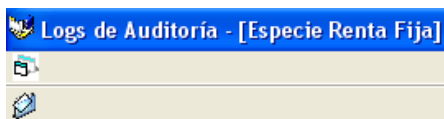
El Sistema suministrará la siguiente información:

- **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

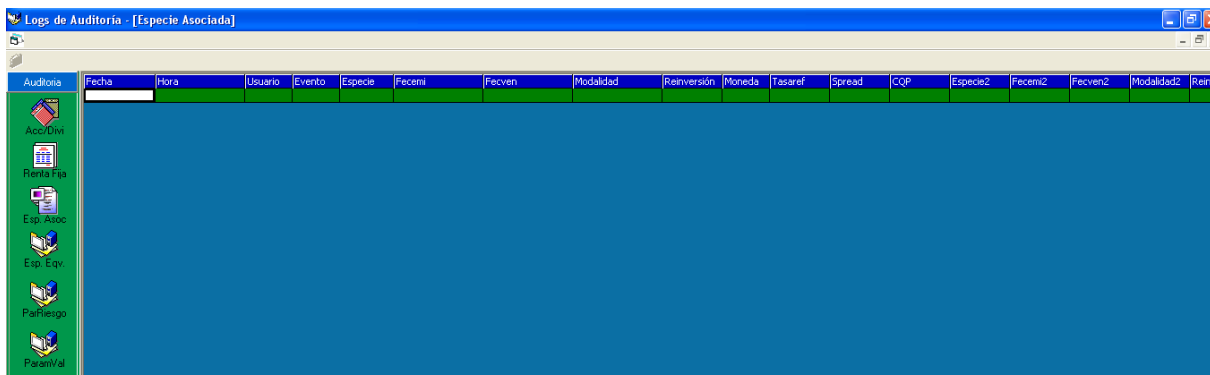
- **Tablades:** Tabla de desarrollo
- **Díaflujo1:** Para títulos con flujos irregulares, se informa el día de adquisición del título
- **MesFlujo1:** Para títulos con flujos irregulares, se informa el mes de adquisición del título
- **Nemoequiva:** Nemo-técnico Equivalente
- **FlujosRe:** Número de 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.



6.1.3. ESPECIE ASOCIADA



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

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 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)

6.1.3.2. 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

Auditoria	Fecha	Hora	Usuario	Evento	Especie	Feceni	Fecven	Modalidad	Reinversión	Moneda	TasaRef	Spread	COP	Especie2	Feceni2	Fecven2	Modalidad2	Reinve
	10/09/2010	12:00	PWPREI	M	ACREDITO	10/09/2010	10/09/2010	X	X	2	2	2	1	2	ACREDITO	10/09/2010	10/09/2010	X
	20/02/2011	1:00	PWPREI	M	BAGRA605	20/02/2009	20/03/2009	X	X	2	2	2	2	2	BAGRA605Q	20/08/2008	20/05/2009	X

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:

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

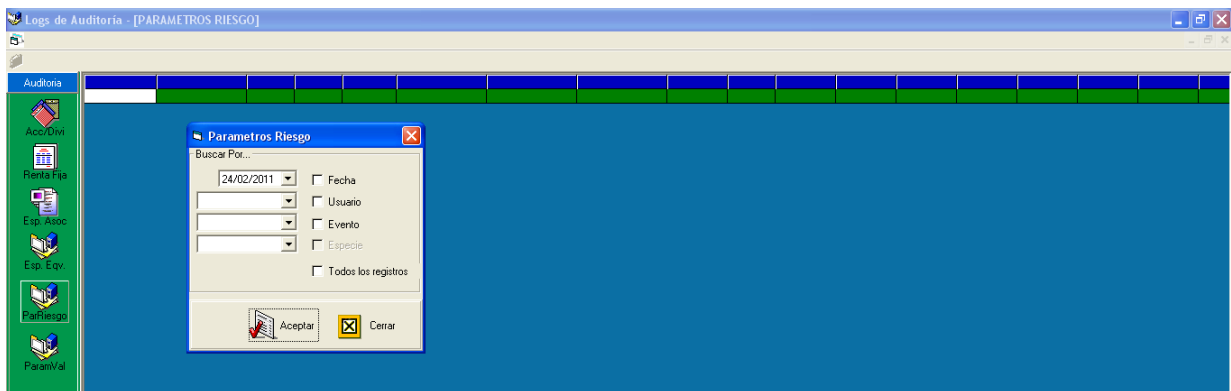
Spread2: Spread

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

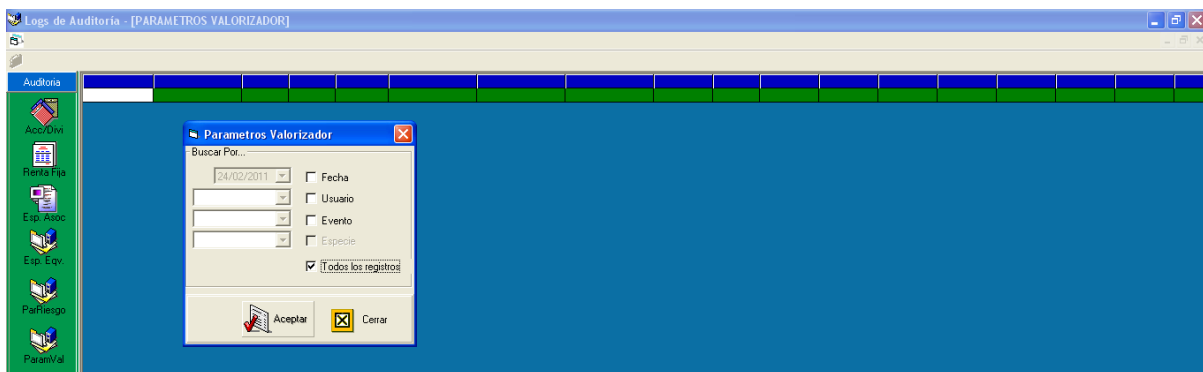


Muestra la información de los cambios ocurridos en los parámetros de Riesgo; por fecha, usuario, evento, especie o todos los registros.

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.

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.

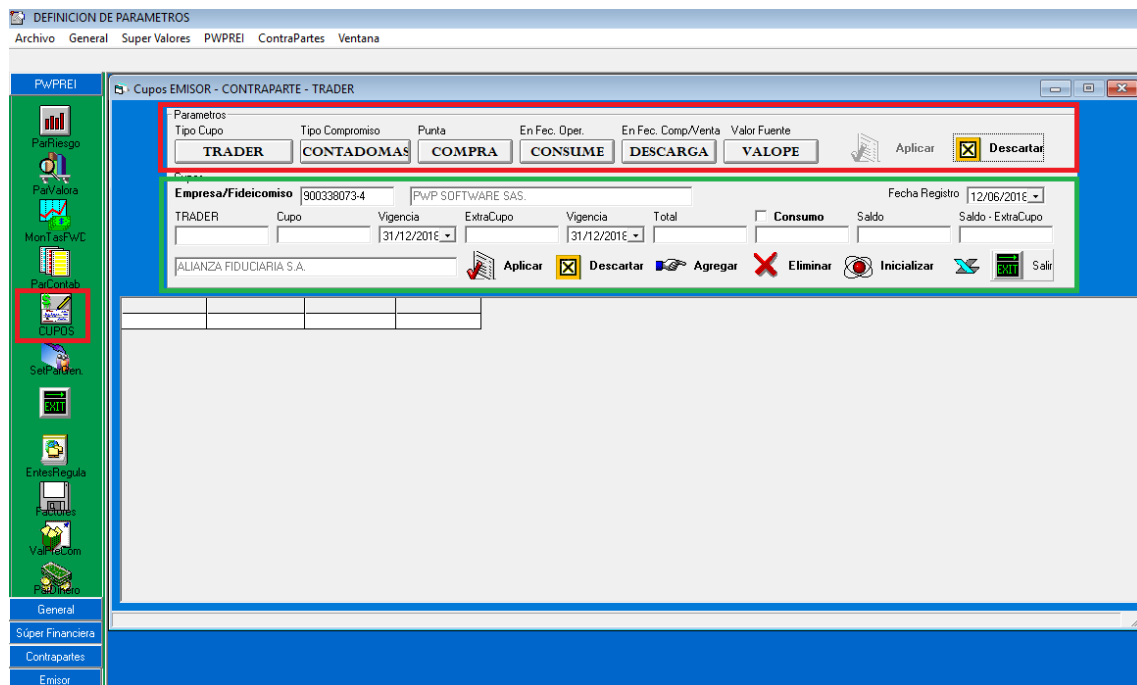
Hay dos conjuntos de datos que se auditan sobre el control de cupos en PWPREI:

- 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.

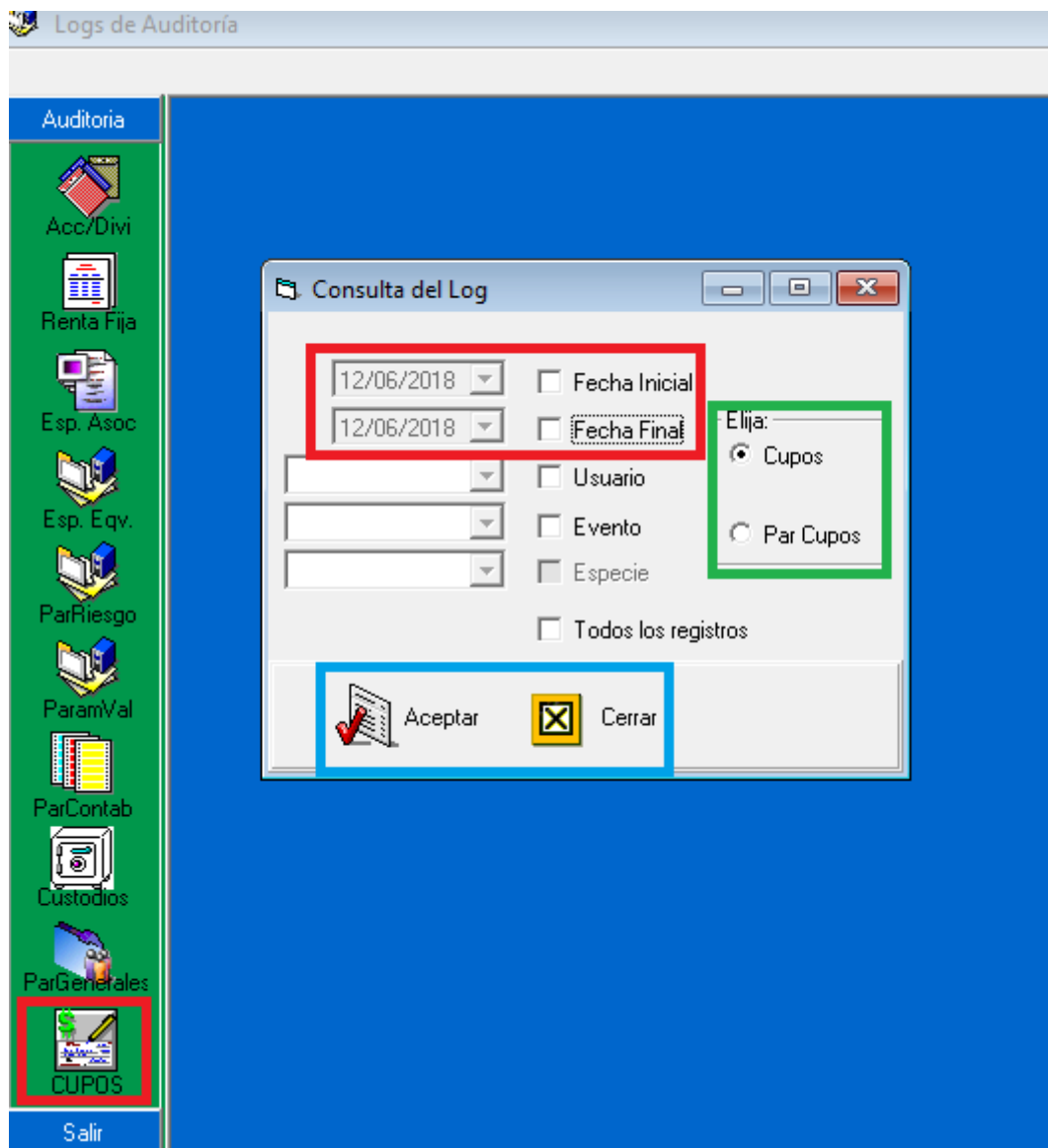
Los siguientes eventos son auditados, según el origen:

- 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.



3. Consulta del Log.

Para consultar el Log de Cupos ingrese al módulo de Auditoria, opción "Cupos":



Una vez haya establecido los criterios de búsqueda pulse "Aceptar". Le saldrá una pantalla como la siguiente:

Log de Auditoria

Log Cupos

FechaEvento	HoraEvento	Evento	Usuario	NombreDato	DatoAnterior	DatoNuevo	FechaRegistro	NitEmpFide	TipoCupo	Codigo
16/07/2018	17:43:33	MODIFICA	PWPREI	ExtraCupo	0	3,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	
16/07/2018	17:42:58	MODIFICA	PWPREI	FechaVigencia	31/12/2018	30/06/2019	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP
16/07/2018	17:42:35	MODIFICA	PWPREI	FechaVigencia	31/12/2018	31/03/2019	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP
16/07/2018	17:42:09	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	EMISOR	BOC
16/07/2018	15:58:36	MODIFICA	PWPREI	Cupo	15,000,000,000	20,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP
16/07/2018	15:58:25	MODIFICA	PWPREI	Cupo	10,000,000,000	15,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP
16/07/2018	15:58:15	MODIFICA	PWPREI	Cupo	8,000,000,000	9,000,000,000	12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP
10/07/2018	17:48:10	ELIMINA	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	AEV
10/07/2018	17:47:54	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	AEV
10/07/2018	17:46:27	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	AEV
10/07/2018	17:43:49	INGRESO	PWPREI	TODOS			12/06/2018	900338073-4	CONTRAPARTE	PWP

Exportar Cerrar

Registro(s) 12

6.1.7. PARAMETROS CONTABILIDAD

Consulta del Log

07/03/2019 Fecha Inicial

27/03/2019 Fecha Final

PWPREI Usuario

INGRESO Evento

AABN Especie

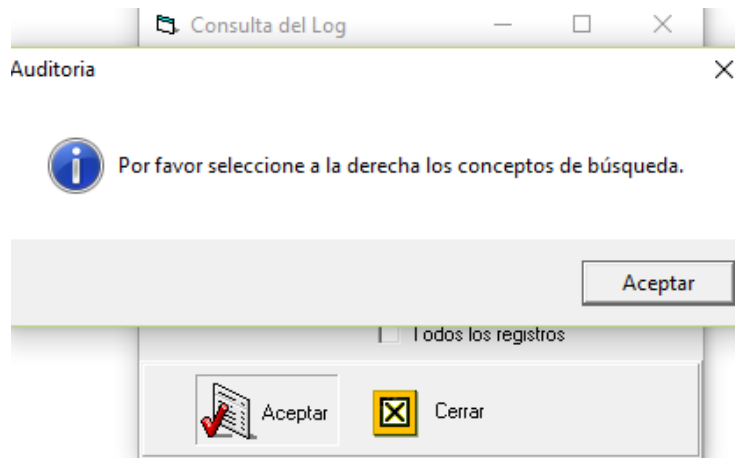
Todos los registros

Aceptar Cerrar

Log Parámetros Contables

FechaEvent	HoraEvento	Usuario	Estacion	EventoLg	TipoPUC	Destino	TipoComproi	TipoContra	TipoInversio	Punta	Especie	FechaEmisio	FechaVen	Evento	ValorFu
26/06/2018	17:49:11	PWPREI	PWPGEREN	ASOCIAR	NA	NA	NA	NA	NA	NA	CONTRA2	NA	NA	NA	NA
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENDI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENDI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	PERMANENT	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENDI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENCP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	NEGOCIAR	VALCAI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	INCUMPLIR	CXP
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SEG	NEGOCIABLI	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	CUMPLIR	VALOPI
18/11/2017	16:35:20	PWPREI	PWPGEREN	MODIFICA	FINANCIER	PROPIO	SIMULTANE	SCP	VENCIMIEN	PASIVA	TFIT 152407	NA	NA	VALORAR	RENDI

6.1.8. CUSTODIOS

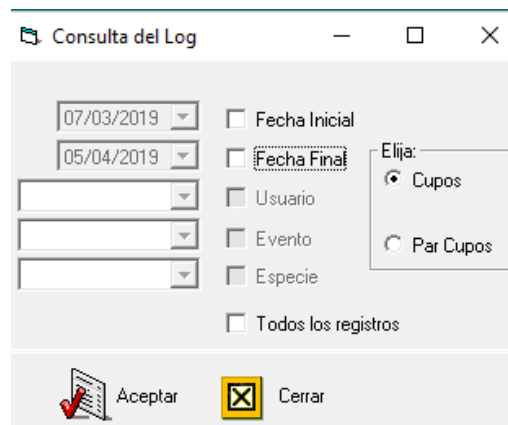


6.1.9. PARAMETROS GENERALES

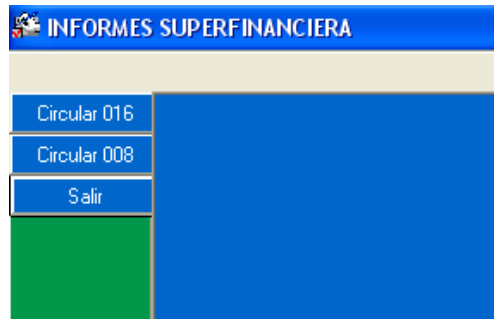
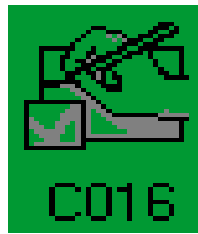
Log Parámetros Generales

FechaEvento	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 PREMIER=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 PREMIER, 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 PREMIER, 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

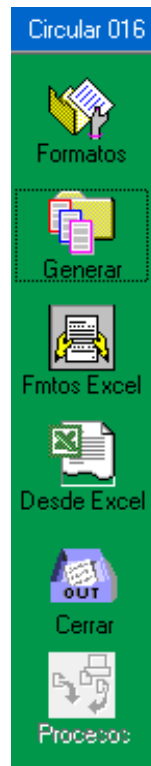
6.1.10. CUPOS



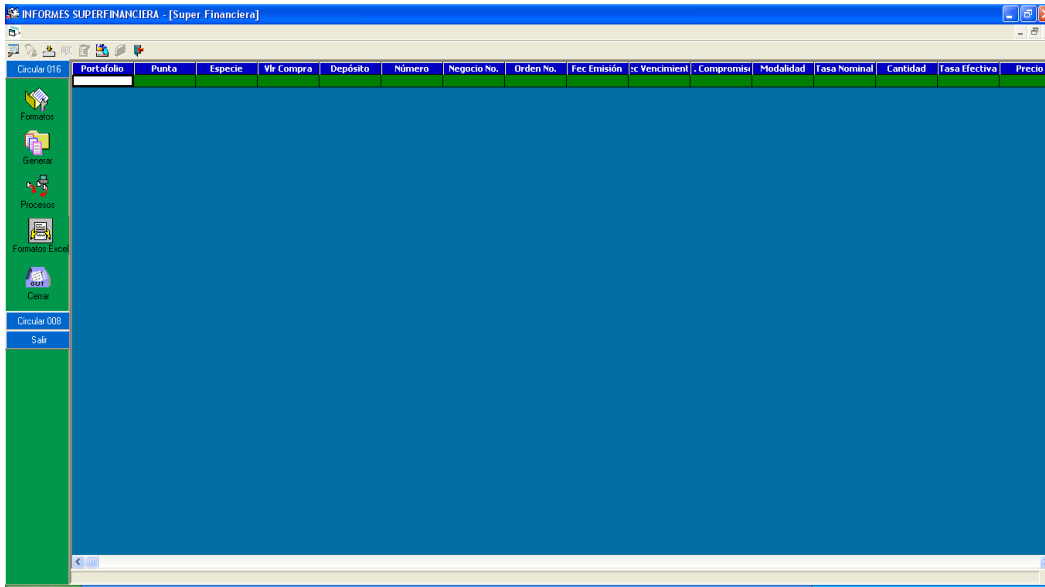
7. CIRCULAR 016



7.1. OPCION CIRCULAR 016



7.1.1. FORMATOS



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



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

Fecha de Registro: 15/02/2010

Portafolio: VAMCOL
 Especie: CDTBCBS0V
 Cantidad: 40712778

CIUU - VAL

PUC Inversión	Fungible
PUC Provisión	Val Provisión
PUC Causación Res.	Val Causación Res.
PUC Causación Patrimonio	Val Causación Patrimonio

IINFO

Base Provisión: 1.Titulos Deuda-Vr. Residual
 Avalado: SI: esta avalado
 Restricción: 2.No Restringido
 Sistema: 9.Otro
 Mercado: 1.Primario
 Novedad: 1.Compra
 Origen Novedad:
 Compensación: DVP
 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

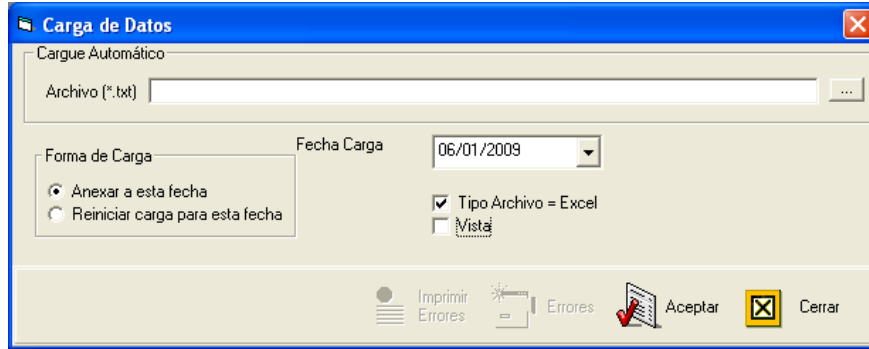
Se abre la siguiente pantalla donde se puede hacer la actualización de un determinado Portafolio.

The screenshot shows a software window titled 'Inver003'. It contains several input fields and dropdown menus for recording investment data. At the top, there is a 'Fecha de Registro' field with a date selector set to '15/02/2010'. Below this, there are fields for 'Portafolio' (VAMCQL), 'Especie' (CDTBCBSOV), and 'Cantidad' (40712778). A section labeled 'CIU - VAL' contains a grid of input fields for 'PUC Inversión', 'Fungible', 'PUC Provisión', 'Val Provisión', 'PUC Causación Res.', 'Val Causación Res.', 'PUC Causación Patrimonio', and 'Val Causación Patrimonio'. To the right, an 'INFO' section contains dropdown menus for 'Base Provisión' (1. Títulos Deuda-Vr. Residual), 'Avalado' (SI: esta avalado), 'Restricción' (2.No Restringido), 'Sistema' (9.Otro), 'Mercado' (1.Primario), 'Novedad' (1.Compra), 'Origen Novedad', 'Compensación', and 'Cal. Crediticio' (A.Riesgo Normal). At the bottom right, there are two buttons: 'Aceptar' (with a checkmark icon) and 'Cerrar' (with a close icon).

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.

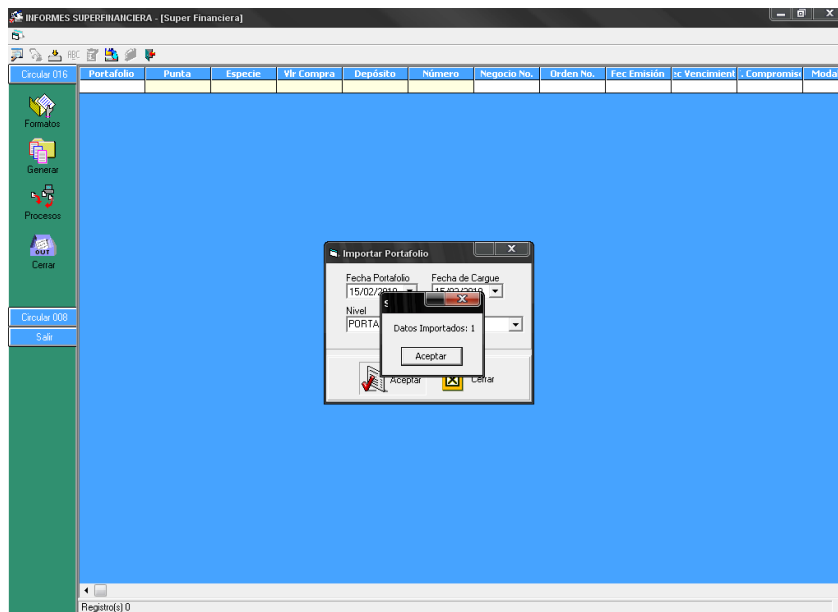


7.1.1.5. IMPORTAR FORMATOS

Cuando se presiona el botón de importar datos aparece la siguiente pantalla:



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

FECHA DE PROCESO.- Corresponde a la fecha del portafolio a reportar.

TIPO DE ENTIDAD.- Corresponde a su tipo de entidad de acuerdo 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.

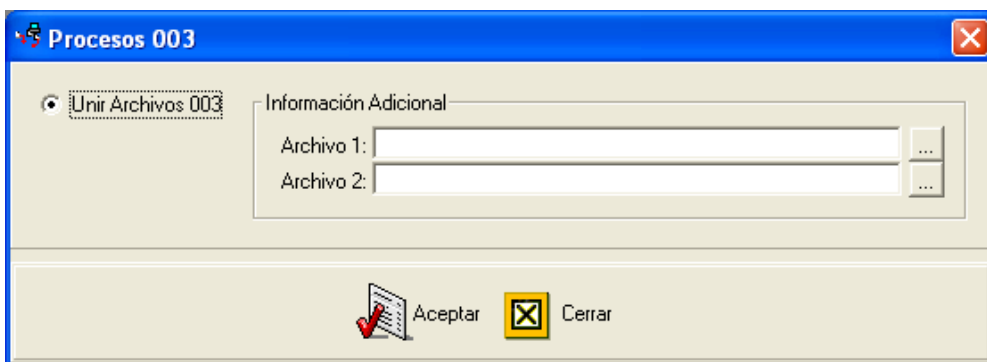
El sistema permite generar un solo archivo con todos los formatos o generar un archivo por cada uno de los formatos, de acuerdo a nuestra interpretación del instructivo suministrado por la Superintendencia Financiera se debería generar uno por cada formato puesto que tienen diferente tipo de informe. 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

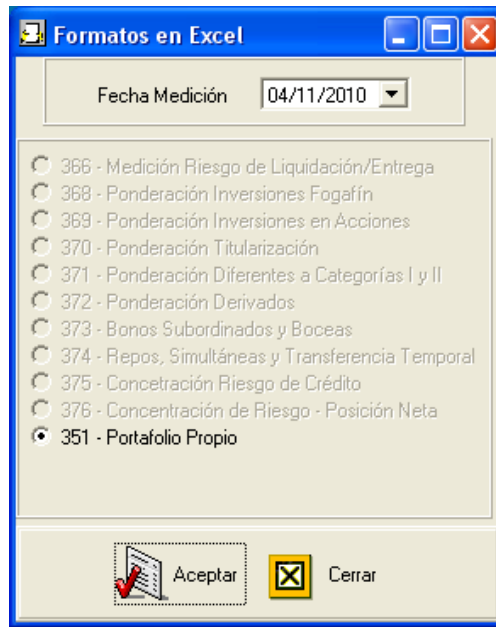
luego seleccione el o los formato que desee incluir en el archivo y de aceptar. El sistema genera un archivo sin encabezado, numerado a partir del consecutivo que se indicó y con registro tipo 6 al final. Mire este registro Tipo 6 y tome de ahí el número total de registros para que lo coloque en el registro 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



Este es el procedimiento para unir los dos archivos y ser enviados a la Superintendencia Financiera.

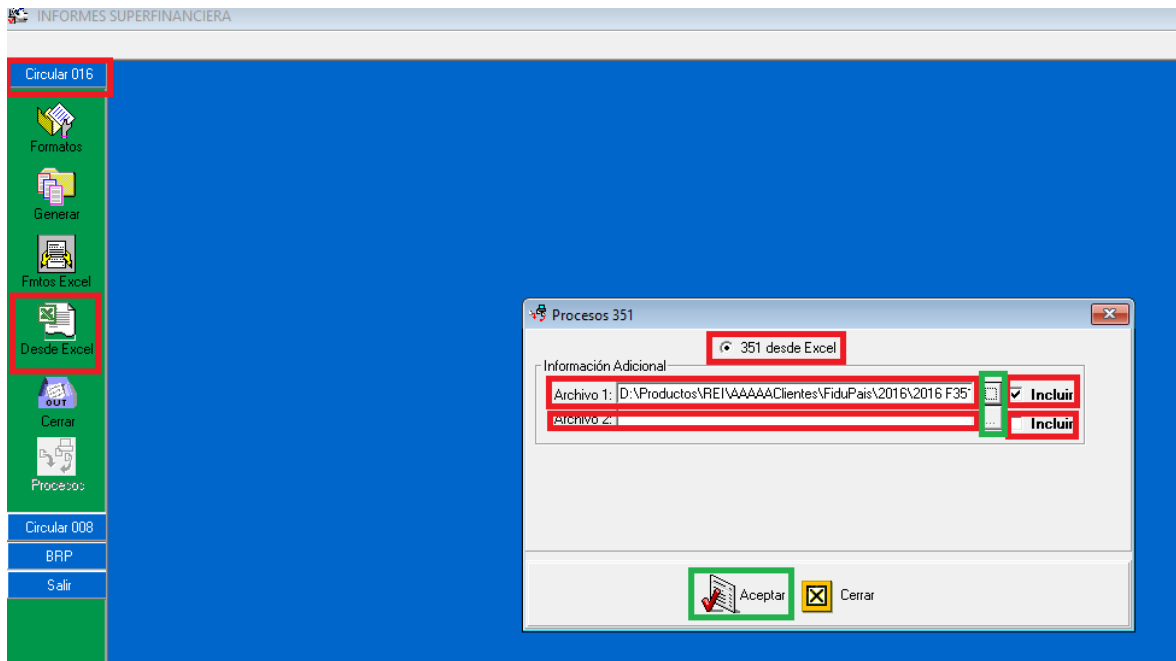
7.1.3. FORMATOS EN EXCEL



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.: 06/01/2009 Fecha de Liquid.: 06/01/2009 Consecutivo: 1

Tipo Entidad: Código Entidad: Clave:

Tipo de Informe

- T51: Bices. Diarios - Comisionistas (Ftos: 368 a 372 y 374)
- T54: Bices. Diarios - Comisionistas (Ftos: 366 y 373)
- T64: Exceso Lte. de C/tración de Riesgo (Ftos: 375 y 376)
- Todos los Formatos

Guardar como:

Aceptar Cerrar

7.2.1.2. FORMATOS EN EXCEL

Formatos en Excel

Fecha Medición: 06/01/2009

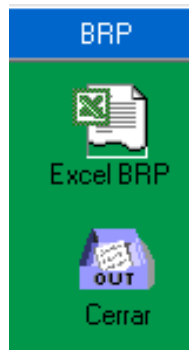
- 366 - Medición Riesgo de Liquidación/Entrega
- 368 - Ponderación Inversiones Fogafin
- 369 - Ponderación Inversiones en Acciones
- 370 - Ponderación Titularización
- 371 - Ponderación Diferentes a Categorías I y II
- 372 - Ponderación Derivados
- 373 - Bonos Subordinados y Boceas
- 374 - Repos. Simultáneas y Transferencia Temporal
- 375 - Concentración Riesgo de Crédito
- 376 - Concentración de Riesgo - Posición Neta

Aceptar Cerrar

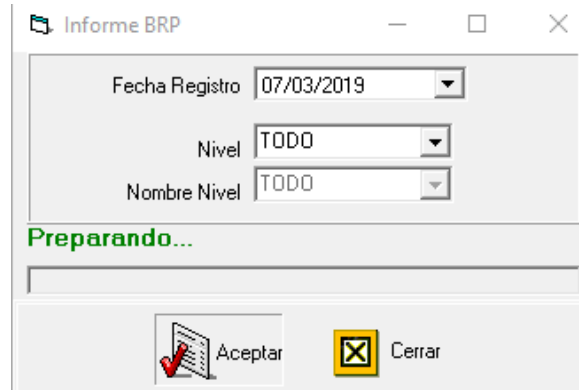
7.2.1.3. CONCENTRACION DE RIESGO



7.3. OPCION BRP



7.3.1. EXCEL BRP



8. PORTAFOLIOS Y RIESGO

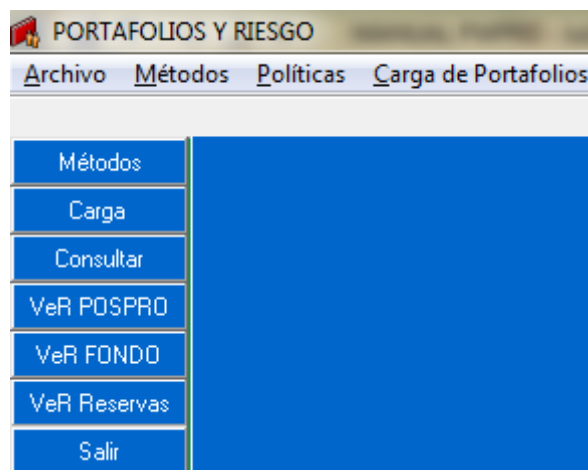


Al dar clic en esta opción aparecerá la pantalla del Módulo de Portafolios y Riesgo, es decir, en donde se pueden hacer las mediciones del **VaR (Valor en Riesgo)**, el ingreso manual y automático de Inversiones y Portafolios y finalmente la aplicación de políticas de control de **VaR**.

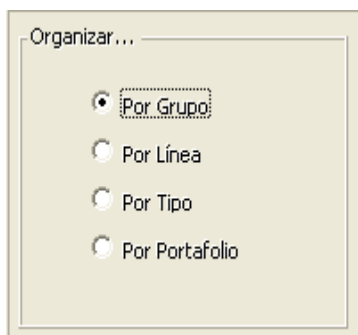
Al dar clic en el Modulo de Portafolio y Riesgos pregunta primero la fecha.



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.

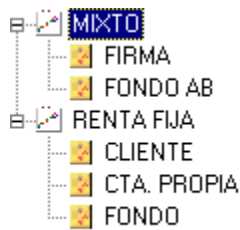
- Por Grupo: Aquí se encuentran todos los Grupos establecidos por la compañía dentro de los cuales estarán las Líneas de Negocio. Ejemplo: Fondo, Firma. Al dar clic en el nombre del Grupo aparecen los portafolios pertenecientes a cada uno de esos grupos.



- Por Líneas de Negocio: Son las Líneas de Negocio o actividades que desarrolla la firma y dentro de las cuales se clasifican los portafolios.



- 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.



- La siguiente pantalla se ha dividido por 4 áreas para una mejor explicación

Organizar...

Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO 04/11/2010

Nombre: Beneficiarios:

Tipo:

Línea de Negocio:

1

CLIENTES

2

INVERSIONES

Ingresar Modificar Eliminar Venta Compra Ver Reversa

3

Punta	Especie	Número	Negocio No.	Orden No.	Fec Emisión
4					

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
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Trans. Temp. Forward Opciones Op. Plazo

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 28/05/2013 Fecha Oper: 28/05/2013 Fec Cumplimiento: 28/05/2013 Punta: COMPRA Posición: LARGA Nro. Negocio: 0 Nro. de Orden: 0 Portafolio:
 Emisor: Especie: Depósito: DCV Isin/NumEmisión: 0 Tipo Inversión: NEGOCIABLE Contraparte: Hora Compra: 03:15:05 Tipo Fw: NDV

Datos Faciales
 Emisión: 12/02/2002 Vencimiento: 12/02/2002 Tasa Nominal: 0.00 Completo-Cup-Ppal: COMPLETO Modalidad Emisión: Mod1
 Cantidad: 0.0 Valor de Compra: 0.0 Per1:
 Trader: Trader Adicional: 0.0 Modalidad Reinv.: Mod2 Per2:
Valoración
 T. Efect.: Precio: 0.00 Captación/Salida: 0.0
 T.Repo/Cpr: 0.00 Oper. Regreso: 0 Valor Giro/Recompra: 0.00
 Dias Cpr: 0.000 Fec Cpr.: 28/05/2013 Orden CPR: FINAL

Comisión: Base Comisión: Retención: Base Retención: Traslado: Base Traslado: Operación Origen/A Cubrir:
 PUC: Nit Cliente: Nombre Cliente: Sistema: MEC Usuario: Estación: Estado Título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO Finalidad: ESPECULA Compensación: DVP Forma de Pago: TRA Cal. Crediticio Inv.: A

Calcular Aceptar 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: 28/05/2013 | Fecha Oper: 28/05/2013 | Fec Cumplimiento: 28/05/2013 | Punta: COMPRA | Posición: LARGA | Número del Negocio: 0

Número de Orden: 0 | Portafolio: | Emisor: | Especie: Especie

Tipo Inversión: NEGOCIABLE | Contraparte: | Hora Compra: 03:14:08 p.m. | Tipo Forward: NDV | Depósito: DVL | Isin/NumEmisión: 0

Valoración

Cantidad	Precio	Valor de Compra	Valor Captación	Valor Giro/Recom	Tasa Cpr.	Neto Repo
0.0	0.00000000	0.00	0.00000000	0.00	0.000	0.000

Fec Compromiso: 28/05/2013 | Dias Comprom.: 0.000 | Orden Comprom.: FINAL | Adicional: 0.000 | Trader: Trader

Comisión: | Base Comisión: | Operación Origen: | PUC: | Nit Cliente: | Sistema: MEC

Usuario: | Estación: | Nombre Cliente: | Estado Título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Decl. de Cambio: 0 | Nral. Cambiario: 0

Lugar de la transacción: NA(NA) (PwP=0000) | País Origen:

Calculador | Aceptar | Cerrar

Cuando escoge el tipo Divisas aparece la siguiente pantalla de Ingreso.

Divisas

Tipo de Operación

Normal
 Contado+1a3
 Repo
 Trans. Temp.
 Oper. a Plazos
 Forward
 OPCFTRM
 Opciones
 InterBancarios

Datos Compromiso

Fecha Registro: 28/05/2013
 Fecha Oper: 28/05/2013
 Fec Cumplimiento: 28/05/2013
 Punta: COMPRA
 Posición: LARGA
 Número del Negocio: 0

Número de Orden: 0
 Portafolio:
 Emisor:
 Especie: Especie

Tipo Inversión: NEGOCIABLE
 Contraparte:
 Hora Compra: 03:14:47 p.m.
 Tipo Forward: NDV
 Depósito: DVL
 Isin/NumEmisión: 0

Valoración

Cantidad: 0.0
 Precio: 0.00000000
 Valor de Compra: 0.00
 Valor Captación: 0.00000000
 Valor Giro/Recom: 0.00
 Tasa Cpr.: 0.000
 Neto Repo: 0.000

Fec Compromiso: 28/05/2013
 Dias Comprom.: 0.000
 Orden Comprom.: FINAL
 Adicional: 0.000
 Trader: Trader

Comisión:
 Base Comisión:
 Operación Origen:
 PUC:
 Nit Cliente:
 Sistema: MEC

Usuario:
 Estación:
 Nombre Cliente:
 Estado Título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO
 Finalidad: ESPECULA
 Compensación: DVP
 Forma de Pago: TRA
 Decl. de Cambio: 0
 Nral. Cambiario: 0

Lugar de la transacción: NA(NA) (PWP=0000)
 País Origen:

MODIFICAR

The screenshot shows a software window titled "Renta Fija" with a green title bar. The window contains several sections of data entry fields:

- Tipo de Operación:** Radio buttons for Normal (selected), Contado+1a5, Repo, Simultáneas, Trans. Temp., Forward, Opciones, and Op. Plazo.
- Datos Compromiso:** Fields for Fecha Registro (28/05/2013), Fecha Oper (28/05/2013), Fec Cumplimiento (28/05/2013), Punta (COMPRA), Posición (LARGA), Nro. Negocio (0), Nro. de Orden (0), and Portafolio.
- Datos Faciales:** Fields for Emisión (12/02/2002), Vencimiento (12/02/2002), Tasa Nominal (0.00), Completo-Cup-Ppal (COMPLETO), Modalidad Emisión (Mod1), Cantidad (0.0), Valor de Compra (0.0), and Modalidad Reinver. (Per2).
- Valoración:** Fields for T. Efect. (0.00), Precio (0.00), Captación/Salida (0.0), T.Repo/Cpr (0.00), Oper. Regreso (0), Valor Giro/Recompra (0.00), Dias Cpr (0.000), Fec Cpr (28/05/2013), and Orden CPR (FINAL).
- Comisión:** Fields for Comisión, Base Comisión, Retención, Base Retención, Traslado, Base Traslado, and Operación Origen/A Cubrir.
- Identificación:** Fields for PUC, Nit Cliente, Nombre Cliente, Sistema (MEC), Usuario, Estación, and Estado Título (NORMAL).
- Operación:** Fields for Mercado (SECUNDARIO), Finalidad (ESPECULA), Compensación (DVP), Forma de Pago (TRA), and Cal. Crediticio Inv. (A).

At the bottom of the window, there are three buttons: "Calcular" (with a calculator icon), "Aceptar" (with a checkmark icon), and "Cerrar" (with a close icon).

Para modificar información correspondiente a Inversiones, seleccione de la cuadrícula 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 cuadrícula 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 Contado+1a5 Repo Simultáneas Trans. Temp. Forward Opciones Op. Plazo

Datos Compromiso:
 Fecha Registro: 28/05/2013 | Fecha Oper: 28/05/2013 | Fec Cumplimiento: 28/05/2013 | Punta: COMPRA | Posición: LARGA | Nro. Negocio: PP01 | Nro. de Orden: PP01 | Portafolio: POSPRODEUDA
 Emisor: GOBIERNO NACIONAL | Especie: TFIT15240720 | Depósito: DCV | Isin/NumEmisión: COL17CT02302 | Tipo Inversión: NEGOCIABLE | Contraparte: AEV | Hora Compra: 12:11:42 | Tipo Fw: NDV

Datos Faciales:
 Emisión: 24/07/2005 | Vencimiento: 24/07/2020 | Tasa Nominal: 11.00
 Cantidad: 2,000,000,000.0 | Valor de Emisión: 2,617,000,000.0
 Trader: TRADER1 | Adicional: 0.0

Valoración:
 T. Efect: 7.05 | Precio: 130.851101 | Captación/Salida: 0.0
 T.Repo/Cpr: 0.00 | Oper. Regreso: 0 | Valor Giro/Recompra: 0.00
 Dias Cpr: 0.000 | Fec Cpr: 28/05/2013 | Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 | Base Comisión: 0.0 | Retención: 0.0 | Base Retención: 0.0 | Traslado: 0.0 | Base Traslado: 0.0 | Operación Origen/A Cubrir:
 PUC: 0 | Nit Cliente: | Nombre Cliente: | Sistema: MEC | Usuario: | Estación: | Estado Título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Cal. Crediticio Inv. A

Calculador | Aceptar | Cerrar

Portafolio - Inversión

Transacción exitosa

Aceptar

ELIMINAR PORTAFOLIOS

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

CLIENTES

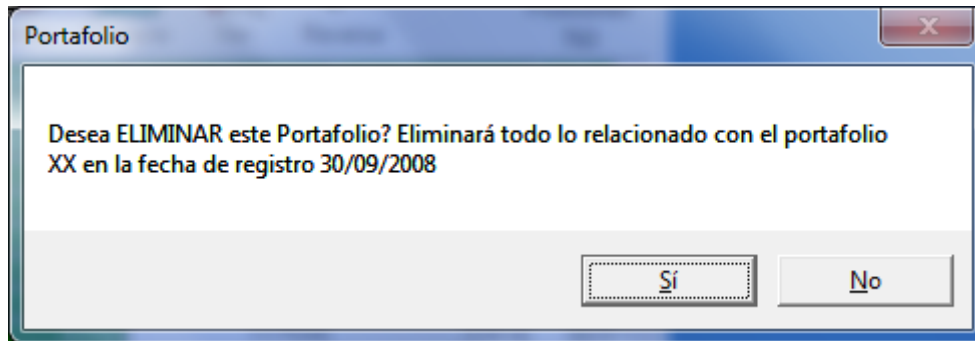
PORTAFOLIO 30/09/2008
 Nombre: Beneficiarios:
 Tipo: GNA
 Línea de Negocio: PUBLICO

INVERSIONES
 Ingresar | Modificar | Eliminar | Venta | Compra | Ver | Reversa

Posiciones: 760

Punta	Especie	Número	Negocio No.	Orden No.	Fec Emi
COMPRA	BGLT1022101E	COG17Bx0031	107150	49739	24/0
COMPRA	BGLT1022101E	COG17Bx0031	127225	60517	24/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	100797	49489	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	88722	43366	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	96478	47589	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	96517	47607	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	117596	49486	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	117594	50414	08/0
COMPRA	TBVT10080611	43768	102972	50357	08/0
COMPRA	TBVT1527051E	44618	88841	42944	27/0
COMPRA	TFIC05100709	47429	86647	43361	10/0

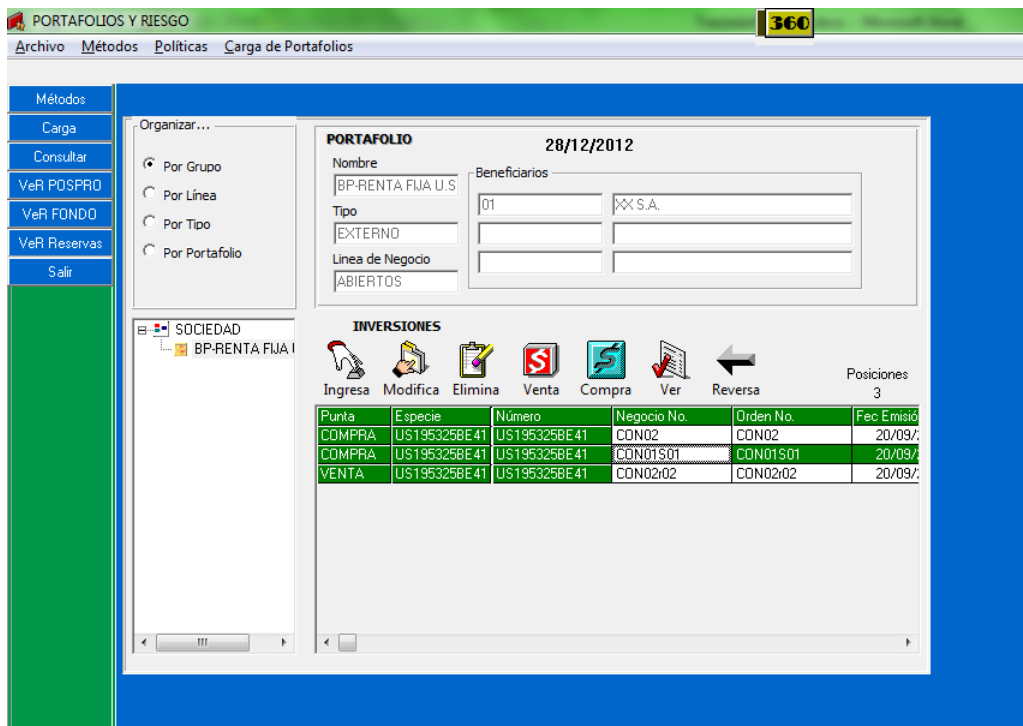
Al lado izquierdo se despliega el árbol de Portafolios debe dar doble clic sobre el Portafolio que desea borrar; al dar doble clic aparece el siguiente mensaje:



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:



Sobre la inversión hacer doble clic y aparece la siguiente pantalla:

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:

Portafolio	Deposito	NumDcvDvl	NumNegocio	NumOrden	Punta	Secuencia
DIVISAS	DVL	1	D4	D4	COMPRA	2917

Ubique el ratón en la operación que desea revertir y pulse doble clic. Aparecerá la operación, como se muestra la figura:

REVERSAR Inversiones y Compromisos Acciones y Divisas

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a3 Repo Oper. a Plazos Forward OPCFTRM Opciones

Datos Compromiso

Fecha Registro: 06/05/2010 | Fecha Oper: 06/05/2010 | Fec Cumplimiento: 06/05/2010 | Punta: COMPRA | Posición: LARGA | Número del Negocio: D4

Número de Orden: D4 | Portafolio: DIVISAS | Emisor: ESTADOS UNIDOS DE NOR. AM | Especie: DOLAR

Tipo Inversión: NEGOCIABLE | Contraparte: AEV | Hora Compra: 11:28:30 a.m. | Tipo Forward: NDV | Depósito: DVL | Isin/NumEmisión: 1

Valoración

Cantidad: 1,200,000.0 | Precio: 1,999.000000 | Valor de Compra: 2,398,800,000.00 | Valor Giro/Recom: 0.00 | Valor Captación: 0.00000000 | Tasa Repo: 0.000

Fec Compromiso: 06/05/2010 | Dias Comprom.: 0.000 | Orden Comprom.: FINAL | Adicional: 0.000 | Trader: Trader

Comisión: 0.0 | Base Comisión: 0.0 | Operación Origen: | PUC: 0 | Nit Cliente: | Sistema: MEC

Usuario: | Estación: | Nombre Cliente: |

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Decl. de Cambio: 0 | Nral. Cambiario: 0

Lugar de la transacción: NA (NA) (PWP=0000) | País Origen: 090(Colombia)

Botones: Calcular Aceptar Cerrar

Para confirmar que desea revertir 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:

Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 04/05/201E Fecha Oper: 04/05/201E Fec Cumplimiento: 04/05/201E Punta: VENTA Posición: CORTA Nro. Negocio: XZ379 Nro. de Orden: 0 Portafolio: X
 Emisor: GOBIERNO NACIONAL Especie: TFIT16240724 Depósito: DCV ISIN: COL17CT02385 Tipo Inversión: NEGOCIABLE Contraparte: AEV Hora Compra: 4:27:37 Tipo Forward: NDV

Datos Faciales
 Emisión: 24/07/2008 Vencimiento: 24/07/2024 Tasa Nominal: 10.00 Completo-Cup-Ppal: COMPLETO Modalidad Emisión: ANUAL
 Cantidad: 2,000,000,000.0 Valor de Compra: 2,879,435,951.8 Ult.Vlr. Mercado: 2,582,460,000.0 PyG/Trading: 296,975,951.8 VENCIDA
 Trader: TRADER1 Adicional: 0.0 Modalidad Reinv.: NO APLICA NO APLICA

Valoración
 T. Efect.: 5.00 Precio: 143.971797! Captación/Salida: 2,879,435,951.80
 T.Repo/Cpr: 4.00 Oper. Regreso: 0 Valor Giro/Recompra: 2,879,745,375.36
 Dias Cpr: 1.000 Fec Compromiso: 05/05/201E Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 Base Comisión: 0.0 Retención: 0.0 Base Retención: 0.0 Traslado: 0.0 Base Traslado: 0.0 Operación Origen/A Cubrir:
 PUC: 0 Nit Cliente: Nombre Cliente: Sistema: MEC Usuario: Estación: Estado Título: GARLIQ

Mercado: SECUNDARIO Finalidad: ESPECULA Compensación: DVP Forma de Pago: TRA Cal. Crediticio Inv.: A #EMISION: 53059

Calcular Aceptar Cerrar

2. Vendemos el título:

Vender/Fondear Inversiones y Compromisos Renta Fija

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso

Fecha Registro	Fecha Dper	Fec.Cumplimiento	Punta	Posición	Nro. Negocio	Nro. de Orden	Portafolio
04/05/201E	04/05/201E	04/05/201E	VENTA	CORTA	XXZ405	0	XX
Emisor	Especie	Depósito	ISIN	Tipo Inversión	Contraparte	Hora Compra	Tipo Fw
GOBIERNO NACIONAL	TFIT16240724	DCV	COL17CT02385	NEGOCIABLE	AEV	3:58:25	NDV

Datos Faciales

Emisión	Vencimiento	Tasa Nominal	Completo-Cup-Ppal	Modalidad Emisión
24/07/2008	24/07/2024	10.00	COMPLETO	ANUAL
Cantidad	Valor de Compra	Ult.Vlr. Mercado	PyG/Trading	
2,000,000,000.0	2,880,000,000.0	2,879,435,951.8	564,048.2	VENCIDA
Trader	Adicional	Modalidad Reinv.		
TRADER1	0.0	NO APLICA		NO APLICA

Valoración

T. Efect.	Precio	Captación/Salida
4.9968320	144.00	0.00
T.Repo/Cpr	Oper. Regreso	Valor Giro/Recompra
0.00		0.00
Dias Cpr	Fec Compromiso	Orden CPF
1.000	04/05/201E	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 20150504:XXZ379

PUC Nit Cliente Nombre Cliente Sistema Usuario Estación Estado Título

0 MEC

Mercado Finalidad Compensación Forma de Pago Cal. Crediticio Inv. #EMISION

SECUNDARIO ESPECULA DVP TRA A 53059

 Calculadora
  Aceptar
  Cerrar

3. La simultánea nos queda en corto:

Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 04/05/2015 | Fecha Oper: 04/05/2015 | Fec Cumplimiento: 04/05/2015 | Punta: VENTA | Posición: CORTA | Nro. Negocio: 2379 | Nro. de Orden: 0 | Portafolio: XX
 Emisor: GOBIERNO NACIONAL | Especie: TFIT16240724 | Depósito: DCV | ISIN: COL17CT02385 | Tipo Inversión: NEGOCIABLE | Contraparte: AEV | Hora Compra: 4:27:37 | Tipo Forward: NDV

Datos Faciales
 Emisión: 24/07/2008 | Vencimiento: 24/07/2024 | Tasa Nominal: 10.00 | Completo-Cup-Ppal: COMPLETO | Modalidad Emisión: ANUAL
 Cantidad: 2,000,000,000.0 | Valor de Compra: 2,879,435,951.8 | Ult.Vlr. Mercado: 2,582,460,000.0 | PyG/Trading: 296,975,951.8 | Modalidad Reinv.: VENCIDA
 Trader: TRADER1 | Adicional: 0.0 | Modalidad Reinv.: NO APLICA

Valoración
 T. Efect.: 5.00 | Precio: 143.971797 | Captación/Salida: 2,879,435,951.80
 T.Repo/Cpr: 4.00 | Oper. Regreso: 0 | Valor Giro/Recompra: 2,879,745,375.36
 Dias Cpr: 1.000 | Fec Compromiso: 05/05/2015 | Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 | Base Comisión: 0.0 | Retención: 0.0 | Base Retención: 0.0 | Traslado: 0.0 | Base Traslado: 0.0 | Operación Origen/A Cubrir: []

PUC: 0 | Nit Cliente: [] | Nombre Cliente: [] | Sistema: MEC | Usuario: [] | Estación: [] | Estado Título: GARCOR

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Cal. Crediticio Inv.: A | #EMISION: 53059

Calculador | Aceptar | 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: **Normal** Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso: Fecha Registro 05/05/2015 Fecha Oper 04/05/2015 Fec Cumplimiento 04/05/2015 Punta COMPRA Posición LARGA Nro. Negocio XXZ395 Nro. de Orden 395 Portafolio XX

Emisor GOBIERNO NACIONAL Especie TFIT16240724 Depósito DCV ISIN COL17CT02385 Tipo Inversión NEGOCIABLE Contraparte AEV Hora Compra 3:13:37 Tipo Fw NDV

Datos Faciales: Emisión 24/07/2008 Vencimiento 24/07/2024 Tasa Nominal 10.00 Completo-Cup-Ppal COMPLETO Modalidad Emisión ANUAL

Valoración: T. Efect. 7.20 Precio 126.127333 Captación/Salida 0.00

Oper. Regreso 0.00 Valor Giro/Recompra 0.00

Días Cpr 0.000 Fec Compromiso 04/05/2015 Orden CPR FINAL

Comisión 0.0 Base Comisión 0.0 Retención 0.0 Base Retención 0.0 Traslado 0.0 Base Traslado 0.0 Operación Origen/A Cubrir

PUC 0 Nit Cliente Nombre Cliente Sistema MEC Usuario Estación Estado Título NORMAL

Mercado SECUNDARIO Finalidad ESPECULA Compensación DVP Forma de Pago TRA Cal. Crediticio Inv. A #EMISION 53059

Calcular Aceptar Cerrar

Nótese que es un papel de las mismas características faciales y que no está comprometido (TipoOper=Normal).

- 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:

Métodos: Organizar... Consultar Ver POSPRO Ver FONDD Ver Reservas Salir

PORTAFOLIO 05/05/2015

Beneficiarios: XXX

Eliminar: X.Portafolio X.Arquivo X.Eliminados Hoy

Recuperar: X.Arquivo X.Eliminados Hoy

INVERSIONES

Usar Lista Seleccionada Seleccionar Todo

PORTAFOLIO: ACCIONES, ARDUEO, BP-RENDA FUA BRASIL, BP-RENDA FUA COLOMBIA, BP-RENDA FUA MEXICO, BP-RENDA FUA U.S.A., CARLOS, CLIMAR1, CLIMAR2, CLIMAR3, CTA PROPIA OTROS

Ingresar Modificar Eliminar Venta Compra Trasladar Reversa Buscar SelPartir SelUnir

Punta	Especie	NroDv/ISIN	Negocio No	Orden No	Fec Emisión	Fec Vencimiento	Compromiso	Modalidad	Tasa Nominal	Cantidad
VENTA	ROP/TRM		XXZ395	0	28/04/2015	06/05/2015	FORVORVISA	ND	0.0	2,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ380	0	24/07/2005	24/07/2020	SIMULTANEA	AV	11.0	2,500,000.00
COMPRA	TFIT16240720	COL17CT02385	XXZ388	387	24/07/2005	24/07/2020	NINGUNO	AV	11.0	750,000.00
COMPRA	TFIT16240720	COL17CT02385	XXZ389	387	24/07/2005	24/07/2020	NINGUNO	AV	11.0	750,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ377	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	1,000,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ379	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	2,000,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ381	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	5,000,000.00
COMPRA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ395	394	24/07/2008	24/07/2024	NINGUNO	AV	10.0	450,000.00
COMPRA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ386	384	24/07/2008	24/07/2024	NINGUNO	AV	10.0	450,000.00
COMPRA	TFIT16240724	COL17CT02385	XXZ395	395	24/07/2008	24/07/2024	NINGUNO	AV	10.0	10,000,000.00

Elegimos la fracción que requerimos y presionamos Partir:

PORTAFOLIO 05/05/2015

Nombre: [] Beneficiarios: [300338073-4] [PWP SOFTWARE SAS.]

Tipo: [] IGNA: []

Linea de Negocio: [PUBLICO]

Lista: X Portafolio Nombre: [Elija un Archivo Cargado Hoy] X Archivo Número: [Elija un Nro de Archivo] X Eliminadas Hoy

INVERSIONES

Punta	Especie	INDC/D/ISIN	Negocio No.	Orden No.	Emisor	Compromiso	Modalidad	Tasa Nominal	Cantidad	
VENTA	COP/TRM	0	XXZ356	0	28/04/2015	06/05/2015	FOR/OIV/IVISA	NO	0.0	2,000.00
VENTA	TFIT15240720	COL17CT0230	XXZ360	0	24/07/2005	24/07/2020	SIMULTANEA	AV	11.0	2,500,000.00
COMPRA	TFIT15240720	COL17CT0230	XXZ388	387	24/07/2005	24/07/2020	NINGUNO	AV	11.0	750,000.00
COMPRA	TFIT15240720	COL17CT0230	XXZ389	387	24/07/2005	24/07/2020	NINGUNO	AV	11.0	750,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT0238	XXZ377	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	1,000,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT0238	XXZ379	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	2,000,000.00
VENTA	TFIT16240724	COL17CT0238	XXZ381	0	24/07/2008	24/07/2024	SIMULTANEA	AV	10.0	5,000,000.00
COMPRA	TFIT16240724	COL17CT0238	XXZ385	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	XXZ395	395	24/07/2008	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:

Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija

Tipo de Operación: Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso

Fecha Registro: 05/05/2015 Fecha Oper: 04/05/2015 Fec Cumplimiento: 04/05/2015 Puntero: COMPRA Posición: LARGA Nro. Negocio: XXZ409 Nro. de Orden: 395 Portafolio: XX

Emisor: GOBIERNO NACIONAL Especie: TFIT16240724 Depósito: DCV ISIN: COL17CT02385 Tipo Inversión: NEGOCIABLE Contraparte: AEV Hora Compra: 3:13:37 Tipo Fw: NDV

Datos Faciales

Emisión: 24/07/2008 Vencimiento: 24/07/2024 Tasa Nominal: 10.00 Completo-Cup-Ppal: COMPLETO Modalidad Emisión: ANUAL

Cantidad: 8,000,000,000.0 Valor de Compra: 10,090,186,694.4 Ult.Vlr. Mercado: 10,329,840,000.0 PyG/Trading: 239,653,305.6 VENCIDA

Trader: TRADER1 Adicional: 0.0 Modalidad Reinv.: NO APLICA

Valoración

T. Efect.: 7.20 Precio: 126.1273331 Captación/Salida: 0.00

T.Repo/Cpr: 0.00 Oper. Regreso: 0 Valor Giro/Recompra: 0.00

Dias Cpr: 0.000 Fec Compromiso: 05/05/2015 Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 Base Comisión: 0.0 Retención: 0.0 Base Retención: 0.0 Traslado: 0.0 Base Traslado: 0.0 Operación Origen/A Cubrir: PARTIR_20150504:XXZ395

PUC: 0 Nit Cliente: Nombre Cliente: Sistema: MEC Usuario: Estación: Estado Título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO Finalidad: ESPECULA Compensación: DVP Forma de Pago: TRA Cal. Credicio Inv.: A #EMISION: 53059

Botones: Calcular, Aceptar, Cerrar

Detalle de Inversiones y Compromisos Renta Fija

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
05/05/2015	04/05/2015	04/05/2015	COMPRA	LARGA	XXZ408	395	XX
Emisor	Especie	Depósito	ISIN	Tipo Inversión	Contraparte	Hora Compra	Tipo Fw
GOBIERNO NACIONAL	TFIT16240724	DCV	COL17CT02385	NEGOCIABLE	AEV	3:13:37	NDV

Datos Faciales

Emisión	Vencimiento	Tasa Nominal	Completo-Cup-Ppal	Modalidad Emisión
24/07/2008	24/07/2024	10.00	COMPLETO	ANUAL
Cantidad	Valor de Compra	Ult.Vlr. Mercado	PyG/Trading	Modalidad Reinv.
2,000,000,000.0	2,522,546,673.6	2,582,460,000.0	59,913,326.4	VENCIDA
Trader	Adicional	Modalidad Reinv.		
TRADER1	0.0	NO APLICA		NO APLICA

Valoración

T. Efect.	Precio	Captación/Salida
7.20	126.1273331	0.00
T.Repo/Cpr	Oper. Regreso	Valor Giro/Recompra
0.00	0	0.00
Dias Cpr	Fec Compromiso	Orden CPR
0.000	05/05/2015	FINAL

Comisión

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_20150504:XXZ395
PUC	Nit Cliente	Nombre Cliente	Sistema	Usuario	Estación	Estado Título
0			MEC			NORMAL

Mercado

Mercado	Finalidad	Compensación	Forma de Pago	Cal. Crediticio Inv.	#EMISION
SECUNDARIO	ESPECULA	DVP	TRA	A	53059

Calcular Aceptar Cerrar

- 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:

Vender/Fondear Inversiones y Compromisos Renta Fija

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 05/05/2015 | Fecha Oper: 05/05/2015 | Fec Cumplimiento: 05/05/2015 | Punta: VENTA | Posición: CORTA | Nro. Negocio: XXZ410 | Nro. de Orden: 395 | Portafolio: XX
 Emisor: GOBIERNO NACIONAL | Especie: TFIT16240724 | Depósito: DCV | ISIN: COL17CT02385 | Tipo Inversión: NEGOCIABLE | Contraparte: AEV | Hora Compra: 4:31:47 | Tipo Fw: NDV

Datos Faciales
 Emisión: 24/07/2008 | Vencimiento: 24/07/2024 | Tasa Nominal: 10.00 | Completo-Cup-Ppal: COMPLETO | Modalidad Emisión: ANUAL
 Cantidad: 2,000,000,000.0 | Valor de Compra: 2,582,460,000.0 | Ult.Vlr. Mercado: 2,582,460,000.0 | PyG/Trading: -59,913,326.4 | Modalidad Emisión: VENCIDA
 Trader: TRADER1 | Adicional: 0.0 | Modalidad Reinv.: NO APLICA

Valoración
 T. Efect.: 0.00 | Precio: 0.00 | Captación/Salida: 0.00
 T.Repo/Cpr: 0.00 | Oper. Regreso: | Valor Giro/Recompra: 0.00
 Dias Cpr: 0.000 | Fec Compromiso: 05/05/2015 | Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 | Base Comisión: 0.0 | Retención: 0.0 | Base Retención: 0.0 | Traslado: 0.0 | Base Traslado: 0.0 | Operación Origen/A Cubrir: 20150504XXZ379
 PUC: 0 | Nit Cliente: | Nombre Cliente: | Sistema: MEC | Usuario: | Estación: | Estado Título: CUBRIR

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Cal. Crediticio Inv.: A | #EMISION: 53059

En el campo Estado, elija CIBRIR y arriba de este, en el campo Operación 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:

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.

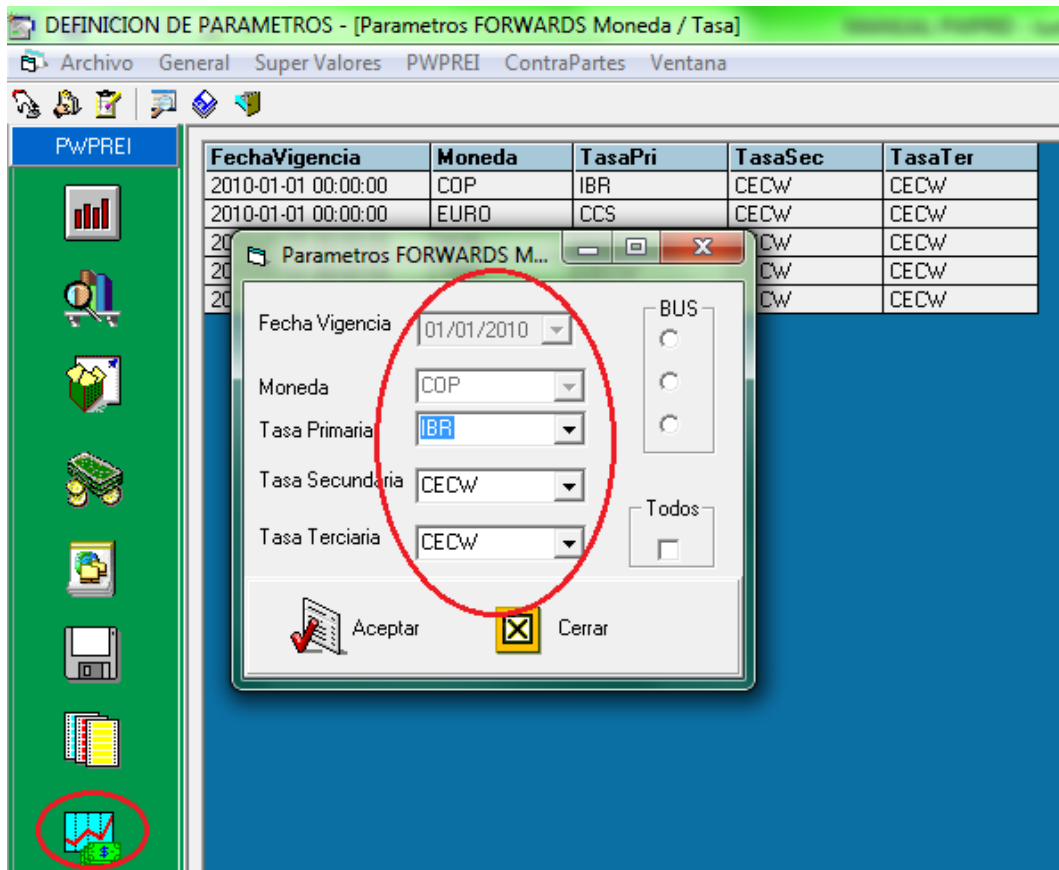
- a. Ingreso manual. Incluya forwards sobre títulos en PWPREI ingresándolos con TipoCompromiso=FORWARD, TipoFw=NDV y con una FechaCompromiso futura, tal como se ve en el ejemplo de una posición "LARGA":

- 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.

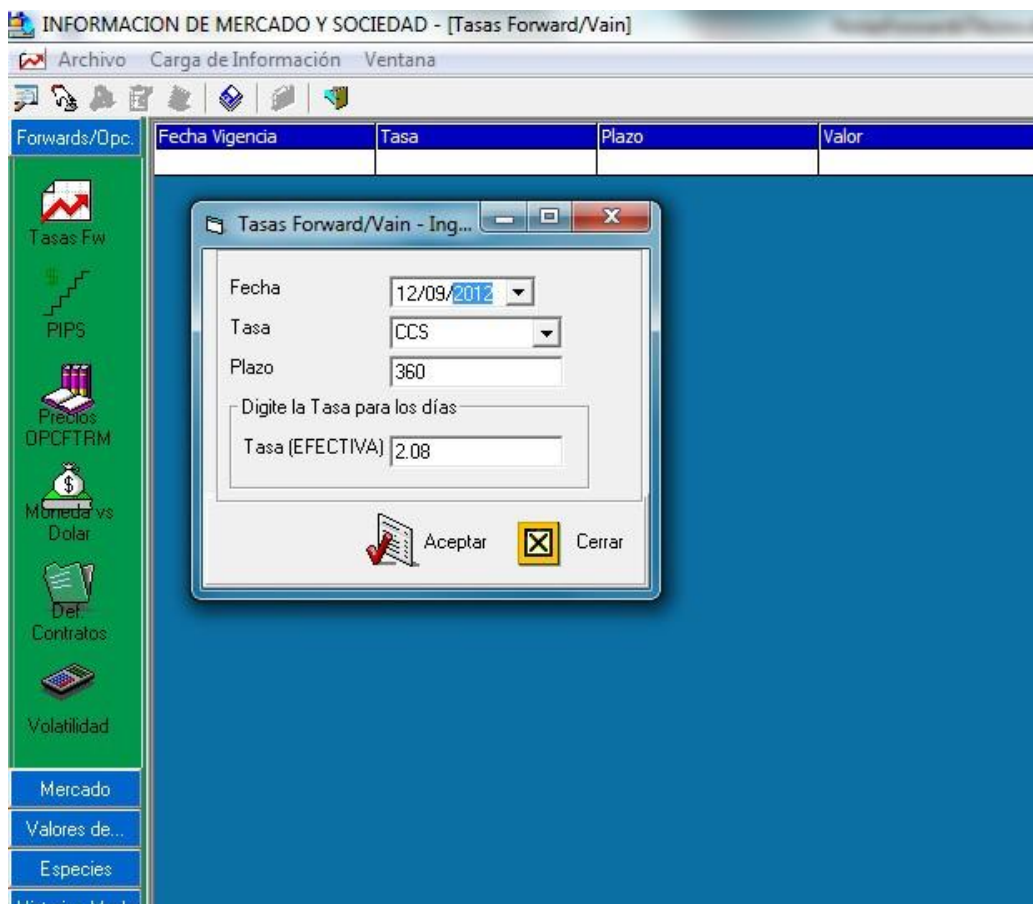
2 Valoración.

- 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:



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:



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 las fórmulas definidas por la SFC, utilizando el mismo plazo de compromiso; Es decir, el punto de la curva del plazo p_1 se lleva a su equivalente 360 al mismo plazo p_1 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 notional 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

$$VPN = \text{SUMA}(Vf / (1 + T)^{Dv/365})$$

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. A 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:

$$\text{MarIni} = (((\text{TasaCompra} + 1) / (1 + \text{TasaRefCom})) - 1) * 100$$

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:

$$\text{TasaRepreciada} = (((1 + \text{TasaRefVal}) * (1 + \text{MarIni})) - 1) * 100$$

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.

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.

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 se 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.

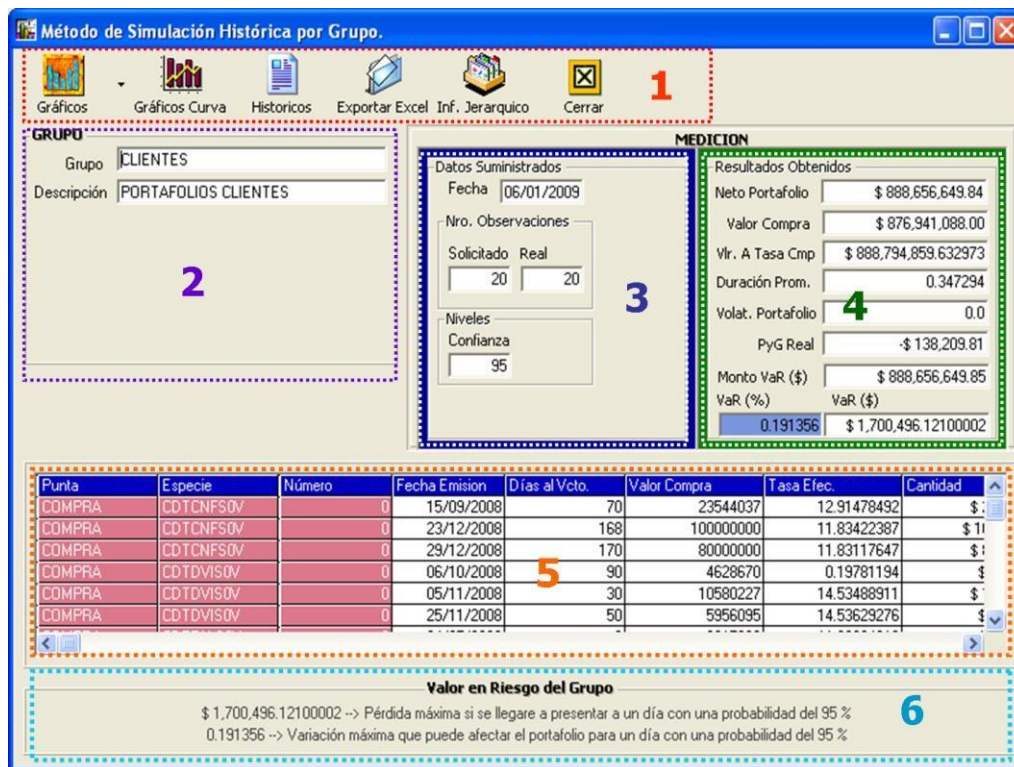
Seleccione Precio: Debe seleccionar Precio Sucio o Precio Limpio.

- **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.



La pantalla que despliega el sistema muestra la información correspondiente a:

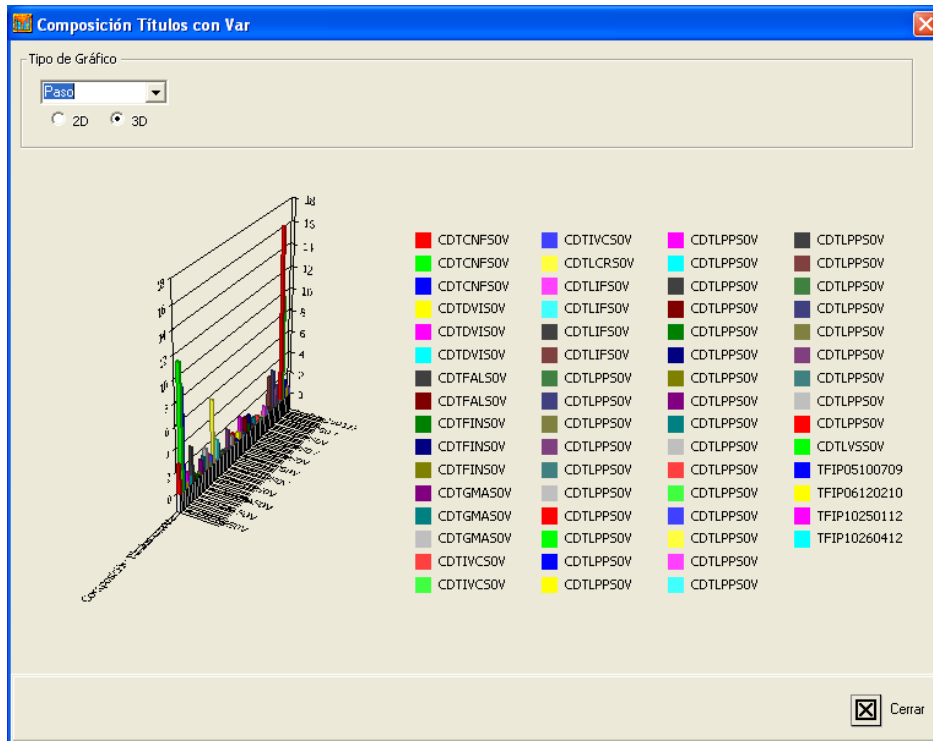
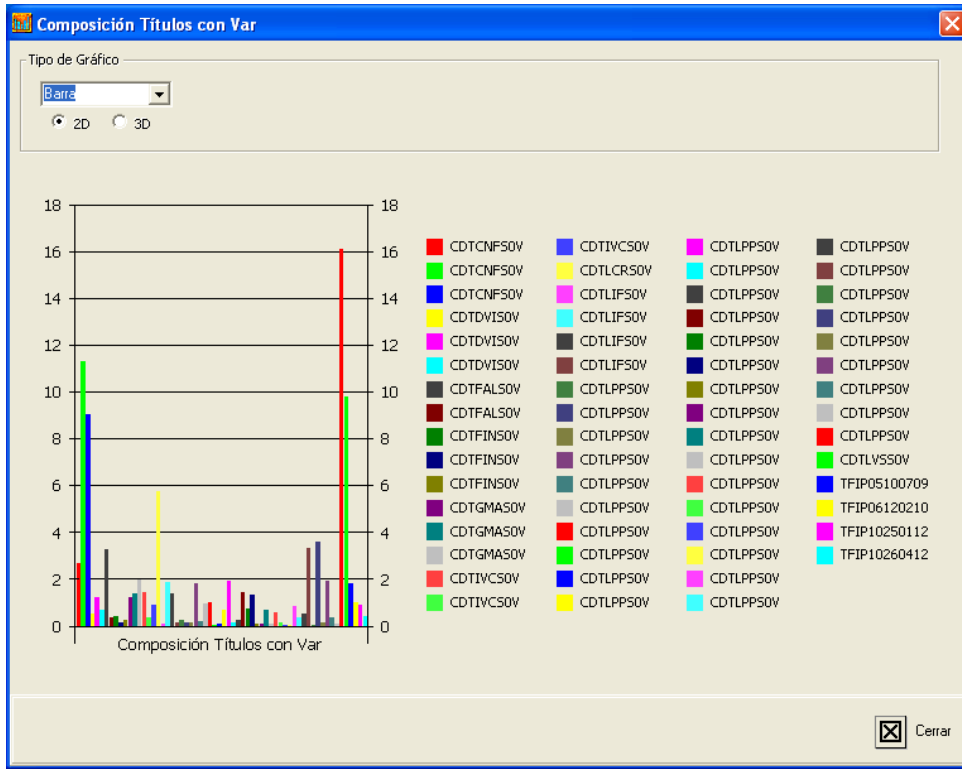
Área 1: Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

- **Gráficos:**

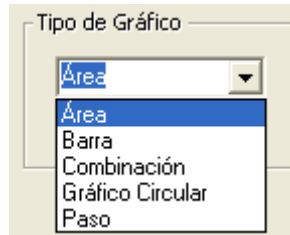


Esta utilidad sirve para observar tres tipos de gráficos:

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



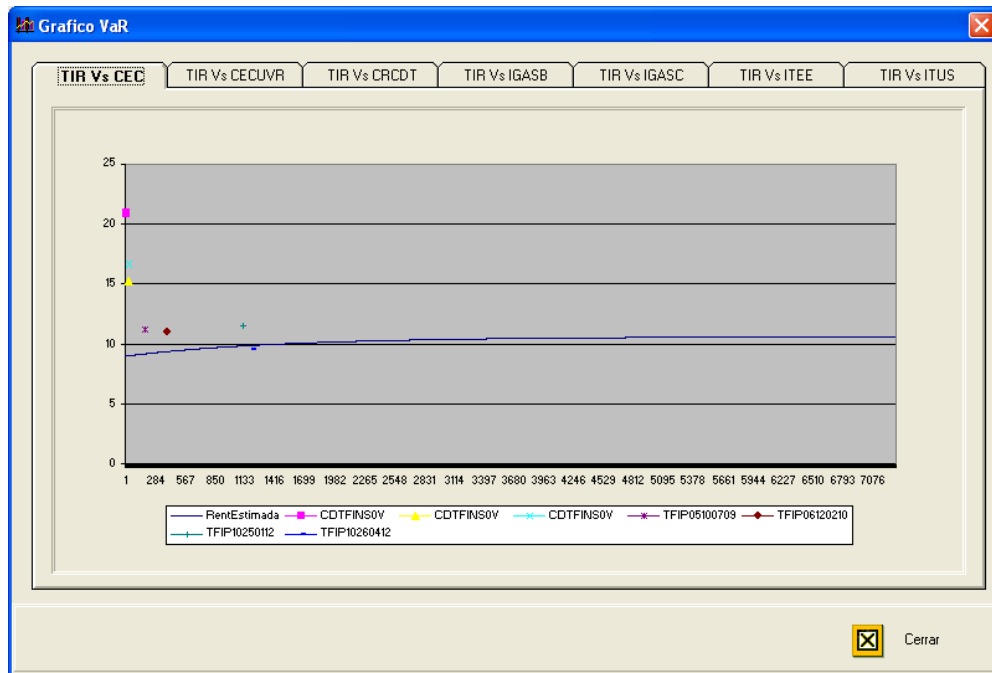
3. VaR en pesos



- **Gráficos Curvas:**



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado.



- **Exportar a Excel:**



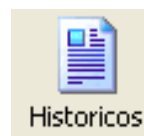
La información suministrada en el método de simulación histórica, puede ser exportada a Excel para manejo de diversos informes.

- **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.

Fecha	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTDVISOV	CDTFALSOV	CDTFALSOV
06/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249	105.30
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	105.01
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	104.87
24/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774	104.81
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	104.74
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	104.53
12/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032	105.30
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

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: 20 Real: 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
Vir. 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 cuadrícula aparecen cada una de las inversiones con sus correspondientes datos y valoraciones:

Punta	Especie	Número	Fecha Emisión	Días al Vcto.	Valor Compra	Tasa Efec.	Cantidad
COMPRA	CD TCNFSOV	0	15/09/2008	70	23544037	12.91478492	\$:
COMPRA	CD TCNFSOV	0	23/12/2008	168	100000000	11.83422387	\$ 1:
COMPRA	CD TCNFSOV	0	29/12/2008	170	80000000	11.83117647	\$:
COMPRA	CD TDVISOV	0	06/10/2008	90	4628670	0.19781194	\$
COMPRA	CD TDVISOV	0	05/11/2008	30	10580227	14.53488911	\$:
COMPRA	CD TDVISOV	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: 08/01/2009

Número de Observaciones: 20

Horizonte Temporal: 1

Nivel de Tolerancia: 0.01

Nivel de Confianza: 95

Número de Simulaciones: 200

Seleccione la Fuente de Información:

- ALTERNA
- INFOVAL

Seleccione Precio:

- Precio Sucio
- Precio Limpio

Seleccione el tipo de la Moneda:

- Simulada
- Histórica
- Actual

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.

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.

Matrices Intermedias de Cálculo

VOLATILIDADES

	CDTCNFS0V	CDTCNFS1V	CDTCNFS2V	CDTDVIS0V	CDTDVIS1V	CDTDVIS2V	CDTFALS0V
CDTCNFS0	0.000006857	0.000005162	0.00000504	-0.000036359	0.000005235	0.000008559	0.000000351
CDTCNFS1	0.000005162	0.00000426	0.000004081	-0.000027056	0.000003839	0.000006381	0.000000243
CDTCNFS2	0.00000504	0.000004081	0.000004261	-0.000026864	0.000003768	0.000006287	0.000000186
CDTDVIS0	-0.000036359	-0.000027056	-0.000026864	0.000196276	-0.000028034	-0.000045771	-0.000001661
CDTDVIS1	0.000005235	0.000003839	0.000003768	-0.000028034	0.000004079	0.000006592	0.00000003
CDTDVIS2	0.000008559	0.000006381	0.000006287	-0.000045771	0.000006592	0.000010774	0.00000044
CDTFALS0	0.000000351	0.000000243	0.000000186	-0.000001661	0.00000003	0.00000044	0.00000000
CDTFALS1	-0.000003347	-0.000002327	-0.000002357	0.00001883	-0.000002708	-0.00000432	-0.00000018

Exportar Resultado Cerrar

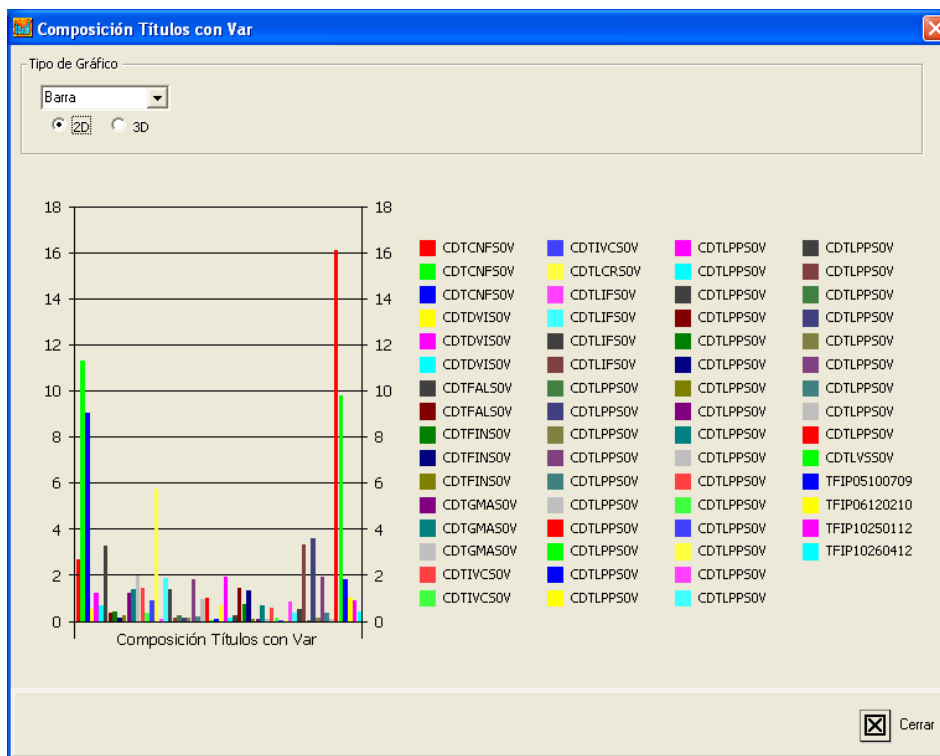
Esta matriz se puede exportar presionando el botón inferior Exportar Resultado

- **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



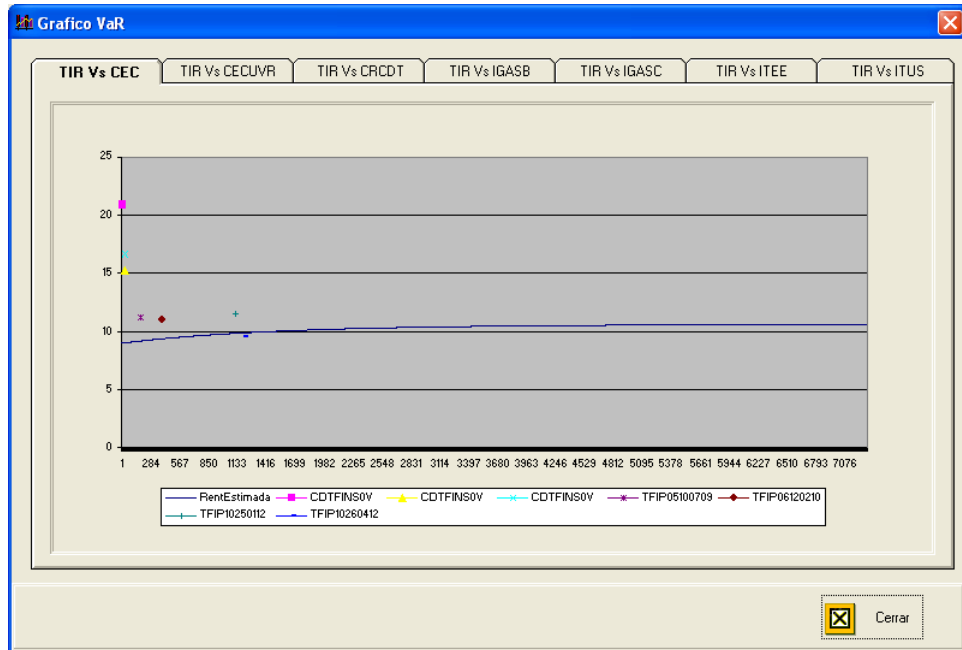
3. VaR en Pesos



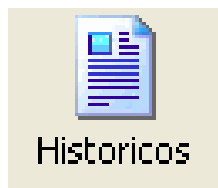
- Gráficos Curva



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado.



- **Históricos:**



Datos históricos que se utilizan para realizar la medición.

Fecha	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTDV50V	CDTDV50V	CDTDV50V	CDTFAL50V	CDTFAL50V
06/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249	105.31
05/01/2009	103.15034662	100.76760663	100.58365647	97.78359961	101.41379589	100.51480955	105.15198296	105.11
02/01/2009	103.05711345	100.67315701	100.48950895	97.77757493	101.32915209	100.42810591	105.06296746	105.01
31/12/2008	102.98976289	100.50043167	100.3157616	97.69265114	101.29396783	100.38264853	105.01928597	105.01
30/12/2008	102.96047016	100.47028166	100.28569204	97.66517718	101.26724409	100.35540779	104.99085233	104.91
29/12/2008	102.93506997	100.40988887	100.22425712	97.63846438	101.24493268	100.33310066	104.96470289	104.91
26/12/2008	102.82740862	100.28165249	100.37977524	97.51959857	101.17755829	100.26918168	104.87574581	104.81
24/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774	104.81
23/12/2008	102.72556981	100.29366424	100.308897	97.42388448	101.0965623	100.07657011	104.78198627	104.71
22/12/2008	102.68571224	100.33300538	100.30752408	97.31591831	101.05379193	100.01888148	104.74859186	104.71
19/12/2008	102.58627308	100.30555013	100.31189049	97.24107032	100.9671523	99.92779959	104.65226531	104.61
18/12/2008	102.49394441	100.28468238	100.32941716	97.17032207	100.94159568	99.89429053	104.62395238	104.61
17/12/2008	102.46302653	100.28528836	100.31934554	97.16247005	100.86792281	99.85141524	104.59175563	104.51
16/12/2008	102.43662043	100.3004381	100.31541485	97.12625913	100.85597273	99.83046768	104.56523658	104.51
15/12/2008	102.39065353	100.30179287	100.31671842	97.08095831	100.81171873	99.80651671	104.53271645	104.51
12/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032	105.31
11/12/2008	102.1591297	100.29355042	100.31989065	96.96838892	100.67590234	99.68790878	104.42360755	104.41
10/12/2008	102.12210864	100.29532402	100.31798538	96.93460103	100.64388813	99.64615201	104.3936663	104.31
09/12/2008	102.09156029	100.29733116	100.31771331	96.89112366	100.61237067	99.60903573	104.36145609	104.31
05/12/2008	101.96737896	100.29670977	100.318173	96.79086223	100.45956431	99.49521949	104.24384975	104.21

Exportar a 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 cuadrícula 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.

$$\text{VaR} = \alpha * \sigma \text{ portafolio} * \text{Valor portafolio}$$

$$\sigma \text{ portafolio} = ([w] T [\sigma \text{ precios}] [C] [\tilde{A} \text{ precios}]$$

$$[w]) ^{(1/2)} \sigma \text{ precios} = Dm * \sigma * r$$

[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.

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**.

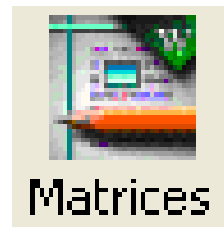
Fuente de Información: La información puede ser tomada de Infoval o de una fuente alterna.

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.

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.

Matrices Intermedias de Cálculo							
VOLATILIDADES							
	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V
CDTCNFS0V	0.00326355	0	0	0	0	0	0
CDTCNFS0V	0	0.002286112	0	0	0	0	0
CDTCNFS0V	0	0	0.002283772	0	0	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0.00215184	0	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0	0.002864103	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0	0	0.004682486	0
CDTFALS0V	0	0	0	0	0	0	0.0001722
CDTFALS0V	0	0	0	0	0	0	0

CORRELACIONES							
	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V
CDTCNFS0V	1	0.982512998	0.982349296	-0.30219021	0.998437554	0.998296674	0.9855276
CDTCNFS0V	0.982512998	1	0.990105799	-0.213212344	0.975739298	0.978620343	0.9442373
CDTCNFS0V	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
CDTFALS0V	0.985527621	0.944237303	0.942491023	-0.327699217	0.989853582	0.987697124	1
CDTFALS0V	-0.599364571	-0.51912915	-0.522554495	0.943731091	-0.604260316	-0.593804545	-0.6149879

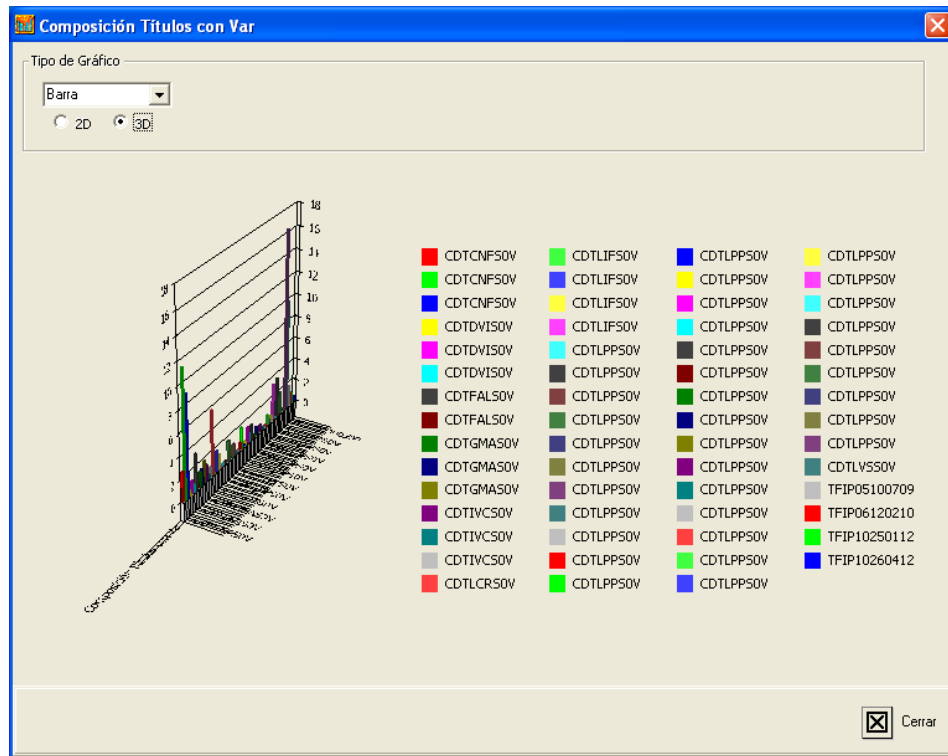
En caso de que se escoja la valoración por el máximo número de observaciones, la pantalla anterior desplegará en color amarillo las varianzas – covarianzas más significativas en el portafolio.

- Gráficos

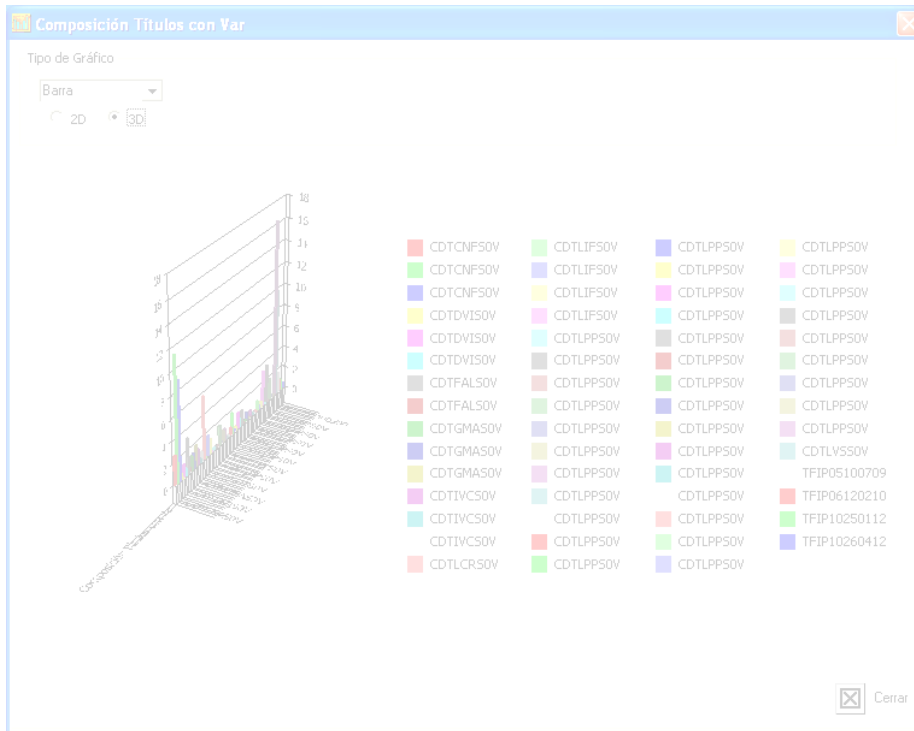


Esta utilidad permite ver el comportamiento del portafolio en tres tipos de gráficos:

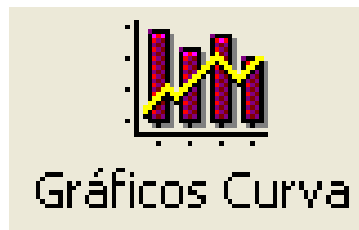
1. Composición de los títulos con VaR



2. VaR:



- **Gráficos Curva**



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado



- **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.

VOLATILIDADES							
	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V
CDTCNFS0V	0.00326355	0	0	0	0	0	0
CDTCNFS0V	0	0.002286112	0	0	0	0	0
CDTCNFS0V	0	0	0.002283772	0	0	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0.00215184	0	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0	0.002864103	0	0
CDTDVIS0V	0	0	0	0	0	0.004682486	0
CDTFALS0V	0	0	0	0	0	0	0.0001722
CDTFALS0V	0	0	0	0	0	0	0

CORRELACIONES							
	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V
CDTCNFS0V	1	0.982512998	0.982349296	-0.30219021	0.998437554	0.998296674	0.9855276
CDTCNFS0V	0.982512998	1	0.990105799	-0.213212344	0.975739298	0.978620343	0.9442373
CDTCNFS0V	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
CDTFALS0V	0.985527621	0.944237303	0.942491023	-0.327699217	0.989853582	0.987697124	1
CDTFALS0V	-0.599364571	-0.51912915	-0.522554495	0.943731091	-0.604260316	-0.593804545	-0.6149879

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	CDTFALS0V	CDTFALS0V
06/01/2009	12.91478492	11.83422387	11.83117647	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	0.75
05/01/2009	10.26176293	10.95293462	10.95734711	10.41924427	9.82397056	9.89011079	10.48964294	10.48
02/01/2009	10.31690159	10.97259033	10.97640112	10.09685286	9.9003705	9.95535447	10.58049946	10.58
31/12/2008	10.37823341	11.23984771	11.24365851	10.24004257	9.71111402	9.90714392	10.19129958	10.19
30/12/2008	10.38552529	11.24175312	11.24546362	10.24592164	9.72187167	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	10.27
24/12/2008	10.53595799	11.43199225	11.18650053	10.45175758	9.58273583	10.44459782	10.37140858	10.37
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	11.22149662	10.77337049	9.86522094	10.75741269	10.67235912	10.67
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	10.67
15/12/2008	11.03957752	11.31666746	11.21598982	10.96364868	10.25889221	10.81062411	10.7150798	10.71
12/12/2008	12.91478492	11.31725327	11.21408922	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	0.75
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	10.67
05/12/2008	11.54677067	11.31435268	11.2144997	11.01095152	10.79483313	10.96436817	10.693332	10.69

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 cuadrícula 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 α de la distribución de los cambios en el valor del portafolio, es decir:

$$\text{VaR} = Z_{\alpha/2} * \sigma$$

Donde $Z_{\alpha/2}$ representa el percentil correspondiente a $\alpha/2$ 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.

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 se 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:

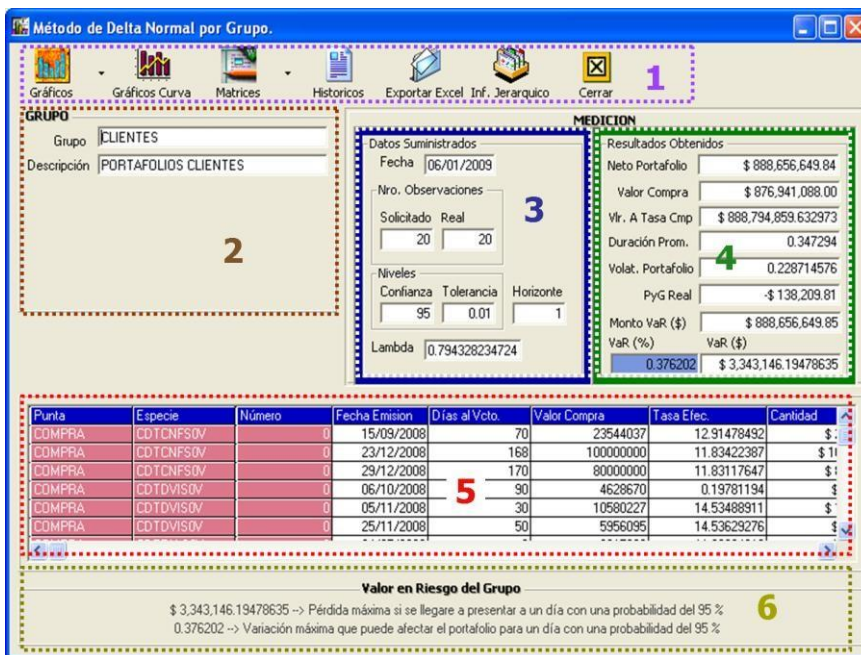
Precio Limpio: Precio descontando los rendimientos pendientes de pago.

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.



La pantalla que despliega el sistema muestra la información correspondiente a:

Área 1: Utilidades Adicionales: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

- **Gráficos:**

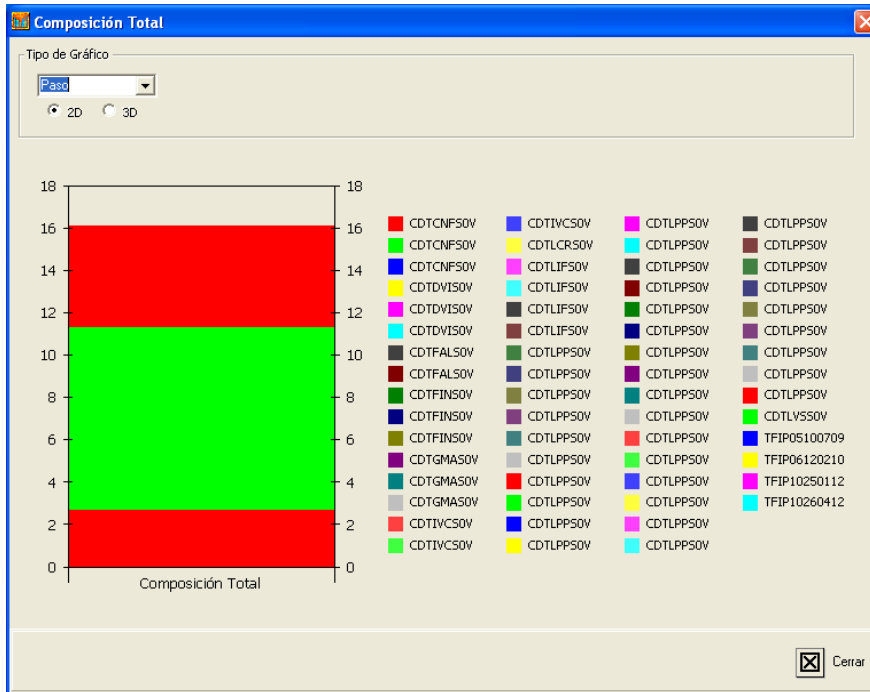


En esta opción encontrará tres tipos de gráficas:

1. Composición títulos con VaR



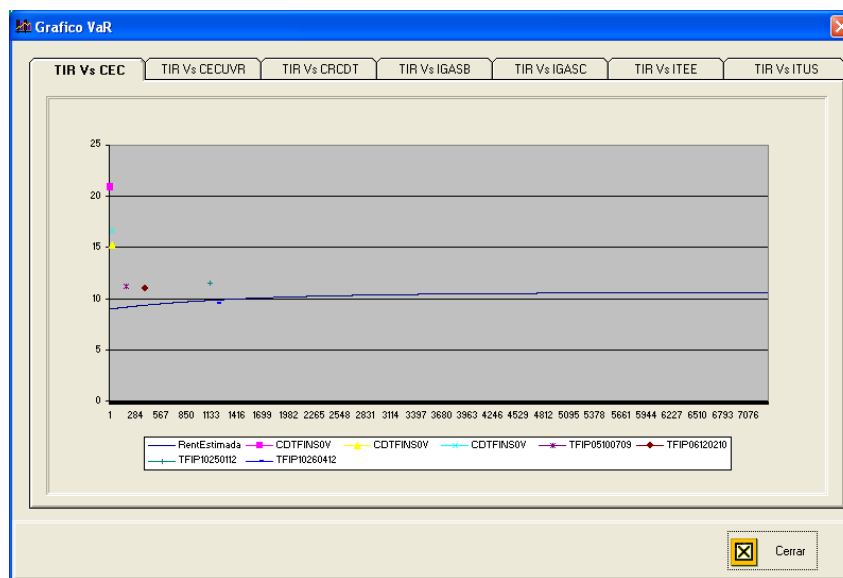
2. Composición Total



3. VaR.



Gráficos Curva



Este gráfico compara la rentabilidad del papel contra la rentabilidad promedio del mercado

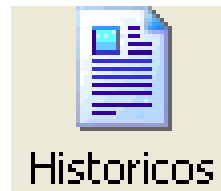
- **Matrices**



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 cuadrícula 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.

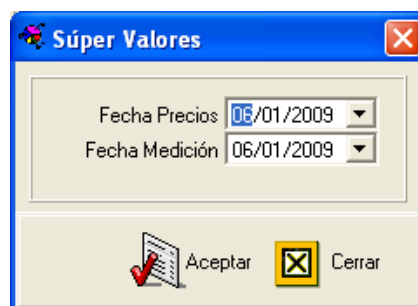
- **Precio Reciente:** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- **Monto:** Valor total de la inversión.
- **Tasa Reciente (%):** De acuerdo a la fecha dada este valor es el mas reciente con el cual se esta negociando en el mercado.
- **Precio 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 %.

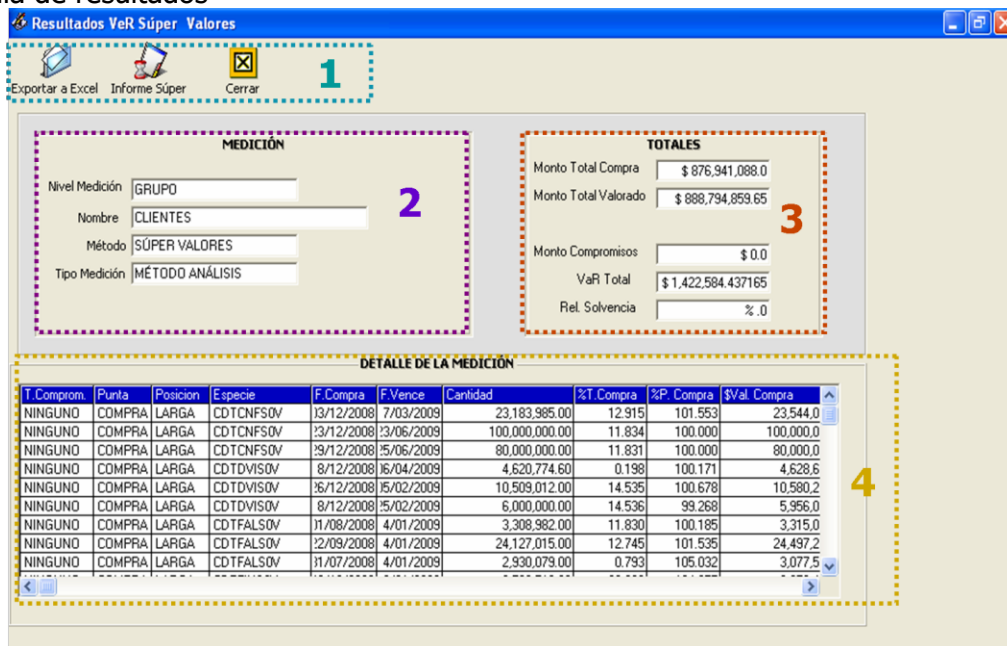
8.1.5. SUPERVALORES

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



AREA 1: Aquí se muestran funcionalidades tales como:

- **Exportar a Excel**

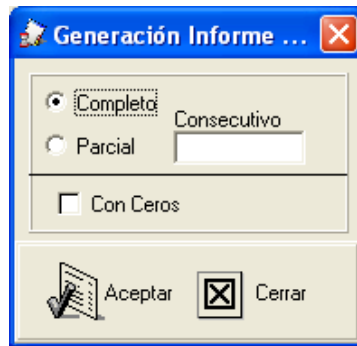


La información proveniente de la medición de la Súper puede ser llevada a Excel para realizar diversos informes.

- **Informe Súper**



Con esta opción se genera el archivo plano para transmitir a la Superintendencia de Valores. Al dar clic en esta opción se muestra la siguiente pantalla.



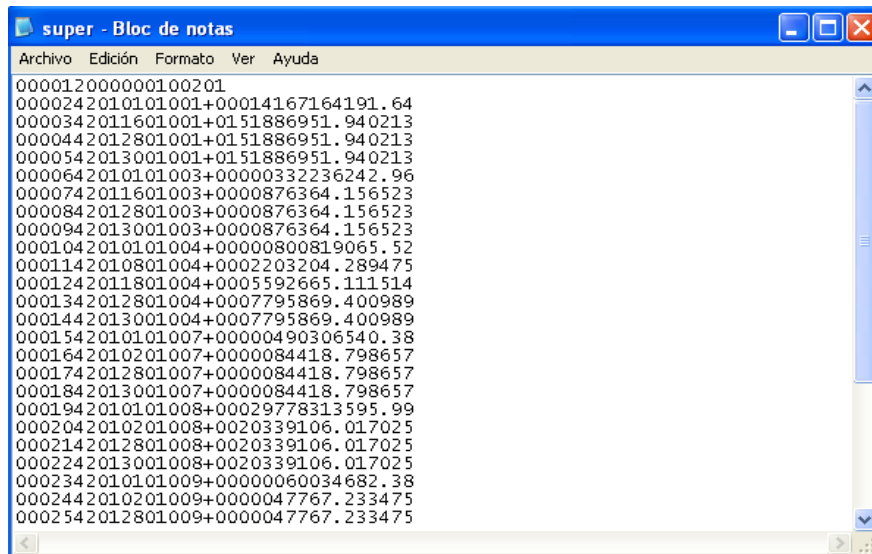
Completo: El archivo es generado con encabezado y fin de archivo como lo requiere la superintendencia de valores.

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 manera transmitir 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.



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

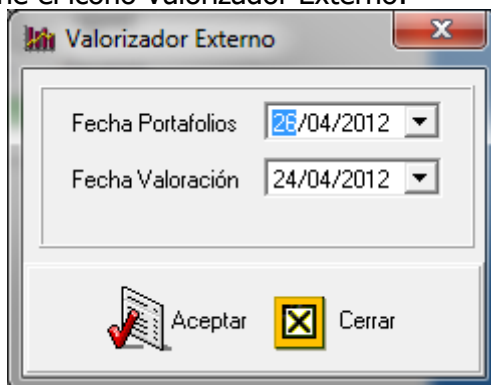
Observaciones: Anotaciones especiales.

8.1.6. VALORIZADOR EXTERNO

Para utilizar el Valorizador Externo de Portafolios, debe proceder:

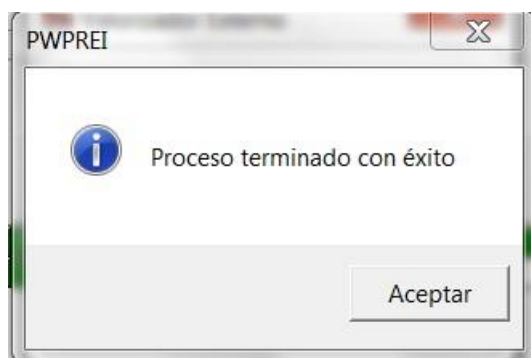
1. Cree, en la base de datos del sistema que va a utilizar el Valorizador Externo, una vista a la tabla "N09ValExterno" de PWPREI, con accesos de Lectura y Escritura.
2. Lea las especificaciones definidas en el archivo "InterfazValorizadorExterno.xls" para ver cómo debe cargar los datos y cómo debe leer 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.

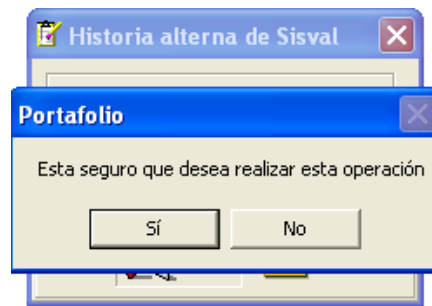
4. Pulse Aceptar, una vez procesado aparece el siguiente mensaje:



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.

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.

Mercado

 Moneda

 Portafolio

Beneficiarios

Opción

Siempre Reemplazar

 Borrar y Recargar

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 reemplazarán aquellas que ya existen. Si escoge la opción Solo actualizar o agregar, cada que haga nuevas cargas de inversiones se actualizarán inversiones existentes y se agregarán 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: JT

Beneficiarios

30391341

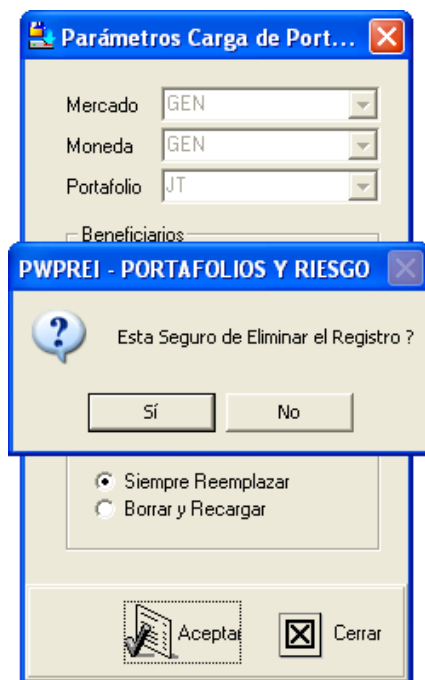
Opción

Siempre Reemplazar

Borrar y Recargar

Aceptar Cerrar

8.2.1.3. ELIMINAR CARGA MANUAL



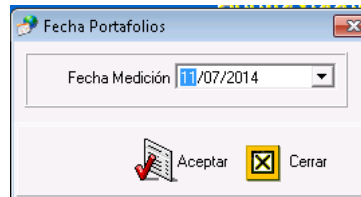
Para eliminar seleccione el registro y pulse la tecla descrita en la parte superior, el sistema le envía un mensaje reconfirmando si desea o no eliminar dicho registro.

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.



Seleccione el portafolio y ubique la inversión, por la opción de búsqueda:

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio
- TODOS

PORTAFOLIO 11/07/2014

Nombre: ACCION UNO
Beneficiarios: [800193848-8] FONDO ABIERTO ACCION

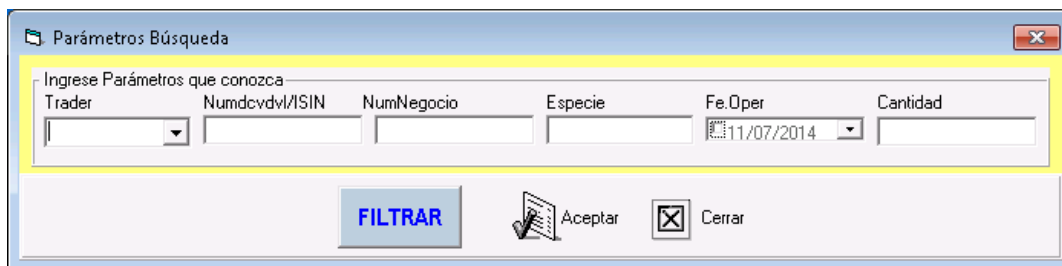
Tipo: CARTERA
Linea de Negocio: ACC

INVERSIONES

Ingresar Modificar Eliminar Venta Compra Trasladar Reversa **Buscar**

Posiciones: 452

Punta	Especie	NDcDv/ISIN	Negocio No.	Orden No.	Fec Emisión	Fec Vencimient	T. Compromiso	Modalida
COMPRA	BAVA01099A	COI03CB00011	ACC8398	13040101166	25/08/2009	25/08/2014	NINGUNO	TV
COMPRA	BBB0108A19A	COB01CB00003	ACC10748	14031800277	15/04/2008	15/04/2015	NINGUNO	AV
COMPRA	BBB0108C11A	COB01CB00005	ACC8765	13052100817	15/04/2008	15/04/2015	NINGUNO	TV



- 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":

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio
- TODOS

CAR

- ACCIÓN UNO
- CONSERVADOR
- FACTURAS
- FOMESA
- GARANTIAS
- ODISEA

PORTAFOLIO 11/07/2014

Nombre: ACCION UNO Beneficiarios: 800193848-8 FONDO ABIERTO ACCION

Tipo: CARTERA

Línea de Negocio: ACC

INVERSIONES

Ingresar Modificar Eliminar Venta Compra **Trasladar** Reversa Buscar Posiciones 1

Punta	Especie	NDcDv/ISIN	Negocio No.	Orden No.	Fec Emisión
COMPRA	BAVA01099A	COI03CB00011	ACC8398	13040101166	25/08/2009

En el campo Nuevo ISIN registre la información y pulse Aceptar.

Traslado de Portafolio/Cambio ISIN

Tipo de Operación: Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso

Fecha Registro: 11/07/2014 Fecha Oper: 01/04/2013 Fec Cumplimiento: 01/04/2013 Punta: COMPRA Posición: LARGA Nro. Negocio: ACC8398 Nro. de Orden: 13040101166 Traslado A: ACCION UNO

Emisor: AVIANCA Especie: BAVA01099A Depósito: DVL Nuevo ISIN: COI03CB00011 Tipo Inversión: NEGOCIABLE Contraparte: ULTRABURSATILE Hora Compra: 12:00:00 Tipo Fw: NDV

Datos Faciales

Emisión: 25/08/2009 Vencimiento: 25/08/2014 Tasa Nominal: 5.50 Completo-Cup-Ppal: COMPLETO Modalidad Emisión: TRIMESTRAL

Cantidad: 530,000,000.0 Valor de Compra: 551,102,480.0 Ult.Vlr. Mercado: 537,112,600.0 PyG/Trading: -13,989,880.0 VENCIDA

Trader: CCASAS Adicional: 0.0 Modalidad Reinv.: NO APLICA NO APLICA

Valoración

T. Efect: 4.906 Precio: 103.9816 Captación/Salida: 0.00

T.Repo/Cpr: 0.00 Oper. Regreso: 0 Valor Giro/Recompra: 0.00

Días Cpr: 0.000 Fec Cpr: 30/04/2014 Orden CPR:

Comisión: 0.0 Base Comisión: 0.0 Retención: 0.0 Base Retención: 0.0 Traslado: 0.0 Base Traslado: 0.0 Operación Origen/A Cubrir:

PUC: 0 Nit Cliente: Nombre Cliente: Sistema: MEC Usuario: Estación: Estado T título: NORMAL

Mercado: SECUNDARIO Finalidad: ESPECULA Compensación: DVP Forma de Pago: TRA Cal. Crediticio Inv. A #EMISION: NA

Calcular Aceptar Cerrar

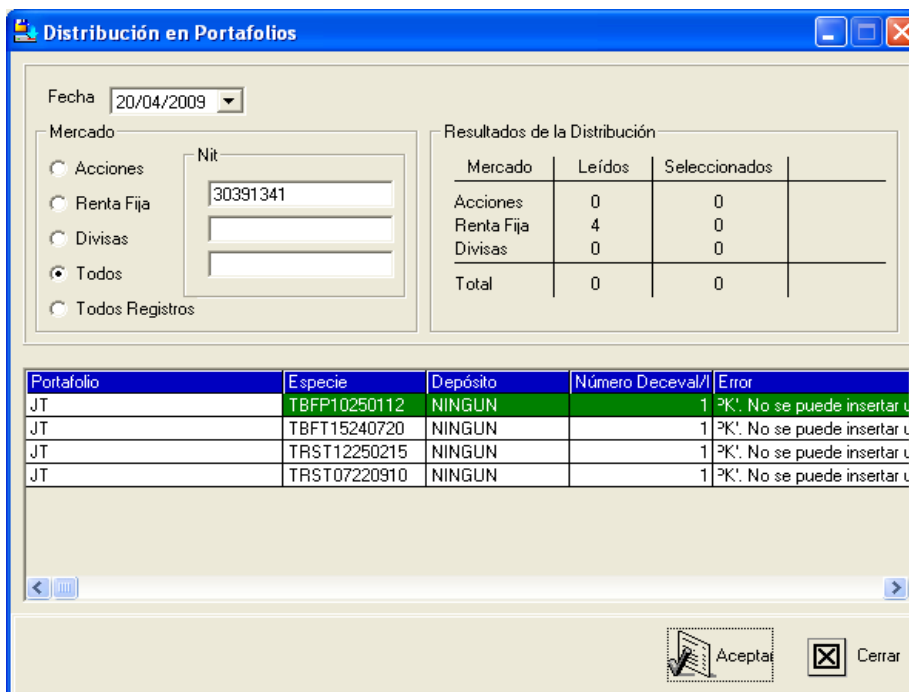
8.2.2. DISTRIBUCION

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.



Después de dar clic en el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla:



8.2.3. COMPROMISOS

Carga de Datos

Cargue Automático

Archivo: D:\Productos\REI\AAAA\Clientes\Equidad Seguros\2018\20180810 Propuesta Carga Portafolios desde F351\

Fecha Carga: 10/08/2018 X Período

Tipo Archivo = Excel Vista PlanoMercado Derechos Swaps Desde 351 Excel

Exportar Vista Exportar Errores Errores Aceptar Cerrar

FormatosTodasEntrada.xls [Modo de compatibilidad] - Microsoft Excel

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K
1											
2	SERIE	ONG	INI	FIN	TIPO	DOMINIO	NOMBRE	DESCRIPCIÓN	REQUERIDO	OBSERVACIONES	PROCEDENCIA DE LOS DATOS
3	1	8	1	8	F	-	Fecha Registro	Fecha del Registro	SI	Llave Primaria	Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
4	2	60	3	68	A	-	Portafolio	Portafolio al que se asigna el título o inversión	SI	Llave Primaria	Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
5	3	10	69	78	A	-	Deposito	Deposito de Valores. Reecode que este es el administrador por defecto.	SI	Llave Primaria (DVC_DVL,FISICO_OTRO)	Formato 12,6 Decimal
6	4	20	79	98	A	-	NumDovDdl	Usito como ISIN o número libre	SI	Llave Primaria	Formato 12,6 Decimal
7	5	15	99	113	A	-	Numero Negocio	Numero del Negocio/Numero asignado a la inversión	SI	Llave Primaria	Formato 12,6 Decimal
8	6	15	114	128	A	-	Numero Orden	Numero de Orden/Numeración Libre	SI	Llave Primaria	Formato 12,6 Decimal
9	7	8	129	134	A	-	Punta		SI	Llave Primaria (Compra o Venta)	Formato 12,6 Decimal
10	8	5	135	139	A	-	Posicion		SI	Llave Primaria (Compra o Venta)	Formato 12,6 Decimal
11	9	12	140	151	A	-	Especie		SI	Llave Primaria (Compra o Venta)	Formato 12,6 Decimal
12	10	8	152	159	F	-	Fecha Operación	Fecha de Realización de la Operación	SI		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
13	11	8	160	167	F	-	Fecha Compra	Fecha en la que se realiza la compra	SI		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
14	12	19	168	186	N	-	Valor de Compra	Valor de Compra del Título	NO		Formato 12,6 Decimal
15	13	9	193	194	F	-	Fecha Emision	Fecha de Emision	SI		Formato 12,6 Decimal
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	A	-	Modalidad Emision		SI		Formato 6,3 Decimal
19	17	2	215	216	A	-	Modalidad de Reinversion		SI		Formato 6,3 Decimal
20	18	17	217	223	N	-	Cantidad	Valor nominal del título	SI		Formato 14,2 Decimal
21	19	1	234	234	A	-	Completo Cup.	Tipo del título	SI	Completo, Cupon, principal	Formato 14,2 Decimal
22	20	20	236	254	N	-	Tasa Efectiva	Tasa de Compra del título	NO		Formato 6,3 Decimal
23	21	10	255	264	N	-	Precio	Tipo de Compra	SI		Formato 6,3 Decimal
24	22	10	265	274	A	-	Tipo Compromiso	Precio de Compra	SI	REPO - TIPOFV=INT son	Formato 6,3 Decimal
25	23	8	275	282	F	-	Fecha Compromiso		SI		Formato AAAAMMDD sin espacios ni separadores de
26	24	5	283	287	N	-	Dias Compromiso		SI		Formato 6,3 Decimal
27	25	10	288	297	N	-	Tasa Compromiso		NO		Formato 6,3 Decimal
28	26	19	298	316	N	-	Valor Captacion	Valor de Captacion para repos	NO	Valor Salida	Formato 16,2 Decimal
29	27	19	317	325	N	-	Valor Compromiso		SI	Valor Salida	Formato 6,3 Decimal
30	28	15	336	350	A	-	Operación Regreso	Operación de Regreso en Simultaneas	SI		Formato 6,3 Decimal
31	29	12	351	362	A	-	Tipo Inversion		SI	NEGOCIABLE O VENCIMIENTO O	Formato 6,3 Decimal
32	30	10	363	372	N	-	ContraParte		SI		Formato 6,3 Decimal
33	31	13	373	385	H	-	Hora Compra	Hora de Compra	SI		Formato 6,3 Decimal
34	32	3	386	388	A	-	TipoFv	Tipo Forward	SI	DELIVERY o NO DELIVERY	Formato 6,3 Decimal
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
37	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 PVPNOV se usa así: i-Poner el nombre que viene en la columna "Portafolio"	SI	SOLO BACKOFF Y PVPNOV	Decimal
38	36	10	430	439	A	-	Trader	N/A. Dejar vacio en carga compromisos normal	NO		Char
39	37	10	440	449	A	-	Orden Compromiso	Indicador para Compromisos SIM, REPO o TRANSTEMP	SI	SOLO BACKOFF	Char
40	38	10	450	459	A	-	Sistema	Sistema Origen de la Operación	SI	SOLO BACKOFF	Char
41	39	20	460	479	A	-	Negocio Origen	Operación donde se compró el título que se esta vendiendo o viceversa.	SI	SOLO BACKOFF	Char
42	40	19	480	498	N	-	Comision	Valor de Comisión pagada	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
43	41	19	499	517	N	-	Base Comision	Valor Base de la comision	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
44	42	19	518	536	N	-	Retefuente	retención en la Fuente	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
45	43	19	537	555	N	-	Base Retencion	Base retención en la Fuente	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
46	44	19	556	574	N	-	Traslado	Retención trasladada	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
47	45	19	575	593	N	-	Base Traslado	Base retención trasladada	SI	SOLO BACKOFF	Formato 16,2 Decimal
48	46	4	594	597	A	-	TIPOINTER	TIPO INTERFAZ:FLUG-RIESGO LIQUIDEZ	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
49	47	1	598	598	A	-	TIPOID	TIPO IDENTIFICACIÓN CLIENTE(C,N,I,E,P)	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
50	48	20	599	618	A	-	NROID	IDENTIFICACIÓN DEL CLIENTE	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
51	49	60	619	638	A	-	NOMBRE	NOMBRE DEL CLIENTE	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
52	50	20	639	658	A	-	CUC	CUENTA INVERSIÓN	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
53	51	1	659	659	A	-	MERCADO	P=PRIMARIO, S=SECUNDARIO	SI	SOLO RLQ	Formato 16,2 Decimal
54	52	10	700	709	A	-	FINALIDAD	ESPECULA, COBVAL, COBFLU, COBACT, DONACION, O BLIGADA, NA	SI		Formato 16,2 Decimal
55	53	4	710	713	A	-	COMPENSACION	DVP, CES, CET, NET, REP, OTRA	SI		Formato 16,2 Decimal
56	54	3	714	716	A	-	PAGO	TRACHEFE	SI		Formato 16,2 Decimal
57	55	4	717	720	N	-	CODMUN/P/P	CODIGO DE MUNICIPIOS SEGÚN TABLA	SI		Formato 16,2 Decimal
58	56	10	721	730	A	-	DCL CAMBIO	NRO DECLARACION DE CAMBIO SEGÚN FORMULARIO	SI		Formato 16,2 Decimal
59	57	10	731	740	A	-	NRAL CAMBIARIO	NRAL CAMBIARIO	SI		Formato 16,2 Decimal
60	58	1	741	741	A	-	CAL CREDITICID	CAL RIESGO CREDITO INVERSIONISTA	SI		Formato 16,2 Decimal
61	59	4	742	745	A	-	PAIS	CODIGO SUPER PAIS ORIGEN GIRO	SI		Formato 16,2 Decimal
62	60	10	746	755	N	-	MARGEN INICIAL	MARGEN QUE DESEA UTILIZAR PARA VALORAR A TI SIR EL TITULO ESTÁ AL VENCIMIENTO	SI		Formato 16,2 Decimal
63	61	10	756	765	A	-	ESTADO	ESTADO DEL TITULO: NORMAL(SIN RESTRICCIÓN), GARLUG(GARANTIZANDO OPERLUG), GARCOR(VENCIDO EN CORTO), GARCRC(DADO EN GARNATIA A LA CPC)	SI		Formato 16,2 Decimal

Inversiones para mantener hasta el Vencimiento - Margen Inicial

Sobre el tema referido hemos agregado a PWPREI la opción de carga de márgenes iniciales para títulos al vencimiento y la funcionalidad de deducirlos. Se describe el funcionamiento a continuación.

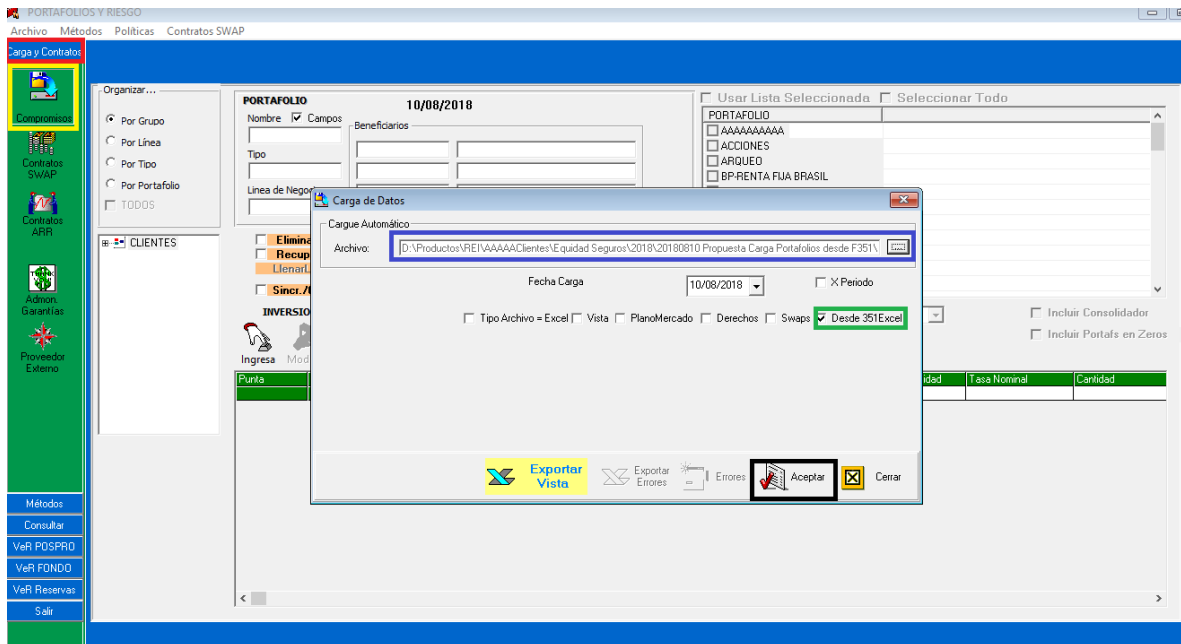
1. En el formato de "Compromisos" PWPREI puede adicionar el "Margen Inicial" en la columna 60. (Ver Formatos de Carga PWPREI FormatosTodasEntrada.xls – Hoja Compromisos(D))
2. Al Valorar el sistema procederá:
3. Si se ha cargado el margen inicial, se valora con ese margen más la tasa de referencia del 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.
 - ii. Con la tasa efectiva de compra + la Tasa de Referencia de esa fecha se define el margen.
 - iii. 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.
 - ii. 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.
 - ii. Valora siempre con la tasa de referencia del día + ese margen.

8.2.3.1. NOTAS OPERATIVAS CARGA PORTAFOLIOS DESDE ARCHIVO 351 EXCEL

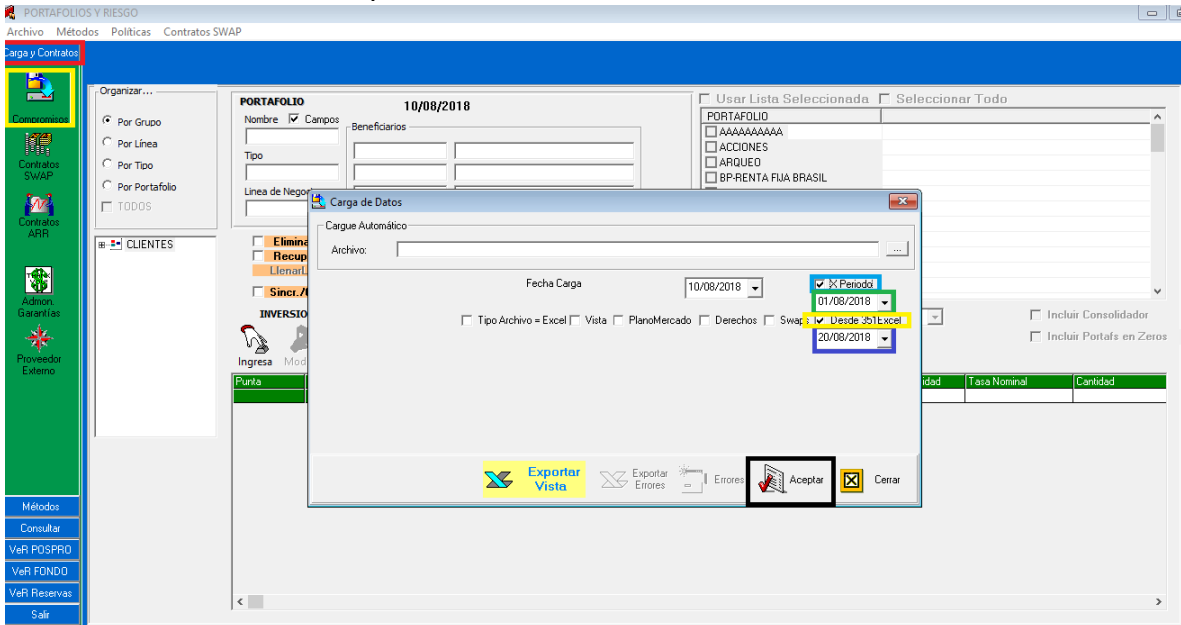
Para alimentar sus portafolios desde el archivo 351, transformado en un Excel, proceda como se indica a continuación.

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:



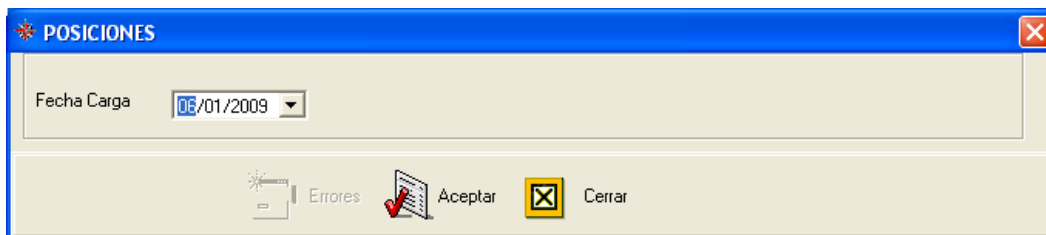
- b. Por Periodos. Para alimentar un periodo proceda:
 - i. Siga los pasos anteriores hasta antes de pulsar Aceptar y sin necesidad de seleccionar un archivo.
 - ii. Pulse en "X Periodo"
 - iii. Seleccione la Fecha Inicial (arriba)
 - iv. Seleccione al Fecha Final (abajo)
 - v. Pulse Aceptar.



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



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:

FechaRegistro	Portafolio	NumNegocio	FechaCompra	CantidadCon	ValorCompraCon	TasaCon	FechaIncial	FechaFinal
21/05/2016	YY	YYZ12980	21/04/2016	240,000,000	0	16	21/04/2016	21/04/2016
21/05/2016	YY	YYZ12981	21/04/2016	100,000,000	0	18	21/04/2016	21/11/2016
21/05/2016	YY	YYZ12982	21/04/2016	200,000,000	0	17.80	21/05/2016	21/01/2017
21/05/2016	YY	YYZ12983	21/04/2016	300,000,000	0	17.60	21/05/2016	21/03/2017
21/05/2016	YY	YYZ12984	21/04/2016	400,000,000	0	17.40	21/05/2016	21/05/2017
21/05/2016	YY	YYZ12985	21/04/2016	500,000,000	0	17.20	21/05/2016	21/07/2017
21/05/2016	YY	YYZ12986	21/04/2016	600,000,000	0	17	21/05/2016	21/09/2017
21/05/2016	YY	YYZ12987	21/04/2016	700,000,000	0	16.80	21/05/2016	21/11/2017
21/05/2016	YY	YYZ12988	21/04/2016	800,000,000	0	16.60	21/05/2016	21/01/2018
21/05/2016	YY	YYZ12989	21/04/2016	900,000,000	0	16.40	21/05/2016	21/03/2018
21/05/2016	YY	YYZ12990	21/04/2016	1,000,000,000	0	16.20	21/05/2016	21/05/2018
21/05/2016	YY	YYZ12991	21/04/2016	1,100,000,000	0	16	21/05/2016	21/07/2018
21/05/2016	YY	YYZ12992	21/04/2016	1,200,000,000	0	15.80	21/05/2016	21/09/2018

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.
 - 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:

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:

The screenshot displays the 'Renta Fija' (Fixed Income) configuration window. Key sections include:

- Consulta:** Contratos ARR - D
- Tipo de Operación:** Normal, Contado+Ta5, Repo, Simultáneas, Tr.Temp, Forward, SWAP, Opciones
- Datos Compromiso:** Fecha Registro (21/05/2016), Fecha Oper (21/04/2016), Fec Cumplimiento (21/04/2016), Puntaje (0), Posición (LARGA), No. Negocio (YY213006), No. de Orden (YY213006), Portafolio (YY), Emisor (ACCARR), Especie (FISICO), Tipo Inversión (NEGOCIABLE), Contaparte (PWP), Hora Compra (01:23:51), Tipo Fw (NDV)
- Datos Faciales:** Emisión (21/04/2016), Vencimiento (21/04/2018), Tasa Nominal (0.000), Completo-Cup-Ppal (COMPLETO), Modalidad Emisión (MENSUAL), Valor de Compra (206.337.758.93), UR Vlr. Mercado (PYG/Trading), Mod. Reinv. (VENCIDA), T.Repo/Cpr (0.00), Oper. Regreso (0.00), Valor Giro/Recompra (0.00), Nominal Adquisición (240.000.000), Costo Adquisición (206.337.758.93), Trader (TRADER1), Adicional (0.00), Modalidad Reinv. (NO A), Dias Cpr (0.000), Fec Compromiso (21/04/2016), Orden CPR (FINAL)
- Comisión:** Base Comisión (0.0), Retención (0.0), Base Retención (0.0), Traslado (0.0), Base Traslado (0.0), Operación Origen/A Cubrir (NORMAL)
- Finalidad:** SECUNDARIO, ESPECULA
- Compensación:** OTRA
- Forma de Pago:** TRA
- Cal. Credicio Inv.:** A
- #EMISION:** NA

A 'Crear Compra' button is highlighted in red. Green boxes highlight the 'Especie', 'Tipo Inversión', 'Contaparte', 'Hora Compra', 'Finalidad', 'Compensación', and 'Forma de Pago' fields, indicating they are modifiable. A 'Calculador' button is also visible.

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: Contratos Tablas **DATOS DEL CONTRATO ADQUIRIDO**

Fec. Registro Portafolio Nro. Contrato Fecha Compra Cantidad Adquirida
 21/05/2016 YY YYZ13009 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
 26.4 300,000,000.0 244,892,109.9 17.6 FLUJOS COMPRA

DATOS FACIALES

Cantidad Total Contrato Fac. Fecha Inicial Fac. Fecha Final Tipo Derecho
 300,000,000.0 21/04/2016 21/04/2018 ECONOMICO

Id Arrendador/Emisor Id Arrendatario/Pagador/Contraparte
 ACCINEGOCIOS LTDA.:8604E PWP:900338073-4

Id Tercero/Contraparte
 PWP:900338073-4

Fec. Vigencia Tab. Fecha Pago Tasa Pago
 21/05/2016 21/05/2016 13.5

Vlr. Nuevo Canon Valor Pago Cantidad Pago
 0.0 120,000,000.0 0.0

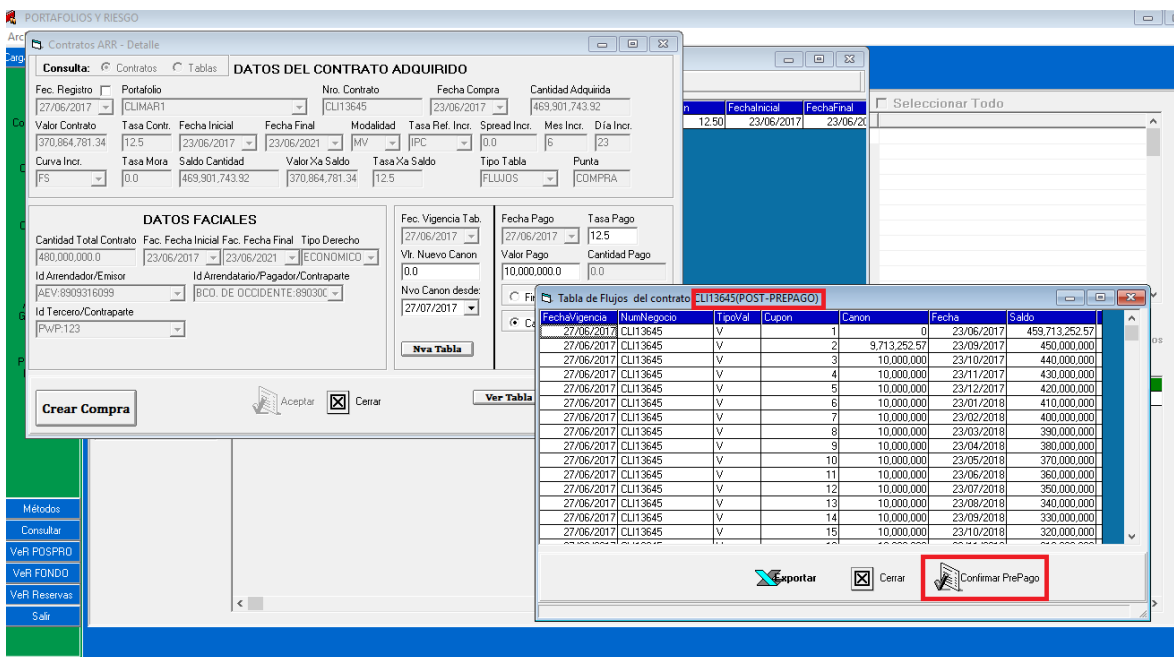
Nvo Canon desde: Final Inicio
 Cancelar Bajar Vlr

Nva Tabla **PrePago**

Crear Compra Aceptar Cerrar Ver Tabla Cargar Tabla

Registre los datos del prepago:

- Tasa Prepago. Tasa para descontar los flujos.
- Valor Prepago. Valor del prepago.
- Final o Inicio:
 - Final. Se descontarán los flujos finales del contrato
 - Inicial. Se descontarán los flujos iniciales, restantes, del contrato
- Cancelar o Bajar Vlr.:
 - 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:



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:

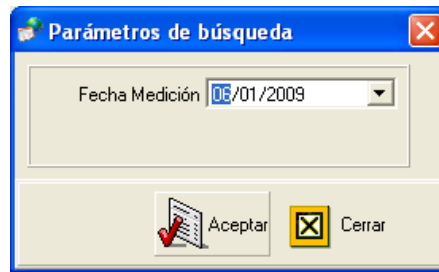
1. **PROVISION+**. Este evento se lanzará al valor al cierre y debe indicar los movimientos para mover la provisión causada en el día para un título enviado a provisión por mora. El valor fuente que debe utilizar es **PROVISION+**
 2. **PROVISION-**. Este evento también se lanza al valor al cierre y 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

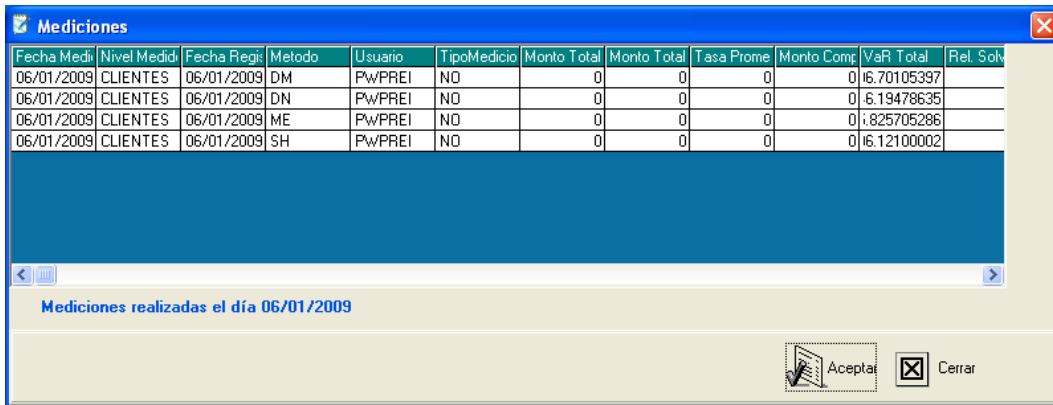


8.3.1. MEDICION

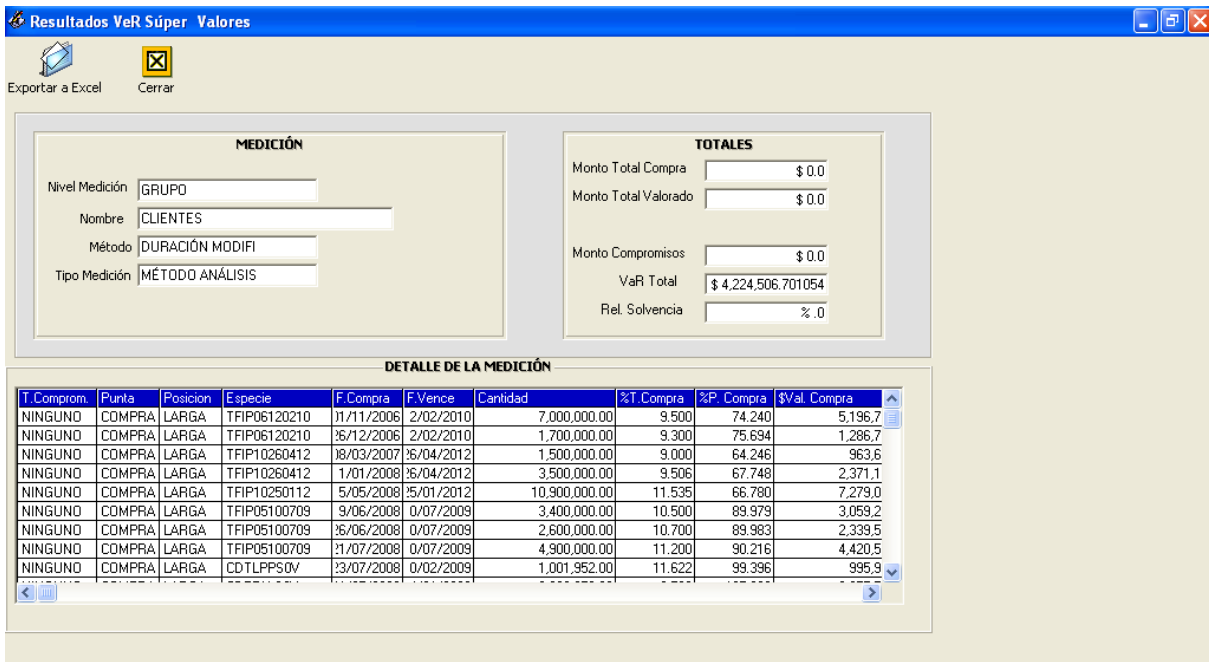
De acuerdo a la fecha dada el sistema muestra de manera detallada las mediciones que se han realizado durante ese día.



Después de seleccionar la fecha debe dar Aceptar y a continuación aparece la siguiente pantalla



Debe de dar Aceptar para ver los resultados.



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...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio

PORTAFOLIO

Nombre: PROFESIONALES

Tipo: GEN

Línea de Negocio: FWPCLI

Beneficiarios:

02	YY S.A.

INVERSIONES

Ingresar Modificar Eliminar

Numero de Operaciones: 36

Punta	Especie	Número	Fec Emisión	Fec Vencimient	T. Com
COMPRA	BPEMINHTA4	10	15/05/2008	04/12/2009	NINGL
COMPRA	CDTB8010D	1	03/12/2008	03/06/2010	NINGL
COMPRA	CDTB8010D	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	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1
COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1
COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1
COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1
COMPRA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1
VENTA	OPCFTRM	0	05/12/2008	05/12/2008	OPCF1

CLIENTES

- VAMCOL
- PRUEBA 513
- JT
- PWP
- PROFESIONALES

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. El 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:
 - i. 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:

1. 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 transformado 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, estas posiciones se tratan según lo establecido en la norma. En términos generales, cada posición en futuros se descompone en dos posiciones notacionales 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 notacionales 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:

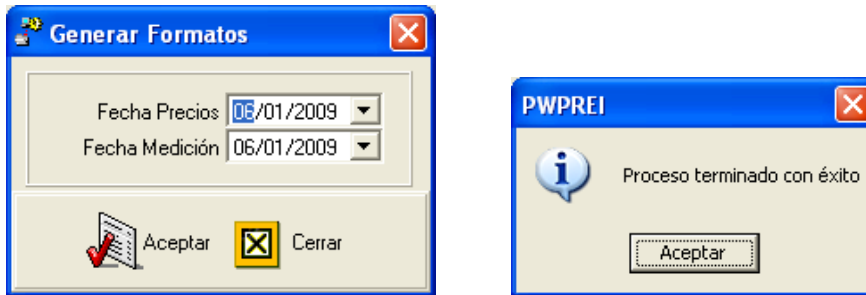
- Futuros en títulos. PWPREI procede a determinar el Ship Delivery de la muestra y tomar el precio de este.
- Futuros en Divisas. PWPREI toma el valor de la moneda como precio del día.
- Futuros en Acciones. PWPREI busca el precio de la acción subyacente.

En cualquier caso PWPREI requerirá que para la fecha de medición exista información del propio derivado.

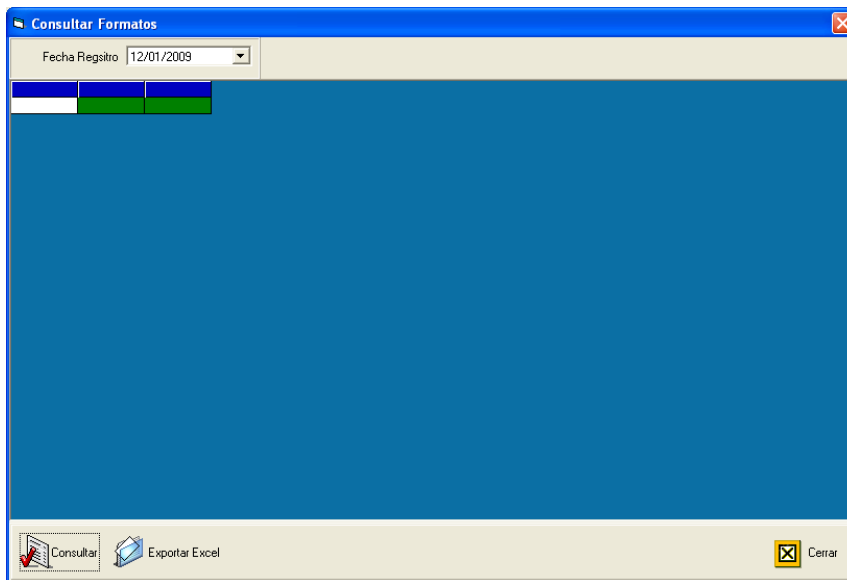
En todos los casos donde no se pueda obtener información histórica suficiente para el activo primario, PWPREI buscará información del activo asociado, si existe, para determinar el dato histórico.

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



8.4.2. CONSULTAR VeR POSPRO



Los Formatos consultados pueden ser exportados a Excel.

8.4.3. FORMATOS

Formatos

Datos Básicos

Fec de Medición 06/01/2009

Tipo Entidad

Código Entidad

Clave

Aceptar Cerrar

8.4.4. INFORME FORMATOS

Form1

Fecha Medición 06/01/2009

- 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

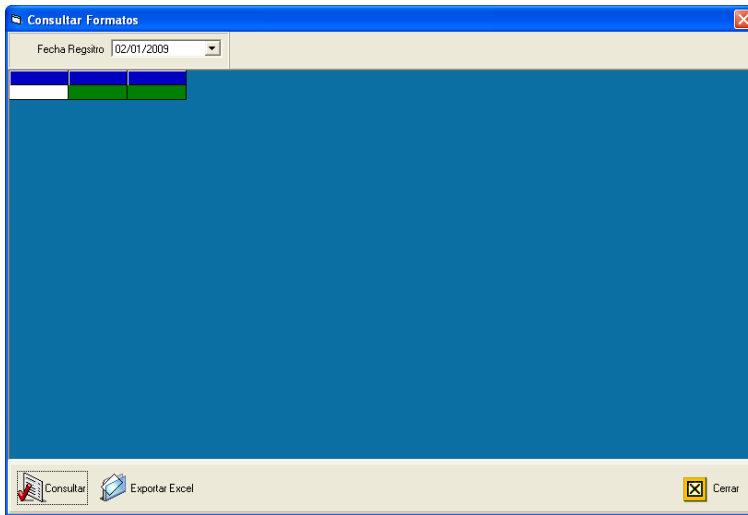
8.5. OPCIÓN VeR FONDO

VeR FONDO

CARTERAS COLECTIVAS

- Consultar
- Generar
- Formatos
- Informe Formatos
- Limpiar Fondos

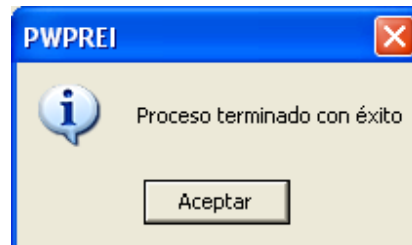
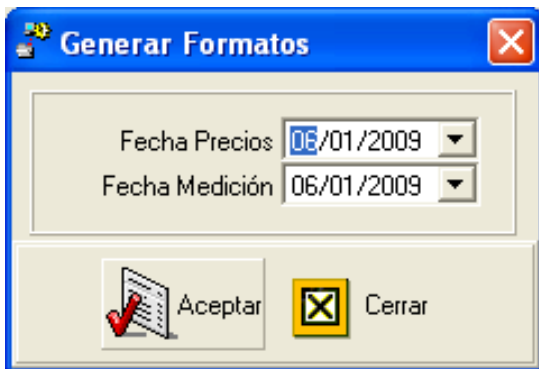
8.5.1. CONSULTAR



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



8.5.3. FORMATOS

8.5.4. INFORME DE FORMATOS

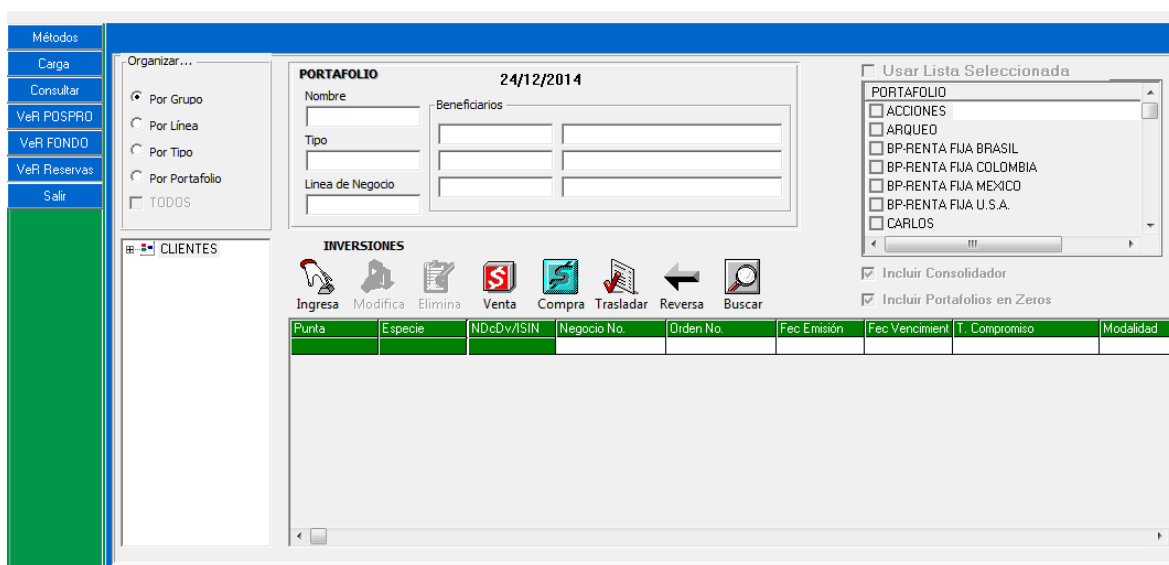
8.5.5. LIMPIAR FONDOS

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.

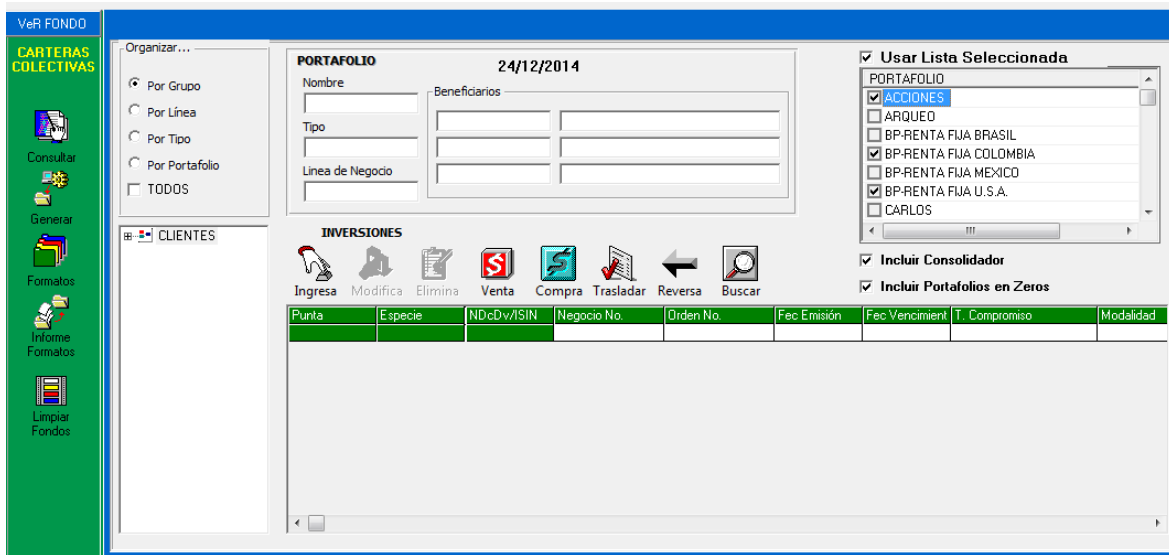
8.5.6. VaR MODELO CARTERAS COLECTIVAS

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:

1. 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:



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:



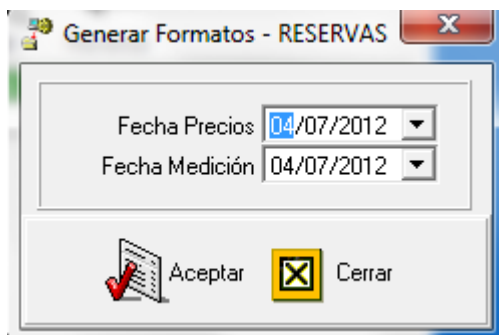
6. Una vez seleccionada su lista, simplemente siga los pasos comunes:
 - a. Pulse "Generar" para que el sistema genere el VaR.
 - b. Pulse "Formatos" para producir los archivos correspondientes.
 - c. Si desea ver los formatos en Excel pulse el botón "Informe Formatos".

8.6. OPCIÓN VeR RESERVAS

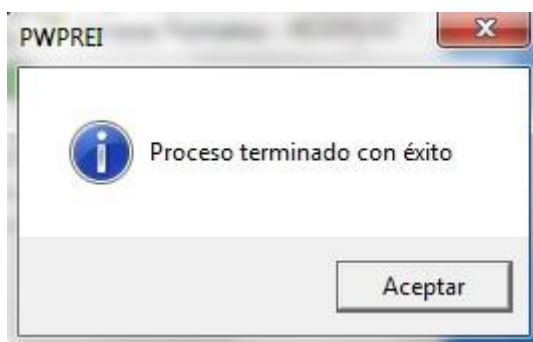


8.6.1. GENERAR

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 Formatos

Fecha Registro: 04/07/2012

Fecha de Registro	TipoCompromiso	Especie	Posicion	FechaEmision	FechaVencimiento	Modalidad
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024	AV
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024	AV
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	LARGA	24/07/2008	24/07/2024	AV
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	CORTA	24/07/2008	24/07/2024	AV
04/07/2012	NINGUNO	TFIT 16240724	LARGA	24/07/2008	24/07/2024	AV

Consultar Exortar Excel Cerrar

8.6.3. FORMATOS

Pulse el Botón "Formatos". Le aparece la pantalla, aquí puede generar los archivos planos

Formatos - RESERVAS

Datos Básicos

Fec de Medición: 04/07/2012

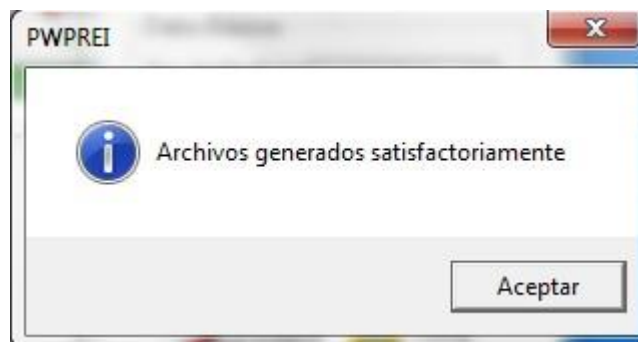
Tipo Entidad:

Código Entidad:

Clave:

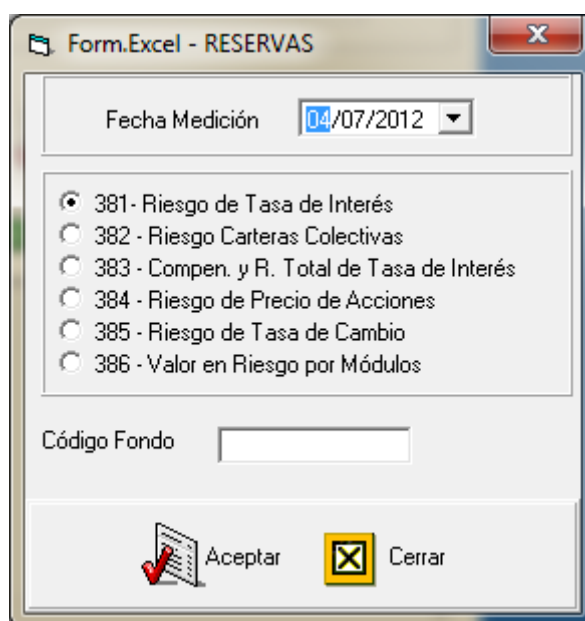
Aceptar Cerrar

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



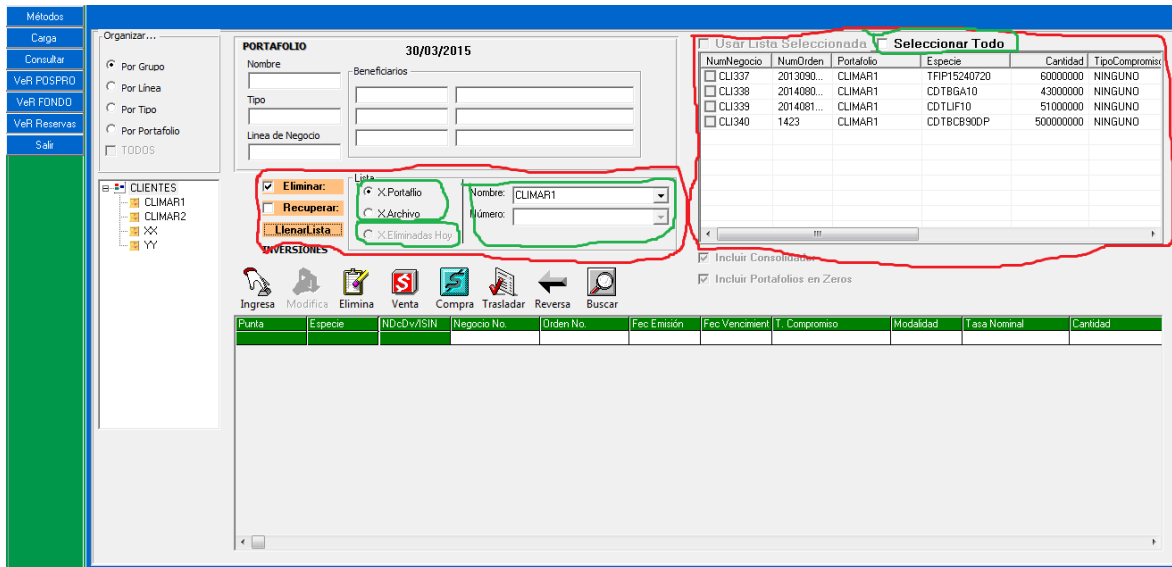
Exportar formatos a Excel.

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:

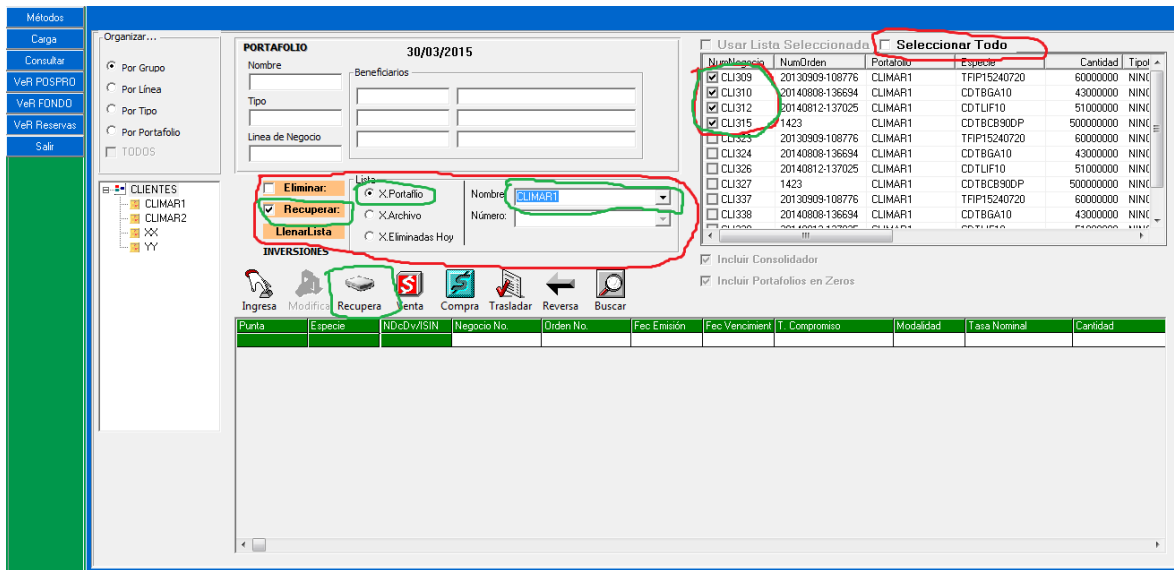
1. Elija la casilla "Eliminar", que está al frente de la lista de portafolios.
2. Luego selecciones "XPortafolio" o "XArchivo" al frente de esta opción e indique el portafolio donde están las operaciones o el archivo fuente que cargó y las contiene.
3. Pulse el botón "LlenarLista". En la grilla de la parte superior derecha le aparece la lista de operaciones de ese archivo o portafolio, como se ve en la pantalla:



4. Seleccione las operaciones que desea eliminar, de esa lista, o utilice la opción "Seleccionar Todo" para chequearlas todas.
5. Una vez establecida la selección, pulse el botón "Elimina" de al lado de "Ingresar" y "Modificar". El sistema le pedirá confirmación 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:



- i. Seleccione las operaciones que desea eliminar, de esa lista, o utilice la opción "Seleccionar Todo" para chequearlas todas.
- ii. Una vez establecida la selección, pulse el botón "Recupera" de al lado de "Ingresar" y "Modificar". El sistema le pedirá confirmación 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.

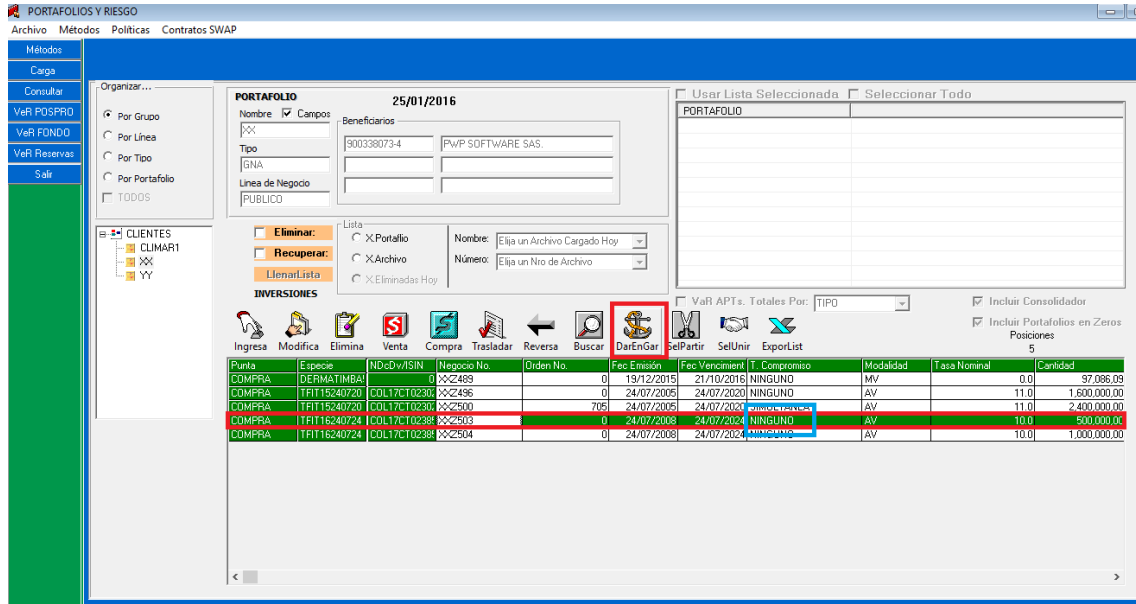
Para el tratamiento de las garantías solicitadas debe proceder así:

- 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":



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 Garantía

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a5 Repo Simultáneas Tr.Temp. Forward SWAP Opciones

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 25/01/201E Fecha Oper: 21/12/201E Fec.Cumplimiento: 21/12/201E Punta: COMPRA Posición: LARGA Nro. Negocio: XZ503 Nro. de Orden: 0 Portafolio: XX
 Emisor: GOBIERNO NACIONAL Especie: TFIT16240724 Depósito: DCV ISIN: COL17CT02385 Tipo Inversión: NEGOCIABLE Contraparte: AEV Hora Compra: 05:30:24 Tipo Fw: NDV

Datos Faciales
 Emisión: 24/07/2008 Vencimiento: 24/07/2024 Tasa Nominal: 10.00 Completo-Cup-Ppal: COMPLETO Modalidad Emisión: ANUAL
 Cantidad: 500.000.000.0 Valor de Compra: 623.522.675.95 Ult.Vlr. Mercado: 623.411.101.9 PyG/Trading: -111.574.05 VENCIDA
 Nominal Adquirido: 500.000.000.0 Costo Adquisición: 623.522.675.95 Trader: TRADER1 Adicional: 0.0 Modalidad Reinv.: NO A NO A

Valoración
 T. Efect: 6.75 Precio: 124.704535 Captación/Salida: 0.00
 T.Repo/Cpr: 0.00 Oper. Regreso: 0 Valor Giro/Recompra: 0.00
 Dias Cpr: 0.000 Fec Compromiso: 21/06/201E Orden CPR: FINAL

Comisión: 0.0 Base Comisión: 0.0 Retención: 0.0 Base Retención: 0.0 Traslado: 0.0 Base Traslado: 0.0 Operación Origen/A Cubrir: PARTIR_20151221:XXZ495
 PUC: 0 Nit Cliente: Nombre Cliente: Sistema: MEC Usuario: Estación: Estado Título: NORMAL

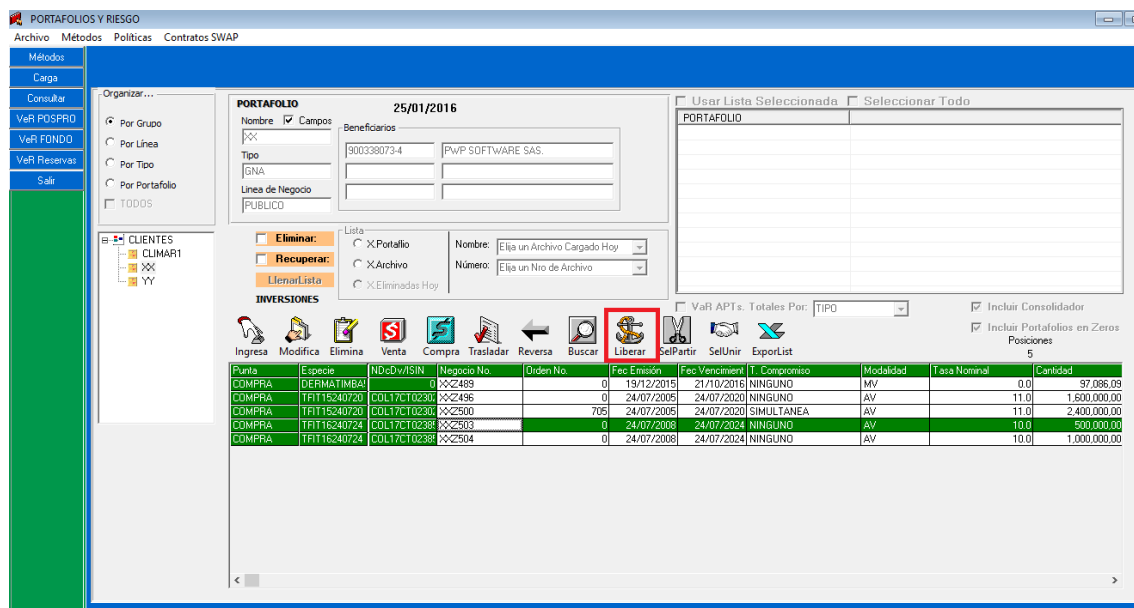
Mercado: SECUNDARIO Finalidad: ESPECULA Compensación: DVP Forma de Pago: TRA Cal. Crediticio Inv.: A #EMISION: 53059

Calculador Aceptar Cerrar

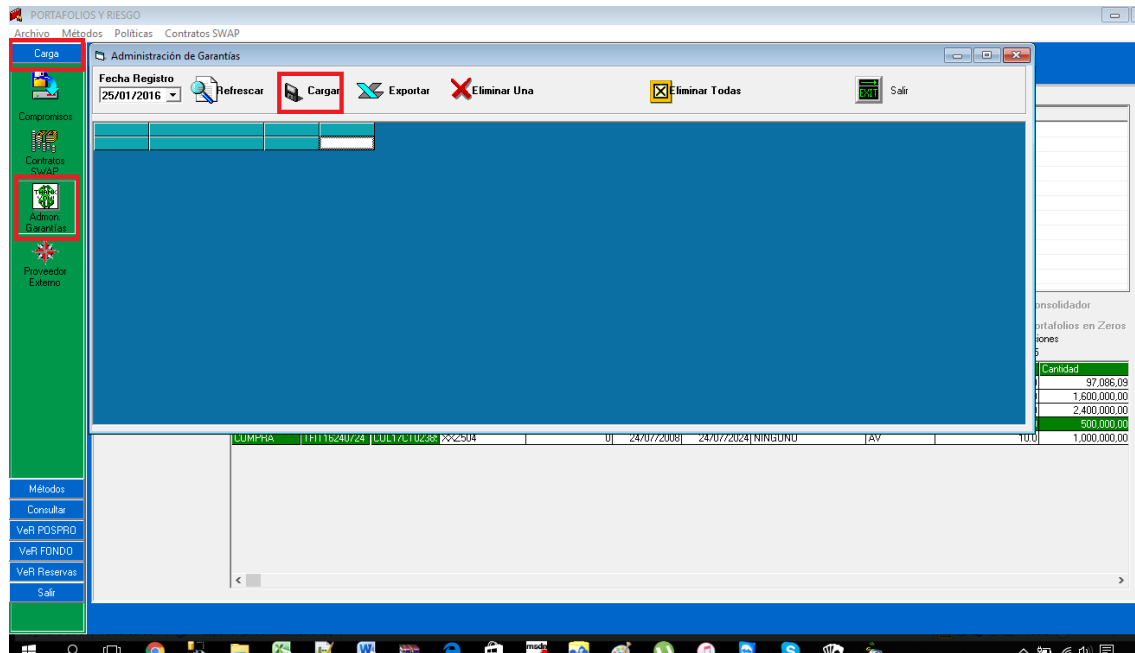
3. Pulse Aceptar. El título quedará marcado como "Dado en Garantía".

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:



- 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:



- 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":

FechaVigencia	NR Emp.D.Fondo	Contraparte	PlazoFasLa	ProbDefaut	TasaRecuper	Vax1000FMI	FechaRegistro	XCobrarDHT	XPagarDHT	XCobrarDVI	XPagarDVI	XCobrarCon
01/12/2015	900338073-4	305	1	0.15	90	150,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	305	3	0.60	92	480,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	305	30	1.20	94	1,000,000,000,000.01	21/12/2015	3,503,744,809.05	0	32,196,952.05	0	0
01/12/2015	900338073-4	305	180	2.50	97	1,000,000,000,000.01	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	305	365	5	99.99	1,000,000,000,000.05	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	305	9,999	5	99.99	1,000,000,000,000.05	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	405	1	0.15	90	150,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	405	3	0.16	91	144,000	21/12/2015	0	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	0
01/12/2015	900338073-4	405	30	1	95	500,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	405	180	2	97	1,000,000,000,000.01	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	405	365	4	99.99	1,000,000,000,000.04	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	405	9,999	4	99.99	1,000,000,000,000.04	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	AEV	1	0.50	82	900,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	AEV	3	0.80	85	1,200,000	21/12/2015	0	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	0
01/12/2015	900338073-4	AEV	30	2	87	2,600,000	21/12/2015	0	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	0
01/12/2015	900338073-4	AEV	365	6	91	5,400,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	AFV	9,999	12	95	0,000,000,000,000.01	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	1	0.10	98	20,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	3	0.10	98	20,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	15	0.20	99	20,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	30	0.30	99	30,000	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	180	0.40	100	0	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	365	0.50	100	0	21/12/2015	0	0	0	0	0
01/12/2015	900338073-4	PWP	9,999	0.50	100	0	21/12/2015	0	0	0	0	0

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 mí 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

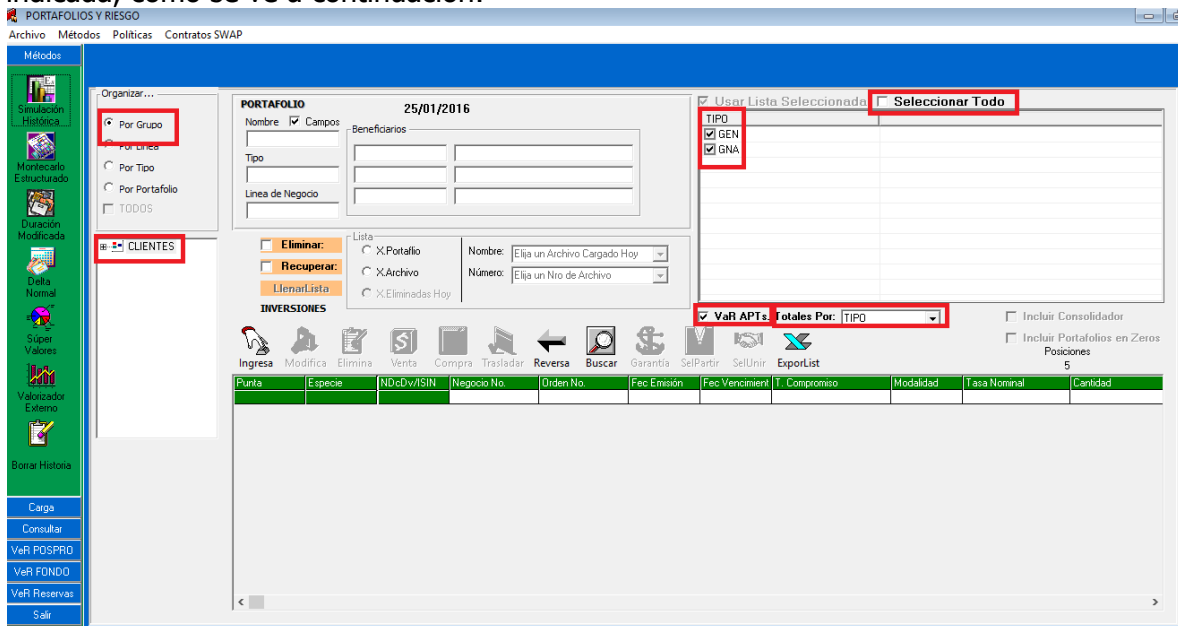
cuando corresponda.

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:**

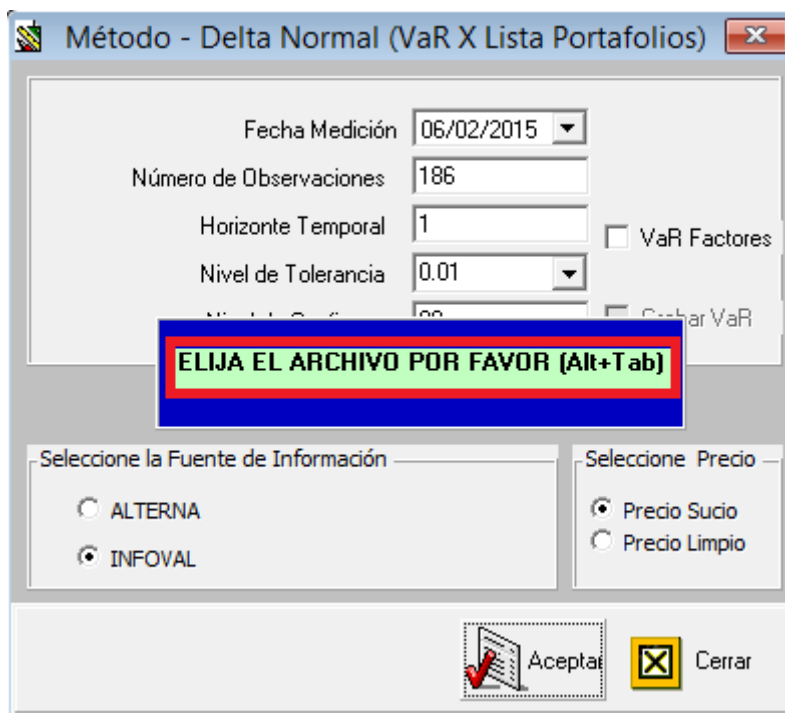
En la pantalla acostumbrada le aparece la opción “VaR APTS Totales Por:”. A la derecha elija a qué nivel desea agrupar el VaR: Tipo, Portafolio, Grupo o Línea. En seguida le aparece arriba la lista de: Tipos, Portafolios, Grupos o Líneas con inversiones en la fecha de registro indicada, como se ve a continuación:



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:



5. Archivo.

Una vez seleccionado el archivo el sistema grabará el informe, así:

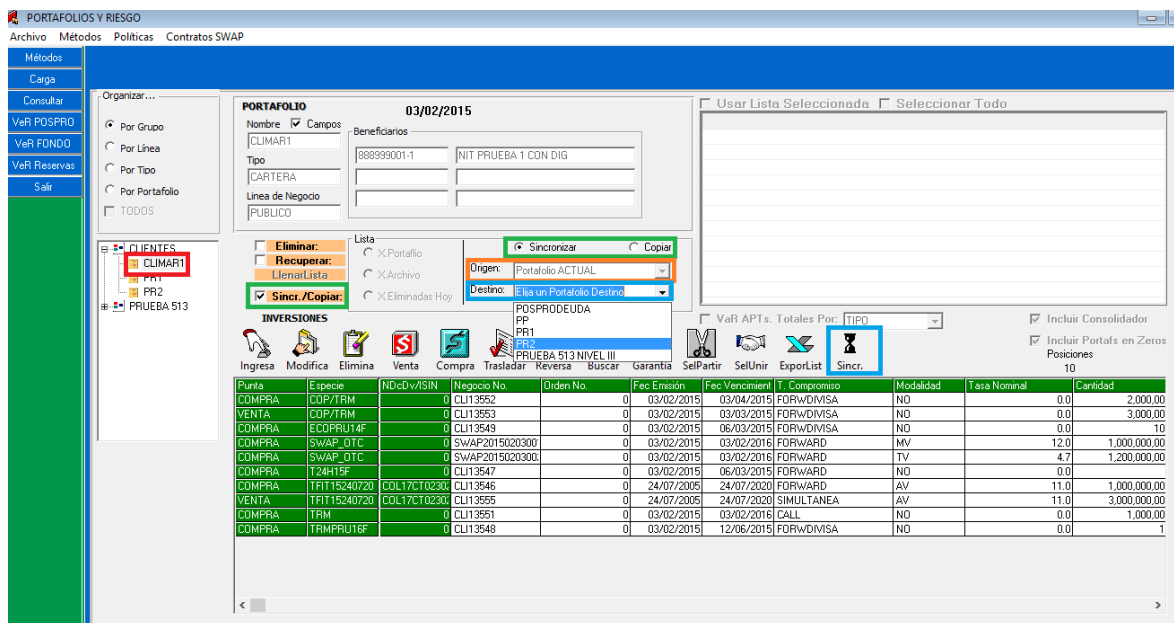
- En la primera hoja, los totales por cada ítem.
- En las subsiguientes hojas del Excel, el detalle de las posiciones para cada ítem. Le aparecerán tantas hojas como portafolios haya incluido en el informe.

SINCRONIZACION DE PORTAFOLIOS

Las funcionalidades descritas a continuación corresponden a:

- Sincronizar Portafolios.
- Copiar Posiciones.

Observe la siguiente pantalla de administración de Inversiones:



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 éstos 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 éstas 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:

- Incluir las 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.

1. 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.

2. 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.

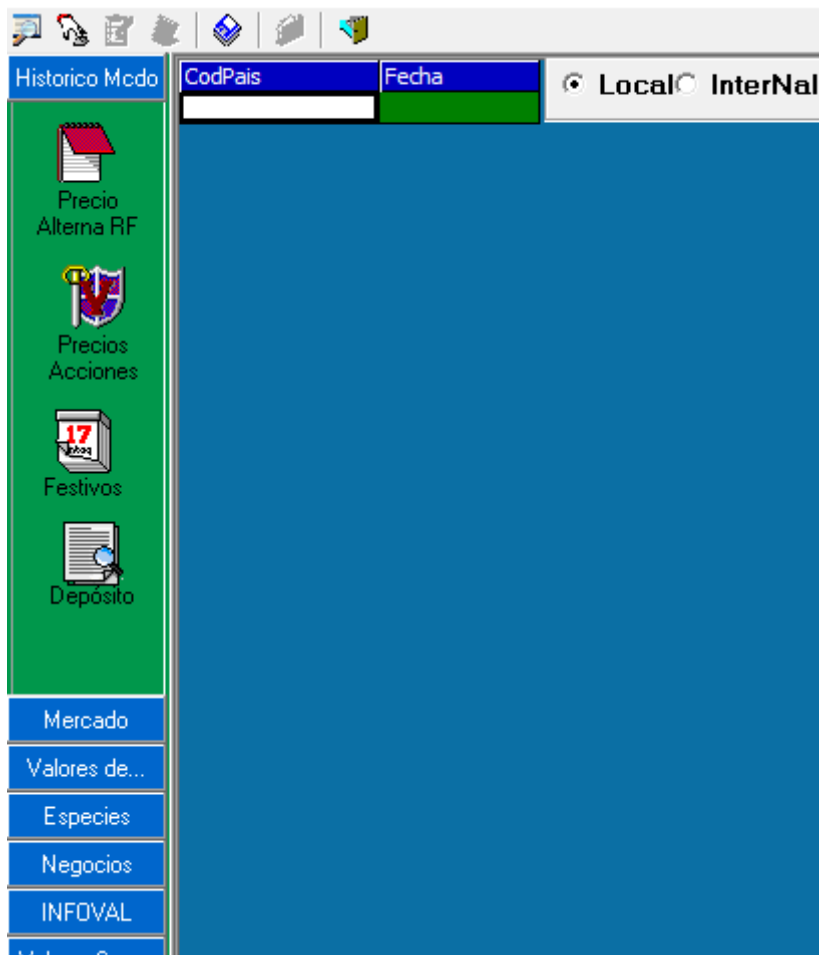
b. Especies para Forwards. No sufren cambios con respecto a la definición tradicional de PWPREI.

3. Carga de información de PPV

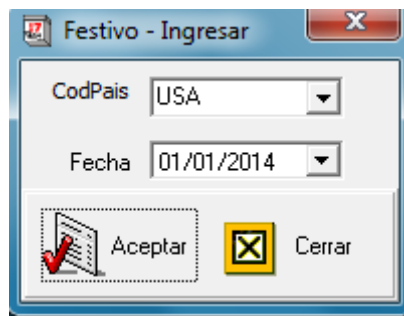
a. Curvas SWAP. Las curvas SWAP son administradas por la opción "Mercado y Sociedad – Forwards/Opc – TasasFw". Utilice el botón "Cargar" para alimentar las curvas al sistema. Tenga en la cuenta que tanto la fecha de vigencia o de carga como el nombre de la tasa a cargar, se toman del nombre del archivo 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.

- ii. 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.
- b. Puntos Forward. Carguelos 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:



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:

FechaRegis	NumNegocio	Normalnt	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

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: 04/06/2015 | Nro. Contrato: SWAP20150504_002 | Norma Int. Flujos: SI

Celebración: 04/05/2015 | Liquidación: 04/05/2015 | Vencimiento: 04/05/2016

RECIBE		ENTREGA	
Tasa Ref.	FS	Tasa Ref.	IBR
Uso Tasa	ACTUAL	Uso Tasa	PREVIA
Spread	5.00	Spread	0.00
Modalidad	MV	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	COMERCIAL
CodPais(Fest.)	COL	CodPais(Fest.)	COL
Calen. Val.	CORRIDO	Calen. Val.	CORRIDO
Curva Val.	SWLIBORCOP	Curva Val.	SWLIBORCOP
Correr Sigte.	0	Correr Sigte.	0

Con Tabla - Pulse para Quitar

Ver Tabla | Cargar Tabla

Aceptar | 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.

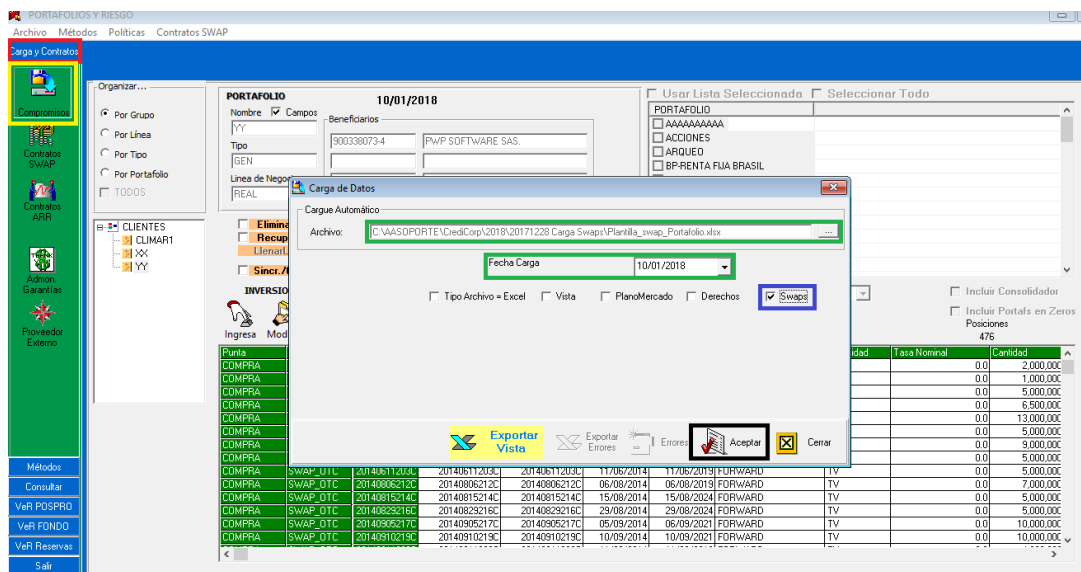
- Cierres. Los contratos con tabla de flujos asociadas serán actualizados al cierre. Es decir, si a la fecha ocurre una amortización, el contrato pasa al día siguiente por una cantidad disminuida en el valor amortizado.

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.**

1. **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:



- iv. Una vez pulse Aceptar, el sistema validará primero los contratos y si es necesario los registrará o modificará según la plantilla.
- v. 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:

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.
- ii. 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.

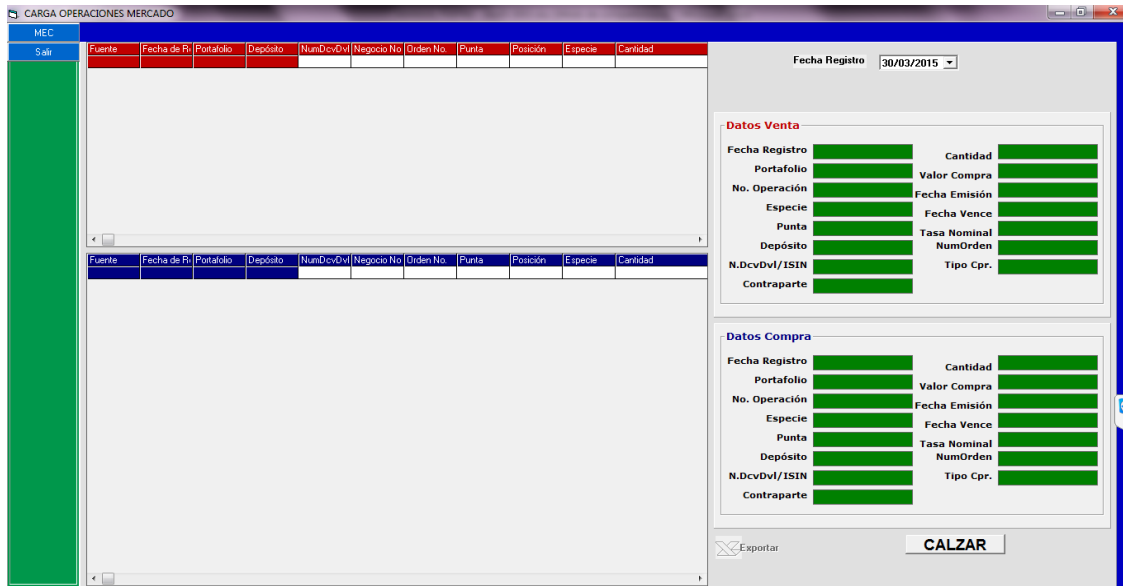
- b. Forwards sobre divisas. Estos se siguen valorando de la forma ya definida, con excepción del hecho de que usted dispone de ahora de los PIPS y tasas publicadas por su PPV para valorarlos.
 - c. Forwards sobre títulos. Estos se siguen valorando de la forma ya definida. No hay cambios en esta versión, 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".
 - b. 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:



Pulse el botón “MEC” para ver el menú de opciones:

9.1. OPCIÓN MEC



9.1.1. NOTAS CARGA MASTER TRADER

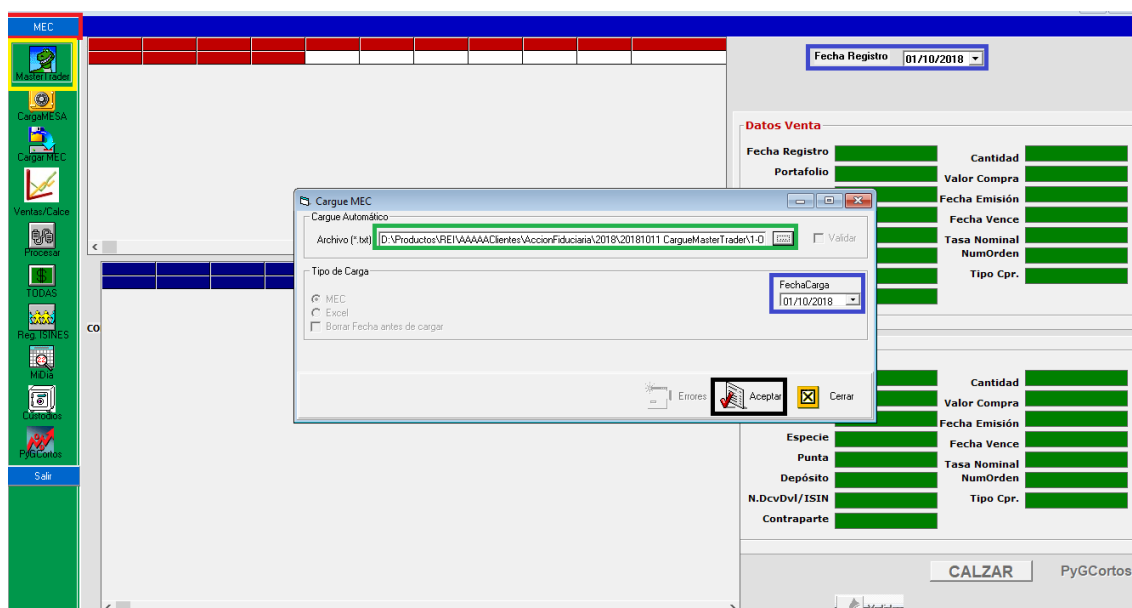
1. Consideraciones:

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:



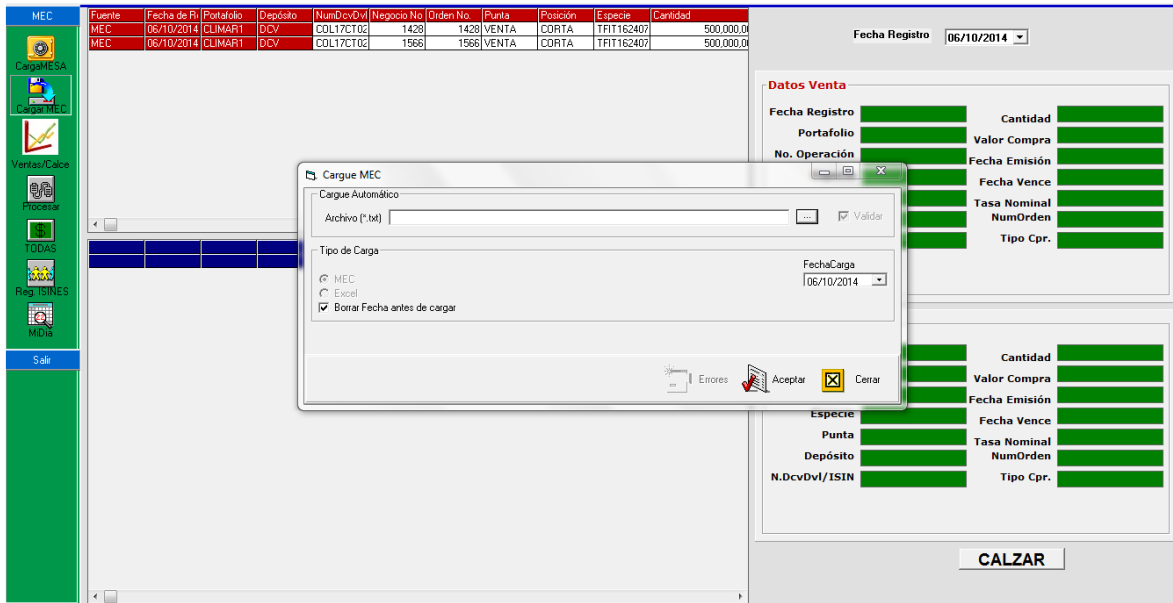
- e. Pulsa Aceptar y las operaciones en el archivo serán alimentados al sistema.
 - f. En caso de errores, pulse el botón errores para ver la lista.
3. Procesamiento.

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 transparente para usted.

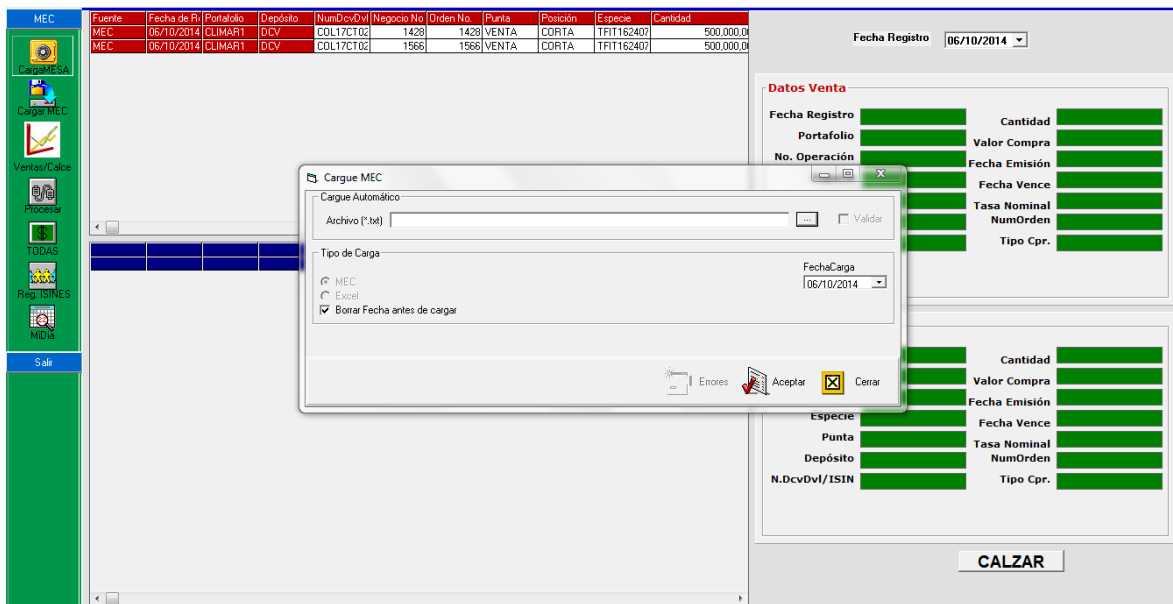
9.1.2. CARGAMESA

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:



- 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:



- 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:

The screenshot displays the PWPRI software interface. On the left is a vertical menu with icons for 'Carga MESA', 'Carga MEC', 'Ventas/Calce', 'Procesar', 'TODAS', 'Reg. ISINES', and 'Salir'. The main area is divided into a table and two data entry panels.

Table Data:

Fuente	Fecha de R	Portafolio	Depósito	NumDcvDvl	Negocio No	Orden No	Punta	Posición	Especie	Cantidad
MEC	06/10/2014	CLIMAR1	DCV	COL17CT02	1428	1428	VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000.0
MEC	06/10/2014	CLIMAR1	DCV	COL17CT02	1566	1566	VENTA	CORTA	TFIT162407	500,000.0
MEC	06/10/2014	CLIMAR2	DCV	COL17CT02	963	963	VENTA	CORTA	TFIT152407	7,000
MEC	06/10/2014	CLIMAR2	DCV	COL17CT02	1186	1186	VENTA	CORTA	TFIT162407	500
MEC	06/10/2014	CLIMAR2	DCV	COL17CT02	1141	1141	VENTA	CORTA	TFIT071508	7,000
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	COL17CT02	333	333	COMPRA	LARGA	TFIT162407	500
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	COL17CT02	53	53	COMPRA	LARGA	TFIT162407	500
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	COL17CT02	1446	1446	VENTA	CORTA	TFIT071508	2,000
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	TFIT020107	933	933	VENTA	CORTA	TFIT020107	5,000
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	TFIT031111	1132	1132	COMPRA	LARGA	TFIT031111	1,000
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DCV	TFIT162804	1041	1041	VENTA	CORTA	TFIT162804	5,000
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DVL	BPEISSA3	236	236	VENTA	CORTA	BPEISSA3	85
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DVL	BPEMINHT1	213	213	VENTA	CORTA	BPEMINHT1	191
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DVL	BPEMINHT1	625	625	VENTA	CORTA	BPEMINHT1	191
MEC	06/10/2014	SINPORTAFOLIO	DVL	BPEMINHT1	195	195	VENTA	CORTA	BPEMINHT1	310

Datos Venta Panel:

- Fecha Registro: 06/10/2014
- Portafolio: [Empty]
- No. Operación: [Empty]
- Especie: [Empty]
- Punta: [Empty]
- Depósito: [Empty]
- N.DcvDvl/ISIN: [Empty]

Datos Compra Panel:

- Fecha Registro: 06/10/2014
- Portafolio: [Empty]
- No. Operación: 339
- Especie: TFIT16240724
- Punta: COMPRA
- Depósito: DCV
- N.DcvDvl/ISIN: COL17CT02385

Buttons: CALZAR, ASIGNAR, [Empty]

b. Elija el portafolio y luego pulse Asignar para que la operación quede asignada al portafolio seleccionado.

- Calzar. Calce las operaciones de manera normal, como lo hace hoy.
- 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

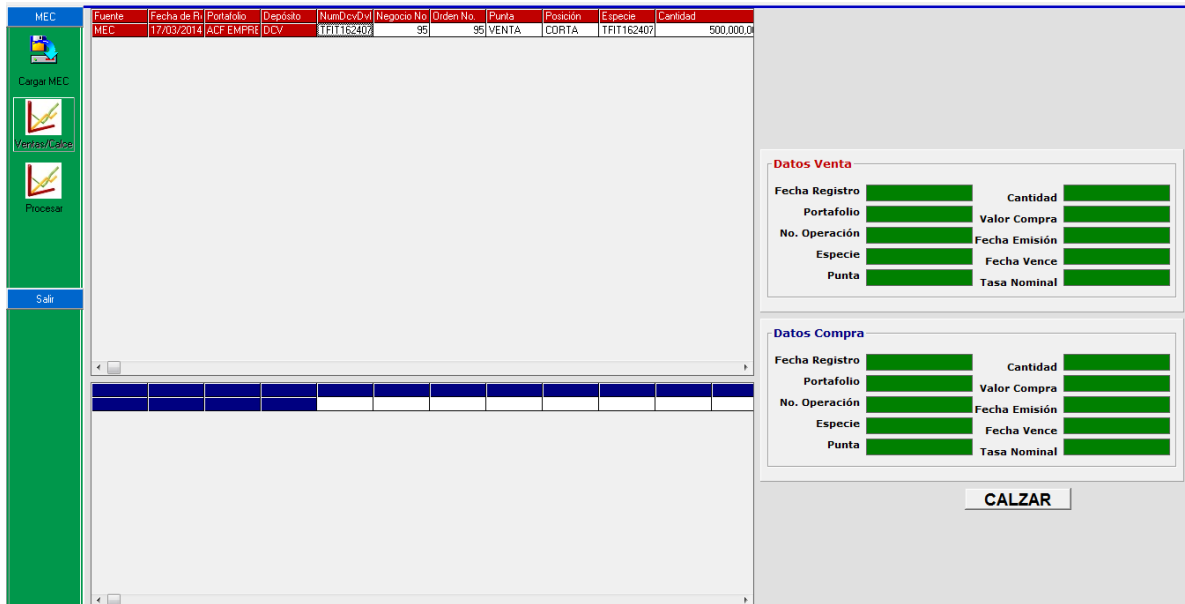
Esta opción le permite cargar un archivo plano de liquidaciones para agregarlas al conjunto de proceso. Para cargar un archivo pulse el botón "Cargar MEC". Le aparece lo siguiente:



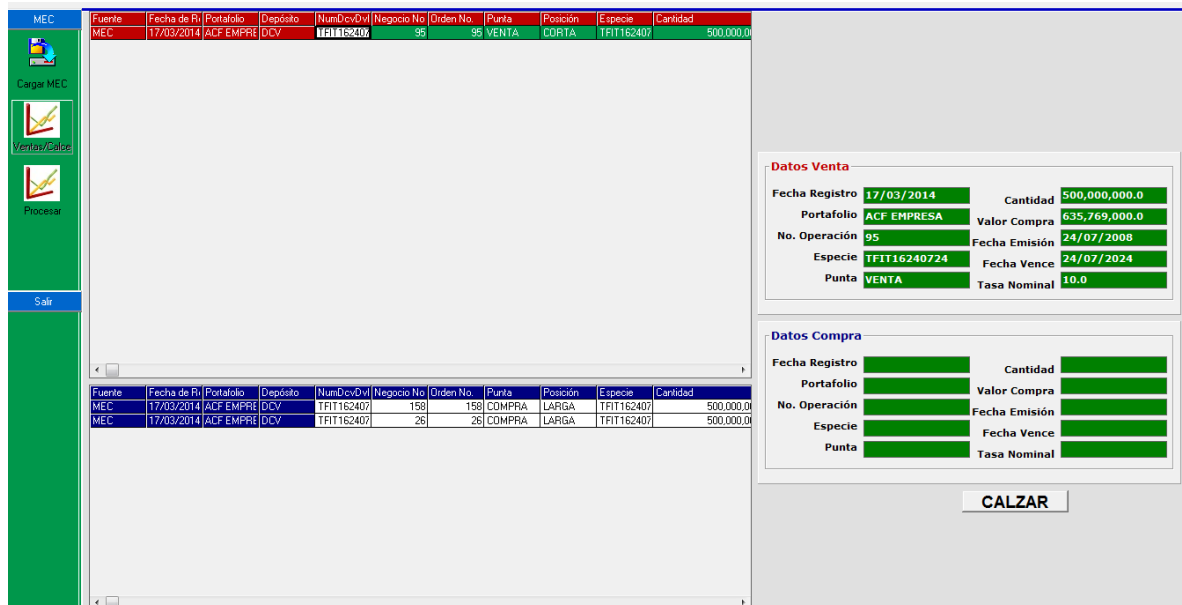
Seleccione el archivo plano a cargar y pulse aceptar. Si se presentan errores en la carga se le habilitará el botón errores que le permite la lista de los mimos para que proceda a corregirlos y repita la carga. Los errores tienen que ver con temas como: Existencia de la Especie, existencia de la Contraparte, 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:



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:



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:

The screenshot shows the main interface of the PWPREI software. On the left is a green sidebar with buttons for 'Cargar MEC', 'Verificar/Calce', 'Procesar', and 'Salir'. The main area contains a table with columns: Fuente, Fecha de R, Portafolio, Depósito, Num/Div/Div, Negocio No, Orden No, Punta, Posición, Especie, and Cantidad. Below the table is a summary panel with two sections: 'Datos Venta' and 'Datos Compra'. Each section lists key transaction details like 'Fecha Registro', 'Cantidad', 'Valor Compra', 'Fecha Emisión', and 'Fecha Vence'. At the bottom right of the interface is a button labeled 'CALZAR'.

Pulse el botón "CALZAR" para registrar el calce.

1. Procesar.

Esta 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:

The screenshot shows a dialog box titled 'Carga de Datos'. It has a text field for 'Archivo (*.txt)' and a date selector for 'Fecha Carga' set to '17/03/2014'. There are three checkboxes: 'Tipo Archivo = Excel' (unchecked), 'Vista' (unchecked), and 'PlanoMercado' (checked). At the bottom, there are several buttons: 'Exportar Vista' (highlighted in yellow), 'Exportar Errores', 'Errores', 'Aceptar' (with a checkmark icon), and 'Cerrar' (with an 'X' icon).

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.

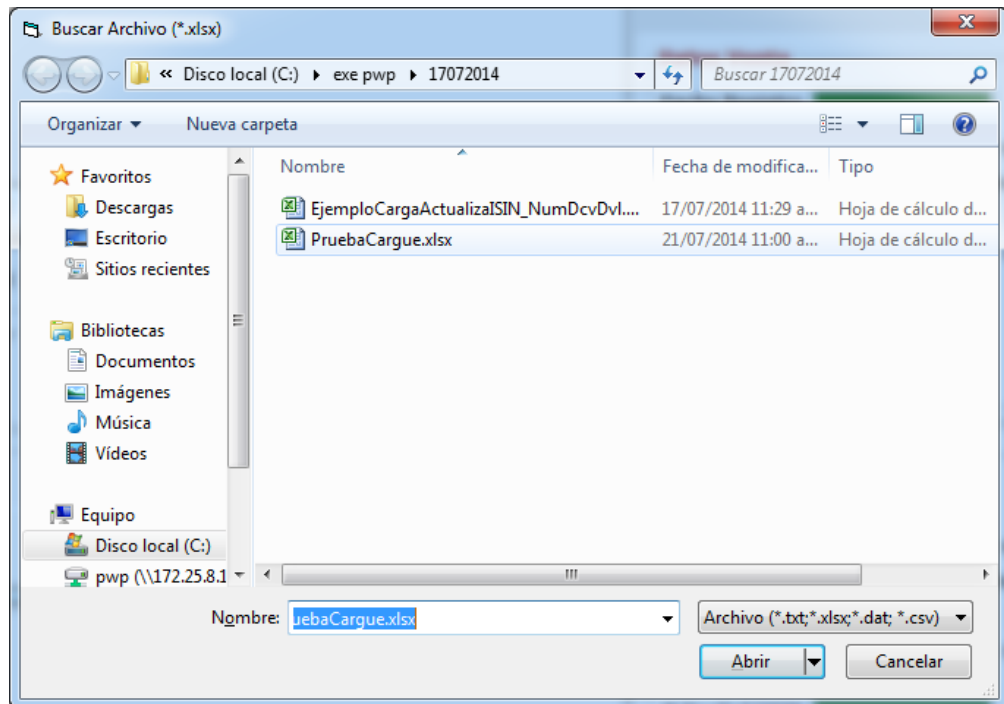
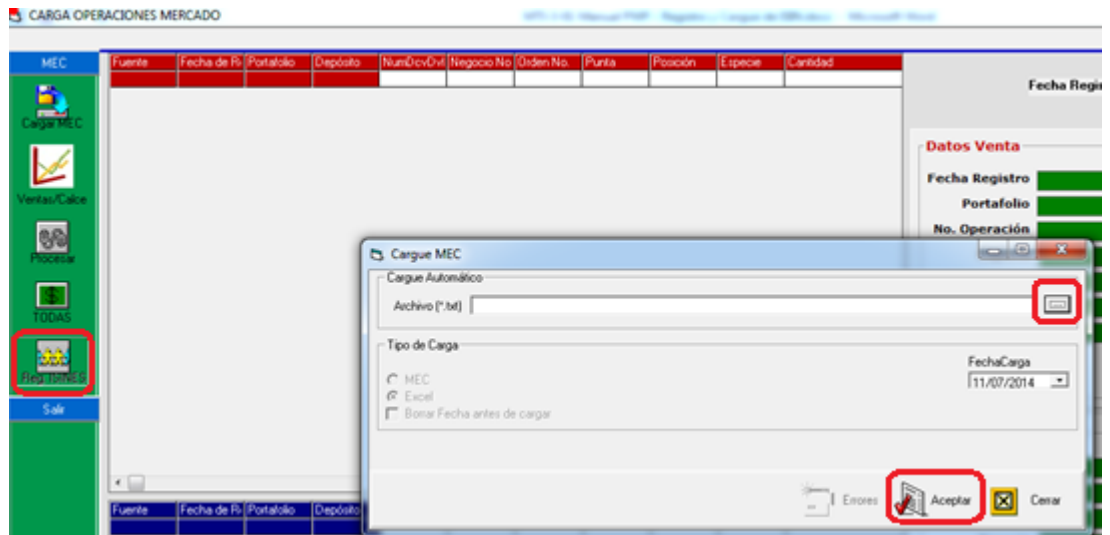
9.1.5. REG ISINES

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:

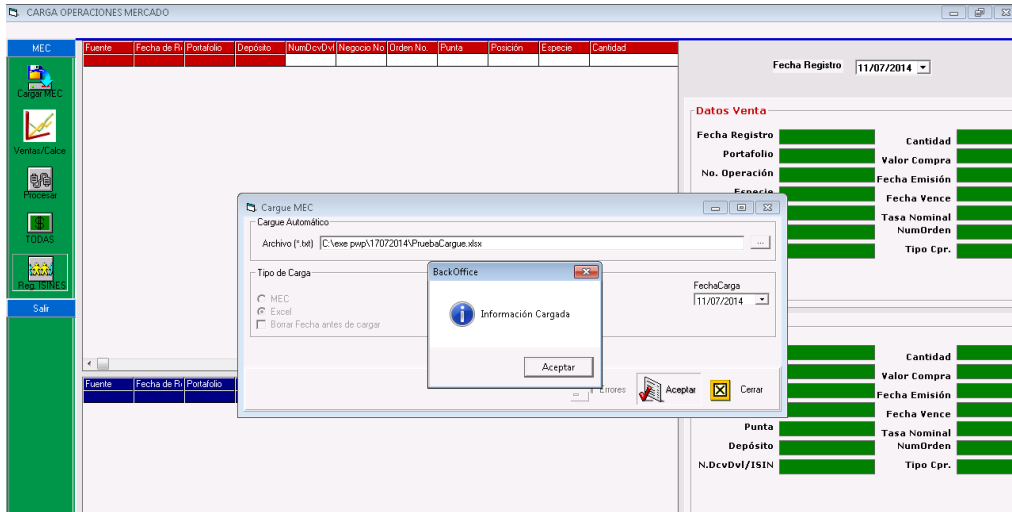
- **Fecha de registro:** Debe indicarse Fecha de Registro actual del sistema o del portafolio donde está la operación.
- **NumOrden (Folio):** Corresponde al número que ha asignado a la operación en el campo NumOrden. Según su esquema operativo puede ser:
 1. Operaciones cargadas de las liquidaciones 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 4	201	DCV	1,000,000, 000.00	TFIT152 40720	XXX	COL58CT02334
15/07/201 4	487	DVL	29,712,000 .00	BPEMINH TA4	SANIT AS	COL92CB61822

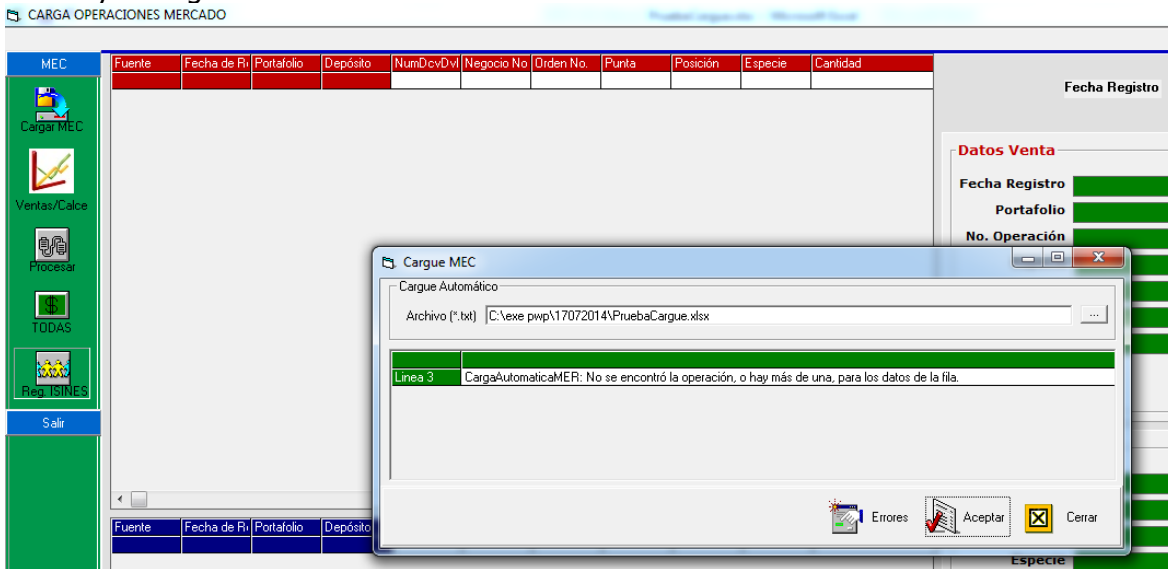
- Para procesar el archivo diríjase al módulo *Carga Operaciones Mercado - carga BOF*, seleccione la opción MEC > Reg. ISINES. Al seleccionar esta opción se habilitará la ventana para seleccionar el archivo para el cargue. Al pulsar Aceptar se procesará el archivo para cargar los ISINES a las inversiones indicadas.



Si la información registrada en el archivo es correcta y corresponde con una inversión del portafolio, se efectuara la descarga:



Si hay errores en la información suministrada el sistema activa el botón Errores, púlselo para revisar y corregir:

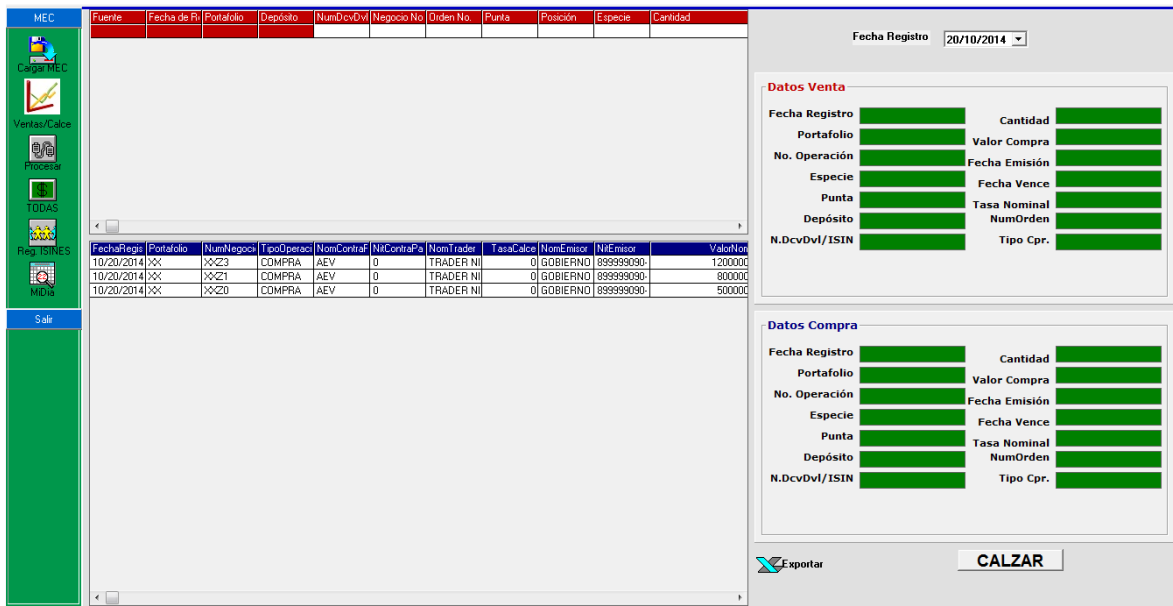


- Para verificar que el proceso haya asignado el ISIN correctamente a cada inversión relacionada en el archivo, simplemente consúltelas:

9.1.6. MI DIA

Seleccione la opción MiDia. Le aparecerá la pantalla como se ve a continuación:

1. En la pantalla "Informe de Operaciones" establezca los parámetros de búsqueda para generar el informe. Marque 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:



- 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:

- Ingrese a "Mercado y Sociedad – Histórico Mercado – Custodios". Aparece una pantalla como la siguiente:

CodigoCustodio	NombreCustodio	NitCustodio
NOCUSTODIO	SIN CUSTODIO	0
PWP	PWP SOFTWARE SAS.	9003380734

- 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:

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:

NumNegocio	EstadoCustodioUI	IncluirComo	FechaRegistro	Portafolio	CodigoCustodio
XX282	CANCELADA	NO INCLUIR	02/02/2015	XX	PwP
XX287	GENERADA	NO INCLUIR	02/02/2015	XX	PwP
YY283	NO CUSTODIO	NO APLICA	02/02/2015	YY	NO CUSTODIO
YY284	NO CUSTODIO	NO APLICA	02/02/2015	YY	NO CUSTODIO
YY285	NO CUSTODIO	NO APLICA	02/02/2015	YY	NO CUSTODIO

NumNegocio	EstadoCustodioUI	IncluirComo	FechaRegistro	Portafolio	CodigoCustodio
XX285	SINGENERAR	GENERADA	02/02/2015	XX	PwP
XX288	SINGENERAR	GENERADA	02/02/2015	XX	PwP

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 transmitió 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.

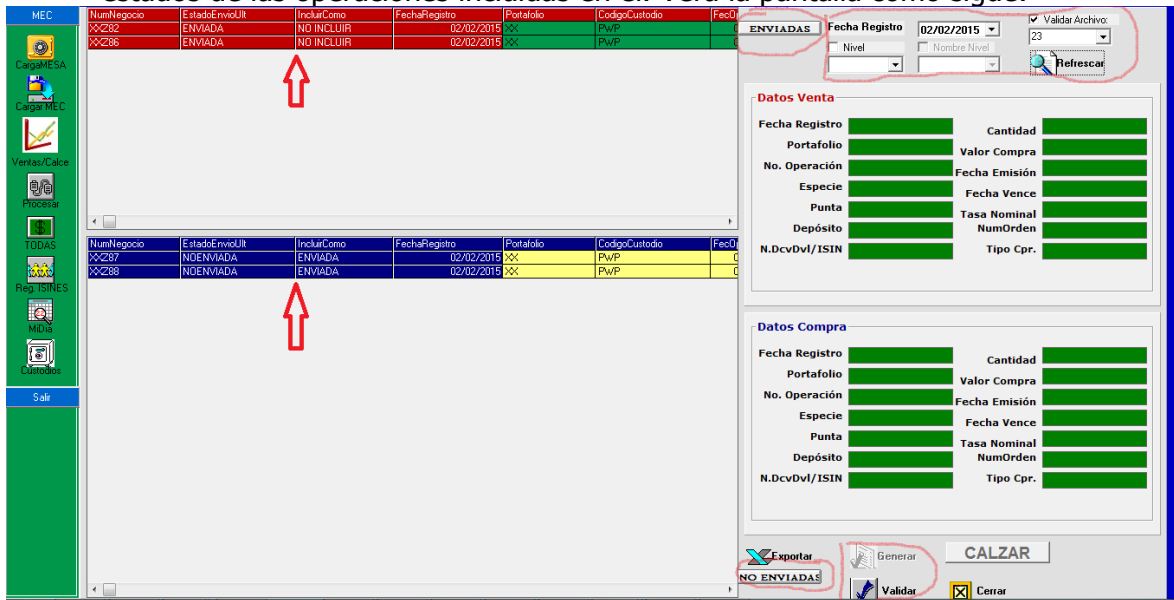
Para la consulta de Estado de ENVIO y Validación de Archivos.

Los archivos generados en el sistema deberán ser transmitidos al custodio efectivamente.

Para mantener un control de sus transmisiones, 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:

1. **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:

Documento Contable - Tabla

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

Registros: 20

Total
 Débitos: 9,646,087,000.00 Créditos: 9,646,087,000.00 Diferencia: 0.00

Exportar Grabar Plano Grabar Tabla Cancelar

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:

Interfaz Contable

Secuencia	SisPro	TipoPUC	Desino	FechaEvento	HoraEvento	Evento	Usuario	Estacion	Fecha
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	PWPREI	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
*									

Parametros Contabilizar Cancelar ..Errores..

- b. El botón Parámetros permite modificar parámetros que se utilizan para armar el archivo de contabilización, como aparece en la figura:

Parametros Contables

Id Compañía 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 Cancelar

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

Contraseña

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

F_NUMERO_REG	F_TIPO_REG	F_SUBTIPO_REG	F_VERSION_REG	F_CIA	F350_ID_CO	F350_ID_TIPO_DC	F350_CONSEC_DI	F351_ID_AUXILIAI	F351
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

Exportar Cancelar

O en archivo plano presionando el botón Ver Archivo Plano

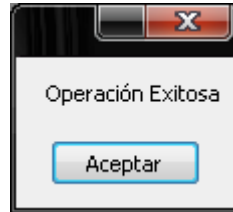
Documento Contable - Archivo Plano

```

<Linea>000000100000001001</Linea>
<Linea>000000203500010010001MPF0000000120100201PwP 0003010Interfaz PwP del dia 20100201
</Linea>
<Linea>000000303510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000001814121644.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000403510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000004886342988.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000503510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000001221894441.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000603510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000001837495010.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000703510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000001215815728.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000803510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000000632438800.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000000903510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+000000632438800.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
</Linea>
<Linea>000001003510002001001MPF000000011301031 0 00101
000000000+00000000000000.0000+0000002446013000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000+00000000000000.0000 000000002: Venta de Titulos
    
```

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:

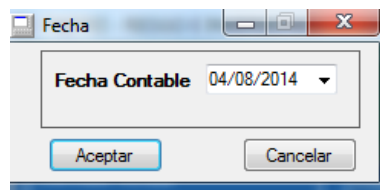


10.1. GENERAR MOVIMIENTOS CONTABLES

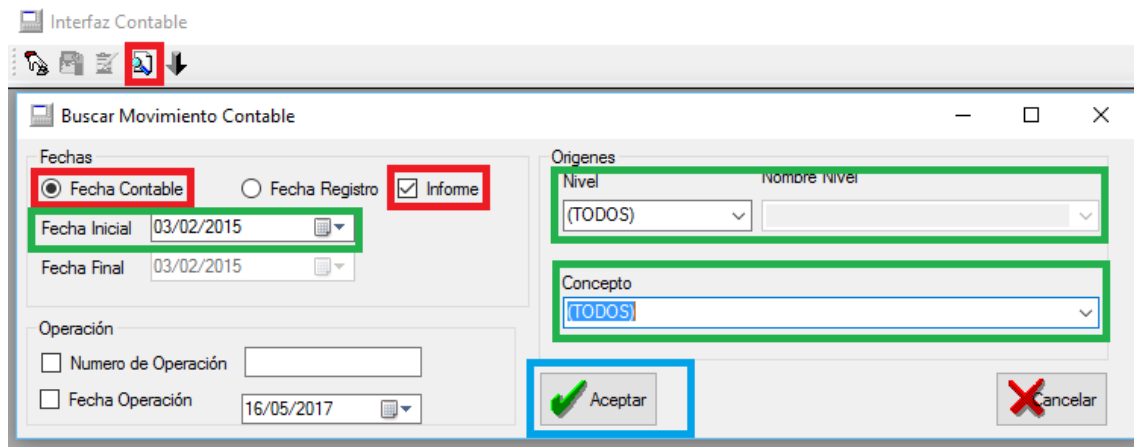
Esta actividad se relaciona con el proceso de Valoración y Contabilización del sistema.

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:



- d. En la ventana de Interfaz contable, seleccione la lupa que permite consultar los movimientos:



- 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 Tt...	151505101001	DEBITO	4700000000
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13552	1: Compra de Tt...	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	7080000000
MAYOBL	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	29: Mayor Valor I...	231506101001	DEBITO	7080000000
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 Tt...	151506101001	DEBITO	7080000000
NEGOCIAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	1: Compra de Tt...	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
VALORAR	03/02/2015	03/02/2015	03/02/2015	CLI13553	15: Causacion V...	512906101001	DEBITO	23744933.99

Registros: 82

Total Débitos: 52,404,577,892.11 Créditos: 52,404,577,892.11 Diferencia: 0.00

Exportar Grabar Plano Grabar Tabla Cancelar

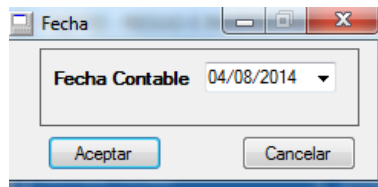
- g. Utilice el botón Exportar para grabar un archivo Excel de los movimientos. El archivo se generará:
 1. Con estructura GENERICA si el parámetro general 8109 no está establecido o su valor es GENERAL.
 2. Con estructura BASICA especial si el parámetro general está establecido en BASICA.
 3. Se grabará 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

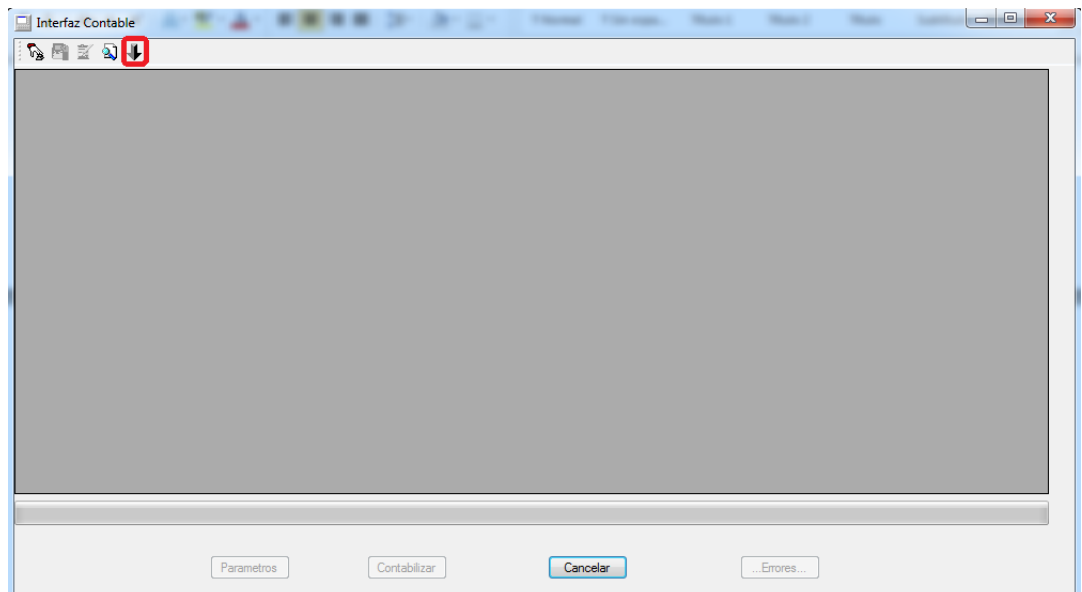
Esta actividad se relaciona con el proceso de Valoración y Contabilización del sistema.

Para consultar los vencimientos y efectuar el recaudo de los mismos en PWPREI. Debe efectuar los siguientes pasos:

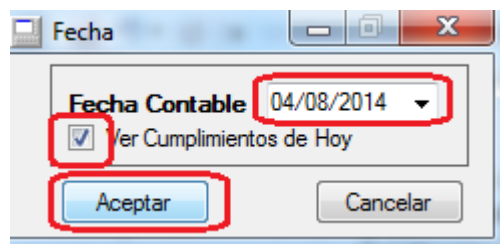
- a. Ingrese a PWPREI.
- b. Previamente se han verificado los vencimientos de rendimientos y capital que están programados para la fecha de proceso del sistema. Puede usar el Informe de Flujos Futuros para el efecto.
- c. Ingrese al módulo Contabilizar. Se presentará la Fecha de Registro o de Proceso actual en que encuentra del sistema:



- d. En la ventana de Interfaz contable, seleccione la flecha indicada en la siguiente imagen:



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	Fec
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	130411101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	168700105011	07	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	817415101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	830500101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	111005101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	168700105001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	130411101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	168700105011	07	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	817415101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	830500101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	168700105001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	111005101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	130411101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	168700105011	07	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	817415101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/08/2014
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	830500101001	01	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	111005101001	01	DEBITO	9150000	CUMPLIDO	04/08/2014
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	410805101001	01	CREDITO	8333.4	CUMPLIDO	04/08/2014

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:


Cumplir Vencimiento

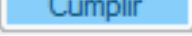
Fecha Cumplido: 04/08/2014 | NumNegocio: ACC10667 | Descripción: 18: Cobro de Rendimientos Financieros | Valor: 16,914,720.00 | Diferencia: 0.00 | ContraValor: 16,914,720.00 | Fecha Recaudo: 04/08/2014


CUMPLIDO

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 cumplimiento se actualizará la vista de cumplimientos, cambiando el estado del cumplimiento de la inversión que fue procesada:

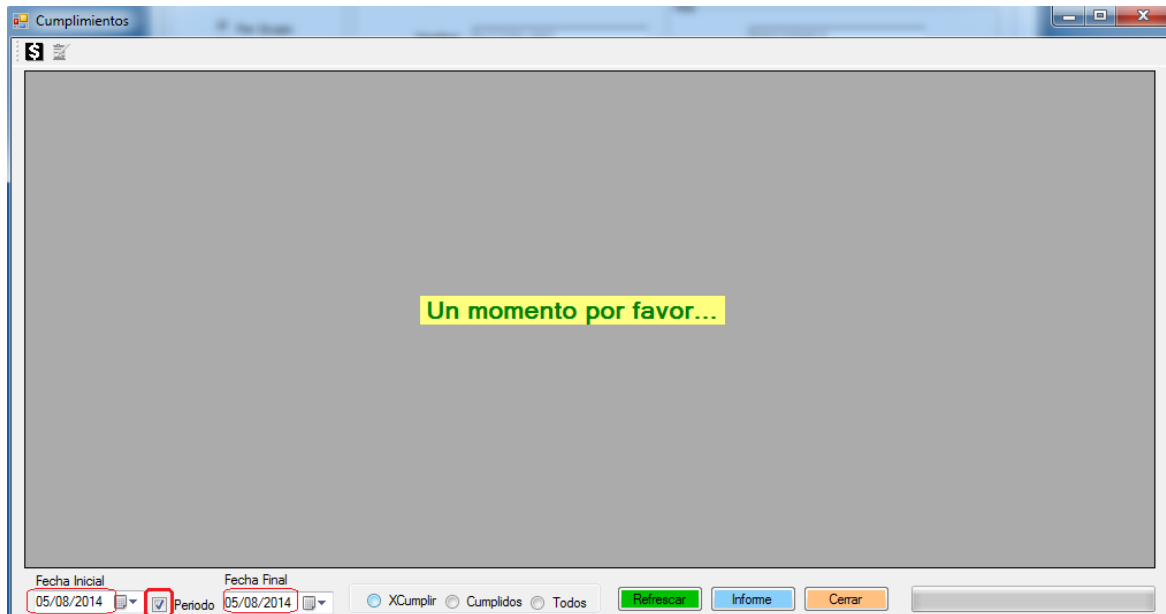
Cumplimientos

Evento	FechaCumple	NumNegocio	Descripcion	PUCBas	Sufijo	Movimiento	Valor	EstadoCum	Fec
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	130411101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	168700105011	07	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	817415101001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	830500101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	111005101001	01	DEBITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	18: Cobro de Re...	168700105001	01	CREDITO	16914720	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	130411101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	168700105011	07	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	817415101001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	830500101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	168700105001	01	CREDITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10667	19: Cobro de Cap...	111005101001	01	DEBITO	786000000	CUMPLIDO	03/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	130411101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	168700105011	07	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	817415101001	01	CREDITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/14
VALORAR	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	830500101001	01	DEBITO	9141666.6	CUMPLIDO	04/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	111005101001	01	DEBITO	9150000	CUMPLIDO	04/14
RECAUDO	04/08/2014	ACC10858	18: Cobro de Re...	410805101001	01	CREDITO	8333.4	CUMPLIDO	04/14

Fecha Cumplimiento: 04/08/2014 | Período: | XCumplir Cumplidos Todos

Quando 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.



10.3. NOTA OPERATIVA- DIFERENCIA EN CAMBIO TITULOS

A continuación se describe como incluir la Diferencia en Cambio en los cálculos PWPREI.

1. **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".
2. **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:

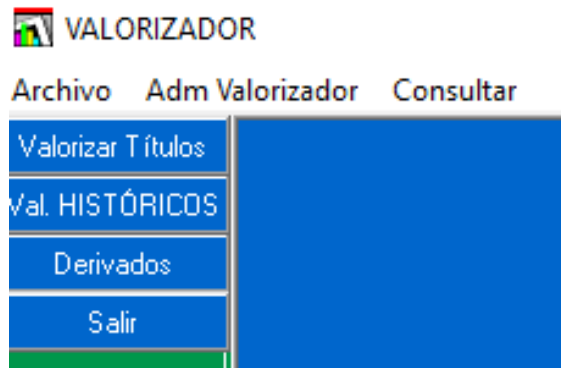
- i. Deje los parámetros que ya tiene para mover la causación total.
- ii. Agregue los parámetros para mover la diferencia en cambio, de forma que esta sume (o reste) en la cuenta del título. Utilice para ello los siguientes valores fuente, en el evento VALORAR:
 - DCAMNETAPOS: Para mover la diferencia 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:



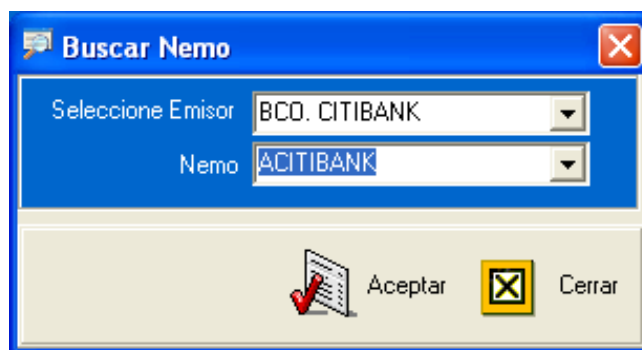
11.1. OPCIÓN VALORIZAR TITULOS

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:

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

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:

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:

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 Nemo, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir si 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 Nemo, la Fecha de Valoración, de Liquidación o Cumplimiento, de Emisión y Vencimiento, el Tipo de Título (es decir si 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:

11.1.7. 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:

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.

PORTAFOLIO 06/01/2009

Nombre: PROFESIONALES
 Tipo: GEN
 Línea de Negocio: CLIENTES PEOPLE

Especie	Depósito	Número
BPEMINHTA4	DCV	10
CDTBBO10D	DCV	1
CDTBBO10D	DCV	2
CDTBGA10D	DCV	7
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0
OPCFTRM	DCV	0

Escoja el Tipo de Valoración:
 Precios de Mercado
 Tasa de Referencia del Título
 Índice Asociado al Título
 Curva
 Tasa Alterna
 Índice Alterno
 Tasa Dada
 Tasa de Compra
 Precios PWPNOW

Calcular Utilidad Portafolio: SI NO

Saldo Caja Inicial: 0 Saldo Caja Final: 0

Contabilizar No Contabilizar

Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio Por Especie

Fec Valorización: 06/01/2009 Fec Liquidación: 06/01/2009

Liquidar compromisos a: Fecha Liquidación Fecha Compromisos

Precio Compra: SI NO Valora Mdo.

Interfaz Aceptar Cerrar

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:

$$\text{MarIni} = (((\text{TasaCompra} + 1) / (1 + \text{TasaRefCom})) - 1) * 100$$

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:

$$\text{TasaRepreciada} = (((1 + \text{TasaRefVal}) * (1 + \text{MarIni})) - 1) * 100$$

Donde:

- *TasaRefVal = valor de la tasa de referencia (DTF, IPC, etc) en la fecha de valoración.*

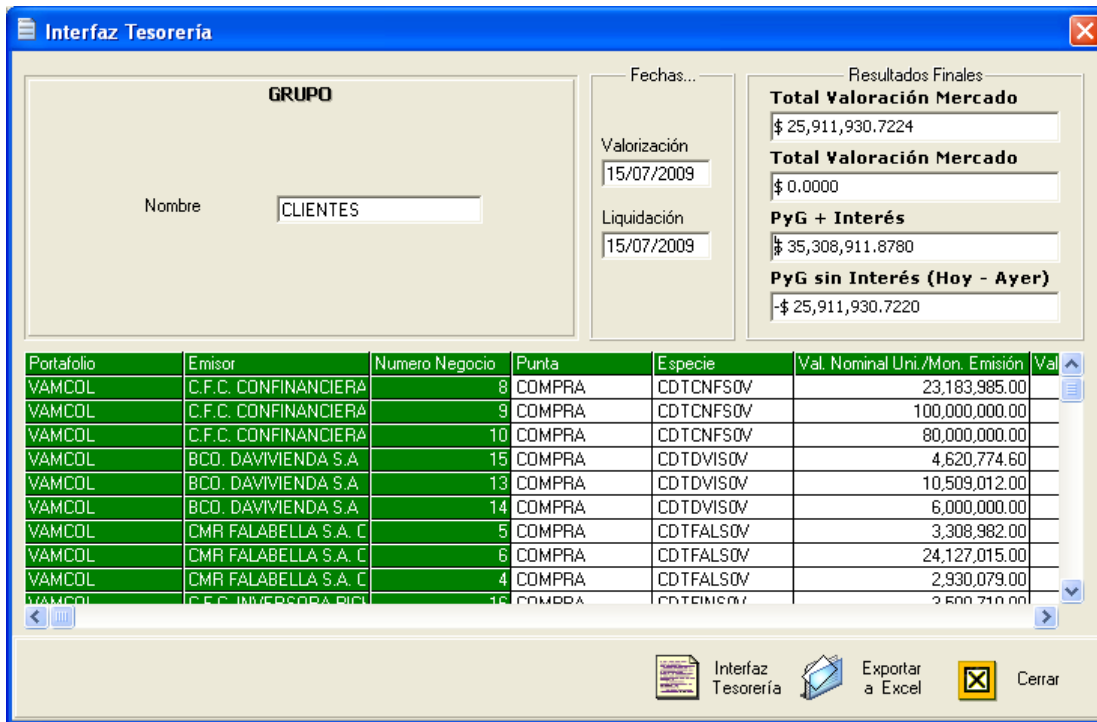
- *TasaRepreciada=tasa de compra actualizada en la fecha de valoración, con el nuevo valor de la tasa referencia.*

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**

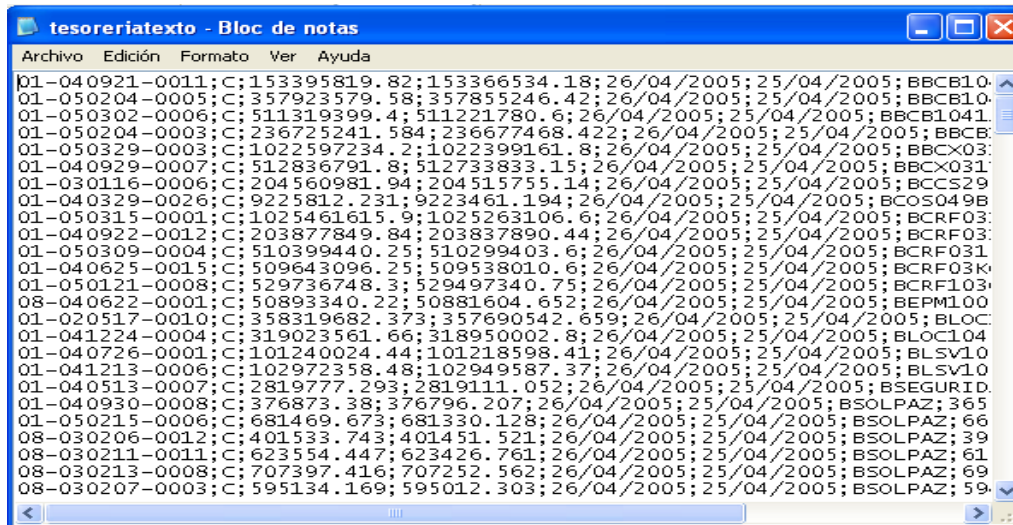
Con esta opción se emite información para ser cargada por tesorería.



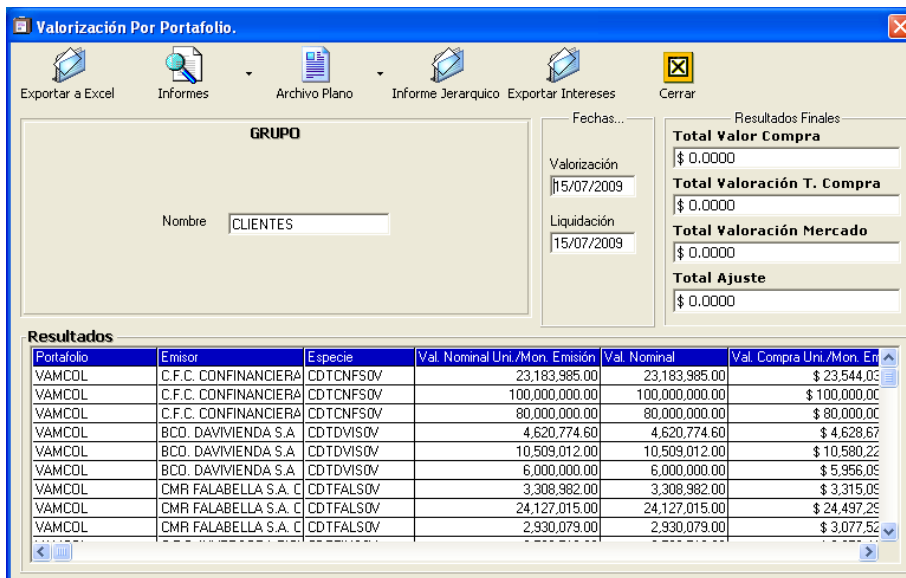
Cuando oprima el botón Interfaz Tesorería, el sistema le mostrará la siguiente pantalla.



Puede escoger la opción texto o en formato Excel, de acuerdo a su elección el sistema genera un archivo como el siguiente.



Una vez se hayan ingresado los datos, aparece la siguiente pantalla de resultados:



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:**



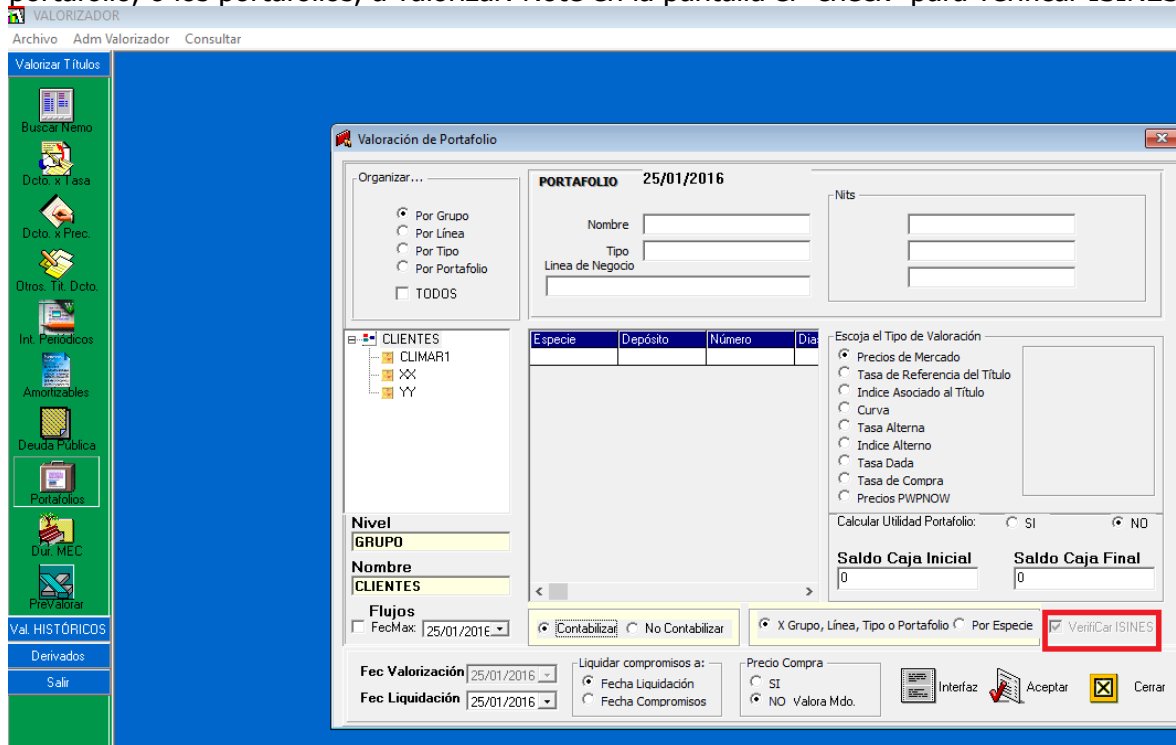
Con esta opción genere el archivo plano, para envío de información.

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.

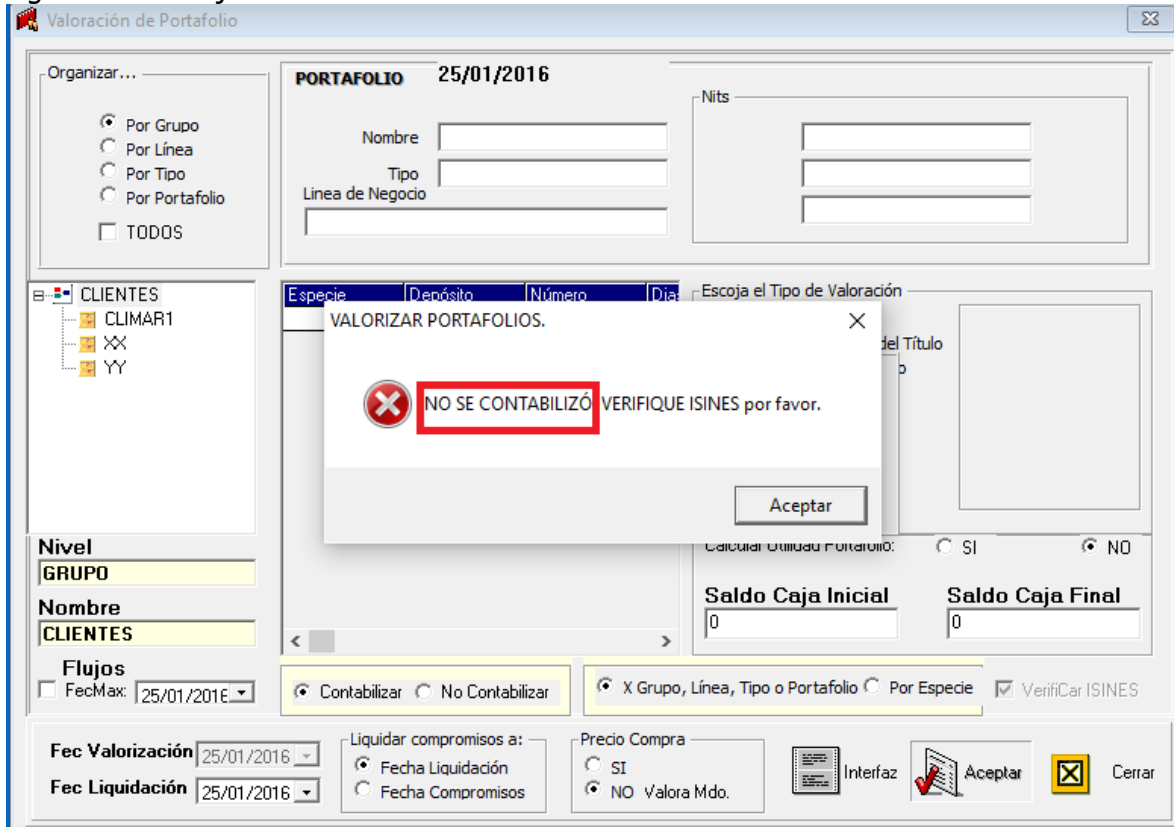
Ingrese por "Valorizador – Títulos" . Pulse "Portafolios", seleccione la fecha y elija el portafolio, o los portafolios, a valorizar. Note en la pantalla el "check" para verificar ISINES:



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:



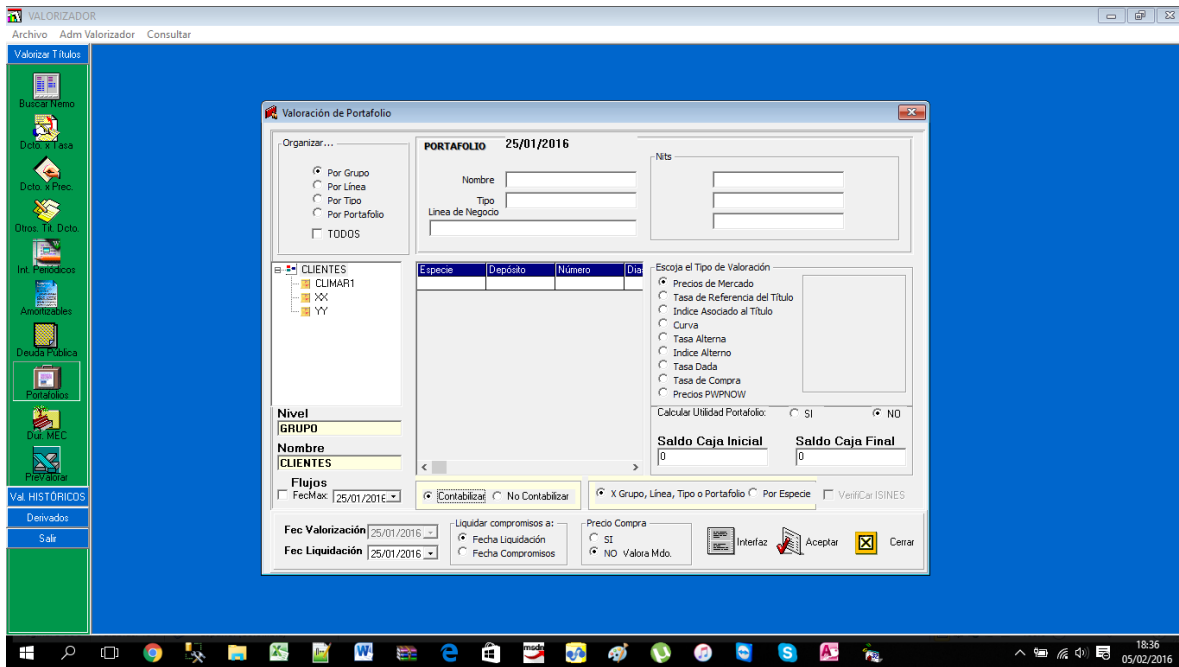
EL proceso de valoración se interrumpe y no pasa a la fase de contabilizar. En seguida le aparece la pantalla de resultados como siempre, pero en la grilla del centro se le muestra la lista de operaciones con problemas de ISIN:

Corrija o registre los ISINES correspondientes y vuelva a valorar.

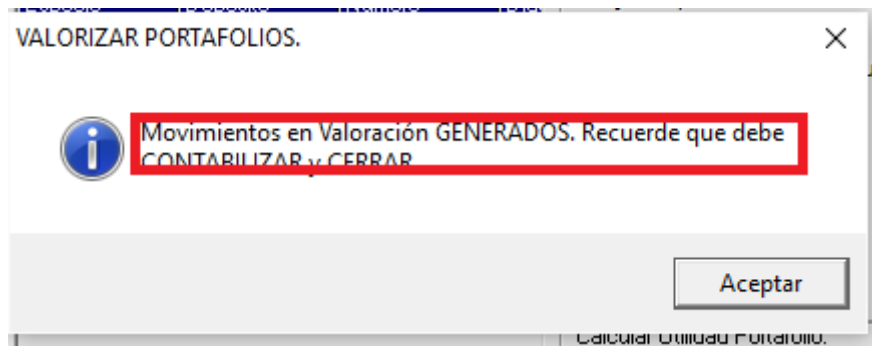
8. Contabilizar sin Verificar ISINES.

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:



Valore como siempre. Si no hay errores de otro tipo la aparece el mensaje de simple:

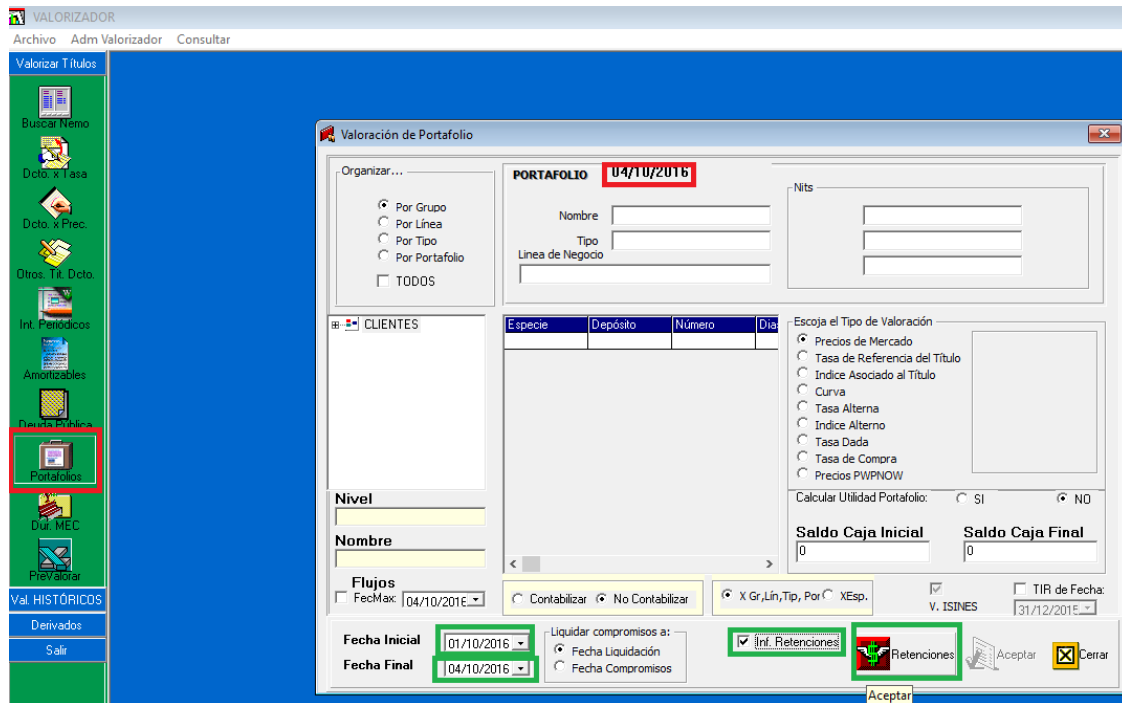


11.1.8.1. NOTAS OPERATIVAS RETENCIONES

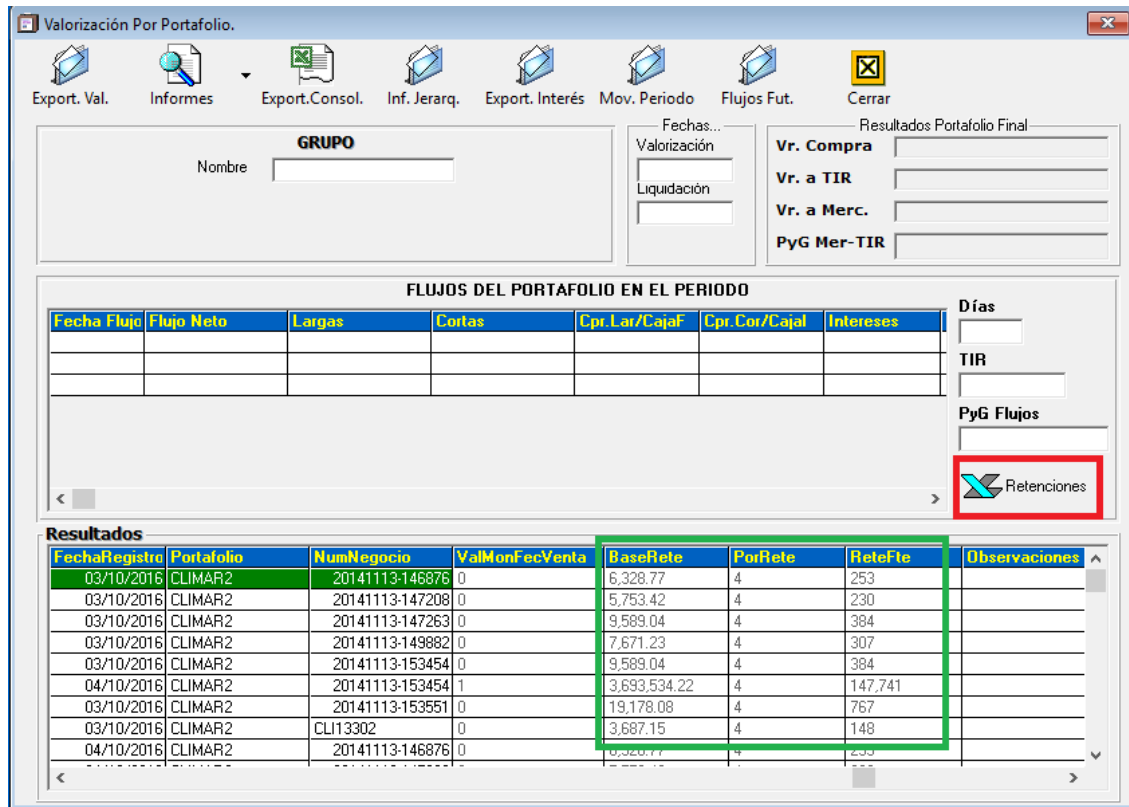
Este apartado se refiere exclusivamente a las retenciones aplicadas al interior de la compañía sobre los rendimientos financieros de papeles de Rf. No hace referencia a las que se apliquen directamente en el sistema de negociación.

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:

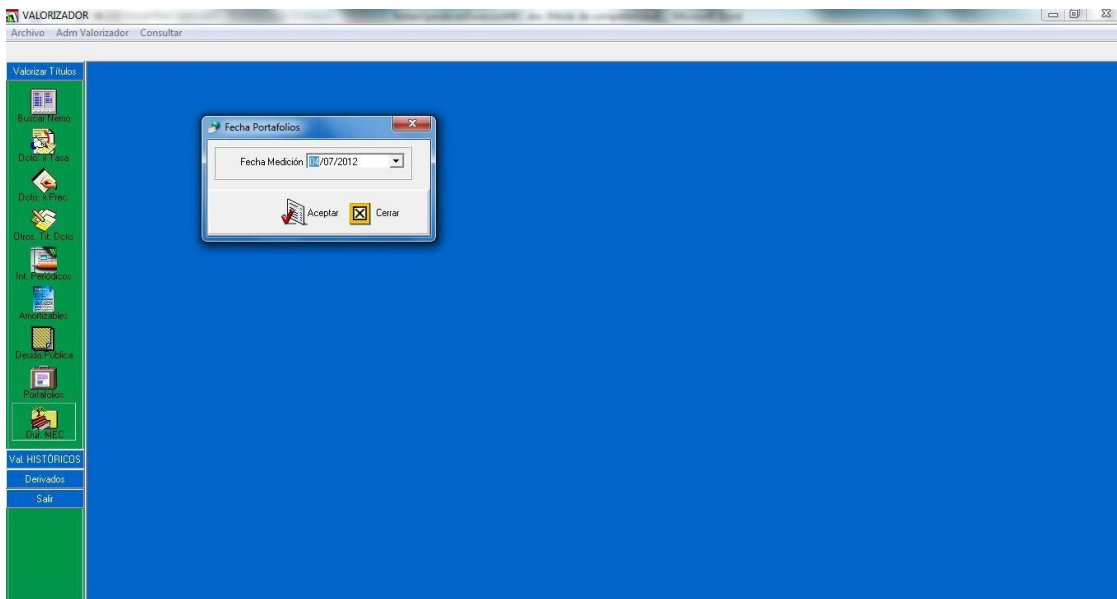


Seleccione el portafolio o conjunto de portafolios, establezca las fechas inicial y final. Pulse el botón "Retenciones" y al terminar el proceso le aparece la pantalla de resultados:



Utilice el botón "Retenciones" para exportar los resultados a Excel.

11.1.9. VALORIZAR DURACION MEC



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

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio

PRUEBA 513

- CARLOS

Nivel

PORTAFOLIO

Nombre

CARLOS

Flujos

FecMax: 04/07/2012

PORTAFOLIO 04/07/2012

Nombre: CARLOS

Tipo: GNA

Línea de Negocio: PRUEB JOSE NIVE

Nits: 5555555555555555

Especie	Depósito	Número	Día
ECCPETROL	DVL	0	
TFIT16240724	DVL	0	
TFIT16240724	DVL	0	
TFIT16240724	DVL	0	

Escoja el Tipo de Valoración

- Precios de Mercado
- Tasa de Referencia del Título
- Índice Asociado al Título
- Curva
- Tasa Alternativa
- Índice Alternativo
- Tasa Dada
- Tasa de Compra
- Precios PWPNOW

Calcular Utilidad Portafolio: SI NO

Saldo Caja Inicial: 0

Saldo Caja Final: 0

Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio Por Especie

Fec Valoración: 04/07/2012

Fec Liquidación: 04/07/2012

Liquidar compromisos a:

- Fecha Liquidación
- Fecha Compromisos

Precio Compra

- SI
- NO Valora Mdo.

Interfaz Aceptar Cerrar

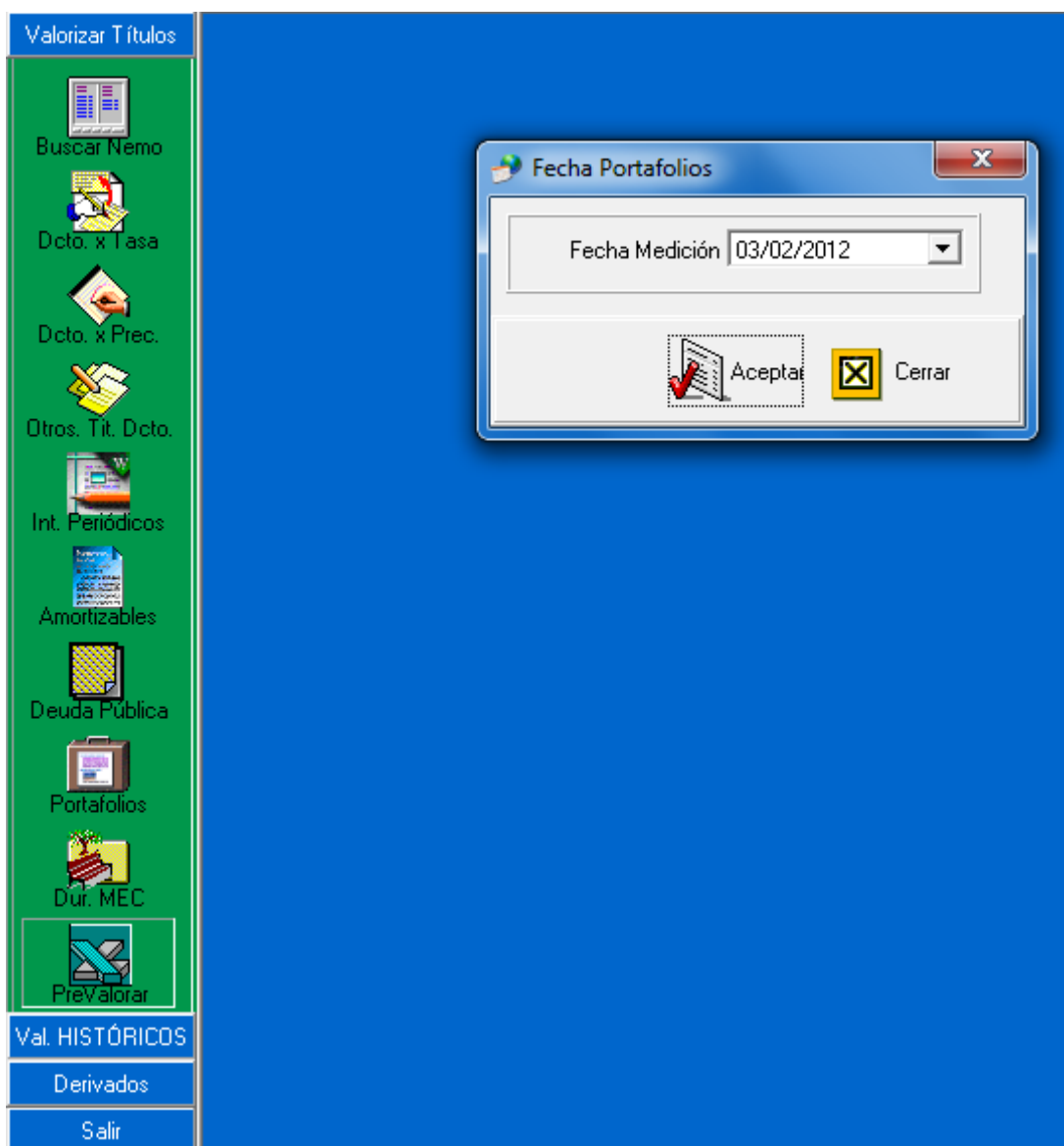
Pulse "Aceptar". Le aparecerán los resultados: En la grilla del centro de la pantalla lo correspondiente a la Duración MEC y abajo la valoración corriente:

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:

Valoración de Portafolio

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO 03/02/2012

Nombre:
 Tipo:
 Línea de Negocio:

Nits:

Escoja el Tipo de Valoración
 Precios de Mercado
 Tasa de Referencia del Título
 Índice Asociado al Título
 Curva
 Tasa Alternativa
 Índice Alternativo
 Tasa Dada
 Tasa de Compra
 Precios PWPNOW

Calcular Utilidad Portafolio: SI NO

Saldo Caja Inicial: Saldo Caja Final:

Contabilizar No Contabilizar

Por Grupo, Línea, Tipo o Portafolio Por Especie

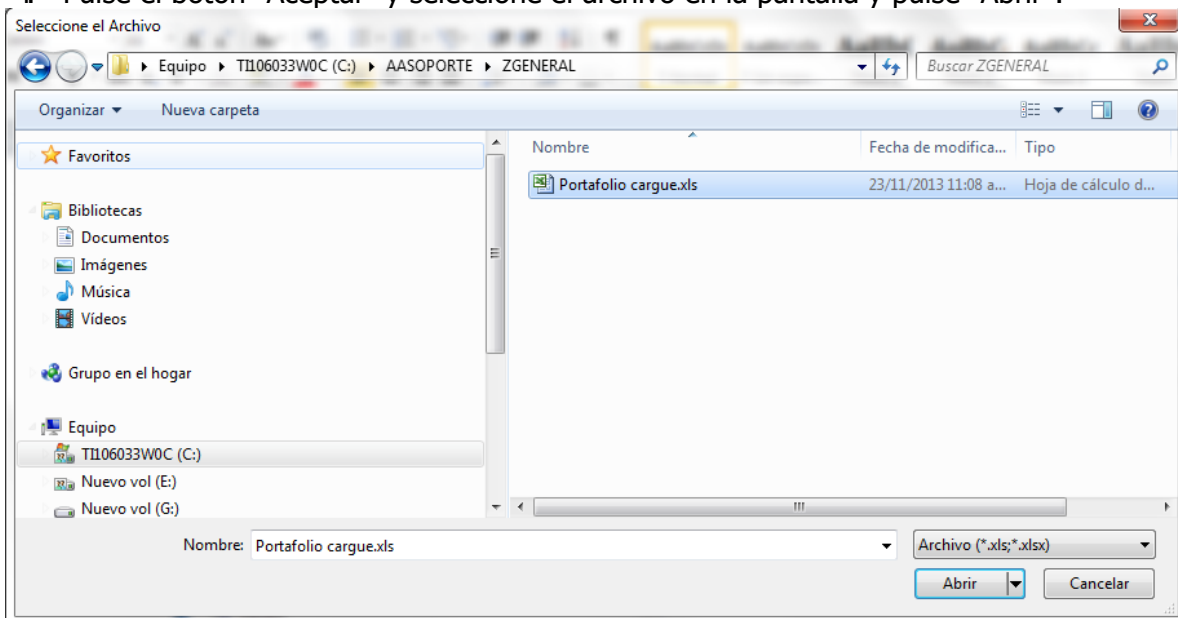
Fec Valorización: 03/02/2012
 Fec Liquidación: 03/02/2012

Liquidar compromisos a:
 Fecha Liquidación
 Fecha Compromisos

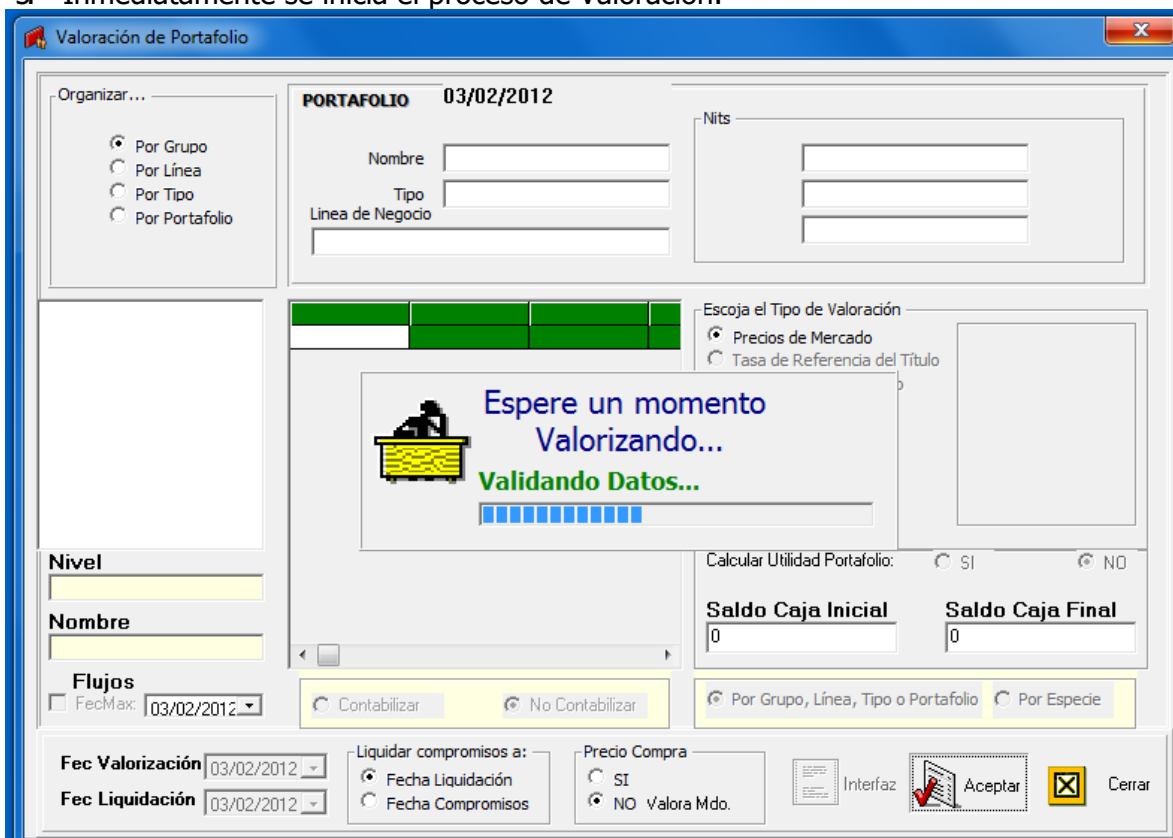
Precio Compra:
 SI
 NO Valora Mdo.

Interfaz Aceptar Cerrar

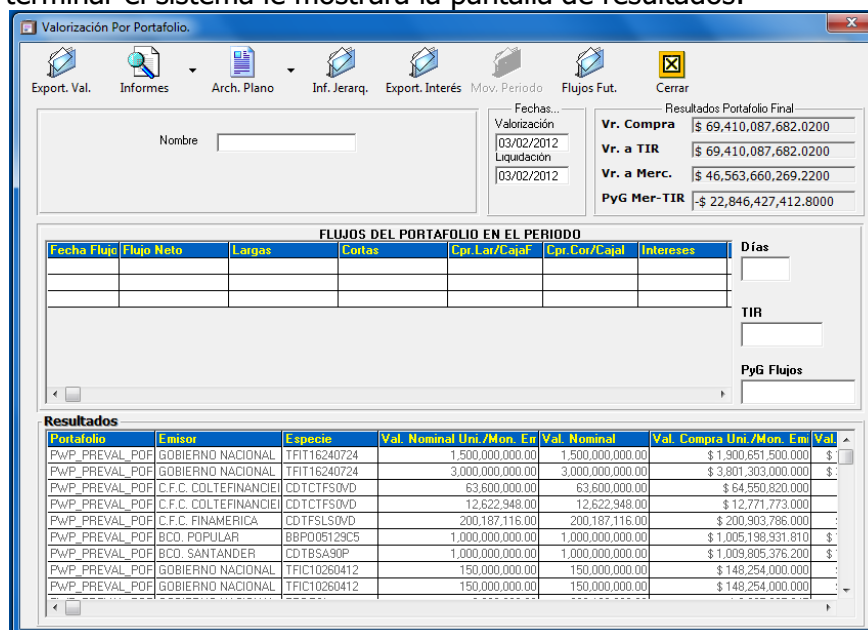
4. Pulse el botón "Aceptar" y seleccione el archivo en la pantalla y pulse "Abrir":



5. Inmediatamente se inicia el proceso de Valoración:



6. Al terminar el sistema le mostrará la pantalla de resultados:

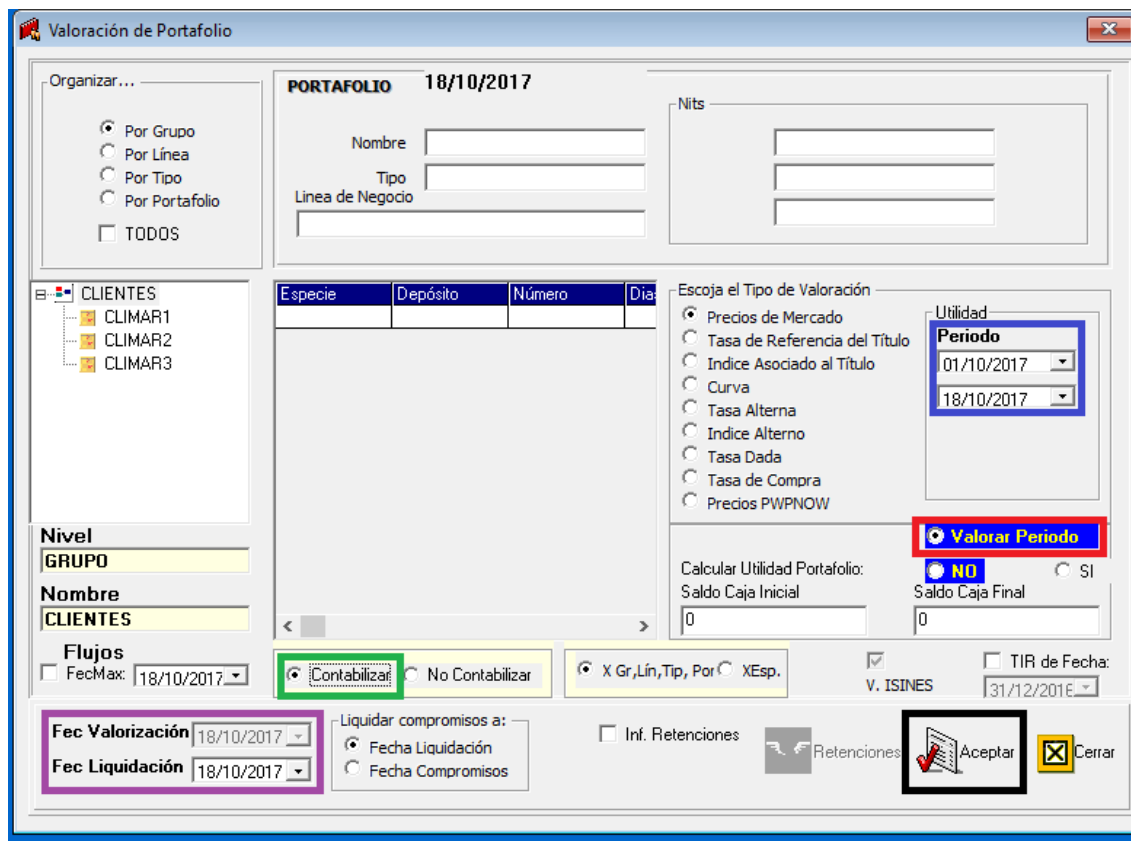


7. Revise la columna "Observaciones" en la grilla de resultados de la parte inferior para verificar que todas las posiciones hayan sido valoradas. En caso de presentarse error en alguna posición, le aparecerá un mensaje en esta columna indicándole el tipo de problema presentado; corríjalo en el Excel 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:



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:

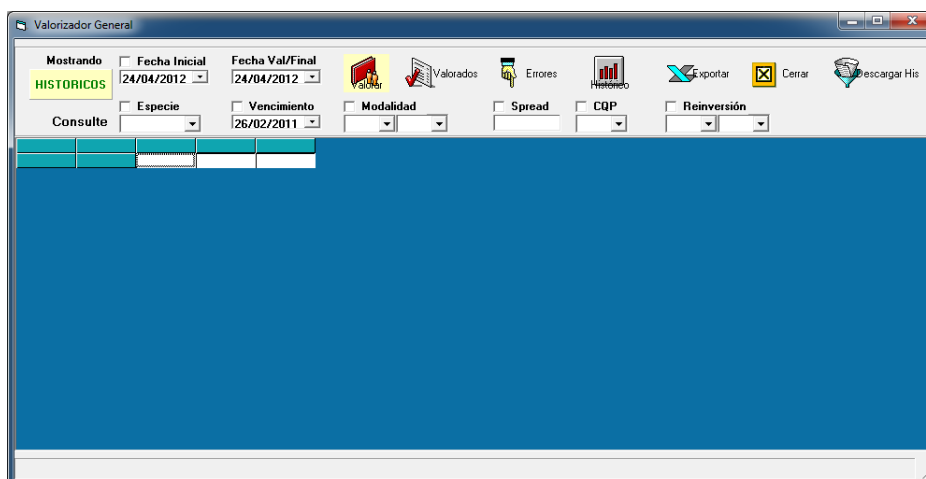
- a. Puede usar el botón "Errores" para exportar los resultados.

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

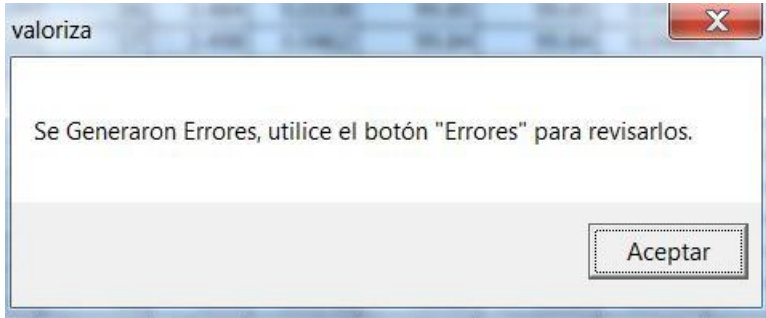


Si en la Fecha de Registro actual hay datos de valoración histórica la grilla de datos aparecerá llena con las especies valoradas exitosamente en esa fecha, de lo contrario aparece vacía como se ve en la figura anterior. Normalmente usted ingresará cada día y pulsará "Valorar" para hacer la valoración del día, la primera vez que ingrese ese día.

1. La pantalla está dividida 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”.
 - ii. Históricos. Estos datos se despliegan cuando usted consulta, mediante el botón “Históricos”.
 - iii. 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.
 - iii. 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.
 - iv. 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.
 - vii. 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.
 - viii. 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:
- i. 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:



Los resultados de las especies valoradas se muestran en la pantalla como se ve en la figura:

FechaRegistr	Especie	Tasaref	Spread	DiasVcto	Tasa	Margen	Precio	PreLimpio	Duracion	Modalidad	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	C
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	C
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	C
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	3.523	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	C
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	C
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	C
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	C
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	C
2011/02/27	ABANCAFE	FS	0.00	19	3.523	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	C
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	C
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	C
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	C
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	C
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	3.523	-0.0567	99.83	99.83	0.0521	PV	1.00	CRCDT - MV	2011/02/27	2011/03/18	C

- ii. Valorados. Muestra las especies correctamente valoradas. Utilícelo después de haber usado el botón "Errores", para volver a los resultados de la valoración.
- iii. Errores. Carga en pantalla las especies con error. Muévase hacia la derecha para ver en el campo "Observaciones" los errores presentados por cada

especie no valorada. La figura siguiente muestra estos resultados.

The screenshot shows the 'Valorizador General' application window. The interface includes a menu bar with options like 'Valorar', 'Valorados', 'Errores', 'Histórico', 'Exportar', and 'Cerrar'. Below the menu, there are filters for 'Mostrando' (set to 'ERRORES'), 'Fecha Inicial' (27/02/2011), 'Fecha Val/Final' (27/02/2011), 'Especie', 'Vencimiento' (26/02/2011), 'Modalidad', 'Spread', 'CQP', and 'Reinversión'. The main area contains a table with the following columns: Modalidad, ValMon, TipoVal, FechaEmisio, FechaVencin, Cqp, Calendar, Monec, Fuente, Vigent, Estado, Observaciones, GruMo, and Gru. The table lists various financial instruments, many of which have an 'ERROR' status and an observation message: '-8128: Modalidad de pago incorrecta..'. The status bar at the bottom indicates 'Registros: 12,051'.

Modalidad	ValMon	TipoVal	FechaEmisio	FechaVencin	Cqp	Calendar	Monec	Fuente	Vigent	Estado	Observaciones	GruMo	Gru
TV	0.00		2010/04/29	2014/04/29	C	N	COP	M	S	ERROR	8821: La especie no tiene definida la Formula de Calo	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/03	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/04	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/05	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/14	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/15	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/16	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/17	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/18	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/19	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/20	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/21	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/03	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/04	C	N	COP	M	S	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/05	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/06	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/07	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/08	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	
NO	0.00		2011/02/27	2011/03/09	C	N	COP	M	N	ERROR	-8128: Modalidad de pago incorrecta..	1	

- iv. Históricos. 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

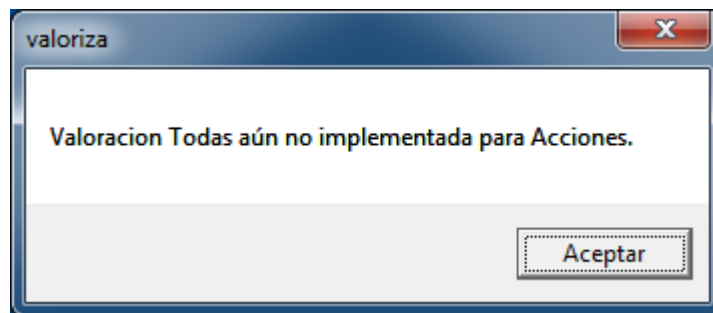
FechaRegistr	Especie	Tasaref	Spread	DiasVcto	Tasa	Margen	Precio	PreLimpio	Duracion	Modalidad	ValMon	TipoVal	FechaEmisio	FechaVencin	Cqp
2011/02/27	TFIT15240720	FS	11.00	3432	8.327	0.00	123.43	116.86	6.2177	AV	1.00	PRECIO INFC	2005/07/24	2020/07/24	C
2011/02/26	TFIT15240720	FS	11.00	3433	8.327	0.00	123.40	116.86	6.2204	AV	1.00	PRECIO INFC	2005/07/24	2020/07/24	C
2011/02/25	TFIT15240720	FS	11.00	3434	8.328	0.00	123.37	116.86	6.2232	AV	1.00	PRECIO INFC	2005/07/24	2020/07/24	C
2011/02/24	TFIT15240720	FS	11.00	3435	8.3717	0.00	123.035	116.5555	6.2213	AV	1.00	PRECIO INFC	2005/07/24	2020/07/24	C
2011/02/23	TFIT15240720	FS	11.00	3436	8.3144	0.00	123.414	116.9647	6.23	AV	1.00	PRECIO INFC	2005/07/24	2020/07/24	C
2011/02/22	TFIT15240720	FS	11.00	3437	8.3386	0.00	123.215	116.7958	6.2303	AV	1.00	PRECIO INFC	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 INFC	2005/07/24	2020/07/24	C

- 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.
 - ii. Que su equipo tenga suficiente memoria disponible, algo así como 1 Gb. Para ello cierre las demás aplicaciones.
 - iii. 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



11.3. OPCIÓN DERIVADOS



11.3.1. VALORIZAR OPCIONES

Valorizar Opciones

Opción de COMPRA Activar

Especie Curva TLR Curva T. Foránea Matriz Volatilidades Cantidad/Nominal

0.00

Datos		Valoración	
Valorización	Vencimiento	Base Opc.	Base Val
07/03/2019	07/03/2019	365	365
Spot (Hoy)	0.00	Prima X Unidad	0.000000
Strike (Pactado)	0.00	Delta	0.000000
Días Vcto.	0	Gamma	0.000000
Volatilidad	50.00	Theta	0.000000
Tasa Libre Riesgo	0.00	Vega	0.000000
Divid/Cuón Intern.	0.00	Rho	0.000000

RESULTADOS

	Call	Put
Prima X Unidad	0.000000	0.000000
Delta	0.000000	0.000000
Gamma	0.000000	0.000000
Theta	0.000000	0.000000
Vega	0.000000	0.000000
Rho	0.000000	0.000000

Aceptar Cerrar
 \$Prima 0.00 0.00

11.3.2. VALORIZAR LOS DERIVADOS / TEORICO

Valorizar DERIVADOS - Contrato y Entregables

Información General

Emisor Contrato Valorización Liquidación Emisión Vencimiento

15/07/2009 15/07/2009 15/07/2009 15/07/2009

Días al Vcto. 360 Días 0

365 Días 0

Cantidad de Contratos

Valoración Subvacentes Definición

Datos Valoración Contrato

Nominal Neto

Valor a Precio Mercado 0.00

Precio de Mercado Tasa Mercado 0.00 0.0

Valoración Entregables

Aceptar Cerrar Exportar a Excel

INFORME DE FLUJOS FUTUROS O VENCIMIENTOS

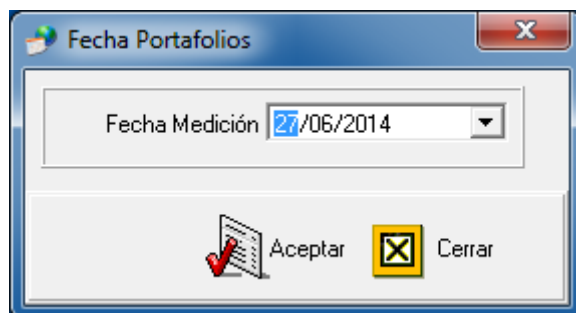
2. DESCRIPCION DEL PROCESO

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)

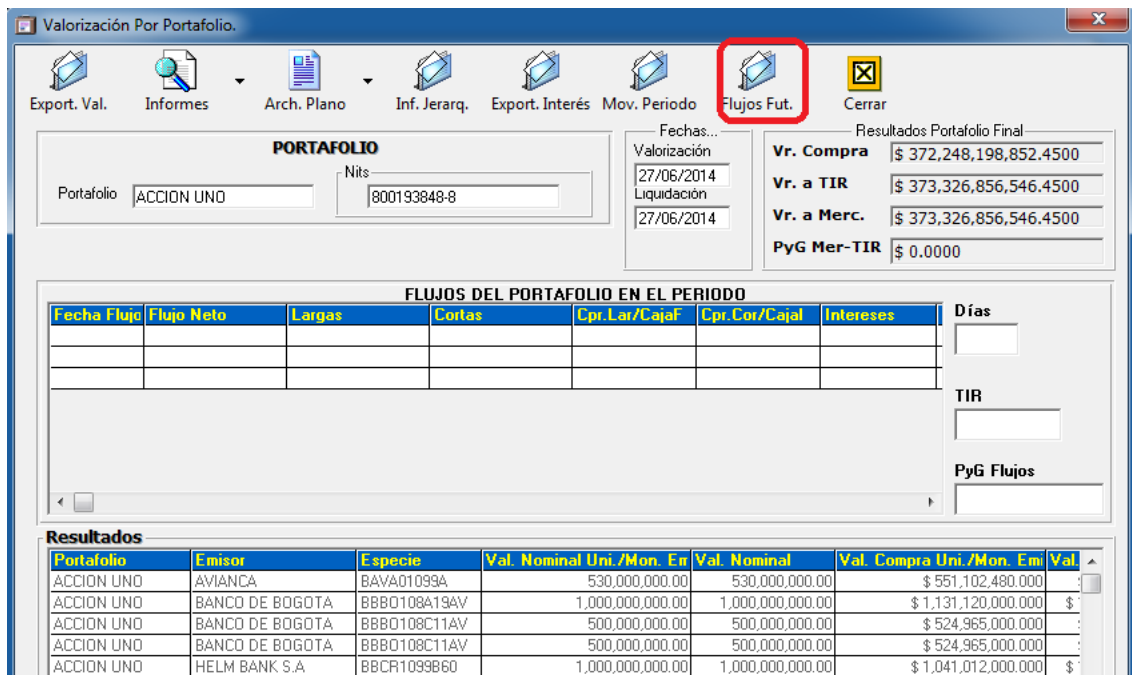
3. FUNCIONALIDAD

- 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:

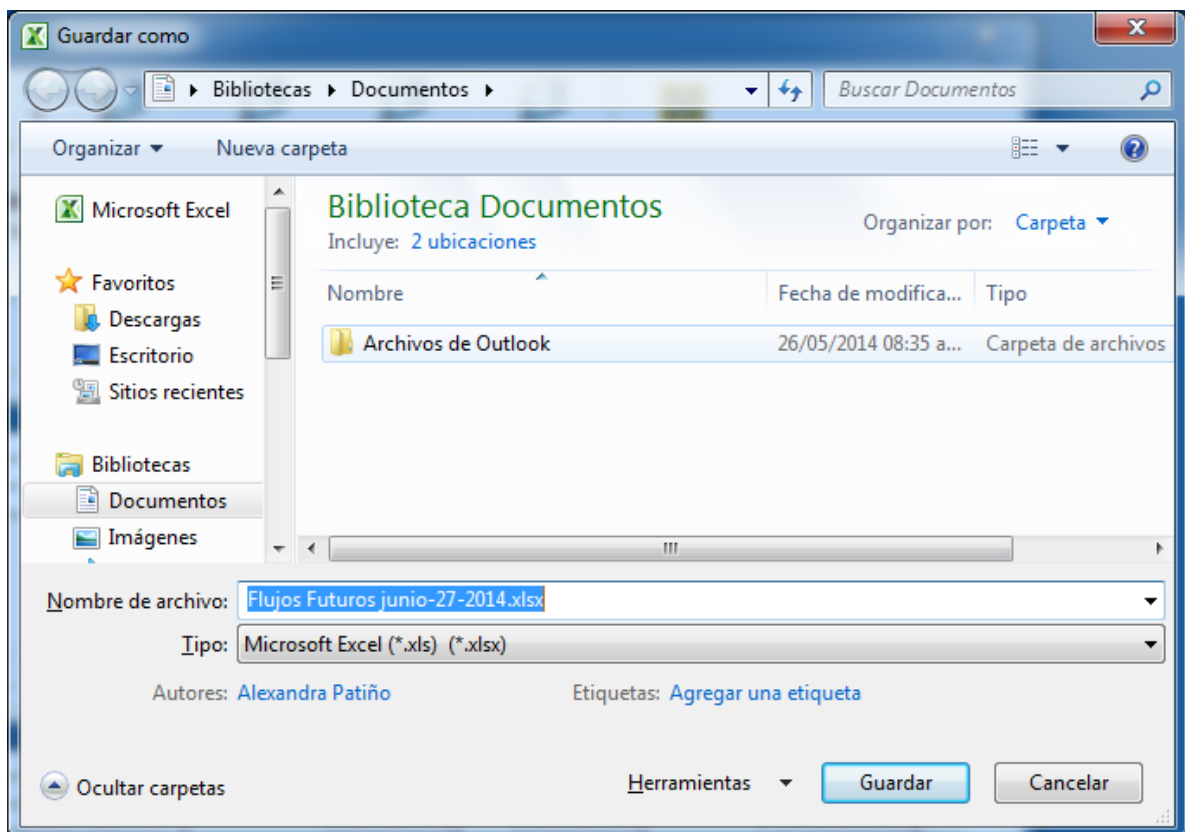


- b. Seleccione el portafolio del cual requiere generar los vencimientos. Seleccione la opción Flujos en la parte inferior izquierda y la fecha hasta la cual desea determinar los vencimientos. Para ejecutar el proceso pulse Aceptar. Si desea generar los vencimientos de todos los portafolios a la vez, seleccione la opción TODOS

- 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.



- e. Esto permitirá exportar a Excel el resultado. Si no aparece la ventana para guardar el archivo pulse ALT+TAB para ubicarla.



f. Visualice la información en el archivo de excel generado:

FECCOPER	NUMNEGOCIO	CANTIDAD	VALMER	TASMER	EMISOR	ESPECIE	FECVEN	MODAL	TASAREF	SPREAD	TASA CUPON(%)	CONTRAPARTE	TRADER
12/09/2013	ACC9453	500,000,000.00	505,530,000.00	4.18104773	BANCO DE BOGOTÁ	CDTBB010	14/07/2014	TV	DTF	0.70	101.11734668	860503748	CCASAS
05/12/2013	ACC9972	1,500,000,000.00	1,517,175,000.00	3.93806167	BANCO CORPBANC	CDTBSA10	14/07/2014	TV	DTF	0.85	101.15570392	890905375	CCASAS
13/03/2014	ACC10702	2,000,000,000.00	2,027,320,000.00	3.68075937	FACTORING BANC	CDTCOMSOV	14/07/2014	PV	FS	4.094	101.37603889	800128735	CCASAS
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	800185214	EVARON
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
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
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
12/09/2012	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
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	800030747	EVARON
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

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...

- Todo el Portafolio
- Cada Título

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio

PORTAFOLIO

Nombre: PROFESIONALES
 Tipo: GEN
 Línea Neg.: PWPCLI

Beneficiarios: 02 YY S.A.

Moneda	Valor	%	Tasa	Valor	%	Curva	%
TRM	2197.72		DTF	9.18		CEC	
UVR	181.7891		ICP	7.67		CECUVR	
			IPC	7.67		CRCDT	

CLIENTES

- VAMCOL
- PRUEBA 513
- JT
- PWP
- PROFESIONALES**

Especie	Deposito	Especie	Fecha Vto
BPEMINHTA4	DCV	BPEMINHTA4	04/12/20
CDTBBO10D	DCV	CDTBBO10D	03/06/20
CDTBBO10D	DCV	CDTBGA10D	09/11/20
CDTBGA10D	DCV	CDTCNFS0V	17/03/20
OPCFTRM	DCV	CDTCNFS0V	23/06/20
OPCFTRM	DCV	CDTCNFS0V	25/06/20
OPCFTRM	DCV	CDTDVIS0V	06/04/20
OPCFTRM	DCV	CDTDVIS0V	05/02/20
OPCFTRM	DCV	CDTDVIS0V	25/02/20
OPCFTRM	DCV	CDTFALS0V	14/01/20
OPCFTRM	DCV	CDTFALS0V	14/01/20
OPCFTRM	DCV	CDTFINS0V	19/01/20

Variaciones de Stress en:

Volatilidad %
 VaR %

Stress a...

- Precio
- Tir %

Adit/Mult

INVERSIONES

Ingresar

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.



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



12.1. SIMULACIÓN HISTÓRICA

Método - Simulación Histórica (Grupo : CLIENTES)

Fecha Medición: 07/03/2018

Número de Observaciones: 45

Nivel de Confianza: 95

Seleccione la Fuente de Información:

ALTERNA

INFOVAL

Seleccione Precio:

Precio Sucio

Precio Limpio

Seleccione el tipo de la Moneda:

Simulada

Histórica

Actual

Esta operación puede tardar unos minutos. Por favor espere.

Aceptar Cerrar

12.2. MONTECARLO ESTRUCTURADO

Método - Montecarlo Estructurado (Grupo : CLIENTES)

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:

ALTERNA

INFOVAL

Seleccione Precio:

Precio Sucio

Precio Limpio

Seleccione el tipo de la Moneda:

Simulada

Histórica

Actual

Aceptar Cerrar

12.3. DURACIÓN MODIFICADA

Método - Duración Modificada (Grupo : CLIENTES)

Fecha Medición: 07/03/2018

Número de Observaciones: 45

Horizonte Temporal: 1

Nivel de Tolerancia: 0.01

Nivel de Confianza: 95

Seleccione la Fuente de Información:

ALTERNA

INFOVAL

Aceptar Cerrar

12.4. DELTA NORMAL

Método - Delta Normal (Grupo : CLIENTES)

Fecha Medición: 07/03/2018

Número de Observaciones: 45

Horizonte Temporal: 1

Nivel de Tolerancia: 0.01 VaR Factores

Nivel de Confianza: 95

Seleccione la Fuente de Información:

ALTERNA

INFOVAL

Seleccione Precio:

Precio Sucio

Precio Limpio

Aceptar Cerrar

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:

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

Archivo Métodos

Aplicar StressTesting a...

Todo el Portafolio

Cada Título

Organizar...

Por Grupo

Por Línea

Por Tipo

Por Portafolio

CLIENTES

CLIMAR1

Arqueo Depósitos

PORTAFOLIO 04/06/2012

Nombre: XX Beneficiarios: 01 XX S.A.

Tipo: GNA

Línea Neg.: PUBLICO

Moneda	Valor	%	Tasa	Valor	%	Curva	%	A
LVR	202.5213		IB1	5.076		CEC		
			ICP	3.43		CECUVR		
			IPC	3.43		CRCDT		

Especie	Deposito	Especie	Fecha Vto.
BAAA1039VA	DVL	BAAA1039VA	20/05/2013
BBBC1079C60V	DVL	BBBC1079C60V	26/09/2012
BPEMINHTA3	DVL	BPEMINHTA3	27/12/2013
CDTBCB80P	DCV	CDTBCB80P	14/06/2013
TFIC07240712	DCV	IBRH13F	15/09/2012
TFIT06141113	DCV	TFIC07240712	24/07/2012
TFIT06141113	DCV	TFIT06141113	14/11/2013
TFIT15240720	DCV	TFIT15240720	24/07/2020
TUVT06200313	DCV	TUVT06200313	20/03/2013
TUVT06200313	DCV		

Variaciones de Stress en ...

Volatilidad %

VaR %

Stress a...

Precio

Tir %

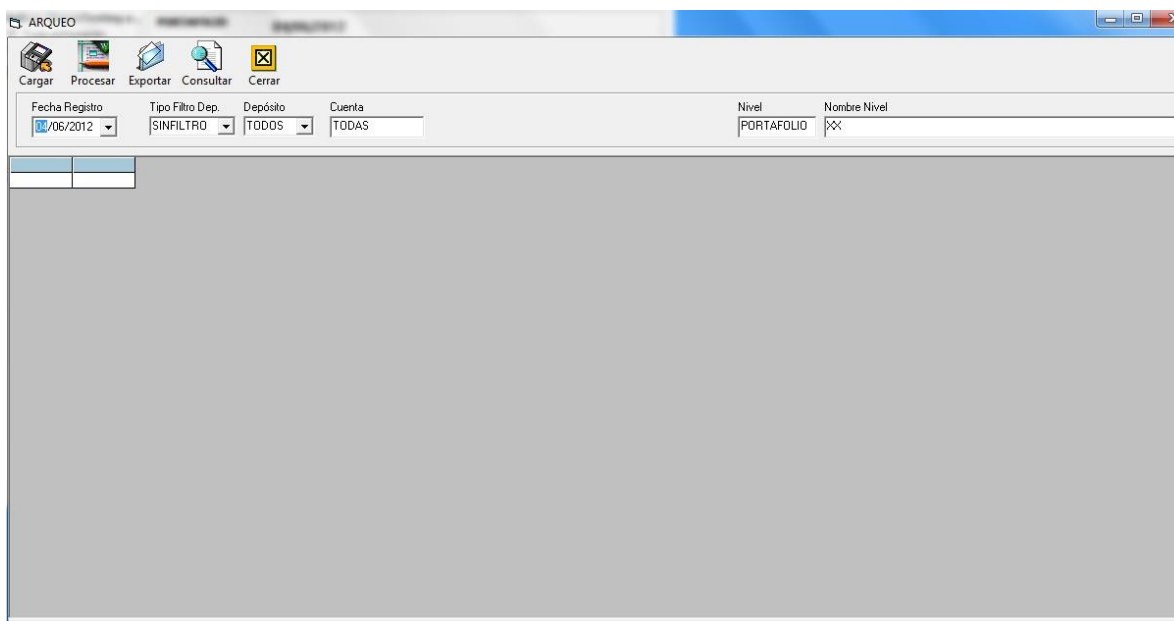
Adit/Mult

INVERSIONES

Ingresar

11 9 Títulos

Una vez hecho lo anterior, pulse el botón “Arqueo” de la parte izquierda. Le aparece la siguiente pantalla:



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 depósitos 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.
 - ii. FILTREDEP: Significa tome sólo lo del mismo depósito.
- c. Depósito:
 - i. TODOS: Significa que el arqueo se hará a todos los depósitos.
 - ii. 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
 - ii. Cualquier otra: Se tomará solo esa.

Una vez definido lo anterior pulse el botón "Procesar" y le aparecerá la pantalla así:

Tipo	FechaReg	ISINumEmi	Especie	Moneda	Deposito	Depositan	Cuenta	Estado	SaldoPortafolio	SaldoDeposito	ArqueoTotal	ArqueoDisponible	PrtD
DETALLE	06/04/2012	USC71059AB42	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279	CEROPRT	0	1,150,000	1,150,000	1,150,000	
DETALLE	06/04/2012	USP09645AG07	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279	CEROPRT	0	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
DETALLE	06/04/2012	USP93077AA61	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279	CEROPRT	0	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
DETALLE	06/04/2012	X50479889007	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279	CEROPRT	0	1,500,000	1,500,000	1,500,000	
DETALLE	06/04/2012	X50749067020	SINESPECIE	TRM	CLSTR	23	890300279	CEROPRT	0	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
DETALLE	06/04/2012	48298	TFIC07240712	COP	DCV			BALANCE	1,320,000,000	1,320,000,000	0	0	1.3
DETALLE	06/04/2012	51371	TUVT06200313	UVR	DCV			BALANCE	465,000,000	465,000,000	0	-40,000,000	4
DETALLE	06/04/2012	51927	TFIT15240720	COP	DCV			CERODEP	1,600,000,000	0	-1,600,000,000	-1,600,000,000	1.6
DETALLE	06/04/2012	51932	TFIT06141113	COP	DCV			BALANCE	170,005,200,000	170,005,200,000	0	-59,505,200,000	170.0
DETALLE	06/04/2012	SINISIN00000001	CDTBCB80P	COP	DCV			CERODEP	1,000,000,000	0	-1,000,000,000	-1,000,000,000	1.0
DETALLE	06/04/2012	39595	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	8,000,000,000	8,000,000,000	8,000,000,000	
DETALLE	06/04/2012	44616	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	16,085,000,000	16,085,000,000	16,085,000,000	
DETALLE	06/04/2012	47798	SINESPECIE	UVR	DCV	23	23	CEROPRT	0	19,539,700	19,539,700	19,539,700	
DETALLE	06/04/2012	48273	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	18,403,000	18,403,000	18,403,000	
DETALLE	06/04/2012	51176	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	3,048,041	3,048,041	3,048,041	
DETALLE	06/04/2012	54689	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
DETALLE	06/04/2012	54706	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	33,014,789,000	33,014,789,000	33,014,789,000	
DETALLE	06/04/2012	54796	SINESPECIE	COP	DCV	23	23	CEROPRT	0	1,132,289,000	1,132,289,000	1,132,289,000	
DETALLE	06/04/2012	COB07CB00090	BBCB1079C60V	COP	DVL			BALANCE	8,833,000,000	8,833,000,000	0	0	8.8
DETALLE	06/04/2012	COE07CB00011	BAAA1039VA	COP	DVL			BALANCE	1,000,000,000	1,000,000,000	0	0	1.0
DETALLE	06/04/2012	COL17CB088F9	BPEMINHTA3	COP	DVL			BALANCE	138,269,000	138,269,000	0	0	1
DETALLE	06/04/2012	COB01CD51266	SINESPECIE	COP	DVL	23	21276	CEROPRT	0	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
DETALLE	06/04/2012	COB12CD31539	SINESPECIE	COP	DVL	23	23	CEROPRT	0	9,000,000,000	9,000,000,000	9,000,000,000	
DETALLE	06/04/2012	CO198CH00849	IRST110131216	COP	DVL	23	23	CEROPRT	0	474,883,013	474,883,013	474,883,013	
DETALLE	06/04/2012	COV37CB00046	SPAT1097D37	UVR	DVL	23	23	CEROPRT	0	80,100,000	80,100,000	80,100,000	
TOTALGRAL	06/04/2012	GENERAL	GENERAL	GENERAL				ROLIOPRT	184,361,469,000	250,600,170,754	66,238,701,754	-27,953,576,246	184.3
TOTALMON	06/04/2012	GENERAL	GENERAL	GENERAL				ROLIOPRT	183,896,469,000	250,024,881,054	66,128,412,054	-28,023,885,946	183.8

Resultados del arqueo. Algunos datos importantes del arqueo:

- Tipo. Este campo indica la clase de información que contiene la línea de resultados:
 - DETALLE. Es el resultado de una posición en particular.
 - TOTALGRAL. Es el resultado del total de posiciones revisadas y del total de datos de depósitos tomados.
 - TOTALMON. Indica que la línea contiene los resultados de la moneda referenciada en el campo Moneda.
- 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:
 - CEROPRT. Para esa posición, encontrada en el depósito, no hay datos en el portafolio seleccionado.
 - CERODEP. Para esa posición, encontrada en el portafolio, no hay datos en el depósito.
 - BALANCE. Eureka, lo mismo que hay en el portafolio se encontró en el depósito.
 - ROJOPRT. Hay más en el depósito que en el portafolio.
 - ROJODEP. Hay más en el portafolio que en el depósito.
- Valores para el arqueo:
 - SaldoPortafolio. Total encontrado en el portafolio.
 - SaldoDepósito. Total hallado en depósito.
 - ArqueoTotal. SaldoDepósito – SaldoPortafolio.
 - ArqueoDisponible. DepDisponible – PrtDisponible
 - Aplice 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.

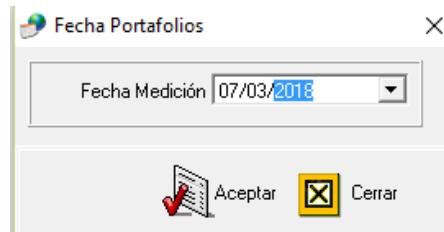
- El botón Consultar. Le permite consultar la información cargada de los depósitos. Los parámetros de consulta son los que están en los campos Fecha Registro, Depósito y Cuenta. Una vez pulse "Consultar" le aparece la pantalla así:

FechaReg	Deposito	Depositante	Cuenta	ISINoNumEmi	Secuencia	TipoSaldo	Saldo	Moneda	TasaRef	Spread	Modalidad	FechaEmi	FechaVen	TipoldTitu	NitTitular
04/06/2012	CLSTR	23	8903002794	USC71058A842	1	DI	1,150,000.00	TRM	FS	7.2500	NO		12/11/2021	N	890300279-4
04/06/2012	CLSTR	23	8903002794	USP09645AG07	2	DI	2,000,000.00	TRM	FS	4.7500	NO		16/11/2016	N	890300279-4
04/06/2012	CLSTR	23	8903002794	USP93077AA61	3	DI	2,000,000.00	TRM	FS	5.7000	NO		20/12/2022	N	890300279-4
04/06/2012	CLSTR	23	8903002794	XS0479889007	4	DI	1,500,000.00	TRM	FS	6.2500	NO		20/10/2013	N	890300279-4
04/06/2012	CLSTR	23	8903002794	XS0749067020	5	DI	4,000,000.00	TRM	FS	2.7000	NO		26/12/2013	N	890300279-4
04/06/2012	DCV	23	23	36695	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	54705	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	23	21276	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	COB01CD51266	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	COB07CB00090	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	COB12CD31539	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	COE07CB00011	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	COL17CB06BF9	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

- 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.



Se visualiza a continuación las inversiones realizadas en fecha especificada.

Aplicar StressTesting a

- Todo el Portafolio
- Cada Título

Organizar...

- Por Grupo
- Por Línea
- Por Tipo
- Por Portafolio

CLIENTES

PORTAFOLIO 07/03/2018

Nombre:

Tipo:

Linea Neg.:

Beneficiarios:

<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>

Moneda	Valor	%	Tasa	Valor	%	Curva	%	Adit.

Especie	Deposito	Especie	Fecha Vto.
		COP/TRM	16/04/2018
		LIBRA	26/02/2018
		USP32133CG63	11/02/2023

Variaciones de Stress en ...

Volatilidad %

VaR %

Stress a...

- Precio
- Tir %

Adit/Mult

INVERSIONES

Ingresar

0 Títulos 3 Títulos

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.

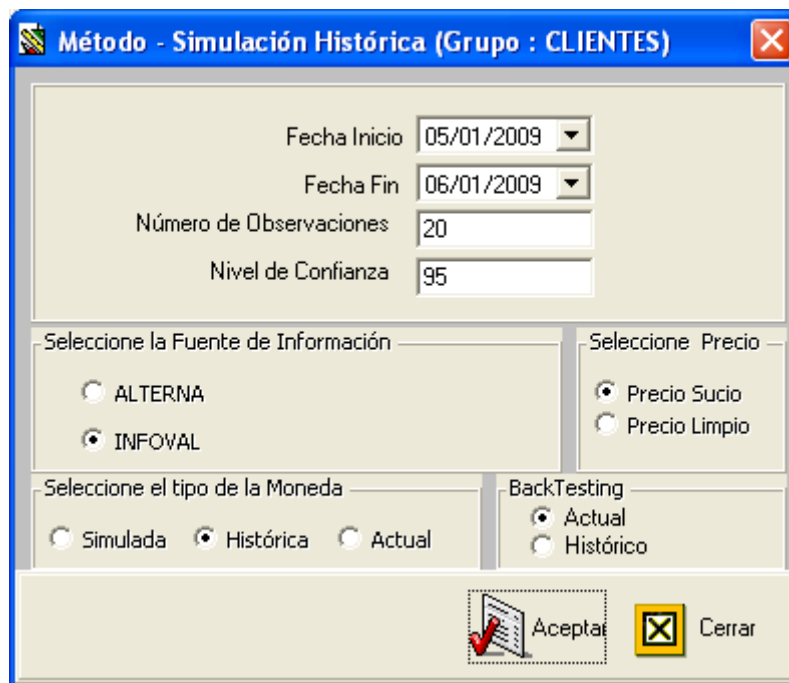
En la cuadrícula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, pérdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

Cuando se da clic en el Modulo Backtesting aparece la pantalla donde se selecciona

la fecha del Portafolio.



Después de seleccionar la fecha se debe dar Aceptar y aparece la siguiente pantalla.



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 medición

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 se 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:

Alternativa: 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.

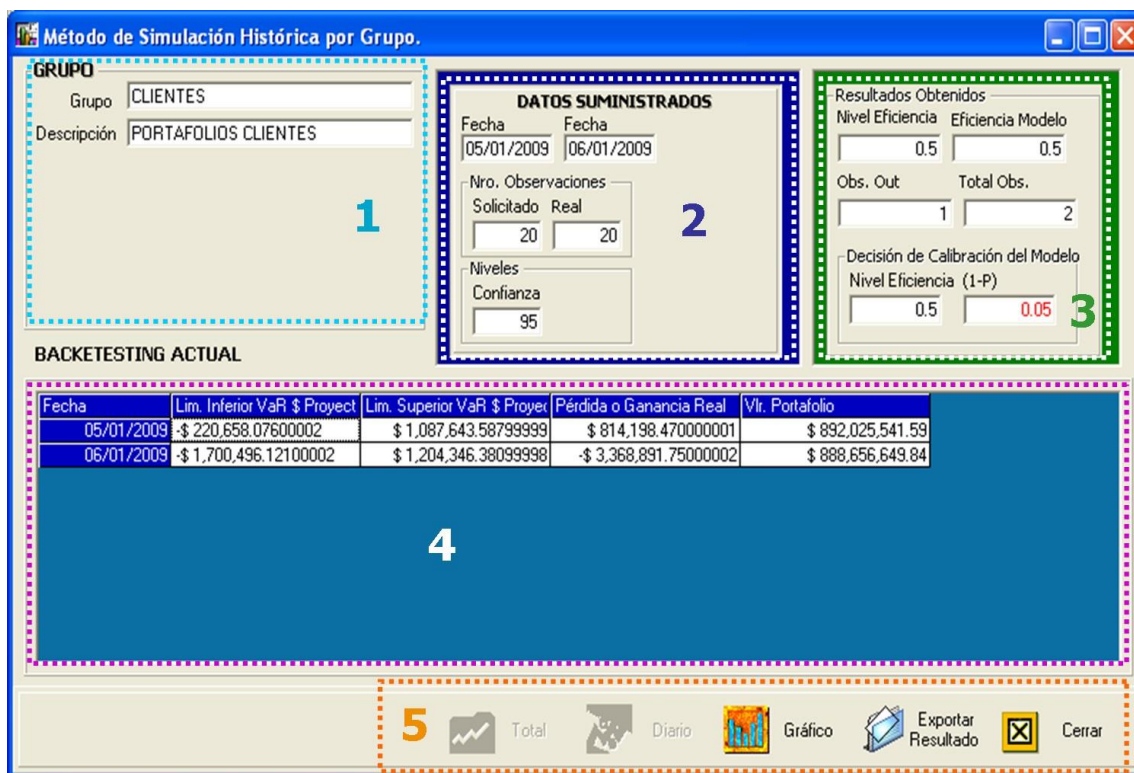
Actual: La de hoy

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.



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**



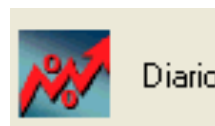
Información del Total del BackTesting por Activo

PORTAFOLIOS					
	Nivel Eficiencia	Eficiencia	Obs Out	(1-P)	Observaciones
CNEC	0.5	0.5	1	0.05	
CNEC	0.5	0.5	1	0.05	
GRUPOAVAL	0.0	1.0	0	0.05	
GRUPOSURA	0.0	1.0	0	0.05	

Exportar Resultado Cerrar

Esta pantalla muestra el total del Backtesting por activo, la información puede ser llevada a Excel para presentar diversos informes.

- **DIARIO.**



Información del BackTesting por Activo

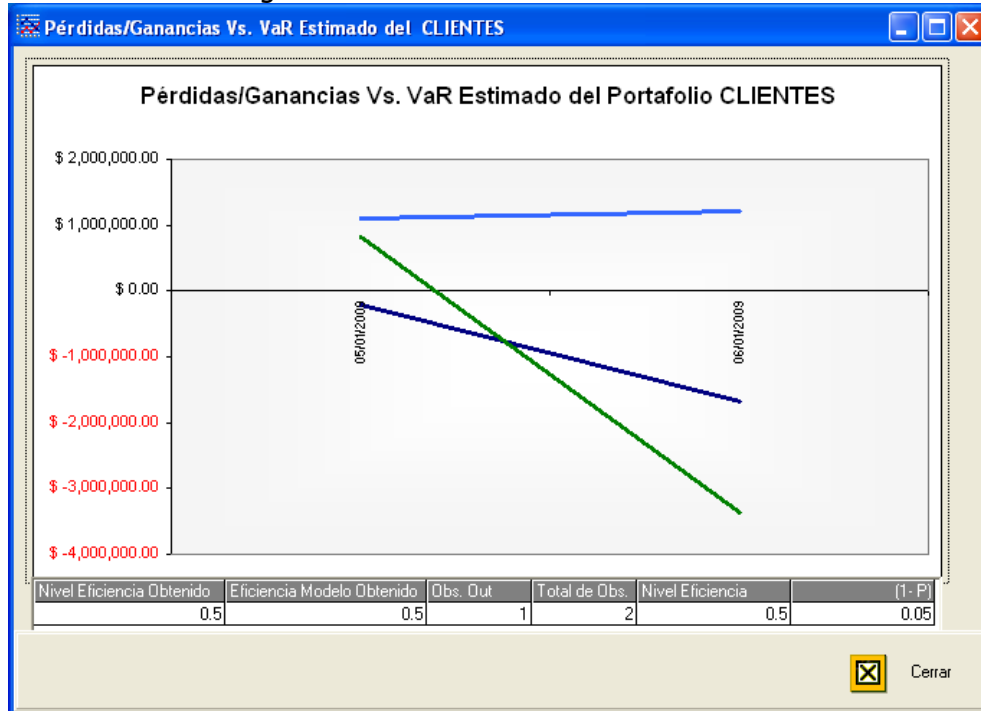
ACTIVOS					
	Fecha	Limite Inferic	Limite Super	PYG Real	Observaciones
CNEC	03/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
CNEC	03/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	\$ 0.00	
GRUPOAVAL	03/11/2010	1,413,667.18	1,485,702.38	,000,000.00	
GRUPOSURA	03/11/2010	,641,007.25	499,710.725	,500,000.00	
CNEC	04/11/2010	\$ 0.00	\$ 0.00	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	

Exportar Resultado Cerrar

Información discriminada por día del Backtesting por activo, adicionalmente puede llevar la información a Excel para diversos informes.

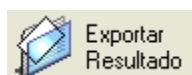
- **GRAFICO**

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.

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 cuadrícula 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:

Fecha	Lim. Inferior VaR \$ Proyect	Lim. Superior VaR \$ Proyect	Pérdida o Ganancia Real	Vlr. Portafolio
05/01/2009	-\$ 119,248,983473683	\$ 738,521,413502336	\$ 738,880,449999999	\$ 892,025,541,59
06/01/2009	-\$ 926,642,772693833	\$ 1,183,803,06341043	\$ 77,098,033,43	\$ 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 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 Modificada (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:

ALTERNA
 INFOVAL

Seleccione el tipo de la Moneda:

Simulada Histórica Actual

BackTesting:

Actual
 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 cuadrícula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, pérdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

La pantalla final de resultados se muestra a continuación:

Fecha	Lim. Inferior VaR \$ Proyect	Lim. Superior VaR \$ Proyer	Pérdida o Ganancia Real	Vlr. Portafolio
05/01/2009	-\$ 774,114,682440967	\$ 774,114,682440967	\$ 814,198,470000001	\$ 892,025,541.59
06/01/2009	-\$ 4,224,506,70105397	\$ 4,224,506,70105397	-\$ 3,368,891,750000002	\$ 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)

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

VaR Factores

Seleccione la Fuente de Información:

ALTERNA

INFOVAL

Seleccione Precio:

Precio Sucio

Precio Limpio

Seleccione el tipo de la Moneda:

Simulada Histórica Actual

BackTesting:

Actual

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 cuadrícula inferior se muestra los datos correspondientes a los límites inferior y superior de la variación del riesgo proyectada, pérdida o ganancia real del portafolio y valor portafolio.

Fecha	Lim. Inferior VaR \$ Proyect	Lim. Superior VaR \$ Proye	Pérdida o Ganancia Real	Vlr. Portafolio
05/01/2009	-\$ 787.398.437685515	\$ 787.398.437685515	\$ 814.198.470000001	\$ 892.025.541.59
06/01/2009	-\$ 3.343.146.19478635	\$ 3.343.146.19478635	-\$ 3.368.891.750000002	\$ 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 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



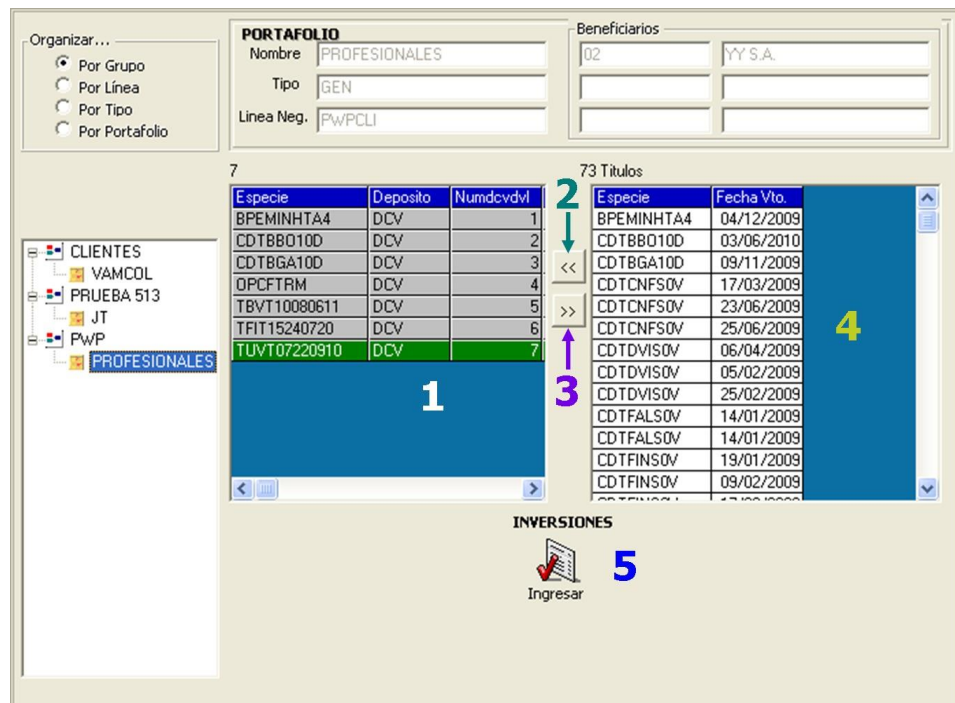
Herramienta muy útil que nos sugiere una composición óptima del portafolio para obtener la mejor tasa con el mínimo riesgo.



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**

The "Renta Fija" form is divided into several sections:

- Operación:** Radio buttons for "Normal", "Contado+1a5", "Repo", "Simultáneas", "Trans. Temp.", "Forward", "Opciones", and "Op. Plazo".
- Datos Compromiso:** Fields for Fecha Registro (04/11/2010), Fecha Oper (04/11/2010), Fec Cumplimiento (04/11/2010), Punta (COMPRA), Posición (LARGA), Nro. Negocio (0), Nro. de Orden (0), and Portafolio (ACCIONES).
- Emisor:** Fields for Emisor, Especie, Depósito (DCV), Isin/NumEmisión (0), Tipo Inversión (TipolInversion), Contraparte, Hora Compra (12:03:49), and Tipo Fw (NDV).
- Datos Faciales:**
 - Emisión: 12/02/2002, Vencimiento: 12/02/2002, Tasa Nominal: 0.00, Completo-Cup-Ppal: COMPLETO, Modalidad Emisión: Mod1.
 - Cantidad: 0.0, Valor de Compra: 0.0, Modalidad Reinv.: Per1.
 - Trader: Trader, Adicional: 0.0, Modalidad Reinv.: Mod2, Per2.
- Valoración:**
 - T. Efect.: 0.00, Precio: 0.00, Captación/Salida: 0.0.
 - T.Repo/Cpr: 0.00, Oper. Regreso: 0, Valor Giro/Recompra: 0.00.
 - Dias Cpr: 0.000, Fec Cpr: 04/11/2010, Orden CPR: FINAL.
- Comisión:** Fields for Comisión, Base Comisión, Retención, Base Retención, Traslado, Base Traslado, and Operación Origen.
- Identificación:** Fields for PUC, Nit Cliente, Nombre Cliente, Sistema (MEC), Usuario, and Estación.
- Mercado:** Mercado (SECUNDARIO), Finalidad (ESPECULA), Compensación (DVP), Forma de Pago (TRA), Cal. Crediticio Inv. (A).

At the bottom of the form are three buttons: "Calcular" (calculator icon), "Aceptar" (checkmark icon), and "Cerrar" (close icon).

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.

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.

	Rentabilidad	Volatilidad	Tasa Libre	Índice Sharpe	Saldo Inversión	Error
Óptimo	31.976	0.7521119109861	0	1.931	\$ 1.159.659.47000	9.04957681254157E-04
Esperado	32.605	0.7604158639443	7	1.4651663293	\$ 771.621.279999	9.14949181062351E-04

Volatilidad Mínima	Rentabilidad Máxima
0.304279116648801	0.141949553693269

Especie	Fecha Vcto.	Peso Optimo %	Cantidad Optimo	Monto Optimo	Cant. Inv Optimo	Monto Inv
TBFC05030506	03/05/2006	54.733	\$ 661.316,015.0200	\$ 547.328,782.691275	\$ 661.000,000.0	\$ 547.000,000.0
TBFC07220808	22/08/2008	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBFT10250112	25/01/2012	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10260110	26/01/2010	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10260710	26/07/2010	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TBVT10290310	29/03/2010	45.267	\$ 419.832,961.9920	\$ 452,671,217.308725	\$ 419.000,000.0	\$ 451.700,000.0
TRST07210906	21/09/2006	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TUST05150306	15/03/2006	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0
TUST08180809	18/08/2009	0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0	\$ 0.0

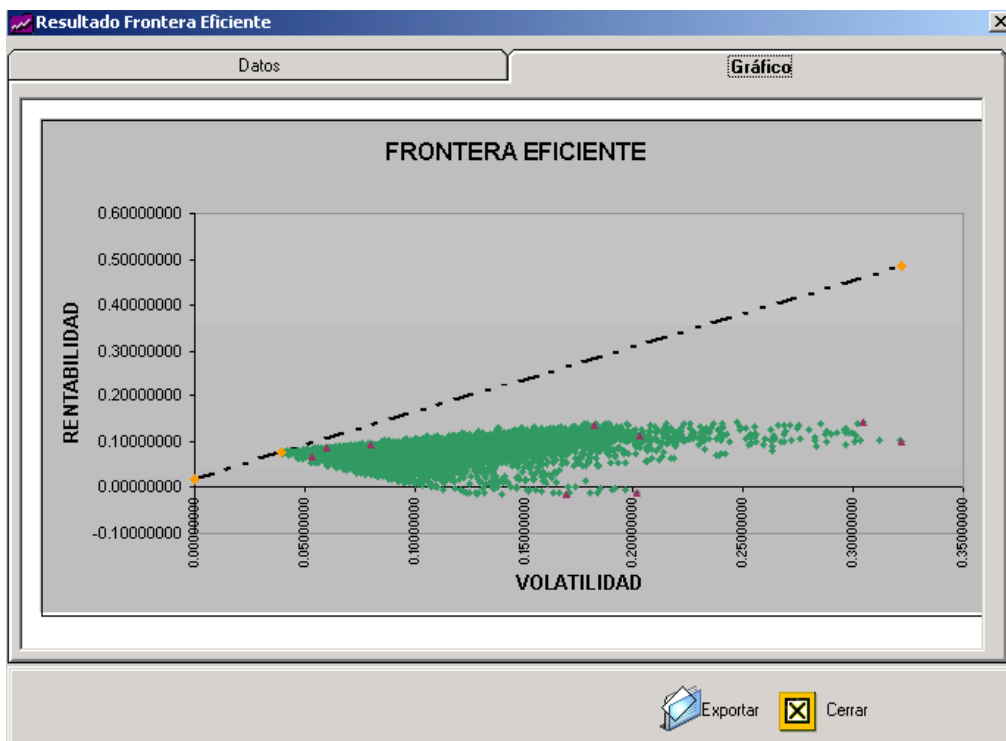
La cual consta de dos partes:

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
 Contado+1a3
 Repo
 Oper. a Plazos
 Forward
 OPCFTRM
 Opciones
 InterBancarios

Datos Compromiso




Fecha Registro	Fecha Oper	Fec Cumplimiento	Punta	Posición	Número del Negocio
04/11/2010	04/11/2010	04/11/2010	COMPRA	LARGA	0
Número de Orden	Portafolio	Emisor		Especie	
0	ACCIONES			Especie	
Tipo Inversión	Contraparte	Hora Compra	Tipo Forward	Depósito	Isin/NumEmisión
TipInversion		12:04:16 p.m.	NDV	DVL	0

Valoración

Cantidad	Precio	Valor de Compra	Valor Giro/Recom	Valor Captación	Tasa Repo
0.0	0.00000000	0.00	0.00	0.00000000	0.000
Fec Compromiso	Días Comprom.	Orden Comprom.	Adicional	Trader	
04/11/2010	0.000	FINAL	0.000	Trader	

Comisión	Base Comisión	Operación Origen	PUC	Nit Cliente	Sistema
					MEC
Usuario	Estación	Nombre Cliente			

Mercado	Finalidad	Compensación	Forma de Pago	Decl. de Cambio	Nral. Cambiario
SECUNDARIO	ESPECULA	DVP	TRA	0	0
Lugar de la transacción	NA(NA) (PWP=0000)			Pais Origen	

 Calcular
  Aceptar
  Cerrar

Divisas

Divisas

Tipo de Operación
 Normal Contado+1a3 Repo Oper. a Plazos Forward OPCFTRM Opciones InterBancarios

Datos Compromiso
 Fecha Registro: 04/11/2010 | Fecha Oper: 04/11/2010 | Fec Cumplimiento: 04/11/2010 | Punta: COMPRA | Posición: LARGA | Número del Negocio: 0
 Número de Orden: 0 | Portafolio: ACCIONES | Emisor: | Especie: Especie
 Tipo Inversión: Tipoinversion | Contraparte: | Hora Compra: 12:05:01 p.m. | Tipo Forward: NDV | Depósito: DVL | Isin/NumEmisión: 0

Valoración
 Cantidad: 0.0 | Precio: 0.00000000 | Valor de Compra: 0.00 | Valor Giro/Recom: 0.00 | Valor Captación: 0.00000000 | Tasa Repo: 0.000
 Fec Compromiso: 04/11/2010 | Días Comprom.: 0.000 | Orden Comprom.: FINAL | Adicional: 0.000 | Trader: Trader

Comisión: | Base Comisión: | Operación Origen: | PUC: | Nit Cliente: | Sistema: MEC
 Usuario: | Estación: | Nombre Cliente:

Mercado: SECUNDARIO | Finalidad: ESPECULA | Compensación: DVP | Forma de Pago: TRA | Decl. de Cambio: 0 | Nral. Cambiario: 0
 Lugar de la transacción: NA(NA) (PWP=0000) | País 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.

Fecha Portafolios

Fecha Medición: 06/01/2009

Aceptar | Cerrar

14.MARGINAL AND INCREMENTAL VAR



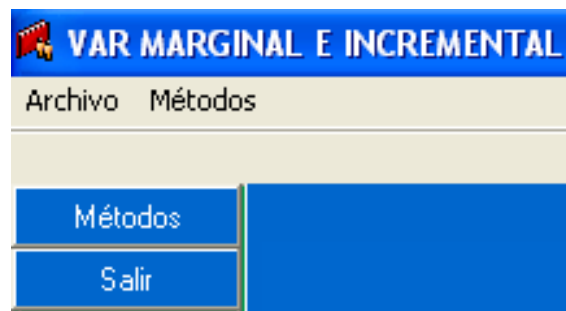
Una pregunta común de los administradores de portafolios y de riesgos es ¿Qué efectos tiene en el nivel de riesgo del portafolio cuando se adiciona o se quita un activo del mismo? Para resolver esta pregunta existen dos medidas muy útiles: el VaR Marginal y el VaR Incremental. PWPREI incluye ahora estas 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.



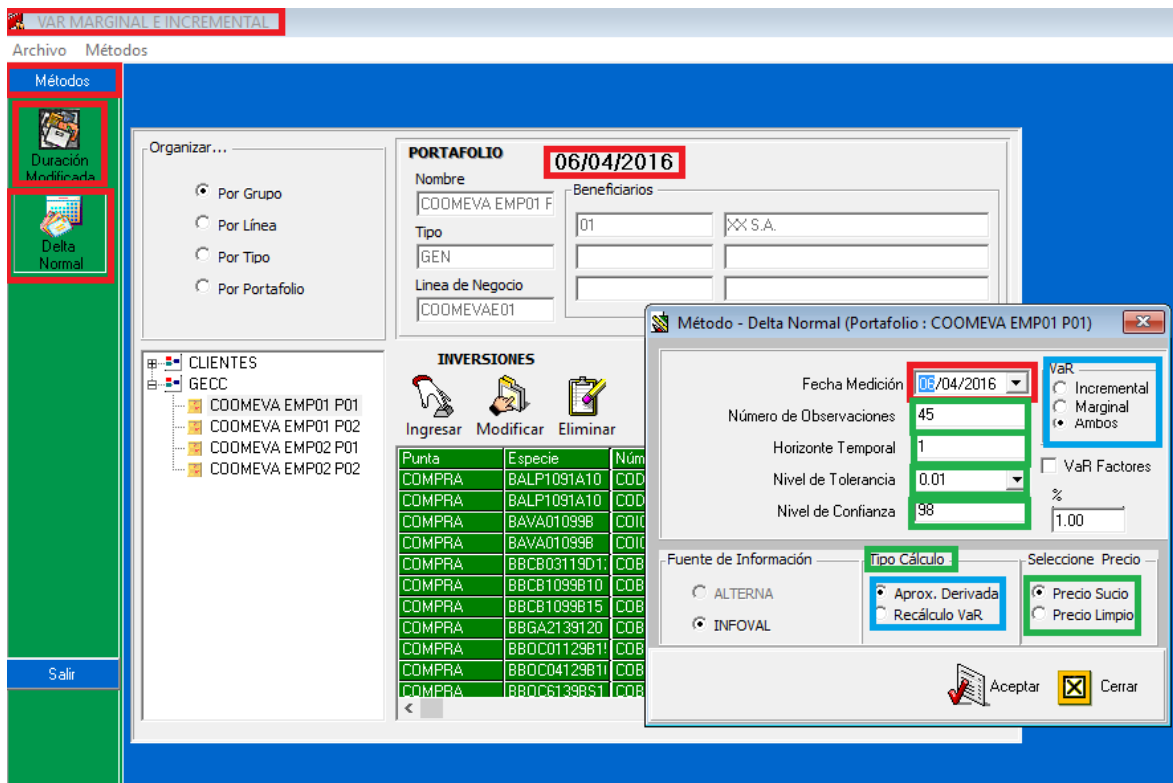
14.1. OPCIÓN METODOS



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:



2. **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:

Factor	VaR %	VaR \$	VaR Marginal %	VaR Marginal \$	VaR Incremental %	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	\$ 6,532.96	0.000003	\$ 65.33
BBCB1099B10	1.989958	\$ 4,547,070.2	0.001141	\$ 2,607.20	0.000012	\$ 26.07
BBCB1099B15	1.967303	\$ 11,039,076.1	0.001551	\$ 8,703.09	0.000016	\$ 87.03
BBGA2139120	0.389153	\$ 5,764,541.7	0.00024	\$ 3,555.13	0.000002	\$ 35.55
BBDC01129B15	0.263408	\$ 5,132,968.2	0.000082	\$ 1,597.92	0.000001	\$ 15.98
BBDC04129B10	0.268713	\$ 4,101,989.1	0.000189	\$ 2,885.15	0.000002	\$ 28.85

Datos Históricos



Información histórica suministrada para realizar la medición.

Datos Históricos

Fecha	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTCNF50V	CDTDV50V	CDTDV50V	CDTDV50V	CDTFAL50V	CDTFAL50V
06/01/2009	12.91478492	11.83422387	11.83117647	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	0.75
05/01/2009	10.26176293	10.95293462	10.95734711	10.41924427	9.82397056	9.89011079	10.48964294	10.46
02/01/2009	10.31690159	10.97259033	10.97640112	10.09685286	9.9003705	9.95535447	10.58049946	10.58
31/12/2008	10.37823341	11.23984771	11.24365851	10.24004257	9.71111402	9.90714392	10.19129958	10.19
30/12/2008	10.38552529	11.24175312	11.24546362	10.24592164	9.72187167	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	10.27
24/12/2008	10.53595799	11.43199225	11.18650053	10.45175758	9.58273583	10.44459782	10.37140858	10.37
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	10.67
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	10.67
15/12/2008	11.03957752	11.31666746	11.21598982	10.96364868	10.25889221	10.81062411	10.7150798	10.71
12/12/2008	12.91478492	11.31725327	11.21408922	0.19781194	14.53488911	14.53629276	11.83024312	0.75
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	10.67
05/12/2008	11.54677067	11.31435268	11.2144997	11.01095152	10.79483313	10.96436817	10.693332	10.69

Interpolación
 Asociado Histórico
 Asociado Promediado
 Promediado
 Asociado Interpolado

Exportar Resultado
 Cerrar

- Exportar a Excel



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

Método - Delta Normal (Grupo : CLIENTES)

Fecha Medición: 06/01/2009

Número de Observaciones: 20

Horizonte Temporal: 1

Nivel de Tolerancia: 0.01

Nivel de Confianza: 95

VaR:

- Incremental
- Marginal
- Ambos

VaR Factores

%: 2.00

Seleccione la Fuente de Información:

- ALTERNA
- INFOVAL

Seleccione Precio:

- Precio Sucio
- Precio Limpio

Aceptar Cerrar

Al presionar el Botón Aceptar aparece la siguiente pantalla:

Resultados del VaR por Factores

Datos Históricos Exportar a Excel Cerrar

MEDICION

General: GRUPO CLIENTES

Datos Suministrados: Fecha 06/01/2009

Nro. Observaciones Solicitado: 20 Real: 20 Niveles Confianza: 95

Resultados Obtenidos:

Neto Portafolio	Valor Compra	
\$ 888,656,649.84	\$ 876,941,088.00	
Mr. A Tasa Cmp	Duración Prom.	
\$ 888,794,859.632973	0.347294	
Volat. Portafolio	PyG Real	
0.228714576	-\$ 138,209.81	
Monto VaR (\$)	VaR (%)	VaR (\$)
\$ 888,656,649.85	0.376202	\$ 3,343,146.194786

Factor	Cantidad	Monto	Volatilidad	VaR %	VaR \$	VaR Marginal %	VaR
CDTCNFS0V	23,183,985.0	\$ 23,811,935.96	0.261857779	0.430718	32,562,294,328193		0.0
CDTCNFS0V	100,000,000.0	\$ 100,429,925.43	0.206395143	0.33949	40,949,553842307		0.0
CDTCNFS0V	80,000,000.0	\$ 80,196,308.75	0.206415778	0.339524	272,285,71532035		0.0
CDTDVIS0V	4,620,774.6	\$ 4,629,146.17	1.400983975	2.304414	36,674,692421944		0.0
CDTDVIS0V	10,509,012.0	\$ 10,623,587.35	0.201959696	0.332194	35,290,919761459		0.0
CDTDVIS0V	6,000,000.0	\$ 5,998,323.55	0.328241287	0.539909	32,385,48869557		0.0
CDTFALS0V	27,435,997.0	\$ 28,849,753.32	0.027187916	0.04472	12,901,609684704		0.0
CDTFALS0V	2,930,079.0	\$ 3,088,135.33	0.145215305	0.238858	7,376,258286531		0.0

Datos Históricos



Información histórica suministrada para realizar la medición.

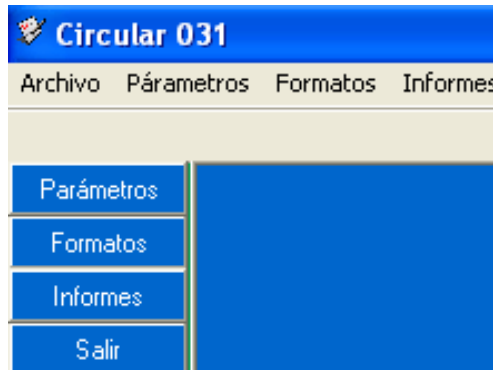
Fecha	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTCNFS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTDVIS0V	CDTFALS0V	CDTFALS0V
06/01/2009	102.70855488	100.42992543	100.24538594	100.18117246	101.09025809	99.97205924	105.1529249	105.39
05/01/2009	103.15034662	100.76760663	100.58365647	97.78359961	101.41379589	100.51480955	105.15198296	105.15
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	105.01
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	104.87
24/12/2008	102.76154328	100.20953966	100.33899899	97.45738828	101.1280324	100.1166209	104.81415774	104.81
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	104.74
19/12/2008	102.58627308	100.30555013	100.31189049	97.24107032	100.9671523	99.92779959	104.65226531	104.65
18/12/2008	102.49394441	100.28468236	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	104.53
12/12/2008	101.8576259	100.29555037	100.31855729	100.16761347	100.15496182	99.04702551	104.3507032	105.39
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

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.
3. 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.

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.

Ingresar Datos	
Tipo Compromiso	NINGUNO
Tipo Inversion	SI
Mercado	SI
Tipo Emisor	SI
Tipo Deuda	SI
Tasa	SI
Moneda	SI
Posicion	SI
Swap	NO

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.

8. Existe algún tipo de información que se reconoce como 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.

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

Ente Regulador	Nombre	Tipo Entidad	Código Tipo Entidad	Palabra Clave	Área Información	Tipo Informe
SF	SUPER FINANCIERA	04	33	CFCFININTER	SUBSISTEMA CONTABLE Y ESTAD	
SB	SUPER BANCARIA	03	055	SA	CALIFICACION DE ACTIVOS	

15.1.1.1. MODIFICAR EL TIPO DE ENTIDAD

Tipo Entidad - Modificar

Ingresar Datos

Ente Regulador: SF

Nombre: SUPER FINANCIERA

Tipo Entidad: 04

Código Tipo Entidad: 33

Palabra Clave: *****

Área Información: SUBSISTEMA CONTABLE

Tipo Informe: 21

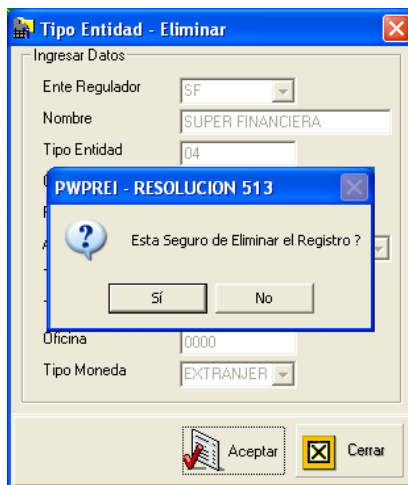
Tipo Información: FORMATOS

Oficina: 0000

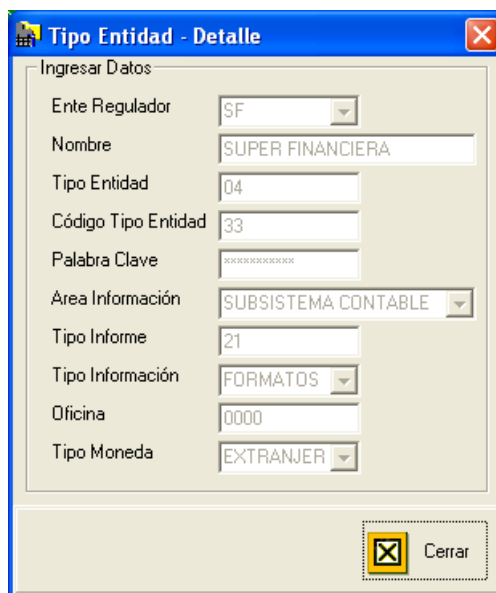
Tipo Moneda: EXTRANJER

Aceptar Cerrar

15.1.1.2. ELIMINAR EL TIPO DE ENTIDAD



15.1.1.3. DETALLE EL TIPO DE ENTIDAD



15.1.2. SUPERBANCARIA

Circular 031 - [Parámetros SB]

Archivo Parámetros Formatos Informes

Parámetros	Duración	Moneda	Monto	Puntos Basicos	Tasa Costo	Nivel Agrupa
	6	6	10	100	5	PORTAFOLIO
	6	6	10	100	5	PORTAFOLIO

Tipo Entidad

Súper Banc.

15.1.2.1. MODIFICAR PARAMETROS SUPERBANCARIA

Parametro SB - Modificar

Ingresar Datos

Duración: 6

Moneda: 6

Monto: 10

Puntos Basicos: 100

Tasa Costo: 5

Nivel Agrupa: PORTAFOLIO

Aceptar Cerrar

15.1.3. FONDO FIDEICOMISO

Circular 031 - [Fondo Fideicomiso]

Archivo Parámetros Formatos Informes

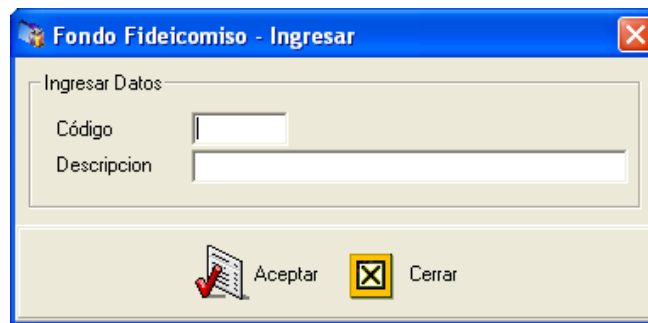
Parámetros	Codigo	Descripcion
	0	NINGUNO
	1	FID. DE INVERSION
	2	FID. DE INMOBILIARIO
	3	FID. DE ADMINISTRACION
	4	OTROS Y DE GARANTIA
	5	FONDO DE CESANTIA
	6	FONDO DE PENSIONES
	7	PRIMA MEDIA
	8	PRIMA MEDIA - CAYDAC
	9	FONDO DE VALORES

Tipo Entidad

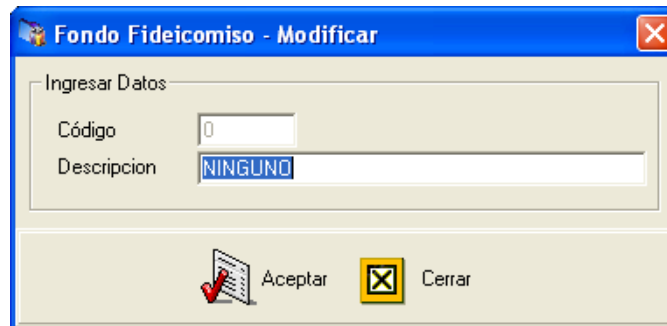
Súper Banc.

Fondo Fideicomiso

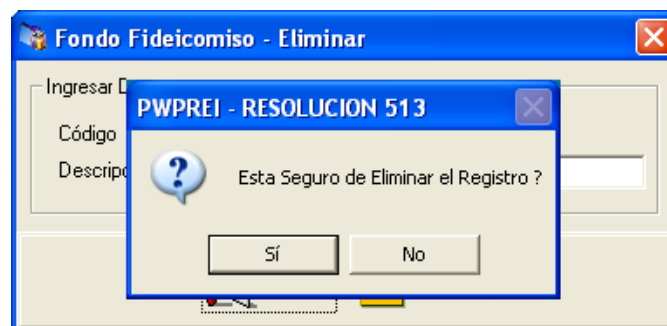
15.1.3.1. INGRESAR FONDO FIDEICOMISO



15.1.3.2. MODIFICAR FONDO FIDEICOMISO



15.1.3.3. ELIMINAR FONDO FIDEICOMISO



15.1.3.4. DETALLE FONDO FIDEICOMISO

Fondo Fideicomiso - Detalle

Ingresar Datos

Código: 0

Descripción: NINGUNO

Cerrar

15.1.4. PUC

Parámetros	Fecha Vigencia	Fondo Fideicomiso	Código Fondo	Formato	Unidad Captura	SubCuenta	Consecutivo	Cuenta PUC	Signo	
	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	+

15.1.4.1. INGRESAR PARAMETRO PUC

Parámetro PUC - Ingresar

Ingresar Datos

Fecha Registro: 15/07/2009

Tipo Fondo Fideicomiso: [dropdown]

Codigo Fondo Fideicomiso: [input]

Formato: [dropdown]

Unidad Captura: [input]

SubCuenta: [input]

Consecutivo: [input]

Cuenta PUC: [input]

Signo: [input]

Aceptar Cerrar

15.1.4.1. MODIFICAR PARAMETRO PUC

Parámetro PUC - Modificar

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

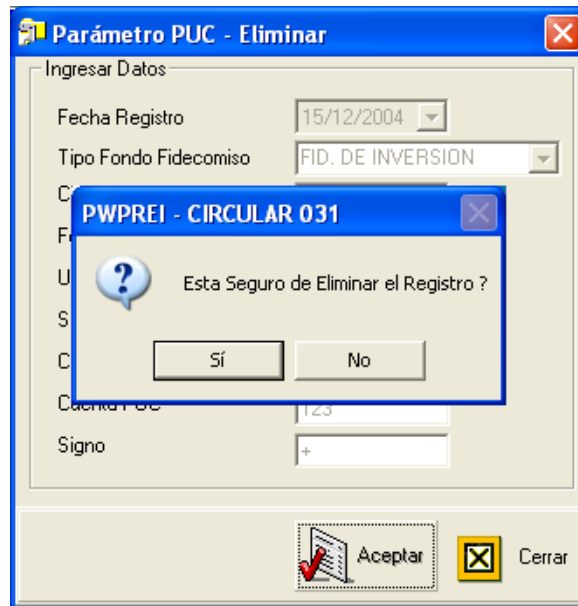
Buscar Parámetro PUC

Buscar Por...

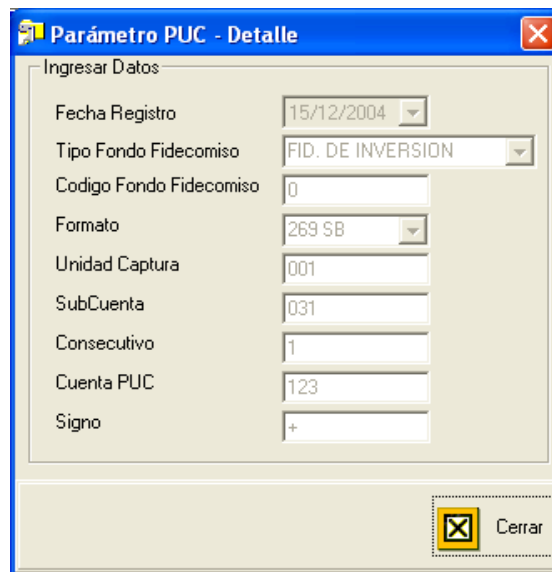
15/07/2009	<input type="checkbox"/> Fecha Vigencia
	<input type="checkbox"/> Formato
	<input type="checkbox"/> Tipo Fondo Fidecomiso
<input checked="" type="checkbox"/> Todos los Registros	

Aceptar Cerrar

15.1.4.3. ELIMINAR PARAMETRO PUC



15.1.4.4. DETALLE PARAMETRO PUC



15.1.5. FILTROS

Circular 031 - [Parámetro Filtro]

Archivo Parámetros 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
	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
	NINGUNO	SI	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO
	OPCFTRM	NO	SI	NO	NO	NO	SI	NO	NO
	PLAZOEFEF	SI	SI	SI	SI	SI	SI	NO	NO
	PUTSB	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
	PUTST	NO	SI	NO	NO	NO	SI	SI	SI
	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

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

The screenshot shows a dialog box titled "Parámetro Filtro - Modificar" with a close button (X) in the top right corner. Below the title bar is a section labeled "Ingresar Datos" containing several dropdown menus. The values are: Tipo Compromiso: CALLSB, Tipo Inversion: NO, Mercado: SI, Tipo Emisor: NO, Tipo Deuda: NO, Tasa: NO, Moneda: SI, Posicion: SI, and Swap: SI. At the bottom of the dialog, there are two buttons: "Aceptar" (with a checkmark icon) and "Cerrar" (with a close icon).

15.1.5.3. ELIMINAR FILTROS

The screenshot shows a dialog box titled "Parámetro Filtro - Eliminar" with a close button (X) in the top right corner. Below the title bar is a section labeled "Ingresar Datos" containing dropdown menus for "Tipo Compromiso" (CALLSB) and "Tipo Inversion" (NO). Below this, there is a confirmation dialog box titled "PWPREI - CIRCULAR 031" with a question mark icon and the text "Esta Seguro de Eliminar el Registro?". It has two buttons: "Si" and "No". Below the confirmation dialog, the "Parámetro Filtro - Eliminar" dialog is partially visible, showing the "Swap" dropdown menu set to "SI" and the "Aceptar" and "Cerrar" buttons at the bottom.

15.1.5.4. DETALLE DE FILTROS

Parámetro Filtro - 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

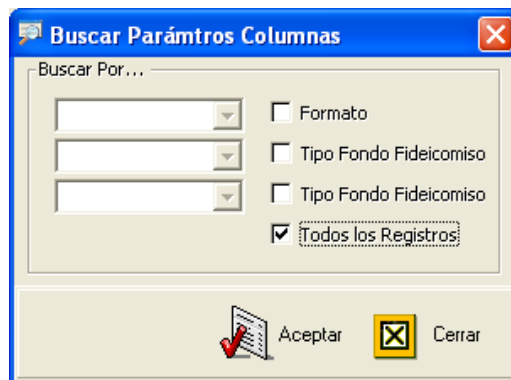
15.1.6. COLUMNAS

Circular 031 - [Parámetros Columnas]

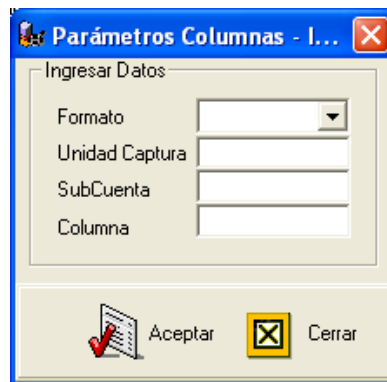
Archivo Parámetros Formatos Informes

Parámetros	Formato	Unidad Captura	Subcuenta	Columna
	269 SB	002	005	3
	269 SB	002	005	4
	269 SB	002	005	5
	269 SB	002	005	6
	269 SB	002	005	7
	269 SB	002	005	8
	269 SB	002	005	9
	269 SB	002	005	10
	269 SB	002	005	11
	269 SB	002	005	12
	269 SB	002	005	13
	269 SB	002	005	14
	269 SB	002	005	15
	269 SB	002	005	16
	269 SB	002	005	17
	269 SB	002	005	18
	269 SB	002	005	19
	269 SB	002	005	20
	269 SB	002	005	21
	269 SB	002	005	22
	269 SB	002	005	23
	269 SB	002	005	24
	269 SB	002	005	25

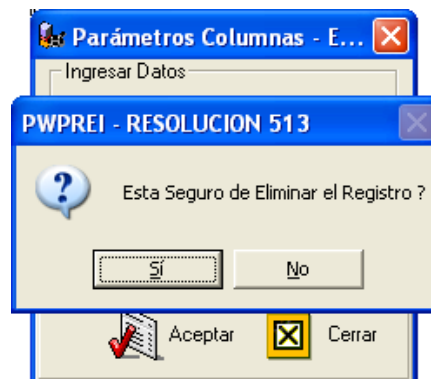
15.1.6.1. BUSCAR PARAMETROS COLUMNAS



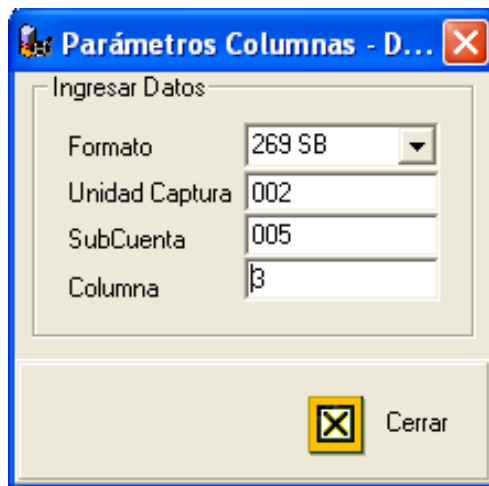
15.1.6.2. INGRESAR PARAMETROS COLUMNAS



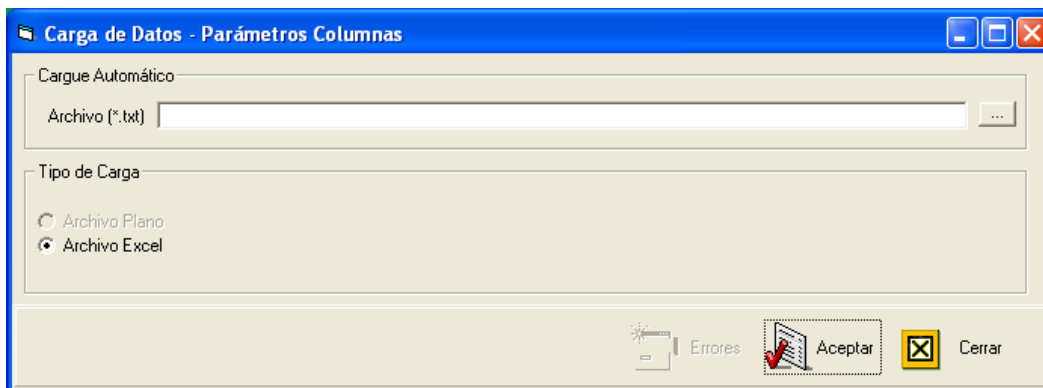
15.1.6.3. ELIMINAR PARAMETROS COLUMNAS



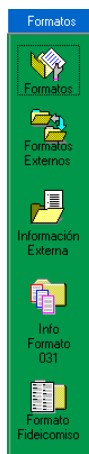
15.1.6.4. DETALLE PARAMETROS COLUMNAS



15.1.6.5. CARGAR DATOS DE PARAMETROS COLUMNAS



15.2. OPCIÓN FORMATOS



15.2.1. FORMATOS

Circular 031 - [Formatos]

Archivo Parámetros Formatos Informes

Formatos	Fecha	Código	Unidad Captura	SubCuenta	Descripción	Aplicación	Tipo Riesgo	Factor Riesgo	Factor Riesgo2	Periodo
	18/11/2004	332 SB	002	005	VALOR EN RIESGO TOTAL	ACTIVO	3	0	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
	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
	18/11/2004	331 SB	003	018	Inversiones en fondos de inversión en el	ACTIVO	3	15	0	0
	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 naci	ACTIVO	3	13	0	1

15.2.1.1. INGRESAR FORMATOS

Formatos - Ingresar

Ingresar Datos

Fecha Vigencia: 18/07/2009

Código: []

Unidad de Captura: []

SubCuenta: []

Descripción: []

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
Descripción: 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

15.2.1.2. BUSCAR FORMATOS

Buscar Formatos

Buscar Por...

15/07/2009
 Fecha Vigencia
 Código
 Todos los Registros

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
Descripción	VALOR EN RIESGO TOTAL
Aplicación	ACTIVO
Tipo Registro	3
Factor Riesgo	0
Factor Riesgo 2	0
Período	0
Período 2	0
Método Carga	AUTOMATIC

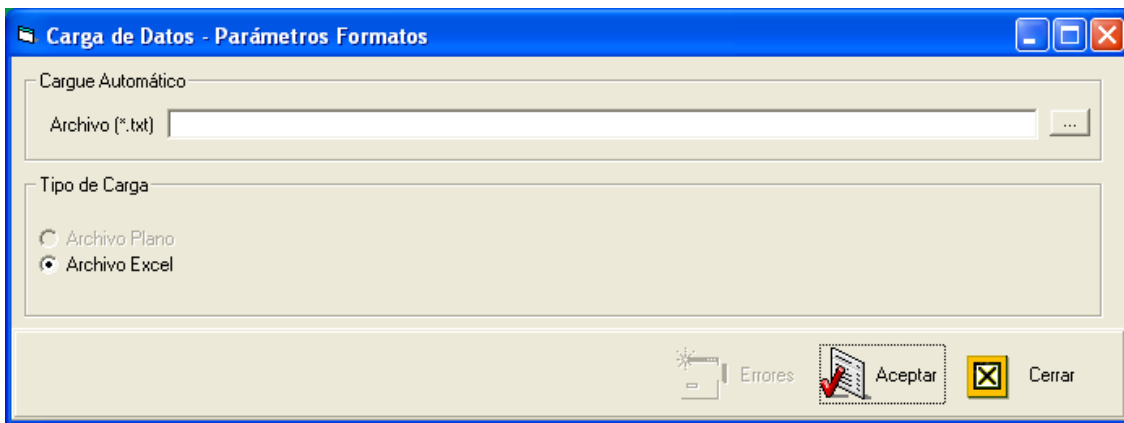
15.2.1.4. DETALLE FORMATOS

Formatos - Detalle

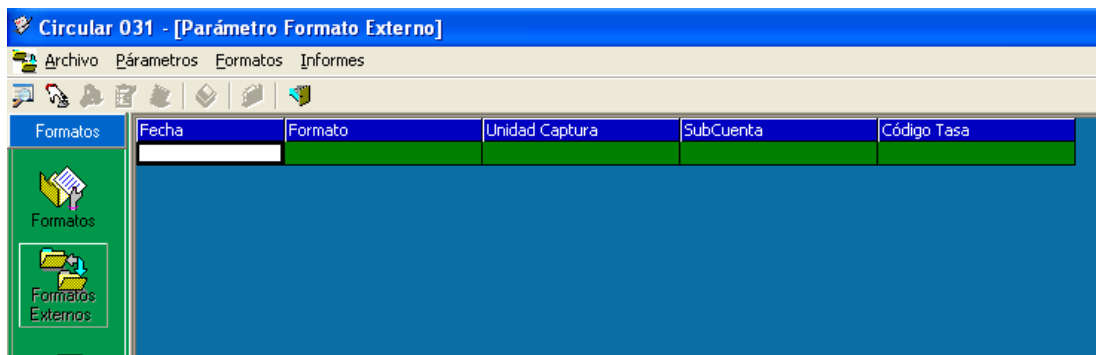
Ingresar Datos

Fecha Vigencia	18/11/2004
Código	332 SB
Unidad de Captura	002
SubCuenta	005
Descripción	VALOR EN RIESGO TOTAL
Aplicación	ACTIVO
Tipo Registro	3
Factor Riesgo	0
Factor Riesgo 2	0
Período	0
Período 2	0
Método Carga	AUTOMATIC

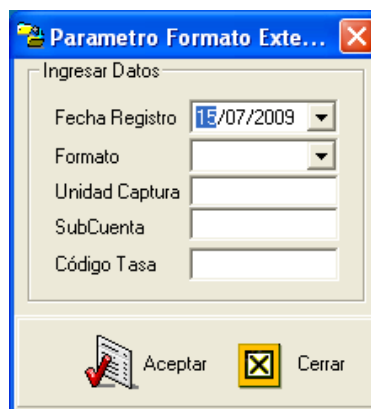
15.2.1.5. CARGAR DATOS DE FORMATOS



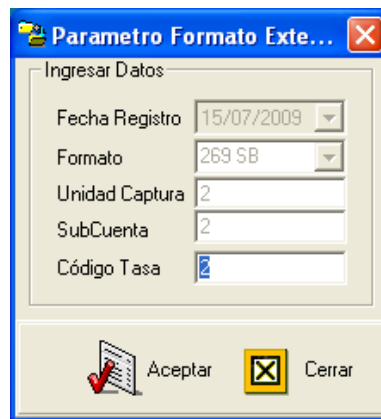
15.2.2. FORMATOS EXTERNO



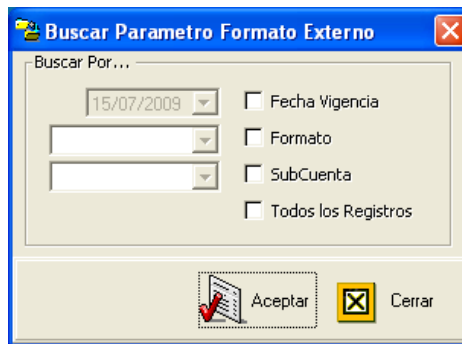
15.2.2.1. INGRESAR FORMATOS EXTERNO



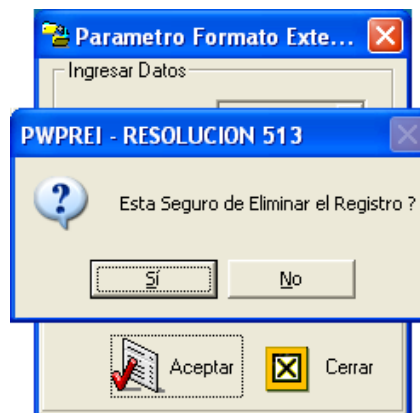
15.2.2.1. MODIFICAR FORMATOS EXTERNO



15.2.2.2. BUSCAR FORMATOS EXTERNO



15.2.2.3. ELIMINAR FORMATOS EXTERNO



15.2.2.4. DETALLE FORMATOS EXTERNO

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 031 - [Información Formato Externo]

Archivo Parámetros Formatos Informes

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: 15/07/2009

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

Aceptar Cerrar

15.2.3.2. BUSCAR INFORMACION EXTERNA

Información Formato Externo

Buscar Por...

15/07/2009

Fecha Vigencia

Formato

SubCuenta

Todos los Registros

Aceptar Cerrar

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 - RESOLUCION 513

Esta Seguro de Eliminar el Registro ?

Valor Presente: 0

Duracion: 0

Cambio Tasa: 0

VeR: 0

15.2.3.4. DETALLE INFORMACION EXTERNA

Info Formato Externo - Detalle

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

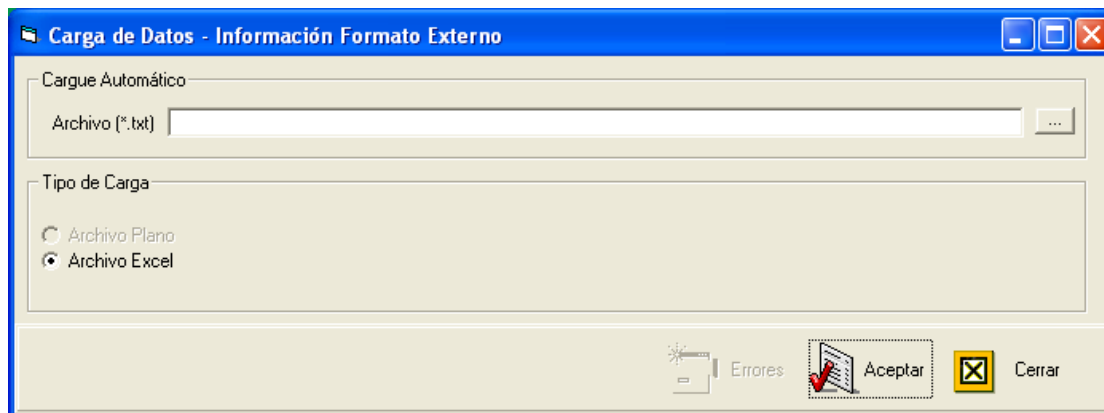
Valor Presente: 0

Duracion: 0

Cambio Tasa: 0

VeR: 0

15.2.3.5. CARGAR DATOS DE INFORMACION EXTERNA



15.2.4. INFORMACION FORMATO 031

Circular 031 - [Información Formato 031]							
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
	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
	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
	16/11/2004	OPCFTRM	NO APLICA	DIVISA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	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 APLICA	NO APLICA	NO APLICA	NO APLICA
	16/11/2004	NO APLICA	NO APLICA	NO BURSATIL	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
	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
	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
	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
	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

15.2.4.1. INGRESAR INFORMACION FORMATO 031

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

15.2.4.2. MODIFICAR INFORMACION FORMATO 031

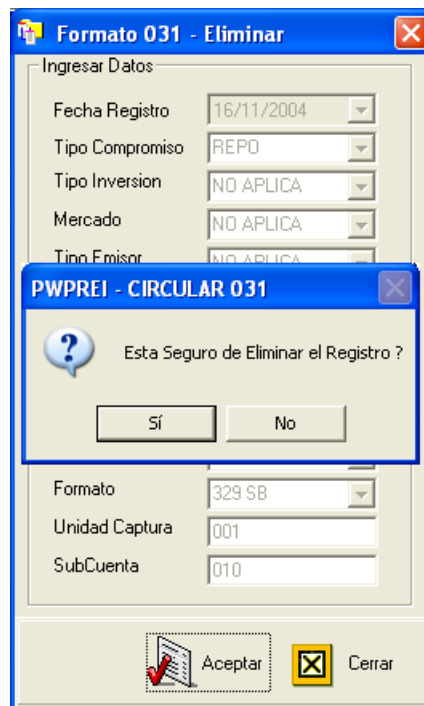
Formato 031 - Modificar

Ingresar Datos

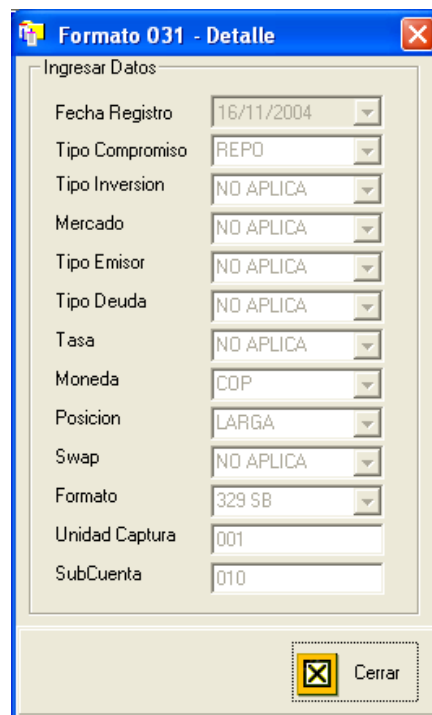
Fecha Registro	16/11/2004
Tipo Compromiso	REPO
Tipo Inversion	NO APLICA
Mercado	NO APLICA
Tipo Emisor	NO APLICA
Tipo Deuda	NO APLICA
Tasa	NO APLICA
Moneda	COP
Posicion	LARGA
Swap	NO APLICA
Formato	329 SB
Unidad Captura	001
SubCuenta	010

Aceptar Cerrar

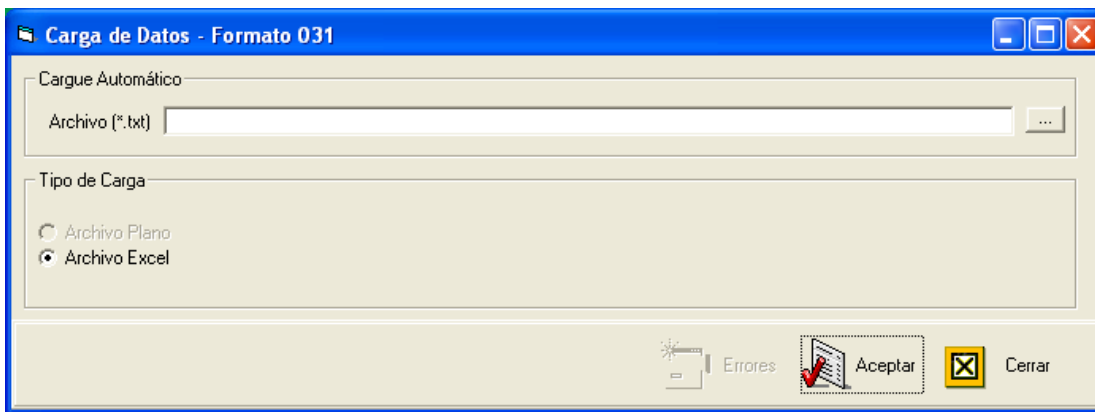
15.2.4.3. ELIMINAR INFORMACION FORMATO 031



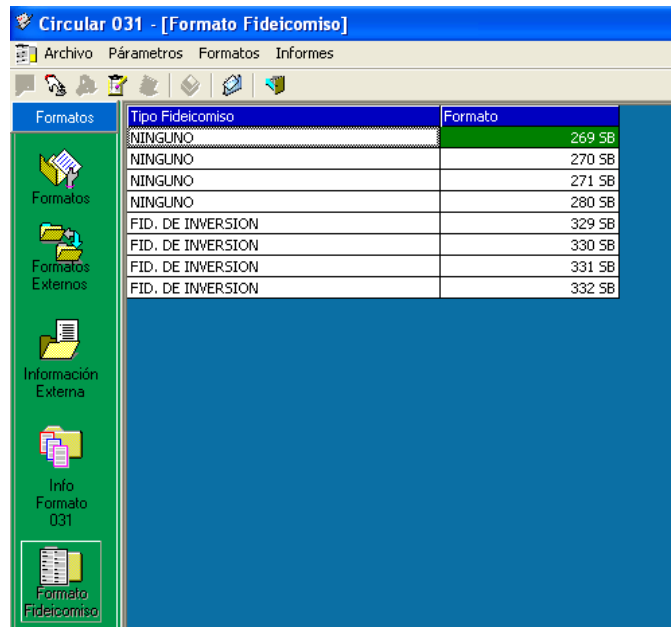
15.2.4.4. DETALLE INFORMACION FORMATO 031



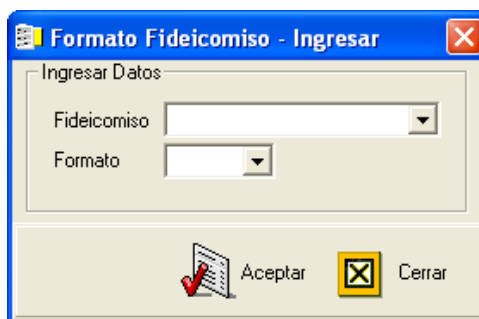
15.2.4.5. CARGAR DATOS DE INFORMACION FORMATO 031



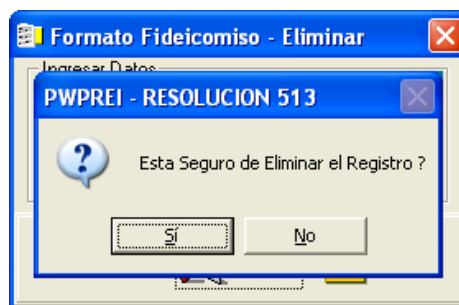
15.2.5. FORMATO FIDEICOMISO



15.2.5.1. INGRESAR FORMATO FIDEICOMISO



15.2.5.2. ELIMINAR FORMATO FIDEICOMISO



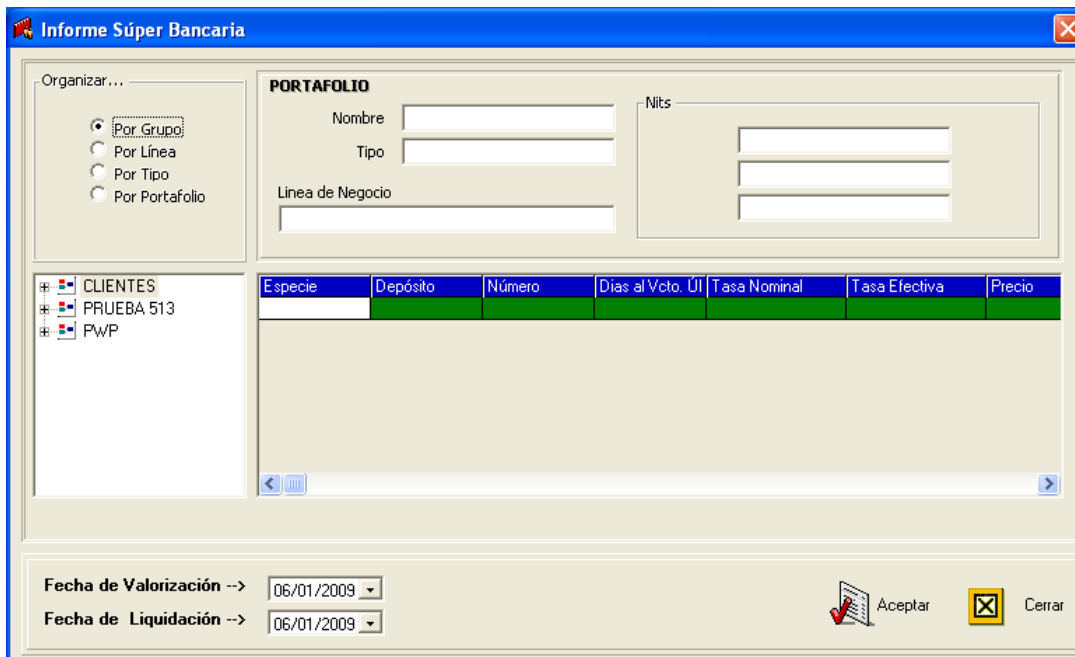
15.3. OPCION INFORMES



15.3.1. GEN IMC / FORMATO 230



Primero se debe seleccionar la fecha del Portafolio y a continuación aparece la siguiente pantalla.



15.3.2. F-DIVISAS

INFORMES DIVISAS

Organizar...
 Por Grupo
 Por Línea
 Por Tipo
 Por Portafolio

PORTAFOLIO 07/03/2019

Nombre: Nits:
 Tipo:
 Línea de Negocio:

Especie	Depósito	Número	Días al Vcto. UI	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

Fecha de Valorización -> 07/03/2019
 Fecha de Liquidación -> 07/03/2019

F388-393 VER FTO Generar Cerrar

15.3.3. INFORME SUPERBANCARIA

Fecha Portafolios

Fecha Medición 06/01/2009

Aceptar Cerrar

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

PORTAFOLIO

Nombre: Nits:
 Tipo:
 Línea de Negocio:

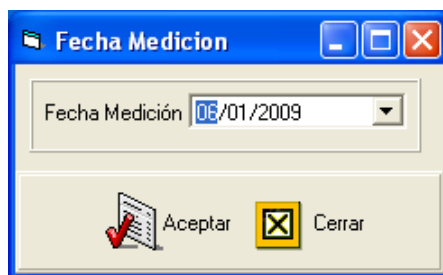
Especie	Depósito	Número	Días al Vcto. UI	Tasa Nominal	Tasa Efectiva	Precio

CLIENTES
 PRUEBA 513
 PwP

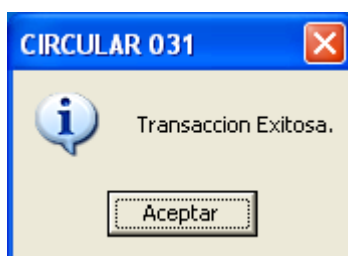
Fecha de Valorización -> 06/01/2009
 Fecha de Liquidación -> 06/01/2009

Aceptar Cerrar

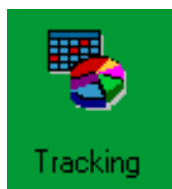
15.3.4. PLANO



Primero se debe seleccionar la fecha del Portafolio y a continuación aparece la siguiente pantalla.

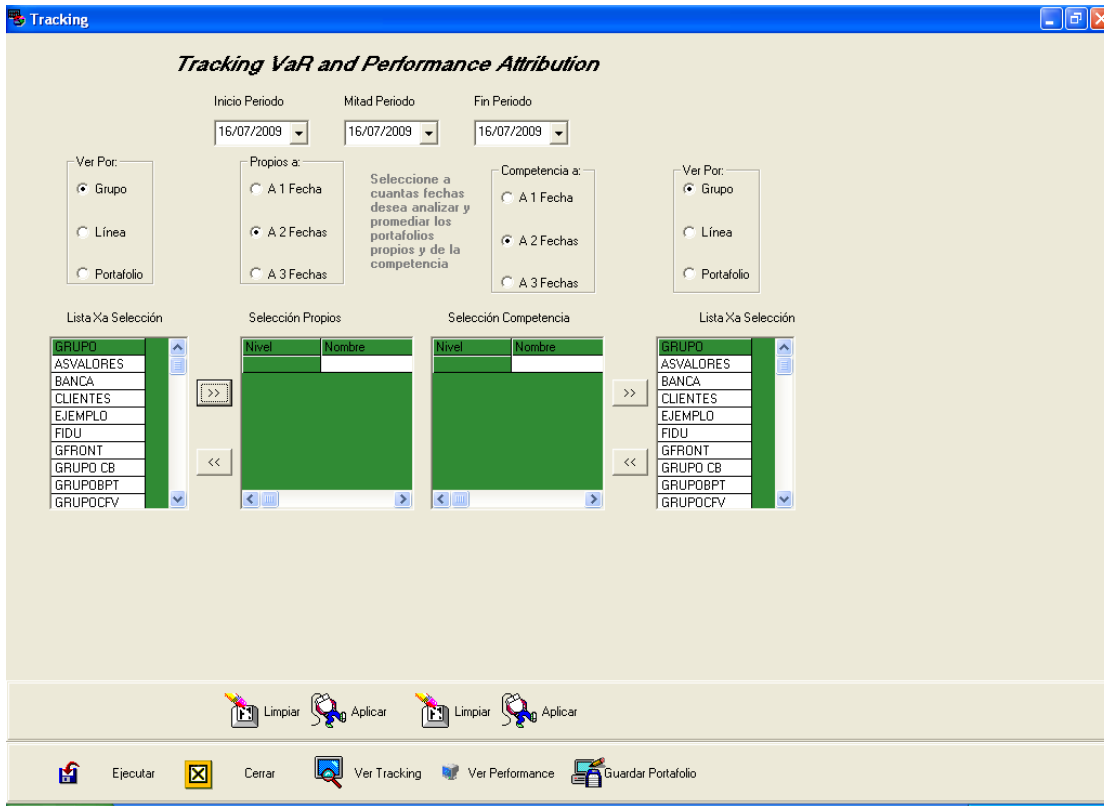


TRACKING VAR AND PERFORMANCE ATTRIBUTION



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.

Inicio Periodo	Mitad Periodo	Fin Periodo
01/11/2005 ▼	15/11/2005 ▼	18/11/2005 ▼

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.

Propios a:	Competencia a:
<input checked="" type="radio"/> A 1 Fecha	<input checked="" type="radio"/> A 1 Fecha
<input type="radio"/> A 2 Fechas	<input type="radio"/> A 2 Fechas
<input type="radio"/> A 3 Fechas	<input type="radio"/> A 3 Fechas

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.

Ver Por:
<input checked="" type="radio"/> Grupo
<input type="radio"/> Línea
<input type="radio"/> Portafolio

Nivel	Nombre
GRUPO	ASVALDORES

Nivel	Nombre
GRUPO	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 Limpia 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.

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

Aceptar

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.

Resultados Performance							
Factor	Monto	Perf. Anual	Factor	Monto	Perf. Anual	Diferencia \$	Diferencia %
CDTLBV10D	1,036,201.12	0.0	CDTLBV10D	0.0	0.0	-1,037,112.54	0.0
TBFT07220808	609,030,000.0	0.0	TBFT07220808	0.0	0.0	-609,029,088.58	0.0
TBVT10250613	0.0	0.0	TBVT10250613	65,579,065.62	0.0	610,066,201.12	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.

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	TIPODEST	TIPOCPR	TIPCONTR	TIPOINVER	PUNTA	ESPECIE	FECEMI	FECVEN	EVENTO	VALFTE	PUCBAS	SUFIJO
FINANCIERO	PROPIO	REPO	BAN	NEGOCIABLE	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	COMPAÑÍAS 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 título para el portafolio de la Entidad VENTA: Venta de un título 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 Título adquirido o vendido

FECEMI: Es la fecha de la Emisión del título

FECVEN: Es la fecha del Vencimiento del título

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, parametrize 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 parametrize.

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 título
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 periodo)
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 Débito

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. Comuníquese 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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
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	Movimiento
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	Movimiento
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	Movimiento
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 Ítems 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 EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	XXXX	NEGOCI ABLE	ACTI VA	NA	NA	NA			1222X XXX	XX

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 C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTI A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	XXXX	NEGOCI ABLE	ACTI VA	NA	NA	NA			1232X XXX	01

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	Movimiento
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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUN A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUNA NO		NEGOCI ABLE	COMP RA	XXXX	NA	NA			1304X XXX	XX O

Contabilización Compra de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
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	Movimiento	
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	Movimiento	
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 título

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 título

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	Movimiento	
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	Movimiento	
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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA	ESPECIE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCB AS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NING UNO	NA	NEGOCI ABLE	COMP RA	XXXX	NA	NA			1304X XXX	XX XX

Contabilización Compra de Derechos de transferencia de inversiones negociables en títulos o valores de deuda.

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
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	Movimiento
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	Movimiento
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	Movimiento
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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNT A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUNA NO		VENCIMI ENTO	COMP RA	XXXX	NA	NA			1308X XXX	XX XX

Contabilización Compra de inversiones permanentes

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 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 título

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 título

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

130814	130815	130816	130817	130818	130842	130895
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNT A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUN A NO		VENCIMI ENTO	COMP RA	XXXX	NA	NA			1308X XXX	XX 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	Movimiento
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	Movimiento
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	Movimiento
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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUNA NO		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	Movimiento
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)

TIPOCPR	Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	51250901	01	DEBITO
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	41160501	01	DEBITO
SIMULTANEA	CUBRIR	PERDIDA	34130501	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	34130501	01	DEBITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41160501	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	UTILIDAD	41250901	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	8177XXXX	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO

Contabilización del incremento del valor del título

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 título

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

“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
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

131314	131315	131316	131317	131318	131342	131395
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUN A	ESPEC IE	FEC MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUNA NO		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	Movimiento
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	Movimiento
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	1313XXXX	01	CREDITO
SIMULTANEA	CUBRIR	VALTIT	27959501	01	DEBITO

Contabilización del incremento del valor del título

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 título

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	XX

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	Movimiento
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	Movimiento
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"

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	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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNT A	ESPEC IE	FEC MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUN O	NA	PERMAN ENTE	COMP RA	XXXX	NA	NA			1316X XXX	XX

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	Movimiento
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	Movimiento
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 título

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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPECIE IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCB AS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	NINGUNA NO		PERMAN ENTE	COMP RA	XXXX	NA	NA			13160 401	XX

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 título

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
VALORAR	VALORIZAI	13160401	01	DEBITO
VALORAR	VALORIZAI	34155001	01	CREDITO

Contabilización de la disminución del valor del título

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

Código	Nombre 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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ 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	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 C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	NEGOCI ABLE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1331X XXX	XX 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	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	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	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	133195
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ 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 C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	NEGOCI ABLE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1331X XXX	XX 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	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		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	Movimiento	
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 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

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 Ítems 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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPECIE IE	FECEN MI	FECVEN EN	EVEN TO	VALFTE	PUCBAS S	SUFIJO O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	VENCIMI ENTO	PASIV A	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	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	CXP	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	8176XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	83050101	01	DEBITO	
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01		CREDITO

INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO	
-----------	--------	----------	----	--------	--

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Item
TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133301	133302	133303	133304	133305	133306	133307	133308	133309	133310	133311
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

TIPOPU C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	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 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	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	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	CXP	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	133342	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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	VENCIMI ENTO	PASI VA	XXXX	NA	NA			1333X XXX	XX 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 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	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	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	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	CXP	2228XXXX	01	CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1333XXXX	01	CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	01	CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	63070501	01	DEBITO

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMILTANEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTANEA

133314	133315	133316	133317	133318	133342	133395
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

TIPOPU C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	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 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	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	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	Movimiento
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	Movimiento
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	CXP	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 Ítems 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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FEC MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFIJ O
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	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	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 C	TIPOD EST	TIPOCPR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1335X XXX	XX O

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		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	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	Movimiento
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

133514	133515	133516	133517	133518	133542	133595
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFIJ O

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	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	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 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	Movimiento	
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO	
INCUMPLIR	CXP	2228XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	1335XXXX	01		CREDITO
INCUMPLIR	VALTIT	64071001	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	

CONTABILIZACION OPERACIONES SIMULTÁNEAS – Seleccionar para el Ítem TIPOCPR - SIMULTÁNEA

133514	133515	133516	133517	133518	133542	133595
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

TIPOPU C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1335X XXX	XX O

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	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	CXP	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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	NEGOCI ABLE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1332X XXX	XX XX

Contabilización Derechos de transferencia de inversiones negociables 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	1332XXXX	01	DEBITO
NEGOCIAR	VALTIT	1306XXXX	01	CREDITO
NEGOCIAR	VALTIT	640710XX	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 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	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	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	Movimiento	
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	Movimiento	
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	Movimiento	
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
--------	-------	--------	--------	--------	------	-------	------	------	------	------	-------	-------

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			1332X XXX	XX

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	Movimiento
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	Movimiento
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.

TIPOPU C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	REPO	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1336X XXX	XX

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.

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	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	Movimiento
INCUMPLIR	VALOPE	2220XXXX	01	DEBITO
INCUMPLIR	CXP	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 Cuentas 133601 - 133602

TIPOPU C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ÁNEA	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1336X XXX	XX O

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	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	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	Movimiento	
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 C	TIPOD EST	TIPOC PR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTE A	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS S	SUFIJ O

FINANC IERO	PROPI O	REPO	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 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	CXP	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 C	TIPOD EST	TIPOCPR	TIPCON TRA	TIPOINV ER	PUNTA	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJO
FINANC IERO	PROPI O	SIMULT ANEA	NA	PERMAN ENTE	PASI VA	XXXX	NA	NA			1336X XXX	XX O

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	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	Movimiento
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	PUNTE	ESPEC	FECFE	FECV	EVEN	VALF	PUCBAS	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			1515X XXX	XX

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	Movimiento
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 EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUN TA	ESPE CIE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBA S	SUFI 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 C	TIPOD EST	TIPOCP R	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA	ESPEC IE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFJ 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	PYG CPR	16879501	07	DEBITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FUTURO DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPO CPR – 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 Ítems 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.

TIPO PUC	TIPO DE EST	TIPO CPR	TIPO CONTRA	TIPO INVER	PUNTA	ESPECIE	FECEMI	FECVEN	EVEN TO	VALFTE	PUCBAS	SUFIJO
FINANCIERO	PROPIO	FORWARDU	NA	COBERTURA	XXXX	XXXX	NA	NA			1566XXX	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	PYG CPR	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	PYG CPRD	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	Movimiento
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

DERECHO							
231505	231506	231507	231508	231510	231515	231516	231520
OBLIGACION							
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	TIPOD	TIPOCP	TIPCON	TIPOIN	PUNTE	ESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBAS	SUFIJ
--------	-------	--------	--------	--------	-------	-------	------	------	------	------	--------	-------

C	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	FORWA RDP	ANA	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	PYG CPR	27959501	01	CREDITO

CONTABILIZACION OPERACIONES FORWARD DE COBERTURA – Seleccionar para el Ítem TIPO CPR – 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 Ítems 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.

TIPO PUC	TIPO DE EST	TIPO CPR	TIPO CONTRA	TIPO INVER	PUNTA	ESPECIE	FECEMI	FECVEN	EVEN TO	VALFTE	PUCBAS	SUFIJO
FINANCIERO	PROPIO	FORWARDP	NA	COBERTURA	XXXX	XXXX	NA	NA			2365XXX	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	PYG CPR	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	PYG CPRD	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	TIPOCPT	TIPCON	TIPOIN	PUNTESPEC	FECE	FECV	EVEN	VALF	PUCBAS	SUFIJ
--------	-------	---------	--------	--------	-----------	------	------	------	------	--------	-------

C	EST	R	TRA	VER	A	IE	MI	EN	TO	TE	S	O
FINANC IERO	PROPI O	FORWANA RDP		ESPECU LA	XXXX	XXXX	NA	NA			2316X XXX	XX

Contabilización Contratos Futuros de Especulación al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
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 C	TIPOD EST	TIPOCPR	TIPCON TRA	TIPOIN VER	PUNTA	ESPECIE	FECE MI	FECV EN	EVEN TO	VALF TE	PUCBAS	SUFIJO
FINANC IERO	PROPI O	FORWANA RDP		COBETU RA	XXXX	XXXX	NA	NA			2366X XXX	XX O

Contabilización Contratos Futuros de Cobertura al momento de Constitución del Compromiso

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
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

Evento	Valor Fuente	Código Cuenta	Sufijo	Movimiento
--------	--------------	---------------	--------	------------

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

2. LIQMED

Especies/Renta Variable - Detalle

Código: LIQBAJ Cod. Super:

Calificación: ISIN:

Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION

Emisor: ZPW Moneda:

Tipo Título: Acciones

Descripción: USADA PARA PARAMTRS CONTABLES

Categoría: Grupo de Calificación:

Estado de Negociación: ACTIVO Fecha Patrimonial: 03/08/2010 Valor Patrimonial: 0.00000000

Bursatilidad:

Tipo: ALTA Fecha Nominal: 03/08/2010 Valor Nominal: 0.00000000

Porcentaje: 0.000

Fecha Fiscal: 29/12/1899 Valor Fiscal: 0

Acc. Circulación: 0 Portafolio Destino:

Factor1: Factor 2:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible:

Calificadora: Otra

Cerrar

Especies/Renta Variable - Detalle

Código: LIQMED Cod. Super:

Calificación: ISIN:

Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION

Emisor: ZPW Moneda:

Tipo Título: Acciones

Descripción: USADA PARA PARAMTRS CONTABLES

Categoría: Grupo de Calificación:

Estado de Negociación: ACTIVO Fecha Patrimonial: 03/08/2010 Valor Patrimonial: 0.00000000

Bursatilidad:

Tipo: NINGUNA Fecha Nominal: 03/08/2010 Valor Nominal: 0.00000000

Porcentaje: 0.000

Fecha Fiscal: 29/12/1899 Valor Fiscal: 0

Acc. Circulación: 0 Portafolio Destino:

Factor1: Factor 2:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible:

Calificadora: Otra

Cerrar

3. LIQALT

Especies/Renta Variable - Detalle

Código: LIQALT Cod. Super:
 Calificación: ISIN:
 Estado: ACTIVO Tipo Especie: ACCION
 Emisor: ZPW Moneda:
 Tipo Título: Acciones
 Descripción: USADA PARA PARAMTRS CONTABLES
 Categoría: Grupo de Calificación:

Estado de Negociación: ACTIVO Fecha Patrimonial: 03/08/2010 Valor Patrimonial: 0.00000000
 Fecha Nominal: 03/08/2010 Valor Nominal: 0.00000000
 Fecha Fiscal: 129/12/1899 Valor Fiscal: 0
 Acc. Circulación: 0
 Portafolio Destino:

Bursatilidad
 Tipo: ALTA
 Porcentaje: 0.000
 Factor1: Factor 2:

Superfinanciera
 Código SF: Aval: Emisión: Fungible:
 Calificadora: Otra

4. COP/TRM

Especies/Renta Variable - Detalle

Código: COP/TRM Cod. Super:
 Calificación: ISIN:
 Estado: ACTIVO Tipo Especie: DIVISA
 Emisor: FORWD Moneda: TRM
 Tipo Título: FAVOR ASIGNAR NOMBRE TITULO
 Descripción: FORWARD PESO/DOLAR
 Categoría: Grupo de Calificación:

Estado de Negociación: ACTIVO Fecha Patrimonial: 04/08/2010 Valor Patrimonial: 0.00000000
 Fecha Nominal: 04/08/2010 Valor Nominal: 0.00000000
 Fecha Fiscal: 30/12/1899 Valor Fiscal: 0
 Acc. Circulación: 0
 Portafolio Destino:

Bursatilidad
 Tipo: NINGUNA
 Porcentaje: 0.000
 Factor1: Factor 2:

Superfinanciera
 Código SF: Aval: Emisión: Fungible:
 Calificadora: Otra

Especies/Renta Fija - Detalle

Código: BBPO02108D1 Emisor: BPO Nemo Equiv Renta Fija:
 Descripción: Moneda: COP ISIN1: COB02CB00117 ISIN2:
 Calificación: Indicador: IRFBVC CurCDT:
 Estado: ACTIVO Cod. Super:
 FecMaxReinv: 01/01/4000 Título: BONOS ORDINARIOS Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera
 Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora:

Fecha
 Emisión: 09/06/2010 Vencimiento: 09/12/2011

Tasa
 Referencia: IB1 Spread: 1.20000 Uso: PREVIA

Flujo
 Día: 0 Mes: 0 Número de Flujos: Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses
 Modalidad: MENSUAL Periodicidad: VENCIDA

Modalidad Pago de Reinversión
 Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo: CALCULO SIN DEFINIR Caja: CAJA SIN DEFINIR Calendario: COMERCIAL Tabla de Desarrollo: NO TIENE Rendimiento: INTERESES Comisión: VALOR Datos Faciales: SI Amortización: 100.000 Retefuente > 5: 0.000 Retefuente < 5: 0.000 Clase Factor 1: Clase Factor 2: Portafolio Destino:

Cerrar

Especies/Renta Fija - Detalle

Código: Emisor: Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: Moneda: ISIN1:

Calificación: Indicador: ISIN2:

Estado: Cod. Super: CurCDT:

FecMaxReinv: Titulo: Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora:

Fecha

Emisión: Vencimiento:

Tasa

Referencia:

Spread:

Uso:

Flujo

Día: Mes:

Número de Flújos

Cantidad: Aplica:

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: Periodicidad:

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: Periodicidad:

Calculo:

Caja:

Calendario:

Tabla de Desarrollo:

Rendimiento:

Comisión:

Datos Faciales:

Amortización:


Retefuente > 5:

Retefuente < 5:

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:

 Cerrar

Especies/Renta Fija - Detalle

Código: CDTFDT80 Emisor: FDT Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: Moneda: COP ISIN1:

Calificación: Indicador: IRFBVC ISIN2:

Estado: ACTIVO Cod. Super: CurCDT:

FecMaxReinv: 01/01/4000 Titulo: CDT FINDETER Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora:

Fecha

Emisión: 12/02/2002 Vencimiento: 12/02/2002

Tasa

Referencia: IB1

Spread: 0.00000

Uso: PREVIA

Flujo

Día: 0 Mes: 0

Número de Flujos: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: CUALQUIERA Periodicidad: VENCIDA

Calculo

Calculo: CALCULO SIN DEFINIR

Caja: CAJA SIN DEFINIR

Calendario: COMERCIAL

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: INTERESES

Comisión: VALOR

Datos Faciales: SI

Amortización: 100.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Especies/Renta Fija - Detalle

Código: SIMULA Emisor: GNA Nemo Equiv Renta Fija:
 Descripción: ESPECIE PAR CONTABLE SIM Moneda: COP ISIN1: 0
 Calificación: Indicador: IRFBVC ISIN2: 0
 Estado: ACTIVO Cod. Super: VACIO CurCDT:
 FecMaxReinv: 17/09/2003 Título: BONOS ORDINARIOS Categoría: Grupo Calificación:
 Superfinanciera:
 Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora: Otra

Fecha
 Emisión: 30/11/2010 Vencimiento: 30/11/2010


Tasa
 Referencia: FS Spread: 0.00000 Uso: ACTUAL

Flujo
 Día: 0 Mes: 0 Número de Flújos: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses
 Modalidad: DIARIA Periodicidad: ANTICIPADA

Modalidad Pago de Reinversión
 Modalidad: DIARIA Periodicidad: ANTICIPADA

Calculo: CALCULO SIN DEFINIR Caja: CAJA SIN DEFINIR Calendario: CORRIDO
 Tabla de Desarrollo: NO TIENE Rendimiento: INTERESES Comisión: VALOR
 Datos Faciales: NO Amortización: 0.000 Clase Factor 1:
 Retefuente > 5: 0.000 Retefuente < 5: 0.000 Clase Factor 2:
 Portafolio Destino:

 Cerrar

REPOC

Especies/Renta Fija - Detalle

Código: REPOC Emisor: GNA Nemo Equiv Renta Fija:

Descripción: ESPECIE PAR CONTABLE REP Moneda: COP ISIN1: 0

Calificación: Indicador: IRFBVC ISIN2: 0

Estado: ACTIVO Cod. Super: VACIO CurCDT:

FecMaxReinv: 17/09/2003 Título: BONOS ORDINARIOS Categoría: Grupo Calificación:

Superfinanciera

Código SF: Aval: Emisión: Fungible: Calificadora: Otra

Fecha

Emisión: 30/11/2010 Vencimiento: 30/11/2010

Tasa

Referencia: ES Spread: 0.00000 Uso: ACTUAL

Flujo

Día	Mes	Cantidad	Aplica
0	0	0	No Capitaliza

Número de Flujos

Cantidad: 0 Aplica: No Capitaliza

Modalidad de Pago de Intereses

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Modalidad Pago de Reinversión

Modalidad: NO APLICA Periodicidad: NO APLICA

Calculo: CALCULO SIN DEFINIR Caja: CAJA SIN DEFINIR

Calendario: CORRIDO

Tabla de Desarrollo: NO TIENE

Rendimiento: INTERESES

Comisión: VALOR

Datos Faciales: NO

Amortización: 0.000

Retefuente > 5: 0.000

Retefuente < 5: 0.000

Clase Factor 1:

Clase Factor 2:

Portafolio Destino:


INTERBANC

Especies/Renta Variable - Detalle

Código	INTERBANC	Cod. Super	VACIO
Calificación		ISIN	
Estado	ACTIVO	Tipo Especie	DIVISA
Emisor	USA	Moneda	TRM
Tipo Título	Divisas		
Descripción	ESPECIE PAR CONTABLE INTERBANC		
Categoría		Grupo de Calificación	

Estado de Negociación	Fecha Patrimonial	Valor Patrimonial
ACTIVO	30/11/2010	0.00000000
Bursatilidad	Fecha Nominal	Valor Nominal
Tipo	30/11/2010	0.00000000
NINGUNA	Fecha Fiscal	Valor Fiscal
Porcentaje	30/12/1899	0
0.000	Acc. Circulación	0
Factor1	Factor 2	Portafolio Destino

Superfinanciera	Aval	Emisión	Fungible
Código SF			
Calificadora	Otra		

 Cerrar

18. GLOSARIO PWPREI

A continuación se presenta una lista de Palabras con su respectivo significado

B

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.

C

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 :

$$\text{Corr}(i,j) = \text{COV}(i,j) / (s_i * s_j)$$

i = Activo 1 j = Activo 2

s_i = Volatilidad del activo 1 s_j = 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 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.

$$\text{COV}(i,j) = \text{SUMA} (R_i - R_1) * (R_j - R_2) / (n - 1)$$

i = Activo 1 j = Activo 2

R_i = Rendimiento del activo 1

R_j = Rendimiento del activo 2

R_1 = Rendimiento promedio del activo 1 R_2 = 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 cambian 1% (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.

E

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 causarían 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.

I

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.

P

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.

$$R_i = \ln (P_t / P_{t-1}).$$

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.

T

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.