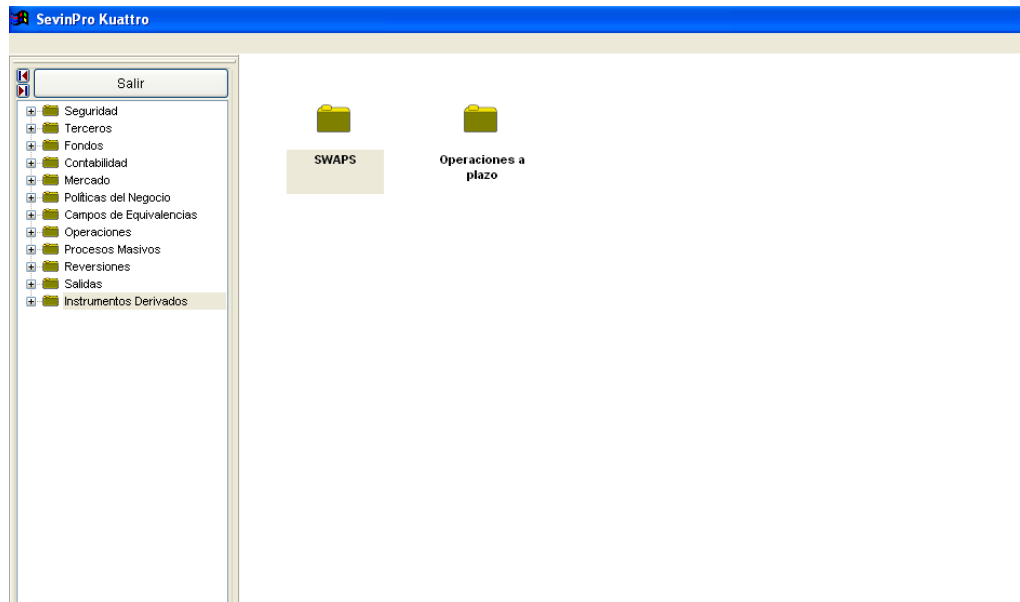


## 17 OPERACIONES DERIVADOS

En el aplicativo de Sevinpro4, en el menú aparece la opción Instrumentos derivados.



### ➤ Operaciones Swaps.

#### Creación Especie Swaps / Datos Faciales

The screenshot shows the 'Creacion Especie Swaps' form. At the top is a blue header bar with the title 'Creacion Especie Swaps'. Below the header is a toolbar with six icons: a magnifying glass, a document, a globe, a magnifying glass over a document, a document with a magnifying glass, and a document with a magnifying glass. The main area is titled 'Datos Faciales' and contains several input fields and dropdown menus. The fields are arranged in two columns. The left column contains: 'Código del título' (text box), 'Descripción' (text box), 'Tipo de Producto' (dropdown), 'Némo técnico' (text box), 'Isin 2' (text box), 'Cusip' (text box), 'Serie' (text box), 'País' (dropdown), 'Periodo Base Años' (dropdown), 'Mercado informador' (dropdown), 'Tipo de Inversión' (dropdown), and 'Al Descuento (S/N)' (radio buttons for 'Si' and 'No'). The right column contains: 'Isin ANNA' (text box), 'Isin 1' (text box), 'Isin 3' (text box), 'NumEmisDCV' (text box), 'Fungible' (text box), 'Moneda' (dropdown with 'PESOS' selected), 'Periodo Base Dias' (dropdown), and 'Sufijo Mercado' (dropdown). At the bottom of the form, there is a 'Ir a Página' dropdown with 'Datos faciales' selected, and a 'Siguiente' button.

Cuando se cree una especie swap se debe diligenciar los siguientes campos:

- Descripción: en este campo se debe colocar el nombre que identificar la especie creada, Ejemplo: Swap tasa Fija Base 360 Int + Cap.
- Periodo Base en años: en este campo se debe seleccionar la base que se utilizara en el Swap. Ejemplo: 360

### Creación Especie Swaps / Contabilidad

**Creacion Especie Swaps**

**Contabilidad**

Combinacion Negociable [dropdown] Clasificaciones Habilitadas ☒

Combinacion Disponible Vta. [dropdown] ☐

Combinacion al Vencimiento [dropdown] ☐

ReteFuente (S/N) ☐ Si ☒ No

ReteFuente largo % [input: 0.0000]

ReteFuente corto % [input: 0.0000]

Limite Corto Años [input: 0]

Tiempo a partir de [dropdown]

Tipo de Retencion [dropdown]

Unidad de captura y subcuenta

Código GAP Negociable [input]

Código GAP al Vencimiento [input]

Código GAP Disponible [input]

Tipo de Swap [dropdown]

Ir a Página [dropdown: Contabilidad] [Anterior] [Siguiente]

En esta ventanilla se debe seleccionar los siguientes campos:

- Combinación Negociable: se debe seleccionar la combinación negociable que se creo para la contabilización de la operación Swap.
- Tipo de Swap: en este campo se determina el tipo de Swap a realizar con esta especie creada. Ejemplo: Flujos de interés y Flujos de Interés + Capital.

## Creación Especie Swaps / Condiciones de Valoración

The screenshot shows a software window titled "Creacion Especie Swaps". At the top, there is a toolbar with several icons. Below the toolbar, the section "Condiciones de Valoración" is displayed. It contains the following fields and controls:

- Modelo:** A dropdown menu.
- Orden:** A text input field with the value "0".
- Fecha exacta:** Radio buttons for "Si" (selected) and "No".
- Clasificación:** A dropdown menu.
- Nuevo:** A button.
- Table:** A table with 6 columns: "Edit", "Del", "Orden", "Clasific", "Modelo", and "Fecha exacta". The table is currently empty.
- Entidad calificadoradora:** A dropdown menu.
- Habilitado:** Radio buttons for "Si" (selected) and "No".
- Calificación:** A dropdown menu.
- Ir a Página:** A dropdown menu.
- Anterior:** A button.

En la pantalla de condiciones de valoración se debe diligenciar los siguientes datos:.

- **Modelo:** en este campo se coloca TIR.
- **Orden:** en este campo se coloca el numero 1
- **Clasificación:** en este campo se selecciona clasificación.
- **Habilitado:** en este campo se debe seleccionar habilitado.

Por último se le da clic en el botón guardar.

## CREACION SWAP

The screenshot shows a software window titled "Creacion Swaps". At the top, there is a toolbar with several icons. Below the toolbar, the main data entry section is displayed. It contains the following fields and controls:

- Codigo:** A text input field with the value "16".
- Compañia:** A dropdown menu.
- Portafolio:** A dropdown menu.
- Especie Swap:** A text input field with the value "0" and a "Buscar..." button.
- Contraparte:** A text input field with the value "0" and a "Buscar..." button.
- Partida a cubrir:** A text input field with the value "0" and a "Buscar..." button.
- Fecha Operación:** A date picker field showing " / / " and " : : ".
- Tasa Derecho:** A text input field with a "%" symbol.
- Tasa Obligación:** A text input field with a "%" symbol.
- Fecha Vencimiento:** A dropdown menu.

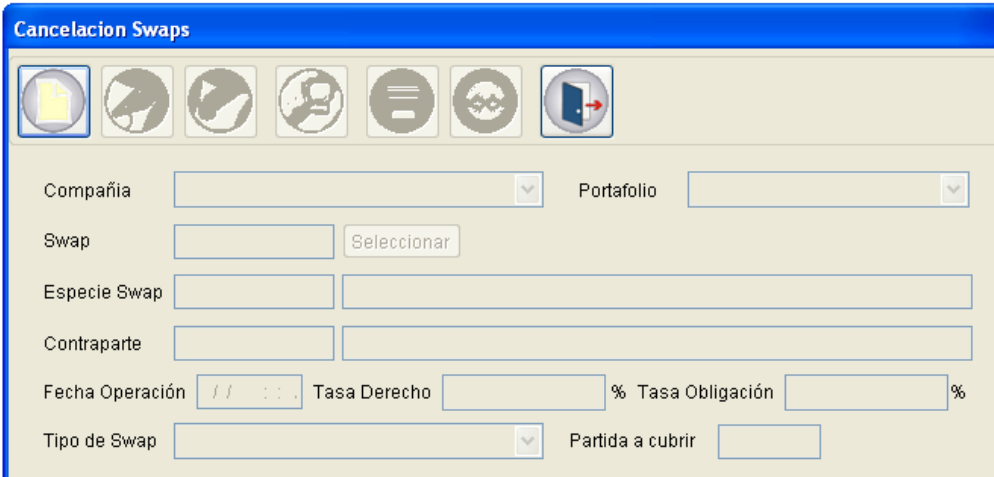
En esta opción se realiza la creación de la operación **swap** diligenciando los siguientes campos

- **Compañía:** en este campo se debe seleccionar la compañía con la que se va a realizar la operación **swap**.
- **Portafolio:** en este campo se debe seleccionar la compañía con la cual se realizara la operación **swap**
- **Especie swap:** dentro de este campo se selecciona la especie creada anteriormente, al momento de seleccionarla aparecerá los detalles de esta operación
- **Contraparte:** en este campo se selecciona la entidad con la que fue realizada la operación
- **Partida a cubrir:** en este campo se selecciona el titulo que va hacer objeto de la operación **swap**
- **Fecha de operación:** el sistema en este campo automáticamente toma la fecha de apertura como fecha de operación
- **Tasa derecho:** en este campo se coloca la tasa pactada con la contraparte para la valoración del derecho.
- **Tasa obligación:** el sistema en este campo coloca automáticamente la tasa facial del título objeto de la operación **swap**.
- **Fecha de vencimiento:** con relación a este campo aparece todos los flujos del título objeto de la operación brindando la oportunidad al operador de seleccionar la fecha de vencimiento de la operación **swap**

**Nota:** Es importante aclarar que si la operación Swap no cubre todos los flujos hasta el vencimiento del instrumento solamente se debe realizar swap de flujo de interés.

Se le da clic en el botón guardar y queda grabada la operación pendiente de confirmación.

### CANCELACION SWAP



The screenshot shows a software window titled "Cancelacion Swaps". It features a toolbar with icons for file operations (new, open, save, print, etc.) and a main form area. The form contains the following fields:

- Compañía:** A dropdown menu.
- Portafolio:** A dropdown menu.
- Swap:** A text input field followed by a "Seleccionar" button.
- Especie Swap:** A text input field.
- Contraparte:** A text input field.
- Fecha Operación:** A date picker showing "11 / 11 / 11".
- Tasa Derecho:** A text input field followed by a "%" symbol.
- Tasa Obligación:** A text input field followed by a "%" symbol.
- Tipo de Swap:** A dropdown menu.
- Partida a cubrir:** A text input field.

En esta pantalla se debe diligenciar los siguientes campos

- **Compañía:** en este campo se debe seleccionar la compañía a la cual se va a cancelar la operación **swap**
- **Portafolio:** en este campo se debe seleccionar la compañía con la cual se va a cancelar la operación **swap**
- **Swap:** en este campo se selecciona la operación **swap** que se va a cancelar
- **Especie Swap:** en este campo el sistema arroja el nombre de la operación **swap** por defecto
- **Contraparte:** en este campo el sistema arroja el nombre de la contraparte de la operación que se va a cancelar
- **Fecha operación:** en este campo el sistema muestra la fecha de apertura del sistema la cual es por defecto la fecha de cancelación de la operación **swap**
- **Tasa derecho:** en este campo aparece la tasa pactada con la contraparte para la valoración del derecho
- **Tasa de obligación:** en este campo aparece la tasa facial del título objeto de la operación
- **Tipo de Swap:** en este campo aparece la especie de la operación swap a cancelar
- **Partida a cubrir:** en este campo se muestra el título a cubrir

## PROCESOS OTROS MODULOS

**Confirmación:** La confirmación de la obligación y el derecho se realiza en el modulo de operaciones / confirmación / confirmación de operaciones.

**Creación tasas:** la creación de las tasas, se realiza en el modulo de mercados/ tasas/definición tasas “en este modulo se crean las siguientes tasas:

IBR: Indicador bancario de referencia

LIBD: Libor Dólar

CCS: Cross currency swap

PIPS: Puntos forwards

VETRM: Volatilidad estresada del dólar

**Definición de Plazos:** La definición de plazos se realiza en el modulo de mercados/ tasas/ definición plazos; en esta opción se debe colocar los plazos reportados por el proveedor de los indicadores mencionados anteriormente.

**NOTA:** es importante resaltar que para la formación de la curva de descuento se debe colocar exactamente el plazo de los indicadores para que en el momento de realizar el cálculo de la interpolación o extrapolación.

**Ingresos Manual de tasas:** Se debe realizar en el modulo de mercados/ tasas/ingreso manual de tasas; este proceso se debe realizar diariamente de forma manual, a excepción de la volatilidad estresada (VETRM) ya que esta es publicada mensualmente en la página de la Superintendencia financiera de Colombia ([http://www.superfinanciera.gov.co/matrices de correlación](http://www.superfinanciera.gov.co/matrices%20de%20correlaci%C3%B3n)).

**Generación Formato 472:** Este formato se genera por el modulo procesos masivos/ cargue información formato Circ. 003 ANNA, y el proceso generación de archivo plano se efectúa por IG formato.