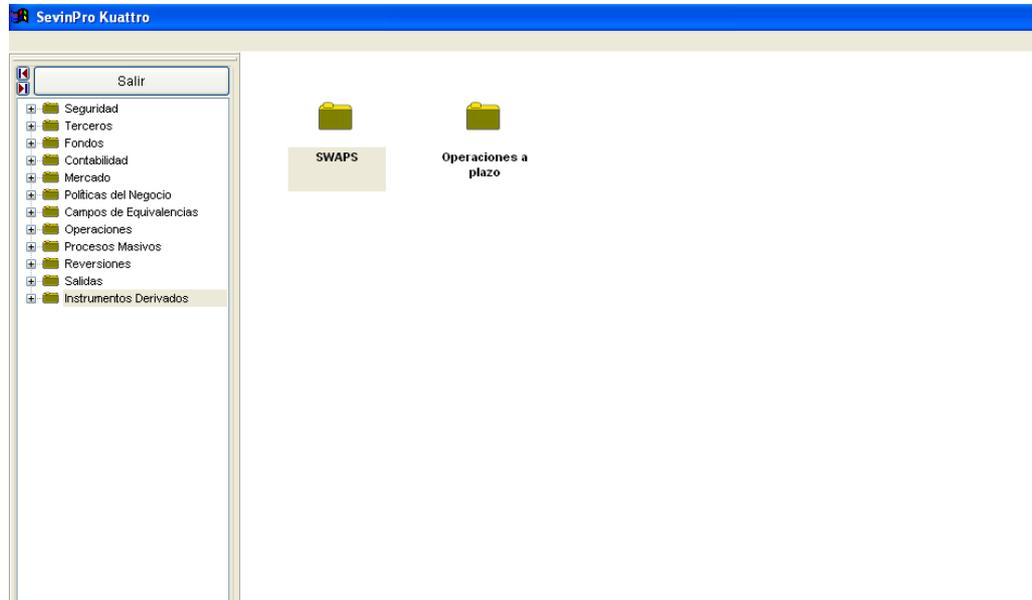


17 OPERACIONES DERIVADOS

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, there is a blue header with the title 'Creacion Especie Swaps'. Below the header is a toolbar with several icons: a yellow square, a globe, a magnifying glass, a list, a gear, and a document with a red arrow. The main area is titled 'Datos Faciales' and contains various input fields and dropdown menus. The fields are arranged in two columns. The left column includes: 'Código del título' (text box), 'Descripción' (text box), 'Tipo de Producto' (dropdown), 'Nénotecnico' (text box), 'Isin 2' (text box), 'Cusip' (text box), 'Serie' (text box), 'Pais' (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 includes: 'Isin ANNA' (text box), 'Isin 1' (text box), 'Isin 3' (text box), 'NumEmisDCV' (text box), 'Fungible' (checkbox), '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 menu 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

Clasificaciones Habilitadas

Combinacion Negociable

Combinacion Disponible Vta.

Combinacion al Vencimiento

Retefuente (S/N) Si No

Retefuente largo % 0.0000

Retefuente corto % 0.0000

Limite Corto Años 0

Tiempo a partir de

Tipo de Retencion

Unidad de captura y subcuenta

Código GAP Negociable

Código GAP al Vencimiento

Código GAP Disponible

Tipo de Swap

Ir a Página 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 main area is titled "Condiciones de Valoración". It contains several input fields: "Modelo" (a dropdown menu), "Orden" (a text box with "0" entered), "Fecha exacta" (radio buttons for "Si" and "No"), and "Clasificación" (a dropdown menu). A "Nuevo" button is located to the right of the "Clasificación" field. Below these fields is a table with the following columns: "Edit", "Del", "Orden", "Clasific", "Modelo", and "Fecha exacta". The table is currently empty. Below the table, there are more input fields: "Entidad calificadoradora" (a dropdown menu), "Habilitado" (radio buttons for "Si" and "No"), and "Calificación" (a dropdown menu). At the bottom, there is an "Ir a Página" dropdown menu and an "Anterior" 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 area contains several input fields: "Codigo" (a text box with "16" entered), "Compañía" (a dropdown menu), "Portafolio" (a dropdown menu), "Especie Swap" (a text box with "0" entered and a "Buscar..." button), "Contraparte" (a text box with "0" entered and a "Buscar..." button), "Partida a cubrir" (a text box with "0" entered and a "Buscar..." button), "Fecha Operación" (a date picker), "Tasa Derecho" (a text box with a "%" sign), "Tasa Obligación" (a text box with a "%" sign), and "Fecha Vencimiento" (a dropdown menu).

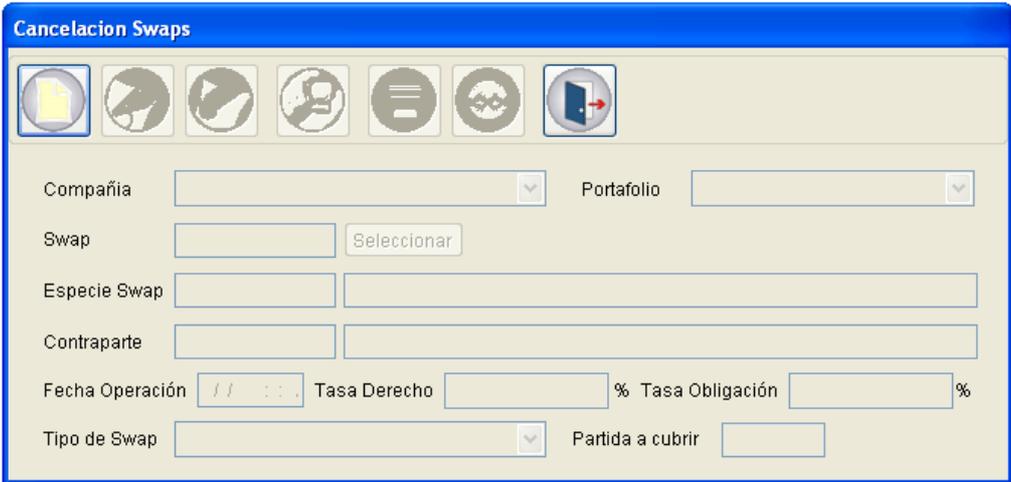
En esta opción se realiza la creación de la operación **swap** diligenciando los siguientes campos

- **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



Cancelacion Swaps

Compañía Portafolio

Swap

Especie Swap

Contraparte

Fecha Operación Tasa Derecho % Tasa Obligación %

Tipo de Swap Partida a cubrir

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%20correlaci3n)).

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.