1. **OBJETIVO**

Realizar la compra y venta divisas a través de la plataforma Set- FX con cumplimiento de operaciones a través de la Cámara de Divisas, como parte de la estrategia, para cubrir el servicio de la deuda externa o administrar la liquidez en USD

1. **ALCANCE**

Este procedimiento inicia desde la autorización, cotización y negociación para la compra y venta de divisas hasta el cumplimiento a través de la Cámara de Divisas.

1. **PRODUCTOS ESPERADOS**

* Cumplimiento de las operaciones
* Registro en el flujo de caja

1. **CONDICIONES ESPECIALES PARA LA OPERACIÓN DEL PROCEDIMIENTO**

* Para la negociación de operaciones se requiere la instrucción vía correo electrónico por parte del Grupo de liquidez
* Instrucciones impartidas por el Subdirector de Tesoreria

1. **TÉRMINOS Y DEFINICIONES**

**Cámara de Divisas**: Es la Cámara de Compensación autorizada para hacer la compensación y liquidación de operaciones de divisas realizadas a través de la plataforma Set-FX

**Cámara de Compensación**: Una Cámara de Compensación es un sistema por el cual entidades financieras acuerdan compensar y liquidar operaciones. La Cámara de Compensación de Divisas acepta operaciones de compra y venta de dólares de contado entre Intermediarios del Mercado Cambiario.

**Plataforma Set-FX**: Es el sistema electrónico de negociación de moneda extranjera en el mercado colombiano.

**Siglas:**

**USD**: Dólar de los Estados Unidos de América.

**COP**: Peso Colombiano

1. **DESCRIPCIÓN**

| **No.** | **PROVEEDOR:**  **ENTRADAS** | **ACTIVIDAD** | **PC** | **RESPONSABLE** | **EXPLICACIÓN** | **REGISTRO** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **A.** | | | | | | |
| **1.** |  | Enviar las garantías  necesarias para  poder operar en Set-FX | NO | Profesional  Especializado Grupo de Pagos y  Cumplimiento | Todos los días antes de las 8 am, se deben contar con las garantías necesarias para poder realizar operaciones de compra y venta de divisas en Set-FX. Estas deben ser enviadas a las cuentas en COP o USD establecidas para este fin por la Cámara de Divisas. Este proceso se programa semanalmente a través del Banco de la República. | No aplica |
| **2.** | **Instrucciones Subdirector** | Definir monto a comprar o vender y parámetros de negociación | NO | Subdirector de Tesorería | De acuerdo con las necesidades de liquidez o de estrategia, se define el monto a comprar o vender y los parámetros de negociación para este fin, como lo es la tasa y la modalidad de la negociación y le comunica al Asesor Mesa de Dinero. | No aplica |
| **3.** |  | Dar instrucciones para realizar la operación. | NO | Asesor Mesa de Dinero | Imparte las instrucciones de la operación al Trader incluyendo los parámetros de negociación o puede ejecutarlos el mismo. | No aplica |
| **4.** |  | Consultar condiciones de mercado | NO | Asesor Mesa de Dinero  Profesional Especializado Grupo Mesa de Dinero - Trader | Consulta las condiciones del mercado en los sistemas de información en tiempo real que posee la Subdirección. Mediante esta consulta se pueden observar las variaciones que está teniendo en el mercado la moneda que se va a negociar y cuál es el mejor momento para realizar la negociación. | No aplica |
| **5** |  | Realizar compra venta a través de la Plataforma Set-FX | NO | Asesor Mesa de Dinero  Profesional Especializado Grupo Mesa de Dinero - Trader | Se realizan las operaciones de acuerdo a las instrucciones y parámetros establecidos a través de la Plataforma Set-FX | Plataforma SET FX |
| **6** |  | Monitorear el mercado de USD y COP y las operaciones cerradas por el Grupo Mesa de Dinero | NO | Profesional Especializado Subdirección de Riesgo | A través de la plataforma Set-FX hace el monitoreo y control de las condiciones de cierre de las operaciones pactadas por el Grupo Mesa de Dinero. | No aplica |
| **7** |  | Consolidar operaciones en planilla de compra y venta de divisas | NO | Asesor Mesa de Dinero  Profesional Especializado Grupo Mesa de Dinero - Trader | En el archivo ubicado en el servidor llamado OPERACIONES DTN SETFX hace la consolidación de las operaciones previamente tomadas de la plataforma Set-FX para informar lo negociado junto con las características mediante mail al Subdirector de Tesorería, al Grupo de Liquidez y Grupo de Flujo de Caja de la Subdirección de Tesorería | Correo electrónico |
| **8** |  | Verificar las operaciones a cumplir a través del aplicativo de la Cámara de Divisas. | SI | Profesional Especializado Grupo de Pagos y Cumplimiento | Después de la 1 pm y a más tardar a la 1:30pm verifica a través del aplicativo de la Cámara de Divisas las operaciones realizadas por el Grupo Mesa de Dinero. | No aplica |
| **9** |  | Realizar el traslado de los fondos necesarios para cumplir con las operaciones realizadas en Set FX | NO | Profesional Especializado Grupo de Pagos y Cumplimiento | Si el cumplimiento es en USD, se procede de acuerdo al instructivo de traslado de recursos de la cuenta Citibank Nación, mediante el diligenciamiento del pre formato en Citidirect con los valores netos resultantes, a la cuenta en USD establecida para este fin por la Cámara de Divisas. Si el cumplimiento es en COP se tiene que hacer el giro en Pesos Colombianos hacia la cuenta en el Banco de la República establecida para este fin por la Cámara de Divisas. | No aplica |
| **10** |  | Verificar e informar el cumplimiento de operaciones | SI | Profesional Especializado Grupo de Pagos y Cumplimiento | Verificar e informar a la Subdirección de Tesorería y a la Subdirección de Riesgo que las operaciones realizadas a través de Set-FX y con cumplimiento a través de la Cámara de Divisas se encuentran cumplidas. | Correo electrónico |
| **FIN DEL PROCEDIMIENTO** | | | | | | |

**escripción grafica de la Compensación y Liquidación de Operaciones**

****

1. **HISTORIAL DE CAMBIOS**

| **FECHA** | **VERSIÓN** | **DESCRIPCIÓN DEL CAMBIO** | **ASESOR SUG** |
| --- | --- | --- | --- |
| 27-11-2014 | 1 | Primera versión del documento | Sandra Calderón |
| 10-02-2016 | 2 | Se actualiza el nombre del procedimiento, incluyendo “con cumplimiento a través de la Cámara de Divisas” Se incluyen términos y definiciones Se incluye diagrama de flujo | Sandra Calderón |
| 30-11-2020 | 3 | Se actualizan responsables, PC, registro y formato | Liliana Parra Ramírez |

1. **APROBACIÓN**

|  |  |
| --- | --- |
| **ELABORADO POR:** | **Nombre:** Maria O Lopez  **Cargo:** *Profesional Especializado Mesa de Dinero*  **Fecha:** *10-11-2020* |
| **REVISADO POR:** | **Nombre:** *Andres Celis*  **Cargo:** *Asesor Mesa de Dinero*  **Fecha:** *10-11-2020* |
| **APROBADO POR:** | **Nombre:** *Francisco Lucero C*  **Cargo:** *Subdirector de Tesoreria*  **Fecha:** *30-11-2020* |