

# Capacitación PMS

¡Bienvenido a PMS!,

El sistema de inversiones que le permitirá mejorar su gestión financiera y contable junto con facilitarle su trabajo diario debido a los procesos automáticos que puede obtener de PMS. A continuación, encontrara la descripción de PMS a través de una guía fácil y útil para la utilización del sistema.

## Mesa de Dinero Contabilidad Custodia Tesorería Superintendencia Gestión Mantención de Tablas Administración del Sistema



Atentamente, PMS Quality Software

\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*





## Manual Acceso Rapido Mantenedores del Sistema PMS





# INDICE

Manual capacitación PMS Vocabulario de Introducción	Pag. 4
	<u> </u>
Iniciando PMS	Pag. 6
¿Como ingresar a PMS?	Pag. 6 – 8
Asnactas Ganaralas	Pag 9
Modalidades del sistema	$\frac{1}{2} \frac{1}{2} \frac{1}$
	1 ag. 7 – 20
Mantenedores del Sistema	Pag.21
Mesa de Dinero, Mantención de Tablas	Pag. 21
Ingreso Operaciones en sistema PMS	Pag. 22
I Compra titulos seriados o con descriptor	Pag. 22 – 37
II Compra titulos No seriados o sin descriptor	Pag. 38 – 41
III Venta de instrumentos de Renta Fija seriados y no seriados	Pag. 42 – 47
Mantenedores disponibles en el sistema	Pag. 48
Anexo Nº 1 Motivo de Inversión	Pag. 48 – 49
Anexo Nº 2 Travectoria de OMD	Pag. 50 – 51
Anexo Nº 3 Valoracion Stock Renta Fija	Pag. 52
Anexo Nº 4 Reporte Valoración Stock Renta Fija	Pag. 53 – 54
Anexo Nº 5 Valoracion Stock Renta Variable	Pag. 55
Anexo Nº 6 Reporte Valoración Renta Variable	Pag. 56
Anexo Nº 7 Reporte de Clasificacion por Instrumento	Pag. 57
Anexo Nº 8 Calculadora Interactiva Instrumentos con y sin Descriptor	Pag. 58 – 60
Anexo Nº 9 Carga valores a traves de archivos	Pag. 61 – 62
Anexo Nº 10 Libro de Operaciones Renta Fija	Pag. 63
Anexo Nº 11 Proyección de Vencimientos	Pag. 64
Contabilidad PMS	Pag 65
Contabilidad PMS	Pag. 65
L-Plan de cuentas	Pag. 67 – 69
II - Hechos Economicos	Pag. 70 – 74
III Enlaces contables	Pag. 75 – 80
IV Procesos Contables	Pag. 81 – 89
Explicación GAAP	Pag 90
Reporte GAAP	Pag. 90 – 104
Preguntas Frecuentes	Pag. 105
FAQ	Pag. 105 – 108
Sugerencia de utilización de parámetro estándar	Pag. 109
Superancias	Pag. 107
Juyerencias	<u>ray. 107</u>





### **Definiciones y Conceptos**

Renta Fija Títulos, Plazos Fijos, Bonos, etc.

Renta Variable Acciones y Fondos Comunes de Inversión

#### Instrumentos Seriados

Instrumentos que dentro de sus características de emisión tienen tabla de desarrollo con cupones.

#### Instrumentos No Seriados

Instrumentos que generalmente son de corto plazo con un vencimiento único

## Nemotécnico con Descriptor

Código de identificación única para instrumentos de renta fija.

#### Nemotecnico Sin Descriptor

Código de identificación única para instrumentos de renta variable.

### Folio OMD

Número identificador de las transacciones de Compra o Venta.

### TIR

Tasa Interna de Retorno de la Compra o Venta que representa la rentabilidad del valor de compra o venta sucia

## % Par

Precio en base a 100 unidades nominales que se aplica sobre el capital residual del titulo mas los intereses devengados a la fecha del calculo (Metodología utilizada en el mercado Chileno).

#### Precio Clean

Precio sin considerar los intereses

## Precio Dirty

Precio considerando intereses



#### Fecha Operación Fecha Concertación

## Fecha Pago

Fecha Liquidación

## Descriptor

Donde se definen las caracteristicas de emisión para los instrumentos que tienen tablas de desarrollo o son instrumentos Seriados.

## Valor Par

Capital Residual más los intereses devengados a la fecha de cálculo y ambos reajustados si corresponde.

## Valor Nominal

Valor del título a la emisión.

### Valores en UM

Valor Moneda de Origen

## Valor en MC

Valor expresado en la moneda de caja en la ransacción o en la moneda de la cartera en reportes y procesos, valor convertido a partir de los valores UM según un determinado tipo de cambio

## Posición o Stock

Información de la cartera al último día de valorización

### Hecho Económico

Asiento Contable por cada tipo de omúnmente o evento (Vencimiento, cierre, etc)

### **Enlace Contable**

Union que se realiza en el sistema entre los reportes y los hechos económicos

### GAAP

Generally Accepted Accounting Principles Principios contables omúnmente aceptados

Volver



## Iniciando PMS

## ¿Como ingresar a PMS?

Usted encontrara en el escritorio de su PC un icono con el nombre PMS-i, usted debe dar un doble clic o un clic derecho y posicionarse sobre la opción 'Abrir', el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.



Para conectarse al sistema usted debe presionar la opción que tiene unas llaves como se muestra en la figura

Quality 👔 📩

De un doble clic, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla





Digite los datos solicitados

Usuario: XXXXXX	Clave:	XXXXXX
Clave :	Clave:	XXXXXX Luego presione Aceptar.





Podrá apreciar que ahora todos los menús están activados y listos para ser utilizados.

En caso que su compañía por la estructura que maneja, tienen más de un empresa, lo que lo llevaría a tener a usted como usuario más de una identificación para el ingreso al sistema. Usted puede verificar el nombre de usuario con el que esta conectado con la misma opción de la llave mencionada anteriormente solo que al estar conectada el sistema le mostrara un dialogo distinto al presentado anterioremente.



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla, como se muestra a continuación





Donde podemos ver que usuario es el que esta conectado, a que empresa y el perfil de acceso que tiene el usuario. También, se permite en esta opción realizar cambio de Password al ingresar a esta opción el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla, ingrese los datos solicitados por el sistema.



Clave	Actual
-------	--------

Nueva Clave

Validación Nueva Clave

Por otra parte también si necesitamos cambiar de nombre de usuario, incorporándonos con un nuevo nombre de usuario para una nueva empresa no es necesario cerrar la pantalla de menú inicial, si usted se dirige a la opción:





Conexión al Se	ervidor 🛛 🔀
¿Esta seguro d	e cerrar conexión?
Sí	No

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla, el sistema le preguntara si quiere cerrar la conexión en la que se encuentra, como se encuentra en la siguiente figura

Presione la opción si, la sesión en la que se encontraba se cerrara y el sistema queda disponible para una nueva sesión donde usted realizara para ingresar los pasos anteriormente descritos.



<u>Volver</u>



## Aspectos Generales del Sistema

Para comenzar en completa armonía con el sistema le sugerimos aprender a utilizar los comandos generales de órdenes de ejecución del sistema PMS. El sistema en su metodología de ingreso de datos es uniforme en todos los menús del sistema. A continuación mostraremos paso a paso la metodología y el uso correcto de ingreso para:

- 1. Insertar Nuevo Registro
- 2. Eliminar Registro
- 3. Modificar Registro
- 4. Confirmar Registro
- 5. Cancelar Registro
- 6. Impresora

## I. Metodología de Ingreso

En todos los menús del sistema usted encontrara esta barra de herramientas con la cual puede ejecutar los comandos anteriormente mencionados



La forma de realizar estas acciones es posicionándose sobre la opción que requiera y presionar sobre ella con el Mouse.

Específicamente las funciones que encontrara son:

## 1. Insertar Nuevos Registros



El dialogo en el que usted se encuentra quedara en método de edición, lo cual nos permite comenzar con el ingreso de datos.

## 2. Eliminación de Registros



Si usted por razones de fuerza mayor se encuentra obligado a eliminar un registro debe utilizar esta opción. El sistema le pedirá justifique los motivos que tiene para realizar la eliminación del registro o le preguntara si esta seguro de querer realizar la eliminación que esta a punto de concretar dependiendo del menú en el cual se encuentre ejecutando esta acción.



## 3. Modificación de Registros



La modificación en el sistema solo es utilizada para ciertos campos dentro de un dialogo, esto quiere decir que el sistema al presionar esta opción solo nos permitirá modificar las descripciones de algunos campos lo cual podremos identificar fácilmente, ya que los campos que no son permitidos se bloquean automáticamente al activar la función.

4. Confirmación de Registros al finalizar el procedimiento de ingreso



Una vez que ingreso los datos que requería y si usted esta seguro de los datos digitados *siempre* antes de salir debe confirmar los registros que recién a digitado, de lo contrario estos no se grabaran y perderá el trabajo realizado.

5. Cancelar Registro de datos durante el procedimiento de ingreso



Si usted se encuentra ingresando datos y por alguna razón desea limpiar los datos digitados o seleccionados en el menú usted debe presionar el botón cancelar esto le borrara los datos sin necesidad de salir del mantenedor en el que se encuentra.

## 6. Función Impresora





## II. Modo Consulta

Una vez que hemos realizado los procesos de ingreso de datos PMS también en todos los menús del sistema nos permite ver los parámetros ingresados y así poder revisarlos para consulta, verificación o modificación de datos.

Esta opción usted la encontrara específicamente cuando vea este símbolo este símbolo este símbolo e un botón con tres puntos significa que el mantenedor de datos le permite ingresar y revisar la información que hay dentro de el. Para ejemplificar lo que se esta diciendo, tomaremos un ejemplo real.

Este modo de consulta se encuentra en todos los tipos de transacciones que existen en PMS

- Compras a Termino de Renta Fija
- Ventas a Termino de Renta Fija
- Compras con Pacto de Renta Fija
- Ventas con Pacto de Renta Fija
- Compras a Termino de Renta Variable
- Ventas a Termino de Renta Variable
- Compras con Pacto de Renta Variable
- Ventas con Pacto de Renta Variable
- Operaciones Swaps

## 1. Compras a Termino Renta Fija



En la figura de arriba se destaca la ubicación de este mantenedor como una forma de acceso rápida, también se encuentra dentro de la opción Transacciones como se muestra en la siguiente figura



Cuando ingrese a cualquiera de estas dos opciones, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla como se muestra en la siguiente figura.



💆 COMPRA A TERMIN	0								- 🗆 ×
	8							?	-
Folio OMD:			Fecha Oper	ación : 19/	/08/2004	15			
Cartera :			Ope	rador :					
Cliente / Contraparte :			Moneda	Caja :					
Detalle de Instrumentos D	atos Transacción   Dato	os Anexos							
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo T.I.R Cambio	Precio	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido		
Þ									
						0			

Para utilizar las consultas usted debe presionar el botón con tres puntos como se muestra en la figura, Aquí se muestran todos los registros de compra que han sido alguna vez ingresados (incluyendo los registros anulados y no confirmados).

Buscar					_
Enlin Interno	Fecha Operación	Contranarte	Moneda Operación	Valor Invertido	•
0000772	27/02/2004	ABES	lisp	166 265	
0000793	27/02/2004	ARES	USD	208,609	
0000794	27/02/2004	ARES	USD	169,288	
0000810	24/06/2004	WACHOVIA	USD	1,911,000	
0000815	24/09/2003	DEUTSCHE	ARS	1,783,040	
0000816	15/09/2003	DEUTSCHE	ARS	5,222,743	
0000819	14/01/2003	DEUTSCHE	ARS	433,694	
0000872	29/06/2004	BCORIO	ARS	991,848	
0000873	29/06/2004	BCORIO	ARS	1,000,000	
0000880	08/12/2003	WACHOVIA	USD	8,053,055	
0000881	21/03/2003	DEUTSCHE	ARS	1,328,690	-
Ruscar Por					
					Ŧ
1					_
				centar Y Cancela	
			<u>× A</u>		·

Seleccione uno de los registros, presione Aceptar o de un doble clic sobre el registro, así lo podrá revisar en el mantenedor de transacciones de compra como se muestra a continuación.



👏 COMPRA A TERMIN	0 - 542 - CITIBANK							
₽₽₹×	4							1
Folio OMD: 542	···		F	echa Opera	ación : 22/	/07/1998	15	
Cartera : GT1GBP				Oper	rador : MA	NAGER		
Cliente / CITIBANK Contraparte :				Moneda	Caja : US	D		
Detalle de Instrumentos D	atos Transacción 🗍 Dato	s Anexos						
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (USD)
TRYGBP2021	39,000	1.64	5.8976	127.15	127.41	128.40	50,074.47	82,307.41
						82,30	07.41	

### Nota:

También, podemos notar que tenemos dentro de la transacción dos botones con tres puntos, esta segunda opción la utilizamos para revisar las operaciones No confirmadas (pendientes) que tenemos en el sistema. En este mismo registro podemos continuar viendo modos de consulta para esto pasemos al punto dos.

## 2. Compras a Termino Renta Fija (modo consulta2)

Archivo	Trans	acciones	Valo	rización	Informes	Rentabilida	ad Venta	ana Ayuda					
1	B.R.	IRE		<b>*</b>		Se 🛃		<b>&amp;</b>	tí		8	5	

En el mismo mantenedor de transacción también tenemos otro modo de consulta, una vez que ingreso a la opción y selecciono un registro de un clic derecho en la parte inferior de la transacción. Como se muestra en la siguiente figura



👏 COMPRA A TERMINO	0 - 794 - ARES							
	8							
Folio OMD: 794			F	echa Opera	ación : 27/	/02/2004	15	
Cartera : L103				Орег	rador : JPB	BESLER		
Cliente / ARES Contraparte :				Moneda	Caja : US	D		
Detalle de Instrumentos Da	atos Transacción 🗍 Dato	os Anexos						
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (USD)
PEREZ2005	160.000	1.00	4.0967	105.21	105.24	105.81	169,288.07	169,288.07
Clic Derecho	Cancelar Eliminar Datos Instrument Datos Adicionales	to						
	Custodia Instrum	ento						
	Asignar Stock Cambio de Tasa	· ·			<u></u>	169,28	38.07	

En general en el sistema encontraremos estos dos tipos de consultas que hemos mencionado, como usted puede apreciar son muy fáciles de usar, sencillas y útiles en la obtención de información.

Una vez que se introduzca al sistema encontrara más formas y métodos de encontrar y buscar la información facilitando su que hacer diario

Datos del Instrumento
Nemotécnico : TRYGBP2021
Emisor : GOBUK
Instrumento : FI-G7GBP
Serie : GB0009997999
Fecha de Emisión : 29/02/1996
Fecha Vencimiento : 07/06/2021
Tasa Financiera : 0
Tasa de Emisión : 8
Moneda: GBP
Tipo Nominales : INICIALES
OK.



## II. Buscadores

En apoyo al modo de consulta también tenemos otro tipo de ayuda en los mantenedores, los cuales denominaremos los buscadores.

Los buscadores en el sistema se encuentran en todos lados y nos facilitan la búsqueda al momento de buscar la información. En general el tipo de búsqueda dependerá del mantenedor en el cual nos encontremos, en orden de continuar con la idea planteada, retomaremos el mismo ejemplo anterior.

Archivo	Transa	acciones	Velo	rización	Informe	es Rer	ntabilidad	d Venta	ana Ayu	uda					
	B.R.			<b>*</b>	6	<b>&amp;</b>	RV E		RV	<b>~</b>	<b>Tí</b>		8	<u>.</u>	

COMPRA A TERMINO × đđ f 8 Folio OMD: Fecha Operación : 19/08/2004 15 Cartera : Operador Cliente / Moneda Caja : Contraparte Detalle de Instrumentos Datos Transacción Date nexos Precio o % PAR Valor Nominal T.I.B Valor Invertido UM Valor Invertido Px Clear Px Dirty Bid -Nemotecnico Tip Rid Ŧ 0

Ingrese al mantenedor de transacción y presione los tres puntos

Como ya lo conversamos en este dialogo se encuentran todos los registros de compra que han sido alguna vez ingresados (incluyendo los registros anulados y no confirmados). Sin embargo, en este ejercicio les pido que miren este mantenedor cuidadosamente.



Eolio Intorno	Eacha Operación	Contranarto	Monoda Operación	Valor Invortido	•
0000772	27/02/2004	ADEC			
0000772	27/02/2004	ADEC		200,203	
0000733	27/02/2004	ADEC		100,003	_
0000734	24/05/2004			1 911 000	_
0000010	24/00/2004	DELITECHE	ADC	1,311,000	_
0000010	15/00/2003	DEUTSCHE	ADC	1,703,040 E 333 743	
0000010	13/03/2003	DEUTSCHE	ADC	3,222,743	
0000013	1470172003		ADC	433,034	_
0000872	29/06/2004	BCORIO	Ans	331,848	
0000873	29/06/2004	BLUHIU		1,000,000	
0000880	08/12/2003	WALHUVIA	050	8,053,055	
0000881	21/03/2003	DEDISCHE	AHS	1,328,690	-
D					

Note en la parte que se destaca el mantenedor con la figura, el termino 'Busar Por' y al lado derecho una opción de flecha. Revisemos la siguiente figura

COMPRA A TERMINO (C)								
B	<u>B</u> uscar							
Γ								
Г	Folio Interno	Decha Operación	Contraparte	Moneda Operación	Valor Invertido	•		
F	0000810	24/06/2004	WACHOVIA	USD	1,911,000			
	0000815	24/09/2003	DEUTSCHE	ARS	1,783,040			
	0000816	15/09/2003	DEUTSCHE	ARS	5,222,743			
	0000819	14/01/2003	DEUTSCHE	ARS	433,694			
	0000872	29/06/2004	BCORIO	ARS	991,848			
	0000873	29/06/2004	BCORIO	ARS	1,000,000			
	0000880	08/12/2003	WACHOVIA	USD	8,053,055			
	0000881	21/03/2003	DEUTSCHE	ARS	1,328,690			
	0000882	19/08/2004	BCRA	USD	1,558,562			
	0000884	20/08/2004	CITIBANK	USD	1,189,212			
	0000885	20/08/2004	CITIBANK	USD	14,423	-		
R	uscar Por							
Г	<u>ascal 1</u> 01							
	E. L.L.							
S	r olio Interno							
i	Contraparte							
<u>\</u>	alor Invertido							

El mantenedor nos proporciona varios datos para poder realizar la búsqueda, No en la figura xx que el primer campo que nos entrega 'bucar por' es el folio interno; así mismo note que el primer campo que muestra el mantenedor es folio interno. Ahora, ordenaremos la opción de menú por el valor invertido y veamos que sucede con la siguiente figura.



COMPRA A TERMINO (	C)			×
<u>B</u> uscar				
Valor Invertido	Folio Interno	Fecha Operación	Contraparte	Moneda Operación 🔺
100,000	0000745	19/03/2004	ARES	USD
102,713	0000684	08/12/2003	WACHOVIA	USD
103,636	0000555	17/11/2000	CITIBANK	USD
106,000	0000758	30/04/2004	ARES	USD
108,335	0000554	19/09/2000	CITIBANK	USD
116,679	0000523	28/06/1999	CITIBANK	USD
122,258	0000521	04/03/1999	CITIBANK	USD
122,812	0000546	14/01/1999	CITIBANK	USD
130,324	0000545	15/12/1998	CITIBANK	USD
132,982	0000539	13/10/1998	CITIBANK	USD
14,423	0000885	20/08/2004	CITIBANK	USD 💌
Purear Per				
Buscal <u>F</u> oi				
Valor Invertido				<u> </u>
Folio Interno				
Contraparte				
Valor Invertido				

El sistema cambia el orden al valor invertido y luego folio. Note, también que dentro de esta búsqueda tenemos otra, por ejemplo luego de seleccionar que el campo por el que va a buscar puede incluir dentro de la busque la letra o el dato, dependiendo de la información que tenga y el sistema realizara una búsqueda por ese parámetro como se muestra en la siguiente figura.

С	OMPRA A TERMINO (C)				×
B	rscal				
(	2				
	Valor Invertido	Folio Interno	Fecha Operación	Contraparte	Moneda Operación 🔺
	163,718	0000526	15/09/2000	CITIBANK	USD
	166,265	0000772	27/02/2004	ARES	USD
	168,054	0000489	15/12/1998	CITIBANK	USD
	169,288	0000794	27/02/2004	ARES	USD
	176,125	0000525	21/08/2000	CITIBANK	USD
	2,010,759	0000742	09/02/2004	ARES	USD —
	2,100,000	0000654	29/03/2004	BCORIO	ARS
	2,134,168	0000723	22/08/2003	WACHOVIA	USD
	2,232,660	0000683	08/12/2003	WACHOVIA	USD
Γ	2,233,530	0000516	21/03/2001	CITIBANK	USD
Г	2,300,000	0000655	29/03/2004	BCORIO	ARS 🗾
B	uscar <u>P</u> or				
1	¥alor Invertido				-
					ptar XCancelar



## NOTAS DEL USUARIO



# MANTENEDORES DEL SISTEMA

## Mesa de Dinero

A continuación, encontraran una guía útil en el manejo diario del sistema PMS. La forma de enfocar este documento es presentando la parte transaccional con sus diferentes opciones, analizando los parámetros que necesitamos para lograr este objetivo.





## Ingreso de Operaciones en sistema PMS

## I. Compra de Títulos Seriados o Con Descriptor

Diríjase al menú Mesa de Dinero, Ingrese a la opción de Compra de Títulos. El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

🔊 COMPRA A TERMINO - 525 - CITIBANK									
:: ::::::::::::::::::::::::::::::::::									
Folio OMD: 525 Fecha Operación : 21/08/2000 IS									
Cartera : GT1EUR				Оре	rador : MA	NAGER			
Cliente / CITIBANK				Moneda	Caja : US	D			
Detalle de Instrumentos Da	atos Transacción 🗍 Dato	s Anexos							
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (USD)	Cupones 🔺 Cortados
BUNDEUR2030	167,000	0.90	5.3515	112.57	113.06	116.99	195,369.28	176,125.41	
									•
							0.00		

Figura 1<sup>a</sup>

Este tipo de operación es para instrumentos de Renta Fija con dos características los instrumentos seriados.

Lo que debemos hacer antes de ingresar una transacción es estar seguros que tenemos la información necesaria para cumplir con este proceso. Por lo tanto, se sugiere revisen cuidadosamente los datos que se necesitan:

Datos

Cartera Cliente/Contraparte Fecha Operación Operador Moneda Caja



### Detalle Transacción

Nemotécnico:	Seleccionar
Valor Nominal:	Dato
Tipo Cambio:	Dato
T. I. R.:	Dato
Precio o % Par:	Dato
PX Clean Bid:	Dato
PX Dirty Bid:	Dato
Valor Invertido UM:	Dato
Valor Invertido (USD):	Dato
Cupones Cortados:	Solo si es el caso

### Datos Transacción

Tipo Instruccion Respaldo Físico Condición Pago Inicial Condición Pago Final Tipo de Pago Custodia Origen Custodia Destino Fecha de Pago

Nota: Para esta parte de la Transacción en renta fija y variable las definiciones se hacen por Default antes del ingreso de estas. En la carga inicial de datos se dejan establecidos estos en el mantenedor de 'Códigos Generales'.

#### Datos Anexos

Por cuenta De:	Default empresa Trading
Motivo:	
Fecha Compromiso:	Default Fecha Operación
Motivo Inversión:	
Observación:	Comentarios

Lo definido anteriormente son los datos que necesita para realizar un buen procedimiento de ingreso de datos. Por lo tanto, se establece como esencial que usted como usuario tenga la habilidad de analizar la información que desea ingresar.

Para cumplir el objetivo de este documento estableceremos un escenario para poder comenzar y ayudarles a formar procedimientos de ingreso de datos.

- Durante el mes en curso se realizo la compra de un nuevo instrumento.

A continuación encontrara paso por paso como debiera ser el analisis para llegar al momento de la transacción sin ningun incoveniente.



1. ¿Se encuentra ingresado dentro de los datos que manejo en el sistema el emisor del instrumento que se adquirio? Si la respuesta es NO, usted debe entonces ingresarlo.

### Emisor

Diríjase al Menú Mantención de Tablas, Archivo, Códigos del sistema, Identidades (Jurídicas)



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

蹙 Mantención de Identidades	×
	? 📲
	🔽 Valida Digito Verificador
Jurídicas Naturales	
Identidades Jurídicas	
Razón Social :	
Nombre de Fantasia : Credencial :	
Direcciones Tipo Empresa Clasificación 🚑	Cuentas Logo



Para ingresar un nuevo registro, presione la opción 'Insertar Registro', luego llene los siguientes campos:

- Código Identidad
- Razón Social
- Nombre de Fantasía
- Credencial (este campo puede quedar en Blanco, no olvide saltar un espacio)
- \* Desmarcar el campo Valida Digito Verificador

Luego presione aceptar.

Posteriormente, debe ingresar el registro de dirección. Llame al registro que acaba de crear



蹙 Mantención de Identidades	×
	? 📲
	Valida Digito Verificador
Jurídicas Naturales	
Identidades Jurídicas	
Código Identidad : PRUEBA	
Razón Social : PRUEBA	
Nombre de Fantasia : PRUEBA	
Credencial :	
Direcciones Tipo Empresa Clasificación 🎒 Cuentas	Logo

Figura 3ª

Luego ingrese a la opción que dice Direcciones, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

👼 Direcciones	×
Archivo Ayuda	
	? 🐴
	Dirección de: PRUEBA PRUEBA
Fecha Desde :	01/01/1900
Fecha Hasta :	
Ubicación Geográfica :	BOGOTA BOGOTA 🗨
Dirección :	SIN DIRECCION
	Contacto Medio Comunicacion

Figura 4<sup>a</sup>



Presione insertar registro y llene los siguientes campos:

- Fecha desde:	01/01/1900
- Fecha Hasta:	Blanco
- Ubicación Geográfica:	La que corresponda al pais
- Dirección:	Dato

Luego ingrese a la opción que dice 'Tipo Empresa'.

👼 Mantención de Identidades	×
🔽 Valida Digito Verifica	ador
Jurídicas Naturales	
Identidades Jurídicas	
Razón Social : PRUEBA	
Nombre de Fantasia : PRUEBA Credencial :	
Direcciones Tipo Empresa Clasificación 🚑 Cuentas Logo	

Figura 5ª

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

🗾 Tipo de Empresa	×
Archivo Ayuda	
	? 📲
; Fecha Desde : 01/01/1900 🗔	
Fecha Hasta :	
Tipo Empresa : EMISOR DE INSTRUMENTOS	•
Figura 6ª	

Presione la opción insertar registro, aquí definiremos el tipo de empresa que estamos creando (en este caso un Emisor, aquí también ingresaremos, custodias, bolsas, etc.)



Llene los siguientes campos:

- Fecha Desde: 01/01/1900
- Fecha hasta: Blanco
- Tipo Empresa: Seleccionar

\*\* Si usted ingreso una custodia no debe olvidar realizar la relacion empresarial entre la compañía y la custodia

2. Diríjase al Menú Mantención de Tablas, Archivo, Grupo Económico, Relación Empresarial.

Archivo Ayuda	
Códigos del Sistema	•
Grupo Económico	Estructura Física
Tablas Financieras	<ul> <li>Estructura Funcional</li> </ul>
Tablas Contables	► Holding
Salir de Mantención de Tablas	Foliación
Salli de Mariterición de Tablas	Relación Empresarial
	Condiciones de Pago
	Default Tipo Empresa

Figura 7ª

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

👼 Relación Em	presarial					×
					?	4
Empresa : AR Dirección : 1 Sistema : <b>Fl</b>		N. SIN DIRECCION SISTEMA FINANO	CIERO	ar No		
Relación	Descripcion		Tipo Relación	Descripción Tipo		<u> </u>
	OPERACIONES FINA	ANCIERAS				

Figura 8ª



Seleccione la empresa deseada (en caso de tener mas de una empresa), dirección y la opción sistema financiero, luego sobre el registro código OPEFIN de un clic derecho, como se muestra en la siguiente pantalla.

👼 Relación Em	presarial					×
					?	-
Empresa : AR Dirección : 1 Sistema : Fl		SIN DIRECCION SISTEMA FINAN	CIERO			
Relación	Descripcion		Tipo Relación	Descripción Tipo		<u> </u>
	OPERACIONES FINA	ANCIERAS En Re Co Re	n <mark>presas Relaciona</mark> elación por Tipo E ndición de Pago ecargos / Descue	adas mpresa entos		Ţ

Figura 9<sup>a</sup>

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

🗾 Empresas Rel	acionadas				×
Archivo Ayuda					
	<			?	4
Empresa : Dirección :					
Empresa	Razon Social	Dir	Descripcion Direccion		<b>_</b>
					•

Figura 10<sup>a</sup>

Presione insertar nuevo registro, llame a la empresa y seleccione la direccion.



🍯 Empresas Rela	acionadas			×
Archivo Ayuda				
₽∎ ∕ ×			?	-
Empresa : CITIBA Dirección : 1				
Empresa	Razon Social	Dir	Descripcion Direccion	
CITIBANK	CITIBANK N.A.	1	BME. MITRE 530 CAPITAL FEDERAL	-

Figura 11<sup>a</sup>

Luego presione Aceptar.

## 3. Una vez realizado este procedimiento debemos crear el instrumento

Diríjase al Menú Mantención de Tablas, Archivo, Tablas Financieras, Instrumento.

Archivo Ayuda	
Códigos del Sistema	
Tablas Financieras	Monedas
Tablas Contables	Indices T
Salir de Mantención de Tablas	Precios Renta Variable
	Formas de Pago
	Emisores
	Descriptor Instrumentos

Figura 12<sup>a</sup>

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla



👿 Emisor de Instrumentos I	Financieros		×	
<b>B</b>		?	4	
Emisor : BANSUD Razon Social : BANCO MACRO BANSUD S. A. Nombre Fantasía : BANCO MACRO BANSUD S. A. Credencial :				
	Instrun	nentos		
	<u>E</u> misor Pagador	<u>T</u> ipo Emisor		
	Emisor Garante	<u>C</u> lasificación	ð	
		<u>E</u> quivalencia		

Figura 13<sup>a</sup>

Presione 'Insertar nuevo registro' ingrese los parámetros que solicita el sistema:

- Codigo Instrumento: Elija una codificación representativa para el tipo de instrumento que esta creando.
- Nombre: Escriba una descripción para el instrumento

Si cuando usted crea el instrumento (descrito en figura anterior) marca la opción que dice 'Tiene Descriptor', la definición de las características del instrumento deberán ser ingresadas en otro Menú del mantenedor (en Descriptores que veremos mas adelante), pero antes de realizar este procedimiento con la descripción del instrumento debemos asociar el instrumento genérico creado con el emisor del mismo.

# 4. Como se menciona en el punto anterior antes de proseguir debemos asociar el nuevo instrumento creado al Emisor.

Diríjase al menú Mantención de Tablas, Archivo, Tablas Financieras, Emisores.

Archivo Ayuda	
Códigos del Sistema	>
Grupo Económico	>
Tablas Financieras	Monedas
Tablas Contables	Indices
Salir de Mantención de Tablas	Tasas Precios Renta Variable
	Formas de Pago
	Emisores
	nuro 148

Figura 14



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

👼 Instrumentos del Emisor		×
Archivo Ayuda		
	?	4
BANCO MACRO BANSUD S. A.		
Instrumento :		
Fecha Desde : Fecha Hasta :		

Figura 15<sup>a</sup>

Llame al emisor que desea asociar el nuevo registro de instrumento, luego seleccione la opción que dice 'Instrumentos'. El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

Presione insertar nuevo registro, seleccione el instrumento genérico que creo, luego llene los campos solicitados.

-Instrumento:	Seleccionar Dato
- Fecha Desde:	01/01/1900
- Fecha Hasta:	Blanco

5. Una vez terminado los pasos anteriores podemos ingresar lo que llamamos en el sistema Descriptor, donde ingresaremos las caracteristicas del instrumento según el emisor.

A continuación, diríjase al Menú Mantención de Tablas, Archivo, Tablas Financieras, Descriptor.

Archivo Ayuda		
Códigos del Sistema	+	
Tablas Financieras Tablas Contables		Monedas Indices
Salir de Mantención de Tablas		Tasas Precios Renta Variable
		Formas de Pago Emisores
		Descriptor

Figura 16<sup>a</sup>



	? 🚭
Datos de Flujos	
Nro. Cupones :	Tabla Desarrollo
Tipo de Voto. :	
Día de Pago:	Laic, Labla Desarrolio
Tipo de Pago :	Tabla Desarrollo PAR
Periodos de Gracia :	Definición Múltiples Tasas
Decimal Ajuste :	Excepciones en Calculos
Tipo Ajuste :	
Base Original :0	l'abla Desarrollo Prepago
Base Conversión : 0	
Fórmulas de Cálculo Fórmula PAR :	Opción Prepago Prepago Fecha Prepago :
	Datos de Flujos Nro. Cupones : Tipo de Vcto. : Día de Pago : Tipo de Pago : Periodos de Gracia : Decimal Ajuste : Tipo Ajuste : Base Original : Base Conversión : C Fórmulas de Cálculo Fórmulas de Cálculo

Figura 17<sup>a</sup>

Presione Insertar nuevo registro, llene todos los campos según descripción de características del instrumento deseado. Presione confirmar registro.

Luego debe crear la tabla de desarrollo también acorde a las características ya ingresadas.



6. Finalmente antes de poder registrar nuestra transacción debemos incorporar lo que llamamos el codigo Nemotecnico, para esto

Diríjase en el menú Mantención de Tablas, Tablas Financieras, Nemotécnicos con Descriptor

Archivo Ayuda	
Códigos del Sistema	
Grupo Económico	· I
Tablas Financieras	Monedas
Tablas Contables	Indices
Salir de Mantención de Tablas	Tasas
Salli de Manterición de Tablas	Precios Renta Variable
	Formas de Pago
	Emisores
	Descriptor
	Instrumentos
	Clasificación de Riesgo
	Fómulas de Calculo
	Nemotécnicos Con Descriptor

Figura 18<sup>a</sup>

El sistema mostrara la siguiente pantalla.

1	Nemotécnic	os Renta Fija					x
	d d E	18				? 🚽	
	Emisor :						
h	nstrumento :	-	]				
	Serie :	•		<b>.</b>	1		
				V Nemotecnico	os		
ſ	Emisor	Instrumento	Serie	Nemotécnico	Fecha Emisión	Fecha Vcto.	

II Figura 19<sup>a</sup>



Seleccione los siguientes registros:

- Emisor
- Instrumento
- Serie

👼 Nemotécnicos	Renta Fija				×
	8				? 🗐
Emisor : GOBG Instrumento : FI-G70 Serie : DE000	GERM EUR 💌 01135176 💌	GOBIE	ERNO ALEMAN REASURY N/B	I EUR	
Emisor	Instrumento	Serie	Nemotécnico	Fecha Emisión	Fecha Vcto. 🔺
Emisor GOBGERM	Instrumento FI-G7EUR	Serie DE00011	Nemotécnico BUNDEUR2031	Fecha Emisión 27/10/2000	Fecha Vcto.

## Figura 20<sup>a</sup>

Luego en la parte inferior del dialogo de un clic derecho y elija la opción 'Insertar nuevo registro'.

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

Ingreso Nemotécnico 🛛
Código Nemotécnico :
Emision Implicita 🗖
Fecha Emisión : 7 / 🛐 Definitión Emitión
Fecha Vencimiento : / / IS
Cupones cortados a la emisión
Cupones Cortados : 0
Clasificación Fechas Variables
Grabar X Cancelar

Figura 21<sup>a</sup>



Ingrese los datos solicitados:

- Código Nemotécnico:
- Emisión Implícita: Blanco
- Fecha Emisión:
- Fecha Vencimiento
- Cupones cortados a la emisión

Cupones cortados: Blanco

- Opción Clasificación: Se pueden ingresar clasificaciones por nemotécnico.

- Opción Fechas Variables: Cuando el titulo no tiene una fecha única de pago de cupón, al presionar la opción Fechas Variables aparecerá la siguiente pantalla.

🛒 Fechas ¥ariables 🛛 🔀					
	<u> </u>	🧕 🕴 📲			
	Nro, Cupon	Fecha Vencimiento 🔺			
▶	1	04/01/2002			
	2	04/01/2003			
	3	04/01/2004			
	4	04/01/2005			
	5	04/01/2006			
	6	04/01/2007			
	7	04/01/2008			
	8	04/01/2009			
	9	04/01/2010			
	10	04/01/2011			
	11	04/01/2012			
	12	04/01/2013			
	13	04/01/2014			
	14	04/01/2015 🗾			

Figura 22<sup>a</sup>

Aquí encontraremos las siguientes opciones:

- Modificar
- Aceptar
- Cancelar
- Calcula fecha variable.

Según sea el caso realice la accion necesaria y luego presione Aceptar o confimar registro. Luego, aparecera el menú anterior como se muestra a continuación.



Ingreso Nemotécnico
Código Nemotécnico :
Emision Implicita
Fecha Emisión : / / 📧 Definición Emisión
Fecha Vencimiento : / / IS
Cupones cortados a la emisión
Cupones Cortados : 0
Clasificación Fechas Variables
Grabar X Cancelar

Figura 23ª

Nuevamente presione aceptar

El paso anterior es el último paso de ingreso de datos antes de poder ingresar de forma correcta y continuada una transacción de compra.

<u>Volver</u>


# NOTAS DEL USUARIO



### II. Compra de Títulos No Seriados o Sin Descriptor

El menú de transacción que se utiliza es el mismo por lo tanto omitiremos las explicaciones ya dadas usted solo debe seguir el mismo procedimiento, paso a paso el ingreso y chequeo de los datos a ingresar, en orden de preparar el ambiente ideal para el repectivo ingreso, en este caso una transacción para instrumentos no seriados o sin descriptor nos implica un poco mas de especificación al momento de la compra, ademas de eso el resto del procedimiento es el mismo.

👮 COMPRA A TERMIN	0 - 525 - CITIBANK								_ 🗆 🗙	
Folio OMD: 525 Fecha Operación : 21/08/2000 [5]										
Cartera : GT1EUR				Оре	rador : MA	NAGER				
Cliente / CITIBANK				Moneda	Caja : US	D				
Detalle de Instrumentos Da	atos Transacción 🗍 Dato	s Anexos								
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (USD)	Cupones 🔺 Cortados	
BUNDEUR2030	167,000	0.90	5.3515	112.57	113.06	116.99	195,369.28	176,125.41		
•							0.00		•	

Figura 1b

Datos Cartera: Cliente/Contraparte: Fecha Operación: Operador: Moneda Caja:



Detalle Transacción	
Nemotécnico	Seleccionar
Valor Nominal	Dato
Tipo Cambio	Dato
T. I. R.	Dato
Precio o % Par	Dato
PX Clean Bid	Dato
PX Dirty Bid	Dato
Valor Invertido UM Dato	
Valor Invertido (USD)	Dato
Cupones Cortados:	No aplica

Datos Transacción Forma Entrega Inicial Respaldo Físico Condición Pago Inicial Condición Pago Final Tipo de Pago Custodia Origen Custodia Destino Fecha de Pago

Para esta parte de la Transacción en renta fija y variable las definiciones se hacen por Default antes del ingreso de estas. En la carga inicial de datos se dejan establecidos estos en Códigos Generales.

Datos Anexos

Por cuenta De:	Default empresa Trading,
Motivo:	Cupón / TIR
Fecha Compromiso:	Default Fecha Operación
Motivo Inversión:	AFS /HTM
Observación:	Comentarios

Si algunos de los datos mencionados anteriormente no estuvieran disponibles significa que el mismo debe ser ingresado, con la misma modalidad explicada anteriormente.

La diferencia en este tipo de transacción parte desde la creación del instrumento genérico (se deduce que anterior a este paso el procedimiento es igual al anteriormente descrito).



### Ingreso transacción

Presione insertar nuevo registro e ingrese los datos como ya se explico, la diferencia en este ingreso estará al seleccionar el Nemotécnico, el cual en este caso se crea en la misma transacción luego al querer ingresar el nominal (dando un clic o tab.) solicita los datos del instrumento. Con la pantalla que se muestra a continuación.

Datos Instrumento	
Emisor :	Tasa Emisión : 0.000000 %
Instrumento :	Moneda Instrumento :
Fecha Emisión : 20/04/2004 15	Fecha Vencimiento : 20/04/2004 15
Tipo Nominales ◯ Iniciales ⊙ Finales	Aceptar X Cancelar

Figura 2b

Para terminar de ingresar la transacción se debe aplicar el procedimiento explicado anteriormente, ya que la mecanica de ingreso de este mantenedor en adelante es la misma.



# NOTAS DEL USUARIO



### III. Venta de instrumentos de Renta Fija Seriados y No Seriados

Diríjase al Menú Mesa de Dinero seleccione la opción Venta de Títulos, Presione insertar nuevo Registro e ingrese los datos solicitados.

Archivo	Transacciones	Valorización	Informes	Rentabilidad	Ventana	Ayuda				
	B.R.		<b>\$</b>			8	111	ا الله الله الله	<b>77</b>	

Figura 1c

🛃 VENTA A TERMINO									
	8								
Folio OMD: Fecha Operación : 30/04/2004 📧									
Cartera :				Оре	ador :				
Cliente / Contraparte :	Cliente / Moneda Caja :								
Detalle de Instrumentos D	atos Transacción 🛛 Dato	is Anexos							
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido	
ļ									
							0		
Figura 2c									

Datos Cartera: Cliente/Contraparte: Fecha Operación: Operador: Moneda Caja:



### **Detalle Instrumentos**

Cuando llegue a esta parte de la transacción, presione un clic derecho, diríjase a la opción 'Asignar Stock', luego Por OMD. Figura 3c

👿 VENTA A TERMINO - 🗉 DEI	UTSCHE								
	6								
Folio OMD: 3	00:58	:37	F	echa Opera	ción : 30/0	04/2004	15		
Cartera : ZSCP01 Operador : MANAGER ····									
Cliente / DEUTSCHE Moneda Caja : ARS									
Detalle de Instrumentos Datos	Detalle de Instrumentos Datos Transacción Datos Anexos								
Nemotecnico Va	lor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS)	
	1								
Cancela	r								
Datos Ir	nstrumento								
Datos A	dicionales								
Custodia	a Instrumento						0.00		
Asignar	Stock			,					
👼 VENTA A TERMINO DE	UTSCHE								
	b								
Folio OMD: 3	00:57	':29	F	echa Opera	ición : 30/	'04/2004	15		
Cartera : ZSCP01				Oper	ador : MA	NAGER			
Cliente / DEUTSCHE				Moneda	Caja : AR	S			
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción Dato	s Anexos							
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción Dato alor Nominal	os Anexos     Tipo	T.I.R	Precio	Px	Px	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción   Dato alor Nominal	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción Dato alor Nominal	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción Dato alor Nominal elar ar	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	, Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato:	s Transacción Dato alor Nominal elar ar s Instrumento	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato: Nemotecnico Va	s Transacción Dato alor Nominal elar ar s Instrumento s Adicionales	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	
Detalle de Instrumentos Dato: Nemotecnico Va Canci Elimin Dato: Dato:	s Transacción Dato alor Nominal elar ar s Instrumento s Adicionales odia Instrumento	os Anexos Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (ARS	

Figura 4c

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.



💌 Stock o Posición de Cartera: GT1EUR	
PARAMETROS DE SELECCION	Tasa EmisiónTasa Compra
Emisor :	Mayor que
Instrumento :	Menor que
Serie :	Asignar
Nemotécnico :	Mayor gue Años
🦵 Incluye Compras del día	Menor que Años
T Folio Item Nemotécnico Mone Operac	da Mon./Indice Moneda Valor Nominal TIR Emis. Tasa_Compra Valor Present A

## Figura 5c

En este Menú debemos seleccionar el Stock que queremos vender, como pueden apreciar tenemos varias opciones de selección de parámetros, utilice la mas adecuada para la ocasión y presione la opción 'Ejecutar Selección', los registros vigentes que esten disponibles apareceran en la pantalla como se muestra a continuación.

### Figura 6c

Ì	<b>1</b>	Stoc	k o Posic	ión (	de Cartera: G	T1EUR							
(	PARAMETROS DE SELECCION Tasa Emisión Tasa Compra												
ā		E	misor :			1	Ma	yor que		Mayor que			
е Э	h	nstrur	mento :		•		Me	nor que		Menor que			ecuta <u>S</u> elección
e	Serie Asignar												
- -	Ne	Nemotécnico     BUNDEUR2024     Image: Comprass del día											
Ĩ		Т	Folio	ltem	Nemotécnico	Moneo Operac	da :ion	Mon./Indice Instrumento	Moneda Del Indice	Valor Nominal	TIR Emis.	Tasa_Compra	Valor Present 🔺
	▶	С	524	1	BUNDEUR20	USD		EUR		370,880.0000	6.2500	5.8693	514,
		С	523	1	BUNDEUR20	USD		EUR		90,303.0000	6.2500	5.4944	130,4
		С	522	1	BUNDEUR20	USD		EUR		180,606.0000	6.2500	5.0996	272,€
-		С	521	1	BUNDEUR20	USD		EUR		90,303.0000	6.2500	5.3443	132,6
		С	520	1	BUNDEUR20	USD		EUR		46,171.0000	6.2500	4.3559	75,



Luego "Presione el botón *control* del teclado y con el Mouse marque las opciones de Venta" como se muestra a continuación

🛃 Stock o Posición de Cartera: GT1EUR			_ 🗆 🗙
			4
PARAMETROS DE SELECCION	Tasa Emisión	Tasa Compra	
Emisor :	Mayor que 📔 🗖	Mayor que	
Instrumento	Menor que	Menor que	Ejecuta Selección
Serie :			Asignar
Nemotécnico BUNDEUB2024	Plazo al Vencimiento		
	Mayor que A	ños 🗖	
☑ Incluve Compras del día	Menor que A	ños 🗖	
p manyo compression and			
T Folio Item Nemotécnico Mone	da Mon./Indice Mone	da Valor Nominal TIR Emis.	Tasa_Compra Valor Present 🔺
	cion I Instrumento I Del Inc	lice	
C 524 1 BUNDEUR20 USD	EUR	370,880.0000 6.2500	5.8693 514,3

Figura 7c

Posteriormente presione la opción 'Asignar', el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

Traspas	o de Stock		×
jAsigi	ación existosa!		
	OR PRESENTE	 	
A	cionado : 514,351 signado : 514,351		<u>Salir</u>

Figura 8C

Presione Salir y cierre la pantalla de selección



Encontrara que en la transacción se encuentran los datos seleccionados

👿 VENTA A TERMINO	CITIBANK								
Folio OMD: 7	00:51	:45	F	echa Opera	ación : 317	/12/2003	15		
Cartera : GT1EUR				Оре	rador : MA	NAGER			
Cliente / CITIBANK Contraparte :				Moneda	Caja : US	D			
Detalle de Instrumentos Da	atos Transacción 🛛 Dato	s Anexos							
Nemotecnico	Valor Nominal	Tipo Cambio	T.I.R	Precio o % PAR	Px Clean Bid	Px Dirty Bid	Valor Invertido UM	Valor Invertido (USD)	
BUNDEUR2024	370,880		5.8693	104.11			409,971.98	514,350.85	
						514,35	50.85		

Figura 9c

Debemos considerar en caso que la venta de nominales sea parcial usted debera digitar sobre el 'Valor Nominal' los nominales que desea vender luego digite los datos acordes a la parcialidad del nominal.

Revise el resto de los datos, una vez realizado este chequeo confirme la Venta.

Volver



# NOTAS DEL USUARIO



A continuación, encontrara algunos Anexos con información de algunos menus disponibles que tiene el sistema, los cuales le serviran de ayuda en el manejo diario del sistema.

### Anexo N° 1 Motivo de Inversion OMD

### Mesa de Dinero

En el Menú Mesa de Dinero, ingrese a Transacciones, luego a la opción Motivo de OMD.



Se mostrará el siguiente dialogo

👼 Mantención Motivos	de OMD				_ 🗆 🗙
					-1
Fecha Operación desde : Fecha Operación hasta : Cartera : Folio :		Emisor : Instrumento : Serie : Nemotécnico :		<u>{ Selección</u>	
Cartera Tran.	Folio Item Fe Ope	cha Fecha ación Vigencia	Emisor Instrumento	Serie Ne	motecnico Motivo 📥
					-
•					Þ



Seleccione los filtros que utilizara para el chequeo, una vez realizado presione la opción

El dialogo (según los filtros que selecciono) debiera mostrarse como se detalla a continuación

1	🝯 Mantención	Motivo	s de OMD								_ 🗆 🗙
	d d B	×									-
	Fecha Operaciór	n desde :	01/06/2004		J.	Emisor :		<b>-</b>			
	Fecha Operación hasta : 30/06/2004 🔄 🔽 Instrumento :										
	Cartera : Serie : Serie :										
		Folio :			0 Nemo	otécnico :					
			,		,						
Γ	Cartera	Tran.	Folio	Item	Fecha	Fecha	Emisor	Instrumento	Serie	Nemotecnico	Motivo 🔺
١.	DATRIMONIO	<u> </u>	207	1	Uperación 1520020004	Vigencia 1520020004		FLUCDEN			
ľ			307		10/06/2004	15/06/2004	AMBEV	FI-USDFIX	US20441XAB82	AMBEV 2011	UPV
-	RRVVME	L -	222	1	02/06/2004	02/06/2004	GUBPER	FI-USDFIX	US715638AP79	PERU GLUBAL	VLMTL
_	RRVVME	С	223	1	02/06/2004	02/06/2004	GOBPER	FI-USDFIX	US715638AP79	PERU GLOBAL	VCMTC
	RRVVME	С	224	1	29/06/2004	29/06/2004	GOBPER	FI-USDFIX	US715638AP79	PERU GLOBAL	VCMTC
	RRVVME	С	251	1	02/06/2004	02/06/2004	GOBMEX	FI-USDFIX	US91086QAJ76	MEXICO	VCMTC
1	RRVVME	С	254	1	15/06/2004	15/06/2004	GOBMEX	FI-USDFIX	US91086QAG38	MEXICO	VCMTC
1	RRVVME	С	263	1	02/06/2004	02/06/2004	PEMEX	FI-USDFIX	US706451AG65	PEMEX 8.625	VCMTC
1	RRVVME	С	264	1	15/06/2004	15/06/2004	PEMEX	FI-USDFIX	US71654YAB11	PEMEX 8.625	VCMTC
	BBWWMN	С	126	1	09/06/2004	09/06/2004	EDELNOR	FI-VACFIX	PEP70101M118	EDELNOR	VCMTC
	BRVVMN	С	127	1	09/06/2004	09/06/2004	EDELNOR	FI-VACFIX	PEP70101M118	EDELNOR	VСМТС 🚽

Como ya lo mencionamos usted puede insertar un nuevo registro o modificar uno ya existente, presione insertar, el siguiente dialogo aparecera en su pantalla.

👏 Edición de Moti	vo _ 🗆 🗙
Folio: Item	307
Transacción	C 🔽
Fecha Desde:	15/06/2004 15
Fecha Hasta:	77 🗉
Motivo:	DPV 💌
Aceptar	<u>C</u> ancelar

Notará que el único campo que permite ser modificado es Motivo, cambie la opción, pero NO olvide Aceptar el cambio de registro, si no este no se grabara. El mismo procedimiento se debe aplicar para cualquier cambio en el Motivo de la Inversión que se requiera.



## Anexo Nº 2 Trayectoria de OMD

Menú Mesa de Dinero

Dirijase al Menu Transacciones, 'Trayectoria OMD'.



El siguiente dialogo aparecera en su pantalla.

👼 Trayector	ia OMD de C	OMPRA									-	
Folio OMD: Cartera :	[ /	Fecha de	ntraparte : e Compra :			Estado OM	ID :				4	Ţ
Detalle OMD												
Cartera I	Nemotécnico	Emisor	Instrumento	Serie	Fecha Emisión	Fecha Vencimiento	Tasa Emisión	Tasa Coa	Mon. Inst.	Valor Nomina	Valor I Invertido MC	1
•												
		C										•
Transaccion	Folio	Ttom	Nomotéonico		iacha I	Facha	Таса	1	Va	o	Valor	
Thursdeeron	Interno	TIGHT	Nemorechico		eración	Vencimiento	Venta		Nom	inal	Invertido MC	
Þ				-								
												-
Total Nor Nomina Nominales Co Nomina	minales OMD les Vendidos omprometidos ales Vigentes	:	0.00 0.00 0.00 0.00								Imprimir	2



Seleccione un folio, como puede apreciar aqui obtenemos la historia completa del folio, ademas de los datos de la compra encontrara si es el caso las ventas asociadas y si esta tuviera nominales vigentes.

ģ	🚺 Trayect	oria OMD	de CO	OMPRA									_ 🗆 🗙
F	olio OMD: Cartera :	3 <sup>.</sup> RRVVMN	2 🗸	Fecha	ontraparte : 1 de Compra : 2	TEMPOF 28/11/2	RAL 005	Estado O₩	ID: V	IGEN	ſE		-
C	)etalle OM	D											
	Cartera	I Nemot	écnico	Emisor	Instrumento	Serie	Fecha Emisión	Fecha Vencimiento	Tasa Emisión	Tasa Mon Cpa Inst	. Valor Nomina	Valor al Invertido	MC A
D	BRVVMN	1 MEXIC	0	GOBMEX	FI-USDFIX	US91086	11/04/200	3 08/10/2008	4.63	4.36 USE	500,00	0.00 50	3,837
	ravectoria	OMD de \	/ENTA	S									-
Γ	Transacci	on Foli	。	Item	Nemotécnico	F	echa	Fecha	Tasa	V V	alor	Valor	
		Inter	no			Op	eración	Vencimiento	Venta	No	minal	Invertido M	c 🔲
	•												
													-
	Total I Nomi Nominales Nom	Nominales inales Ven Comprome inales Vin	OMD didos etidos entes	:	500,000.00 0.00 0.00 500 000 00							E Imprimi	

Ademas, si se requiere usted puede imprimir esta informacion, o bajarla a excel.

Volver



## Anexo Nº 3 Valoracion Stock Renta Fija

### Menú Mesa de Dinero

Dirijase al Menu 'Valorizacion' luego, Valorización Stock.

Archivo	Transacciones	Valorización Informes	Rentabilidad Ventana Ayuda
LI E	B.R. IRE	Instrumentos IIF.	
		Renta Fija	
		Bonos BR CBR	
		Valorización Stock	
		Valorización Renta Va	ariable

El siguiente dialogo aparecerá en la pantalla

👼 Valoriz	zación de Posició	1	_ 🗆 🗙
			? 🚽
Desde :	31/08/2004	<u>V</u> aloriza	
Hasta :	31/08/2004	Errores	
Parámetros	s de Valorización		]
☐ Rango ☐ Cartera	de Fechas 🔲 Instr as 🗍 Emis	rumentos 🔽 ( sores 🗌 S	Genera Stock Solo Stock

En este dialogo se muestra la entrada de parámetros para realizar la Valoración del portfolio de Renta Fija, es importante que se recuerde que este proceso debe realizarse de forma continua, ya que de este proceso automáticamente se envian los datos de valorización al Menu de Gestión. Para el menú de la Mesa y la visualización de Stock Vigente solo mostrará el último día valorizado.

Luego de presionar la opción 'Valoriza' se ejecutará el proceso de valorización, donde el sistema entregará un reporte de errores dentro del periodo en que el proceso se ejecute si correspondiese.

Volver



### Anexo Nº 4 Reporte Valoración de Stock Renta Fija

Mesa de Dinero

Dirijase a la opción



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

Cartera	CONSOLIDA 🚽 🔽 Consolida			
Descripción	CONSOLIDA			
Fecha Stock o Posición	24/04/2003			
P Resumen por Nemoténico	Ex Detaile de stock por OMD	X Cancelar		

Aqui podemos obtener el reporte con la Valorización del Portfolio a la última fecha de ejecución de Valorización ademas tenemos la posibilidad de Consolidar la Empresa por todas sus carteras o algunas de ellas presionando el checkbox 'Consolida', al presionar este botón y seleccionar las carteras existe un procedimiento de verificación de fechas de valorización, esto significa que si algunas de las carteras seleccionadas no estuviera valorizada a la misma fecha el sistema no permitira la consolidación de los datos.

Encontraremos aqui por ejemplo los siguientes datos: Nemotécnico, folio, valor nominal, clasificación de riesgo, duration, valor presente, valuación, cartera, empresa, moneda, etc.

Teniendo tambien la posibilidad de utilizar varios filtros para obtener la información deseada. Como se muestra a continuación.



											· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
P	ARA	METROS	DE	SELECCION	-1	Fasa Emisión		Tasa Comp	ra -		
	F	Emisor :				Mayor que	_	Mayor que			
Instrumento		ir i			Menor que		-	Finnuta Calención			
				and the second	A STATE		nie diata		Elecula Selección		
		Selle 1	-		- F	lazo al Vencimiento					Imprimir [
Ne	emoté	ácnico :									
r	= In	cluye Com	pras d	<u></u> Iel día		Mayorque Menorque	Años ( Años (				Lexto
r	T In	icluye Com Folio	pras d	iel día Nemotécnico	Moneda Operacio	Mayor que Menor que Mon./Indice	Años ( Años ( Moneda Del Indice	Valor Nominal	TIR Emis.	TIR Cpa.	Valor Presente
r	T In T C	Folio 476	pras d Item 1	tel día Nemotécnico REMBABR2	Moneda Operacion ARP	Mayor que Menor que Monor que Mon./Indice n Instrumento REMB\$ LOCAL	Años ( Años ( Moneda Del Indice ARP	Valor Nominal 133,846 0000	TIR Emis.	TIR Cpa.	Valor Presente
•	T In T C C	rcluye Com Folio 476 359	pras d Item 1	tel día Nemotécnico REMBABR2 BT07PESI	Moneda Operacion ARP ARP	Mayor que Menor que Mon./Indice n Instrumento REMB\$ LOCAL ARP	Años ( Años ( Moneda Del Indice ARP	Valor Nominal 133,846,0000 3,150,000,0000	TIR Emis. .0000 11.7500	TIR Cpa .0000 .0000	Valor Presente
 	T In T C C C	Folio 476 359 360	Item	tel día Nemotécnico REMBABR2 BT07PESI BT08PESI	Moneda Operacio ARP ARP ARP	Mayor que Menor que Mon Andice Instrumento REM9\$LOCAL ARP	Años ( Años ( Moneda Del Indice ARP	Valor Nominal 133,846,0000 3,150,000,0000 2,150,000,0000	TIR Emis. .0000 11.7500 12.1250	TIR Cpa. .0000 .0000 .0000	Valor Presente 300,179 3,335,063 2,801,773
•	T In C C C C	Folio 476 359 360 358	Item	el día Nemotécnico REMBABR2 BT07PESI BT08PESI BGX 2031	Moneda Operacio ARP ARP ARP ARP	Mayor que Menor que Mon./Indice Instrumento REM9\$LOCAL ARP USD	Años ( Años ( Moneda Del Indice ARP	Valor Nominal 133,846,0000 3,150,000,0000 2,150,000,0000 700,000,0000	TIR Emis. .0000 11.7500 12.1250 12.0000	TIR Cpa. .0000 .0000 .0000 .0000	Valor Presente 300,179 3,335,063 2,801,773 14,654,022
 		Folio Folio 476 359 360 358 352	Item 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	el día Nemotécnico REMBABR2 BT07PESI BT09PESI BGX 2031 BGX 2031	Moneda Operacion ARP ARP ARP ARP ARP ARP	Mayor que Menor que Mon./Indice Instrumento REM8\$LOCAL ARP ARP USD USD	Años ( Años ( Moneda Del Indice ARP	Valor Nominal 133,846,0000 3,150,000,0000 2,150,000,0000 700,000,0000 847,038,0000	TIR Emis. .0000 11.7500 12.1250 12.0000 .0000	TIR Cpa. .0000 .0000 .0000 .0000 12.1989	Valor Presente 300,179 3,335,063 2,801,773 14,654,022 2,470,627
•	T In T C C C C C C C	Folio Folio 476 359 360 358 352 390	Item 1 1 1 1 1 1 1	el día Nemotécnico REMBABR2 BT07PESI BT07PESI BGX 2031 BGX 2031 BGX2008U\$S CFUNDSEPC	Moneda Operacion ARP ARP ARP ARP ARP ARP ARP	Mayor que Menor que Mon./Indice Instrumento REM8\$LOCAL ARP ARP USD USD USD CITIFUND	Años ( Años ( Del Indice ARP	Velor Nominal 133,846,0000 3,150,000,0000 2,150,000,0000 700,000,0000 847,038,0000 150,000,0000	TIR Emis. .0000 11.7500 12.1250 12.0000 .0000	TIR Cpa. .0000 .0000 .0000 12.1989 .0000	Valor Presente 300,179 3,335,063 2,801,773 14,654,022 2,470,627 438,360

Como se puede apreciar se pueden obtener 3 tipos de resultados por valuación:

- Valor Presente
- Valor de Mercado
- Ambos dependiendo del motivo de la inversion

Ademas de toda la información que viene en el reporte.



## Anexo Nº 5 Valoracion Stock Renta Variable

Menú Mesa de Dinero

Dirijase al Menu 'Valorizacion' luego, Valorización Stock.

Archivo 1	Transacciones [	Valorización Informes	Rentabilidad Ventana Ayuda
В		Instrumentos IIF. Renta Fija Bonos BR CBR Valorización Stock Valorización Renta Va	ariable

El siguiente dialogo aparecerá en la pantalla

Valorización Renta Va	ariable	
🖓 Carteras	Fecha Desde	-1
	14/04/2005 15	
	Fecha Hasta	Procesar
	14/04/2005 15	Estado
		🖨 Errores
	Genera Steek al 14/04/2005	
	Genera Stock al 1470472000	
	Cálculo de Corrección Monetaria	

En este dialogo se muestra la entrada de parámetros para realizar la Valoración del portfolio de Renta Variable, es importante que se recuerde que este proceso debe realizarse de forma continua, ya que de este proceso automáticamente se envian los datos de valorización al Menu de Gestión. Para el menú de la Mesa y la visualización de Stock Vigente solo mostrará el último día valorizado.

Luego de presionar la opción 'Valoriza' (y marcar la opcion genera stock) se ejecutará el proceso de valorización, donde el sistema entregará un reporte de errores dentro del periodo en que el proceso se ejecute si correspondiese.



### Anexo Nº 6 Reporte Valoración Stock Renta Variable

Mesa de Dinero

Dirijase a la opción



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

Valores valorizados de Renta Variabl	e			
	🖓 Carteras	Fecha Cierre : 14/04/2005	Selección	-1
	🗖 Consolidación			

Aqui podemos obtener el reporte con la Valorización del Portfolio a la última fecha de ejecución de Valorización ademas tenemos la posibilidad de Consolidar la Empresa por todas sus carteras o algunas de ellas presionando el boton 'carteras' encontrara la opcion 'consolida', al presionar este botón y seleccionar las carteras existe un procedimiento de verificación de fechas de valorización, esto significa que si algunas de las carteras seleccionadas no estuviera valorizada a la misma fecha el sistema no permitira la consolidación de los datos.

Encontraremos aqui por ejemplo los siguientes datos: Cartera, Nemotécnico, Numero de acciones, Precio costo promedio corregido, valor costo promedio corregido, entre otros.

Presionando el boton de la impresora, tambien puede obtener un reporte para ser impreso o bajar el mismo a Excel.

**Volver** 



## Anexo Nº 7 Reporte de Clasificación por Instrumento

Menú Mesa de Dinero

Dirijase a la opción



El siguiente dialogo aparecerá en la pantalla.

Distrubución d	e Instrumentos		×
CARTERA		💌 🗖 Consolida 🛛 🎘 🎒 Imprimir	
1	Cartera	Descripción	•
	BC03	BLUE CHIP DOLAR	
	BC07	BLUE CHIP GLOBAL	
	CF01	COMPETITIVE PESOS	
	CF03	COMPETITIVE DOLAR	
	CF07	COMPETITIVE GLOBAL	
	ESCP01	CARTERA PROPIA PESOS	
Total C	GT1EUR	GT1EUR	
	GT1GBP	GT1GBP	•

Seleccione la opción de cartera deseada o consolide, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.



También en este menú se puede imprimir un reporte o tambien bajar la información a excel

Volver



# Anexo Nº 8 Calculadoras Interactivas

Menú Mesa de Dinero

Valorizadores Interactivos Dirijase a la opción



El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

	I DE INSTRUMENTOS D	E RENTA FIJA (-19/10/	2004) 🗕 🗖	×
<u>B</u>			? 📲	
Nemotécnico :		••• Tir :	0.0000	%
Fecha de Cálculo :	19/10/2004 15	% Valor Par :	0.0000	
Nominales :	0.0000	Valor Presente :	0.0000	
Fecha de Compra : Valor Resultados en : Cálculo a Realizar Calculo Valor Par Calculo Valor Pre Calculo Valor Pre	19/10/2004 sente rna de Retorno	☐ Incluye Cupón a la ☐ No considera exce ☐ Considera solo flu	<u>C</u> alcular Fecha de Cálculo epción variación cambiaria jos de capital	
Cálculos Par		Cálculos Tir		
Valor Par Base :	0.0000000	% Valor Par :	0.00	%
Valor Par en UM :	0.0000	Valor Presente en UM :	0.0000	
Valor Par en MC :	0	Valor Presente en MC :	0	
Duration :	0.00	Tasa o Tir (2 dec.) :	0.00	%
Duration Modif. :	0.00	Tasa o Tir:	0.0000000	%
Convexidad :	0.00			

\* Esta calculadora la utilizamos para los instrumentos de Renta Fija



Ingrese los datos solicitados y presione la opción <u>Calcular</u>, a traves de esta calculadora interactiva usted puede obtener:

- 1. Valor Par
- 2. Valor Presente
- 3. Tasa Interna de Retorno (TIR)

Ademas, de compatibilizar los resultados anteriormente mencionados con las siguientes opciones



Calculo de Valor PAR

	I DE INSTRUMENTOS D	E RENTA FIJA (AMBEV 2	2013-31/08/ 💶 🗙						
<u>B</u>			? 📲						
Nemotécnico :	AMBEV 2013	••• Tir :	0.0000 %						
Fecha de Cálculo :	31/08/2004 15	% Valor Par :	0.0000						
Nominales :	500,000.0000	Valor Presente :	0.0000						
Fecha de Compra :	31/08/2004 13								
Valor Resultados en :	USD 🔽								
		[	Calcular						
Cálculo a Realizar	,	🔲 🥅 Incluye Cupón a la Fecha de Cálculo							
C Calculo Valor Pre	esente van de Reterre	No considera excepción variación cambiaria							
	rna de Retorno	Considera solo fiuj	os de capital						
Cálculos Par		Cálculos Tir							
Valor Par Base(100)	104.01041667	% Valor Par :	0.00 %						
Valor Par en USD:	520,052.08	Valor Presente en USD:	0.00						
Valor Par en USD:	520,052.08	Valor Presente en USD:	0.00						
Duration :	7.00	Tasa o Tir (2 dec.) :	0.00 %						
Duration Modif. :	7.00	Tasa o Tir :	0.0000000 %						
Convexidad :	64.46								



También, tenemos un valorizador interactivo para los instrumentos No seriados, dirijase a la opcion



El siguiente dialogo aparecera en su pantalla.

VALORIZACION DE INSTRUMENTOS IIF.				- 🗆 🗙
<u><b>B</b></u>				? 🗐
Datos para el cálculo				
INSTRUMENTO :	Va	alor Nominal :	0.00 Nominales	
Fecha Valorización : 19/10/2004	Va	alor Invertido :	0.00 C Finales	
Unidad :				
Tasa Interes : 0.000000 %	Valor Re	esultados en :	<u>C</u> alcular	1
Tasa de Emisión : 0.000000 %	Fe	oho Emisión :		
Calculo Valor Par			Cancelar	
C Calculo Valor Presente C Calculo Tasa Interna de Retorno	Fecha	Vencimiento		
r Valores Según la emisión	T echo	Valores Presentes		
Valores en Unidad de Emisión				0.00
Valor Unidad de emisión	0.00	Valor Unidad de emisión		0.00
Valor Inicial / Futuro	0.00	Valor en Moneda Conversión		0.00
		Tasa a 4 decimales	0.0000	)
Valores en Unidad de Lonversion	0.00	Tasa a 2 decimales	0.00	
Valor en Moneda Conversión	0.00		,	
Valor Inicial / Futuro	0.00			

Aqui podemos valorizar y obtener gran variedad de datos para instrumentos No Seriados o Sin Descriptor.



## Anexo Nº 9 Carga de Valores a traves de archivos

### Carga Automática

En el sistema existe un formato específico por medio del cual podemos realizar el ingreso de parámetros que son de utilización diaria para nuestra valorización del Portfolio.

Este formato debe cumplir las siguientes características dependiendo del tipo de valor que desea traspasar, el archivo debe ser de Texto con tabulaciones delimitadas y un fin de archivo. Si el archivo no cumpliera con estas características el sistema entregara un error de carga. A continuación, encontraran los formatos especificados según el tipo de valor.

CARGA MC	ONEDA	S (ARCHIV	D TXT - DE	LIMIT	ADO POR T	TABU	LACIONES)		
FECHA	COD	IGO	MONEDA		VALOR		TIPO		
	MON	EDA	PARIDAD						
31/12/2002	USD		ARS		1	10.45	MONEDA		
		(						r	
CARGA T	ASAS	(ARCHIVO	TXT - DELI	MITAI	DO POR TA	BUL	ACIONES)		
FECHA	COD	IGO	CODIGO		VALOR		ПРО		
21/12/2002	31/12/2002 LIBO-180					6 17	ΤΛςΛ	L .	
31/12/2002			LIDO-100			0.47	TAJA		
CARGA IN	DICES	S ( ARCHIVO	TXT - DEL	IMITA	DO POR T	ABUL	ACIONES)	[	
FECHA CODI		IGO	MONEDA		VALOR		TIPO		
	INDI	NDICE PARIDAI							
31/12/2002	UF		CLP		1	10.45	INDICE		
CARGA TAS	AS ME	RCADO (AR	CHIVO TX	T - DE		POR	TABULACION	ΞS)	
FECHA	10000	NEMOTECN		VAL	OR				
31/12	/2002	DANIMY000			1.1				
51/12	12002	DAIMINIA070	1			1.2			
CARGA PRE	CIO M	ERCADO RE	NTA FIJA (	ARC	HIVO TXT -	DEL	MITADO POR	TABULACIONES)	Π
FECHA		NEMOTECN	VICO	VAL	OR			,	
31/12	/2002	UMS050406	'n			11			
31/12	/2002	GIDUSA080	)3		1.2				
CARGA PRE	CIO M	ERCADO RE	NTA VARIA	ABLE	(ARCHIVO	CSV	- DELIMITADO	POR COMAS)	
FECHA		NEMOTECN	VICO	VAL	ÓR		TIPO		
31/12	/2002	UMS050406	, )			1.1	CIEF	RE	
31/12	/2002	GIDUSA080	)3			1.2	CIEF	₹RE	
CARGA PRE	CIO PO		ARCHIVO			JO PO	JK TABULACIO	JNES)	
FECHA		NEMOTECI	NICO	VAL	UK				
31/12	/2002	EKTFIN981				1.1			
31/12	/2002	SINALUA91				1.2			

El menu de carga de datos esta en Administración del Sistema, Archivo, Traspasos, Carga Valores.



Archivo Ayuda							
Administración	۲	h	13%				
Traspasos 🕨 🕨			Front-Back Back-Front				
Calia da Administracion			Carga Valores				
Salir de Administración	_		Genera Archivos de Texto				
			Carga Operaciones Desde Archivos CSV				

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

🛒 Carga de Valores.				- 🗆 ×
Archivo Lectura :		ß	<u>C</u> arga	-
⊂Valor a Traspasar ⊂ Monedas, Tasas e Indices	C) Tasas de Mercado	C Precios de l	Mercado (BV)	
C Precios de Mercado (RF)	C Precios por titulo			
Registros Procesados :				

Seleccione el archivo que desea traspasar y el tipo de valor luego presione 'Carga'.

En el campo Registros procesados saldra la cantidad de registros que se traspasaron en el archivo. Una vez terminado este proceso el sistema dara el siguiente mensaje.

Lectura	×
•	Proceso Finalizado
	ок

Por lo tanto, los datos fueron cargados con exito.



# Anexo Nº 10 Libro de Operaciones Renta Fija

### Libro de Operaciones

Podemos obtener a traves de un reporte todas las operaciones de renta fija realizadas dentro de un periodo determinado, ademas de tener la posibilidad de seleccionar con otros filtros, este mantenedor se encuentra en el mantenedor de Mesa de Dinero, Informes

Archivo	Transacciones	Valorización	Informes	Rentabilidad	Ventana	Ayuda					
1	B.R.					<mark>} </mark> ₿	111	<b>11</b>	<b>i se </b>	6 🕎	₽

Archivo	Transacciones	Valorización	Informes	Rentabilidad	Ventana	Ayuda						
	B.R.		Libro d Libro O Proyec Informe	e Operaciones peraciones Re ción Vencimier e BR Vencidos	<b>Renta Fija</b> inta Variable ntos Renta y No Cobra	e Fija dos	2 111	1	8	8	<b>1</b>	<mark>}}</mark> ₿

El siguiente dialogo aparecera en su pantalla

👮 Libro de Operacione	s Renta Fija	_ 🗆 🗙
		? 📲
Carteras	Fecha Operación Desde : 01/01/1900 II Hasta : 31/08/2004 II	🞒 Imprimir
	Emisor :	Opciones © Operaciones Confirmadas no Nulas © Operaciones Nulas
Consolidación	Moneda:	<ul> <li>Operaciones Nulas y no Nulas</li> <li>Operaciones No Confirmadas</li> </ul>

Aquí usted puede seleccionar una cartera o consolidar varias, elegir un periodo de obtención de transacciones e incluso especificar en detalle caracteristicas de las transacciones, tambien puede optar por operación vigente, confirmadas, anuladas, etc. Finalmente, usted puede imprimir la información en un reporte o bajar la información a excel.



## Anexo Nº 11 Proyección de Vencimientos

#### Proyección de Vencimientos

Podemos obtener a traves de un reporte todas las operaciones de vencimientos realizadas dentro de un periodo determinado (este periodo puede retroceder, avanzar o ejecutar una posición presente) ademas, de tener la posibilidad de seleccionar con otros filtros, este mantenedor se encuentra en el mantenedor de Mesa de Dinero, Informes

Archivo	Transac	ciones	Valorización	Informes	Rentabilidad	Ventana	Ayuda					
<b>UB</b>	B.R.	<b>B</b>		<b>\$</b>			₿ 🐯	111			<b>.</b>	₽¢¢



El siguiente dialogo aparecera en su pantalla

🔲 Informe Ven	cimientos		_ <b>_</b> ×
Cartera :			arteras 🕂
Fecha Inicial :	19/10/2004	•••	
Fecha Final :	31/10/2004		Calculo
			Informe 🚑

Aquí usted puede seleccionar una cartera o consolidar varias, tambien debe elegir un periodo de obtención de vencimientos,

<u><u><u>C</u>alculo</u></u>

una vez seleccionados los parámetros correspondientes presione la opción. Finalmente, usted puede imprimir la información en un reporte o bajar la información a excel, para ingresar a la opcion de impresión presione la





# CONTABILIDAD PMS

### <u>Contabilidad</u>

A continuación, encontraran una guía útil en el manejo diario del sistema PMS. La forma de enfocar este documento es presentando la confeccion contable en detalle con sus diferentes opciones, analizando los parámetros que necesitamos para lograr este objetivo.

### Ingreso de Datos Contables y Ejecución de Procesos

- Plan de Cuentas
- Hechos Económicos
- Enlaces Contables

- Ejecuciones de Procesos Contables
- Generación de Archivos de Traspaso





# Contabilización en Sistema PMS

La Contabilización en el sistema PMS, se basa en la imputación a cuentas contables, de los **resultados de los informes del sistema**, esto mediante el uso de Hechos Económicos y Enlaces Contables los cuales permiten definir la forma en que se deben generar los asientos contables (Vouchers).

Diríjase al menú Mantención de Tablas, Archivo, Códigos Generales, Clasificaciones

Archivo Ayuda			
Códigos del Sistema	►	Paises	1
Grupo Económico	►	Códigos Generales	
Tablas Financieras	•	Unidades de Medida	-
Tablas Contables	⊁	Transacciones	
Salir de Mantención de Tablas		Clasificaciones	
		Identidades	
		Impuestos	
		Equivalencias	
		Tratamiento Fechas	

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

👼 Clasificación de Objetos		×
	?	4
Código Objeto : PLACPRUEBA		-
Estructura		



### I. Plan de Cuentas

El plan de cuentas es definido en el sistema en el mantenedor de clasificaciones, permitiendo de esta forma la creación de múltiples planes de cuenta, si así lo requiere la definición de la contabilidad de la empresa. Además, por su definición en una estructura jerárquica tipo árbol de Windows, ofrece la ventaja de permitir la definición de cuentas y sub - cuentas en un número ilimitado de niveles.

Presione insertar nuevo registro y digite los campos que requiere el sistema. Elija una codificación para nombrar el plan de cuentas y luego ingrese la descripción.

Código Objeto: Digite código Descripción Objeto:Describa el código

Luego, presione confirmar registro

Posteriormente ingrese a la opción	Estructura el s	iguiente dialogo aparecerá en su pantalla
Estructura de Clasificación		

Archivo Ayuda		
	?	-
e PLAN DE CUENTAS DE PRUEBA		

Aquí ingresaremos el plan de cuentas que utilizaremos en la contabilidad. Presione insertar nuevo registro, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

TIPO CLASIFICACION	×
TIPO CLASIFICACION	
Aceptar X Cancelar	

Digite el numero de cuenta y su descripción, como se muestra a continuación



TIPO CLASIFICACION	×
TIPO CLASIFICACION	
00000001 BANCO	
Aceptar Cancelar	

Luego, presione Aceptar

👼 Estructura de Clasificación		×
Archivo Ayuda		
	?	-
efe PLAN DE CUENTAS DE PRUEBA		

A continuación, siga la misma dinámica de ingreso para el resto del plan de cuentas.

👿 Estructura de Clasificación	×
Archivo Ayuda	
	? 📲
FLAN DE CUENTAS HOME OFFICE	<b>_</b>
	]
and 10122 NON- CID BONDS- SHORT TERM- COST	
10126 NON- CID OTHER SHORT TERM	
a 10127 CID OTHER SHORT TERM- COST	
a 10130 BONDS- IMPAIRMENT REVALUATION	
a 10150 INTEREST RATE FUTURES O/S	
- A 10152 UNAMORT GAIN ON BOND DERIV	
a a second secon	
and the stocks-common-cost	
ूर्द्ध 10213 NON - CID STIOCKS- COMMON-COST	
Ended a contraction of the second sec	
E CONTRACTOR CONTRACTOR CONTREVIEW TO MRKT	
10222 CID STOCKS- PREFERRED-COST	
a 10223 NON-CID STOCKS- PREFERRED-COST	
10224 CID STOCKS-PREFRD-REV TO MKT	
10225 NON- CID STOCKS-PREF-REV TO MKT	
	-



# NOTAS DEL USUARIO



### II. Hechos Económicos

Una vez terminado el ingreso del plan de cuentas, en el mismo menú vuelva a la opción Archivo, Tablas contables, Hechos económicos

Archivo	Ayuda		
Códig	os del Sistema	•	
Grupo	Económico	•	
Tablas Financieras 🔹 🕨		.⊁_	
Tablas Contables			Hechos Económicos
Salir de Mantención de Tablas			Enlaces Contables

En este parte del proceso de ingreso ingresaremos los parámetros necesarios para crear los hechos económicos. Básicamente, un hecho económico es un código y una glosa, que permiten agrupar la definición de operaciones sobre el plan de cuentas.

Este procedimiento se realiza especificando la cuenta que debe afectar, la forma (Debe – Haber / Cargo – Abono / Débito - Crédito) y de donde deben ser obtenidos los valores (datos del reporte). A continuación, mostraremos la forma práctica de ingresar estos registros.

Primero debe elegir la codificación adecuada, para esto es necesario que analice la información. Por ejemplo: si queremos ingresar un hecho económico de compra de una empresa específica, moneda, tipo de inversión, etc.

Empresa - Prueba Instrumento - Largo Plazo Moneda - Dólar

Código:PRCPALPUSD (Máximo 10 caracteres)Descripción:EMPRESA DE PRUEBA INVERSIONES LARGO PLAZO USD

Presione insertar nuevo registro e ingrese el nombre de hecho económico como se muestra a continuación



🔲 Mantención Hechos Eco	nómicos	- 🗆 ×	]
d∎¶∕×⊗	•	? 📲	
Código Hecho Económico :	PRCPALPUSD		
Descripción Hecho Económico :	EMPRESA DE PRUEBA INVERSIONES LARGO PLAZO EN DOLARES		
Plan de Cuentas :	PLACPRUEBA		
	_		
		-	1

Digite los datos solicitados

Código Hecho Económico: Descripción Hecho Económico: Plan de Cuentas: PRCPALPUSD EMPRESA DE PRUEBA INVERSIONES LARGO PLAZO USD Seleccione plan de cuentas que corresponda

Luego, presione confirmar registro

A continuación, posicione el Mouse en la parte inferior de este menú un clic derecho como se muestra en la siguiente pantalla

Mantención Hechos Económicos		- 🗆 🗙
	?	4
Código Hecho Económico : PRCPALPUSD		
Descripción Hecho Económico : EMPRESA DE PRUEBA INVERSIONES LARGO PLAZO EN DOLARES		
Plan de Cuentas : PLACPRUEBA		
Insertar		
Modificar		
Eliminar		

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla



Hechos Económicos			×
Hecho Económico :	PRCPALPUSD	1	
<u>P</u> lan de Cuenta :	PLACPRUEBA	1	
<u>C</u> uenta :			-
<u>D</u> ebe / Haber :	•		
<u>T</u> ipo de Hecho :	•		
<u>C</u> ódigo Monto :	V	Código Monto Origen :	
Máximo Ajuste :	0.00	Máximo Ajuste Origen : 0.00	
Ajustar Diferencia			
		<u>A</u> ceptar <u>C</u> ancelar	

En este menú solo seleccionaremos los siguientes datos.

Cuenta:	Selección la cuenta
Debe/Haber:	Seleccione donde quiere dirigir la cuenta
Tipo de Hecho:	ΜΟΝΤΟ
Código Monto:	Selección de la columna del reporte que se obtendrá el valor para imputar a la cuenta contable en moneda conversión este campo se activa luego de seleccionar como tipo de hecho 'monto'
Código Monto Origen:	Selección de la columna del reporte que se obtendrá el valor para imputar a la cuenta contable en moneda origen solo si el reporte tiene disponible la conversión de moneda
Ajustar Diferencia:	Optativo - Al marcar esta opción se activa el campo 'Maximo Ajuste' para moneda de conversión y moneda origen
Máximo Ajuste:	Optativo – Se establece el máximo de ajuste posible para el hecho económico en moneda de conversión.
Máximo Ajuste Origen:	Optativo – Se establece el máximo de ajuste posible para el hecho económico en moneda origen.
Luego, presione Aceptar	


i M	antención Hechos Eco	nómicos						- 🗆	×
đ							?	-1	
	Código Hecho Económico :	PRCPALPUSD							
Desc	ripción Hecho Económico :	EMPRESA DE PRU	IEBA INVERSIONES LA	RGO PLAZO EN	DOLARES				
	Plan de Cuentas :	PLACPRUEBA	-						
		,	_						
Cue	nta			Debe / Haber	Tipo	Descripción		Ajuste	
000	00001 BANCO			HABER	MONTO	INTEREST RECEIVED			

Continúe ingresando el hecho económico con la misma metodología logrando el cuadre del mismo y cubriendo todas las características deseadas como se muestra a continuación

nivo Ayuda				
			? <	<b>1</b> [
Mantención Hechos Económicos				
			?	· -
Céder Usele Francézie - MEDDUO 1				
escripción Hecho Económico : VENTAS DE BONOS LARGO F	LAZO DPARTS HOME OFFI	CE CID		_
Tuenta	Debe / Haber	Tipo	Descripción	Aiusta
IA310 CASH IN TRANSIT	DEBE	MONTO		Aluste
INTERCOST IN THATST	HABER	MONTO		
0111 CID BONDS-LONG TEBM-AMOBT	HABEB	MONTO	INCREASED / DECREASED TOTAL	
0111 CID BONDS- LONG TERM- AMORT	DEBE	MONTO	INCREASE BY ADJUSTEMENT	
6010 ACCRUED INVESTMENT INCOME	HABER	MONTO	DEVENGADO DESDE ULTIMO	
2100 CAPITAL GAIN/LOSS REALIZED	DEBE	MONTO	LOSS [LOSS_DISPOSAL]	
2100 CAPITAL GAIN/LOSS REALIZED	HABER	MONTO	PROFIT [PROFIT_DISPOSAL]	S
1310 CID INV INC/EXP AMORT LT BND	DEBE	MONTO	DECREASE BY ADJUSTEMENT	
0111 CID BONDS- LONG TERM- AMORT	HABER	MONTO	DECREASE BY ADJUSTEMENT	
1310 CID INV INC/EXP AMORT LT BND	HABER	MONTO	INCREASE BY ADJUSTEMENT	
A210 CACLUM TRANCIT	DEBE	MONTO	DEVENGADO DESDE LILTIMO	

<u>Volver</u>



# NOTAS DEL USUARIO



# III. Enlaces Contables

Finalmente antes de contabilizar debemos realizar los enlaces contables para esto diríjase en el mismo menú en Archivo, Tablas Contables, Enlaces contables

Archivo Ayu	uda			
Códigos del Sistema		►		
Grupo Económico 🔹 🕨		•		
Tablas Financieras 🔹 🕨		- ▶_		_
Tablas Contables 🔹 🕨		•	Hechos Económicos	
Salir de Mantención de Tablas		;	Enlaces Contables	

El siguiente dialogo aparecerá en la pantalla

Mantención Enlaces Contables	- 🗆 🗙
	? 📲
Tipo de Contabilidad : Cartera: Proceso : Motivo de Inversión: Tipo de Operación Contable : Motivo OMD: Operación	
Instrumentos Clasificaciones Custodia Destino Emisor Contraparte Nemotécnicos	

Un Enlace Contable corresponde a la definición de los Hechos Económicos que deben ejecutarse bajo condiciones especificas, o sea como resultado de la definición de un proceso pueden definirse las diferentes formas de contabilizar dependiendo del instrumento, su emisor, su clasificación o la custodia definida en la operación.

A continuación, crearemos el enlace contable para el hecho económico de compra que vimos anteriormente.

Seleccione el proceso que requiera para realizar el enlace contable en este caso estamos llamando a un libro de compras como se muestra en la siguiente pantalla



Mantención Enlaces Contables	- 🗆 ×
	? 📲
Tipo de Contabilidad : USGAAP	
Proceso : D-PART3 Motivo de Inversión:	
Tipo de Operación Contable : T 🛛 🚽 Motivo OMD:	
C C	
Instrumentos Clasificaciones Custodia Destino Emisor Contraparte Nemotécnicos	
Nemotécnico Fecha Desde Fecha Hasta Hecho Económico	<b>▲</b>

Los procesos contables serán siempre en sus inicios ingresados por el implantador del sistema por lo tanto usted solo deberá seleccionar los procesos ya creados.

*IMPORTANTE*: Antes de continuar será su responsabilidad analizar como serán ingresados los hechos económicos para esto tiene las siguientes opciones:

- Instrumento En caso que nuestra contabilidad y cuentas se base en la definición de los instrumentos que se mantienen en cartera - Clasificaciones En caso que nuestra contabilidad y cuentas no sea a un nivel de especificación descriptivo y puedan realizarse contabilidades de forma general, por ejemplo que todos los instrumentos de largo plazo de nuestra cartera o una empresa específica se contabilicen de la misma manera - Custodia Destino En caso que nuestra contabilidad se base en la custodia de destino del instrumento En caso que nuestra contabilidad se base en los emisores de instrumentos que se mantienen - Emisor en cartera - Contraparte En caso que nuestra contabilidad se base en la custodia de los instrumentos que se mantienen en cartera - Nemotécnico En caso que nuestra contabilidad y cuentas sean tan especificas como para identificar de forma independiente cada uno de los codigos nemotecnicos que ingresamos al sistema

Una vez decidida la metodología de ingreso, posicione el Mouse en la parte inferior de este menú luego de un clic derecho como se muestra en la siguiente pantalla seleccione en este caso insertar registro.



Mantención Enlaces Contables	- 🗆 ×
	? 📲
Tipo de Contabilidad :       USGAAP       Image: Cartera:       GENERALES         Proceso :       D-PART3       Motivo de Inversión:       Image: Cartera:         Tipo de Operación Contable :       T       Motivo OMD:       Image: Cartera:         Operación       Image: Cartera:       Image: Cartera:       Image: Cartera:       GENERALES       Image: Cartera:         Operación       Image: Cartera:       Image: Cartera:       Motivo OMD:       Image: Cartera:       Image: Cartera:	
Instrumentos Clasificaciones Custodia Destino Emisor Contraparte Nemotécnicos	
Nemotécnico Fecha Desde Fecha Hasta Hecho Económico	

El siguiente dialogo aparecerá en la pantalla

Clasificaciones	×
Tipo de Contabilidad	USGAAP
Tipo de Operación	Т
Proceso	D-PART3
Operación	C
Cartera	GENERALES
Motivo Inversión	
Motivo OMD	
Código Clasificación	<b>_</b>
Clasificación	<b></b>
Fecha Desde	01/01/1900
Fecha Hasta	// 15
Hecho Económico	
[	<u>A</u> ceptar <u>C</u> ancelar

En este caso se ha decidido realizar el enlace contable por clasificación por lo tanto el sistema nos solicitara la siguiente información:

# QUALITY SOFTWARE Portfolio Manager System (PMS) Mantención Tablas – Mesa Dinero – Contabilidad



Código Clasificación:	Seleccione el código de clasificación previamente definido en el sistema
Clasificación:	Seleccione la característica que corresponda
Fecha Desde:	Conserve la fecha Default
Fecha Hasta:	Blanco
Hecho Económico:	Seleccione el código de hecho económico que asociara

Los datos deben quedar como se muestra a continuación

Clasificaciones	×
Tipo de Contabilidad	USGAAP
Tipo de Operación	T
Proceso	D-PART3
Operación	C
Cartera	GENERALES
Motivo Inversión	
Motivo OMD	
Código Clasificación	INST-GAAP
Clasificación	NORMALES
Fecha Desde	01/01/1900 3
Fecha Hasta	77 3
Hecho Económico	PRCPALPUSD
	<u>A</u> ceptar <u>C</u> ancelar

Luego, presione Aceptar

El registro debe quedar como se muestra a continuación



Mantención Enlaces Contables		- 🗆 🗙
	?	-
Tipo de Contabilidad : USGAAP Cartera: GENERALES		
Proceso : D-PART3 Motivo de Inversión:		
Tipo de Operación Contable : T Motivo OMD:		
Instrumentos Clasificaciones Custodia Destino Emisor Contraparte Nemotécnicos		
Cod. Clasif. Clasificación Fecha Desde Fecha Hasta Hecho Económico		
▶ INST-GAAP NORMALES 01/01/1900 EMPRESA DE PRUEBA INVERSIONES LARG	io plaz	ZO

Para ingresar otros enlaces siga la misma metodología

Ahora, una vez realizados todos los pasos anteriormente descritos y se definan en su totalidad los enlaces contables, usted puede proceder a contabilizar a través de la ejecución de los reportes con procesos contables en el sistema.

<u>Volver</u>



# NOTAS DEL USUARIO



# **IV Procesos Contables**

Diríjase al menú de contabilidad del sistema para realizar la ejecución de su reporte ingrese a la opción países. En esta ocasión y para hacer una acción representativa mostraremos la ejecución del proceso para el reporte GAAP

# ¿Como ejecutar el reporte GAAP?

Diríjase en el menú Contabilidad a la opción G. A. A. P. Ingrese en Informes GAAP

Configuración	Paises	G.A.A.P.	Voucher	Ventana	Ayuda
		Informe	es U.S. GA	AP	

El siguiente dialogo aparecerá en su pantalla.

GAAP Método Lineal X
Fecha Cierre :       ©0/11/2004       15         Fecha Cierre Anterior :       31/10/2004       15         Fecha Inicio Cierre Anterior :       01/10/2004       15         Moneda Conversión       C. Moneda Coipa
<ul> <li>Moneda Caja</li> <li>Moneda Origen</li> <li>Moneda Cartera</li> <li>Conversión</li> <li>MO</li> </ul>
Conversión Avanzada Habilitar Conversión Avanzada Definir conversión avanzada
Parámetros usados para informes
<u>A</u> ceptar <u>C</u> ancelar

Ingrese las fechas de ejecución que requiera procesar, elija la 'Moneda de conversión que utilizara' recuerde tambien ingresar a la opción de 'Parámetros usados para informes', como se muestra en el siguiente dialogo.

# QUALITY SOFTWARE Portfolio Manager System (PMS) Mantención Tablas – Mesa Dinero – Contabilidad



Parámetros para Informes U.S. GAAP	×
Informes a generar D-Part1 D-Part4 DA-Part1 D-Part4 DA-Part1 D-Part5 DA-Part3	DA-Part4 D-Part1 Pactos D-Part5 Pactos DA-Part5 D-Part3 Pactos
<ul> <li>Incluye Informes para comparación histórica</li> <li>✓ Incluye Operaciones Renta Fija</li> <li>Incluye Operaciones Renta Variable</li> <li>✓ Utiliza Decimales Moneda Conversión</li> <li>Market Value a Reportar Proceso : GAAP</li> <li>✓ Market Value para Tasa Proceso : MERCADO</li> <li>✓ Gastos Estimados</li> <li>Calcula Gastos Estimados</li> <li>Código Rec / Des para gastos estimados</li> <li>✓ Aplica Gastos Estimados al Market Value</li> <li>Solo para instrumentos Clasificados como:</li> <li>Tipo Clasificación :</li> </ul>	Clasificaciones usados para informes         Parámetros Contables         Clasificación :         Tipo Contab.:         LOCAL         Forma en que son ingresados los valores de compra         Empresa       Transac         Fecha Desde       Fecha Hasta         Valor Libro Renta Variable         Book Value corresponde a Valor Libro del valorizador de Renta Variable
Costo Histórico  Habilita uso Costo Histórico a fecha determinada  ///	Unrealized Gains By Market Value Unrealized Gains By Market Value Cancelar

Aquí usted debera realizar las especificaciones necesarias de acuerdo a los parámetros con los que desea ejecutar el proceso. Una vez seleccionada las opciones necesarias presione Aceptar. Luego de marcar esta opción, el sistema le preguntará si quiere contabilizar, marque la opción 'SI'.

US GAAP	×
¿Contabiliza Resultados?	
Yes Co	ancel

Una vez terminado el proceso de ejecución GAAP y si su ejecución fue exitosa, usted puede ya visualizar la generación de

# V. Visualización de Asientos Generados (Vouchers) y Generación de archivo de traspasos

Como resultado de la generación de los procesos son generados automáticamente los asientos contables según la definición realizada de los enlaces contables y hechos económicos.

Para poder ver los resultados de la Contabilización existe la opción de Vouchers Contables en el Menú Contabilidad del sistema



👼 Contabilidad Front Office Chile (Local)						
Configuración	Paises	G.A.A.P.	Voucher	Ventana	Ayuda	
			Vouche	rs Contable	es	
			<u>G</u> enera	Traspaso (	Contabilidad	

Este menú de acuerdo a los parámetros ingresados (ya sean procesos locales o GAAP y a las diferentes fechas que existan guardadas en el sistema), permite ver los asientos contables generados según fecha de cierre. Asi mismo usted encontrara variadas posibilidades de formatos para revisar y chequear los asientos contables.

Parámetros Asientos	Contables	×
Fecha Cierre: Fecha Cierre Anterior: Fecha Inicio Cierre Anterior: Tipo Conversón: Moneda Conversón: Tipo Contabilidad:	28/02/2005 31/01/2005 01/01/2005 MONEDA CAR1 LOCAL	IERA
Agrupado Por Proceso Hechos Económico Transacción / Folio Transacción / Cod. Proceso/Con Mone Por cuenta Formato SAP Detal Formato SAP por N Proceso/Agrupado Por Cuenta/Agrupado	rs Analitico eda Original lado emotécnico por Cartera	Con Cod. Analítico
Aceptar	<u>E</u> liminar	<u>C</u> ancelar



Una vez verificados los Vouchers generados, la fase final del proceso de Contabilización del sistema PMS es la <u>generación</u> del archivo de traspaso al sistema de contabilidad corporativo.

Lo anterior se realiza mediante la opción 'Genera Traspaso Contabilidad'. Lo que sigue a continuación será la carga de los asientos generados en el sistema de contabilidad corporativo fase que será definida por el departamento de sistemas central.

¿Como realizar el traspaso de archivo?

🛒 Contabilidad Front Office Chile (Local)						
Paises	G.A.A.P.	Voucher	Ventana	Ayuda		
		Vouche	rs Contable	es		
		<u>G</u> enera	Traspaso (	Contabilidad		
	ad Fron Paises	ad Front Office C Paises G.A.A.P.	ad Front Office Chile (Loca Paises G.A.A.P. Voucher <u>V</u> ouche <u>G</u> enera	ad Front Office Chile (Local) Paises G.A.A.P. Voucher Ventana <u>V</u> ouchers Contable <u>G</u> enera Traspaso 0	ad Front Office Chile (Local) Paises G.A.A.P. Voucher Ventana Ayuda Vouchers Contables Genera Traspaso Contabilidad	ad Front Office Chile (Local) Paises G.A.A.P. Voucher Ventana Ayuda Vouchers Contables <u>G</u> enera Traspaso Contabilidad

Ingrese a la opción Genera Traspaso Contabilidad, el siguiente dialogo aparecerá en su pantalla

Generación Archivo de	Traspaso Contable X
Traspasos a:	
Fecha Cierre: Fecha Cierre Anterior: Fecha Inicio Cierre Anterior: Tipo Conversión: Moneda Conversión: Tipo Contabilidad: Nombre Archivo: Carpeta Destino: Libros:	



# Pasos a seguir para realizar traspaso contable:

1 FTIMEIO Elija El Sistema C	orporativo contac	ne al cual desea traspasar los datos contables.	
Generación Archivo de	Traspaso Cont	able 🔀	
Traspasos a:	SUN		
	Código	Descripción (TRASCONTAB)	
Fecha Cierre:	MERIDIAN	SISTEMA CONTABILIDAD MERIDIAN	
	SAP DETALL	TRASPASO A CONTABILIDAD SAP FORMATO DETALLADO	
Fecha Lierre Anterior:	SAPXNEMO	TRASPASO A CONTABILIDAD SAP AGRUPADO POR NEMOTECNICO	
Fecha Inicio Lierre Anterior	SIS	SISTEMA CONTABILIDAD SIS	
Tipo Conversión:	SUN	SISTEMA CONTABILIDAD SUN	
Manada Camarián	SUN ACCOUN	SISTEMA CONTABILIDAD SUN	
Moneda Conversion:			
Tipo Contabilidad:			-
Nombre Archivo:	SUN050228.TXT	Г	
Carpeta Destino:		<u>2</u>	
Libros:			
	🔽 Todos		

1.- Primero elija el sistema corporativo contable al cual desea traspasar los datos contables.

2.- Posteriormente seleccione la fecha en la cual requiere realizar el traspaso contable.

Generación Archivo de	Traspaso Contable	×
Traspasos a:	SUN	
Fecha Cierre:	28/02/2005 <u>G</u> enerar	
Fecha Cierre Anterior:	31/01/2005 Salir	
Fecha Inicio Cierre	01/01/2005	
Tipo Conversión:	MONEDA CARTERA	
Moneda Conversión:		
Tipo Contabilidad:	LOCAL	
Nombre Archivo:	SUN050228.TXT	
Carpeta Destino:	ß	
Libros:	<b></b>	
	✓ Todos	
		1



3.- La Carpeta de destino debe ser seleccionada, Después de realizar el primer traspaso contable, el sistema asumirá por Default esta carpeta como muestra la siguiente figura.

Generación Archivo de	Traspaso Contable	X
Traspasos a:	SUN	
Fecha Cierre:	28/02/2005 <u>G</u> enerar	
Fecha Cierre Anterior:	31/01/2005 Salir	
Fecha Inicio Cierre	01/01/2005	
Tipo Conversión:	MONEDA CARTERA	
Moneda Conversión:		
Tipo Contabilidad:	LOCAL	
Nombre Archivo:	SUN050228.TXT	1
Carpeta Destino:	C:\PROGRAM FILES	]
Libros:		3
	▼ Todos	

4.- La opción Libros debe quedar en blanco al momento de marcar el Checkbox.





# 5. - Luego presione Generar

eneración Archivo de	Traspaso Contable
Traspasos a:	SUN
Fecha Cierre:	28/02/2005 ··· Generar
Fecha Cierre Anterior:	31/01/2005
Fecha Inicio Cierre	01/01/2005
Tipo Conversión:	MONEDA CABTERA
Moneda Conversión:	
Tipo Contabilidad:	LOCAL
Nombre Archivo:	SUN050228.TXT
Carpeta Destino:	C:\PROGRAM FILES
Libros:	<b>•</b>
	Todos

# 6.- Aparecerá un mensaje de finalización del proceso.

Generaci	ión de Archivo 🛛 🔀
(į)	El archivo SUN050228.TXT ha sido creado exitósamente en la carpeta: C:\PROGRAM FILES\
	Aceptar

Presione Aceptar.

El proceso contable ha finalizado.

# <u>Volver</u>



# NOTAS DEL USUARIO



# CONTABILIDAD PMS

# Explicación Proceso GAAP

¿Cómo ejecutar el procesoGAAP?

¿Cómo seleccionar los parametros adecuados para el proceso GAAP? ¿Como interpretar los reportes GAAP?





# **USGAAP PARA LATINOAMÉRICA (PMS)**

El siguiente documento explica los conceptos aplicados en el reporte USGAAP entregado por el sistema PMS. United States Generally Accepted Accounting Principles (U. S. GAAP)

El documento esta separado por movimientos de inversiones o libros que identificamos a través de códigos

- SCHEDULE D PART 1 Instrumentos de Largo Plazo vigentes en Cartera
- SCHEDULE DA PART 1 Instrumentos de Corto Plazo vigentes en Cartera

SCHEDULE D – PART3	Compras de Instrumentos de Largo Plazo
--------------------	--

SCHEDULE DA – PART3 Compras de Instrumentos de Corto Plazo

SCHEDULE D – PART4 Ventas y Vencimientos de Instrumentos de Largo Plazo de periodos anteriores a la fecha de ejecución establecida

SCHEDULE DA – PART4 Ventas y Vencimientos de Instrumentos de Corto Plazo de periodos anteriores a la fecha de ejecución establecida.

SCHEDULE D – PART5 Ventas y Vencimientos de Instrumentos de Largo Plazo del periodo.

SCHEDULE DA – PART5 Ventas y Vencimientos de Instrumentos de Corto Plazo del periodo.

Cada uno de los libros mencionados anteriormente tienen a su vez distintos anexos los cuales nos proveen de una gran variedad de conceptos que podemos utilizar para nuestra gestión financiero - contable.



# <u>Schedule DPART – 1</u> <u>Schedule DA - Part 1</u>

Estos reportes contienen todos aquellos bonos de corto y largo plazo. Este proceso en función de los parámetros de fechas de cierre seleccionará las operaciones de corto y largo plazo, así obtendremos los saldos vigentes al cierre. Estos libros actualmente tienen diferentes anexos contables que son los que se utilizan para contabilizar, a continuación encontraran la definición de las columnas.

# DPART1 ANEXOS CONTABLES DAPART1 ANEXOS CONTABLES

# CUSIP Identification

Corresponde al código de identificación del instrumento. Otorgado al momento de la compra del mismo en PMS. Se recomienda mantener los códigos registrados en el titulo al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

# Book Value

Corresponde al valor de compra, más o menos el monto de diferencia de precio diaria multiplicado por los días transcurridos entre la fecha de compra y el cierre (dd/mm/aaaa). Esto quiere decir que es el valor de compra menos los intereses devengados al momento de la compra. El valor de compra pasa hacer el actual Cost, si es que este incluye un ingreso de valor de compra limpio.

\*Book Value: Actual Cost + Increase + Reajuste Actual Cost + Reajuste de Amortizaciones pagadas de Capital – Decrease – Amortizaciones de Capital pagadas.

# Actual Cost

Valor capital pagado a la compra, no necesariamente equivale al capital residual del titulo, ya que, la compra puede haber sido sobre la par o bajo la par.

# Interest 9.1

Corresponde al interés acumulado a Tasa de Emisión del instrumento desde el cierre anterior, fecha de compra o la fecha del último vencimiento de cupón hasta el cierre.

# Interest 9.2

Corresponde a los Intereses Recibidos durante el periodo establecido en las fechas de cierre. Pago de Vencimiento de Cupones.

# Increase by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio positiva (descuento) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de descuento diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra o cierre anterior hasta la fecha de cierre ACTUAL.

# Decrease by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio negativa (prima) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de prima diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra hasta la fecha de cierre.



# Interest Accrued

Interés devengado correspondiente a los cupones cuya fecha de vencimiento esta dentro del rango del periodo a procesar. Además, incluye en su concepto los intereses pagados y el último interés devengado que no ha sido pagado. Esta columna se calcula de forma independiente y sirve para realizar la contabilidad histórica.

#### Interest Accrued from Last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el último vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al último vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

#### Principal Amortization Readjustment

Corresponde al reajuste del capital pagado basados en alguna cláusula de reajuste o índice (tales como índices de precio u otros) especificados en la emisión del titulo, por lo tanto esta actualización de capital es parte de el valor que el emisor paga al momento de vencer alguno de los cupones que consideran amortización de capital.

#### Principal Amortization Received During Period

Valor pagado de amortización de capital reajustada de aquellos cupones vencidos entre la fecha de cierre actual y la fecha de cierre anterior.

#### Increase / Decrease to Maturity

La proporción de Increase o Decrease que falta por ser reconocido entre la fecha de cierre y el vencimiento final del instrumento.

#### Book Value + Increase / Decrease to Maturity + Interest Accrued from last coupon

Se compone del equivalente del capital residual, si a esto se le agregan los intereses debo llegar al Valor Par a fecha de cierre. Sirve como formula para chequear que los métodos de segregación estén correctos.

#### Par Value at Closing Date

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado a fecha de cierre ambos reajustados.

# Difference column 22 – 23

Indicador si los cálculos han sido bien realizados. Si existe un valor por sobre un porcentaje razonable, indica un error en el Book Value o el Par Value a la fecha de cierre.

#### Actual Cost Readjustment / Capitalization Readjustment During Period

a.- Reajuste del Actual Cost entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo al actual Cost residual durante el periodo.

b.- Reajuste de la capitalización entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo a la capitalización durante el periodo.

#### Total Increase / Decrease

Increase o Decrease desde la fecha de compra al cierre actual (si tiene reajuste este será considerado dentro del periodo de ejecución).

#### Capitalization Received During Period

Si el titulo en sus características de emisión tuviese definido la capitalización de los intereses y correspondiese un reajuste en esta columna estaría representado.

#### Current Market Value

Valor de Mercado al cierre según características de emisión definidas a cada inversión dentro de la cartera



# Current Par Value

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado a fecha de cierre ambos reajustados.

*Difference + Valuation Monthly Basis* Diferencia entre columnas 7 y 23

<u>Difference - Valuation Monthly Basis</u> Diferencia entre columnas 7 y 23 <u>Previous Market Value</u> Valor de Mercado al cierre anterior según características de emisión definidas a cada inversión dentro de la cartera

#### Previous Par Value

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado a fecha de cierre anterior ambos reajustados.

<u>Previous Difference + Valuation Monthly Basis</u> Diferencia anterior entre columnas 7 y 23

<u>Previous Difference - Valuation Monthly Basis</u> Diferencia anterior entre columnas 7 y 23

Folio

Numero identificador de las transacciones ingresadas al sistema.

### Anexo Reverso Contable DPART1

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para efectos contables de lo provisionado en el cierre del mes anterior de los instrumentos vigentes en cartera.

#### Previous Residual Actual Cost Readjustment

Reajuste del Actual Cost desde la compra a la fecha del periodo del cierre anterior

#### Previous Interest Accrued from Last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el último vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre anterior del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al último vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

<u>Previous Total Increase</u> Increase desde la fecha de compra al cierre anterior

<u>Actual Total Increase</u> Increase desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Previous Total Decrease</u> Decrease desde la fecha de compra al cierre anterior

<u>Actual Total Decrease</u> Decrease desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Effective paid for accrued</u> Paid for Accrued pagado a la compra



# Intereses Ganados por cobrar anterior

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre anterior

#### Intereses Ganados por cobrar actual

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre actual

<u>Intereses Ganados Cobrados</u> Intereses recibidos – el interés pagado a la compra

#### Anexo Unrealized Gains DPART1 - DAPART1

(Cierre Actual – Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o perdida no realizada aplicada entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

Lo que nos llevara a poder ver Profit y Loss por ambos conceptos para el periodo de cierre anterior y actual. El objetivo de obtener los valores al cierre anterior es el poder realizar los reversos que correspondan

#### Anexo Unrealized Gains by Exchange Rate DPART1 - DAPART1

(Cierre Actual – Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o pérdida no realizada por diferencia tipo cambio aplicada entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

3. El Capital y el Valor Mercado

Esta comparación por tipo cambio es entre el valor tipo cambio a la compra y el valor tipo cambio al cierre anterior y actual. El objetivo de obtener los valores al cierre anterior es el poder realizar los reversos que correspondan

#### Anexo Unrealized Gains by Market Value DAPART1 (Renta Variable)

(Cierre Actual – Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o pérdida no realizada por diferencia de valor de mercado aplicada entre:

1. El Valor de Mercado anterior y el Valor Mercado actual

El objetivo de obtener los valores al cierre anterior es el poder realizar los reversos que correspondan



<u>SCHEDULE DPART – 3</u> SCHEDULE DA - PART 3

Estos reportes contienen todas aquellas compras de bonos corto y largo plazo. Este proceso en función de los parámetros de fechas de cierre seleccionará las operaciones de corto y largo plazo, así obtendremos los movimientos por compra de instrumentos. Estos libros no tienen anexos contables, a continuación encontraran la definición de las columnas.

SCHEDULE D – PART 3 SCHEDULE DA – PART 3

#### CUSIP Identification

Corresponde al código de identificación del instrumento. Otorgado al momento de la compra del mismo en PMS. Se recomienda mantener los códigos registrados en el titulo al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

#### Description

Nombre del instrumento otorgado al momento de ingresar el mismo en PMS. Se recomienda mantener los nombres que traen los instrumentos al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

#### Date Acquired

Corresponde a la fecha de compra (mm/dd/aaaa).

#### Name of Vendor

Nombre de la casa de corretaje o intermediario. Se recomienda mantener los nombres y códigos que traen los instrumentos al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

#### Number of shares stock

Corresponde a la cantidad de acciones compradas y vigentes al cierre.

# Actual Cost

Valor capital pagado a la compra, no necesariamente equivale al capital residual del titulo, ya que, la compra puede haber sido sobre la par o bajo la par.

# Par Value

Corresponde al Valor del capital Residual a la compra, cuando hay amortización el nominal no es igual al capital residual

#### Paid for Accrued Interest and Dividends

Corresponde al interés a tasa de emisión acumulado desde la fecha de vencimiento del ultimo cupón anterior a la fecha de compra o fecha de emisión hasta la fecha de compra.

# Purchase Value

Si se ingresa el valor de compra limpio refleja el valor del capital pagado, de lo contrario el Valor de compra incluye el capital y intereses devengados a la fecha de compra.

<u>Settlement Date</u>

Fecha de pago de la transacción



<u>SCHEDULE DPART – 4</u> SCHEDULE DA - PART 4

Estos reportes contienen los movimientos de ventas y vencimientos registrados durante el mes de ejecucion que sean de periodos anteriores al mismo. Estos libros actualmente tienen diferentes anexos contables que son los que se utilizan para contabilizar, a continuación encontraran la definición de las columnas.

# SCHEDULE D – PART4 ANEXOS CONTABLES SCHEDULE DA – PART4 ANEXOS CONTABLES

# CUSIP Identification

Corresponde al código de identificación del instrumento. Otorgado al momento de la compra del mismo en PMS. Se recomienda mantener los códigos registrados en el titulo al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

# **Disposal Date**

Corresponde a la fecha de venta o vencimiento (mm/dd/aaaa).

#### **Consideration**

Ya sea una venta o un vencimiento corresponde al valor limpio sin intereses. En el caso del vencimiento si se realiza la comparación con el Book Value estos son iguales por lo tanto no se produce utilidad por diferencia de capital, en cambio para la venta al realizar esta comparación se produce una diferencia lo cual produce la utilidad o perdida por venta.

#### Par Value

Corresponde al Valor del capital Residual a la venta. Cuando hay amortización el nominal no es igual al capital residual. Además, se debe considerar una venta de nominales parciales.

#### Actual Cost

Valor capital pagado a la compra, no necesariamente equivale al capital residual del titulo, ya que, la compra puede haber sido sobre la par o bajo la par o haber sufrido una venta e nominales. Se calcula dividiendo el valor e compra por los nominales de la compra y este factor se multiplica por los nominales vendidos.

#### Book Value at Disposal date

Valor del instrumento a la Fecha de venta o vencimiento, considerando en este todas las variables ya mencionadas.

#### Increase by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio positiva (descuento) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de descuento diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra hasta la fecha de cierre.

#### Decrease by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio negativa (prima) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de prima diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra hasta la fecha de cierre.

# Profit on Disposal

Ganancia realizada por concepto de venta. Que corresponde a la diferencia entre el Consideration y el Book Value.

#### Loss on Disposal

Pérdida realizada por concepto de venta. Que corresponde a la diferencia entre el Consideration y el Book Value.



## Interest on Bonds received during year

Corresponde a los Intereses Recibidos durante el periodo establecido en las fechas de cierre. Pago de Vencimiento de Cupones.

<u>Sell / Maturity Value</u> Valor al momento de la venta o vencimiento.

#### Total Increase / Decrease

Increase o Decrease desde la fecha de compra al vencimiento final o venta del titulo.

#### Amount Due and Accrued

Interés devengado correspondiente a los cupones cuya fecha de vencimiento esta dentro del rango del periodo a procesar. Además, incluye en su concepto los intereses pagados y el último interés devengado que no ha sido pagado. Esta columna se calcula de forma independiente y sirve para realizar la contabilidad histórica.

#### Interest Accrued from last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el último vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al último vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

#### Increase / Decreased to Maturity

Lo que falta por ser reconocido entre la fecha de cierre y el vencimiento final del instrumento.

#### Principal Amortization Received During Period

Valor pagado de amortización de capital reajustada de aquellos cupones vencidos entre la fecha de cierre actual y la fecha de cierre anterior.

# Book Value + Interest Accrued + Increase / Decreased to Maturity

Se compone del equivalente del capital residual, si a esto se le agregan los intereses debo llegar al Valor Par a fecha de cierre. Sirve como formula para chequear que los métodos de segregación estén correctos.

#### Par Value at Closing Date

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado a fecha de cierre ambos reajustados.

#### Difference column 22 – 23

Indicador si los cálculos han sido bien realizados. Si existe un valor por sobre un porcentaje razonable, indica un error en el Book Value o el Par Value a la fecha de cierre.

#### Actual Cost Readjustment / Capitalization Readjustment During Period

a.- Reajuste del Actual Cost entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo al actual Cost residual durante el periodo.

b.- Reajuste de la capitalización entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo a la capitalización durante el periodo.

# Residual Actual cost

Valor actual Cost de acuerdo a la proporción de venta de los nominales parciales ya reajustado.

# Principal Amortization Received from Purchase Time

Valor pagado de amortización de capital reajustada de aquellos cupones vencidos desde la fecha de compra al cierre actual o venta.



#### Principal Amortization Readjustment Received During Period

Corresponde al reajuste del capital pagado basados en alguna cláusula de reajuste o índice (tales como índices de precio u otros) especificados en la emisión del título, por lo tanto esta actualización de capital es parte de el valor que el emisor paga al momento de vencer alguno de los cupones que consideran amortización de capital.

#### Residual Actual Cost Readjustment from Purchase Time

Valor del reajuste del actual Cost desde la compra de acuerdo a la proporción de venta de nominales parciales.

#### Previous Market Value

Valor de Mercado al cierre anterior según características de emisión definidas a cada inversión dentro de la cartera

#### Previous Par Value

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado a fecha de cierre anterior ambos reajustados.

#### Previous Difference + Valuation Monthly Basis

Diferencia entre valor a mercado y valor par del titulo (valor par según el concepto que se maneja en el reporte GAAP columnas 7 y 23 del cierre anterior)

#### Previous Difference - Valuation Monthly Basis

Diferencia entre valor a mercado y valor par del titulo (valor par según el concepto que se maneja en el reporte GAAP columnas 7 y 23 del cierre anterior)

#### Folio Operación

Numero identificador de las transacciones ingresadas al sistema, se distingue una venta de un vencimiento por el código C – para vencimiento o una V – para una venta.

# Anexo Reverso Contable DPART4 – DAPART4

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron.

#### Previous Residual Actual Cost Readjustment

Reajuste del Actual Cost desde la compra a la fecha del periodo del cierre anterior

#### Previous Interest Accrued from Last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el último vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre anterior del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al último vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

#### Previous Total Increase

Increase desde la fecha de compra al cierre anterior

#### <u>Actual Total Increase</u> Increase desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Previous Total Decrease</u> Decrease desde la fecha de compra al cierre anterior

#### Actual Total Decrease

Decrease desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Effective paid for accrued</u> Paid for Accrued pagado a la compra



# Intereses Ganados por cobrar anterior

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre anterior

Intereses Ganados por cobrar actual

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre actual

<u>Intereses Ganados Cobrados</u> Intereses recibidos – el interés pagado a la compra

# Anexo Realized Gains DPART4 – DAPART4

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o perdida realizada aplicada entre:

1. Consideration y Book Value

2. Consideration y Actual Cost

Lo que nos llevara a poder ver Profit y Loss por ambos conceptos para el periodo en que nos encontramos procesando.

### Anexo Unrealized Gains DPART4 – DAPART4

(Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

#### Anexo Unrealized Gains by Exchange Rate DPART4 – DAPART4

(Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

3. El Capital y el Valor Mercado



<u>SCHEDULE DPART – 5</u> SCHEDULE DA - PART 5

L.....

Estos reportes contienen los movimientos de ventas y vencimientos registrados durante el mes de ejecución que sean de periodos anteriores al mismo. Estos libros actualmente tienen diferentes anexos contables que son los que se utilizan para contabilizar, a continuación encontraran la definición de las columnas.

# SCHEDULE D – PART5 ANEXOS CONTABLES SCHEDULE DA – PART5 ANEXOS CONTABLES

#### **CUSIP** Identification

Corresponde al código de identificación del instrumento. Otorgado al momento de la compra del mismo en PMS. Se recomienda mantener los códigos registrados en el titulo al momento de la compra junto con los datos y características de emisión.

#### Date Acquired

Corresponde a la fecha de compra (mm/dd/aaaa).

#### **Disposal Date**

Corresponde a la fecha de venta o vencimiento (mm/dd/aaaa).

#### Par Value (bonds) or Number of Shares (stock)

Corresponde a los nominales vendidos, estos pueden ser parciales o totales.

#### Cost to Company

Valor capital pagado a la compra, no necesariamente equivale al capital residual del titulo, ya que, la compra puede haber sido sobre la par o bajo la par o haber sufrido una venta e nominales. Se calcula dividiendo el valor e compra por los nominales de la compra y este factor se multiplica por los nominales vendidos.

#### Consideration

Ya sea una venta o un vencimiento corresponde al valor limpio sin intereses. En el caso del vencimiento si se realiza la comparación con el Book Value estos son iguales por lo tanto no se produce utilidad por diferencia de capital, en cambio para la venta al realizar esta comparación se produce una diferencia lo cual produce la utilidad o perdida por venta.

#### Book value during year

Valor del instrumento a la Fecha de venta o vencimiento, considerando en este todas las variables ya mencionadas. Increase by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio positiva (descuento) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de descuento diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra hasta la fecha de cierre. (Se contabiliza, columna 10)

## Decrease by Adjustment in Book Value During Year

Sólo si la operación generó una diferencia de precio negativa (prima) se debe presentar en esta columna la multiplicación de la cuota de prima diaria por el número de días transcurridos desde la fecha de compra hasta la fecha de cierre.

#### Profit on Disposal

Ganancia realizada por concepto de venta. Que corresponde a la diferencia entre el Consideration y el Book Value.

#### Loss on Disposal

Pérdida realizada por concepto de venta. Que corresponde a la diferencia entre el Consideration y el Book Value.



## Interest on Bonds received during year

Corresponde a los Intereses Recibidos durante el periodo establecido en las fechas de cierre. Pago de Vencimiento de Cupones.

Paid for Accrued Interest and Dividends Interés Devengado.

<u>Sell / Maturity Value</u> Valor al momento de la venta o vencimiento.

Total Increase / Decrease

Increase o Decrease desde la fecha de compra al vencimiento final del titulo.

#### Interest Accrued

Interés devengado correspondiente a los cupones cuya fecha de vencimiento esta dentro del rango del periodo a procesar. Además, incluye en su concepto los intereses pagados y el último interés devengado que no ha sido pagado. Esta columna se calcula de forma independiente y sirve para realizar la contabilidad histórica.

#### Principal Amortization Received During Period

Valor pagado de amortización de capital reajustada de aquellos cupones vencidos entre la fecha de cierre actual y la fecha de cierre anterior.

#### Interest Accrued from Last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el ultimo vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al ultimo vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

#### Actual Cost Readjustment / Capitalization Readjustment During Period

a.- Reajuste del Actual Cost entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo al actual Cost residual durante el periodo.

b.- Reajuste de la capitalización entre la fecha de cierre anterior y la fecha de cierre actual de acuerdo a la capitalización durante el periodo.

**Residual Actual Cost** 

Valor actual Cost de acuerdo a la proporción de venta de los nominales parciales ya reajustado.

#### Principal Amortization Received from Purchase Time

Valor pagado de amortización de capital reajustada de aquellos cupones vencidos desde la fecha de compra al cierre actual o venta.

#### Principal Amortization Readjustment receive during period

Corresponde al reajuste del capital pagado basados en alguna cláusula de reajuste o índice (tales como índices de precio u otros) especificados en la emisión del título, por lo tanto esta actualización de capital es parte de el valor que el emisor paga al momento de vencer alguno de los cupones que consideran amortización de capital.

#### Increase / Decreased to Maturity

Lo que falta por ser reconocido entre la fecha de cierre y el vencimiento final del instrumento.

#### Quadrature Book Value

Se compone del equivalente del capital residual, si a esto se le agregan los intereses debo llegar al Valor Par a fecha de cierre. Sirve como formula para chequear que los métodos de segregación estén correctos.



### Par Value to Sell / Maturity

Valor residual del Titulo según las características de emisión + interés devengado al momento de la venta vencimiento ambos reajustados.

#### Difference column 22 – 23

Indicador si los cálculos han sido bien realizados. Si existe un valor por sobre un porcentaje razonable, indica un error en el Book Value o el Par Value a la fecha de cierre.

#### Residual Actual Cost Readjustment from Purchase Time

Valor del reajuste del actual Cost desde la compra de acuerdo a la proporción de venta de nominales parciales.

#### Folio Operación

Numero identificador de las transacciones ingresadas al sistema, se distingue una venta de un vencimiento por el código C – para vencimiento o una V – para una venta.

### Anexo Reverso Contable DPART5 – DAPART5

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron.

<u>Previous Residual Actual Cost Readjustment</u> Reajuste del Actual Cost desde la compra a la fecha del periodo del cierre anterior

#### Previous Interest Accrued from Last Coupon

Corresponde al interés devengado desde el último vencimiento parcial o fecha de emisión, hasta la fecha de cierre anterior del informe. Considera incluso los intereses que hubiesen sido devengados antes de la fecha de compra, si esta es posterior al último vencimiento o fecha de emisión si corresponde.

<u>Previous Total Increase</u> Increase desde la fecha de compra al cierre anterior

<u>Actual Total Increase</u> Increase desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Previous Total Decrease</u> Decrease desde la fecha de compra al cierre anterior

<u>Actual Total Decrease</u> Decrease desde la fecha de compra al cierre actual

<u>Effective paid for accrued</u> Paid for Accrued pagado a la compra

Intereses Ganados por cobrar anterior

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre anterior

Intereses Ganados por cobrar actual

Intereses devengados desde el último vencimiento - el interés pagado a la compra del cierre actual

<u>Intereses Ganados Cobrados</u> Intereses recibidos – el interés pagado a la compra



# Anexo Realized Gains DPART5 – DAPART5

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o perdida realizada aplicada entre:

1. Consideration y Book Value

2. Consideration y Actual Cost

Lo que nos llevara a poder ver Profit y Loss por ambos conceptos para el periodo en que nos encontramos procesando.

# Anexo Unrealized Gains DPART5 – DAPART5

# (Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

# Anexo Unrealized Gains by Exchange Rate DPART5 – DAPART5

#### (Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos o vencieron entre:

1. El Actual Cost y el Valor Mercado

2. El Book Value y el Valor Mercado

3. El Capital y el Valor Mercado

#### Anexo Realized Gains DAPART5 (Renta Variable)

En este anexo usted encontrara un concepto de ganancia o perdida realizada aplicada entre:

1. El valor de mercado del cierre anterior y el valor de la venta

#### Anexo Unrealized Gains DAPART5 (Renta Variable)

(Cierre Anterior)

En este anexo usted encontrara los conceptos que deben ser reversados para los instrumentos que fueron provisionados el mes anterior y durante el mes actual han sido vendidos entre:

1. Valor a mercado anterior y Valor Mercado al cierre actual

<u>Volver</u>



# NOTAS DEL USUARIO



# Preguntas Frecuentes

1.- ¿No veo los reportes de PMS aparece un error o un cuadrado blanco muy pequeño?
 Respuesta: Esto quiere decir que no tiene una impresora asociada a su equipo, la solucion es incorporar una impresora a su equipo, luego vuelva a procesar

2.- Al realizar la carga de datos automaticos me aperece el siguiente error: "IO ERROR 32" Respuesta: verfique que los archivos estan cerrados antes de comenzar la carga automática

# 3.- Al copiar un registro del excel me aparece un error invalid floating point

8	'120.789654 ' is not a valid floating point value for field 'Px~Dirty Bid'.	
	Aceptar	

**Respuesta**: Esto sucede cuando se traspasa el dato copiando la celda completa de excel, la cual puede traer espacion en blanco, la forma correcta de copiar es copiando solo el valor letra o numero que se requiere traspasar. Sugerencia, al obtener este error se le sugiere cancelar los datos cerrar el mantenedor y posteriormente volver a entrar en el.

4.- Ejecuto un proceso, usted siguió utilizando el computador al volver a llamar el mantenedor donde realizo la ejecución del proceso y esta se bloquea, no responde al presionar con el mouse.

**Respuesta**: Es posible que sobre el mantenedor se encuentra el reporte que se estaba ejecutando, se le sugiere presione ALT + TAB y verifique que no exista alguna ventana abierta.

# 5.- El sistema da Aviso que no encuentra un parametro determinado de algun proceso

Respuesta: Verifique si el parámetro ha sido ingresado (si el mismo no ha sido ingresado, ingreselo y procese nuevamente)

*6.- Si el sistema da el siguiente mensaje* **Respuesta**: *contacte al administrdor* 

8	Table does not exist. ORA-00942: table or view does not exist.	
	Aceptar	

7.- Si el sistema da el siguiente mensaje Respuesta: contacte al administrdor

⊗	Invalid field name. ORA-00904: invalid column name.		
	Aceptar		



8.- Si usted se encuentra ejecutando en la opcion de la mesa de dinero la opcion para ver el stock o posición de renta fija y al presionar la opcion consolidar el sistema le envia un mensaje de error

**Respuesta**: Quiere decir que las carteras que quiere consolidar estan valorizadas a distinta fecha, la solucion es valorizar las carteras que requiera a una misma fecha.

tión de Stock		
Cartera	CONSOLIDA 🔽 🗹 Consoli	ida
Descripción	CONSOLIDA	
Fecha Stock o Posiciór	30/11/2004	
Resumen por Nemoténico	En Detalle de stock por OMD	Cancelar
CARTERAS VALORIZADAS A D	DIFERENTES FECHAS	
CARTERAS VALORIZADAS A D 30/11/2004 ART ART	DIFERENTES FECHAS	
CARTERAS VALORIZADAS A D 30/11/2004 ART ART 30/11/2004 ART ART FDOFI 30/11/2004 ART ART USD	DIFERENTES FECHAS	
CARTERAS VALORIZADAS A D 30/11/2004 ART ART 30/11/2004 ART ART FDOFI 30/11/2004 ART ART USD 31/10/2004 MAS MAS	DIFERENTES FECHAS	

9.- Al ejecutar el proceso GAAP el sistema entrega un 'Error de descuadre en Hecho Economico'
 Respuesta: Esto significa que uno o mas movimientos no fueron realizados de forma correcta imputando de forma erronea los valores a algunas de las cuentas.

# Procedimiento de chequeo

El aviso de descuadre que entrega el sistema identifica el hecho economico, monto del descuadre y folio, por lo que le sera muy facil, realizar el seguimiento, para esto se le sugiere:

- 1. Revise el Hecho economico y los movimientos que se ha producido
- 2. Revise el reporte y la imputación de valores que se ha llevado a la cuenta contable

Siguiendo los dos pasos anteriores usted debe llegar a la solucion del problema.

*10.- Al ejecutar el proceso GAAP el sistema entrega un 'Error de Error Enlace'* **Respuesta**: Esto significa que uno o mas enlaces contables no fueron realizados de forma correcta

#### Procedimiento de chequeo

El aviso de enlace que entrega el sistema identifica el enlace contable y libro especificos, por lo que le sera muy facil, realizar el seguimiento, para esto se le sugiere:

- 1. Revise el Enlace Contable que da el problema
- 2. Revise que dependiendo de la parametrizacion del enlace este se ha realizado correctamente.

Siguiendo los dos pasos anteriores usted debe llegar a la solucion del problema.



#### 11.- Sugerencia de Codificación

En general en el sistema manejamos muchos tipos de codificacion por eso le pedimos que lea atentamente estas sugerencias y trate de aplicarlas acorde a su realidad

- PMS generalemente trabaja recibiendo o traspasando información desde o hacia otros sistema, por lo general con codificaciones ya existentes, le sugerimos utilizar la misma codificacion. Por ejemplo,

- Los códigos ISIN de Bloomgerg para identificar los instrumentos, estos debieran ser ingresados al sistema de la misma forma

- Los códigos de los instrumentos locales tienen generalmente numeros de identificación, estos también debieran ser conservados

#### Para los códigos que debemos crear se sugiere:

- Primero verifique la cantidad de caracteres que acepta el sistema para los códigos que va a crear

- Luego piense en la totalidad de datos que debera ingresar, para realizar la codificacion (es bueno considerar todo el ambiente antes de comenzar)

- Piense que la codificación que usted ingrese sera la que se visualizara en reportes o información que se enviara a otras personas (Gerencia, Directorios, Superintendencia). Por lo tanto, se le sugiere pensar en codificaciones que sean claras y faciles de deducir para cualquier persona, donde se siga una logica de ingreso permanente y estable en el tiempo.

\* El codigo a ingresar puede ser alfanumerico siempre con un maximo de caracteres, se le sugiere no incluir: Puntos, Espacios

Volver



# I.- Sugerencias de Utilización de Parámetros

1. Utilización parámetros Fecha

Fecha Desde	01/01/1900	B
Fecha Hasta	11	15



# 2. Fecha Sugerida

Fecha Desde	01/01/1900	15
Fecha Hasta	11	15

En el sistema en los campos de fecha encontrara al lado izquierdo un botón que si presiona le mostrara un calendario

Con la opción 🖸 o 🕩 usted puede avanzar meses, con la opción 💶 o 🕩 usted puede avanzar años. También, puede simplemente posicionarse sobre el campo y digitar la fecha deseada.

En el sistema usted encontrara en distintos mantenedores la definición de vigencia para diferentes objetos. Esto en el sistema significa *validación de información*.

Esto significa que usted no puede dar por ejemplo a un emisor una fecha de vencimiento si tiene un instrumento asociado con una fecha de vencimiento distinta (mayor a la otorgada al emisor), ya que esto mostrara inconsistencias en la ejecución de procesos. Entonces en orden de facilitar la iniciación en el sistema se le sugiere, en el momento de implantación del mismo utilizar la fecha desde como 01/01/1900 y Fecha Hasta en blanco. Posteriormente, esto le permitirá conservar la historia o sea podrá retroceder en sus procesos sin que estos sean modificados ya que al dar una fecha de vencimiento y nuevo inicio se mantendrán los registros. Al mismo tiempo se le aconseja que donde tenga esta opción la utilice en vez de proceder a la eliminación por el mismo motivo mencionado anteriormente mantener la historia.

Con el tiempo y el uso del sistema vera y comprobara la ventaja que esto traerá a la buena mantención de los parámetros del sistema.

Volver


## NOTAS DEL USUARIO