

## **Asunto:**

### **INFORMACION SOBRE LA PRÓXIMA ACTUALIZACIÓN DEL SISTEMA TRANSACCIONAL SET- FX**

Integrados FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "Set-FX", en adelante INTEGRADOS FX, se permite informar a todos sus afiliados que el día viernes 29 de abril de 2011 realizará una actualización de software al Sistema Set-FX, cuyo objetivo será implementar algunas nuevas funcionalidades entre las cuales se destacan:

- Unificar la terminología Tasa/Precio para los mercados Forward y Swap (todos los elementos referentes a una tasa de cambio se denominarán "Precio").
- Posibilidad de ingresar modificaciones a las operaciones realizadas bajo la ventana Forward-Forward.
- Envío de operaciones Forward-Forward a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte.
- Hacer posible interactuar entre las ventanas de registro de operaciones Spot y Next Day sin que sea necesario cerrar la ventana de registro.
- Los usuarios creados por cualquier sucursal pueden ser visualizados por las otras sucursales.
- Posibilidad tener abiertos los resúmenes de cualquier módulo de registro de operaciones sin que quede bloqueada la ventana principal de registros.
- Creación del nuevo tipo de Identificación "Empresas del Exterior" para compañías fuera del País.

- Poder visualizar si una operación realizada por un cliente proviene del sector Real, un vigilado por la Superfinanciera o una empresa del exterior.
- Facilitar el envío de operaciones Next Day a la Cámara de Compensación de Divisas.
- Las tasas pactadas para las operaciones *Interest Rate Swaps* ahora tendrán tres cifras decimales.
- Cambio en la metodología para calcular el IVA en operaciones Next Day

La nueva metodología contempla que para las operaciones Next Day, el sistema Set-FX calculará el IVA a partir de la Tasa Promedio Ponderada de Compra "TPC" vigente por cada entidad, el día en que se realiza la operación Next Day.

En este sentido, resulta de gran importancia notificar este cambio con la suficiente anticipación a todas las áreas implicadas, de modo que puedan realizar los ajustes necesarios en sus procesos y evitar cualquier riesgo asociado.

Es importante recalcar, que las operaciones Next Day a 2 días que se realicen el 28 de Abril, y las operaciones Next Day a dos y un día que realicen el 29 de Abril, tendrán implícita la metodología actual para el cálculo del IVA. Es decir, la nueva metodología solo empieza a aplicarse a aquellas operaciones que se realicen a partir del 2 de mayo.

Para garantizar el funcionamiento adecuado del sistema, se ha programado una sesión de pruebas el día sábado 30 de abril de 2011 entre las 10:00 AM y 11:00 AM, con el fin de que cada afiliado pueda revisar las funcionalidades y el rendimiento general del Sistema.

Para la realización de dichas pruebas es necesaria la asistencia de las personas del área de tecnología de cada Afiliado, así como de las personas del Front Office (para realizar transacciones) y del área de back office para la verificación del cálculo del IVA en las operaciones Next Day.

A continuación se explican los pasos detallados para la mencionada prueba:

1. El día 29 de abril, los funcionarios de Set-FX instalarán en los servidores la actualización antes mencionada, para lo cual es necesario que todos los usuarios se encuentren conectados al sistema,

2. El día 30 de abril los funcionarios de la mesa de dinero realizan pruebas de transacciones, barridos y demás funciones de mensajería o de información del sistema entre las 10:00 AM y las 11:00AM,
3. Durante las pruebas, los funcionarios de Set-FX realizarán la correspondiente revisión para determinar el correcto funcionamiento del sistema,
4. El mismo día 30 de febrero a las 11:00 AM el administrador del sistema enviará a través del chat del sistema el informe sobre el resultado de las pruebas,
5. Si el resultado de las pruebas no es satisfactorio, los funcionarios de Set-FX procederán a revertir la actualización, para lo cual es necesario que los usuarios se encuentren conectados al sistema,
6. Si el resultado de las pruebas es satisfactorio los funcionarios de Set-FX realizarán una notificación a través del chat para concluir la sesión de pruebas.

Enviamos adjunto con el presente Boletín la siguiente documentación:

1. Manual Para Actualización a versión 618 de SET-FX: contiene las instrucciones básicas que garantizan el proceso de actualización de la nueva versión,
2. Pruebas de Mercado: este documento presenta los escenarios de pruebas de mercado que deben ser realizadas por los afiliados el sábado 30 de abril,
3. Check List - Pruebas de mercado: permite consignar el estado de las instrucciones más importantes requeridas en el "Manual de Actualización" y las "pruebas de Mercado",

INTEGRADOS FX estará en disposición para resolver cualquier inquietud que se pueda presentar sobre este particular.

Cordialmente,

**ANDRES MACAYA DÁVILA**  
Gerente