



# **INSTRUCTIVO DE CAMBIOS EN VERSION 6.39 DEL SISTEMA SET-FX**

**(INTERFACES DAPI, PLANO)**

**Noviembre 2015**

## Tabla de contenido

<b>INTRODUCCIÓN .....</b>	<b>3</b>
<b>1. OBJETIVO .....</b>	<b>3</b>
<b>2. ALCANCE .....</b>	<b>3</b>
<b>3. CAMBIOS.....</b>	<b>4</b>
3.1 COMPENSACIÓN DE OPERACIONES NEXT DAY POR LA CAMARA DE COMPENSACIÓN DE DIVISAS .....	4
3.2 FRACCIONAMIENTO DE OPERACIONES NDF CON CLIENTES.....	6

## **INTRODUCCIÓN**

El sistema SET-FX ofrece como mecanismos de entrega de información el “Archivo plano” y el “DAPI” (Datatec Application interface), dichas herramientas contienen la información de todas las operaciones realizadas en el sistema tanto entre IMC’s como IMC’s con clientes.

### **1. OBJETIVO**

Informar a los afiliados del sistema SET-FX los cambios que se incluirán en la versión 6.39 (Es potestad de las entidades implementar o no los desarrollos necesarios para la entrega y recepción de información).

### **DIRIGIDO A**

Áreas de desarrollo e implementación de las entidades.

### **2. ALCANCE**

Interfaces DAPI y Archivo Plano usados para la entrega de información correspondiente a las operaciones de cada entidad.

### 3. CAMBIOS

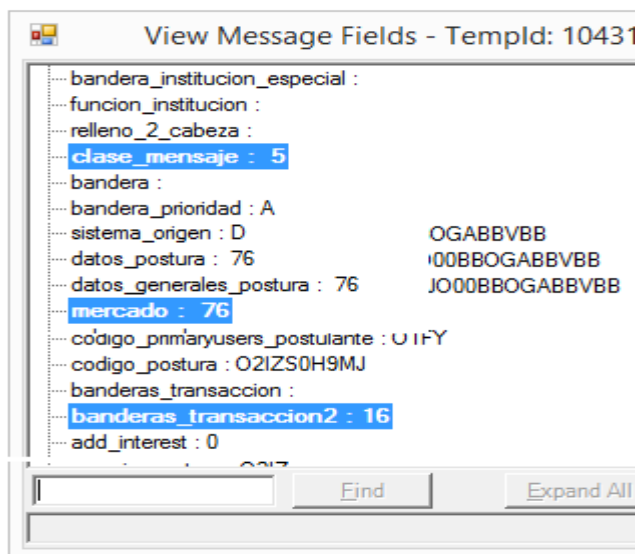
#### 3.1 COMPENSACIÓN DE OPERACIONES NEXT DAY POR LA CAMARA DE COMPENSACIÓN DE DIVISAS

##### Premisas:

- Hoy en día las operaciones Spot son enviadas a compensar a través de la cámara de compensación de divisas, dichas operaciones son enviadas a través de las interfaces anteriormente mencionadas.
- A nivel de funcionalidades e interfaces, no hay cambios en la lógica de operación de estos mercados, es decir que los desarrollos actuales para Spot hay que replicarlos para Next Day.
- Las transacciones por defecto se envían a compensar a la cámara de divisas siempre que se tenga cupo, las que no tienen cupo consumen cupo bilateral y posteriormente se pueden enviar a compensar por solicitud de las contrapartes.

##### Procedimiento:

- Una vez se negocia o registra un Next Day con consumo de cupo cámara el dapi genera un mensaje orden\_transaccion con los siguientes datos:



5 = Operación

76 = Identifica mercado  
Next Day

16 = Identifica que está  
compensada.

##### Archivo plano:

**Clase\_mensaje = posición 66,2**

**Mercado = 125,3**

**Banderas\_transaccion2 = posición 1484,1**

- Operación sin cámara y posterior envío a cámara. Una vez se realiza una transacción sin envío a cámara el dapi genera un mensaje orden\_transaccion así:

```
bandera_institucion_especial :
funcion_institucion :
relleno_2_cabeza :
clase_mensaje : 5
bandera :
bandera_prioridad : A
sistema_origen : D          OGABB
datos_postura : 76          '00BBO'
datos_generales_postura : 76 JO00BB
mercado : 76
código_primaryusers_postulante : UIFY
codigo_postura : 02IZS0H9MJ
banderas_transaccion :
banderas_transaccion2 : 0
add_interest : 0
```

5 = Operación

76 = Identifica mercado  
Next Day

0 = Identifica que **no**  
está compensada.

- Una vez las contrapartes deciden enviarla a la cámara, se genera un nuevo mensaje así:

```
bandera_institucion_especial :
funcion_institucion :
relleno_2_cabeza :
clase_mensaje : 42
bandera : C
bandera_prioridad : A
sistema_origen : D
datos_postura : 76
datos_generales_postura : 76
mercado : 76
código_primaryusers_postulante :
codigo_postura : 02IZS0H9MJ
banderas_transaccion :
banderas_transaccion2 : 16
add_interest : 0
```

42 = Indica cambio a  
cámara

16 = Indica que está  
compensada

## 3.2 FRACCIONAMIENTO DE OPERACIONES NDF CON CLIENTES

### Procedimiento:

Las operaciones forward y Swap una vez negociadas o registradas pueden ser fraccionadas en varias operaciones, el procedimiento a nivel funcional consiste en anular la operación original y crear las nuevas operaciones en la fecha que se están realizando. Cada fracción se comporta como una operación independiente.

### Operación original:

```
hora : 120240
-----
clase_mensaje : 5
bandera : R
mercado : 174
sub_mercado : f
o_d : D
precio : 3010.0000
points_forward : 10.0000
numero : 3000000
numero_minimo :
numero_transado : 3000000.00
mcod_postura : S0H9MQ
sucursal_postulante : 000BBOGABBVBB
codigo_sucursal_postura : 000BBOGA
fecha_vencimiento : 20151120
ciudad_3c_postura : BOG
agencia_postura : A
mcod_transaccion : S0H9MR
ciudad_postura : B
banco_postulante :
codigo_banco_postura :
```

La operación se fracciona en dos operaciones:

Registros Derivados Clientes - Transacciones														
Spot		Next Day		Fix		Forward		Swap		Opciones		IRS/CCS		
Todas		Compras		Ventas		Usuario		Sucursal		Instit.				
Hora	Usuario	st	Nombre comitente	st	T/C/V	Par	Mnda	Monto	Tasa FW	Tasa spot	Plazo	Vence	B	E
12:13:21	JPBARNEY		ALTALENE S.A.	R	Compra	USD / COP		1'500,000.00	3025.5500	3010.0000	2 Meses	07/01/2016	FR	
12:12:35	JPBARNEY		ALTALENE S.A.	R	Compra	USD / COP		1'500,000.00	3012.0000	3001.0000	2 Semanas	20/11/2015	FR	

Se anula la original: Se genera otro mensaje dapi

```

hora : 120240
clase_mensaje : 52
bandera : C
mercado : 174
sub_mercado : f
o_d : D
precio : 3010.0000
points_forward : 10.0000
numero : 3000000
numero_minimo :
numero_transado : 3000000.00
mcod_postura : S0H9MQ
sucursal_postulante : 000BBOGABBVB
codigo_sucursal_postura : 000BBOGA
fecha_vencimiento : 20151120
ciudad_3c_postura : BOG
agencia_postura : A
mcod_transaccion : S0H9MR
ciudad_postura : B
banco_postulante :

```

52 = Indica que la transacción se anulo

Mismo código de la operación

#### Operación fraccionada:

```

hora : 121235
clase_mensaje : 5
bandera : C
mercado : 174
sub_mercado : f
o_d : D
precio : 3012.0000
points_forward : 9.0000
numero : 1500000
numero_minimo :
numero_transado : 1500000.00
mcod_postura : S0H9MQ
sucursal_postulante : 000BBOGABBVBE
codigo_sucursal_postura : 000BBOGA
fecha_vencimiento : 20151122
ciudad_3c_postura : BOG
agencia_postura : A
mcod_transaccion : S0H9MV
ciudad_postura : B
origen_postura : F
codigo_banco_postura :
vencimiento_real : 20151106
referencia : O1FYS0H9MR
hora_cierre_subasta : 120240

```

F = Identifica que es una fracción

Fecha de la operación original

Código de la operación original

Hora de la operación original

## **ARCHIVO PLANO**

En el archivo plano TRANSMO1 durante el proceso de Fraccionamiento se utilizan los siguientes campos:

### **ANULACIÓN DE REGISTRO ORIGINAL FRACCIONADO**

- Bandera\_Postura\_Mercado: muestra **F** que Indica que operación ha sido anulada por Fraccionamiento (En clase\_mensaje debe ser 50)

Tipo dato: Alfabético

Longitud: 1

Posición: 1130

### **NUEVOS REGISTROS QUE NACEN DE FRACCIONAMIENTO (Depende del número de Fraccionamientos)**

- Referencia: Muestra el código de la transacción original, la que fue fraccionada.

Tipo dato: Alfanumérico sin justificar

Longitud: 10

Posición: 482

- Origen\_Postura: Muestra F que indica que proviene de un fraccionamiento.

Tipo dato: Alfanumérico

Longitud: 1

Posición: 1273

- Vencimiento\_Real: Muestra la fecha de la transacción original, la que fue fraccionada.

Tipo dato: Fecha

Longitud: 8

Posición: 912

- Hora\_Cierre\_Subasta: Muestra la hora de la transacción original, la que fue fraccionada.

Tipo dato: Hora

Longitud: 6

Posición: 1261