



# **INSTRUCTIVO DE CAMBIOS EN VERSION 6.27 DEL SISTEMA SET-FX**

**(INTERFACES DAPI, PLANO, XML)**

**Mayo 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    MERCADO FIX: AUTOMATIZACION DE OPERACIONES.....	4
3.2    ANULACIÓN DE COMPENSACION DE OPERACIONES FORWARD EN LA CRCC (Cámara central de riesgo de contraparte) .....	5
3.3    ORIGEN SISTEMA DE NEGOCIACIÓN .....	9
3.4    ORIGEN OPERACIÓN MERCADO FORWARD INTERBANCARIOS PESO/DÓLAR Y OTRAS MONEDAS, FORWRAD CLIENTES PESO/DÓLAR Y OTRAS MONEDAS.....	11
3.5    MATCHING SPOT INTERBANCARIO .....	14

## **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 el sistema. Para la recepción de información se cuenta con el “XML” (eXtensible Markup Language), herramienta que recibe y almacena las operaciones registradas en los sistemas internos de los afiliados.

Es importante que las entidades mantengan actualizadas las interfaces e implementen los cambios que puedan surgir con cada versión del sistema SET-FX, a fin de contar con la mejor información (esto depende de la necesidad de cada entidad).

### **1. OBJETIVO**

Informar a los afiliados del sistema SET-FX los cambios que se incluirán en la versión 6.27 (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, Archivo Plano y XML usados para la entrega y recepción información correspondiente a las operaciones de cada entidad.

### 3. CAMBIOS

#### 3.1 MERCADO FIX: AUTOMATIZACION DE OPERACIONES

##### Procedimiento:

Una vez se negocia o registra un FIX en el sistema SET-FX, se genera un mensaje o línea (archivo plano) con todos los datos de la operación a excepción del precio, lo anterior dado que para el mercado FIX el precio se fija con el promedio del sistema al cierre del mismo.

Los campos que identifican esta operación son:

##### DAPI:

```
.....clase_mensaje : 5
.....bandera :
.....mercado : 75
.....fecha_valor : 1          Depende de plazo (0, 1, 2,3)
.....fecha_entrega : 20141128
.....dias : 1                 Depende de plazo (0, 1, 2,3)
.....precio : 0.0000
.....numero_transado : 1000000.00
.....mcod_transaccion : HRCOBV
```

##### Archivo plano:

Campo	Tipo	Tam	Pos	Descripción
clase_mensaje	númeroico ascii 2	2	66	5 - Transacción
bandera	alfanumerico 1	1	68	Negociación = Empty, Registro = "R"
mercado	numerico ascii 3	3	125	75
fecha_valor	numerico ascii con signo 5	6	169	vacio,1,2,3
fecha_entrega	fecha 8	8	175	Depende de fecha valor
dias	numerico ascii 6	6	183	No. de dias hasta el vencimiento
precio	numerico ascci con signo 13,4	19	219	Viene en cero (0)
numero_transado	numerico ascci 13,2	16	274	El monto transado
mcod_transaccion	alfanumerico 6	6	1473	Llave

Al cierre del mercado Dólar Spot, (13:11) el sistema genera un nuevo mensaje o línea (archivo plano) con todos los datos de la operación FIX original, asignando como precio el promedio de cierre del mercado spot, mercado=71 y clase\_mensaje=43

#### DAPI:

```

...clase_mensaje : 43
...bandera :
...mercado : 71
...fecha_valor : 1
...fecha_entrega : 20141128
...dias : 1
...precio : 2071.4300
...numero_transado : 1000000.00
...mcod_transaccion : HRCOBV

```

#### Archivo Plano

Campo	Tipo	Tam	Pos	Descripción
clase_mensaje	númeroico ascii 2	2	66	43 - Asignación de precio
bandera	alfanumerico 1	1	68	Negociación = Empty, Registro = "R"
mercado	numerico ascii 3	3	125	71
fecha_valor	numerico ascii con signo 5	6	169	vacio,1,2,3
fecha_entrega	fecha 8	8	175	Depende de fecha valor
dias	numerico ascii 6	6	183	No. de dias hasta el vencimiento
precio	numerico ascci con signo 13,4	19	219	Viene en cero (0)
numero_transado	numerico ascci 13,2	16	274	El monto transado
mcod_transaccion	alfanumerico 6	6	1473	Llave

### 3.2 ANULACIÓN DE COMPENSACION DE OPERACIONES FORWARD EN LA CRCC (Cámara central de riesgo de contraparte)

#### Procedimiento:

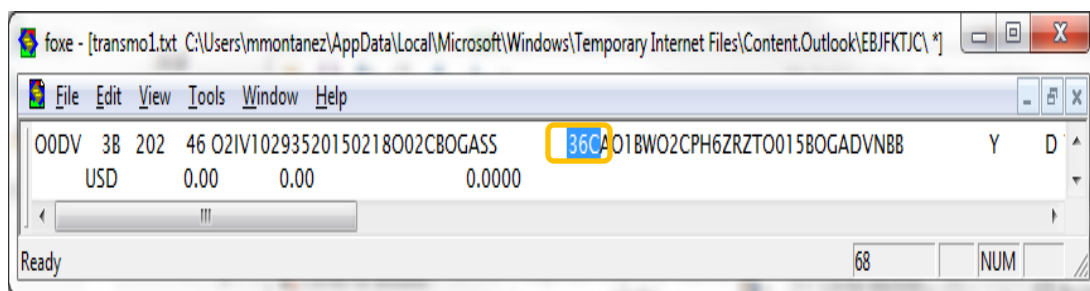
Actualmente las operaciones que son novadas o compensadas en la CRCC, generan un mensaje en el DAPI ó línea en el archivo plano para indicar que la operación ha tenido un cambio de estado, esto se puede evidenciar en los campos que se muestran a continuación:

**DAPI:** la letra “C” mayúscula indica que la operación se encuentra Novada ó compensada en la CRCC

```
bandera_institucion_especial : S
funcion_institucion : S
relleno_2_cabeza :
clase_mensaje : 36
bandera : C
bandera_prioridad : A
```

**Archivo Plano:** La letra “C” mayúsculas indica que la operación se encuentra Novada ó compensada en la CRCC

Campo	Tipo	Tam	Pos	Descripción
				La clase del mensaje : ; 1 - Ingreso de postura ; 2 - Modificación de postura ; 3 - Retiro de postura ; 4 - Aceptación ; 5 - Transacción ; 6 - No transacción ;42 - Cambio a cámara de una operación ;50-Anulación
<b>clase_mensaje</b>	<b>númeroico ascii 2</b>	<b>2</b>	<b>66</b>	<b>:36 - Compensacion a CRCC</b>
<b>bandera</b>	<b>alfanumerico 1</b>	<b>1</b>	<b>68</b>	El campo vendra con una “C” (MAYÚSCULA) para indicar la compensacion por Camara de riesgo ó con “c” (MINÚSCULA) para indicar anulación de compensacion en CRCC



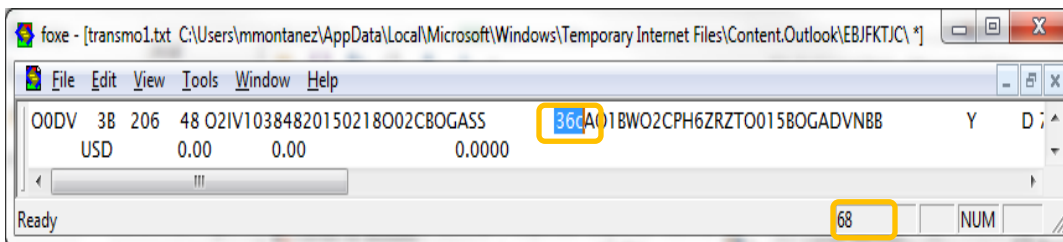
Cuando una operación ha sido anulada en la CRCC, se re-utilizará clase mensaje 36 y el mismo campo bandera pero con una letra “c” (minúscula), queriendo decir con esto, que la operación ahora se encuentra anulada ante la CRCC.

**DAPI:** La letra “c” en minúsculas indica que la operación se encuentra anulada en la CRCC

```
.....bandera_institucion_especial : S
.....funcion_institucion : S
.....relleno 2 cabeza :
.....clase_mensaje : 36
.....bandera : c
.....bandera_prioridad : A
```

**Plano:** La letra “c” minúscula indica que la operación se encuentra anulada en la CRCC

Campo	Tipo	Tam	Pos	Descripción
				La clase del mensaje : ; 1 - Ingreso de postura ; 2 - Modificación de postura ; 3 - Retiro de postura ; 4 - Aceptación ; 5 - Transacción ; 6 - No transacción ; 42 - Cambio a cámara de una operación ; 50 - Anulación
clase_mensaje	númeroico ascii 2	2	66	:36 - Compensacion a CRCC
bandera	alfanumerico 1	1	68	El campo vendra con una "C" (MAYÚSCULA) para indicar la compensacion por Camara de riesgo ó con "c" (MINÚSCULA) para indicar anulaci3n de compensacion en CRCC





También puede verificar desde el blotter del usuario de la siguiente manera:

Compensación en la CRCC: “CR”

Dólar Swap - Transacciones

<

Anulación de compensación en la CRCC “vacío”

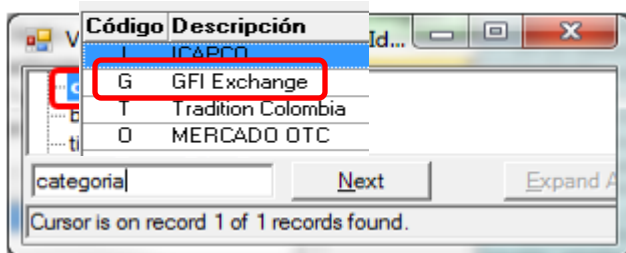
Dólar Swap - Transacciones

### 3.3 ORIGEN SISTEMA DE NEGOCIACIÓN

#### Procedimiento:

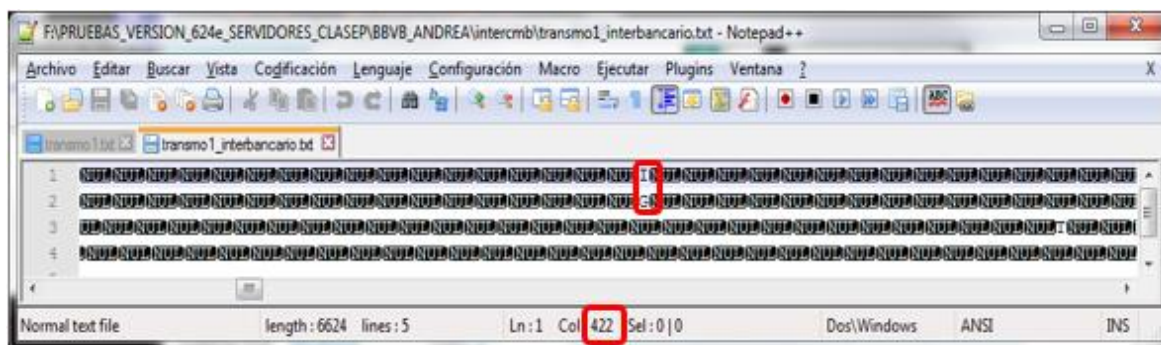
Por requerimiento de la Súper Intendencia Financiera de Colombia, se agregó un campo para seleccionar el sistema en el cual fue negociada la operación (ICAPCO, GFI, tradition, Mercado OTC, otras que se vayan creando):

**DAPI:** El nuevo campo en el DAPI “codigo\_categoria” traerá los valores que indican el sistema de Negociación:



**Archivo Plano:** Para todos los mercados el nuevo campo se ubica en la posición **422** y traerá los valores que indican el sistema de Negociación:

Código	Descripción
I	ICAPCO
G	GFI Exchange
T	Tradition Colombia
O	MERCADO OTC



**XML:** Para los registros realizados con contrapartes Offshore, el campo <tipo\_identificacion> es "X" ó "S".

En el campo <Sistema\_Negociacion> se ingresarán los valores que indican el sistema en el cual fue negociada la operación que está registrando:

<!-- Código único de un carácter que identifica al sistema de negociación ingresado en el DmCliente -->

Código	Descripción
I	ICAPCO
G	GFI Exchange
T	Tradition Colombia
O	MERCADO OTC

<sisistema\_negociacion>I</sisistema\_negociacion> ó  
<sisistema\_negociacion>G</sisistema\_negociacion> ó  
<sisistema\_negociacion>T</sisistema\_negociacion> ó  
<sisistema\_negociacion>O</sisistema\_negociacion>

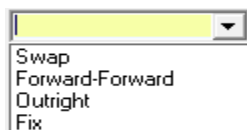
### 3.4 ORIGEN OPERACIÓN MERCADO FORWARD INTERBANCARIOS PESO/DÓLAR Y OTRAS MONEDAS, FORWRAD CLIENTES PESO/DÓLAR Y OTRAS MONEDAS

#### **Procedimiento:**

Para mejorar la información que se ingresa al registrar una operación, se solicitó que para estos mercados se identificara el origen de la operación, a fin de conocer si proviene de un Swap, Forward-forward, outright o un Fix. Este campo no es obligatorio, por lo cual podrá venir sin información.

**DAPI:** El campo actual del DAPI “entidad\_publica\_3c\_1” traerá los valores que indican origen de la operación, identificados de la siguiente manera:

Swap=S  
Forward-Forward=F  
Outriht=O  
Fix=X0  
Empty=vacio



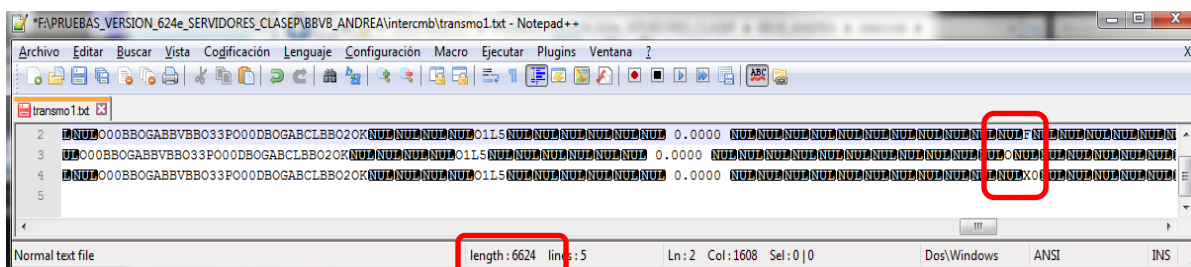
A screenshot of a software interface showing a dropdown menu. The menu is open, displaying four options: "Swap", "Forward-Forward", "Outright", and "Fix". The menu has a yellow background and a small downward arrow icon on the right side of the header.

```

.....
entidad_publica_3c_1 : S
entidad_publica_3c_1 : F
entidad_publica_3c_1 : O
entidad_publica_3c_1 : X0

```

**Archivo Plano:** El campo actual del plano en la posición 1608, traerá los valores que indican el origen:



**XML:** En el campo < Texto\_Origen> se ingresarán los valores para indicar el origen o proveniencia de la operación que está registrando:

- Para el mercado **Spot Registro divisas (174 y sub\_mercado “S” o “s”)** se debe Indicar el origen de la transacción, <texto\_origen></texto\_origen> de la siguiente manera:

S – Spot  
 F - Swap Forward  
 O - Swap O/N contado  
 U - Swap Futuro

- Para el mercado **Forward (74) y registro de divisas (174 y submercados “F”, “f”)**, se debe indica el origen de la transacción de la siguiente manera:

S - Swap  
 F - Forward-Forward

O - Outright  
X0 - Fix  
Empty - Vacio

**Nota: Las mismas opciones aplican para el mercado spot (71) y Forward (74) respectivamente**


### 3.5 MATCHING SPOT INTERBANCARIO

#### Procedimiento:

Se implementará una nueva herramienta de negociación **“Matching Spot”** en la cual se operará fijando un precio discrecional o con el precio promedio del mercado SPOT.

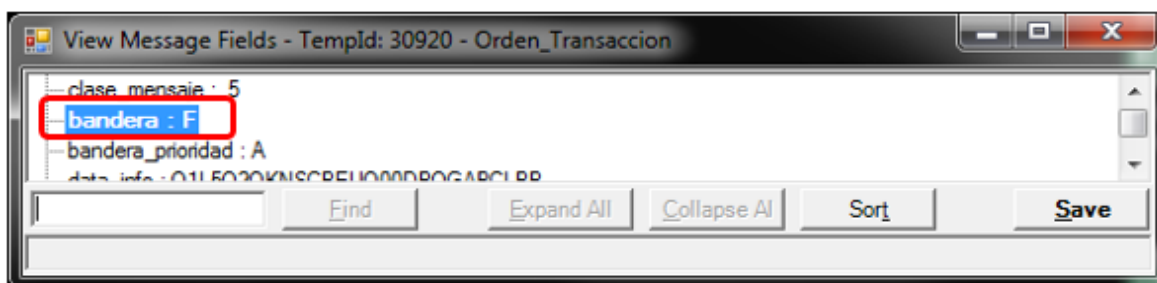
Esta herramienta no genera ningún cambio a nivel de mensajería, pero si se quiere identificar el origen de esta operación, será necesario leer el campo adicional.

Ejemplo: un usuario negoció una operación por el mecanismo de **“Matching Spot”**, en el blotter del usuario se podrá identificar en la columna **Ori**, dicha operación como **“FP”**.


Dólar Spot - Transacciones

Todas	Compras	Ventas	Usuario	Sucursal	Inst.					
Hora	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	Ori	A	R	E	C
15:00:48	ANDREA	Compra	2599.00	5000	BCLB	FP	A			C
15:01:00	ANDREA	Compra	2599.00	1000	BCLB	FP	A			C
Total compras sucursal:			13'250,000	2545.64						
Total ventas sucursal:			17'000,000	2485.32						
En Cámara		Compras	Pérd/Gan	Ventas		Pérd/Gan	Netos			
BBV:		10'250,000		500,000			9'750,000			
Cupo:		4,990'250,000		5,009'750,000			Detalle Pérd/Gan			
Estado de transferencias: Compensación pendiente										

**DAPI:** En el campo actual del DAPI **“bandera”** traerá el valor **(F)** que indica la operación proviene de un **“Matching Spot”**



**Archivo Plano:** En el campo 1608 traerá el valor **(FP)** para indicar que la operación proviene de un Matching Spot

