

05/2021

MODIFICACION INTERFASES

ARCHIVO PLANO,
API Y XML

Actualización

Versión 7.12

Sistema SET-FX



INTRODUCCIÓN

SET-ICAP FX, entidad administradora del sistema de negociación y registro de operaciones sobre divisas SET-FX, de acuerdo a nuevos requerimientos realizados por el mercado y organismos de control está implementando cambios en el sistema, los cuales se describen en este documento y están disponibles en el ambiente de pruebas para sus afiliados.

ALCANCE

Este documento está dirigido a las áreas técnicas de las entidades afiliadas al sistema SET-FX, desarrolladores y proveedores de sus sistemas de información internos. Las ventanas ejemplo de este documento son referenciales y en el desarrollo final pueden tener otra apariencia, pero conservando la funcionalidad indicada.

OBJETIVO

Informar a las áreas de desarrollos de los afiliados al sistema SET-FX los cambios en las interfaces Archivo plano, API y XML, teniendo en cuenta la nueva versión del sistema 7.12 que entrará en producción en la última semana de julio de 2021.

La entidad afiliada deberá tomar en cuenta este documento para validar, dimensionar y ejecutar los ajustes respectivos a sus desarrollos internos.

CONSIDERACIONES GENERALES

- Las entidades deberán probar con antelación la conectividad y accesos al ambiente de pruebas del sistema SET-FX:
 - 100.100.32.206
 - 100.100.32.205
 - 100.100.32.209

Las IPs mencionadas anteriormente deben alcanzarse por los Puertos 7006 y 10443.

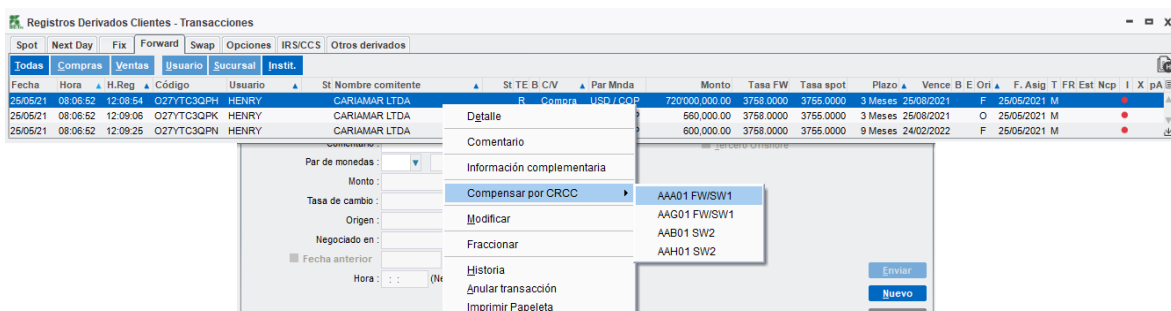
- Inclusión de dos nuevos campos en el DAPI
- Retiro del campo “cuenta_crcc_postura”
- No hay cambios en las posiciones del archivo plano
- Cambios en Tag en la estructura del XML para operaciones IRS/CCS
- Es necesario que todas las entidades que usan la herramienta API actualicen la librería OCX a su última versión, se implemente o no los cambios descritos en este documento
- Los cambios aplican para entidades afiliadas que compensan operaciones Forward y swaps de tasa de interés en la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia (CRCC)
- El área de soporte de SET-FX estará disponible para atender todas las dudas de tipo técnico relacionadas con este documento.
- Una vez la entidad finalice los ajustes o desarrollos en las interfaces que le corresponden, esta deberá informar a SET-ICAP por un medio formal la culminación exitosa de los mismos.

COMPENSACIÓN MÚLTIPLES CUENTAS CLIENTES

En el sistema SET-FX en los registros de operaciones Forwards y Swap de tasa de interés (IRS/CCS) para la compensación de instrumentos derivados en la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) se podrán asignar múltiples cuentas para clientes de cada entidad IMC

A partir del lanzamiento de la nueva actualización 7.12 y en línea con el procedimiento actual, las entidades afiliadas podrán solicitar a la CRCC la creación de varias cuentas de compensación a nombre de un mismo cliente, para las operaciones Forward y Swaps de tasa de interés

Estas operaciones son registradas en el mercado 174 (Registro de divisas) y posteriormente enviadas a la CRCC desde el blotter de operaciones. Con esta nueva funcionalidad los operadores podrán seleccionar la cuenta a la que quieren enviar la operación.



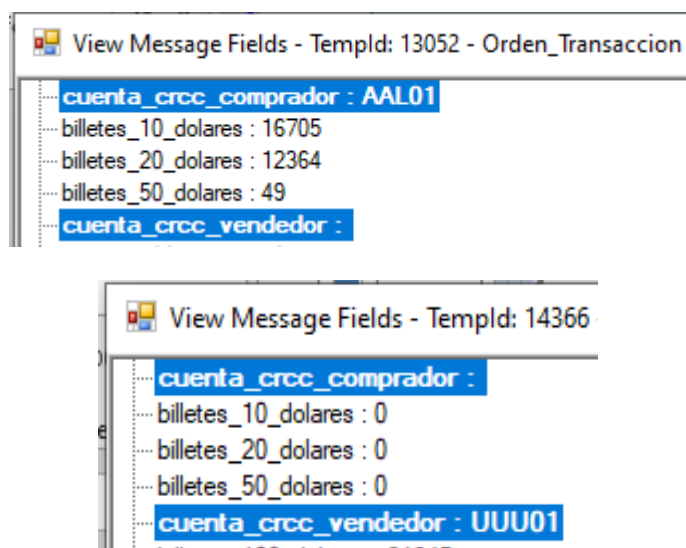
La información de la cuenta CRCC seleccionada también se incluirá en la descarga a Excel del blotter de operaciones en la columna “Cta. CRCC Contraparte”.

Plazo	Vence	Fecha pago	Cumplimiento	B	E	Ori	F. Asig.	T	FR	Est	Cta. CRCC Contraparte
2 Meses	23/07/2021	26/07/2021	NON-DELIVERY			O	25/05/2021	M		CR	AAA01
3 Meses	25/08/2021	26/08/2021	NON-DELIVERY				25/05/2021	M		CR	AAG01
9 Meses	24/02/2022	25/02/2022	NON-DELIVERY				25/05/2021	M		CR	AAG01
3 Meses	25/08/2021	26/08/2021	NON-DELIVERY			F	25/05/2021	M			
3 Meses	25/08/2021	26/08/2021	NON-DELIVERY			O	25/05/2021	M			
9 Meses	24/02/2022	25/02/2022	NON-DELIVERY			F	25/05/2021	M			

API

El mecanismo actual para la captura de la compensación de operaciones de derivados no tendrá cambios.

Para identificar la cuenta de compensación CRCC en la operación, deben tomar el mensaje tipo “orden_transaccion”, “Clase_mensaje” 36, campos “cuenta_crcc_comprador” o “cuenta_crcc_vendedor”.



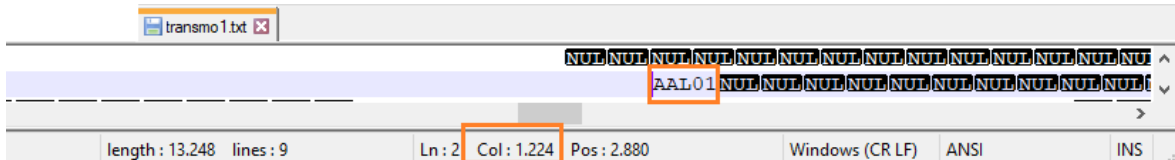
Archivo Plano

El mecanismo actual de lectura de la compensación de operaciones de derivados no tendrá cambios.

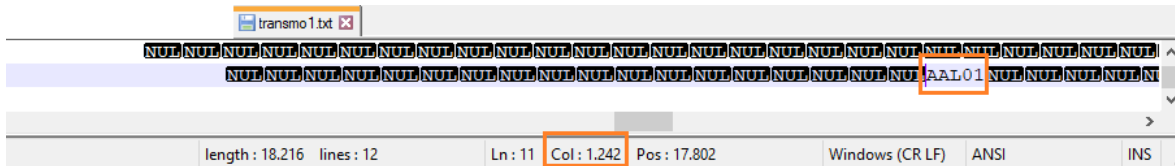
Para identificar la cuenta de compensación CRCC en la operación, deben leer la línea clase mensaje 36, posición 1224 para la cuenta CRCC comprado o 1242 para la cuenta CRCC vendedor.

Valor Alfanumérico de 5 posiciones.

Cuenta CRCC Comprador



Cuenta CRCC Vendedor



XML NUEVOS CAMPOS PARA REGISTROS IRS Y CCS

Para las operaciones Swaps de tasa de interés (IRS / CCS) realizadas con clientes, se implementan los siguientes campos dentro del archivo XML:

Fecha vencimiento sin ajustar

- Formato YYYY-MM-DD.
- Campo OPCIONAL, solo se una en IRS/CCS para plazos libres.
- No puede ser mayor que el día laborable posterior o menor que el día laborable anterior al vencimiento del plazo

<vencimiento_sin_ajustar></vencimiento_sin_ajustar>

```
<!-- Fecha primera amortización en formato YYYY-MM-DD, por defecto es la misma fecha de pago,
      Sólo debe ser mayor o igual a fecha de pago -->
<vencimiento_sin_ajustar></vencimiento_sin_ajustar>
```

Segundo Monto

- Formato 999999999.99.
- Campo OPCIONAL.
- Por omisión se mantiene el mismo valor del monto
- No puede ser mayor al monto de la operación

<segundo_monto></segundo_monto>

```
<!-- Valor amortizacion, con formato 999999999.99, por default mantiene el mismo valor del monto,
      menor a éste, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS -->
<segundo_monto></segundo_monto>
```

SET-ICAP estará disponible para resolver dudas en las siguientes direcciones de correo electrónico soportesetfx@set-icap.co; comercial@set-icap.co o al número telefónico 7427778.

Cordialmente,

FRANZ CHAMORRO
Gerente de Tecnología
SET-ICAP FX

CONTROL DE CAMBIOS

Versión	Revisado – Responsable	Fecha de Revisión	Aprobado	Fecha Aprobación	Razón
01	Director de Servicios y Soporte SET-FX	25/05/2021	Gerente de TI	25/05/2021	Creación del documento.