



INSTRUCTIVO DE CAMBIOS VERSION 7.15 DEL SISTEMA SET-FX

(INTERFACES DAPI, ARCHIVO PLANO, XML Y PROTOCOLO FIX)

Noviembre 2022

INTRODUCCIÓN

SET-ICAP sociedad administradora del Sistema de negociación y registro sobre divisas SET-FX, se permite informar a todas las entidades los cambios que se presentarán en los mecanismos de automatización “Archivo plano”, “DAPI” (Datatec Application Interface), Protocolo FIX y “XML” (Extensible Markup Language), teniendo en cuenta la puesta en producción de la nueva versión 7.15 del sistema SET-FX en marzo de 2023.

1. CAMBIOS API Y ARCHICO PLANO TRASMO1.TXT

No se van a realizar cambios en la estructura ni en los campos de las interfaces. Sin embargo, **es necesario que todas las entidades actualicen la librería OCX teniendo en cuenta la última versión 7.15.**

1.1 Envío de operaciones sobre Opciones a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) para novación.

A partir de la puesta en producción de la versión 7.15, las entidades afiliadas podrán enviar a compensar a la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) las operaciones sobre Opciones que se registren en el Sistema SET-FX.

Se podrán enviar operaciones realizadas entre Intermediarios del Mercado Cambiario (IMC) e Intermediarios del Mercado Cambiario y sus clientes finales, con las siguientes características:

- Par de moneda: USD/COP
- Tipo de opción: Europea
- Cumplimiento: Non-Delivery

A continuación, se presentan los mensajes que se producen en el API y en el Archivo Plano cuando se envía una operación del mercado de Opciones a compensar, así como los que se producen cuando una operación se desmarca de la CRCC.

Mensajes en operaciones IMC-IMC

- **API – Envío de la operación a compensar:** Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje = 36, campo “mercado” = 174; Submercado = “O”; “bandera” = C
- **API – Desmarque de la operación en CRCC:** Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje = 36, campo “mercado” = 174; Submercado = “O”; “bandera” = c
- **Archivo – Envío de la operación a compensar:** Clase mensaje= 36 (posición 66), campo “mercado” = 174 (posición 125); Submercado = “O” (posición 128;), “bandera” = C (posición 68)
- **Archivo Plano – Desmarque de la operación en CRCC:** Clase mensaje= 36 (posición 66), campo “mercado” = 174 (posición 125); Submercado = “O” (posición 128;), “bandera” = c (posición 68)

Mensajes en operaciones IMC-Clientes

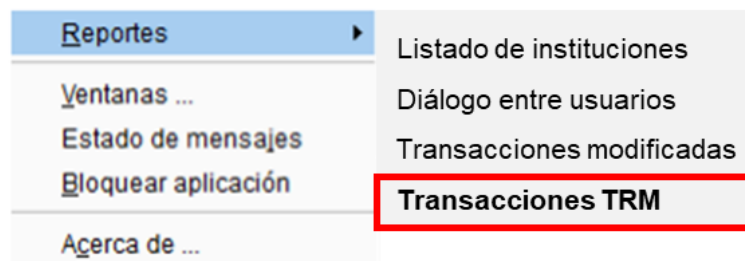
- **API – Envío de la operación a compensar:** Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje = 36, campo “mercado” = 174; Submercado = “o”; “bandera” = C
- **API – Desmarque de la operación en CRCC:** Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje = 36, campo “mercado” = 174; Submercado = “o”; “bandera” = c
- **Archivo – Envío de la operación a compensar:** Clase mensaje= 36 (posición 66), campo “mercado” = 174 (posición 125); Submercado = “o” (posición 128;), “bandera” = C (posición 68)
- **Archivo – Desmarque de la operación en CRCC:** Clase mensaje= 36 (posición 66), campo “mercado” = 174 (posición 125); Submercado = “o” (posición 128;), “bandera” = c (posición 68)

Reportes operaciones TRM, formatos 102 y 395 Superintendencia Financiera de Colombia (SFC).

A partir de la nueva versión 7.15 del sistema SET-FX, las entidades afiliadas podrán generar, revisar, modificar y descargar en formato XML, los archivos 102 y 395 con los cuales se reportan a la SFC las operaciones que hacen parte del cálculo de la TRM.

Las entidades que cuenten con la opción de generar el reporte de operaciones TRM, deberán informar por medio de una comunicación escrita, que usuarios tendrán acceso a la descarga.

El acceso se realizará por medio de modulo de reportes del sistema.



Se generará un reporte inicial con las operaciones y registros incluidos dentro de la base de datos del sistema SET-FX. Los usuarios autorizados podrán incluir y/o modificar operaciones dentro las ventanas del formato 395 (discriminador de operaciones). Cada modificación será guardada por el sistema, identificando la hora de modificación y el usuario que la realizó.

Formato 102 consolidado de operaciones

Reporte Transacciones TRM - Nuevo

Tipo SFC: 01 Cód. SFC: 000013 Nombre: BBVA Fecha: 12-ene-2021 Formato SFC: 102

Subcta SFC	Tipo de operación	COMPRAS		VENTAS		U. captura SFC
		Promedio	Monto transado	Promedio	Monto transado	
015	Operaciones de transferencia	2039.85	250,000.00	2038.37	374,970.87	2
015	Operaciones de interbancario	2056.00	500,000.00	2055.35	375,059.31	3

Generar archivos TXT **Cancelar**

Formato 395 discriminado de operaciones (transferencia / Interbancario)

Reporte detallado transacciones TRM (*Nuevo reporte)

Operaciones de transferencias - COMPRAS

Tipo SFC: 01 Cód. SFC: 000013 Nombre: BBVA Fecha: 12-ene-2021 Formato SFC: 395 U. captura SFC: 5

No.	Hora	H.Reg	Tipo id. SFC	Identificación	Nombre contraparte	Monto	Tasa	Sis. Neg. SFC	Sis. Reg. SFC	Cód. Sis. Negociación	Cód. Sis. Registro
1	08:12:00	08:26:52	3	800182281	Fiduciaria Davivienda S.A.	250,000.00	2039.80	3	1	ABCDEFGHJ123456	O3UY2WAWAG
2	08:15:00	08:29:02	3	800149496	Colfondos S.A. Pensiones y Cesan	250,000.00	2039.90	1	1	O3UY2WAWAG	O3UY2WAWAG

Aumentar **Cerrar**

El sistema generará un archivo TXT que podrá ser cargado en la plataforma de la Superintendencia Financiera de Colombia.

Cualquier duda al respecto de esta información, puede ser enviada al correo Soportesetfx@set-icap.co o al número telefónico 57 1 7427778.