



2024

Nueva Versión 7.17

Actualización Interfaces para
el envío de operaciones
Forward UVR/COP

Archivo Plano, API

ACTUALIZACIÓN DE INTERFACES

INTRODUCCIÓN

SET-ICAP Securities y SET-ICAP FX suscribieron un acuerdo operativo con el objeto de facilitar a los clientes el envío de las operaciones Forward UVR/COP a los sistemas de registro de SET-ICAP Securities.

A través de la tecnología del SET-FX se habilitarán Interfaces que transmiten información a los sistemas internos de sus afiliados.

ALCANCE

Este documento está dirigido a las áreas técnicas de las entidades interesadas en negociar y registrar el Forward UVR/COP, desarrolladores y proveedores de sus sistemas de información internos, para que en el caso que aplique se realicen el ajuste necesario.

OBJETIVO

- Explicar las modificaciones a implementarse en las interfaces de información API, Archivo plano.
- Informar la actualización de los valores del campo PAR MONEDAS para la negociación de forward de inflación.

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

CONSIDERACIONES GENERALES

Las ventanas ejemplo de este documento conservan la funcionalidad indicada, pero es de anotar que son referenciales.

Es necesario que las entidades garanticen con antelación la conectividad y accesos al siguiente ambiente de pruebas:

IPs: 100.100.32.206 o 100.100.32.209

Puertos: 7006 y 10443.

- Una vez salga a producción la nueva versión 7.17 del sistema SET-FX todos los DAPI deben estar con la versión de la OCX 3.017 (Linux/Windows). Estas versiones ya se encuentran disponibles en <https://set-icap.com/set-icap-fx/todos-los-productos-y-servicios-de-set-icap-fx-de-negociacon-registro-y-post-trade-para-el-analisis-de-informacion-sobre-divisas-somos-la-principal-fuente-de-informacion-de-divisas-en-colombia/descargas-de-set-icap-fx/>
- 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.

Cambios en el manejo de operaciones Forward UVR/COP en los componentes DAPI y Archivo Plano

A continuación, se describen los puntos clave para la identificación y registro de operaciones Forward UVR/COP en los componentes **DAPI** y **Archivo Plano**:

1. Sin cambios en la estructura del DAPI y Archivo Plano:
 - Los componentes **DAPI** y **Archivo Plano** continuarán utilizando la misma estructura que manejan actualmente para el registro de operaciones entre dos **IMC** o entre un **IMC** y su **cliente**.
 - No habrá modificaciones en los campos, posiciones o en la lógica de los mensajes existentes.
2. Identificación de operaciones Forward UVR/COP:
 - Tras el registro de operaciones Forward entre pares de monedas UVR/COP, el afiliado deberá identificar el código del mercado 174.
 - Submercado "F" para operaciones entre dos IMCs.
 - Submercado "I" para operaciones entre un IMC y un cliente.
3. Identificación del par de monedas UVR/COP:

- El afiliado podrá identificar el par de monedas involucrado en el registro de la operación por medio de los campos correspondientes, cuya estructura se mantiene intacta en ambos componentes (DAPI y Archivo Plano).
4. A continuación, se describen las posiciones y campos clave para identificar el par de monedas UVR/COP:
- Registro de operaciones entre dos IMC

DAPI : Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174
sub_mercado=F, bandera = R moneda=”UVR” otra_moneda=”COP”

Archivo plano: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= R (posición 68) como
mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=F (posición 128) currency_pair
=”UVR COP” (posición 349)

- Registro de operaciones entre IMC y Cliente

DAPI: Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174
sub_mercado=f, bandera = R moneda=”UVR” otra_moneda=”COP”

Archivo plano: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= R (posición 68) campo
mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=f (posición 128) currency_pair
=”UVR COP” (posición 349)

5. Registro de operaciones Forward UVR/COP:
- Tanto para operaciones entre IMCs como entre un IMC y un cliente, los afiliados deberán seguir los mismos procedimientos de registro que aplican para otros pares de monedas del **mercado de derivados**.
 - Las interfaces del DAPI y Archivo Plano reconocerán el código de mercado y submercado mencionados para estos tipos de operaciones.

Proceso de Compensación de Operaciones Forward UVR/COP

Una vez que la Cámara Central de Contraparte (**CRCC**) esté en capacidad de recibir y compensar las operaciones **Forward UVR/COP**, estas seguirán la misma metodología que actualmente se utiliza para la compensación de operaciones de derivados.

Los siguientes puntos describen cómo se gestionarán estas operaciones a través de los componentes DAPI y Archivo Plano:

1. Metodología de compensación:
 - La compensación de operaciones Forward UVR/COP utilizará los mismos procedimientos y estándares que se aplican actualmente para las operaciones de derivados Forward USD/COP.

- No se introducirán cambios en la lógica de compensación ni en los procesos de liquidación por parte de la *Cámara Central de Contraparte (CRCC).
- Los mensajes generados para la compensación de operaciones Forward UVR/COP incluirán los mismos campos que se utilizan en el mercado de derivados Forward USD/COP, permitiendo así una transición sin cambios estructurales.

A continuación, los mensajes específicos (API y Archivo plano)

Compensación y descompensación de operaciones entre IMC

API compensación: Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174 sub_mercado=F, bandera = C

API descompensación: Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174 sub_mercado=F, bandera = c

Archivo plano compensación: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= C (posición 68) campo mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=F (posición 128)

Archivo plano descompensación: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= c (posición 68) campo mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=F (posición 128)

Compensación y descompensación de operaciones entre IMC-CLIENTES

API compensación: Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174 sub_mercado=f, bandera = C

API descompensación: Tipo de Mensaje “Orden_Transaccion”, clase_mensaje=5, mercado=174 sub_mercado=f, bandera = c

Archivo plano compensación: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= C (posición 68) campo mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=f (posición 128)

Archivo plano descompensación: Clase mensaje= 5 (posición 66), campo “bandera”= c (posición 68) campo mercado=174 (posición 125), campo sub_mercado=f (posición 128)

Nota: por el momento las operaciones UVR/COP no podrán ser enviada a la CRCC y aun cuando le trader las envíe quedarán en estado NC (no compensadas).