



2024

Nueva Versión 7.17 Sistema SET-FX

Actualización Interfaces

Archivo Plano, DAPI,
Protocolo FIX y XML

ACTUALIZACIÓN INTERFASES SET-FX

INTRODUCCIÓN

El sistema SET-FX provee varias interfaces que transmiten información a los sistemas internos de sus afiliados. A medida que el sistema se ha robustecido, ha sido necesario realizar ajustes en estas interfaces para cumplir con los nuevos servicios que los afiliados consumen del sistema. Este documento muestra los cambios asociados a la nueva versión 7.17 del sistema SET-FX.

ALCANCE

El documento está dirigido a las áreas técnicas, desarrolladores y proveedores de sistemas internos de las entidades afiliadas al sistema SET-FX, con el fin de aplicar los ajustes necesarios.

OBJETIVO

- Explicar las modificaciones a implementarse en las interfaces de información API, Archivo plano, XML y sesiones FIX, a propósito de la nueva versión del sistema SET-FX.
- Informar las modificaciones a implementar en las interfaces para que los desarrollos internos de los afiliados puedan incluir un nuevo origen para registros FIX entre IMC-IMC e IMC-CLIENTES.

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 ambiente de pruebas del sistema SET-FX:

IPs: 100.100.32.206 o 100.100.32.209

Puertos: 7006 y 10443.

Adicionalmente, las entidades que manejen sesiones de protocolo FIX deben garantizar la conexión a los puertos correspondientes en el ambiente de pruebas:

IP: 100.100.32.207

Market Data puerto :7118

Order Management puerto: 7138

Drop Copy puerto :7128

Drop Copy Supervisor puerto: 7148

Finalmente, una vez esas sesiones de protocolo FIX realicen su proceso de pruebas y se garantice el funcionamiento, las entidades deberán solicitar la recertificación conectándose al respectivo ambiente:

IP: 100.100.32.207

Market Data Puerto: 2118

Order Management Puerto: 2138

Drop Copy puerto 2128

Drop Copy Supervisor puerto 2148

- Una vez salga a producción la nueva versión 7.17 del sistema SET-FX todos los DAPI deben estar con la versión de la librería 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 PARA LA NUEVA VERSIÓN 7.17 SISTEMA SET-FX

MODIFICACIÓN DEL NEMOTÉCNICO, DE INSTITUCIÓN Y SUCURSAL

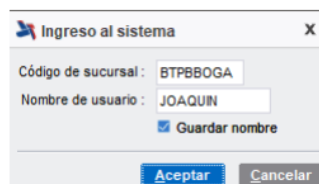
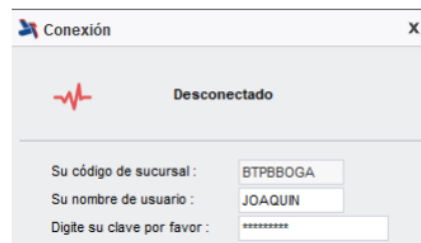
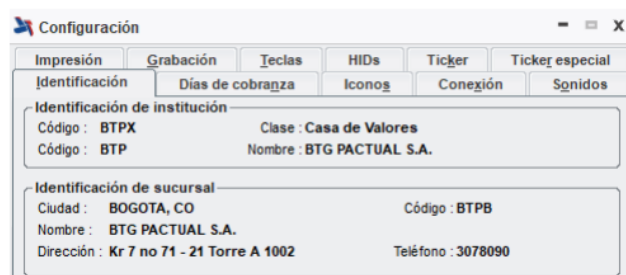
Con la nueva versión 7.17, las entidades afiliadas podrán solicitar al administrador del sistema el cambio del nemotécnico con el que se identifican. Por ejemplo, la entidad **BTG Pactual**, que actualmente se identifica como “**BYR**”, podrá cambiar su código a uno que se identifique mejor con su nombre actual, como “**BTP**”.

En caso de que una entidad afiliada utilice en sus sistemas internos los nemotécnicos, propios o de sus contrapartes, deberán realizar los ajustes correspondientes cuando se ejecute el cambio en el Sistema SET-FX.

Estos cambios serán notificados al mercado mediante un boletín con suficiente antelación, por lo cual se recomienda a las áreas técnicas y a los desarrolladores implementar los ajustes necesarios dentro de los tiempos establecidos en el boletín.

Así mismo, la entidad que realice el cambio de nemotécnico deberá ajustar cada una de las terminales de sus usuarios mediante una nueva instalación del aplicativo SET-FX, configurando el nuevo código de sucursal:

Ingresar el nuevo nombre de sucursal que corresponda

La entidad que solicite el cambio de su nemotécnico deberá realizar los siguientes ajustes dependiendo de las interfaces que utilice:

Conexión Clientes FIX

Es necesario usar el nuevo nemotécnico de sucursal en el mensaje de Login de los clientes FIX de la entidad.

Conexión Usuarios DAPI

Se requiere realizar el ajuste en el archivo de configuración dapi.cfg, actualizando el nuevo nemotécnico.

Ejemplo:

Nemotécnico BYR

```
branch_code    = BYRKMDE
user_name      = DAPIBBTG
```

Después del cambio de código

```
branch_code    = BTPXKDE
user name      = DAPIBBTG
```

RECOMENDACIÓN GENERAL

Para los afiliados que utilizan el componente DAPI, con el fin de facilitar la identificación de contrapartes en los registros realizados con otros IMC, se recomienda utilizar el campo que contiene el número NIT de cada contraparte. De esta manera, podrán evitar ajustes en sus interfaces cada vez que se produzca un cambio de nemotécnico asociado a un IMC.

Los campos asociados al número NIT en el DAPI son:

- Codigo_banco_postura.codigo_ruc
- Codigo_banco_postura_1.codigo_ruc
- codigo_sucursal_postura.codigo_ruc
- codigo_sucursal_postura_1.codigo_ruc

Con respecto al archivo plano, los IMC deberán realizar los ajustes necesarios para identificar los nuevos nemotécnicos asociados al IMC que solicite el cambio.

SESIONES FIX PROTOCOL, MERCADOS SPOT Y NEXT DAY

Sesiones Order management, Drop Copy y DC Supervisor.

Con esta nueva versión, en las sesiones “Order Management”, “Drop Copy” y “Drop Copy Supervisor” se podrán identificar el ingreso/retiro de una postura tipo orden. Cabe anotar que este tipo de posturas solo se hacen a través de la interfaz gráfica del sistema SET-FX.

A continuación, se muestran los nuevos valores en el TAG 2594 de los mensajes 35=8 relacionados a este tipo de posturas.

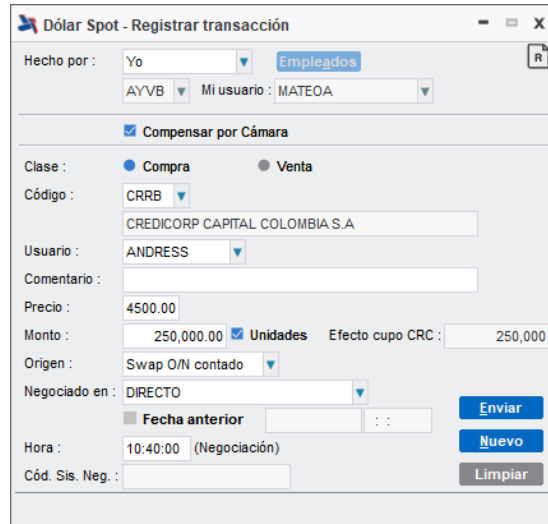
Protocolo FIX (Spot y Next Day)				
Drop Copy y Drop Copy Supervisor				
Mensaje	Campo	Tipo dato	Reqd	Valores
ExecutionReport(35=8)	OrderAttributeGrp component (Nuevo)	int		Required if NoOrderAttributes(2593) > 0 Type of order attribute. Supported values: 9 = Hidden order
	OrderAttributeType(2594)			Notas: - Órdenes con este atributo son órdenes C/V ingresadas desde el Frontend Datatec y no son parte del mercado electrónico. - Va a llegar el mensaje ER con este atributo al ingresar, retirar o expirar una orden C/V. - No va a llegar el mensaje ER de cancelación cuando la orden C/V se transa totalmente, sino que llega el ER de transacción. - Debe dar error si el cliente FIX OM intenta retirar (Cancel) o modificar (CancelReplace) una orden C/V ingresada por un usuario Datatec.

Para las sesiones FIX mencionadas se requiere recertificación para la salida a producción.

Las entidades que utilicen estas sesiones deben revisar la Especificación FIX con el fin de validar el cambio mencionado.

MERCADOS SPOT, NEXT DAY, DÓLAR FIX.

Se permitirá realizar registros en los mercados Spot, Next Day y Dólar Fix con unidades y dos decimales



En las interfaces de suministro de información, como DAPI y Archivo Plano, la información relacionada con el registro de operaciones que incluyan montos con decimales será enviada en los campos y posiciones correspondientes a dichos montos.

Ejemplo:

View Message Fields - Templd: 7461 - Orden_Transaccion
numero_transado : 80000.45

View Message Fields - Templd: 7462 - Precios_Montos_Transados
monto_hoy : 80000.45

transmo1.txt		
0.0000	70000	70000.99
0.0000	70000	70000.40
0.0000	70000	70000.40
0.0000	80000	80000.45

CAMPO FECHA DE ASIGNACIÓN EN MERCADO FIX PARA REGISTROS ENTRE IMCS

Se aumenta campo en el DAPI para identificar la fecha de asignación de tasa en Registros IMC-IMC para el mercado Fix. Para el Archivo Plano se hace uso de la posición 175.

DAPI:

- **Tipo de Mensaje** "Orden_Transaccion"
- **clase_mensaje= "5"**
- **mercado= "75"**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa

Archivo plano:

- **Clase mensaje= "5"** (posición 66)
- **mercado= 75 (posición 125)**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa (posición 175)

Nota:

- **Si la fecha de asignación de tasa es anterior a la fecha de vencimiento, no hace la transición al mercado Spot.**
- El día de asignación de tasa, se enviará por medio del DAPI y Archivo Plano una asignación de tasa clase mensaje 43 para el mercado 75.

Asignación de Tasa:

*Si la fecha de asignación de tasa es **menor** a la fecha de vencimiento, se informará de la siguiente manera:*

DAPI:

- **Tipo de Mensaje** "Orden_Transaccion"
- **clase_mensaje= "43"**
- **mercado= "75"**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa

Archivo Plano:

- **Clase mensaje= "43"** (posición 66)
- **mercado= 75 (posición 125)**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa (posición 175)

*Si la fecha de asignación de tasa es **igual** a la fecha de vencimiento, se informará de la siguiente manera:*

DAPI:

- **Tipo de Mensaje** "Orden_Transaccion"
- **clase_mensaje= "43"**
- **mercado= "71"**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa

Archivo plano Registro:



- **Clase mensaje= "43"** (posición 66)
- **mercado= 71 (posición 125)**
- **fecha_entrega** = Fecha asignación de la tasa (posición 175)

Sesiones FIX

Para las sesiones FIX Drop Copy y Drop Copy Supervisor en los mensajes 35=AE, no habrá cambios.

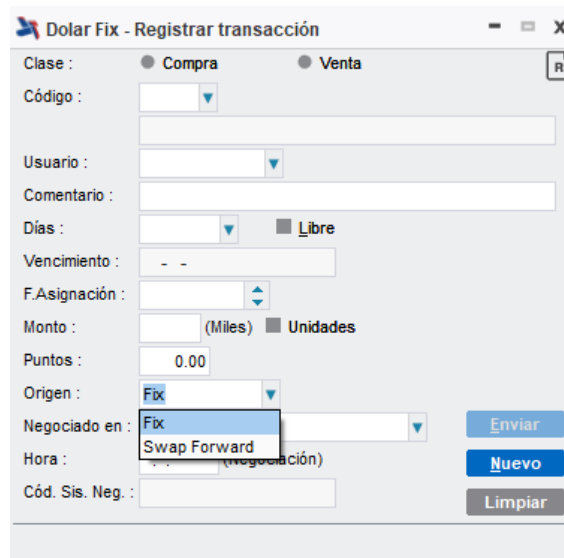
XML

No / Aplica

CAMPO ORIGEN EN OPERACIONES DE REGISTRO DÓLAR FIX Y REGISTROS DERIVADOS FIX.

Se incluye un nuevo campo de "Origen" en los registros FIX con contraparte IMC y Clientes, el cual incluye las opciones FIX y SWAP FORWARD.

Para los registros entre IMC:



Cambios en el DAPI

Nuevo Campo en el Dapi = texto_origen_add

Operaciones FIX, Origen:

X - Fix

F - Swap Forward

Para los Registros del mercado FIX entre IMC:

DAPI :

- **Tipo de Mensaje** "Orden_Transaccion"
- **clase_mensaje= "5"**
- **mercado="75"**
- **texto_origen_add= "X" – Fix, "F" - Swap Forward**

Archivo plano:

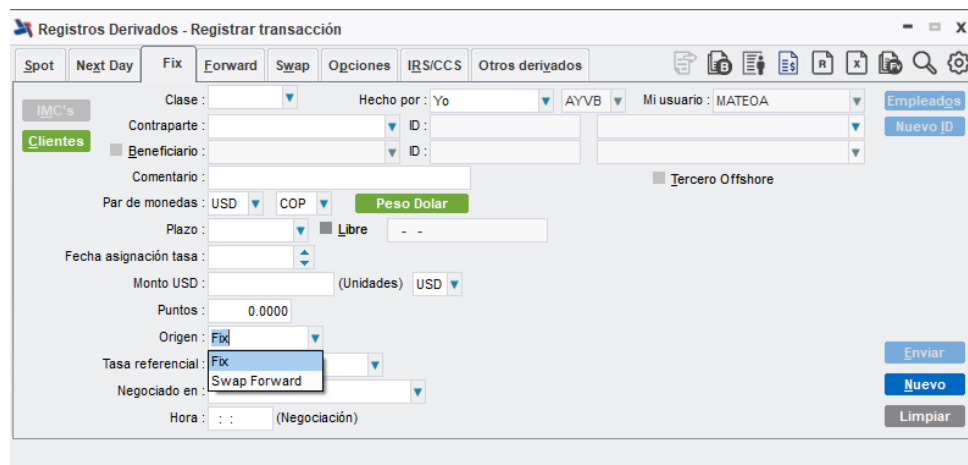
- **Clase mensaje= "5"** (posición 66)
- **mercado= "75"** (posición 125)
- **texto_origen_add= "X" – Fix "F" - Swap Forward** (posición 889)

Sesiones FIX Drop Copy y Drop Copy Supervisor

Para las sesiones FIX en los mensajes 35=AE se recibirán los siguientes valores para las operaciones FIX con origen

Protocolo FIX (Spot y Next Day)				
Drop Copy y Drop Copy Supervisor				
Mensaje	Campo	Tipo dato	Reqd	Valores
TradeCaptureReport(35=AE)	TrdSubType(829)	int		1) Aplica a Spot en transacciones que vienen de Dólar Fix 1001 = FIX converted 1012 = FIX Swap Forward converted (Nuevo) 2) Aplica a Spot en transacciones que vienen de Next Day 1000 = Next Day converted 1009 = Next Day Swap O/N converted (Nuevo) 1010 = Next Day Swap Forward converted (Nuevo) 1011 = Next Day Swap Future converted (Nuevo)

Registros FIX IMC-Clientes



DAPI

- **Tipo de Mensaje** "Orden_Transaccion"
- **clase_mensaje= "5"**

- `mercado="174"`
- `sub_mercado="x"`
- `texto_origen_add="X"` – Fix "F" - Swap Forward

Dolar Fix - Detalle de transacción

Fecha: 17/09/2024	Código: 03V0EDRO5R	Hora de registro: 16:45:58	Hora Neg.: 16:25:00
-------------------	--------------------	----------------------------	---------------------

Comprador	Sucursal	Persona
BANCO POPULAR S.A.	BOGOTA	David Roberto Cubides
Vendedor	Sucursal	Persona
SCOTIABANK COLPATRIA S.A.	BOGOTA	Natalia Duarte Giraldo

Monto US\$:	35'000,000.00		
Días :	1 Día	Jueves 19-Sep-2024	Origen : X2
Fecha asignación tasa :	Miércoles 18-Sep-2024		
Puntos :	1.00	Tasa Spot : 4530.00	Precio : 4531.00
Negociado en :	DIRECTO		
Código sis. neg. :			
Origen de transacción :	Registrado por DAVIDC		
Comentario :	PRUEBA COMENTARIO		

En DAPI se crea un nuevo tipo de mensaje con nombre “Comentario_Transaccion”.

DAPI :

Tipo de Mensaje “Comentario_Transaccion”

Bandera=“T”

comentario= “PRUEBA COMENTARIO”

```

.....usuario_postura_comentario : 04AA
.....mcod_postura_comentario : G0HDAO
.....codigo_postura_1 : 0398G0HDAP
.....usuario_postura_1_comentario : 0398
.....mcod_postura_1_comentario : G0HDAP
.....c_v : C
.....dias :
.....rentabilidad :
.....precio :
.....valor :
.....vencimiento :
.....bandera : T
.....comentario : PRUEBA COMENTARIO
.....fecha_transaccion : 20240917
.....primaryuser_transaccion : 03V0
.....mcod_transaccion : EDRO5R
.....bandera_publicar_comentario : S
.....codigo_institucion_postura : 001R
.....codigo_institucion_postura_1 : 000T
.....codigo_banco_postura :
.....codigo_banco_postura_1 :
.....codigo_externo :
.....sub_mercado :
.....bandera_broker_postura :

```

Archivo Plano

NO/ APLICA

AUMENTAR ESTADÍSTICA DE MONTO NEGOCIADO CON PRECIO FIX EN EL MERCADO SPOT

En la nueva versión 7.17 en la ventana Resumen de hoy, se permitirá ver el total de los montos negociados de las operaciones Spot que hacen parte del precio promedio FIX.



Por medio del DAPI y Sesiones FIX podrá capturar, así mismo en las interfaces se podrá capturar este valor.

DAPI

Mensaje= "Precios montos transados "

DAPI				
Mensaje	Campo nuevo	Formato	Pos desde 1	Valores
Precios_Montos_Transados	monto_t_fix	Número ascii 13,6	N/A	Campo NUEVO Monto negociado al promedio Fix del día (millones) Monto en unidades = monto_t_fix * 1'000000
Precios_Montos_Transados	precio_x_monto_t_fix	Número ascii 15,9	N/A	Campo NUEVO Promedio Fix (4 decimales) * Monto negociado Fix (miles)
Precios_Montos_Transados	precio_transacciones_fix_dia	Alfanumérico 1	N/A	S = Se incluye datos de Promedio Fix
Precios_Montos_Transados	precio_fix_dia	Número ascii con signo 4,4	N/A	Promedio Fix del día (cuatro decimales)
Precios_Montos_Transados	precio_promedio_calculos_dia	Número ascii con signo 4,6	N/A	Promedio Datatec del día (cuatro decimales)
Precios_Montos_Transados	monto_total_dia	Número ascii 13,6	N/A	Monto negociado al promedio Datatec del día (millones) Monto en unidades = monto_total_dia * 1'000000
Precios_Montos_Transados	precio_x_monto_total_dia	Número ascii 15,9	N/A	Promedio Datatec (4 decimales) * Monto negociado Datatec (miles)

Sesiones FIX

Protocolo FIX (Spot y Next Day)				
Drop Copy y Drop Copy Supervisor				
Mensaje	Campo	Tipo dato	Reqd	Valores
MarketDataSnapshotFullRefresh(35=W) MarketDataIncrementalRefresh(35=X)	MDEntrySize(271)	Qty		<p>Required when MDEntryType is 0 (Bid), 1 (Offer), 2 (Trade), B (Trade Volume) or n (Total number of today trades) Quantity or volume of the market data entry</p> <p>Notas: 1) Datos Promedio Fix: - MDEntryType (269)=W(Session Fixing Price) - MDEntryPx(270)=Price of the market data entry - MDEntrySize(271)=Qty of the market data entry (Nuevo dato) 2) Mensaje suscripción a Promedio Fix - Mensaje MarketDataRequest(35=V) - MDEntryType (269)=W(Session Fixing Price)</p>