



ACTUALIZACION SET-FX VERSIÓN 622
PRUEBAS DE MERCADO

Febrero de 2013

INDICE

1.	Objetivo del documento	3
2.	Alcance	3
3.	Consideraciones	3
4.	Prueba de Mercado Sábado 16 de Febrero	4
5.	Documentos adjuntos	5

1. Objetivo del documento

Dar a conocer a los usuarios del sistema y a las áreas de tecnología de nuestros afiliados, las instrucciones que garantizan el proceso de actualización del sistema SET-FX en su nueva versión 622. Lo anterior permitirá que la operación del mercado en el próximo día hábil transcurra de manera normal.

2. Alcance

Replicar un día normal de mercado, incluyendo las funcionalidades actuales y nuevas del sistema. Es muy importante que se lea cuidadosamente el presente documento y se realicen en su totalidad las verificaciones aquí especificadas en cada una de los equipos de usuario que participa y contiene la aplicación SET-FX.

3. Consideraciones

A continuación se especifican las consideraciones que se deben tener en cuenta para lograr una adecuada actualización de la versión 622 en el sistema SETFX:

1. Autorizar el ingreso de los Ingenieros de SET-ICAP FX a la entidad, en caso de ser necesario.

Diego Martin	CC 80.996.804
Jeann A. Ardila	CC 79.899.770
Henry Cruz	CC 80.852.270
Edher Saavedra	CC 91.070.389 de Medellín
Adolfo Balcazar	CC 16.712.014 de Cali

2. El día de la prueba, cada entidad debe garantizar la asistencia de por lo menos: Un usuario que administre los cupos del sistema SET-FX, otro que tenga el perfil negociador, un usuario encargado de registro de operaciones, una persona del back office que obtenga información del sistema y una persona del área de tecnología para el soporte y apoyo en todo el proceso.
3. Al momento de realizar estas pruebas, TODOS los equipos de los usuarios conectados que participarán en dichas pruebas, deben contar con la versión actualizada del sistema Set-FX, lo cual debió ser completada desde el día 15 de febrero cuando se dio inicio a dicho proceso.

4. Prueba de Mercado Sábado 16 de Febrero

A continuación se presenta el procedimiento que deben seguir los afiliados para confirmar el correcto funcionamiento del sistema SET-FX en su nueva versión 6.22:

Verificación de cupos. 9:30am a 10:00am. El usuario administrador de cupos deberá ingresar a la aplicación para verificar el estado de sus cupos con el resto de entidades, en todos los mercados disponibles.

Como lo que se pretende con estas pruebas es simular un día de mercado, la idea es que se ingrese por la persona responsable el valor de la TPC correspondiente, bien desde el mercado SPOT o desde el mercado Next Day

Ingreso a la aplicación. Es necesario, que sólo los equipos de los usuarios que van a participar en las pruebas del mercado ingresen a la aplicación, los demás equipos **no** deben estar conectados con el fin de evitar hacer un respaldo innecesario de dichas estructuras.

Ingreso de posturas, realización de transacciones y anulaciones. A partir de la 10:00a.m. y hasta la 11:00am Los usuarios deben realizar operaciones en el sistema por tabla y por registro en todos los mercados disponibles (**Spot, Next Day, Forward, Swaps, Sector real, Registro de divisas**), confirmar registros, de la misma forma realizar algunas anulaciones. Para las anulaciones es importante tener en cuenta que en el mercado Spot sólo se pueden hacer a través de la Cámara de Compensación (cuando ya han sido enviadas a CCD). Durante este periodo es importante que las entidades revisen si sus cupos se han afectado correctamente y que todas las estaciones están viendo la misma información.

Nuevas funcionalidades. La nueva versión 6.22 contiene nuevas funcionalidades que deben ser probadas por los usuarios del sistema, entre las más importantes se destacan:

- ✓ Perfil Broker (las operaciones realizadas a través del sistema de Brokerage de voz serán ingresadas al sistema a través del Broker).
- ✓ Identificación del origen de las operaciones Spot
- ✓ Ajuste a la obligatoriedad de digitar hora de negociación (solicitud AMV)
- ✓ Funcionalidad “Stop Loss”
- ✓ Ajustes para hacer más completo el registro de operaciones Interest Rate Swap y Cross Currency Swap

Cierre de Mercado. A las 11:00am. Se cerrarán todos los mercados.

Revisiones Back Office y Riesgos. Entre las 11:00 a.m. y la 11:30a.m. Las áreas de Back office y Riesgos realizaran un proceso de verificación de reportes e informes del sistema para validar si a información es coherente y real.

Cierre pruebas. A partir de la 12:00m las entidades deberán enviar por correo la confirmación de que las pruebas fueron correctas anexando el Check List diligenciado. dmartin@set-icap.co

Cualquier anomalía percibida por los usuarios debe ser comunicada inmediatamente al administrador del sistema.

5. Documentos adjuntos

Check List de Prueba de mercado: El cual es enviado con la presente documentación