



**Sistema Electrónico de Transacciones
e Información del Mercado de Divisas
SET-FX**

Manual de cambios versión 6.40

Julio de 2016

Ajustes a nivel de interfaces DPI, XML y archivos Planos

Contenido

Introducción.....	4
1.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX - Registrar operación con Fecha y hora anterior:	5
1.2. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX Detalle del registro en el sistema:	5
1.3. Cambios en la interfaz DAPI:	5
1.4. Cambios en el archivo plano:	7
1.5. Cambios en el archivo XML: No aplica para operaciones enviadas por este mecanismo	7
2. Aumentar longitud de campo “Comentario” de 15 a 30 caracteres.....	7
2.1. Cambios en el aplicativo SET-FX:.....	8
2.2. Cambios en la interfaz DAPI	8
2.3. Cambios en el archivo plano:	8
2.4. Cambios en el archivo XML:	9
3. Aumentar el calendario CO para operaciones de registro CCS (Cross Currency Swaps)	9
3.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	9
3.2. Cambios en la interfaz DAPI:	9
3.3. Cambios en el archivo plano:	11
3.4. Cambios en el archivo XML:	11
4. En el mercado Registros de Divisas (174), ahora el campo “Negociado en” será obligatorio.....	11
4.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	11
4.2. Cambios en la interfaz Dapi	12
4.3. Cambios en el plano:	12
4.4. Cambios en el archivo XML:	12
5. Para los mercados Forward interbancario (74) y Registro de divisas Forward (174) sub_mercado (F) y (f) ahora se podrá realizar operaciones en plazo T+0	13
5.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	13
5.2. Cambios en la interfaz Dapi	14
5.3. Cambios en el plano:	14
5.4. Cambios en el archivo XML:	15
6. Nuevo campo Tasa Pool y campo informativo Tercero Offshore	16
6.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	16

6.2.	Cambios en la interfaz Dapi:	17
6.3.	Cambios en el plano:	17
6.4.	Cambios en el archivo XML:	18
7.	Permitir tasas fijas y tasa variable negativa en registro de operaciones IRS/CCS (174) submercados (I,i)	18
7.1.	Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	18
7.2.	Cambios en la interfaz Dapi:.....	18
7.3.	Cambios en el plano:	19
7.4.	Cambios en el archivo XML:	19
8.	Aumentar a doce (12) enteros y dos (2) decimales el campo monto en operaciones de registro derivados (174)	20
8.1.	Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	20
8.2.	Cambios en la interfaz Dapi:.....	20
8.3.	Cambios en la interfaz Dapi:.....	20
8.4.	Cambios en el archivo XML:	21
9.	Cambios en mercados FIX	21
9.1.	Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:	21
9.1.2.	Cambios en la interfaz Dapi:.....	21
9.1.3.	Cambios en el archivo plano:	21
9.2.1.	Cambios en la interfaz Dapi:.....	22
9.2.2.	Cambios en el archivo plano:	22
9.2.3.	Cambios en el archivo XML:	23

Introducción

El propósito de este documento es informar a las entidades y sus áreas tecnológicas, los ajustes necesarios que deben realizar en sus interfaces internas (Dapi, Plano, XML) para procesar los nuevos ajustes y/o funcionalidades que sobre el sistema SET-FX ha sido solicitados.

Para SET-ICAP FX es muy importante asegurar que sus clientes cuenten con información veraz, completa y confiable, razón por la cual, disponemos de todo un equipo de profesionales y un ambiente de prueba con el cual podrán interactuar para resolver inquietudes y realizar las pruebas correspondientes.

A continuación, se describe cada uno de las nuevas funcionalidades, los cambios y ajusten que podrían impactar sus desarrollos actuales:

1. Permitir registrar operaciones del día anterior después de los primeros quince (15) minutos de apertura del mercado.

Para todos los mercados se permite registrar operaciones negociados el día hábil inmediatamente anterior quince (15) minutos después de la apertura del horario del respectivo mercado. Se permitirá registrar operaciones que fueron negociadas el día hábil anterior y las cuales no pudieron se registradas ese mismo día.

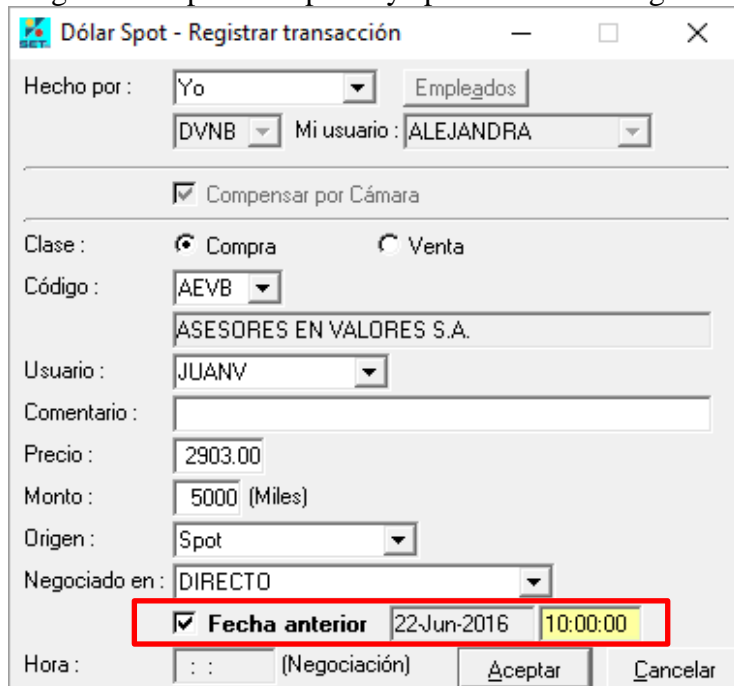
Para lo anterior, será posible que durante los primeros quince (15) minutos de apertura del mercado requerido se ingrese la fecha día anterior y hora día anterior. Pasado este tiempo no se permitirá.

Tenga en cuenta los horarios actuales del sistema para cada mercado:

# Mercado	Nombre Mercado	Apertura	Permitir registros día anterior hasta:
71	SPOT	8:00	8:15
76	NEXT DAY	8:00	8:15
74	FORWARD	7:00	7:15
77	SWAP	8:00	8:15
174	REG. DIVISAS	7:00	7:15

1.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX - Registrar operación con Fecha y hora anterior:

En el aplicativo SET-FX el usuario podrá ingresar un registro indicando que este fue negociado el día anterior. En la siguiente gráfica una vez seleccionado el checkbox se habilitarán los campos “Fecha Anterior” y “Hora” los cuales deberán ser diligenciados para completar y poder enviar el registro.



Dólar Spot - Registrar transacción

Hecho por : Yo

DVNB

☒ Compensar por Cámara

Clase : ☒ Compra ☐ Venta

Código : AEVB

ASESORES EN VALORES S.A.

Usuario : JUANV

Comentario :

Precio : 2903.00

Monto : 5000 (Miles)

Origen : Spot

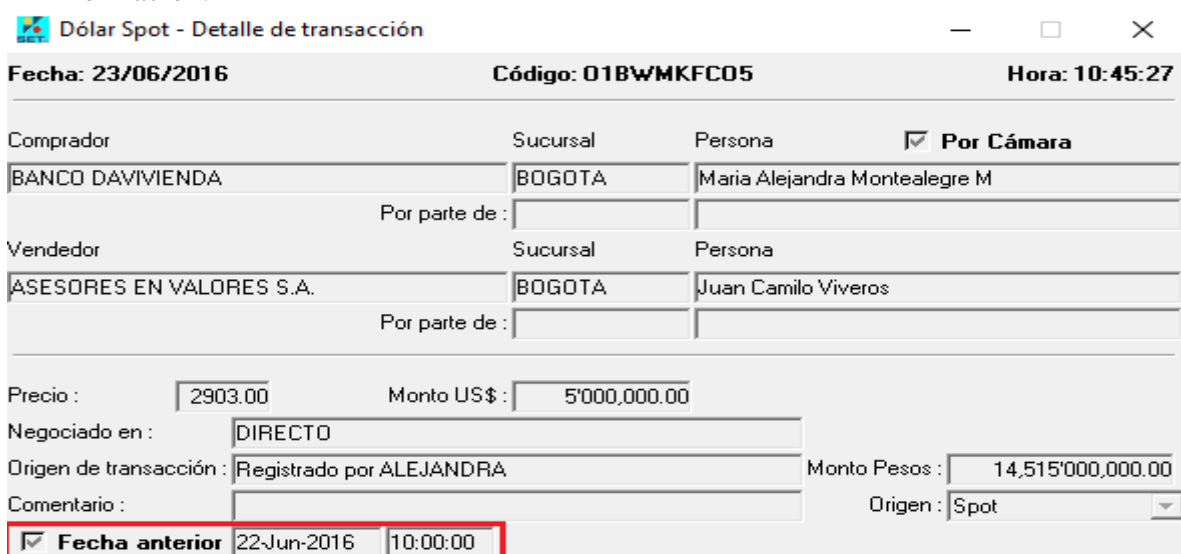
Negociado en : DIRECTO

☒ Fecha anterior 22-Jun-2016 10:00:00

Hora : : : (Negociación)

1.2. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX Detalle del registro en el sistema:

Una vez el registro se encuentre en el sistema SET-FX, se podrá revisar e identificar si este fue un registro de un día anterior, para ello desde el blotter de operaciones y haciendo clic derecho “Detalle” sobre la operación se obtiene la siguiente información:



Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 23/06/2016 Código: 01BWMKFC05 Hora: 10:45:27

Comprador	Sucursal	Persona	<input checked="" type="checkbox"/> Por Cámara
BANCO DAVIVIENDA	BOGOTA	Maria Alejandra Montealegre M	
Por parte de :			
Vendedor	Sucursal	Persona	
ASESORES EN VALORES S.A.	BOGOTA	Juan Camilo Viveros	
Por parte de :			

Precio : 2903.00 Monto US\$: 5'000,000.00

Negociado en : DIRECTO

Origen de transacción : Registrado por ALEJANDRA Monto Pesos : 14,515'000,000.00

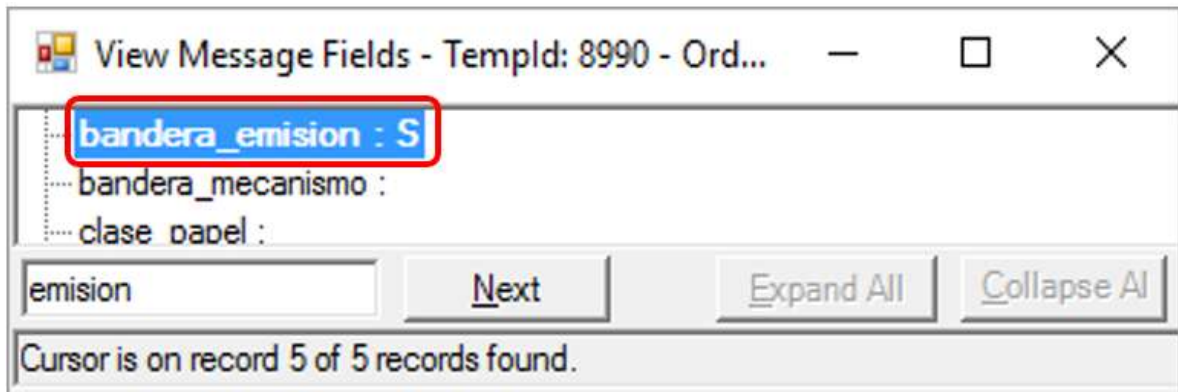
Comentario :

☒ Fecha anterior 22-Jun-2016 10:00:00

Origen : Spot

1.3. Cambios en la interfaz DAPI:

Para identificar si una operación tiene la característica de fecha anterior, será necesario leer el campo “**bandera_emision**”, este campo tiene 2 valores, “Empty” o



View Message Fields - Templd: 8990 - Ord...

bandera_emision : S

bandera_mecanismo :

clase papel :

emision

Next

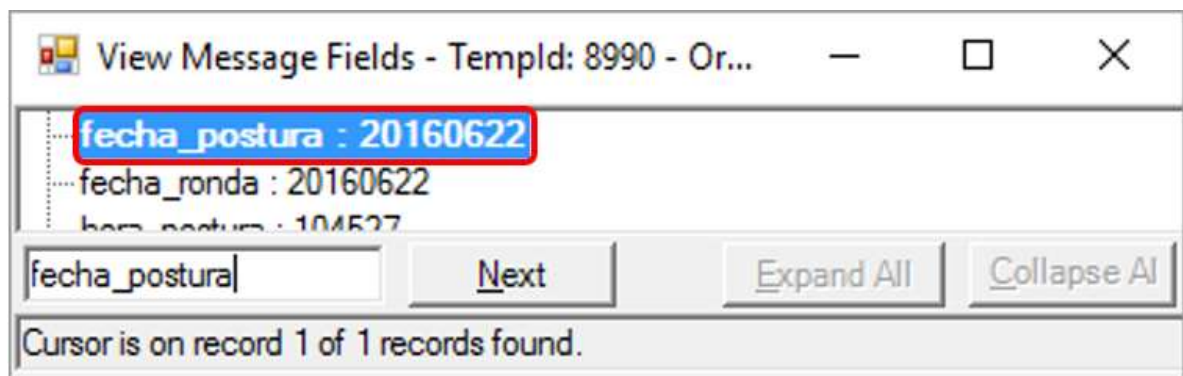
Expand All

Collapse All

Cursor is on record 5 of 5 records found.

“S”.

Si campo **bandera_emision** es “S”, entonces para identificar la **fecha día Anterior**, se debe leer el campo “**fecha_postura**”



View Message Fields - Templd: 8990 - Or...

fecha_postura : 20160622

fecha_ronda : 20160622

hora_postura : 104527

fecha_postura

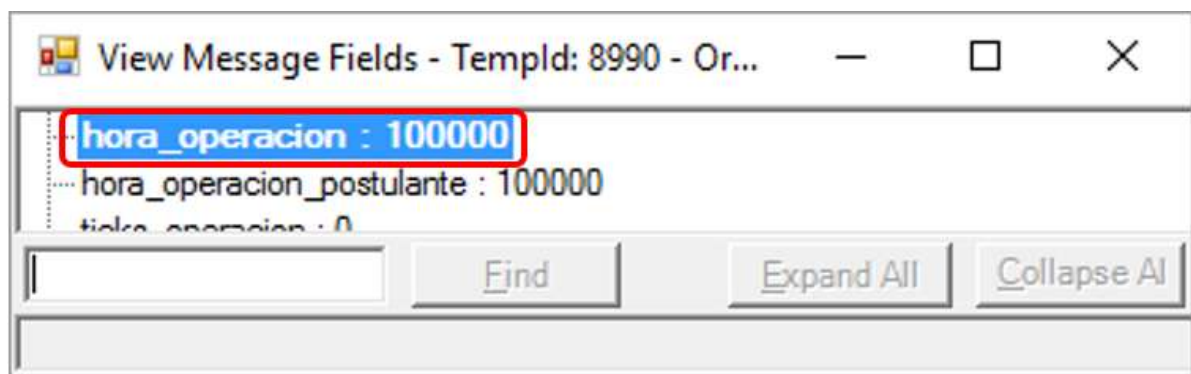
Next

Expand All

Collapse All

Cursor is on record 1 of 1 records found.

Y la **hora del día anterior** en el campo “**hora_operacion**”



View Message Fields - Templd: 8990 - Or...

hora_operacion : 100000

hora_operacion_postulante : 100000

ticks_operacion : 0

Find

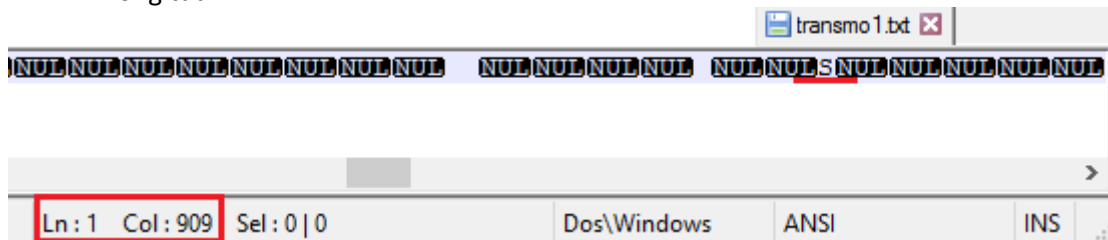
Expand All

Collapse All

1.4. Cambios en el archivo plano:

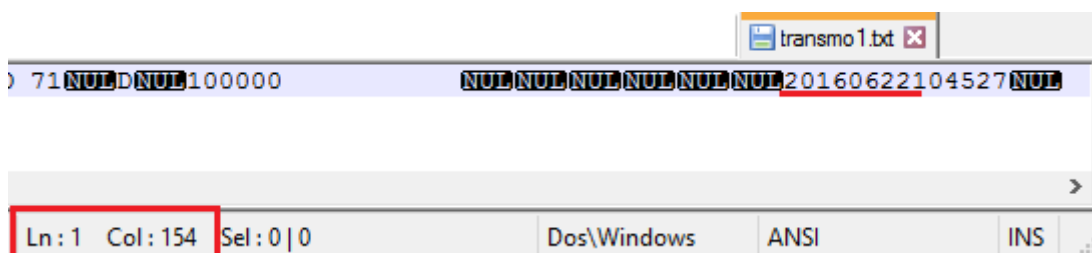
Para identificar si una operación tiene la característica de **fecha anterior**, será necesario leer el campo “**bandera_emisión**”, este campo tiene 2 valores, “Empty” o “S”:

- Nombre del Campo: bandera_emision
- Tipo dato: Alfabético
- Posición: 909
- Longitud: 1



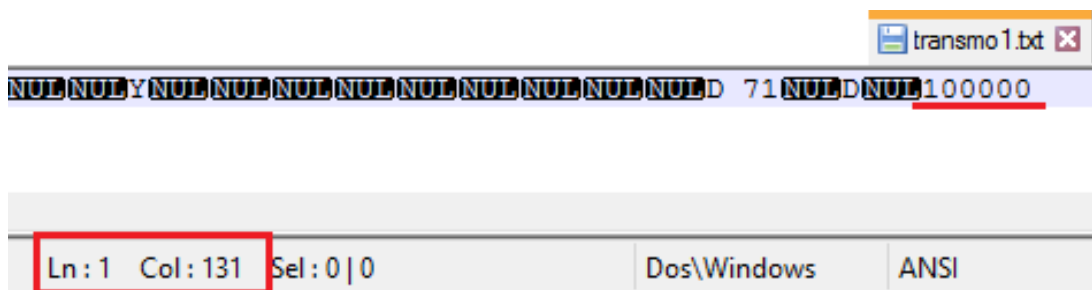
Si campo es “S”, entonces para identificar la **fecha día Anterior**, se debe leer el campo “**fecha_ronda**”

- Nombre del Campo: fecha_ronda
- Tipo dato: Fecha
- Posición: 154
- Longitud: 8



Y la **hora del día anterior** en el campo “**hora_operacion Postulante**”

- Nombre del campo: hora_operacion_postulante
- Tipo dato: Hora
- Posición: 131
- Longitud: 6



1.5. Cambios en el archivo XML: No aplica para operaciones enviadas por este mecanismo

2. Aumentar longitud de campo “Comentario” de 15 a 30 caracteres

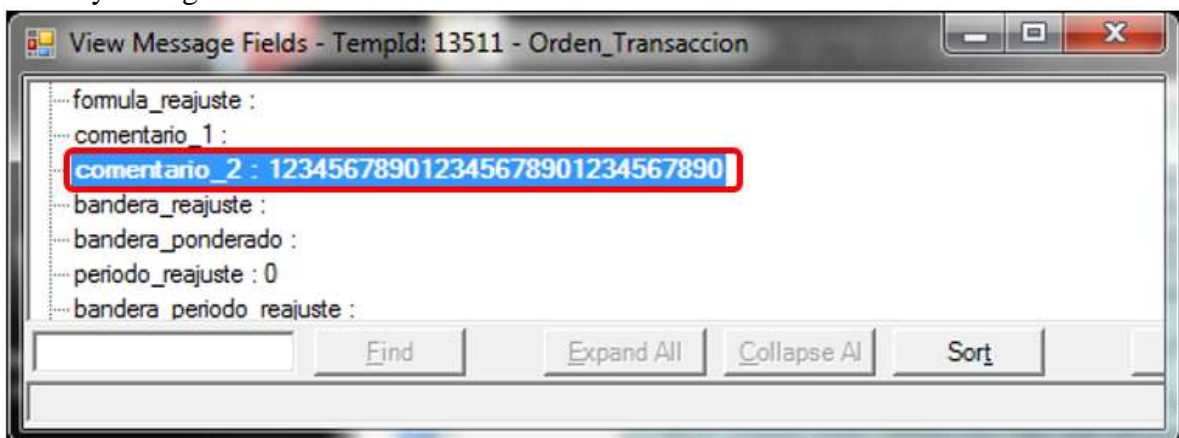
2.1. Cambios en el aplicativo SET-FX:

En el aplicativo SET-FX el usuario podrá ingresar un mayor número de caracteres alfanuméricos con el fin de incluir sus comentarios con mayor especificidad



2.2. Cambios en la interfaz DAPI

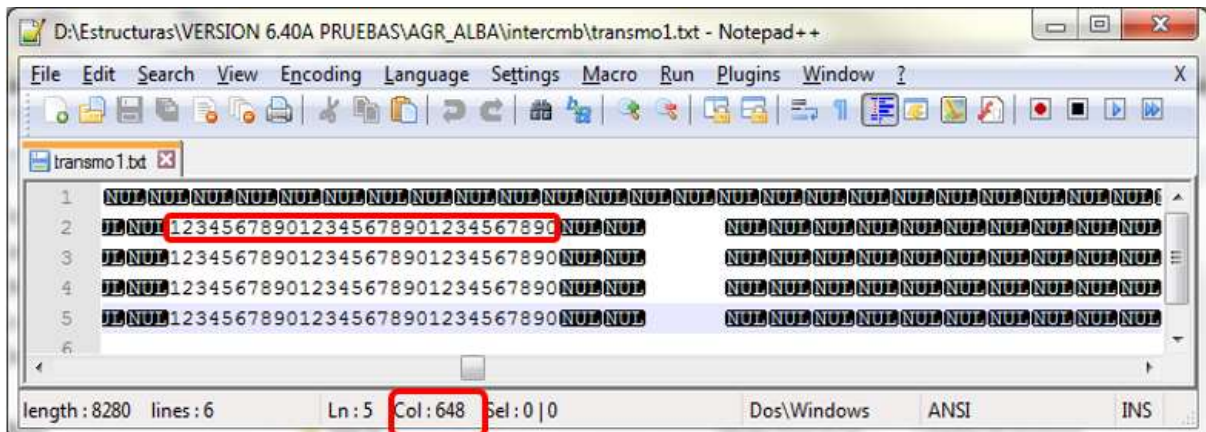
Para identificar el comentario ingresado por el usuario será necesario leer el campo “comentario_2”, el mismo que actualmente es usado por el sistema pero ahora con mayor longitud.



2.3. Cambios en el archivo plano:

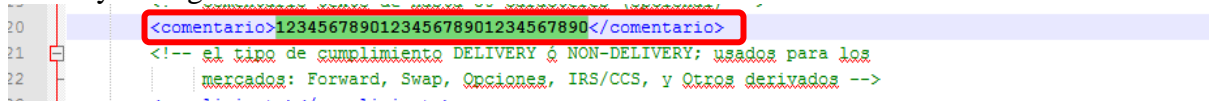
Para identificar el comentario ingresado por el usuario será necesario leer el campo “comentario_2”, el mismo que actualmente es usado por el sistema pero ahora con mayor longitud.

- Nombre del campo: comentario_2
- Tipo dato: alfanumérico
- Posición: 648
- Longitud: 30



2.4. Cambios en el archivo XML:

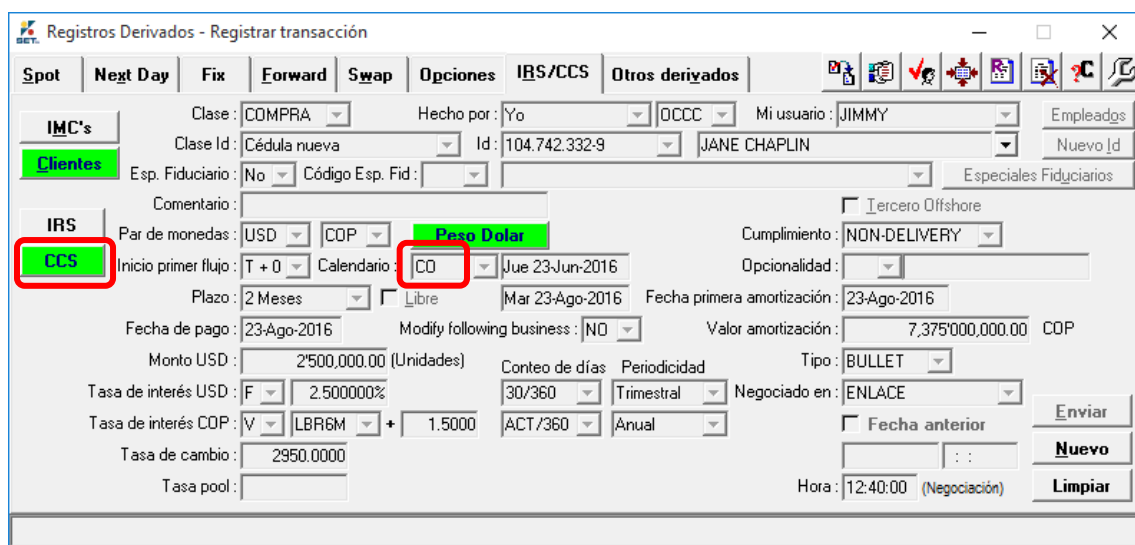
Para identificar el comentario ingresado por el usuario será necesario leer el TAG “comentario”, el mismo que actualmente es usado por el sistema pero ahora con mayor longitud.



3. Aumentar el calendario CO para operaciones de registro CCS (Cross Currency Swaps)

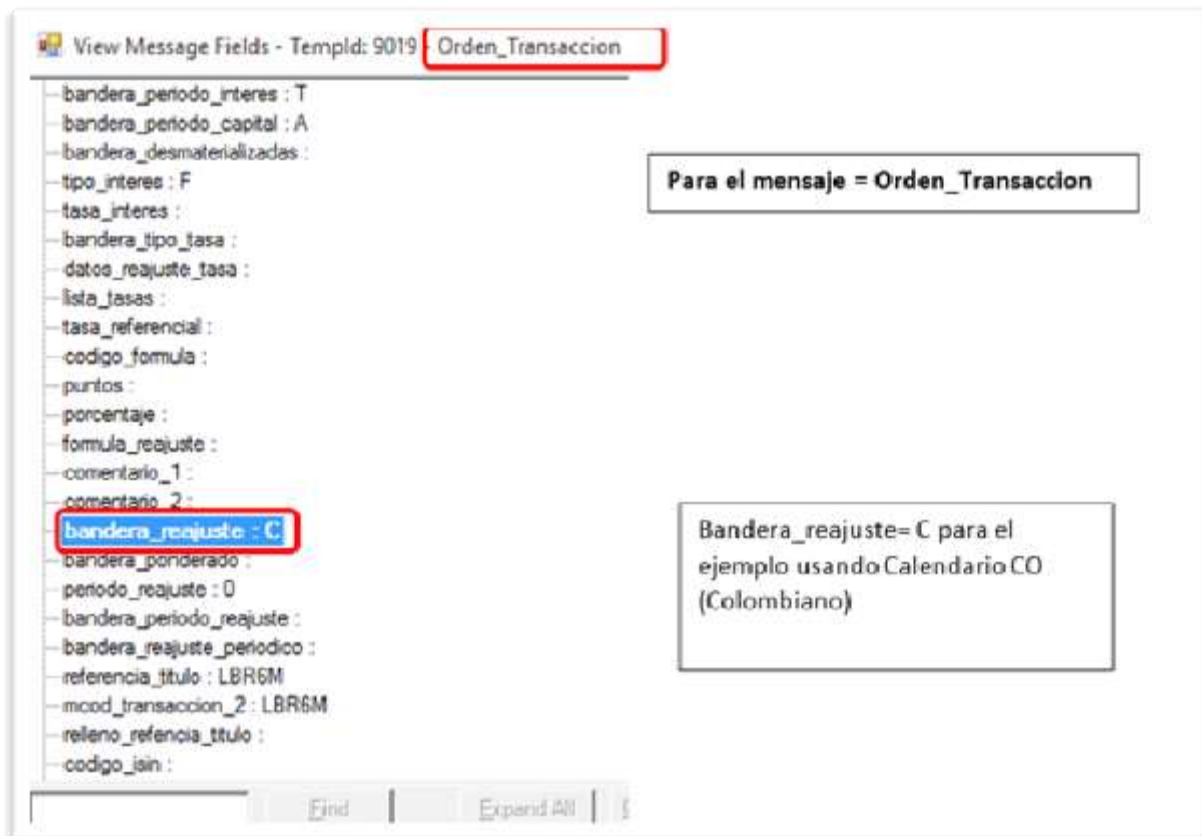
3.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

Las operaciones de registro “CCS” ahora tendrán la opción de seleccionar el calendario CO (Colombiano) además del calendario CO-NY (Colombia y USA), esto aplica para operaciones de registro entre IMC’s y entre un IMC’s y un cliente.



3.2. Cambios en la interfaz DAPI:

Para identificar el calendario ingresado por el usuario será necesario leer el campo “Bandera_reajuste”, el mismo que actualmente es usado por el sistema pero ahora con un nuevo estado para identificar dicho calendario **“C” = Calendario CO.**



View Message Fields - Templd: 9019 : Orden_Transaccion

- bandera_periodo_interes : T
- bandera_periodo_capital : A
- bandera_desmaterializadas :
- tipo_interes : F
- tasa_interes :
- bandera_tipo_tasa :
- datos_reajuste_tasa :
- lista_tasas :
- tasa_referencial :
- codigo_formula :
- puntos :
- porcentaje :
- formula_reajuste :
- comentario_1 :
- comentario_2 :
- bandera_reajuste : C**
- bandera_ponderado :
- periodo_reajuste : 0
- bandera_periodo_reajuste :
- bandera_reajuste_periodico :
- referencia_titulo : LBR6M
- mood_transaccion_2 : LBR6M
- relleno_referencia_titulo :
- codigo_isin :

Para el mensaje = Orden_Transaccion

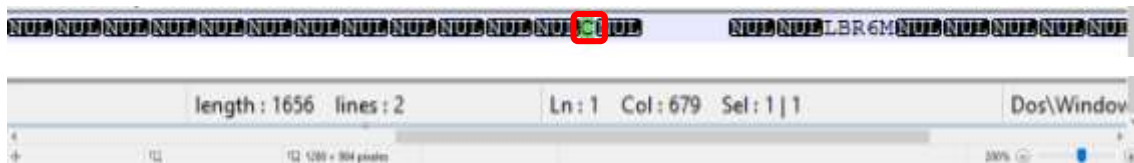
Bandera_reajuste= C para el ejemplo usando Calendario CO (Colombiano)

Find | Expand All

3.3. Cambios en el archivo plano:

Para identificar el calendario ingresado por el usuario será necesario leer el campo “Bandera_reajuste”, el mismo que actualmente es usado por el sistema pero ahora con un nuevo estado para identificar dicho calendario **“C” = Calendario CO.**

- Nombre del campo: Bandera_reajuste
- Tipo dato: alfanumerico
- Posición: 678
- Longitud: 1



3.4. Cambios en el archivo XML:

Para el importar operaciones a través del archivo XML e identificar el calendario, este se deberá incluir usando el siguiente TAG

<!-- Calendario contiene dos valores: CO y CO-NY usado para cálculo de feriados en fechas, por default presenta CO, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS -->
<calendario>CO</calendario>




4. En el mercado Registros de Divisas (174), ahora el campo “Negociado en” será obligatorio

4.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

El campo “Negociado en” ahora es obligatorio en todos los mercados

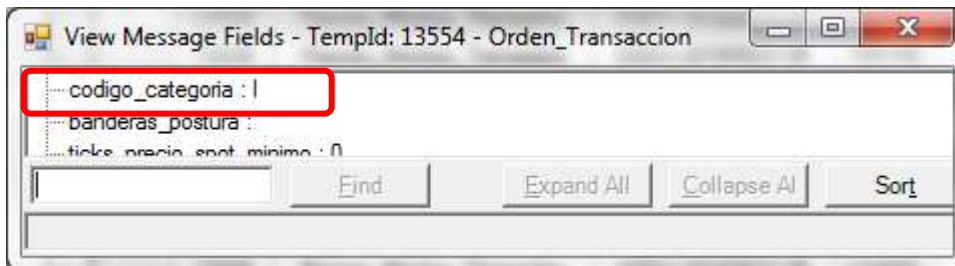


Una vez ingresado el sistema de negociación en dicho campo, el botón **Enviar** se habilitará como se muestra a continuación:



4.2. Cambios en la interfaz Dapi

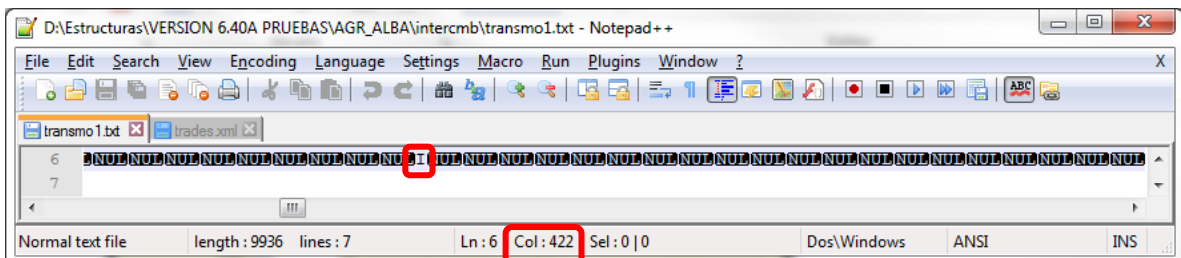
Tal como funciona hoy en día, para identificar el sistema de negociación de la operación de registro, se deberá seguir leyendo el campo “codigo_categoria”.



4.3. Cambios en el plano:

Al igual que la interfaz Dapi, el campo “codigo_categoria” se debe seguir leyendo para identificar el sistema en el cual la operación de registro fue negociado.

- Nombre del campo: codigo_categoria
- Tipo dato: alfanumerico
- Posición: 422
- Longitud: 1



4.4. Cambios en el archivo XML:

Para el importar operaciones a través del archivo XML e identificar el sistema de negociación en el cual la operación de registro fue negociada, se seguirá usando el TAG <sisistema_negociacion>I<sisistema_negociacion>

```

140 <!-- USUARIO USUARIO --> <!-- USUARIO QUE AUTORIZA EL SISTEMA DE NEGOCIACION AUTORIZADO EN EL SISTEMA -->
141 <!-- USUARIO --> <!-- USUARIO QUE AUTORIZA EL SISTEMA DE NEGOCIACION AUTORIZADO EN EL SISTEMA -->
142 <!-- S si se registra con Tercero Offshore -->
143 <!-- Tasa Pool con el formato de precio para el caso de IRS_CCS línea formato "990.0000" si se registra con Tercero Offshore -->
144 <!-- Tasa Pool -->
145 </transaccion>

```

Negociado en:	ICAPCO
Origen de transacción:	Registrado por ALBA
Comentario:	123456789012345678901234567890

5. Para los mercados Forward interbancario (74) y Registro de divisas Forward (174) sub_mercado (F) y (f) ahora se podrá realizar operaciones en plazo T+0

5.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

Desde el aplicativo de los usuarios se habilitará poder ingresar registros en plazo T+0 (hoy)

Registros Derivados - Registrar transacción

Spot	Next Day	Fix	Forward	Swap	Opciones	IRS/CCS	Otros derivados
<div> <div>IMC's</div> <div>Cientes</div> </div>							
Clase: COMPRA		Hecho por: Yo		OCCC		Mi usuario: JIMMY	
Clase Id: Cédula nueva		Id: 1.047.423.329		JANE CHAPLIN		Nuevo Id	
Esp. Fiduciario: No		Código Esp. Fid:				Especiales Fiduciarios	
Comentario:							
<input type="checkbox"/> Tercero Offshore							
Par de monedas: USD		COP		Peso Dolar			
Origen:							
Plazo: 0		<input checked="" type="checkbox"/> Libre Jueves 23-Jun-2016					
Fecha de pago: 23-Jun-2016		Tasa referencial: MANUAL					
Monto USD: 2'500.000.00 (Unidades)		Cumplimiento: NON- DELIVERY					
<input type="checkbox"/> Puntos forward: 10.0000		Opcionalidad: NO					
Tasa forward: 2900.0000		Negociado en: BLOOMBERG					
Tasa spot: 2890.0000		Tasa pool:		<input type="checkbox"/> Fecha anterior : :			
Hora: 11:30:00 (Negociación)							
<div> <div>Enviar</div> <div>Nuevo</div> <div>Limpiar</div> </div>							

5.2. Cambios en la interfaz Dapi

En el Dapi se seguirán utilizando los campos actuales pero ahora en este se podrá leer que dicha operación viene con un plazo T+0

View Message Fields - Templd: 9006 - Orden_Transaccion

```

...datos_postura : 174fD
...datos_generales_postura : 174fD
...mercado : 174
...sub_mercado : f
...o_d : D
...bandera_via_procesamiento :
...hora_operacion :
...hora_operacion_postulante :
...ticks_operacion : 0
...hora_para_titular :
...fecha_postura : 20160623
...fecha_ronda : 20160623
...hora_postura : 115328
...total_postura :
...fecha_valor : 0
...fecha_entrega :
...dias : 0
...xdias : 0
...fecha_vencimiento_xdias : 20160623
...nivel : 1
...texto_term : 0/0
...bandera_fisico_compensacion :
...bandera_estandar_libre : L
...identificador_grupo_posturas :
  
```

Find Expand All

Selected 4 records.

Para el mensaje =
Orden_Transaccion

Fecha_valor = 0 para el ejemplo

días= 0 para el ejemplo

Xdias = 0 para el

Fecha_vencimiento_xdias =
20160623 para el ejemplo

co para los registros T+0

- Nombre del campo: **dias**
- Tipo dato: alfanumérico, llega en Blanco para los registros T+0
- Posición: 183
- Longitud: 6
- Nombre del campo: **Xdias**
- Tipo dato: alfanumérico, llega en Blanco para los registros T+0
- Posición: 189
- Longitud: 6
- Nombre del campo: **Fecha_vencimiento_xdias**
- Tipo dato: alfanumérico, llega en Blanco para los registros T+0
- Posición: 195
- Longitud: 8

2016062310/0

length: 1656 lines: 2 Ln: 1 Col: 195 Sel: 0 | 0 Dos\Windows

5.4. Cambios en el archivo XML:

Se va a permitir de igual manera, poder subir desde el archivo XML operaciones de registro con plazo T+0 de cumplimiento, para esto, se seguirán utilizando los campos actuales:

Será necesario ingresar los siguientes TAG para una operación T+0:

<!-- Fecha de fin de un contrato en formato YYYY-MM-DD indispensable para los mercados, forward, swap, opciones, irs/ccs y otros -->

<fecha_fin_contrato>2016-06-23</fecha_fin_contrato>

<!-- Fecha de Pago de un contrato en formato YYYY-MM-DD indispensable para los mercados, forward, swap, opciones, irs/ccs y otros derivados, esta fecha debe Ser mayor o igual a fecha fecha_fin_contrato -->

<fecha_pago>2016-06-23</fecha_pago>

Plazo:	0	Días	23-Jun-2016	Tasa referencial:	OTRA
Fecha de pago:	23-Jun-2016			Cumplimiento:	DELIVERY
Tasa de interés USD:	F	-3.500000%	ACT/360	Mensual	
Tasa de interés COP:	V	FED	30/360	Mensual	


6. Nuevo campo Tasa Pool y campo informativo Tercero Offshore

- Tasa Pool: este es un campo informativo cuyo valor no genera ningún cálculo o modificaciones a las operaciones. Algunas entidades lo requieren para propósitos internos. Dicha tasa se habilita para los mercados de registro de derivados (174) sub_mercados forward, swap, opciones e IRS (F,f, W,w, O, o, I,i).
- Tercero offshore: Este es un campo informativo, el cual permitirá a los usuarios indicar que la operación de registro tendrá como destinatario final una entidad de exterior de la cual aún no se conoce el nombre.

Nota: Estos campos no son obligatorios

6.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

En el aplicativo SET-FX de usuario al momento de realizar el registro, sin que sea obligatorio el usuario podrá ingresar el valor de la “Tasa pool” y/o seleccionar el checkbox para indicar que dicha operación de registro será con un cliente del exterior.

 Registros Derivados - Detalle de transacción

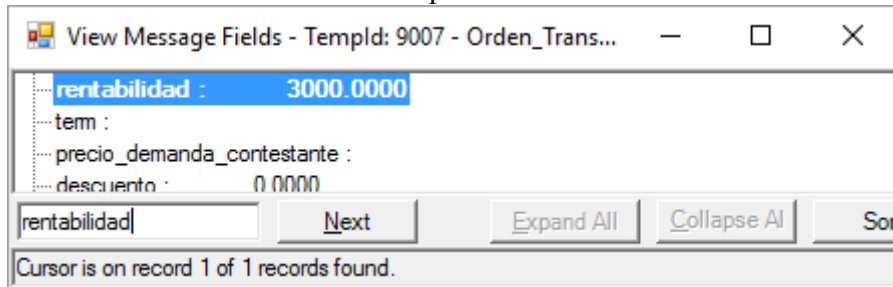
Fecha: 23/06/2016 Código: 01BWMKFC07 Hora de registro: 13:19:14 Hora: 13:00:00

Comprador - Nombre comitente	Clase Id	Identificación
JAIME DE LA TORRE MATAMOROS	Cédula	00.079.829
Por parte de:		
Vendedor	Sucursal	Persona
BANCO DAVIVIENDA	BOGOTA	Maria Alejandra Montealegre M
Por parte de:		

Par de monedas:	USD / COP	<input checked="" type="checkbox"/> Tercero Offshore
Plazo:	2 Meses	25-Ago-2016
Fecha de pago:	26-Ago-2016	Tasa referencial:
Monto:	50,000.00	Cumplimiento:
Puntos forward:	3.5600	Opcionalidad:
Tasa forward:	2903.5600	Origen:
Tasa spot:	2900.0000	SEF Proofed:
Tasa pool:	3000.0000	SEFable:
Negociado en:	DIRECTO	
Origen de transacción:	Registrado por ALEJANDRA	
Comentario:		
Estado CRCC:		
<input type="checkbox"/> Fecha anterior		

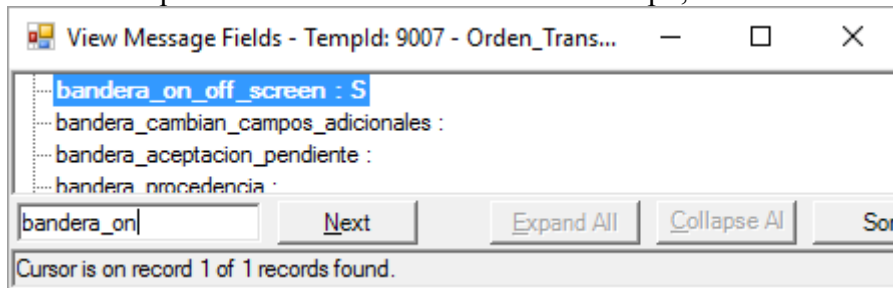
6.2. Cambios en la interfaz Dapi:

Una vez el usuario ha ingresado el valor de la “**Tasa pool**”, en el dapi podrá identificarse a través del campo “**rentabilidad**”



The screenshot shows a window titled "View Message Fields - Templd: 9007 - Orden_Trans...". It displays a list of fields: "rentabilidad : 3000.0000", "tem : ", "precio_demanda_contestante : ", and "descuento : 0.0000". Below the list are buttons for "rentabilidad", "Next", "Expand All", "Collapse All", and "Sort". A status bar at the bottom indicates "Cursor is on record 1 of 1 records found."

Una vez el usuario ha seleccionado el checkbox “tercero offshore”, el valor podrá identificarse a través del campo “**bandera_on_off_screen**” con valor “S” que indica que “SI” se ha seleccionado dicho campo, de lo contrario vendrá “Empty”



The screenshot shows a window titled "View Message Fields - Templd: 9007 - Orden_Trans...". It displays a list of fields: "bandera_on_off_screen : S", "bandera_cambian_campos_adicionales : ", "bandera_aceptacion_pendiente : ", and "bandera_precedencia : ". Below the list are buttons for "bandera_on", "Next", "Expand All", "Collapse All", and "Sort". A status bar at the bottom indicates "Cursor is on record 1 of 1 records found."

6.3. Cambios en el plano:

Para el campo “tasa pool” los valores ingresados se podrán encontrar en el campo “**rentabilidad**”:

- Nombre del campo: rentabilidad
- tipo dato: Alfabético
- posición: 952
- longitud: 18



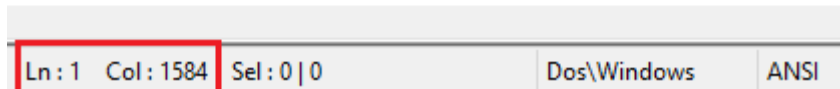
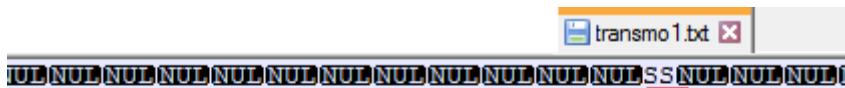
transmo1.txt			
0.0000	3000.0000	0.0000	0.0000



Ln: 1	Col: 952	Sel: 0 0	Dos\Windows	ANSI
-------	----------	------------	-------------	------

Para el campo seleccionado con el checkbox que indica operación con un cliente del exterior, se podrá encontrar en el campo “**bandera_on_off_screen**”

- Nombre del campo: bandera_on_off_screen
- Tipo dato: Alfabético
- Posición: 1584
- Longitud: 1



6.4. Cambios en el archivo XML:

Se va a permitir de igual manera, poder subir desde el archivo XML operaciones de registro con el valor del campo “Tasa pool” y “Tercero offshore”, para esto será necesario utilizar los siguientes TAG’s:

<!-- **Tasa Pool** con el formato de precio para el caso de IRS_CCS tiene formato "990.0000" si es registro con Tercero OffShore -->

<tasa_pool>320.0000</tasa_pool>

y

<!-- S si es registro con **Tercero OffShore** -->

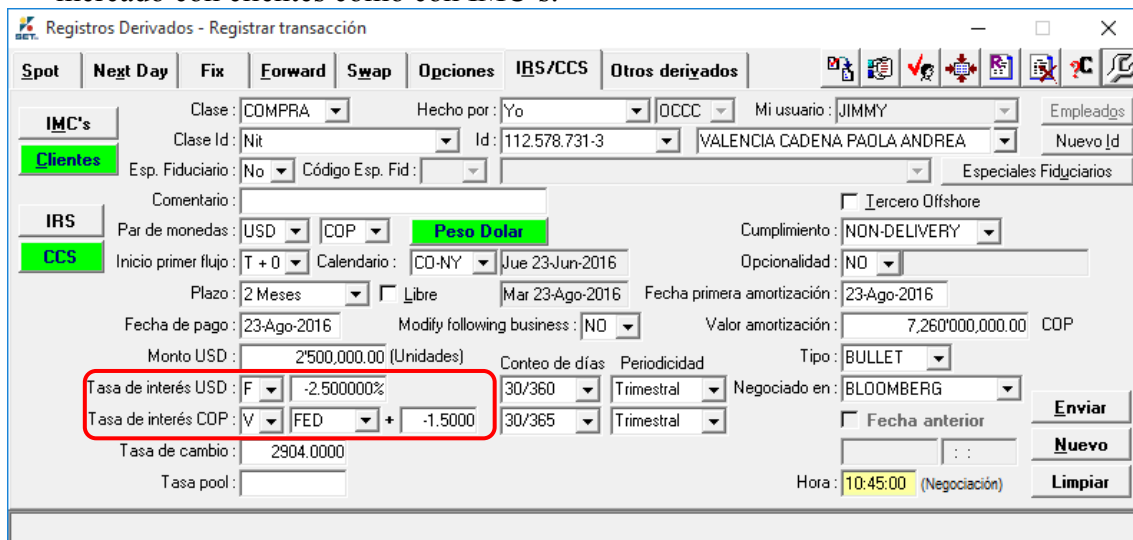
<bandera_tercer_offshore>S</bandera_tercer_offshore>

Es un campo NO obligatorio.

7. Permitir tasas fijas y tasa variable negativa en registro de operaciones IRS/CCS (174) submercados (I,i)

7.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

Se permitirá el ingreso tasas Fijas o Variables con signo negativo esto aplica para el mercado con clientes como con IMC’s.



Registros Derivados - Registrar transacción

Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados

IMC's Clase: COMPRA Hecho por: Yo OCCC Mi usuario: JIMMY Empleados

Clase Id: Nit Id: 112.578.731-3 VALENCIA CADENA PAOLA ANDREA Nuevo Id

Cientes Esp. Fiduciario: No Código Esp. Fid: Especiales Fiduciarios

Comentario:

IRS Par de monedas: USD COP **Peso Dolar** Tercero Offshore

CCS Inicio primer flujo: T + 0 Calendario: CO-NY Jue 23-Jun-2016 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Plazo: 2 Meses Libre Mar 23-Ago-2016 Fecha primera amortización: 23-Ago-2016 Opcionalidad: NO

Fecha de pago: 23-Ago-2016 Modify following business: NO Valor amortización: 7,260'000,000.00 COP

Monto USD: 2'500,000.00 (Unidades) Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa de interés USD: F -2.500000% 30/360 Trimestral Negociado en: BLOOMBERG

Tasa de interés COP: V FED + -1.5000 30/365 Trimestral

Tasa de cambio: 2904.0000

Tasa pool:

Enviar Nuevo Limpiar

Hora: 10:45:00 (Negociación)

Una vez se registra un IRS-CCS con tasas Fijas o Variables negativas el DAPI genera un mensaje orden_transaccion con los siguientes datos:

7.2. Cambios en la interfaz Dapi:

Ahora en los campos actuales para identificar las tasas variables y fijas están podrán recibirse con signo negativo:

View Message Fields - Templd: 9010 - Orden_Transaccion

```

tem :
precio_demanda_contestante :
descuento : 0.0000
dias_transcuridos : 0
dias_resta : 0
dias_ultimo_periodo : 0
intereses_devengados : - 2.500000
valor_a_negociar :
valor_efectivo :
valor_total :
valor_minimo_subasta : - 1.50000000
precio_spot_medio : - 1.50000000
codigo_externo :
decreto :
fix_messageid :
cadena_dias_cupon_actual :
dias_cupon_segun_base : 0
numero_linea : 0
dias_real_cupon : 0
numero_ventana : 0
omitir_cierre_pi :
bandera_tipo_dias_cierre_pi :
datos_mercados_acciones :
accion :

```

Para el mensaje

Tasa de interés Fija =
-2.5 para el ejemplo

Tasa de interés Variable
= -2.5 para el ejemplo

Para identificar las tasas variables y fijas están
definidos

- Longitud: 22

transmo1.txt

1	0	-	2.500000	0.00
---	---	---	----------	------

Normal text file length: 1656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1025 Sel: 0 | 0

- Nombre de campo: Precio_Spot_medio
- Tipo dato: Alfabético
- Posición: 1095
- Longitud: 16

transmo1.txt

2.500000	0.00	0.00	0.00	-	1.500000
----------	------	------	------	---	----------

length: 1656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1095 Sel: 0 | 0 Dos\Windows

7.4. Cambios en el archivo XML:

Se va a permitir de igual manera, poder subir desde el archivo XML operaciones de registro con el valor negativo en ambas tasas fija y variable TAG's, estas se seguirán identificando en los TAG's correspondientes:

<!-- Valor de interes para tipo de tasa Fija para la primera moneda con el formato de 99.999999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS -->

<tasa_interes>-03.50</tasa_interes>

<!-- Valor de spread para una Variable para la segunda moneda, con el formato de 99.9999, campo requerido y usado solo en registro IRS/CCS -->

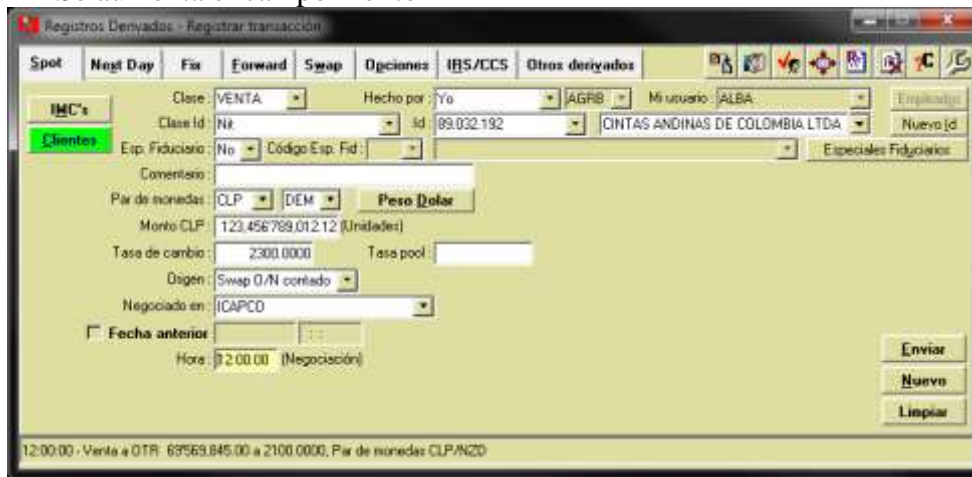
<spread_tasa_2>-00.5000</spread_tasa_2>

Tasa de interés USD :	F	3.500000%	ACT/360	Mensual
Tasa de interés COP :	V	FED	30/360	Mensual

8. Aumentar a doce (12) enteros y dos (2) decimales el campo monto en operaciones de registro derivados (174)

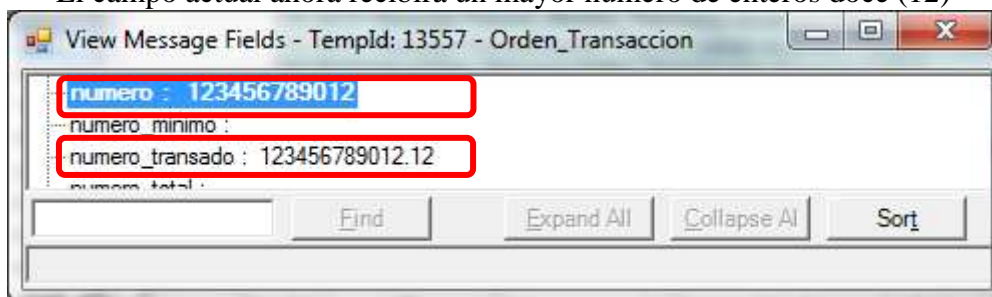
8.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

Se aumenta el campo monto



8.2. Cambios en la interfaz Dapi:

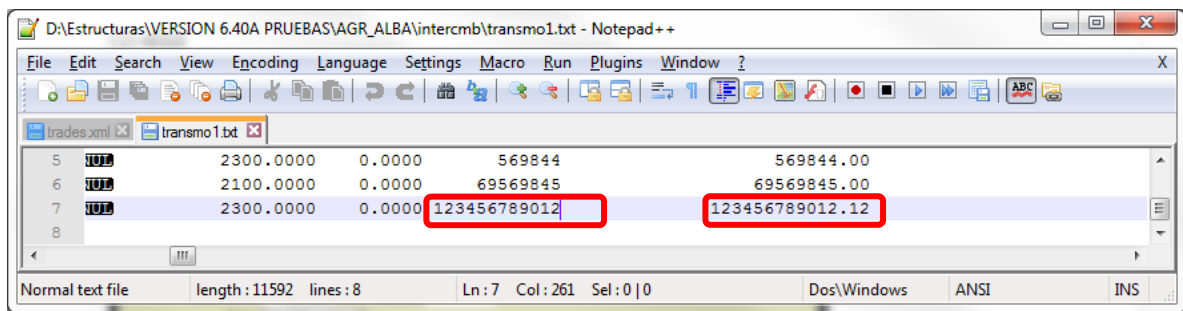
El campo actual ahora recibirá un mayor número de enteros doce (12)



8.3. Cambios en la interfaz Dapi:

El campo actual ahora recibirá un mayor número de enteros doce (12)

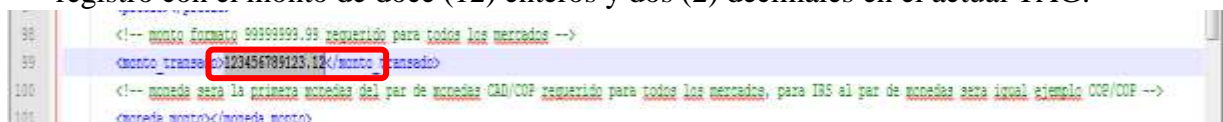
- Nombre del campo: numero
- Tipo dato: alfanumérico
- Posición: 248
- Longitud: 13



5	2300.0000	0.0000	569844	569844.00
6	2100.0000	0.0000	69569845	69569845.00
7	2300.0000	0.0000	123456789012	123456789012.12
8				

8.4. Cambios en el archivo XML:

Se va a permitir de igual manera, poder subir desde el archivo XML operaciones de registro con el monto de doce (12) enteros y dos (2) decimales en el actual TAG:




9. Cambios en mercados FIX

En los mercados FIX Spot, FIX Forward Interbancario, FIX y FIX Forward Clientes (Registro de Divisas), se realizaron ajustes acordes con las necesidades de los mercados.

9.1. Cambios en el aplicativo de usuario SET-FX:

9.1.1. Mercado FIX SPOT (75)

La ventana de registro para FIX Spot tiene un campo nuevo para ingresar los **puntos** que se sumarán o restarán al precio promedio del mercado spot cuando este cierre.

9.1.2. Cambios en la interfaz Dapi:

El campo en el dapi para obtener los **puntos** se llama “**points_forward**”.

9.1.3. Cambios en el archivo plano:

Con respecto al archivo plano los **puntos** se encuentran en la posición 238, 10

9.2. Mercados FIX forward interbancario (74), fix forward clientes y FIX Spot (174)

En las ventanas para los mercados Fix Forward, Fix y Fix Forward en el módulo de registro de divisas se adicionaron dos campos para el control de la fecha de asignación de la tasa y la tasa de referencia a la que el usuario desea negociar una operación. Para el caso de las tasas de referencia el proceso de asignación de la tasa va a ser automático dependiendo si se elige “**Promedio SET-FX**” o “**TRM**” o también existe una tercera opción para tasa manuales.

Ventana FIX forward Interbancario

Ventana FIX forward Clientes

Ventana FIX Spot Clientes

9.2.1. Cambios en la interfaz Dapi:

El campo donde se almacena la fecha de **asignación de precio** es:

“Fecha_entrega” = Fecha de asignación de la tasa

Y el campo donde se almacena la **tasa de referencia** que puede ser “Promedio SET-FX”, “TRM”, “MANUAL” es:

“Bandera_postura_especifica”. Este campo puede tomar los siguientes valores:

- P = “Promedio SET-FX”
- T = “TRM”
- M = “MANUAL”

9.2.2. Cambios en el archivo plano:

El campo donde se almacena la **“fecha de asignación”** de tasa en la posición 175,8

Y el campo donde se almacena la **tasa de referencia** estará en la posición 431,1

9.2.3. Cambios en el archivo XML:

A nivel del cargue de transacciones a través del servicio XML se relacionan a continuación los nuevos tags por mercado.

Mercado FIX Spot (174) en Registro de Divisas:

El valor requerido para indicar la moneda en la cual esta expresado el monto en este mercado, deberá ser enviado en el siguiente TAG:

<!-- par_monedas tag requerido para el mercado **FIX** ejemplo USD o COP -->

<par_monedas></par_monedas>

Mercados FIX forward interbancario (74) y fix forward clientes (174,f):

- El valor de los **puntos** deberá ser enviado en el siguiente TAG:

<!-- puntos para el mercado FIX Y forward en formato "-9990.0000" ejemplo "-1.2200" -->

<puntos></puntos>

- El valor para **fecha de asignación** de tasa deberá ser enviado en el siguiente TAG:

<!-- fecha_asignacion fecha de asignacion del precio el mercado FIX en formato YYYY-MM-DD -->

<fecha_asignacion></fecha_asignacion>

- El valor para la **tasa de referencia** deberá ser enviado en el siguiente TAG:

<!-- para el par de monedas USD/COP y para los mercados Fix, Forward, Swap; los valores permitidos son PROMEDIO SET FX, TRM, MANUAL -->

<tasa_referencial></tasa_referencial>