

Modificación a las Interfases Archivo Plano y API para la nueva versión del sistema SET-FX

Agosto 19 de 2020

ANTECEDENTES

La Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC) y la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia (CRCC) se fusionarán el 30 de noviembre de 2020, lo que implica que todas las operaciones Spot, Next Day y FIX USD/COP ahora se enviarán a compensar a través de la CRCC y como consecuencia se realizarán ajustes al aplicativo SET-FX.

ALCANCE

Este documento está dirigido a las áreas técnicas de las entidades afiliadas al sistema SET-FX, desarrolladores y proveedores de sus sistemas de información internos.

OBJETIVO

Exponer las modificaciones que se van a implementar en la información transmitida en algunos campos específicos de las interfases DAPI y Archivo Plano, a propósito de la nueva versión del sistema SET-FX con el proyecto Fusión de cámaras. La entidad afiliada deberá tomar en cuenta este documento para validar, dimensionar y ejecutar los ajustes respectivos a sus desarrollos internos.

Estos ajustes deberán ser realizados, probados y puestos en producción el treinta (30) de noviembre del 2020.

CONSIDERACIONES GENERALES.

- Las entidades deberán probar con antelación la conectividad y accesos al ambiente de pruebas del sistema SET-FX:
 - 100.100.32.206
 - 100.100.32.205
 - 100.100.32.209
 - Por los Puertos 7006 y 10443.
- Una vez los desarrollos o ajustes sean finalizados, la entidad afiliada deberá informar a SET-ICAP para proceder con la programación de sesiones de certificación de esos desarrollos.
- El área de soporte de SET-FX estará disponible para atender todas las dudas de tipo técnico relacionadas con este documento.
- La estructura y campos del DAPI no van a cambiar con esta nueva versión, lo que se va a modificar es el contenido de ciertos campos puntuales.

CAMBIOS EN EL API

Se adjunta con este documento el archivo anexo llamado *DAPI fusión cámaras.xlsx*, el cual describe la información que se va transmitir en el DAPI una vez la CRCC sea la contraparte para las operaciones en los mercados Spot, Next Day y FIX, a partir del 30 de noviembre de 2020.

En términos generales, una vez se implemente la nueva versión del sistema SET-FX, la información de los mensajes de DAPI para las operaciones enviadas a compensar a través de la CRCC se verá específicamente afectada en los siguientes dos aspectos.

1. Para aquellas operaciones compensadas a través de la CRCC, los campos del DAPI que hagan referencia al trader de la contraparte (tales como el código de usuario, la sucursal a la cual pertenece, el nombre, la identificación, correo etc.), aparecerán vacíos a partir de la salida en producción del proyecto fusión de cámaras vendrá vacía.
2. Toda la información que se transmitirá en el nuevo DAPI y que haga referencia a la entidad contraparte ahora incluirá la información de la CRCC para aquellas operaciones compensadas a través de esta Cámara.

En el archivo *DAPI fusión cámaras.xlsx* adjunto, se muestra en cada pestaña un escenario con el detalle de los cambios a la información transmitida por el DAPI, especificando en cada caso la descripción del campo, el nombre del campo, el valor que el API envía actualmente y el nuevo valor que vendrá al momento de la salida a producción del proyecto fusión de Cámaras, tal como se muestra a continuación:

Escenarios (pestañas)

Agresor	Postulante	Registro con Compensacion	Registro sin Compensacion	Anulacion	FIX
---------	------------	---------------------------	---------------------------	-----------	-----

Descripción detallada de los campos en cada pestaña

ITAU BBA COLOMBIA S.A.
BANCO DAVIVIENDA S.A.
CLASE MENSAJE 42

Descripción Campo	Campo API	Valor Actual	Nuevo Valor
Nemotécnico de la entidad postura	Sucursal_4c_postura	TAUB	CRCC
Nemotécnico de la contestantante	Sucursal_4c_postura_1	DVNC	DVNC

IDENTIFICACIÓN DE OPERACIONES COMPENSADAS Y/O REALIZADAS A TRAVÉS DE UN MERCADO CIEGO

Para las entidades que usan API y desean identificar si una operación está o no está compensada en Cámara, se deben tomar como referencia el campo `banderas_transaccion2`, en el cual el valor entregado será dividido por 16, si el resultado (números enteros) es impar la operación esta compensada de lo contrario no está compensada.

Ejemplo:

Campo `banderas_transaccion2` = 80

$80/16 = 5$; Operación Compensada

Campo `banderas_transaccion2` = 64

$64/16 = 5$; Operación No Compensada

Campo `danderas_transaccion2` = 0

$0/16 = 0$; Operación No Compensada

De la misma manera, las entidades pueden identificar si la operación pertenece al mercado ciego o no, utilizando el campo `danderas_transaccion2`, donde el valor entregado será dividido por 64, si el resultado (números enteros) es impar la operación fue realizada en el mercado ciego de lo contrario se realizó en el mercado semiciego.

Campo `danderas_transaccion2` = 80

$80/64 = 1$; Mercado ciego

Campo `danderas_transaccion2` = 64

$64/64 = 1$; Mercado ciego

Campo `danderas_transaccion2` = 0

$0/64 = 0$; Mercado semiciego

Las entidades regulatorias y de compensación no tendrán cambios en la información suministrada por el API o en archivo plano salvo lo descrito en el párrafo anterior.

CAMBIOS AL ARCHIVO PLANO

Se adjunta con este documento el archivo anexo llamado “Archivo Plano Fusión Cámaras”, el cual describe la información que se va transmitir en el archivo plano de SET-FX una vez la CRCC sea la contraparte para las operaciones en los mercados Spot, Next Day y FIX, a partir del 30 de noviembre de 2020.

En términos generales, una vez se implemente la nueva versión del sistema SET-FX, la información de los mensajes del archivo plano para las operaciones enviadas a compensar a través de la CRCC se verá específicamente afectada en los siguientes dos aspectos.

1. Para aquellas operaciones compensadas a través de la CRCC, los campos del archivo plano que hagan referencia al trader de la contraparte (tales como el código de usuario, la sucursal a la cual pertenece, el nombre, la identificación, correo etc.), aparecerán vacíos a partir de la salida en producción del proyecto fusión de cámaras.
2. Toda la información que se transmitirá en el nuevo archivo plano y que haga referencia a la entidad contraparte ahora incluirá la información de la CRCC para aquellas operaciones compensadas a través de esta Cámara.

En el archivo *Archivo plano fusión cámaras.xlsx* adjunto, se muestra en cada pestaña un escenario con el detalle de los cambios a la información transmitida por el archivo plano, especificando en cada caso la descripción del campo, el nombre del campo, el valor que el archivo plano envía actualmente y el nuevo valor que vendrá al momento de la salida a producción del proyecto fusión de Cámaras, tal como se muestra a continuación:

Escenarios (pestañas)

Agresor	Postulante	Registro con Compensacion	Registro sin Compensacion	Anulacion	FIX
---------	------------	---------------------------	---------------------------	-----------	-----

Descripción detallada de los campos en cada pestaña

ITAU BBA COLOMBIA S.A. - Dueño Postura, Postulante (TAUB) BANCO DAVIVIENDA S.A. - Agrede Postura, Aceptante (DVNC) POSICIÓN 66, CLASE MENSAJE 5 (Para el Aceptante)					
Descripción Campo	<input checked="" type="checkbox"/> Campo Plano	<input type="checkbox"/> Longitud	<input checked="" type="checkbox"/> Posición	<input checked="" type="checkbox"/> Valor Actual	<input type="checkbox"/> Nuevo Valor
Nemotécnico de la entidad postura	Sucursal_4c_postura	4	92	DNVC	DVNC

Durante los días 25, 26 y 27 de Agosto se han programado seis sesiones de capacitación en formato virtual, en las cuales se explicarán detalladamente los cambios explicados en este documento. Los enlaces de estas capacitaciones se informan a través de Boletín Informativo.

SET-ICAP estará disponible para resolver sus dudas en las siguientes direcciones de correo electrónico: soportesetfx@set-icap.co; comercial@set-icap.co o al número telefónico 7427778.