

2020

MODIFICACION INTERFASES ARCHIVO PLANO, API Y XML

Nueva Versión 7.12
Sistema SET-FX



API VERSIÓN FUSIÓN CÁMARAS

ANTECEDENTES

La aprobación del proceso de fusión de la Cámara de Compensación de Divisas de Colombia (CCDC) y la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia (CRCC) implicó realizar ajustes en el sistema SET-FX, en el cual todas las operaciones Spot, Next Day y FIX USD/COP ahora se enviarán a compensar a través de la CRCC.

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.

Las ventanas ejemplo de este documento son referenciales y en el desarrollo final pueden tener otra apariencia pero conservando la funcionalidad indicada.

OBJETIVO

- Exponer las modificaciones que se van a implementar en las interfaces de información API y Archivo plano, a propósito de la nueva versión del sistema SET-FX con el proyecto Fusión de cámaras.
- Informar los desarrollos necesarios para incluir el nuevo origen para registros entre clientes sub-mercado Spot.
- Informar la actualización de los valores del campo “Negociado en” para el registro de operaciones en el sistema SET-FX.

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



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

Las IPs mencionadas anteriormente deben alcanzarse por los Puertos 7006 y 10443.

- Ni la estructura y campos del API van a cambiar con esta versión, lo que se modifica es el contenido de ciertos campos en específico.
- 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.**



API VERSIÓN FUSIÓN CÁMARAS

Con este documento se adjunta el archivo “API fusión cámaras.xlsx”, el cual describe la información que se va transmitir una vez la CRCC sea la contraparte de las operaciones en los mercados Spot y Next Day.

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

1. Para aquellas operaciones compensadas a través de la CRCC, los campos del API 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 API y que haga referencia a la entidad contraparte ahora incluirá la información de la CRCC para aquellas operaciones compensadas a través de esta Cámara.

El archivo “API fusión cámaras.xlsx” se divide en pestañas, en cada pestaña se encuentra un escenario con el detalle de los cambios a la información, especificando en cada caso la descripción del campo, el nombre del campo, el valor que el API envía actualmente y el 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 contestante	Sucursal_4c_postura_1	DVNC	DVNC

ARCHIVO PLANO VERSIÓN FUSIÓN CÁMARAS

Con este documento se adjunta el archivo “*Archivo plano fusión cámaras.xlsx*”, el cual describe la información que se va transmitir en el archivo plano de SET-FX una vez la CRCC sea la contraparte de las operaciones en los mercados Spot y Next Day.

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 afectada en los siguientes dos aspectos:

1. Para aquellas operaciones compensadas a través de la CRCC, los campos del archivo plano que hacen 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 archivo plano y que haga referencia a la entidad contraparte, incluirá la información de la CRCC para aquellas operaciones compensadas a través de esta.

En el archivo adjunto “*Archivo plano fusión cámaras.xlsx*”, se muestra en cada pestaña un escenario con el detalle de los cambios a la información transmitida, 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	Campo Plano	Longitud	Posición	Valor Actual	Nuevo Valor	
Nemotécnico de la entidad postura	Sucursal_4c_postura	4	92	DNVC	DVNC	

IDENTIFICACIÓN SI LA OPERACIÓN ESTA COMPENSADA Y SI PERTENECE AL MERCADO CIEGO

API

Para las entidades que usan API y desean identificar cuando una operación está o no compensada en la CRCC, se debe tomar el valor el campo banderas_transaccion2 y dividirlo por 16, si el resultado (número entero) es impar la operación esta compensada de lo contrario no lo está.

Ejemplo:

Campo banderas_transaccion2 = 80

$80/16 = 5$; Operación Compensada

Campo banderas_transaccion2 = 64

$64/16 = 4$; Operación No Compensada

Campo banderas_transaccion2 = 0

$0/16 = 0$; Operación No Compensada

Asimismo para identificar si la operación pertenece al mercado ciego o no, si el resultado al dividir por 64 el valor entregado en el campo banderas_transaccion2, es impar la operación fue realizada en el mercado ciego de lo contrario se realizó en el mercado semiciego.

Campo banderas_transaccion2 = 80

$80/64 = 1$; Mercado ciego

Campo banderas_transaccion2 = 64

$64/64 = 1$; Mercado ciego

Campo banderas_transaccion2 = 0

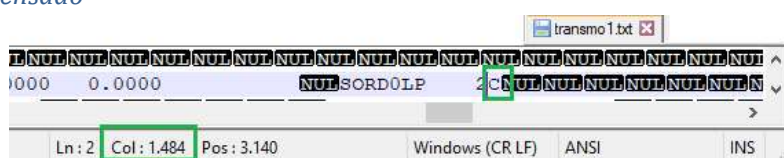
$0/64 = 0$; Mercado semiciego

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.

Archivo Plano

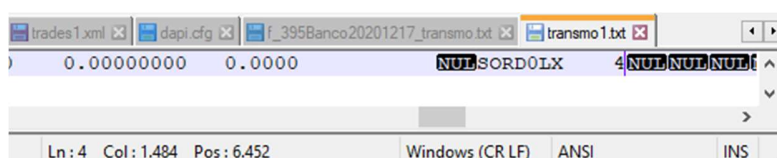
Para identificar en el archivo plano cuando una operación está o no esta compensada se debe tomar la posición 1484, banderas_transaccion y si el valor entregado es "C" el registro esta compensado y si el valor es vacío el registro significa que no está compensado.

Registro compensado



Ln : 2	Col : 1.484	Pos : 3.140	Windows (CR LF)	ANSI	INS
--------	-------------	-------------	-----------------	------	-----

Registro No compensado



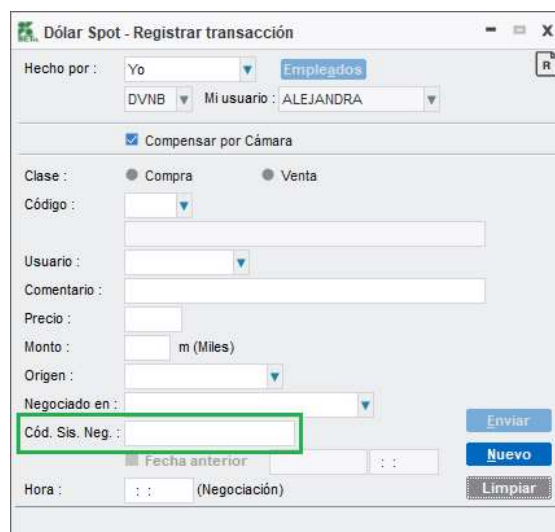
Ln : 4	Col : 1.484	Pos : 6.452	Windows (CR LF)	ANSI	INS
--------	-------------	-------------	-----------------	------	-----

CÓDIGO SISTEMA DE NEGOCIACIÓN

SET-ICAP ha implementado un nuevo campo Código Sistema de Negociación (Cód. Sis. Neg), en la ventana utilizada para el registro de operaciones Spot y FIX t+0. El campo será solicitado para aquellas operaciones celebradas en otro sistema de negociación, que sean registradas en el sistema SET-FX y que hagan parte del cálculo de la TRM.

Este campo tiene como características ser alfanumérico con una longitud de 16 caracteres y es obligatorio para los siguientes sistemas de negociación:

- SET-ICAP
- GFI
- TRADITION
- Banco de la República
- Dirección del Tesoro Nacional



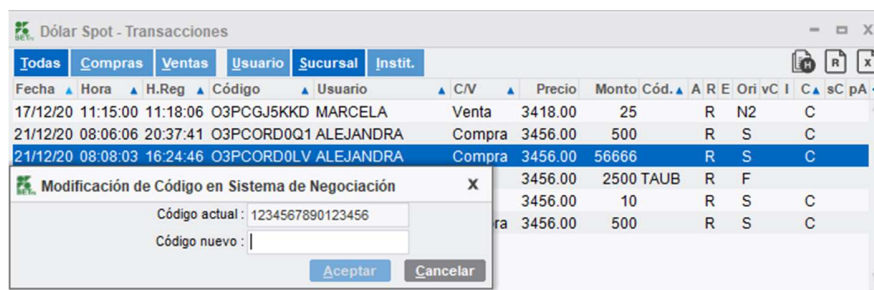
Hecho por: Yo Empleados R
 DVNB Mi usuario: ALEJANDRA
☒ Compensar por Cámara
 Clase: ☐ Compra ☐ Venta
 Código:
 Usuario:
 Comentario:
 Precio:
 Monto: m (Miles)
 Origen:
 Negociado en:
 Cód. Sis. Neg.:
 Hora: : : (Negociación)
 Botones: Enviar, Nuevo, Limpiar

Si el trader después de registrar la operación desea modificar el código sistema de negociación, debe realizar los siguientes pasos:

- Seleccionar la operación desde el blotter de operaciones
- Seleccionar “Cambiar Código en Sistema de Negociación”

</

- El sistema SET-FX abrirá una ventana, que permite la modificación del código.



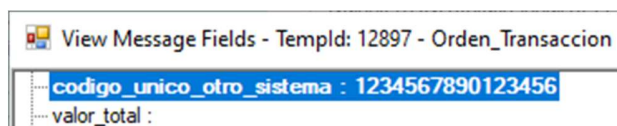
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	C/V	Precio	Monto	Cód.	A	R	E	Ori	v	C	I	C	s	C	p	A
17/12/20	11:15:00	11:18:06	O3PCGJ5KKD	MARCELA	Venta	3418.00	25		R		N2									
21/12/20	08:06:06	20:37:41	O3PCORD0Q1	ALEJANDRA	Compra	3456.00	500		R		S									
21/12/20	08:08:03	16:24:46	O3PCORD0LV	ALEJANDRA	Compra	3456.00	56666		R		S									
						3456.00	2500	TAUB	R		F									
						3456.00	10		R		S									
						3456.00	500		R		S									

Modificación de Código en Sistema de Negociación

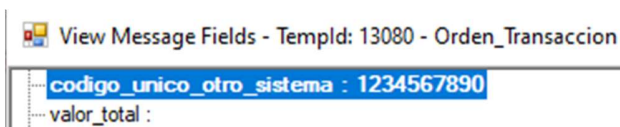
Código actual: 1234567890123456
 Código nuevo:
 Botones: Aceptar, Cancelar

API

Para identificar el código de la operación del sistema de negociación en el API, es necesario tomar el tipo de mensaje Orden_transaccion, clase mensaje 5, en el campo codigo_unico_otro_sistema

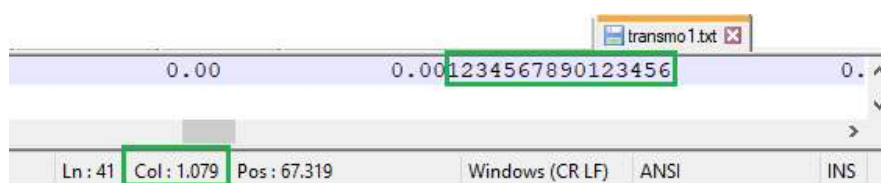


En el caso de la modificación del código sistema de negociación en el API se genera tipo mensaje Orden_transaccion, clase mensaje 41

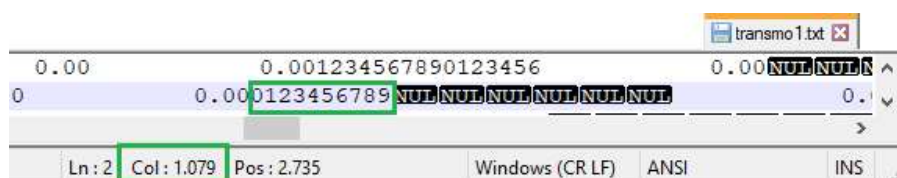
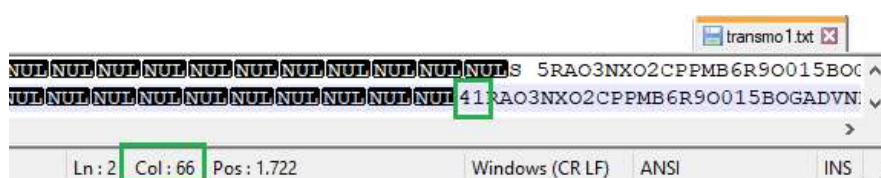


Archivo Plano

Para identificar el código de la operación del sistema de negociación en el archivo plano se debe tomar el Clase mensaje 5, la posición 1079



En el caso de la Modificación código sistema de negociación, se debe tomar en clase mensaje 41, la posición 66.



CÓDIGO DE OPERACIÓN SISTEMA SET-FX

En el sistema SET-FX por cada operación realizada se genera un código único de operación por mercado y día. El código de operación se identifica desde el front-end en el detalle de la operación:

Dólar Spot - Detalle de transacción

Fecha: 27/11/2020 Código: O3PCUH32R0 Hora: 20:48:26

☒ Por Cámara

Comprador: CAMARA DE RIESGO CENTRAL Sucursal: BOGOTA

Vendedor: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Maria Alejandra Montealegre M

Precio: 3960.00 Monto US\$: 250,000.00

Origen transacción: Oferta aceptada por ...

Comentario: Monto Pesos: 990'000,000.00

A continuación se describe la forma de obtener ese código de operación en el API y Archivo plano del sistema SET-FX.

API

En el tipo mensaje Orden_transaccion, clase mensaje 5 tomar los campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion.

Registros Derivados - Forward - Detalle de transacción

Fecha: 27/11/2020 Código: O3NXW7193E Hora de registro: 20:50:55 Hora: 08:06:03

Comprador: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Maria Alejandra Montealegre M

Por parte de:

Vendedor - Nombre comitente: BEL-STAR S.A. Clase ID: Nit Identificación: 800.018.359-1 Real

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP ☐ Tercero Offshore

Plazo: 2 Meses 28-Ene-2021 Origen: Swap

Fecha asignación tasa: Viernes 27-Nov-2020 Tasa referencial: MANUAL

Fecha de pago: 29-Ene-2021 Cumplimiento: NON-DELIVERY

Monto: 5'630,000.00 Opcionalidad:

Puntos forward: 100.3000 SEFable:

Tasa forward: 3963.3000

Tasa spot: 3863.0000 Tasa pool: 0.0000

Negociado en: DIRECTO

Origen de transacción: Registrado por ALEJANDRA

Comentario:

Estado CRCC:

☐ Fecha anterior

View Message Fields - Templd: 13423 - Orden_Transaccion

codigo_primaryuser : O3NX

View Message Fields - Templd: 13423 - Orden_Transaccion

mcod_transaccion : W7193E

View Message Fields - Templd: 13422 - Orden_Transaccion

codigo_primaryuser : O3PC

View Message Fields - Templd: 13422 - Orden_Transaccion

mcod_transaccion : UH32RO

Archivo Plano

Tomar los campos `codigo_primaryuser` y `mcod_transaccion`, de la línea clase mensaje 5 pociones 1 y 1473, respectivamente.

transmo1.txt

1 03PC NUL NUL NUL NUL 3B 31 4 NUL NUL NUL NUL NUL 20482620201127004JBOGAS NUL

2

<

Normal text file length: 1.656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1 Sel: 0 | 0

transmo1.txt

1 SUH32RO 1C NUL NUL NUL NUL NUL NUL NUL Z0N8CAMYQRO04QBOGACRCBB NUL NUL NUL NUL NUL

2

<

Normal text file length: 1.656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1,473 Sel: 0 | 0

transmo1.txt

1 03NX 3B 15 02CP080603202011270015BOGA 5R 03NX NUL

2

<

Normal text file length: 1.656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1 Sel: 0 | 0 | 0

transmo1.txt

1 0000 3963.30000000 0.0000 W7193E 2 C W7193G OTR

2

<

Normal text file length: 1.656 lines: 2 Ln: 1 Col: 1,473 Sel: 0 | 0

Para efectos de identificación única dentro de los sistemas internos de cada entidad se recomienda utilizar la siguiente secuencia la cual creara una llave única:

- Fecha+Hora+mercado+código_primaryuser+mcode_transaccion

CUADRO EXPLICATIVO CÓDIGO NEGOCIACIÓN Y CÓDIGO DE REGISTRO

De acuerdo a los sistemas de negociación configurados en el sistema SET-FX se adjunta cuadro explicativo para los mercados Spot y FIX, el cual expone los campos y posición en API y Archivo plano de acuerdo al sistema de negociación para los registros.

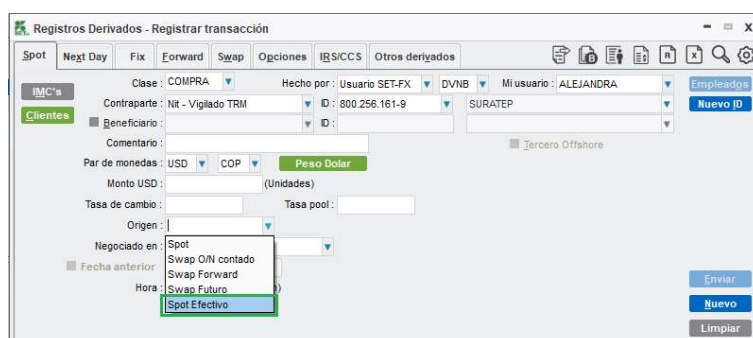
Sistema de Negociación	MERCADO			
	SPOT	FIX		
Código de Negociación	Código de Registro	Código de Negociación	Código de Registro	
DIRECTO	N/A	N/A		
SET-ICAP	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema
BLOOMBERG	N/A	N/A		

Sistema de Negociación	MERCADO			
	SPOT	FIX		
Código de Negociación	Código de Registro	Código de Negociación	Código de Registro	
BANCO DE LA REPUBLICA	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema
GFI EXCHANGE	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema
TRADITION	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos código_unico_otro_sistema

Sistema de Negociación	MERCADO			
	SPOT		FIX	
	Código de Negociación	Código de Registro	Código de Negociación	Código de Registro
OTC	N/A	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473	N/A	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473
REFINTIV	N/A	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473	N/A	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473
DIRECCION TESORO NACIONAL	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_unico_otro_sistema	API - Tipo mensaje Orden_Transaccion - Clase mensaje 5 - Campos codigo_primaryuser+mcod_transaccion
	Archivo Plano Clase mensaje 5, posición 1079	Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473	Archivo Plano Clase mensaje 5, posición 1079	Archivo Plano Clase mensaje 5, paciones 1 y 1473

REGISTRO DERIVADOS CLIENTES, NUEVO VALOR SPOT EFECTIVO

Actualmente el sistema SET-FX cuenta con una ventana para el ingreso de registros de derivados con clientes.



Detalle del Registro

Registros Derivados - Spot - Detalle de transacción

Fecha: 27/11/2020 Código: 03NXW7193K Hora de registro: 21:33:19 Hora: 08:06:03

Comprador: BANCO DAVIVIENDA S.A. Sucursal: BOGOTA Persona: Maria Alejandra Montealegre M

Por parte de:

Vendedor - Nombre comitente: SURATEP Clase ID: Nit Identificación: 800.256.161-9 Vigilado TRM

Por parte de:

Par de monedas: USD / COP Tercero Offshore

Monto: 5'600,000.00

Tasa de cambio: 3963.0000 Tasa pool: 0.0000

Monto COP: 22,192'800,000.00

Negociado en: SET-ICAP

Origen de transacción: Registrado por ALEJANDRA

Comentario:

Origen: Spot Efectivo

Fecha anterior:

Blotter operaciones

Registros Derivados Clientes - Transacciones													
Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados													
Todas Compras Ventas Usuario Sucursal Instit.													
Fecha	Hora	H.Reg	Código	Usuario	Nombre comitente	TE B C/V	Par Mnda	Monto	Tasa cambio B	E	Or	I	X pA
27/11/20	08:06:03	21:33:19	03NXW7193K	ALEJANDRA	SURATEP	T	Compra	USD / COP	5'600,000.00	3963.0000	E		

Para identificar las operaciones Spot con origen efectivo en el mercado registro de derivados, submercado Spot con clientes se agregó un nuevo valor “E” tanto en el API como en el Archivo Plano.

A continuación se describe la forma de obtener ese valor dentro del API y Archivo plano del sistema SET-FX.

API

Para el tipo de mensaje Orden_transaccion, clase mensaje 5, en el campo texto_origen

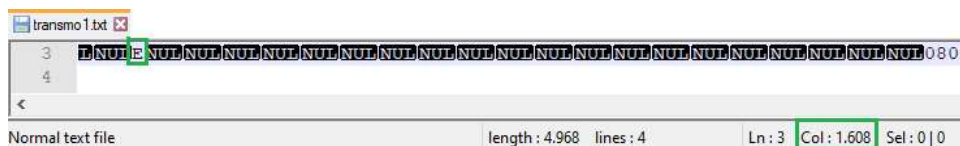
View Message Fields - Templd: 13429 - Orden_Transaccion

entidad_publica_3c_1 : E

texto_origen : E

Archivo Plano

Clase mensaje 5, posición 1608



XML

En XML se acepta el valor “E” para el tag texto_origen

```
<!-- Indica el origen de la transaccion S - Spot, F - Swap Forward, O - Swap O/N contado, U - Swap Futuro, E - Spot Efectivo,
Indica el origen de la transaccion N - Next Day, F - Swap Forward, O - Swap O/N contado, U - Swap Futuro, en caso de mer
Indica el origen de la transaccion X0 - Fix, S - Swap, F - Forward-Forward, O - Outright, en caso de mercado Forward per
<texto_origen></texto_origen>
```

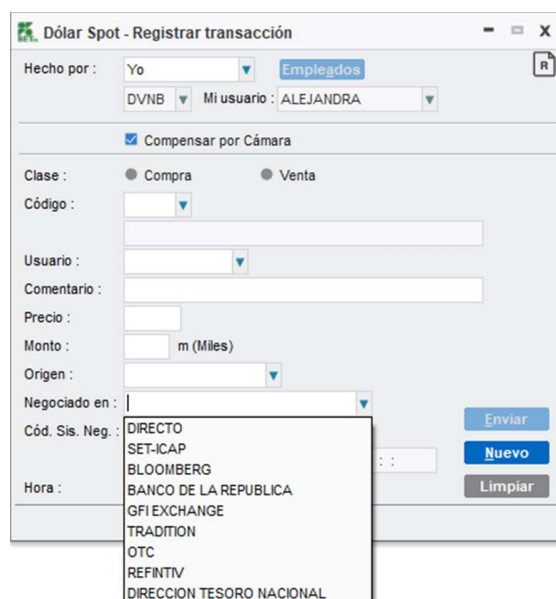
ACTUALIZACIÓN SISTEMAS DE NEGOCIACIÓN

Con el fin de unificar los sistemas de negociación establecidos por la Superintendencia Financiera de Colombia en el formato 395 se realizan los siguientes ajustes:

Código	Descripción
D	DIRECTO
I	SET-ICAP
B	BLOOMBERG
P	BANCO DE LA REPUBLICA
G	GFI EXCHANGE
T	TRADITION
O	OTC
R	REFINTIV
N	DIRECCION TESORO NACIONAL

Front-end

- Cambio de nombre en la opción “ICAPCO” por “SET-ICAP”.
- Cambio de nombre en la opción “REUTERS” por “REFINITIV”.
- Eliminación opción “ENLACE”.
- Se adiciona “DIRECCIÓN TESORO NACIONAL” con código “N”.



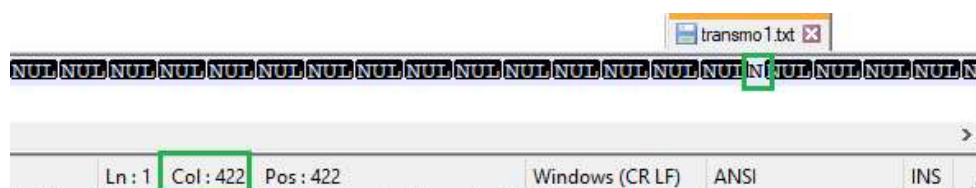
API

Se agrega un nuevo valor para identificar el sistema de negociación “DIRECCIÓN TESORO NACIONAL” con código “N”, para el tipo de mensaje “Orden_Transaccion”, Clase mensaje 5, campo “Codigo_categoria”.



Archivo Plano

Clase mensaje 5, posición 422



XML

En XML se acepta el valor “N” para el tag <sistema_negociacion>

```
<sistema_negociacion>N</sistema_negociacion>
```


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.

Cordialmente,

XXXXXXXXXXXXXXXXXX

CONTROL DE CAMBIOS

Versión	Revisado – Responsable	Fecha de Revisión	Aprobado	Fecha Aprobación	Razón
01	Director de Servicios y Soporte SET-FX	18/12/2020	Gerente de TI	22/12/2020	Creación documento modificación interfaces API, archivo plano, XML nueva versión sistema SET-FX
02	Director de Servicios y Soporte SET-FX	06/01/2020	Gerente de TI	06/01/2020	Creación cuadro explicativo código de negociación y código de registro de acuerdo al sistema de negociación con referencia al API y Archivo plano