­

MODIFICACIÓN INTERFASES

ARCHIVO PLANO, API Y XML

2021

Nueva Versión 7.13 Sistema SET-FX

# **INTRODUCCIÓN**

SET-ICAP sociedad administradora del Sistema de negociación y registro sobre divisas SET-FX, se permite informar sobre los cambios que tendrá el proceso de modificación de operaciones teniendo en cuenta algunas sugerencias y/o recomendaciones realizadas por parte de la Superintendencia Financiera de Colombia.

Todas las operaciones registradas en el sistema podrán ser modificadas, manteniendo las restricciones establecidas en la regulación vigente.

A continuación se describen los cambios necesarios para actualizar las interfaces de automatización Archivo plano, API y Protocolo FIX, y XML.

# **OBJETIVO**

Informar a las áreas de desarrollo de las entidades afiliadas al sistema SET-FX, los cambios en las interfaces Archivo plano, API, Protocolo FIX y XML, teniendo en cuenta la nueva versión 7.13 del sistema, que entrará en producción en diciembre de 2021.

# **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.

# **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.

* El área de soporte de SET-FX estará disponible para atender todas las dudas de tipo técnico relacionadas con este documento.
* La modificación de operaciones solo estará disponible para registros realizados en el Sistema SET-FX.
* Las operaciones de contado pactadas entre intermediarios del mercado cambiario y que se encuentren compensadas por la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (CRCC) deben seguir el siguiente proceso para poder ser modificadas:
  + - Contraparte A solicita modificación a contraparte B
    - Contraparte B acepta la solicitud de modificación
    - La solicitud de modificación es enviada de forma automática al perfil CRCC
    - La CRCC debe acepta la modificación
* **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 API Y ARCHIVO PLANO (TRANSMO1.TXT)**

## Clave Única de Identificación de Operaciones en el Sistema SET-FX

A partir de la puesta en producción de la versión 7.13, la identificación de cualquier operación (transaccional o registro) del sistema se debe construir:

* **API:** usando el tipo de mensaje “**Orden\_Transaccion”**, **clase mensaje = 5** y los campos “**fecha” + “codigo\_primaryuser” + “mcod\_transaccion”**
* **Archivo Plano:** Clase mensaje = 5 (**posición 66**), fecha(**posición 34**) + código primaryuser (**posición 1**) + mcod\_transaccion (**posición 1473**)

Las modificaciones, anulaciones, cambio a cámara o asignación de tasa, se identificarán utilizando:

* **API:** usando el tipo de mensaje “**Orden\_Transaccion”**, **clase mensaje correspondiente** **a la acción**\* y los campos **“fecha\_original” + “codigo\_primaryuser\_original” + “mcod\_transaccion”**
* **Archivo Plano:** Clase mensaje =5 (**posición 66**), “fecha\_original” **(posición 1643)** + “codigo\_primaryuser\_original” **(posición 1639)** + “mcod\_transaccion” **(posición 1473)**

**\* Clase\_mensaje:**

* Modificación: Clase\_mensaje = 53
* Anulación: Clase\_mensaje = 51
* Cambio a cámara (Operaciones derivados): Clase\_mensaje = 36
* Asignación de tasa (Precio FIX/TRM): Clase\_mensaje = 43
* Asignación de tasa (Manual): Clase\_mensaje = 53

## Mensaje de Modificación para todos los Mercados Del Sistema

Teniendo en cuenta que la modificación de operaciones será implementada para todos los mercados y sub-mercados del sistema, es necesario que los afiliados implementen la lectura del tipo de mensaje= **“Orden\_Transaccion”** (API), **clase\_mensaje = 53** (API/Archivo plano) para todos los mercados:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **MERCADOS Y MENSAJE DE MODIFICACIÓN** | | | |
| **MERCADO y Sub-mercado** | | **Versión 7.12** | **Versión 7.13** |
| **Clase\_Mensaje** | **Clase\_Mensaje** |
| Dólar Spot (71) | | **N/A** | **53** |
| Dólar Next Day (76) | | **N/A** | **53** |
| Dólar Fix (75) | | **N/A** | **53** |
| Dólar Forward (74) | | 53 | **53** |
| Dólar Swap (77) | | 53 | **53** |
| Registros Derivados (174) **IMC** | Spot, Next Day, Fix, Otros Derivados | **N/A** | **53** |
| Forward, Swap, Opciones, IRS/CCS | 53 | **53** |
| Registros Derivados (174) **Clientes** | Spot, Next Day, Fix, Otros Derivados | **N/A** | **53** |
| Forward, Swap, Opciones, IRS/CCS | 53 | **53** |

## Nuevos Campos Modificables

A continuación se listan los campos que serán modificables en una operación a partir de la versión 7.13 del Sistema SET-FX.

1. **Clase de Transacción (Compra/Venta)**

Para identificar si una operación cambia de ser una comprar a una venta o viceversa, posibles valores son “D”, “O”:

* **API:** Tipo de Mensaje “**Orden\_Transaccion**”, **clase\_mensaje = 53**, campo “**o\_d**”
* **Archivo plano:** Clase mensaje = 53 (**posición 66**), o\_d (**posición 129**)

1. **Hora de Negociación**

Cuando se realice la modificación de la hora de negociación

* **API:** Tipo de Mensaje “**Orden\_Transaccion**”, **clase\_mensaje = 53**, campo “**bandera\_retiro\_para\_modificar” = H**, “**hora\_operacion” = nueva hora de negociación**
* **Archivo plano:** Clase mensaje = 53 (**posición 66**), “bandera\_retiro\_para\_modificar” **(posición 1635) = H,**  “hora\_operacion\_postulante” **(posición 131) =** nueva hora de negociación

1. **Trader y Sucursal**

* En los mercados interbancarios se necesita la confirmación de la contraparte para poder ejecutar una modificación. Solo quien solicita la modificación puede cambiar el valor de la sucursal, el usuario o el empleado de su propia entidad.
* Para cambiar ambos usuarios o sucursales en la operación, es necesario que se procesen dos modificaciones y que ambas contrapartes confirmen los cambios.
* Los datos de la contraparte modificada llegan en el mensaje de modificación tipo de Mensaje “**Orden\_Transaccion**” para API, **clase mensaje = 53** (API/ Archivo Plano) en los mismos campos de contraparte original.

1. **Entidad Contraparte**

Para cambiar la entidad contraparte de una operación entre Intermediarios del Mercado Cambiario es necesario realizar la anulación de la operación inicial y posteriormente incluir una nueva con la contraparte correcta, incluyendo el código y la fecha de la operación anulada en el campo comentario de la nueva operación.

1. **Otros Campos en la Operación**

Para los cambios a otros campos dentro de una operación no mencionados anteriormente, en el mensaje de modificación se van a incluir los nuevos valores en los mismos campos.

## Anulación de Operaciones en todos los Mercados

La información de anulación de operaciones para todos los mercados y sub-mercados del sistema en los API tipo banco se enviará en el Tipo de Mensaje “Orden\_Transaccion”, clase\_mensaje =51. Se deja de utilizar el clase\_mensaje 52.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **ANULACIONES** | | | |
| Interface | Clase institución | Versión 7.12 | **Versión 7.13** |
| Tipo de Mensaje “Orden\_Transaccion”  clase\_mensaje | **Tipo de Mensaje “Orden\_Transaccion”**  **clase\_mensaje** |
| API | Banco | 52 | **51** |

## Asignación de Tasa Manual en Operaciones FIX

En el mercado Registro de divisas (174) sub-mercado FIX, es posible pactar operaciones a las que el día de su cumplimiento se asignará el precio de forma manual. En la versión 7.13 para la asignación de tasa manual es necesario leer y extraer la información del Tipo de Mensaje “**Orden\_Transaccion**” (API), **clase\_mensaje = 53** (API, Archivo Plano).

Nota: Para las operaciones con asignación de tasa automática se seguirá utilizando el Tipo de Mensaje “**Orden\_Transaccion**”, **clase\_mensaje = 43**.

## **CAMBIOS ARCHIVO XML**

Para el cargue automático de operaciones con clientes finales, el sistema cuenta con el mecanismo “XML” (Extensible Markup Language), el cual es desarrollado por los afiliados y tendrá los siguientes cambios a partir de la implementación de la versión 7.13:

## Habilitar la Modificación en los todos los Sub-mercados

Se habilitará la modificación de operaciones para los sub-mercados Spot, Next Day y Fix mediante el tag:

<tipo\_operacion>M</tipo\_operacion>

## Habilitar la Modificación de todos los Campos de una Operación

Se permitirá la modificación de todos los campos de una operación excepto el tipo de sub-mercado, siempre y cuando cumpla con las restricciones establecidas por la normativa actual.

A continuación se listan los campos que se podrán modificar a partir de la puesta en producción de la versión 7.13.

* Tipo de transacción (Compra o Venta, Call/Put de Compra/Venta)

<operación></operacion>

* ID de usuario de la misma institución que realizó la operación

<id\_usuario></id\_usuario>

* Hora de negociación (hh:mm:ss)

<hora\_transaccion></hora\_transaccion>

* Par de monedas

<moneda\_monto> </moneda\_monto>

<moneda\_contraparte> </moneda\_contraparte>

\***Solo para submercado Fix:**

<par\_monedas></par\_monedas>

* Comitente Contraparte

<tipo\_identificacion></tipo\_identificacion>

<identificacion\_contraparte></identificacion\_contraparte>

* Beneficiario

<clase\_id\_comitente\_contraparte></clase\_id\_comitente\_contraparte>

<id\_comitente\_contraparte></id\_comitente\_contraparte>

* Tercero Offshore

<bandera\_tercer\_offshore></bandera\_tercer\_offshore>

## **NUEVO ESTADO PARA OPERACIONES “NO CUMPLIDA”**

De conformidad con las normas actuales, no es posible anular operaciones una vez hayan transcurrido 15 minutos desde la negociación. Para aquellos casos donde el cliente final se retracte de la operación, los afiliados podrán marcar dichas operaciones cómo “no cumplidas”.

Con esta marca las entidades afiliadas podrán identificar este tipo de operaciones y de ser necesario anular dicha operación en sus sistemas internos.

Para las operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario (IMC), solo el administrador del sistema SET-FX podrá poner la marca “No cumplida” una vez reciba autorización formal de las contrapartes involucradas. En las operaciones IMC-Clientes los usuarios (transaccional o de registro) tienen la potestad de marcar la operación como “No cumplida”.

* **API:** Tipo de Mensaje **“Orden\_Transaccion”, clase\_mensaje = 38, campo “bandera\_adjudicacion”=n**
* **Archivo plano:** Clase mensaje= 38 **(posición 66),** bandera\_adjudicacion **(posición 1269)=n**

## **NUEVO CAMPO “CLASE” PARA OPCIONES**

A partir de la puesta en producción de la versión 7.13 en el registro de opciones, solo se podrá seleccionar Compra o Venta en el campo “Clase”. El tipo de opción (Call / Put) se seleccionará en el nuevo campo “Clase opción”, este nuevo campo se podrá identificar:

* **API:** Tipo de Mensaje **“Orden\_Transaccion”, clase\_mensaje = 5, Campo "tipo\_transacción”** **= C (Call)/ P (Put)**
* **Archivo plano:** Clase mensaje= 5 **(posición 66),** tipo\_transaccion **(posición 1620) = C (Call)/ P (Put)**
* **XML: Para ingresar el nuevo campo “Clase opción” se adiciona el tag** <clase\_opcion></ clase\_opcion >. Las posibles valores son (Call / Put)

## **SE ELIMINA LA OPCIÓN “MODIFICAR CÓDIGO DE NEGOCIACIÓN”**

A partir de la puesta en producción de la versión 7.13, se eliminara la opción clic derecho “modificar código de negociación” para las operaciones que hacen parte del cálculo de la TRM. Para realizar el cambio del código de negociación de otros sistemas es necesario realizar el proceso de modificación mediante la lectura del tipo de mensaje= **“Orden\_Transaccion”** (API), **clase\_mensaje = 53** (API/Archivo plano).

El mensaje clase **“Orden\_Transaccion”** (API), **clase\_mensaje = 41** (API/Archivo plano), ya no estará habilitado en el sistema.

Cualquier duda al respecto de esta información, puede ser enviada al correo [Soportesetfx@set-icap.co](mailto:Soportesetfx@set-icap.co) o al número telefónico 57 1 7427778.