

**CIRCULAR REGLAMENTARIA DEL  
SISTEMA SET-FX PARA MECANISMOS  
ESPECIALES DE NEGOCIACIÓN (MEN) –  
SERVICIO SET-FIX**

## Tabla de contenido

<b>1</b>	<b>GENERALIDADES.....</b>	<b>3</b>
<b>2</b>	<b>ETAPAS ANTES DE LA ENTRADA AL AMBIENTE DE PRODUCCIÓN .....</b>	<b>3</b>
2.1	Solicitud de inicio del proceso .....	3
2.2	Requerimientos mínimos para la conexión al ambiente de pruebas .....	4
2.3	Proceso de Certificación de Desarrollos .....	4
<b>3</b>	<b>AMBIENTE DE PRODUCCIÓN.....</b>	<b>5</b>
3.1	Entrega de credenciales.....	5
3.2	Conexión al Ambiente de Producción .....	6
3.3	Condiciones Especiales de los Ambientes de Producción.....	6
3.4	Desconexión y reconexión.....	6
<b>4</b>	<b>REPETICIÓN DEL PROCESO DE CERTIFICACIÓN.....</b>	<b>7</b>
<b>5</b>	<b>PERIODO DE TRANSICIÓN .....</b>	<b>7</b>

## 1 GENERALIDADES

SET ICAP FX S.A, Sociedad Administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas “SET-FX”, publica para conocimiento de todos sus afiliados la Circular Reglamentaria No 001 de 2018, la cual imparte instrucciones relacionadas con el funcionamiento de los “*Mecanismos Especial de Negociación*” (en adelante “MEN”) en desarrollo de lo establecido en el literal “w” del Artículo 2.1.1.2 del Reglamento del Sistema SET-FX.

De conformidad con el Reglamento del Sistema, un MEN es un medio por el cual, de manera automática, un Afiliado puede ingresar, modificar y retirar posturas, así como realizar transacciones en el Sistema, el cual deberá ser previamente aprobado por el Administrador para su funcionamiento.

Los desarrollos realizados por los Afiliados deberán ajustarse a las reglas establecidas en el documento “*Rules of Engagement*” y sus anexos, los cuales son informados al mercado mediante Boletines Informativos y/o Circulares, en atención a lo establecido en el Reglamento de Funcionamiento del Sistema.

Los MEN podrán conectarse al Sistema SET-FX únicamente a través del servicio SET-FIX, correspondiente al Protocolo FIX 5.0 SP2, el cual está disponible a partir del 19 de febrero de 2018, fecha del lanzamiento de la nueva versión del sistema SET-FX. Aquellos Afiliados que a la fecha cuenten con un MEN que se conecte al Sistema SET-FX a través de un servicio diferente a SET-FIX, deberán remitirse al numeral 6 – Periodo de Transición – de la presente Circular.

Los Afiliados al Sistema SET-FX son los únicos que podrán utilizar el Servicio SET-FIX. En este sentido, los desarrollos internos hechos por los Afiliados a través de un tercero no eximen de la responsabilidad reglamentaria y legal al Afiliado, y para todos los eventos, deberán ser comunicados al Administrador del Sistema antes de iniciar el proceso de certificación del MEN.

**Aquellos Afiliados y personas jurídicas que solo reciban información a través del Servicio SET-FIX y no desarrollen un MEN, les serán aplicables las normas propias establecidas en el contrato de provisión de información que suscriban con SET-ICAP, así como lo establecido en las Circulares, Boletines Informativos y demás documentos que los complementen o modifiquen.**

## 2 ETAPAS ANTES DE LA ENTRADA AL AMBIENTE DE PRODUCCIÓN

### 2.1 Solicitud de inicio del proceso

El Afiliado interesado en desarrollar un MEN deberá remitir al Administrador del Sistema SET-FX una comunicación, firmada por Representante Legal, manifestando su intención de vincularse al servicio SET-FIX e informando los contactos tecnológicos, comerciales y operativos que serán responsables por el MEN. De igual

manera debe formalizar el número de usuarios o clientes FIX que requiere y los perfiles de los mismos.

## **2.2 Requerimientos mínimos para la conexión al ambiente de pruebas**

Los requerimientos mínimos que debe cumplir un Afiliado para tener acceso a dicho ambiente de pruebas son:

- a) Implementar una *Virtual Private Network* (VPN). Es importante tener en cuenta que el rendimiento del ambiente de pruebas depende de la calidad de la conexión VPN establecida por el Afiliado, por lo cual el Administrador no se hace responsable del rendimiento, la disponibilidad y los tiempos de latencia.

Para tal fin, el contacto técnico deberá diligenciar el formato “Acceso VPN ambiente de pruebas SET-FIX”, y enviarlo al Administrador al correo electrónico [soportesetfx@set-icap.co](mailto:soportesetfx@set-icap.co).

- b) Gestionar los permisos de red (dirección IP y puertos) dentro del firewall del Afiliado y solicitar los permisos correspondientes para acceder a las direcciones IP y a los puertos establecidos por el Administrador. Las direcciones y puertos serán informadas directamente a los Afiliados antes de iniciar el proceso de pruebas.
- c) Diligenciar y enviar al Administrador del Sistema el Formato “Solicitud Usuario de Ambiente de Pruebas y Certificación - Servicio SET-FIX” para proceder a la creación de los usuarios del ambiente de pruebas.

Una vez el Administrador verifique las condiciones de conectividad y cumplimiento de los requisitos por parte del Afiliado, procederá a hacer entrega vía correo electrónico del usuario y la contraseña a los contactos establecidos en el formato “Solicitud Usuario de Ambiente de Pruebas y Certificación - Servicio SET-FIX” para el acceso al ambiente de pruebas.

**Todos los Afiliados que deseen probar sus desarrollos en el ambiente de pruebas, deberán seguir los lineamientos establecidos en el documento “SET-FIX Basic Guide for Testing” (*Guía Básica de Pruebas para SET-FIX*), el cual servirá únicamente como guía al Afiliado para probar sus desarrollos.**

## **2.3 Proceso de Certificación de Desarrollos**

Una vez los Afiliados hayan realizado todas las pruebas sobre sus desarrollos, estos deben surtir un proceso de certificación antes de establecer una conexión con el ambiente de producción.

El proceso de certificación es la etapa en la cual el Administrador del Sistema realiza diferentes validaciones para verificar que los desarrollos realizados por los afiliados tengan un funcionamiento adecuado. En la fase de certificación, el Afiliado deberá

completar exitosamente las pruebas especificadas en el documento “SET-FIX Bitácora de Certificación”

Para realizar las pruebas de certificación, el Afiliado debe agendar dichas pruebas con al menos dos (2) días hábiles de anticipación, a través de la línea de teléfono de Soporte SET-FX (+571) 7427778 indicando los productos que desea certificar a través del formato “Solicitud Ingreso Ambiente de Pruebas y Certificación - Servicio SET-FIX”. Este formato debe ser diligenciado cada vez que el desarrollo haya sufrido cambios o modificaciones, teniendo en cuenta que los servicios a certificar pueden ser distintos en cada momento.

El Equipo de Soporte de SET-FX enviará vía correo electrónico el horario y el formato “SET-FIX Bitácora de Certificación” que la entidad debe desarrollar para cada uno de los productos a certificar. Durante el horario agendado para la certificación, el Afiliado tendrá atención a través de servicio telefónico del Equipo de Soporte de SET-FX.

El Afiliado deberá remitir al correo electrónico [soportesetfx@set-icap.co](mailto:soportesetfx@set-icap.co) el formato “SET-FIX Bitácora de Certificación” debidamente diligenciado con los resultados. El Administrador validará los resultados y dará su concepto sobre la aprobación o rechazo de las pruebas a través de correo electrónico.

La certificación tendrá una vigencia de treinta (30) días calendario y durante este periodo el Afiliado puede solicitar el paso al ambiente de producción. Sin embargo, si el Administrador evidencia durante dicho periodo que el Afiliado debe certificar algún cambio, lo informará a este y solicitará nuevamente que se realice el proceso de certificación.

Nota: Cada vez que el afiliado realice alguna actualización o modificación a sus desarrollos de Software sobre el servicio SET-FIX deberá informar al Administrador del Sistema e iniciar nuevamente el proceso de certificación.

### **3 AMBIENTE DE PRODUCCIÓN**

#### **3.1 Entrega de credenciales**

Una vez concluido el proceso de certificación, el Administrador del Sistema entregará a las personas indicadas en el documento “Formato de Productos Contratados - Servicio SET-FIX”, las credenciales de acceso (nombre de usuario, contraseña de acceso, direcciones IP, Puertos, etc.) para ingresar al ambiente de producción.

El desarrollo del Afiliado debe hacerse de manera que la contraseña sea cambiada inmediatamente al momento en que se reciba por primera vez, cambio que deberá adelantarse sucesivamente y de manera obligatoria cada treinta (30) días. Cabe resaltar que este proceso deberá ser programado en los desarrollos del afiliado.

Es importante tener en cuenta que esta clave será bloqueada si se ingresa de manera errónea en tres (3) ocasiones consecutivas, en cuyo caso el Afiliado deberá

comunicarse con el Equipo de Soporte del Sistema SET-FX para tramitar su desbloqueo.

Sin perjuicio de lo anterior, y al tenor de lo expuesto en el artículo 1.1.3.19 del Reglamento de Funcionamiento del Sistema, el Afiliado será responsable por el uso que sus Operadores hagan de las claves de acceso a través de los Mecanismos Especiales de Negociación y deberá velar porque las mismas se mantengan y usen bajo estricta reserva y seguridad, de conformidad con lo previsto en el Reglamento de funcionamiento del Sistema y en las circulares que lo complementen.

El usuario del Mecanismo Especial de Negociación deberá ser un Operador Transaccional en el sistema SET-FX y será responsable por la ejecución del MEN.

### **3.2 Conexión al Ambiente de Producción**

Es importante resaltar que la conexión del desarrollo del Afiliado con el ambiente de producción debe realizarse a través de un canal dedicado con las condiciones de ancho de banda y demás establecidas en el documento “*Rules of Engagement*”. El Afiliado deberá reportar al Administrador las novedades que se puedan presentar con el Servicio SET-FIX.

### **3.3 Condiciones Especiales de los Ambientes de Producción**

El MEN desarrollado por el Afiliado deberá controlar el envío de posturas por segundo. El máximo de posturas enviadas no podrá superar el límite establecido por el Administrador en el documento “*Rules of Engagement*”.

**Parágrafo.-** Para los mercados Spot y Next Day USD/COP el servicio SET-FIX contempla un control especial para el ingreso de posturas. Este control establece que el Afiliado no podrá ingresar vía MEN posturas cuyo precio tenga una diferencia superior a 10 veces el valor máximo de variación definido en el sistema SET-FX respecto de la mejor postura de demanda u oferta en ese momento, según sea el caso. Aquellas posturas que superen dicho valor serán rechazadas por el Sistema.

### **3.4 Desconexión y reconexión**

En los casos en los que el Administrador considere que un MEN implementado por un Afiliado pueda estar afectando el curso normal del proceso de negociación, o se evidencie un incumplimiento de los documentos que reglamentan la utilización y conexión del MEN, el usuario será desconectado del Sistema hasta tanto se establezca el servicio, en atención a lo expuesto por el Reglamento de Funcionamiento del Sistema SET-FX.

Una vez solucionado los inconvenientes y/o errores, el Afiliado deberá enviar al Administrador del Sistema la solicitud de reactivación del servicio.

SET-FIX valida si una sesión establecida por un MEN está activa, mediante el mensaje Heartbeat y el valor de la secuencia contenida en este. El Heartbeat por especificación

FIX es de 30 segundos. Si en la sesión activa el mensaje de heartbeat no llega continuamente cada 30 segundos al SET-FIX o si la secuencia contenida en el mensaje no coincide con el orden establecido; SET\_FIX cerrará la conexión y las posturas u órdenes serán retiradas automáticamente del sistema.

Ante un evento de desconexión abrupta, intermitencia o fallas en la comunicación del MEN con el servidor que provee el servicio SET-FIX, el sistema detectará inmediatamente esta situación; declara cerrada la sesión y retira de igual manera las posturas u órdenes del MEN en el sistema.

El Administrador recuerda a sus Afiliados que en el evento de presentarse inconvenientes en el ambiente de producción, deben comunicarse de manera inmediata con la línea de Soporte SET-FX (+571) 7427778 o al correo [soportesetfx@set-icap.co](mailto:soportesetfx@set-icap.co)

#### **4 REPETICIÓN DEL PROCESO DE CERTIFICACIÓN**

El Administrador se reserva el derecho de solicitar cuantas veces considere necesario al Afiliado el proceso de certificación del MEN, cuando:

- Exista un nuevo cambio en el MEN del Afiliado. Será obligación del Afiliado informar cualquier cambio en el MEN al Administrador del Sistema SET-FX.
- Se modifique la funcionalidad del servicio ofrecido por el Administrador.
- Se incluya un nuevo campo que debe ser recibido de manera obligatoria y sea necesario para el MEN.
- Se presenten desconexiones en el usuario MEN que afecten el normal funcionamiento del Sistema SET-FX.
- Se evidencie un comportamiento que no haya sido detectado durante el proceso de certificación.

#### **5 PERIODO DE TRANSICIÓN**

Los Afiliados que actualmente tienen implementados MEN en el mercado a través de otros mecanismos diferentes al SET-FIX, contarán con un periodo de transición que finaliza el 31 de diciembre de 2018.

Durante el periodo de transición, los Afiliados no podrán eximirse de las responsabilidades que para tal efecto sean aplicables a los MEN establecidas en el Reglamento de funcionamiento del Sistema SET-FX. Bajo ninguna circunstancia, este periodo de transición implica una certificación temporal a los Afiliados.

Sin otro particular,

(Original firmado)

**ANDRÉS MACAYA DÁVILA**

Presidente