



INSTRUCTIVO DE CAMBIOS EN VERSION 7.02z DEL SISTEMA SET-FX

(INTERFACES DAPI Y ARCHIVO PLANO)

Noviembre 2018

CONTENIDO

INTRODUCCIÓN	3
NUEVO TIPO DE ENTIDAD “ENTIDAD VIGILADA TRM”	4
BENEFICIARIO Y TERCERO OFFSHORE	5
MODIFICACIÓN OPERACIONES SOBRE PRODUCTOS DERIVADOS	10

INTRODUCCIÓN

El presente documento tiene como principal propósito facilitar el entendimiento por parte de las entidades afiliadas al Sistema SET-FX, sobre los cambios en las estructuras del “Archivo plano” y “DAPI”, teniendo en cuenta la Circular Reglamentaria DODM 317 del Banco de la República.

La nueva versión del sistema, la cual se va a implementar el próximo 15 de diciembre de 2018, incluye las siguientes modificaciones:

- Adicionar un nuevo tipo de entidad “Entidad vigilada TRM”.
- En las operaciones entre Intermediarios del mercado cambiario (IMC) y sus clientes, se incluye dentro del registro un nuevo campo para identificar el Ordenante o Beneficiario final de la operación.
- Las operaciones de productos derivados (Forward, Swaps, Opciones) podrán ser modificadas en todas sus condiciones hasta su día de cumplimiento.

Es indispensable que las entidades actualicen las interfaces e implementen los cambios que surgen con esta versión, con el fin de cumplir con los requerimientos del Banco de la República y la Superintendencia Financiera de Colombia (SFC).

NUEVO TIPO DE ENTIDAD “ENTIDAD VIGILADA TRM”

Teniendo en cuenta la nueva regulación del Banco de la República y con el fin de facilitar la identificación de operaciones que se computan para el cálculo de la TRM, se ha actualizado el tipo de entidades en el sistema SET-FX incluyendo una nueva clase de entidad denominada “Entidad Vigilada TRM”.

A continuación se presenta la nueva lista de tipos de entidad en el sistema SET-FX:

Tipo Entidad	Identificación API
Real	R
Empresas Vigiladas (excepto TRM)	V
Entidades vigiladas TRM	T
Empresas del exterior	E

La identificación del nuevo tipo de entidad “Entidades vigiladas TRM, se realiza bajo la letra “T” y estará incluida dentro del mismo campo en que hoy día se encuentran las otras identificaciones (R, V, E).

Cambios dentro del DAPI.

Se incluye una nueva letra “T” para identificar las “Entidades vigiladas TRM”. Este campo aparecerá en:

1. bandera_tipo_entidad_contraparte: identifica el tipo de entidad de la contraparte
2. tipo_entidad_comitente_contraparte: identifica el tipo de entidad del beneficiario

Cambios dentro del Archivo Plano

Se incluye una nueva letra “T” para identificar las “Entidades vigiladas TRM”. Este campo aparecerá en:

1. tipo_entidad_comitente_contraparte: identifica el tipo de entidad de la contraparte (posición 518).
2. tipo_entidad_comitente_contraparte: identifica el tipo de entidad del Beneficiario (posición 1360).

BENEFICIARIO Y TERCERO OFFSHORE

Según la nueva reglamentación en las operaciones entre IMCs y Clientes se debe incluir en el registro de cualquier operación el campo “Ordenante o Beneficiario” (cuando sea posible su identificación) con su tipo de identificación, identificación, nombre y si este es residente o no (Bandera Tercero Offshore).

Es importante recordar que el registro de operaciones entre IMCs y Clientes se efectúa hoy en día el mercado 174.

A continuación se ilustran los nuevos campos en la pantalla de registro.

Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: Hecho por: Yo AVVB Mi usuario: ANDRES Empleados

Contraparte Empresas del exterior ID: Nuevo ID

☒ Beneficiario: Cédula de extranjero ID: 310248 KENNETH WAYNE BROWN

Comentario: Tercero Offshore

Par de monedas: Peso Dolar

Monto: (Unidades)

Tasa de cambio: Tasa pool:

Origen:

Negociado en:

Fecha anterior: Hora: (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Teniendo en cuenta lo anterior se describen a continuación:

Cambios dentro del DAPI

Como requerimiento primordial para la actualización del DAPI se hace necesario instalar la versión 2.024 de la librería de funcionamiento, la cual se puede descargar en el link <http://www.set-fx.com/content/mercadocambiario/descargas/index.html>

Campos para identificar el beneficiario y tercer offshore (Residente):

bandera_comitente_contraparte	tipo_id_comitente_contraparte	id_comitente_contraparte	tipo_entidad_comitente_contraparte	bandera_on_off_screen
S	N	0007118702	T	S

1. bandera_comitente_contraparte: Al marcar el Checkbox “Beneficiario” en la pantalla de registro de operaciones, en el mensaje “orden_transaccion”, viaja una letra “S” indicando que existe un beneficiario u ordenante.

☒ Beneficiario :

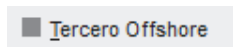
2. tipo_id_comitente_contraparte: Este campo identifica el tipo de ID del beneficiario según el siguiente listado:

Tipo ID	Identificación API
Cédula	C
Cédula nueva	D
Nit Entidades	N
Nit Entidad vigilada TRM	N
Pasaporte	P
Tarjeta de identidad	T
Tarjeta de identidad nueva	I
Cédula de extranjero	E
Registro civil	R
Empresas del exterior	X
Código Swift	S

3. id_comitente_contraparte: Número de identificación del Beneficiario u Ordenante (15 caracteres).
4. tipo_entidad_comitente_contraparte: identifica el tipo de entidad del Beneficiario, según la siguiente tabla:

Tipo Entidad	Identificación API
Real	R
Empresas Vigiladas (excepto TRM)	V
Entidad vigilada TRM	T
Empresas del exterior	E

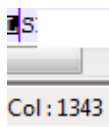
5. bandera_on_off_screen: Al marcar el Checkbox “Tercero offshore”, en el mensaje **“orden_transaccion”** se envía una letra **“S”** indicando que el Beneficiario es residente.



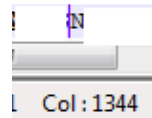
Cambios dentro del Archivo plano

Campos para identificar el beneficiario y tercero offshore:

1. bandera_comitente_contraparte: Se envía la letra “S” si se marca el Checkbox Beneficiario en la posición 1343.

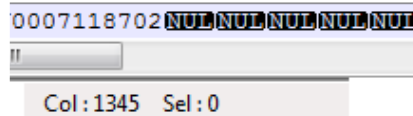


2. tipo_id_comitente_contraparte: Este campo identifica el tipo de ID del beneficiario (posición 1344).



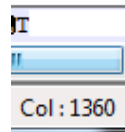
N
Col: 1344

3. id_comitente_contraparte: Este campo tiene el número de identificación del Beneficiario u Ordenante (posición 1345).



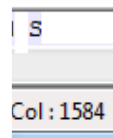
0007118702NULNULNULNULNUL
Col: 1345 Sel: 0

4. tipo_entidad_comitente_contraparte: Identifica el tipo de entidad del Beneficiario (posición 1360).



IT
Col: 1360

5. bandera_on_off_screen: Al marcar el Checkbox “Tercero offshore” se envía la letra “S” indicando que el Beneficiario es residente (posición 1584).

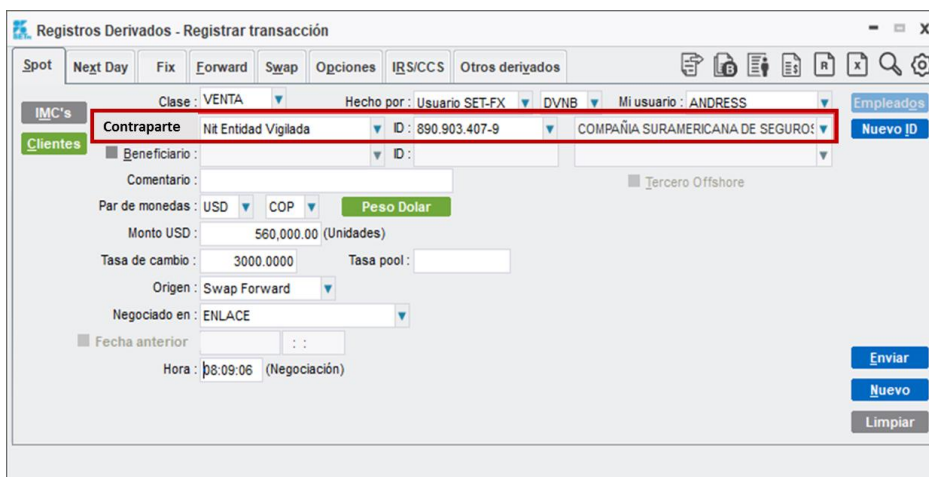


S
Col: 1584

Contraparte

Ejemplos:

1. Registro con Entidad Vigilada TRM sin Beneficiario.



Registros Derivados - Registrar transacción

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

Clase: VENTA Hecho por: Usuario SET-FX DVNB Mi usuario: ANDRESS Empleados

Contraparte Nit Entidad Vigilada ID: 890.903.407-9 COMPANIA SURAMERICANA DE SEGUROS Nuevo ID

Beneficiario: ID: Tercero Offshore

Comentario:

Par de monedas: USD COP **Peso Dolar**

Monto USD: 560,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 3000.0000 Tasa pool:

Origen: Swap Forward

Negociado en: ENLACE

Fecha anterior: Hora: 08:09:06 (Negociación)

Enviar Nuevo Limpiar

Cambios dentro del DAPI

Field Name	Value
bandera_tipo_entidad_contraparte	T

Cambios dentro del Archivo Plano

transmo1.txt

1	N8909034079	NUL	NUL	NUL	NUL	NUL	NUL	NUL	NUL	NUL	USD	NUL	0.00
2													

length : 1.656 lines : 2 Ln : 1 Col : 518 Sel : 0 | 0 Windows (CR LF) ANSI INS

2. Registro con Entidad Vigila con Beneficiario

Registros Derivados - Registrar transacción

SpotNext DayFixForwardSwapOpcionesIRS/CCSOtros derivados

Clase: VENTAHecho por: Usuario SET-FX DVNB Mi usuario: ANDRESS Empleados

IMC's

Cientes

Contraparte Nit Entidad Vigilada ID: 890.903.407-9 COMPAÑIA SURAMERICANA DE SEGUROS

Beneficiario Empresas del exterior ID: 045 CITIBANK NA LONDON

Comentario:

Tercero Offshore

Par de monedas: USD COP Peso Dolar

Monto USD: 560,000.00 (Unidades)

Tasa de cambio: 3120.0000 Tasa pool:

Origen: Swap Forward

Negociado en: ICAPCO

Fecha anterior

Hora: 08:09:06 (Negociación)

Enviar

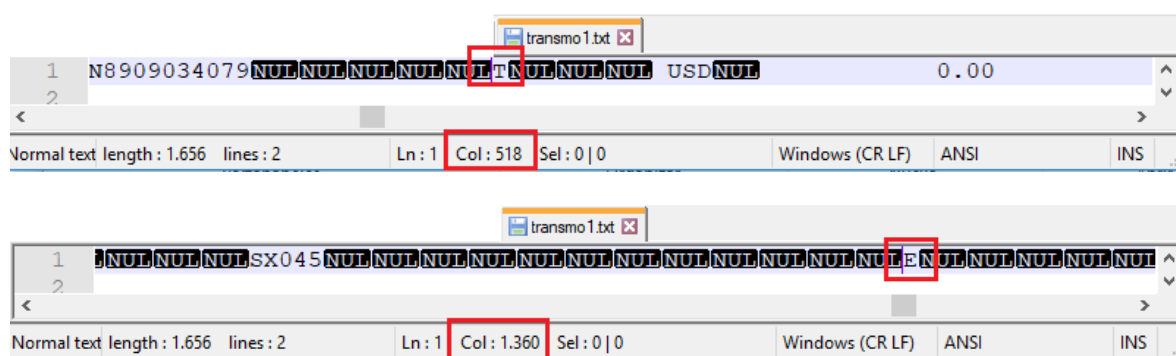
Nuevo

Limpiar

Cambios dentro del DAPI

Field Name	Value
tipo_identificacion_contraparte	N
identificacion_contraparte	8909034079
bandera_tipo_entidad_contraparte	T
bandera_comitente_contraparte	S
tipo_id_comitente_contraparte	X
id_comitente_contraparte	45
tipo_entidad_comitente_contraparte	E

Cambios dentro del Archivo Plano



Consideraciones especiales DAPI y Archivo Plano

nombre_tasa_interes_moneda_1: Reduce tamaño de 46 a 20 caracteres (posición 731).

nombre_tasa_interes_moneda_2: Reduce tamaño a 20 caracteres (posición 1303).

MODIFICACIÓN OPERACIONES SOBRE PRODUCTOS DERIVADOS

Con la entrada en vigencia de la nueva reglamentación del Banco de la Republica, los registros de las operaciones sobre productos derivados podrán ser modificados en cualquiera de sus características durante su tiempo de vigencia.

Las modificaciones que contemplen cambios de “Clase” (Compra/Venta), contraparte u hora de negociación, se les dará un tratamiento especial anulando la operación inicial e ingresando una nueva en el sistema.

Esto generara:

Cambios dentro del DAPI

El administrador del sistema dará el permiso de anulación para la operación específica y en ese momento llegará un mensaje **orden-transacción, clase_mensaje “37”** con las siguientes características:

1. bandera_permiso_anulacion: Razón de la anulación:

Razón de anulación	Identificación API
Modificación	M
Error	E

2. fecha_original: Fecha del día que se registró la operación.

Una vez se ejecute la anulación llega el mensaje **orden-transacción, clase_mensaje “52”** para los DAPI tipo Banco y **orden-transacción, clase_mensaje “51”** para los DAPI tipo Cámara; estos mensajes incluyen los campos listados a continuación para permitir trazabilidad.

1. bandera_permiso_anulacion: Razón de la anulación:

Razón de anulación	Identificación API
Modificación	M
Error	E

fecha_original: Fecha del día que se registró la operación hoy o día anterior.

Posteriormente a la anulación, se procede a ingresar la nueva operación.

Cambios dentro del Archivo Plano

El administrador del sistema dará el permiso de anulación para la operación específica. En este caso no se generará ningún mensaje relacionado a esta acción.

Una vez se ejecute la anulación llega el mensaje **clase_mensaje “50”** con los siguientes campos para poder identificar la anulación de esa operación.

1. bandera_permiso_anulacion: Razón de la anulación (posición 121 – 1 carácter).

Razón de anulación	Identificación API
Modificación	M
Error	E

N
Col: 121

2. fecha_original: Fecha del día que se registró la operación hoy o día anterior (posición 1643).

20181031
Col: 1643 Sel