**No.109 / Agosto 13 de 2021**

**ASUNTO: Cambios Nueva Versión 2021 del Sistema de Información SMART**

La Cámara informa a sus Miembros la implementación de la **Nueva Versión 2021 del Sistema de Información SMART**, la cual comenzará a operar a partir del **16 de noviembre de 2021.** Los cambios que se producirán en las tablas Meff Server y Meff Station son:

**Cambios Tablas Meff Server**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tipos de contrato: CCONTRTYP.DB**  Campo Eliminado | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Descripción** |
| ~~9~~ |  | ~~CFICode~~ | ~~String(6)~~ | ~~Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962~~ |
| ~~Ver Tabla 16 en documento “Tablas de Codificación”~~ |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Parámetros de la matriz de garantías: CVALARRAYS.DB**  Campo Agregado | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Descripción** |
| 14 |  | NumColsLPos | Smallint | Número de Columnas para grandes posiciones |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Comisiones: CFEES.DB**  Campo Agregado | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Descripción** |
| 11 |  | ComisionPorConcepto | Float | Comisión que se aplica para este concepto |

**Cambios Tablas Meff Station**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Información diaria de contratos: CCONTRSTAT.ch** Campo Nuevo | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 21 |  | NextDaySwapPoints | Price |  | Puntos Swap aproximados para la siguiente sesión |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Parámetros de la matriz de garantías: CVALARRAYS.ch** Campo Nuevo | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 16 |  | NumberOfColumnsLPos | Int | <=16 | Número de Columnas para grandes posiciones |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Detalle de entrega física de gas: CPHYSDELDETS.ch** Tabla Nueva | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 1 | Ñ | SessionDate | LocalDate |  | Fecha de sesión |
| 2 | Ñ | ContractGroup | String(2) |  | Código de grupo de contratos |
| 3 |  | ClearingMember | String(4) |  | Miembro Compensador |
| 4 | Ñ | Member | String(4) |  | Miembro |
| 5 | Ñ | PositionAccount | String(5) |  | Cuenta de posición |
| 6 | Ñ | Infraestructure | String(10) | “PVB”=Punto Virtual de Balance Español | Infraestructura |
| 7 |  | EICcode | String(16) |  | Código EIC |
| 8 | Ñ | ContractCode | String(22) |  | Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega |
| 9 | Ñ | DeliveryDate | LocalDate |  | Fecha de entrega |
| 10 | Ñ | SettlPrice | Price |  | Precio de liquidación |
| 11 |  | Side | char | "1"=Compra | Signo de la operación a liquidar |
| "2"=Venta |
| 12 |  | Quantity | Qty |  | Número de contratos a entregar |
| 13 |  | QuantityToDeliver | float |  | Cantidad a entregar |
|
| 14 |  | UnitOfMeasure | Char(20) |  | Unidad de medida de la cantidad a entregar |
| 15 |  | NominationStatus | char | “P”=Previsión | Estado de la nominación |
| “N”=Notificación |
| “A”=Aceptada |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Comisiones Ajuste de posición: CPOSADJFEE.ch** Tabla Nueva | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 1 | Ñ | SessionDate | LocalDate |  | Fecha de sesión |
| 2 | Ñ | ContractGroup | String(2) |  | Código de grupo de contratos |
| 3 | Ñ | ClearingMember | String(4) |  | Miembro Compensador |
| 4 | Ñ | Member | String(4) |  | Miembro |
| 5 | Ñ | PositionAccount | String(5) |  | Cuenta de posición |
| 6 | Ñ | ContractCode | String(22) |  | Código de contrato |
| 7 | Ñ | Currency | Currency | ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación” | Divisa en la que están expresadas las comisiones |
|
| 8 |  | ClearingFee | Amt |  | Comisión de Liquidación |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Liquidación de entregas de gas por cuenta de garantías: CDELIVESETTL.ch** Tabla Nueva | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 1 | Ñ | SessionDate | LocalDate |  | Fecha de sesión |
| 2 | Ñ | ContractGroup | String(2) |  | Código de grupo de contratos |
| 3 | Ñ | MarginAccountMember | String(4) |  | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 4 | Ñ | MarginAccount | String(12) |  | Cuenta de garantías |
| 5 | Ñ | ContractCode | String(22) |  | Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega |
| 6 | Ñ | Currency | Currency | ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación” | Divisa |
| 7 | Ñ | Infraestructure | String(10) | “PVB”=Punto Virtual de Balance Español | Infraestructura |
| 8 | Ñ | SettlPrice | Price |  | Precio de liquidación |
| 9 | Ñ | SettlDate | LocalDate |  | Fecha de Liquidación monetaria |
| 10 |  | DeliveryAmt | Amt |  | Importe efectivo antes de impuestos (\*) |
| 11 |  | TaxRate | Amt |  | % Impuesto |
| 12 |  | TaxAmount | Amt |  | Importe impuesto (\*) |
| 13 |  | GrossDeliveryAmt | Amt |  | Importe Efectivo incluidos impuestos (\*) |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión: CCPALLOCAS.ch** Tabla Nueva | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 1 | Ñ | SessionDate | LocalDate |  | Fecha de sesión |
| 2 | Ñ | CCPCode | String(2) |  | Código de contrapartida central |
| 3 | Ñ | ContractGroup | String(2) |  | Código de grupo de contratos |
| 4 | Ñ | ClearingMember | String(4) |  | Miembro Compensador |
| 5 | Ñ | CollateralAccountMember | String(4) |  | Miembro al que pertenece la cuenta de colateral |
| 6 | Ñ | CollateralAccount | String(12) |  | Cuenta de colateral |
|
| 7 | Ñ | AssetCode | String(12) |  | Código del activo entregado |
| Nótese que el código ISIN para el Euro es “EU0009656420” |
| 8 | Ñ | MarginInstrument | char | ver Tabla 6 en documento “Tablas de Codificación” | Modo de materialización de garantías |
| 9 |  | AssetType | String(3) | ver Tabla 2 en documento “Tablas de Codificación” | Tipo de activo entregado |
| 10 |  | AssetDescription | String(40) |  | Descripción del activo entregado |
| 11 |  | AssetCSD | String(20) | ver Tabla 15 en documento “Tablas de Codificación” | Nombre del Depositario Central del activo |
| 12 |  | Haircut | float |  | Coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento. |
| 13 |  | AssetPrice | Price |  | Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido |
| 14 |  | Nominal | Float |  | Valor nominal del colateral total asignado a la cuenta. |
| 15 |  | AssetValue | Amt |  | Valoración del colateral total asignado a la cuenta (Nominal \* Precio \* Haircut). |
| 16 | Ñ | Currency | Currency | ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación” | Divisa en la que están expresados los importes de este registro |
| 17 | Ñ | CSDCode | char | ver Tabla 15 en documento “Tablas de Codificación” | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía |
| 18 |  | NominalRequired | Float |  | Valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta |
| 19 |  | AssetValueRequired | Amt |  | Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta |
| 20 |  | NominalExcess | Float |  | Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta |
| 21 |  | AssetValueExcess | Amt |  | Valoración del exceso de nominal asignado. |
| 22 |  | ValueDate | LocalDate |  | Fecha valor de los asignados (siguiente día hábil a la fecha sesión). |
| 23 | Ñ | CollateralSourceAccount | String(12) |  | Indica el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer. |
| 24 |  | Field1 | String(20) |  | \*         Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) |
| Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3) |
| 25 |  | Field2 | String(20) |  | \*         Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) |
| Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7) |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Colateral asignado a cada cuenta de colateral: CCPALLOCBS.ch** Tabla Nueva | | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Tipo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
| 1 | Ñ | SessionDate | LocalDate |  | Fecha de sesión |
| 2 | Ñ | CCPCode | String(2) |  | Código de contrapartida central |
| 3 | Ñ | ContractGroup | String(2) |  | Código de grupo de contratos |
| 4 | Ñ | ClearingMember | String(4) |  | Miembro Compensador |
| 5 | Ñ | CollateralAccountMember | String(4) |  | Miembro al que pertenece la cuenta de colateral |
| 6 | Ñ | CollateralAccount | String(12) |  | Cuenta de colateral |
|
| 7 | Ñ | AssetCode | String(12) |  | Código del activo entregado. |
| Nótese que el código ISIN para el Euro es “EU0009656420” |
| 8 | Ñ | MarginInstrument | char | ver Tabla 6 en documento “Tablas de Codificación” | Modo de materialización de garantías |
| 9 |  | AssetType | String(3) | ver Tabla 2 en documento “Tablas de Codificación” | Tipo de activo entregado |
| 10 |  | AssetDescription | String(40) |  | Descripción del activo entregado |
| 11 |  | AssetCSD | String(20) | ver Tabla 15 en documento “Tablas de Codificación” | Nombre del Depositario Central del activo |
| 12 |  | Haircut | float |  | Coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento. |
| 13 |  | AssetPrice | Price |  | Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido |
| 14 |  | Nominal | Float |  | Valor nominal del colateral total asignado a la cuenta. |
| 15 |  | AssetValue | Amt |  | Valoración del colateral total asignado a la cuenta (Nominal \* Precio \* Haircut). |
| 16 | Ñ | Currency | Currency | ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación” | Divisa en la que están expresados los importes de este registro |
| 17 | Ñ | CSDCode | char | ver Tabla 15 en documento “Tablas de Codificación” | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía |
| 18 |  | NominalRequired | Float |  | Valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta |
| 19 |  | AssetValueRequired | Amt |  | Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta |
| 20 |  | NominalExcess | Float |  | Valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta. |
| 21 |  | AssetValueExcess | Amt |  | Valoración del exceso de nominal asignado. |
| 22 |  | ValueDate | LocalDate |  | Fecha valor de los asignados (sesión en curso, SessionDate). |
| 23 | Ñ | CollateralSourceAccount | String(12) |  | Indica el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer. |
| 24 |  | Field1 | String(20) |  | \*         Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) |
| Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3) |
| 25 |  | Field2 | String(20) |  | \*         Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) |
| Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central: CCPMARGINSCLM.ch.XML** Tabla Nueva | | | | |
| **#** | **\*** | **Campo** | **Valores válidos** | **Descripción** |
|  | 7.2.3.1 | RequiredMarginMemberDetail |  | Desglose por Miembro de una garantía exigida (un elemento para cada Miembro) |
|  | 7.2.3.1.1 | Member |  | Miembro al que se exige la garantía |
|  | 7.2.3.1.2 | Amount |  | Importe de la garantía exigida |
|  | 8.2.3 | AmountDetail |  | Desglose de garantías depositadas según el MarginInstrument |
|  | 8.2.3.1 | CMBuffer |  | Total del valor efectivo depositado como colateral en la cuenta de colateral buffer del Compensador. |
|  | 8.2.3.2 | CMDefaultFund |  | Total del valor efectivo depositado como colateral en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund. |
|  | 8.2.3.3 | CMAdditionalMargin |  | Total del valor efectivo depositado como colateral cuentas de colateral que cubren garantías Individuales o Extraordinarias. |
|  | 9 | CashMovement |  | Movimientos de efectivo |
|  | 9.2 | CashMovementDetail |  | Desglose de movimientos de efectivo |
|  | 9.2.1 | CMBuffer |  | Movimiento de efectivo de efectivo en la cuenta de colateral buffer del Compensador. |
|  | 9.2.2 | CMDefaultFund |  | Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund. |
|  | 9.2.3 | CMAdditionalMargin |  | Movimiento de efectivo en cuentas de colateral cubren garantías Individuales o Extraordinarias. |
|  | 15 | IntradayAdditionalMargins |  | Garantías Intradía |
|  | 15.1 | MarginType | Ver Tabla 3 en documento “Tablas de codificación” | Tipo de garantía exigida intradía |
|  | 15.2 | ContractGroup |  | Grupo de contratos en el que se exige la garantía |
|  | 15.3 | Amount |  | Importe de la garantía exigida |
|  | 15.4 | RequiredMarginMemberDetail |  | Desglose por Miembro de una garantía exigida (un elemento para cada Miembro) |
|  | 15.4.1 | Member |  | Miembro al que se exige la garantía |
|  | 15.4.2 | Amount |  | Importe de la garantía exigida |

Cualquier inquietud, por favor comunicarse con la mesa de ayuda al **3277000 opción 4** o al correo **mesadeayuda@camaraderiesgo.com.co.**