**Solicitud de Requerimiento No**.**1**

**Fecha de Solicitud**: **24/02/2017**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Nombre del solicitante:**  Jaime Francisco Buritica Leal | **Identificación del área solicitante:**  Departamento de Tesorería | **Teléfono- extensión:**  Ext. 2721 | | **Aplicativo:**  **Plataforma COBIS** |
| **Nombre del requerimiento:**  Notificación de vencimientos Portafolio de Coberturas | | | **Prioridad:**  **Alta**  **X Media**  **Baja** | |
| **Objetivo**:  Se requiere que el sistema genere un mensaje de Notificación de Vencimientos de las operaciones NDF - OTC y NDF-CRCC que se realicen con destino al Portafolio de Coberturas. | | | | |
| **Participantes:**  Departamento de Tesorería | | | **Que temas se asocian o son prerrequisito o influyen en la elaboración del requerimiento a solucionar.**  Se requiere contar previamente con la creación del Portafolio de Cobertura. | |
| **Entradas:**  Corresponden a las operaciones NDF OTC y NDF – CRCC que se negocien con contrapartes locales y *Off-shore* y que tenga como destino el Portafolio de Cobertura. | | | | |
| **Salidas:**  Corresponde a las Notificaciones de Vencimiento generadas por el sistema sobre operaciones que venzan y que pertenezcan al Portafolio de Cobertura. | | | | |
| **Requerimiento *FRONT-OFFICE*:**  Se requiere mitigar los riesgos operativos y financieros que se podrían presentar por la “NO” renovación de una operación NDF-OTC o NDF-CRCC, según sea, exactamente en la fecha de vencimiento que se haya pactado y correspondan al Portafolio de Cobertura.  Por lo tanto, se solicita que el sistema genere un mensaje de “Notificación de Vencimiento” con dos (2) días de anticipación a la fecha de vencimiento de las operaciones que pertenezcan a dicho portafolio.  La Notificación de Vencimiento correspondiente deberá contener la siguiente información y ser enviada a los usuarios que se relacionan a continuación:   * ID de la operación * Tipo de operación (compra / venta) * Monto de la operación * Contraparte * Fecha de Negociación * Tasa Negociada   Los usuarios a quienes deberá ser enviada la notificación son:  Boris Roberto Quintero Restrepo  Lorena Arrieta Bula  Jaime Francisco Buritica Leal  David Andrés Rodríguez Navarro  Carlos Andrés Torres Gómez  Carlos Andrés Díaz Pérez  Se requiere que estos usuarios puedan ser modificados a necesidad del Banco. | | | | |