**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 RestrepoLorena Arrieta BulaJaime Francisco Buritica LealDavid Andrés Rodríguez NavarroCarlos Andrés Torres GómezCarlos Andrés Díaz PérezSe requiere que estos usuarios puedan ser modificados a necesidad del Banco. |