**Solicitud de Requerimiento No**.**2**

**Fecha de Solicitud**: **06/02/2017**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Nombre del solicitante:**  Jaime Francisco Buritica Leal | **Identificación del área solicitante:**  Departamento de Tesorería | **Teléfono- extensión:**  Ext. 2721 | | **Aplicativo:**  **Plataforma COBIS** |
| **Nombre del requerimiento:**  Afectación temporal y desafectación del límite de crédito contingente en operaciones *Fix Spot* y *FIX Forward*, afectación de posiciones y registros contables. | | | **Prioridad:**  **X Alta**  **Media**  **Baja** | |
| **Objetivo**:  Realizar la afectación temporal y desafectación del límite de crédito contingente que deben consumir las operaciones *Fix Spot y Fix Forward*. Adicionalmente, realizar las afectaciones automáticas de las posiciones de cada uno de los tipos de producto indicados así como también los registros contables necesarios. | | | | |
| **Participantes:**  Departamento de Tesorería | | | **Que temas se asocian o son prerrequisito o influyen en la elaboración del requerimiento a solucionar.**  Contar con la implementación de la versión de SET-FX que contiene la funcionalidad de registro de operaciones FIX. | |
| **Entradas:**  Corresponden a las operaciones que conforman el Portafolio de Coberturas. | | | | |
| **Salidas:**  Corresponden a las notificaciones automáticas generadas por el sistema de las operaciones que se vayan a vencer en los dos (2) días siguientes a la fecha del sistema. | | | | |
| 1. **Requerimientos *FRONT-OFFICE*:**    1. **Antecedentes**   Con ocasión de la entrada en vigencia de la norma con Circular Externa - DODM – 317 (Boletín No 36 del 26 de Junio de 2015) del Banco de República, sobre el registro de operaciones cuya tasa no se conoce al momento de la negociación, se relaciona a continuación los tipos de operación que cobija :   1. Operaciones *FIX Spot* (IMC – IMC) 2. Operaciones *FIX Forward* (IMC – IMC) (USD/COP) 3. Operaciones *FIX Spot* (IMC – Clientes) (USD/COP) 4. Operaciones *FIX Forward* (IMC – Clientes)   Donde, IMC = Intermediario del Mercado Cambiario   * 1. **Administración de Posiciones FIX**   Se requiere que el sistema realice los registros de las operaciones FIX Spot y Forward y permita la correspondiente gestión por parte del usuario en la plataforma de forma automática.  La nueva normatividad del Banco de la República en cuanto al registro de estas operaciones, ha obligado a que el sistema transaccional de SET-FX tenga implementada las fechas de asignación de dichas operaciones que permita su registro y complementación.  El *Fix Spot* (Caja) se encuentra almacenado en el módulo Dólar FIX de SET-FX:    El *Fix Forward* se encuentra almacenado en el módulo Registro de divisas de SET-FX:    De acuerdo con la anterior información, SET-FX a través del servicio DAPI cuenta con toda la información requerida (fecha de asignación, monto y lado) para la implementación automática de cargue de posiciones, las cuales deben atender los siguientes criterios:  Para los *Fix Spot* (Caja) con parámetro **13** y producto **19** -🡪    Se requiere ubicar la información correspondiente donde se muestra a continuación:    Para los *Fix Forward* con parámetro **14** y producto **19** -🡪    Se requiere ubicar la información correspondiente donde se muestra a continuación:     1. **Requerimientos *MIDDLE-OFFICE*:**    1. **Afectación del límite de crédito temporal**   Se requiere que el sistema para cada una de las operaciones *Fix Spot* y *Fix Forward* que se registren en SET-FX bajo los códigos de mercado (71,74, 75, 174 y 174 código sub-mercado X) y que pasan a la plataforma a través del servicio DAPI, consuman un límite de crédito temporal atendiendo la siguiente formula:  Dónde:  **Fecha de Postura (Tn)** = Fecha en la cual se le incluye la tasa fix con la cual se van a liquidar las operaciones de Fix Spot y Fix Forward.  **T =** Fecha de negociación de la operación *Fix Spot* y *Fix Forward*  **TVencimiento :** Diferencia en días entre la fecha de negociación (T) y la fecha de postura  **Nota 1** -🡪 Para calcular la afectación en cada fecha hasta llegar a la fecha de postura se deberá utilizar la TRM vigente en cada fecha de análisis.  **Nota 2 -🡪** Para las operaciones *FIX Spot* y/o *FIX* *Forward*, de Hoy para hoy (Fecha de negociación = Fecha de Postura). El límite temporal de crédito se deberá ver reflejado desde el momento del registro y hasta cuando se complemente la operación con la tasa *FIX*, ***momento en el que se deberá desafectar el límite de crédito temporal asignado***, dado que la operación ingresara como una operación *Spot* o *Forward* según se haya pactado.   * 1. **Aclaraciones:**   Este límite calculado debe ir a afectar los límites de crédito desde el momento del registro y hasta **Tn= fecha de postura** en la cual se tiene pactado que se ingresa la tasa fix. Cuando se haya complementado la operación, el sistema deberá devolver los límites de crédito temporales incluidos a cada contraparte que se han afectado por este tipo de operaciones.     * 1. **Resumen de las actividades a considerar para la afectación:**  1. Registro en SET-FX de una operación *FIX* (cualquier modalidad) 2. El servicio DAPI debe actualizar el sistema. 3. El sistema debe identificar la operación *FIX* (cualquier modalidad) 4. A las operaciones identificadas como FIX el sistema deberá afectar el límite de crédito temporal hasta la fecha de postura. 5. El usuario deberá registrar la tasa FIX 6. En la fecha de postura se deberá reversar los límites temporales afectados. 7. El servicio DAPI envía registro de modificación con el registro FIX efectuado por el usuario. 8. El sistema deberá afectar los límites de crédito según formulación anteriormente indicada de acuerdo si se trata del producto **19 (NDF - OTC)**  o del producto **21 (NDF-CRCC)**. 9. **Requerimientos contables**    1. **Registros contables *FIX Spot***   **Estos registros deben ser afectados automáticamente el día de la operación y cancelados el día de su finalización.**  **FX -  SPOT DE COMPRA**   |  |  | | --- | --- | | 630500020101 | COMPROMISO DE COMPRA DE MONEDA | | 64950002010302 | COMPROMISOS COMPRA SPOT FIX ME |   **FX - SPOT DE VENTA**   |  |  | | --- | --- | | 610500020101 | ACREEDORA X CONTRA | | 6295000201001 | COMPROMISOS DE VENTA SPOT FIX ME | |  |  |  * 1. **Registros contables *FIX Forward***   **Estos registros deben ser afectados automáticamente el día de la operación y cancelados el día de su finalización.**   * **Fecha en que se pacta el negocio**   Cuando el FIX es de compra de USD, los movimientos se realizan por el valor de la negociación a la TRM del día:    Cuando el FIX es de venta de USD, los movimientos se realizan por el valor de la negociación a la TRM del día:     * **Fecha en la que se conoce la tasa y la operación se traslada a Forward:**   Cuando el FIX es de compra de USD, los movimientos se realizan por el valor de la negociación a la TRM del día:    Cuando el FIX es de venta de USD, los movimientos se realizan por el valor de la negociación a la TRM del día:    **Requerimiento DOP**   * El cierre de estas operaciones deben estar atadas al proceso de cierre automático de operaciones y también contar con las validaciones técnicas de control para este proceso. * Los registros contables se deben visualizar en el listado Te\_asiento de cada una de las fechas. * Se solicita un listado que permita identificar las operaciones vigentes de FIX SPOT – FIX FORWARD, donde logremos visualizar : * Numero de operación * Tipo de Operación ( Venta / Compra ) * Fecha de negociación * Fecha de finalización * Nit de la contraparte * Valor nominal en USD * Valor en COP * Tasa de inicio * Tasa de finalización * Trader que realizo la operación * Jefe de mesa que autoriza la operación.   Esta información se debe permitir generar en Archivo Excel y en PDF. | | | | |
|  | | | | |