**Solicitud de Requerimiento No**.**3**

**Fecha de Solicitud**: **14/02/2017**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Nombre del solicitante:**Jaime Francisco Buritica Leal | **Identificación del área solicitante:** Departamento de Tesorería | **Teléfono- extensión:**Ext. 2721 | **Aplicativo:** **Plataforma COBIS** |
| **Nombre del requerimiento:** Nueva presentación del P&G de USDCOP de forma similar que el P&G EURUSD, ya implementado. | **Prioridad:** **[ ]  Alta** **[ ]  Media**  **X Baja** |
| **Objetivo**: Ajustar la presentación el P&G USDCOP de forma similar a la actualmente implementada para el P&G EURUSD, bajo el esquema desagregado de T+0, T+1, T+2 y T+3 y valoración intradía a la tasa *FIX* traída en forma automática y en línea del sistema de negociación SET-FX. |
| **Participantes:** Departamento de Tesorería | **Que temas se asocian o son prerrequisito o influyen en la elaboración del requerimiento a solucionar.** Los cálculos internos ya implementados en el sistema, no deberán sufrir modificación para la atención de esta solicitud. |
| **Entradas:**Corresponden a las operaciones realizadas durante la jornada diaria que son registradas en la plataforma a través del servicio DAPI y que conforman la materia prima para administrar el P&G de USDCOP. |
| **Salidas:**Corresponden a los resultados de utilidad o pérdida generados en el P&G USDCOP producto del registro de operaciones de compra y venta de posiciones.  |
| **Requerimientos *FRONT-OFFICE*:**Se requiere que el sistema permita al usuario visualizar los resultados del P&G USDCOP bajo el esquema actual implementado en la plataforma para el P&G EURUSD. La desagregación solicitada como se puede observar en el P&G USDCOP, es por tipo de operación (compra / venta), por plazo de la operación: T+0, T+1, T+2 y T+3.La valoración intradía de las posiciones deberá ser realizada con la tasa *FIX* generada por el sistema transaccional de negociación SET-FX de forma automática a través del servicio DAPI, recientemente implementado.A continuación, se presenta el prototipo de presentación requerida donde se excluye de la presentación la columna indicada con la fecha roja y el comentario correspondiente. De igual forma, se indica comentario con flecha azul la cual indica que es la columna que deberá presentarse como resultado esperado.De otra parte y como complemento a lo indicado anteriormente, se requiere poder visualizar por parte del usuario la información por columnas de izquierda a derecha tanto para compras como para ventas, en el siguiente orden: 1. Fecha de la operación
2. Hora de Negociación
3. Monto USD
4. Tasa Negociada
5. Equivalente COP
6. Contraparte con quien se realizó la operación.

Finalmente, el orden planteado anteriormente para el P&G USDCOP se solicita implementarse también en el P&G EURUSD que permita al usuario visualizar la misma estructura.  |