**Solicitud de Requerimiento No**.**5**

**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:**  Consolidación de operaciones para cumplimiento por parte del *Back-Office.* | | | **Prioridad:**  **X Alta**  **Media**  **Baja** | |
| **Objetivo**:  Consolidar las operaciones NDF-OTC celebradas durante el día con un mismo cliente NO Intermediario del Mercado Cambiario, siempre que cumplan con los mismos criterios: Nit, fecha inicial, fecha de vencimiento y tipo de operación (compra o venta) únicamente a efectos de generar la correspondiente carta de confirmación de operaciones del día con la contraparte y unificar en un solo pago el valor a pagar a favor o en contra al vencimiento. | | | | |
| **Participantes:**  Departamento de Operaciones, Departamento de Riesgo Financiero y  Departamento de Tesorería | | | **Que temas se asocian o son prerrequisito o influyen en la elaboración del requerimiento a solucionar.**  Con este requerimiento no se deben modificar las funcionalidades del sistema relacionadas con valoración, contabilización, cálculos y liquidación de posiciones, ni reportes normativos los cuales deben mantenerse de manera individual. | |
| **Entradas:**  Corresponden a las operaciones NDF OTC y NDF – CRCC que se negocien con contrapartes NO IMC’s con destino al Portafolio de Especulación o *Trading* vigente. | | | | |
| **Salidas:**  Corresponde al Portafolio de Especulación o *Trading* vigente total. | | | | |
| 1. **Requerimientos *FRONT-OFFICE*:** 2. Se requiere contar con un parámetro en la tabla de clientes, que permita identificar en el sistema que la contraparte se encuentra habilitada para consolidar operaciones NDF-OTC celebradas durante el día y que cumplan con los mismos criterios de NIT, Fecha inicial, Fecha de Vencimiento, Tipo de operación (Compra / Venta). 3. Se requiere que el sistema genere una consulta de *Front-Office* que contenga el total de operaciones NDF - OTC celebradas realizadas en el día, para que el usuario seleccione por cliente las operaciones a consolidar (contrapartes NO IMC’s) y que cumplan con los criterios descritos en el anterior numeral.   A continuación se presenta un prototipo de la información requerida previamente a la consolidación :  **Old Mutual Fondo de Pensiones Voluntarias**    Puede presentarse que exista más de una contraparte para consolidar en la consulta.   1. Se requiere que el usuario pueda seleccionar con un *click* sobre dicha consulta cuál de los clientes presentados requiere consolidar operaciones. 2. Una vez seleccionado el cliente y solamente para efectos de generar la carta de confirmación de operaciones, el sistema debe calcular el promedio ponderado simple de las tasas spot y promedio ponderado simple de las tasas forwards pactadas por tipo de operación (de manera independiente para compras y para ventas) y realizar la suma del valor negociado durante el día.   Se presenta a continuación un ejemplo del cálculo esperado:     1. **Requerimientos *BACK-OFFICE*:** 2. La carta de confirmación de las operaciones no deberá sufrir cambio en su estructura. Se espera que la comunicación se genere con la información agrupada de las transacciones solamente para aquellas contrapartes seleccionadas por el usuario Front durante el día, teniendo en cuenta que pueden existir contrapartes habilitadas para consolidar pero que en día no requieren de consolidar operaciones. 3. Al vencimiento, el sistema debe:  * Liquidar y contabilizar las operaciones consolidadas de manera individual * Mostrar la posición a pagar / recibir de manera consolidada en el reporte de cumplimientos del día.   Dado que puede presentarse diferencias entre el valor a pagar / recibir al sumar la liquidación de las operaciones individuales frente a la liquidación de las operaciones consolidadas, se requiere generar una transacción en el sistema y el usuario Back pueda llamar la contraparte consolidada e ingreso el valor sobrante / faltante. Se requiere que el sistema también contabilice de manera automática el valor ingresado con el P&G de utilidad (sobrante) o pérdida (faltante), según sea el caso.  **C. CONTROLES REQUERIDOS**   * El sistema debe alertar al usuario *Front* las operaciones que fueron consolidadas previamente en el evento que requiera de alguna modificación a alguna de ellas durante el día y corresponda a una operación ya consolidada. En este evento, el sistema deberá permitir desmarcar el *check* de consolidación y refrescar o actualizar la consulta solicitada para que el usuario *Front* vuelva a iniciar el proceso de marcación de la contraparte y que el sistema realice nuevamente la consolidación de la contraparte requerida. Puede presentarse modificaciones a más de una contraparte consolidada. * Se requiere que el sistema genere una consulta en pantalla que permita monitorear las transacciones que han requerido de ajuste contra P&G, que incluya: Fecha del Ajuste, Contraparte, Monto consolidado, Valor del Ajuste, Cuenta del P&G afectada y usuario que ingresó el ajuste correspondiente. Esta información deberá conservarse en forma histórica para futuras consultas de los usuarios *Front, Middle y Back-Office* sobre operaciones consolidadas de clientes. | | | | |