**Solicitud de Requerimiento No**.2

**Fecha de Solicitud**: 12/04/2017

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Nombre del solicitante:** Maria Paula Restrepo Alvarez | **Identificación del área solicitante:** 53.067.504 | **Teléfono- extensión: 4863000 ext. 2813** | | **Aplicativo:**  COBIS |
| **Nombre del requerimiento: Elaboración plano de forwards para FINAC** | | | **Prioridad:**  **X Alta**  **Media**  **Baja** | |
| **Objetivo**: elaboración de archivo plano con la estructura solicitada. | | | | |
| **Participantes: DSI, DRF y DTE.** | | | **No hay prerrequisitos, toda la información proviene de COBIS. Se requiere archivo plano al cierre diario.** | |
| **Entradas.**  **Se requiere la información de la negociación diaria de forwards de la Entidad, registrada en COBIS.** | | | | |
| **Salidas.**  **Archivo plano diario al cierre, el cual se debe guardar en el público de COBIS.** | | | | |
| **Proceso**   * Elaborar un archivo plano con información proveniente de COBIS. * Los N/A en este caso significan que el campo puede ir vacío. * La estructura del archivo plano es la siguiente:  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | **COMPROMISO DE COMPRA** | | **COMPROMISO DE VENTA** | |  | | **CAMPO** | **DESCRIPCION** | **CAMPO** | **DESCRIPCION** | **Formato** | | Número de Contrato | Número de contrato del compromiso | Número de Contrato | Número de contrato del compromiso | Alfanumérico (16) | | **Contraparte** | **Código de moneda de liquidación del pago, según la siguiente tabla de monedas**   |  |  | | --- | --- | | serial | Nombre | | 0 | LOCAL | | 1 | DOLAR | | 2 | EURO | | **Contraparte** | **Código de moneda de liquidación del pago, según la tabla de monedas** | **Alfanumérico (11)** | | Cuenta Mayor (posición larga) | Cuenta correspondiente al contrato de inversión | Cuenta Mayor (posición larga) | Cuenta correspondiente al contrato de inversión | Numérico (10) | | Moneda Corto | Código de la moneda de ejecución (con que se paga). **Corto**   |  |  | | --- | --- | | serial | Nombre | | 0 | LOCAL | | 1 | DOLAR | | 2 | EURO | | Moneda Largo | Código de la moneda de inversión. (Con que nos pagan). **Largo** | Numérico (5,0) | | Tipo de Contrato | V | Tipo de Contrato | V | Alfanumérico (1) | | Entidad | Código según tabla de entidades (BANCOLDEX CÓDIGO 1) | Entidad | Código según tabla de entidades | Numérico (5,0) | | Fondo | Factor de segmentación opcional | Fondo | Factor de segmentación opcional | Numérico (5,0) | | Tipo de Operación | N.A. | Tipo de Operación | N.A. | Numérico (5,0) | | Emisor | N.A. | Emisor | N.A. | Alfanumérico (12) | | Tipo de Acción o Título | N.A. | Tipo de Acción o Título | N.A. | Alfanumérico (10) | |  |  |  | | Negociabilidad | N.A. | Negociabilidad | N.A. | Numérico (5,0) | | Estatus | Código según según tabla 3. Para estos compromisos solo es posible el estatus 4 o ninguno. | Estatus | Código según según tabla 3. Para estos compromisos solo es posible el estatus 4 o ninguno. | Numérico (5,0) | | Mercado | N.A. | Mercado | N.A. | Numérico (5,0) | | Tipo Tasa de Mercado Largo | Tasa de descuento libre de riesgo en moneda extranjera (cuenta inversión). **Largo** | Tipo Tasa de Mercado Corto | Tasa de descuento libre de riesgo en moneda extranjera (Cuenta ejecución). **Corto** | Numérico (5,0) | | Margen de Mercado | Spread aplicado al campo anterior | Margen de Mercado | Spread aplicado al campo anterior | Numérico (8,6) | | Valor en Libros Largo | Valor en libros de la cuenta de inversión (en la moneda 2 del plano). **Largo** | Valor en Libros Corto | Valor en libros del préstamo en moneda extranjera (En la moneda 2 del plano). **Corto** | Numérico (16,0) | | Valor de Mercado Corto | Valor en libros de la cuenta de ejecución (En la moneda 1 del plano). **Corto** | Valor de Mercado Largo | Valor en libros de la cuenta de inversión (En la moneda 1 del plano). **Largo** | Numérico (16,0) | | Tipo Tasa de Mercado Corto | Tasa de descuento libre de riesgo en moneda ejecución. **Corto** | Tipo Tasa de Mercado Largo | Tasa de descuento libre de riesgo en moneda de inversión. **Largo** | Numérico (5,0) | | Margen | Spread aplicado al campo anterior | Margen | Spread aplicado al campo anterior | Numérico (8,6) | | Fecha de Corte | Fecha de corte de la información | Fecha de Corte | Fecha de corte de la información | AAAA/MM/DD | | Fecha Inicial | Fecha de ejecución del contrato | Fecha Inicial | Fecha de ejecución del contrato | AAAA/MM/DD | | Fecha Final | Fecha de ejecución del contrato | Fecha Final | Fecha de ejecución del contrato | AAAA/MM/DD | | Posición | C = Compra | Posición | V = Venta | Alfanumérico (1) | | Tipo Compromiso | F = Forward sobre divisas | Tipo Compromiso | F = Forward sobre divisas | Alfanumérico (1) | | **Tipo de Entrega Derivado** | **1 = Forward Delivery 2 = Forward Non delivery** | **Tipo de Entrega Derivado** | **1 = Forward Delivery 2 = Forward Non delivery** | **Numérico (1)** | | Precio Ejercicio por Unidad en moneda corto | Precio pactado (En moneda de ejecución; moneda 1 del plano). **En moneda corto** | Precio Ejercicio por Unidad en moneda largo | Precio pactado ( en la moneda de inversión; moneda 1 del plano). **En la moneda largo** | Numérico (16,0) | | Unidades en moneda largo | Cantidad de divisas pactadas (en moneda 2 del plano). **En moneda largo** | Unidades en moneda corto | Cantidad de divisas pactadas (en moneda 2 del plano). **En moneda corto** | Numérico (16,0) | | Cuenta de Ejecución. **Cuenta corto** | Cuenta correspondiente al préstamo | Cuenta de Ejecución. **Cuenta corto** | Cuenta correspondiente al préstamo | Numérico (10) | | Fecha Esperada de Venta | N.A. | Fecha Esperada de Venta | N.A. | AAAA/MM/DD | | **Puntos Forward** | **Puntos forward del contrato.** | **Puntos Forward** | **Puntos forward del contrato.** | **Numérico (5,6)** | | Código Moneda largo | Según tabla de monedas. **Código moneda largo** | Código de moneda corto | Según tabla de monedas. **Código moneda corto** | Numérico (5,0) | | | | | |