



Gestire il collaterale dei derivati OTC

Gerrard Mahony
Business Development Director



è una società di sviluppo software italiano che fornisce una piattaforma finanziaria e che ha una esperienza ventennale nella fornitura di soluzioni back office per banche, aziende corporate e società di asset management.

inside riskart

Software di back office – Derivati OTC

- Copertura dei derivati OTC e regolamentati
- Calcolo dei flussi di cassa per tutti i derivati OTC
- Facilmente parametrizzato per l'inserimento di nuove classi di derivati
- Gestione del monitoraggio e rendicontazione dei derivati
- Gestione regolamento
- Generazione scritture contabili
- Gestione principi IAS/IFRS
- Gestione "multi-entity"
- Reporting
- Integrazione con Front Office

Software di back office – Gestione Collaterale

- In fase di sviluppo...



perché un software collaterale?

- Lezioni post-Lehman
- Rischio controparte
- Ottimizzazione della liquidità
- Utilizzo più efficace del capitale
- Automazione dei processi
- Reporting



cosa offre riskart?



funzionalità collaterale

- Gestione anagrafica contratti Credit Support Annex (ISDA)
 - Thresholds, Evaluation Agent, Assets ecc.
- Calcolo esposizione netta per controparte
 - Netting per prodotto
 - Cross-product netting per controparte
- Gestione eventi di mercato
 - Credit events ecc.
- Mark-to-Market portafoglio
- Gestione Riconciliazione per controparte
 - Importazione file XML
- Calcolo Margine
- Generazione messaggi Margin Call/Recall
 - Messaggi SWIFT o
 - Lettera/e-mail/fax
- Calcolo interessi
- Generazione notifica/istruzioni di pagamento interessi
- Gestione dispute
 - Invio Notifica, Monitoraggio ecc.
- Reporting
 - Posizione, Interessi, break-down assets ecc

caratteristiche del servizio

Software distinto dal Back Office riskart

- Facilmente integrabile con altri ambienti

Tecnologia Standard

- Architettura Client/Server
- Client Web/HTML puro
- Database SQL/Oracle/DB2
- Linguaggio C++
- Import/Export File XML

Supporto locale

- Società italiana
- Team di analisti finanziari

Personalizzazioni software

- Tempi rapidi di realizzazione
- Mantenimento integrità software

Reporting

- Integrazione MicroStrategy
- Altri pacchetti utilizzabili
(Business Objects ecc.)



punti di forza software collaterale

Automazione processi Middle/ Back Office

- Automazione Margin Call/Recall
- Riduzione di errori manuali

Gestione pro-attiva del Collaterale

- Rischio Controparte
- Rischio Credito
- Rischio Portafoglio

Gestione più accurata della liquidità

Gestione ottimizzata del capitale

Riconciliazione automatica

- Netting di posizioni
- Riduzione di errori





riskart S.p.A.

Via Montebello, 25 - 20121 Milano
Telefono: 02 455 063 93 - Fax: 02 65 92 724