

solutions for derivatives



inside riskart®

ed. 02 (luglio 2010)

indice

riskart S.p.A.

un nuovo approccio alla gestione dei derivati

caratteristiche

contatti

riskart S.p.A.

- La Società riskart S.p.A. opera a Milano dal 1975
- Con l'ingresso di Tomato Financial & Treasury Services SA., nel 2000, si avvia il processo di reingegnerizzazione dell'applicativo FOSWin®. L'obiettivo era quello di utilizzare le nuove tecnologie per una più semplice e immediata fruibilità dei servizi e dei sistemi nell'ambito della gestione dei rischi finanziari. Il risultato di tale processo è l'applicativo riskart®, che ha raggiunto l'obiettivo, puntando su qualità del sistema, standardizzazione del linguaggio ed elevata compatibilità con numerose piattaforme (Windows, Unix, Linux...).
- L'applicativo riskart® si è specializzato maggiormente nella gestione Middle e Back Office e conseguente rendicontazione contabile, con particolare attenzione agli strumenti derivati, pur mantenendo la più ampia possibilità di applicazione nell'area finanziaria di un istituto.
- riskart® governa e sviluppa costantemente l'ambiente di base, con elevato grado di flessibilità e compatibilmente con la normativa e le evoluzioni del mercato.

riskart®

E' la soluzione dedicata al supporto operativo, amministrativo e contabile (Middle/Back-Office) dei contratti finanziari.

- Gestisce le posizioni c/proprio – c/terzi di qualsiasi forma di contratto finanziario ed è parte del sistema complessivo di Risk Management;
- Produce la base dati per sistemi di regolamento esterni (es. SWIFT);
- Integra sistemi di mercato per il calcolo/controllo dei margini;
- Supporta la gestione del collaterale;
- Genera le scritture per tutti gli aspetti contabilmente rilevanti, anche nel rispetto della normativa IAS/IFRS (principi 32 e 39);
- Produce la base dati per i sistemi di segnalazione (es. PUMA2).

Esterno

Mercato

Controparti

Business Process Management

Front Office

Money Market e Forex products:

Time Deposit, Currency Spot, Outright, Forex Swap, Currency Option

Interest Rate Derivatives:

IRS, FRA, OIS, CCS, DCS, Index Swap, Cap, Floor, Collar, Swaption

Equity Derivatives:

Plain Vanilla and Exotic Option, Index Futures, Equity Futures, Equity Swap, Equity Asset Swap, Equity Linked Note and structured product, Inflation Swap

Credit Derivatives:

Credit Default Swap

Middle and Back Office

Inserimento Eseguiti • Spunta Controparti • Validazione Deal • Calcolo NAV • Generazione Scritture Contabili • Hedge Accounting • Settlement • Gestione del Collaterale • Reportistica • Generazione Segnalazioni

riskart

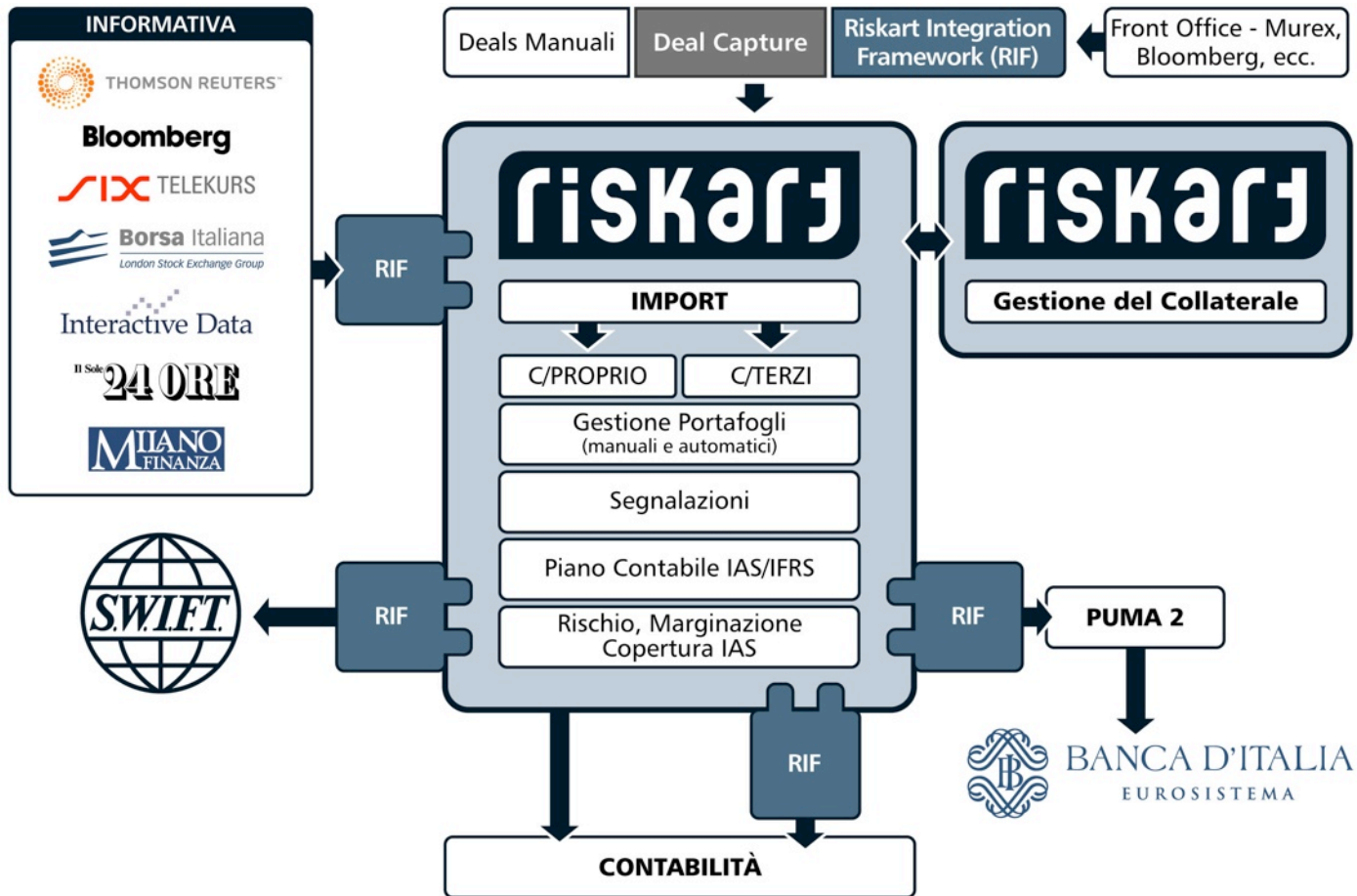
Dati di Mercato

Comunicazioni Interbancarie

Contabilità

Segnalazioni di Vigilanza

posizionamento nel System Integration



un approccio “scientifico” maturato nel tempo

La lunga esperienza maturata con FOSWin[®], il predecessore di riskart[®], ha consentito l'identificazione di un modello concettuale generale per ogni possibile strumento finanziario.

Tale schema è stato implementato in un'architettura tecnologica “state of the art” indipendente dalla piattaforma sistemistica.

L'adeguamento alle esigenze organizzative del cliente è ottenuto attraverso interventi di parametrizzazione senza modifiche al software.

La soluzione è in linea con le “best practices” di audit e controllo interno.

Money Market e Forex products:
Time Deposit, Currency Spot, Outright, Forex Swap, Currency Option

Interest Rate Derivatives:
IRS, FRA, OIS, CCS, DCS, Index Swap, Cap, Floor, Collar, Swaption

Equity Derivatives:
Plain Vanilla and Exotic Option, Index Futures, Equity Futures Equity Swap, Equity Asset Swap, Equity Linked Note and structured product, Inflation Swap

Credit Derivatives:
Credit Default Swap

la condivisione della conoscenza

- riskart S.p.A. mantiene costantemente aggiornata la competenza funzionale sugli strumenti finanziari. Tutte le novità sono prontamente analizzate ed integrate nel modello concettuale di base denominato “0” level e comune a tutti gli utenti.
- riskart® gestisce, implementa e si adegua ai cambiamenti provenienti da:
 - normativa
 - mercati e strumenti finanziari
 - input provenienti dagli utenti
- La distribuzione degli aggiornamenti arricchisce di funzioni il modello, ma avviene con un processo che non produce alterazioni nel sistema personalizzato dell'utente.

la condivisione della conoscenza



obiettivi di riskart®

■ Risposta tempestiva alle esigenze della clientela:

- costante aggiornamento sui nuovi strumenti finanziari
- allineamento alla normativa
- personalizzazione dei processi operativi, Workflow/Dashboard
- adeguamenti delle parametrizzazioni a seguito delle mutate esigenze degli utenti

■ Riduzione del rischio operativo:

- gestione automatizzata dei processi operativi
- gestione della sicurezza
- auditabilità e tracciabilità di dati e processi

■ Riduzione dei rischi/costi IT:

- architettura sistemistica multipiattaforma
- parametrizzabilità del software e descrizione di nuovi strumenti finanziari con ricorso minimo o nullo alla programmazione
- flessibilità della proposta commerciale

caratteristiche funzionali

■ Flessibilità:

- parametrizzabilità delle schermate per la gestione delle operazioni e degli eventi amministrativi/contabili
- reportistica d'impianto indipendente (MicroStrategy "embedded")

■ IAS "compliant":

- classificazione degli strumenti finanziari e delle posizioni anagrafate
- "First Time Application" e riclassificazione
- scritture contabili "IAS compliant " e "doppio binario"
- test di efficacia per "Hedge Accounting"

■ Ambiente di base della soluzione governato e fatto evolvere da riskart S.p.A.

caratteristiche tecnologiche

■ Qualità:

- sviluppato con standard e metodologie open
- modularità (concetto di “engine”)
- interfaccia grafica omogenea, funzionale e professionale (colori, forme e dialogo)

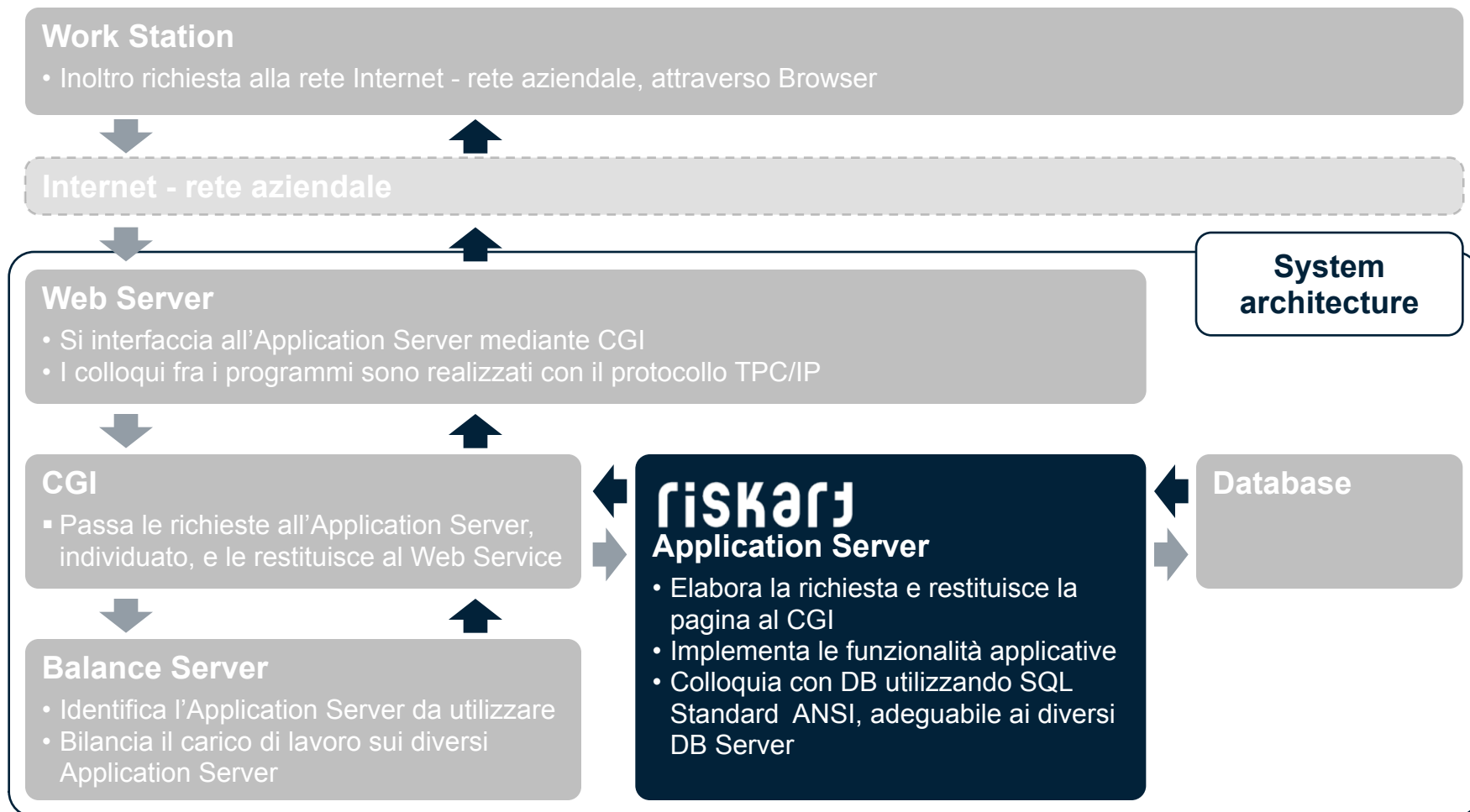
■ Standard:

- ANSI SQL
- XML, C++ Standard
- Data import/export via MQ Series/Web services

■ Multiplatforma:

- Windows/Unix/Linux
- Multi-lingua
- Oracle/MS Sql/Db2/Postgres
- Client browser-based (puro HTML)

architettura di sistema



tipologia di offerta

■ Installazione presso il cliente:

- licenza software
- personalizzazione
- system integration

■ Installazione presso ASP (“application service provider”):

- utilizza modalità “pay per use”
- personalizzazione
- scalabilità degli utenti

contatti

■ riskart S.p.A.

www.riskart.com

+39 02.45506393

■ Informazioni commerciali

g.mahony@riskart.com

■ Direzione

f.marinotti@riskart.com

■ Informazioni funzionali di prodotto

e.vallini@riskart.com



riskart S.p.A.

Via Montebello, 25 - 20121 Milano
Telefono: +39 02.45506393 - Fax: +39 02.6592724