

solutions for derivatives



inside riskart®

ed. 02 (julio 2010)

índice

riskart S.p.A.

una nueva aproximación a la gestión de derivados

características

contactos

riskart S.p.A.

- La Sociedad riskart S.p.A. opera en Milán desde el año 1975.
- Con la entrada de Tomato Financial & Treasury Services, S.A. en el año 2000, se inicia el proceso de reingeniería de la aplicación FOSWin®. El objeto no es otro que el de utilizar las nuevas tecnologías para un uso sencillo e inmediato de los servicios y de los sistemas en el ámbito de la gestión de riesgos financieros. El resultado de dicho proceso es la aplicación riskart®, que ha alcanzado su objetivo apuntando hacia la calidad del sistema, la estandarización del lenguaje y hacia una elevada compatibilidad con numerosas plataformas (Windows, Unix, Linux...).
- La aplicación riskart® se ha especializado principalmente en la gestión de middle office y back office y el correspondiente extracto contable, prestando una especial atención a los instrumentos derivados, manteniendo además una posibilidad más amplia de aplicación en el área financiera de una entidad.
- riskart® dirige y desarrolla constantemente el ambiente de base, con un alto grado de flexibilidad y compatible con la normativa y las evoluciones del mercado.

riskart®

Es la solución que se dedica al soporte operativo, administrativo y contable (middle office/back office) de los contratos financieros.

- Gestiona las posiciones c/propio – c/terceros de cualquier tipo de contrato financiero y forma parte del sistema global de Gestión de riesgos.
- Elabora la base de datos para sistemas de regulación externos (p.ej. SWIFT).
- Integra sistemas de mercado para el cálculo/control de márgenes.
- Soporta la gestión del collateral.
- Genera las escrituras para todos los aspectos relevantes desde el punto de vista contable, respetando además la normativa NIC/NIIF (principios 32 y 39).
- Elabora la base de datos para sistemas de señalización (p.ej. PUMA2).

Externo

Mercado

Contrapartidas

Gestión de Procesos de Negocio

Front Office

Mercado monetario y productos Forex:

Depósito a plazo, divisa al contado, outright, swap de divisas, opción sobre divisas.

Derivados de tipos de interés:

IRS, FRA, OIS, CCS, DCS, swap de índices bursátiles, cap, floor, collar, swaption.

Derivados de acciones:

Opción tradicional y exótica, futuro sobre índices, futuros de acciones, swap de acciones, swap de activos acciones, ELN y producto estructurado, swap de inflación.

Derivados de créditos:

Swap de incumplimiento crediticio.

Middle and Back Office

Introducción realizada • Marca contrapartidas • Validación Deal • Cálculo NAV • Generación Escrituras • Contables • Contabilidad de cobertura • Pago • Gestión del Collateral • Informes • Generación Señalizaciones

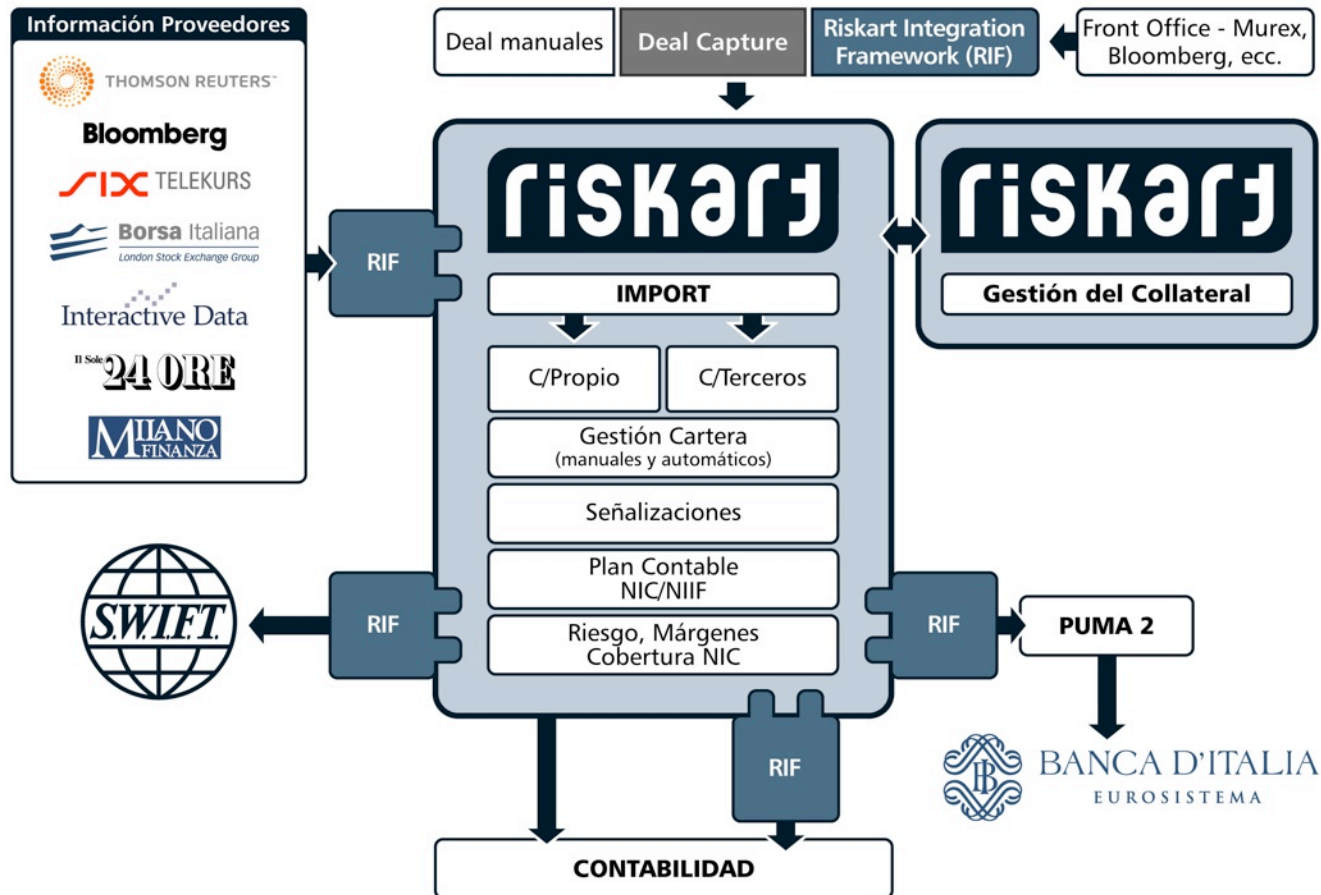
Datos de mercado

Comunicación interbancaria

Contabilidad

Señalizaciones de control

posicionamiento en la integración de sistemas



una aproximación “científica” madurada en el tiempo

La larga experiencia obtenida mediante FOSWin®, predecesor de riskart®, ha permitido la identificación de un modelo conceptual general para cada instrumento financiero.

Dicho esquema ha sido implementado en una arquitectura tecnológica “puntera” independiente de la plataforma de sistema operativo.

La adecuación a las exigencias organizativas del cliente se obtiene mediante intervenciones de parametrización sin modificaciones en el software.

La solución está en conformidad con las mejores prácticas de auditoría y control interno.

Mercado monetario y productos Forex:
Depósito a plazo, divisa al contado, Outright, swap de divisas, opción sobre divisas.

Derivados de tipos de interés:
IRS, FRA, OIS, CCS, DCS, swap de índices bursátiles, cap, floor, collar, swaption.

Derivados de acciones:
Opción tradicional y exótica, futuros sobre índices, futuros de acciones, swap de acciones, swap de activos acciones, ELN y producto estructurado, swap de inflación.

Derivados de créditos:
Swap de incumplimiento crediticio.

compartir el conocimiento

- riskart S.p.A. mantiene constantemente actualizada la competencia funcional sobre los instrumentos financieros.
Todas las novedades son analizadas e integradas inmediatamente en el modelo conceptual de base denominado nivel “0”, común a todos los usuarios.
- riskart® gestiona, implementa y se adecúa a los cambios procedentes de:
 - Normativa.
 - Mercados e instrumentos financieros.
 - Input procedente de los usuarios.
- La distribución de las actualizaciones enriquece con funciones el modelo, pero se realiza con un proceso que no produce modificaciones en el sistema personalizado del usuario.

compartir el conocimiento



objetivos de riskart®

■ Respuesta inmediata a las exigencias de los clientes:

- Actualización constante en nuevos instrumentos financieros
- Adecuación a la normativa
- Personalización de los procesos operativos, Workflow/Dashboard
- Adecuación de las parametrizaciones como consecuencia de las exigencias de los usuarios

■ Reducción del riesgo operativo:

- Gestión automatizada de los procesos operativos
- Gestión de la seguridad
- Auditabilidad y trazabilidad de datos y procesos

■ Reducción de riesgos/costes IT:

- Arquitectura de sistemas multiplataforma
- Parametrizabilidad del software y descripción de nuevos instrumentos financieros con recurso mínimo o nulo a la programación
- Flexibilidad de la propuesta comercial

características funcionales

■ Flexibilidad:

- Parametrizabilidad de las pantallas para la gestión de las operaciones y de los eventos administrativos/contables
- Informes de instalación independientes (MicroStrategy “integrada”).

■ Conforme a la NIC:

- Clasificación de los instrumentos financieros y de las posiciones registradas
- “Primera aplicación” y reclasificación
- Registros contables “conforme a la NIC” y “doble vía”
- Test de eficacia para “contabilidad de cobertura”

■ Ambiente de base de la solución dirigido y desarrollado por riskart S.p.A.

características tecnológicas

■ Calidad:

- Desarrollado con estándares y metodologías abiertas
- Modularidad (concepto de engine);
- Interfaz gráfica homogénea, funcional y profesional (colores, formas y diálogo)

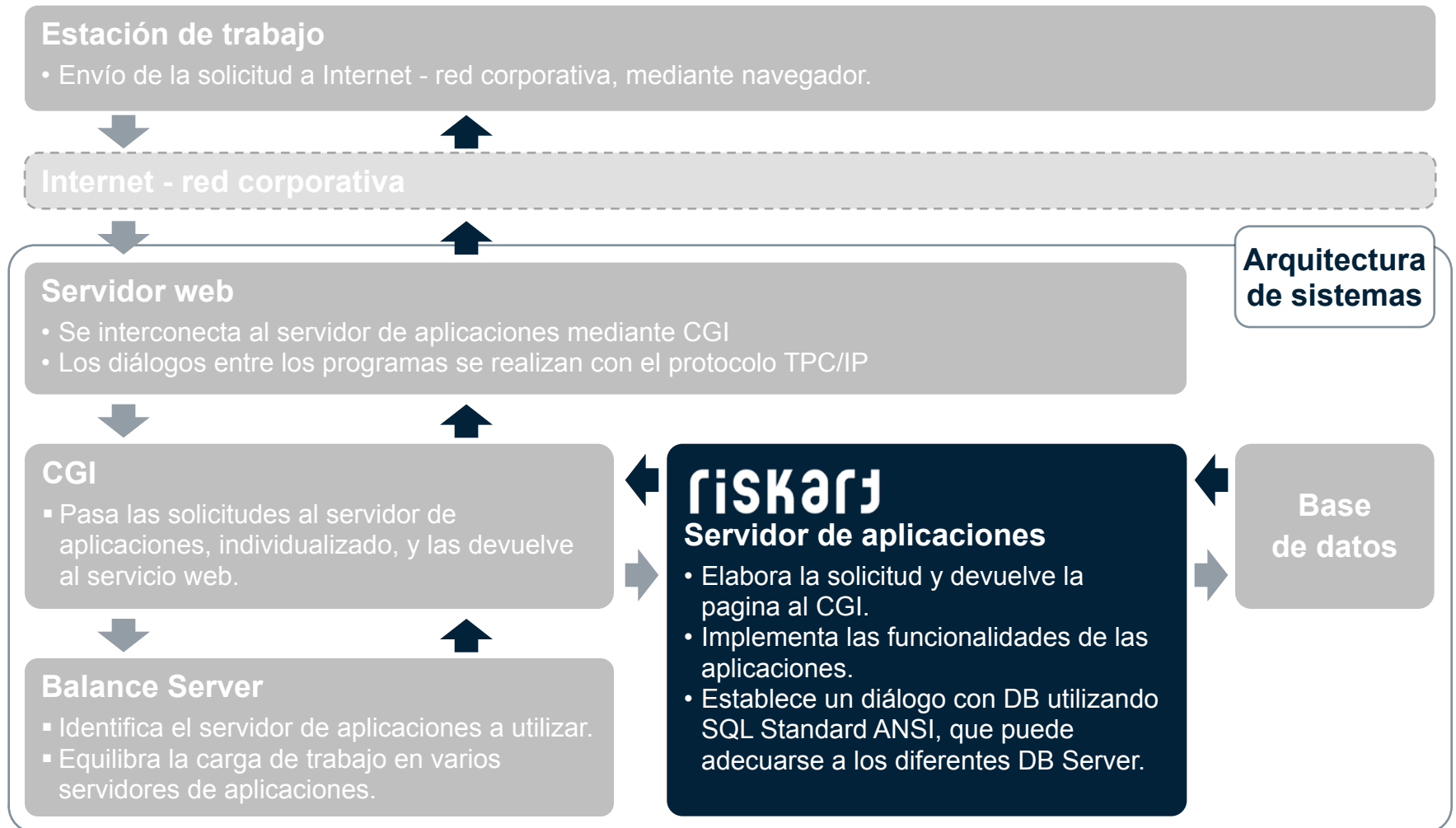
■ Estándar:

- ANSI SQL
- XML, C++ Estándar
- Importación/exportación de datos a través de MQ Series/servicios Web

■ Multiplataforma:

- Windows/Unix/Linux
- Multilingüe
- Oracle/MS Sql/Db2/Postgres
- Basado en el navegador

arquitectura de sistemas



tipo de oferta

■ Instalación en el local del cliente:

- Licencia software
- Personalización
- Integración de sistemas

■ Instalación en ASP (proveedor de servicios de aplicación):

- Utiliza modalidad “pago por uso”
- Personalización
- Escalabilidad de usuarios

contactos

■ riskart S.p.A.

www.riskart.com

+39 02.45506393

■ Informaciones Comerciales

g.mahony@riskart.com

■ Dirección

f.marinotti@riskart.com

■ Informaciones funcionales del producto

e.vallini@riskart.com



riskart S.p.A.

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