



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Назначение

Представленные функциональные решения позволяют кредитной организации автоматизировать свою деятельность на различных финансовых рынках:

- ✓ фондовый рынок
- ✓ срочный рынок
- ✓ денежный и валютный рынки

Обеспечивается комплексная автоматизация бэк-офисного учета операций и сделок – от взаимодействия с внешними фронт-офисными системами до формирования платежей и информационных сообщений контрагентам.

Состав бизнес-модулей

В линейку решений входит функционал следующих модулей:

- ✓ Учет торгов ценными бумагами
- ✓ Векселя (собственные и учтенные)
- ✓ Депозитарный учет
- ✓ Операции с фьючерсными контрактами
- ✓ Операции доверительного управления
- ✓ Конверсионные и срочные сделки с валютой
- ✓ Межбанковские кредиты и депозиты
- ✓ Купля-продажа драгоценных металлов
- ✓ Выгрузка в Репозиторий (НРД)
- ✓ Отчетность ЦБ и ФСФР (ФКЦБ)

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Решения для бэк-офисного учета операций



ММВБ

МОСКОВСКАЯ БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Используется единая инструментальная среда

Общие финансовые инструменты:

- ✓ **Ценные бумаги:**
 - ✓ акции и облигации
 - ✓ векселя (учтенные и собственные)
- ✓ **Биржевые и внебиржевые ПФИ:**
 - ✓ форварды
 - ✓ валютные свопы
 - ✓ фьючерсные контракты
- ✓ **Прочие денежные средства:**
 - ✓ заемные (кредитные) средства
 - ✓ депозиты и сертификаты
 - ✓ драгоценные металлы
 - ✓ споты

Автоматы групповых операций

Полный цикл учета и обработки информации:

- ✓ ведение портфелей ценных бумаг
- ✓ договоры с клиентами и контрагентами
- ✓ импорт сделок с биржи и внешних систем
- ✓ операции по обслуживанию сделок
- ✓ ведение внутреннего учета:
 - ✓ расчет резерва, налогов и комиссий
 - ✓ расчет финансового результата
 - ✓ переоценка и закрытие торговых дней
- ✓ обмен сообщениями с контрагентами
- ✓ бухгалтерский учет:
 - ✓ формирование документов и платежей
 - ✓ открытие и закрытие счетов
- ✓ налоговый учет
- ✓ формирование отчетности ЦБ и ФСФР (ФКЦБ)

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX

ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Учет торгов ЦБ

Автоматизация учета результатов биржевых и внебиржевых сделок с ценными бумагами по собственным и клиентским операциям

- ✓ сделки РЕПО (прямое и обратное)
- ✓ корзина ценных бумаг
- ✓ срочные сделки
- ✓ амортизация номинала
- ✓ начисление/погашение купона и дисконта
- ✓ брокерское обслуживание
- ✓ учет в депозитарии

Депозитарный учет

Автоматизация услуг по хранению или переходу прав на ценные бумаги

- ✓ открытие счетов, разделов и лицевых счетов ДЕПО
- ✓ учет и исполнение поручений:
 - ✓ административных
 - ✓ инвентарных
 - ✓ глобальных
 - ✓ информационных
- ✓ аналитические отчеты:
 - ✓ по счетам
 - ✓ по ценным бумагам
 - ✓ об исполнении поручений
- ✓ балансы и оборотные ведомости

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Векселя учтенные

Автоматизация операций с учтенными векселями

- ✓ ведение сделок с векселями:
 - ✓ покупка
 - ✓ сделки РЕПО (прямое и обратное)
 - ✓ продажа / погашение / частичное погашение
- ✓ учет просроченных векселей
- ✓ признание безнадежными к взысканию
- ✓ учет накопленного дисконта и процентов
- ✓ учет договоров обеспечений
- ✓ ведение портфеля векселей
- ✓ учет в депозитарии

Векселя собственные

Автоматизация операций с собственными векселями

- ✓ ведение сделок с векселями:
 - ✓ выпуск (перепродажа)
 - ✓ погашение
 - ✓ новация
 - ✓ выкуп / досрочный выкуп
- ✓ учет накопленного дисконта и процентов
- ✓ ведение портфеля векселей

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Фьючерсные контракты

Автоматизация учета договоров и сделок с фьючерсными контрактами на любых торговых площадках

- ✓ ведение спецификаций фьючерсов и серий инструментов
- ✓ учет поставочных и расчетных фьючерсов
- ✓ ведение собственной и клиентской позиции по денежным средствам и срочным контрактам (расчет методом FIFO)
- ✓ отчеты по позициям

Доверительное управление

Автоматизация учета деятельности банка по индивидуальным договорам доверительного управления (ДУ) активами клиентов

- ✓ справочник типовых условий обслуживания
- ✓ инвестиционные декларации
- ✓ финансовые операции по договорам ДУ
- ✓ вознаграждение доверительного управляющего

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Дилинг (валюта)

Автоматизация собственных и клиентских сделок по торговле валютами на валютной бирже или внутренних площадках.

- ✓ учет и исполнение сделок:
 - ✓ наличные сделки (today, tomorrow, spot)
 - ✓ срочные сделки (forward)
 - ✓ смешанные сделки (swap)
- ✓ формирование сообщений контрагенту (SWIFT, Telex, произвольный формат)
- ✓ установка и контроль лимитов дилера
- ✓ автоматический неттинг по сделкам

Межбанковские кредиты

Автоматизация предоставления и получения межбанковских кредитов, размещения и привлечения межбанковских депозитов.

- ✓ пролонгация сделок
- ✓ операции начисления %
- ✓ распоряжения по операциям
- ✓ учет договоров обеспечений
- ✓ плановые и досрочные гашения
- ✓ формирование сообщений (SWIFT, Telex)
- ✓ установка и контроль лимитов задолженности

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Драгоценные металлы

Автоматизация процесса ведения учета операций купли-продажи драгоценных металлов.

- ✓ справочник драгоценных металлов
- ✓ брокерское обслуживание и ответственное хранение
- ✓ наличные/срочные сделки с обезличенной/физической поставкой
- ✓ автоматический неттинг по сделкам
- ✓ аналитические отчеты о состоянии счетов и движении металлов

Репозиторий

Автоматизация процесса обмена сообщениями с НКО АО НРД, по требующим регистрации внебиржевым сделкам с ПФИ, сделкам РЕПО и иным видам сделок.

- ✓ поддержка протокола обмена и форматов ПО «Луч»
- ✓ виды сообщений:
 - ✓ анкеты генеральных соглашений и договоров (СМ0...)
 - ✓ извещения, уведомления, выписки и запросы (RM00...)
- ✓ использование пользовательских алгоритмов для подготовки массива данных

ММВБ

МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

RTS БИРЖА

FORTS FOREX



ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Примеры экранных форм



Изменить финансовый инструмент

Ценная бумага | Свойства | Дополнительные свойства | Котируемость | Комиссия биржи

Вид, тип выпуска: акция (Акция обыкновенная)

Гос.рег.номер: 1-02-00028-A

Код Ц.Б (ISIN): RU0007661625 | Код идентификации (Торговый код): RU0007661625

Код выпуска: GAZP

Эмитент: ОАО "ГАЗПРОМ" | Валюта: Российский рубль

Дата регистрации выпуска: 30.12.1998 | Дата погашения: ..

Номинал: 5 | Размещенное кол-во: 23'673'512'900

Сумма выпуска: 118'367'564'500 | Заявленное кол-во: 23'673'512'900

Форма выпуска: бездокументарная | Порядок фиксации: на предъявителя

Наименование: Акция Газпром-во

Примечание:

Сохранить | Новая карточка | Выход

Добавить корзину

Основная

Биржа: Внебиржевой рынок | Номер: 1122/2016 | Договор: 55 | 17.10.2016

Валюта: Российский рубль | Корзина Сумма: 10'000'000 | Дата: 17.10.2016 00:00:00

Банк: ПАО "ЮнисАБ" | Возврат Сумма: 10'100'000 | Дата: 17.10.2016 00:00:00

Покупатель: Контрагент | 21 | Промсвязьбанк

Код учета: 095

Бумага	Портфель	Дата репо	Номер репо	Дата возврата	Номер возврата	Количество
1-04-01689-A	Удерживаемые до погашения	17.10.2016 00:00:00		17.10.2016 00:00:00		
20301481B	По справедливой стоимости	17.10.2016 00:00:00		17.10.2016 00:00:00		
SK-0-0M-128	Иллюстрируется в наличии	17.10.2016 00:00:00		17.10.2016 00:00:00		
* Выбрать бумагу						

Сохранить | Выход