

SLIB CLEARING MANAGEMENT SYSTEM

PRESENTATION GENERALE

SLIB CMS (Clearing Management System) s'adresse aux établissements devant gérer une activité de clearing cash et/ou dérivés en interaction avec les systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA. SLIB CMS s'adresse indifféremment à des compensateurs ou des négociateurs. Pour ces derniers, SLIB CMS peut faire l'objet d'une installation propriétaire ou d'une installation délocalisée au sein de l'architecture CMS de son compensateur multiple.

SLIB CMS est composé d'un serveur et d'une station de travail qui permettent :

- La gestion interactive de la session de clearing temps réel
- Le suivi des informations diffusées par les systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA
- Le suivi temps réel des positions au niveau des Position Accounts

Référentiels des systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA

Trades

Actions de clearing sur trades

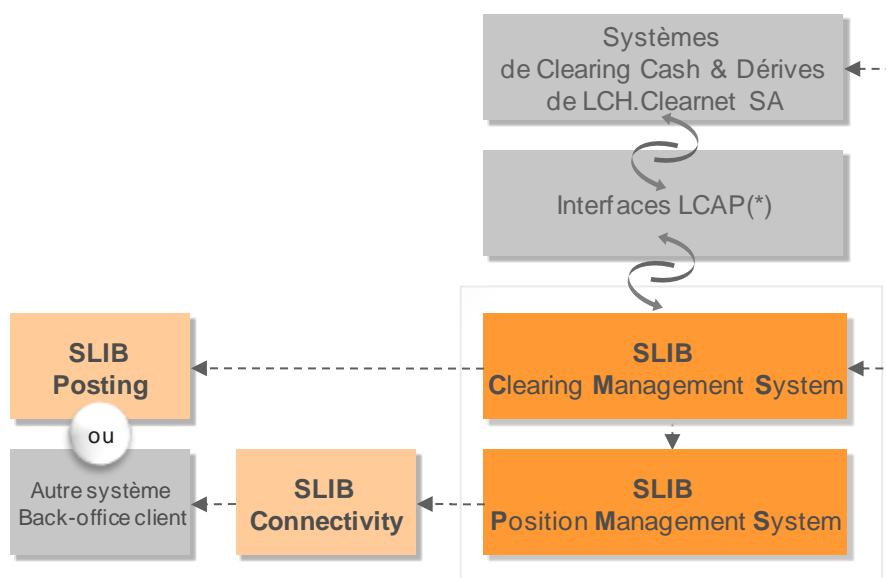
Actions de clearing sur positions

La saisie et l'envoi aux systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA de toutes les actions de clearing disponibles.

L'alimentation temps réel du module SLIB Position Management System.

SLIB CMS dispose également d'un automate qui permet d'envoyer des actions de clearing aux systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA, sur la base d'instructions en provenance d'un autre système comme SLIB Posting (dépouillement) ou n'importe quel système exogène.

FONCTIONNALITES



(*) Logical Certified Access Point

SLIB CMS est un outil de gestion et de consultation des flux, dédié aux activités de compensation sur les produits cash et dérivés. En interaction avec les systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA, mis en place sur les 4 segments d'Euronext, SLIB CMS permet la gestion de fonctionnalités à plusieurs niveaux :

Administration de flux

- Intégration en temps réel de tous les messages et fichiers privés et publics
- Eclatement des flux par segment de marché et par organisme de clearing
- Gestion des différentes classes de messages des systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA

Gestion et saisie des données

SLIB CMS intègre les différentes formes de traitement autorisées par LCH.Clearnet SA (automatique, manuel et systématique).

Par ailleurs, au travers de la station de travail, chaque utilisateur peut procéder à la saisie de tous types d'opérations autorisées par LCH.Clearnet SA ;

Ainsi il peut :

- gérer les give-up et take-up
- effectuer des contrôles de positions en net et en global
- et dans le cadre des dérivés, intégrer toutes les opérations possibles telles que les exercices d'options, le suivi des assignations, les corrections et les transferts

Consultation de données

SLIB CMS intègre et reflète les bases de données des systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA en temps réel : à tout moment l'utilisateur peut interroger cette base de données dans SLIB CMS. Ces données concernent aussi bien les Position Accounts ouverts chez LCH.Clearnet, que les dépouillements, les opérations traitées, les give-up et les take-up.

Les positions sont sauvegardées jusqu'à leur dénouement (pour les produits cash) ou leur échéance (pour les dérivés).

SLIB CMS affiche immédiatement les statuts de chaque opération, permettant ainsi à l'utilisateur de confirmer la prise en compte de ses saisies et validations.

Monitoring

SLIB CMS assure l'administration et la supervision de la communication avec les systèmes de place et fait ressortir des informations sur le niveau de connexion.

Intégration avec les systèmes externes

En amont, SLIB CMS est connecté à un LCAP, point d'accès aux systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA. En sortie, SLIB CMS sait effectuer la translation de protocole MMTP.

Ces données sont ensuite aiguillées vers les différentes interfaces applicatives (telles que les outils de tenue de positions et de suivi du risque SLIB Position Management System et SLIB CRMS ou d'autres applications de back-office clients).

SLIB CMS dispose également d'un automate qui permet d'envoyer des actions de clearing aux systèmes de Clearing Cash & Dérivés de LCH.Clearnet SA, sur la base d'instructions en provenance d'un autre système, comme le module de dépouillement SLIB Posting ou n'importe quel autre système exogène.