

SLIB CONFIRMATION

PRESENTATION GENERALE

Différentes plateformes et protocoles d'ajustement existent, afin de permettre aux Brokers-Dealers de s'entendre avec leurs clients donneurs d'ordres sur les termes de la transaction (comptes, frais, quantité, etc.) avant enregistrement dans le système back-office.

Ces plateformes s'inscrivent dans une logique STP (Straight Through Processing) assurant une rentabilité maximale et un risque d'erreur minimal du fait de l'automatisation des traitements. SLIB Confirmation suit cette logique en proposant une gestion centralisée des confirmations.

POINTS FORTS

- Permet une connexion à différentes plateformes d'ajustement et selon plusieurs protocoles (OASYS, FIX, SWIFT)
- Gère des confirmations en mode BLOC et DETAIL
- Permet de personnaliser le processus par tiers
- Gère les confirmations dans une base flux
- Propose des écrans de suivi de l'activité grâce à une interface conviviale de type Web
- Propose des schémas comptables riches
- Est interfacé avec les outils de middle-office de SLIB (SLIB Allocation, SLIB Posting)

FONCTIONNALITES

File	Date Exéc	Ref Conf Client	Statut	Valeur	Serie	Quant à Co.	Quant. Allouée	Quant. Validée	Quant. Acco...
74	17/01/2007	FIDELTY BLOCK	Accorde totalement		PRO000120273	Achat	1 000,000	1 000,000	1 000,000
80	17/01/2007	FIDELTY BLOCK	NRE annulé		PRO000120271	Achat	540,000	0,000	0,000
81	17/01/2007	FIDELTY BLOCK	NRE émis		PRO000120593	Achat	750,000	0,000	0,000
82	17/01/2007	BL 4846	NRE émis		PRO000120172	Achat	20,000	0,000	0,000
84	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120404	Achat	53,000	53,000	53,000
85	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000068024	Achat	6 774,000	6 774,000	6 774,000
86	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000062154	Achat	5 780,000	5 780,000	5 780,000
87	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120560	Vente	7 589,000	7 589,000	7 589,000
88	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000121261	Vente	45 897,000	45 897,000	45 897,000
89	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120219	Achat	951,000	951,000	951,000
90	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120628	Achat	5 000,000	5 000,000	5 000,000
91	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120628	Achat	3 000,000	3 000,000	3 000,000
92	17/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120628	Achat	1 000,000	1 000,000	1 000,000
93	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120073	Achat	500,000	500,000	500,000
94	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120172	Achat	950,000	950,000	950,000
95	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120271	Achat	570,000	570,000	570,000
96	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120321	Achat	510,000	510,000	510,000
97	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Allocation en erreur		PRO000120321	Achat	520,000	520,000	0,000
98	18/01/2007	DE BEGG	Allocation Detail liberée		PRO000120404	Achat	470,000	470,000	0,000
99	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120593	Achat	770,000	770,000	770,000
100	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120529	Achat	880,000	880,000	880,000
101	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120628	Achat	1 080,000	1 080,000	1 080,000
102	18/01/2007	FUNCI DETAIL	Accorde totalement		PRO000120637	Achat	990,000	990,000	990,000

Détail Instruction de Confirmation

Informations générales | **Allocations** | **Evénements** | **Messagerie**

VALORISATION: Le cours doit être compris entre 32,218 et 32,200

Statut instruction : **Accorde totalement** | Valeur : 1 PRO000120628 AXA | Quantité à Confirmer : Achat 1 000 UNIT

Reference Externe : | Place de Cotation : 025 PARIS | Date Exécution : 17/01/2007 17:01:47

Reference Confirmation Client : FUNCI DETAIL | Montant brut : 55 000,00 | Date Déroulement : 22/01/2007

Tiers : AMI DETAIL | Montant net : 55 000,00 | Cours Valorisation : 55,0000 EUR

Quantités	Cours
Quantité Allouée : 1 000	Cours Cotation : 55,0000 EUR
Quantité Validée : 1 000	Mode Expression Cours : A la pièce Montant Nominal : 0,00
Quantité Accordée : 1 000	Code FCC : Montant FCC : 0,00

Références / Tiers	Gestion
Reference Client ACE : 222211	Origine : ACE Mode Confirmation : DETAIL
Reference Application Origine : 200711700002001	Type de message : OASYS Emission NCE : Non
Reference Externe : 02	Validation CND : Mode émission CND : Ligne à ligne
Reference Interne : 02	Mode génération : Net Mode émission CND : Ligne à ligne
Compte Contreparte Tiers : TR 00000300001 EUR	Identifiant Broker :

Profil Demandeur : C_CharEF | Profil de Création : 0_EVP988

Indicateur de Regroupement : | Horaire de Création : 17/01/2007-17:04:29

Commentaire Broker : | Profil de Modification : MONITOR

| Horaire de Modification : 17/01/2007-17:08:07

Fermer | **Annuler Instruction**



Confirmation en mode « Détail » et « Bloc »

La confirmation en mode « Détail » permet au broker d'envoyer un Avis d'Opéré à son donneur d'ordre qui peut accepter ou refuser. La confirmation complexe en mode « Bloc » permet au broker de pouvoir recevoir de la part de son client l'éclatement de l'ordre sur plusieurs comptes et de gérer l'ajustement par compte.

Personnalisation du processus de confirmation par tiers

Les clients donneurs d'ordres sont identifiés dans le référentiel tiers SLIB Third Party qui permet de décrire le mode de confirmation à utiliser pour chacun, à savoir :

- Choix du réseau (OASYS, autre)
- Identification sur ce réseau (acronyme,...)
- Mode de confirmation (bloc / détail)
- Mise en place de point de validation utilisateur
- Mode d'envoi des Avis d'Opéré (ligne à ligne / global)
- Mode d'avertissement du back-office (ligne à ligne / global)

Ecrans

Des écrans permettent de suivre en temps réel l'activité de confirmation et de repérer : les instructions de confirmation nécessitant une intervention d'un utilisateur (correction / validation) ou celles pour lesquelles le broker est en attente de réponse de son client.

Toutes les étapes d'une confirmation (action utilisateurs, échange de messages) sont tracées et visualisables dans SLIB Confirmation.

L'outil permet également d'intervenir dans le processus de confirmation dans le cas où le processus STP ne peut être appliqué :

- Contrôle / validation de l'avis d'opéré avant envoi
- Ajustement des informations de la confirmation suite à rejet du client
- Simulation de messages (allocation, accord / refus) en cas de rupture de dialogue avec la messagerie (coupure réseau, non réception des messages du client, ...)

Schémas comptables riches

Les schémas comptables permettent d'avoir une position des confirmations initiées mais non terminées. Pour une confirmation en mode Bloc, le compte « bloc » du client est positionné en début de confirmation puis soldé lorsque le processus de confirmation est terminé. En mode détail, le schéma utilise un compte d'attente de confirmation pour matérialiser les positions non ajustées.