

SLIB POSTING

PRESENTATION GENERALE

SLIB Posting s'adresse aux Brokers-Dealers / RTO exerçant une activité d'exécution d'ordres pour compte de tiers, de réception transmission d'ordres ou de négociation pour compte propre.

SLIB Posting prend en charge :

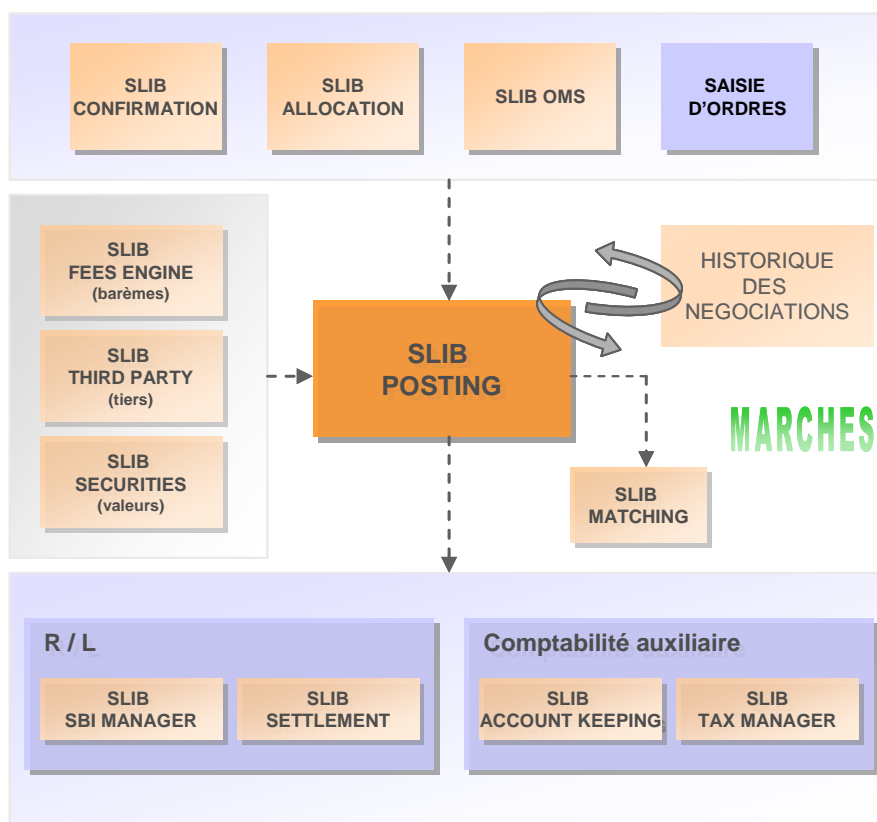
- L'acquisition des exécutions réalisées sur les marchés ou l'intermédiaire d'un broker
- Leur valorisation pour le donneur d'ordres et le broker éventuel
- Leur diffusion aux applications de back-office et aux systèmes de Règlement / Livraison

Les différents modes d'acquisition des exécutions font de SLIB Posting un point d'entrée des applications de back-office de SLIB.

SLIB Posting est :

- multi-devises
- multi-instruments
- et intègre des spécificités propres à des places (Italie, Suisse, Grande-Bretagne, Allemagne, ...).

FONCTIONNALITES



Les différents marchés couverts

- Euronext, dont le marché SRD
- Les négociations sur places étrangères
- Le marché des OPCVM
- LIFFE
- Les opérations hors marché (gré à gré, acheté / vendu)

Acquisition

Plusieurs modes d'acquisitions des négociations sont possibles :

- Les outils de front-office comme SLIB Trading et SLIB Allocation
- SLIB SBI Manager : accord et refus d'avis d'opéré
- Les différentes interfaces avec des outils externes (IGD, systèmes propriétaires clients, ...)
- Les Ecrans de saisie pour les exécutions d'ordres directs non-traitées par SLIB Allocation

Contrôles

Différents contrôles sont effectués pour assurer la cohérence de la négociation :

- Contrôle de premier niveau : alimentation, domaine de valeur
- Cohérence fonctionnelle marché / compte / valeur en fonction de l'établissement
- Contrôle de couverture pour les négociations hors carnet

Valorisation

Les postes de frais associés à une négociation sont paramétrables par code opération:

- Frais commerciaux : courtage, CRD, différentes remises, droits entrée / sortie
- Frais légaux : TVA, impôt, droit de timbre
- Frais de broker pour les négociations sur place étrangère

Les différentes règles de calcul des frais sont précisées dans SLIB Fees Engine.

La valorisation des frais est facultative dans le cas d'une négociation issue d'un outil externe (interface). Dans ce cas, l'outil externe communique une négociation pré-valorisée (brut + frais + net).

Trois devises sont intégrées dans le processus de traitement d'une négociation :

- La devise de cotation : devise liée à la place de cotation sur laquelle il y a eu négociation
- La devise de valorisation : devise d'expression des montants bruts, nets et des frais
- La devise de règlement : devise pour les conversions de change en comptabilité

Les taux de change sont propres à chaque négociation

Diffusion

Un large catalogue de diffusion fil de l'eau et batch est à la disposition de l'établissement.

Les principales diffusions se font vers :

- La comptabilité
- La tenue des positions titres et espèces
- Les systèmes de R / L au travers de SLIB Settlement (dénouement)
- Les systèmes d'ajustement tels que SBI (pour la France) ou divers ETC (OMGEO, SWIFT)
- La fiscalité
- Un infocentre via une requête (ex. : requête ARCOLE)
- Une application de gestion de FAX / TELEX
- L'outil d'Editique pour les relevés d'opérations. Un ensemble d'états de gestion vient compléter ces diffusions.