

SLIB SETTLEMENT

PRESENTATION GENERALE

L'internationalisation des activités financières conduit à accroître le nombre des acteurs avec lesquels vous êtes en relation dans vos opérations post-marché.

SLIB Settlement vous permet de répondre à la multiplication et à la complexité croissante des Instructions de Règlement / Livraison (IRL).

SLIB Settlement est un outil qui s'adresse à tous les établissements qui doivent gérer des IRL qu'ils soient TMF, ICM, GCM ou teneur de comptes – conservateur pour dialoguer avec leurs dépositaires étrangers. SLIB Settlement centralise dans une base unique toutes les IRL pour en faciliter la gestion, le suivi et le pilotage, indépendamment de leur origine et du mode de dialogue avec les intervenants.

Les IRL peuvent être :

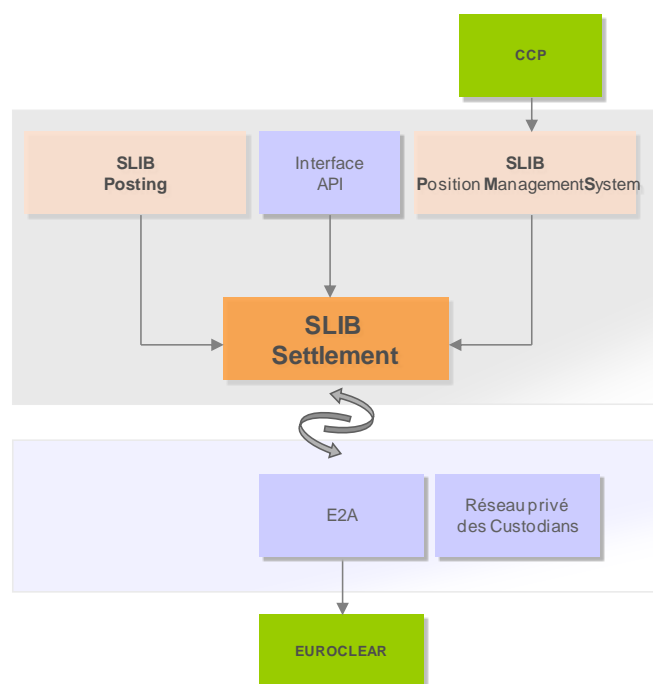
- générées automatiquement par SLIB Posting pour des relivraisons d'institutionnels ou la gestion de négociations non garanties
- reçues de systèmes exogènes à travers une API
- élaborées par le module SLIB Position Management System à partir des flux reçus des chambres de compensation
- les OST sont également prises en compte

En émission et en réception, SLIB Settlement peut fonctionner :

- avec des formats de messages SWIFT (15022 et bientôt 20022) ou des formats propriétaires
- en adressant divers réseaux de communications : E2A pour ESES, BT RADIANTZ ou autre réseau public ou privé

POINTS FORTS

- Gestion centralisée de toutes les instructions de Règlement / Livraison
- Connecteurs disponibles à plusieurs réseaux d'échanges de données
- Algorithmes multiples de netting pour générer des économies d'échelles (Date de dénouement, Sens, Prix d'exécution, ...)
- Conception du système fondée sur le standard international en matière d'échanges d'instructions de Règlement / Livraison (Norme ISO 15022 aujourd'hui, 20022 demain)
- Personnalisation des messages échangés avec de nombreux Global Custodians pour adresser plus de 30 marchés
- Gestion de la « Cascade » des instructions échangées (local / sub-custodian)



FONCTIONNALITES

Les acteurs du processus

SLIB Settlement distingue les différents acteurs qui interviennent dans le processus de Règlement / Livraison :

- le bénéficiaire : propriétaire des titres échangés
- le donneur d'ordre : initiateur de l'instruction
- l'exécutant de l'instruction : il s'agit de l'entité mandaté pour régler-livrer les titres
- la contrepartie de l'instruction de Règlement / Livraison
- le dépositaire adressé et final, dans le cas d'un dénouement local ou cross-border

La Matrice d'aiguillage

La Matrice d'aiguillage permet de déterminer les modalités d'exécution de chaque instruction.

Le dépositaire peut être identifié selon la contrepartie, la place de cotation, le type d'instruments, la valeur, le type de négociation.

Elle précise les coordonnées de l'établissement chez le dépositaire, le réseau, le format de message et le modèle de « netting » à utiliser pour générer et transmettre l'instruction de Règlement / Livraison.

Le suivi des statuts

Chaque changement d'état d'une instruction est suivi dans SLIB Settlements qui conserve la trace de tous les événements intervenus sur cette instruction.

Ces changements de statuts sont d'origine :

- interne (création de l'instruction, modification, validation, annulation, netting, recyclage)
- ou externe, événements sous forme d'avis reçus des systèmes de Règlement / Livraison (postage, appariement, dénouement, suspens, annulation exécution, rejet d'annulation,...)

Gestion des instructions

Différents écrans à sélections multi-critères permettent de consulter les instructions.

Les instructions peuvent être corrigées, modifiées, validées, annulées, recyclées.

Elles peuvent être dupliquées ou « splitées » pour permettre de générer une nouvelle instruction liée à l'instruction d'origine.

Détail d'une instruction de R/L							
Détail	Référence Interne	201002010000190	Externe	EUR202076	lib flux	1	
Evénements	Opération	LCP Livraison Contre Paiement	Irrevocable	Oui	Dénoù le	04/02/2010 à 20:39:55	
Liens	Etat	EXTOT Exécution totale en une seule fois	Place	006	Pays	BEL BELGIQUE	
Flux	Valeur	I BE0003793107 ANHEIUS BUSCH HBEV	Agence	000	Racine	35016	
Avis	Donneur d'ordres		Compte bénéficiaire	TI 0000500141	EUR	DEX AM LUX	
OST	Partie	S 0000000051 00001 DENIA SECURITES FRA	Partie	S 00000001003	RIB	BELGIUM NVISA	
Spécificités	Contrepartie		Quantité	Vente	Instruction	448 UNIT	
Segments analytiques	Montant	Credit	Rejeté	0	Exécuté	448	
Mouvements titres	Rejeté	0	Restant	0	Restant	0	
Prêt emprunt	Montant	Credit	Instruction	16191.93	EUR	Exécuté	16191.93
Pension livrée	Rejeté	0.00	Restant	0.00	Restant	0.00	
Observations	Informations détaillées						
Frais	Statut	Statut externe	TRAITE	Statut	Statut externe	TRAITE	
Segment EIC	Instruction	Oui	Le	01/02/2010 à 16:41:23	Etat	Etat actif	
Intermédiaires	Destination RL	I Destination Interne	Mode de traitement	A Ajustement	Mode d'exéc	A Ajustement dans Système de RL	
Rafraîchir	Mode de traitement	A Ajustement	Code filière	SL SLAB/RQV	Code filière	SL SLAB/RQV	
Quitter	Réseau de RL	SIGMA - SIGMA de SICQ/VAE	Lieu de livraison	XBRU NYSE BRUSSELS	Depositaire final	EUROCL BE	
	Code message	UTS02	Pré appariement	Non	Code net (EB)		
	Depositaire	EUROCL BE	Date de création	01/02/2010 16:41:23	Date de négociation	01/02/2010 17:45:00	
	Caractéristiques		Code externe valeur	8500393107	Type de valeur	041	
	Date de création	01/02/2010 16:41:23	DER Déploiement	DN/300	Client	Non	
	Date de négociation	01/02/2010 17:45:00	Type d'instruction	S Push	RL à notifier	Non	
	Code externe valeur	8500393107	RL à notifier	Non	Reconnue	Oui	
	Ordonne	Non	RL interne	Non	RL annulée	Oui	
	Code RL	Non	Centre-passation	Non	Livré destinataire	Non	
	Type d'instruction	S Push	Service destinataire	Non	Montant brut	16175.75 EUR	
	Indicateur gestion RL	Non	Montant brut	16175.75 EUR	Cours	36.35 EUR	
	RL à notifier	Oui	Cours	36.35 EUR	Prix de levant	0.00 EUR	
	Reconnue	Non	Prix de levant	0.00 EUR	Bénéficiaire		
	RL interne	Non	Commentaire		Ordre		
	RL annulée	Oui	Ordre		Libro		
	Livré destinataire	Non	Libro		Références et comptes externes		
	Montant brut	16175.75 EUR	Identifiant déboulement		Date	01/02/2010	
	Cours	36.35 EUR	N° lot	830	N° neg		
	Prix de levant	0.00 EUR	Référence externe coté contrepartie		N° neg	1	
	Bénéficiaire						
	Ordre						
	Libro						