

SLIB OMS

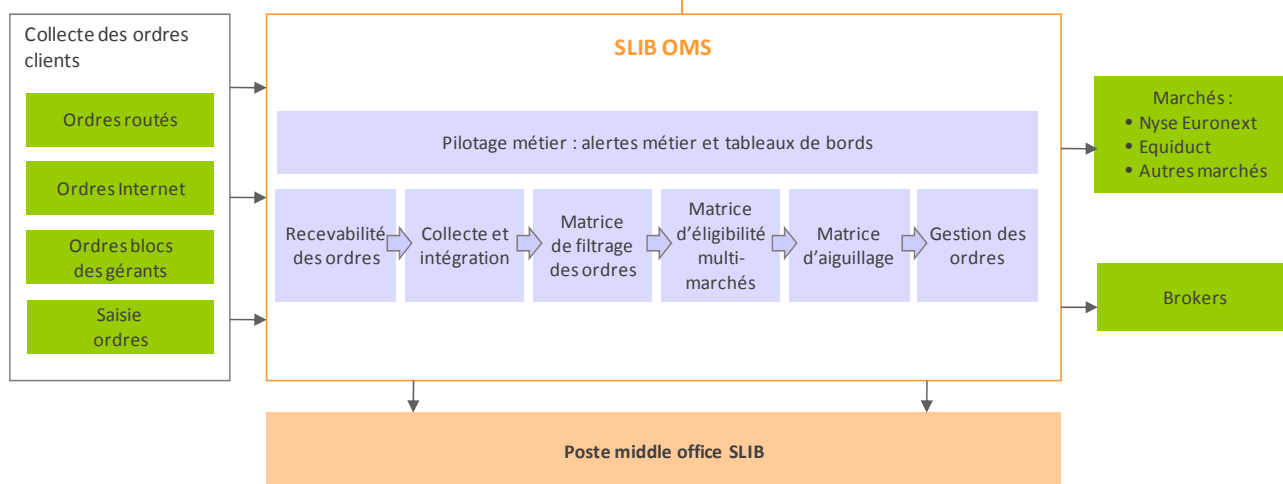
Présentation générale

Dans un contexte international de forte concurrence et d'augmentation des volumes d'ordres à traiter, **SLIB OMS** s'adresse aux Broker dealers ou encore aux Asset managers qui souhaitent sécuriser la gestion de leurs ordres et automatiser les flux d'ordres selon des règles de routage prédéfinies.

Les ordres exécutés sont enregistrés dans le carnet marché et alimentent vos systèmes post-marché. Les allocations qui sont issues de **SLIB OMS** sont diffusées automatiquement vers le poste de middle office.

SLIB OMS gère le processus de passage d'ordres en plusieurs étapes :

- Les ordres sont collectés via différents canaux (réseaux de brokers, pseudo-RONA, ORFI, Internet, FIX,...).
- La Centrale de couverture contrôle la recevabilité des ordres et calcule en temps réel le pouvoir d'achat et crédit d'espèces du client, comptant ou SRD.
- La matrice de filtrage permet de filtrer les ordres via la mise en place de règles paramétrées.
- Une matrice d'éligibilité multi-marchés définit si l'ordre est éligible à un lieu d'exécution alternatif et détermine le marché où ce même ordre doit être adressé.
- Une matrice d'aiguillage détermine le mode de traitement des ordres en fonction de ses caractéristiques.
- Les ordres sont routés sur le marché ou vers des brokers selon les règles paramétrées dans la matrice d'aiguillage.



Points forts

- + Carnet d'ordres unique multi-marchés, multi-devises et multi-instruments
- + Information en temps réel de l'évolution du statut de l'ordre de son exécution jusqu'à son allocation
- + Ergonomie simple d'usage avec le carnet client et le carnet marché sur la même interface

SLIB OMS : une offre riche pour le traitement STP des ordres

- + Gains en réactivité et qualité : structure de pilotage dédiée aux opérationnels (tableaux de bord et alertes métier en temps réel)
- + Traçabilité des opérations conformément aux règles déontologiques et à votre politique commerciale

Fonctionnalités

Collecte des ordres

SLIB OMS collecte tout type d'ordre en provenance :

- D'un réseau pseudo-RONA ou ORFI pour les ordres en provenance d'établissements bancaires
- De réseaux Internet de collecte d'ordres (ex réseau d'agences)
- De réseaux de collecte d'ordres de brokers : FIX, etc.
- De systèmes de gestion de portefeuilles comme **SLIB Portfolio Manager** (ordres bloc et détail)
- De saisies directes comme **SLIB Web Service**

Les types d'ordres traités par **SLIB OMS** sont :

- Des ordres à exécuter ou d'annulation
- Des ordres bloc ou détail

Recevabilité des ordres

La recevabilité des ordres est effectuée par la centrale de couverture qui est intégrée dans **SLIB OMS**.

Matrice de filtrage des ordres

La matrice de filtrage est à la main du client. Elle permet de filtrer les ordres nécessitant une attention particulière, via la mise en place de règles paramétrées. Ces règles sont bâties à partir des caractéristiques de l'ordre client (cours, montant, valeur, quantité, groupe de cotation, ...).

Les ordres client ayant vérifié au moins une des règles de filtrage sont bloqués dans le carnet d'ordres, en attente d'un traitement manuel (forçage envoi sur le marché, saisie de l'ordre sur poste de négociation, ...).

Matrice d'éligibilité multi-marchés

La matrice d'éligibilité multi-marché de **SLIB OMS** permet à chaque broker de paramétrer une logique de décision très fine adaptée à sa politique et aux choix de ses clients : montant, type de validité, modalité, groupe de cotation de la valeur, ..., de nombreuses caractéristiques de l'ordre sont disponibles pour entrer dans les critères de décision.

Matrice d'aiguillage et qualification de l'ordre

La matrice d'aiguillage de **SLIB OMS** permet de définir sa valeur via des critères (origine ordre, marché, groupe de cotation, ...) avec quel connecteur et vers quel marché ou broker, l'ordre doit être émis :

- Si l'ordre doit être présenté directement sur le marché et enregistré dans le carnet d'ordres marché
- Si l'ordre doit être édité sous forme d'une fiche de bourse, afin d'être saisi directement dans un poste de négociation
- Si l'ordre doit être édité ou routé directement et vers quel broker

Gestion et suivi des ordres

Des fonctions de consultation sont accessibles dans **SLIB OMS**, afin de suivre l'évolution d'un ordre et de son statut :

- Qualification et aiguillage de l'ordre
- Réponses
- Ordres marché
- Rejet
- Statut de l'ordre

Ces fonctions de consultation vous permettent également d'intervenir sur l'ordre :

- Regroupement
- Modification
- Annulation
- Exécution de l'ordre
- Macro-commande

Les OST sur flux (détachement de coupons, droits, etc.) sont appliquées automatiquement sur les ordres, qui sont alors réémis sur le marché.

Connexions aux marchés

SLIB OMS vous propose deux modes de connexion :

- **Si vous êtes membre de marché**
Vous pouvez par exemple interfacier **SLIB OMS** à une station de trading pour la partie « suivi des négociations ». **SLIB OMS** peut également s'interfacier avec tout autre outil.
La matrice d'aiguillage vous permet de router les ordres avec la connexion marché de votre choix. Des moniteurs en temps réel assurent le dialogue pour chaque connexion selon un protocole sécurisé (maillonnage, Heart Beat, demande réémission, etc.) basé sur TCP/IP.
Les connexions sont suivies par les systèmes de supervision de **SLIB** (gestion d'alertes, tableau de bord). Un système de back-up permet en cas de problème sur une connexion d'orienter les ordres vers une connexion de back-up.
- **Si vous n'êtes pas membre de marché**
Vos ordres sont routés vers un broker. La transmission des ordres est effectuée au travers de réseaux de brokerage auxquels doivent être raccordées les brokers. Plusieurs réseaux, formats et protocoles sont gérés (FIX, etc.).

Gestion des retours d'exécution

Pour les ordres client, le regroupement est effectué à cours moyen. Pour les ordres directs, les exécutions et les allocations viennent alimenter le **poste de middle office de SLIB**. Le regroupement est effectué à cours moyen automatiquement. Il est possible d'émettre des réponses sur l'exécution de l'ordre à son émetteur.

Pilotage métier : tableaux de bords et statistiques

Des tableaux de bord exhaustifs et un moniteur de gestion des alertes permettent aux opérateurs de piloter, consulter et justifier chaque décision prise par **SLIB OMS** pour chaque ordre.

Dans **SLIB OMS**, vous pouvez consulter: les fiches de bourse, les erreurs sur ordres reçus, les retours marché les messages échangés (émis/reçus) avec le marché.

Vous disposez de statistiques journalières sur les messages échangés avec les émetteurs d'ordres et les marchés et/ou brokers (nombre d'ordres, d'annulations, d'acquittements, de rejets, d'exécutions, etc...).

Pour plus de renseignements sur notre offre, merci de contacter notre équipe commerciale au +33 1 70 36 97 00 ou par mail à sales.contact@slib.com.

