

FINANCIAL RISK MANAGEMENT & IAS 39

Gestione delle operazioni di copertura dal **rischio cambio e tasso**:

- Operazioni SPOT, Outright e NDF,
- Forex Swap,
- Option PUT e CALL,
- Forward Rate Agreement,
- Interest Rate Swap (IRS, Amortized IRS, FIRS),
- Basis Swap,
- Cross Currencies Swap,
- Interest Rate Option (Cap, Floor e Collar).

Gestione dedicata delle attività di **Middle Office** e di **Back Office**.

Funzionalità di **adeguamento e ricalcolo** del valore dei contratti al variare delle quotazioni di mercato.

Abilitazione ai vari livelli di gestione in funzione dello **stato di avanzamento** del contratto.

Schemi contabili parametrici e modalità di gestione dei prodotti derivati.

Integrazione diretta con applicazioni Piteco di Front-Office per la gestione di scenari di valutazione, negoziazione on-line contratti, determinazione pricing prodotti derivati, gestione liquidità, ecc.

Simulazione dell'impatto delle operazioni derivate stipulate o in corso di valutazione sulla posizione finanziaria a tendere, con generazione automatica di voci previsionali.

Gestione **anagrafica** delle controparti finanziarie, banche di copertura, durata, data regolamento, scadenza, data expiry, tassi, periodicità, ecc.

Gestione dell'estratto conto della singola operazione e generazione automatica delle **lettere di istruzione** agli istituti finanziari e controparti.

Integrazione con il Cash Management e con i report standard PITECO di inquiry saldi e flussi di Cash Flow.

Gestione automatizzata delle scritture contabili di valutazione degli strumenti derivati, di finanziamento, di mutuo nel rispetto **dell'International Accounting Standard (IAS 39)**.

Tracciabilità e storicizzazione delle diverse valutazioni e dei loro elementi di riferimento (**Fair Value, Test di Efficacia** della copertura, percentuali di copertura, costi di transazione, tassi d'interesse effettivo e relativo **costo ammortizzato**, ecc.).

Gestione Tassi - Sviluppo rate (Zoom Window)

Trascina qui l'intestazione di una colonna per raggruppare

Data liquidazione	Div. fisso	Importo nominale	Tasso fisso	Interesse fisso	Importo nominale	Tasso variabile	Interesse variabile	Data calcolo pag...	Data calcol
31/05/2010	EUR	8.000.000,00	2,87500	-638,89	8.000.000,00	3,02500	1.344,44		
30/06/2010									
31/07/2010									
31/08/2010									
30/09/2010									
31/10/2010									
30/11/2010									
31/12/2010									
31/01/2011									
28/02/2011									
31/03/2011									
30/04/2011									
31/05/2011									
30/06/2011									
31/07/2011									

Rubrica Copertura e Derivati

DEMO - Società Demo [Conferma] [Annulla] [Pulisci] [Registra] [Conferma Prodotto] [Chiusura] [Esecuto] [Rubrica] [Rimuovi] [Dettaglio] [Lettere]

Gestione Rubrica Copertura e Derivati **Gestione Cambi**

Gestione movimenti - Numero Prodotto: (123)

Tipo Buy

Prodotto FWD BUY

Dati principali - Proposto

Contratto Legato

Controparte SANPAOLO

Data registrazione 05/03/2010 Operazione 05/03/2010 Valuta 09/03/2010

Data scadenza 31/03/2010 Expiry 29/03/2010

Divisa 1

Divisa 1 USD

Imp. Termine 100.000,00

Conto Termine SPAOLO USD Conto Impegni SPIMI AT

Divisa 2

Divisa 2 EUR

Imp. Termine 73.463,51

Conto Termine SPAOLO CC Conto Impegni SPIMI VT

Cambio Spot 1,36 Premio Fwd 0,00122 Cambio Fwd 1,36122

Cambio Co.Ged 0,0 (Div. 1 / Co.Ge)

Descrizione

Banca Cop. Ctp/Pronb

Banca Cop. Ctp/Term.

Dati aggiuntivi

Altri dati

Causale

Numero operazione 2.010.000.701

Stagione

Linea

Fonte dati

Sistema esterno