

# FINANCIAL FUTURES

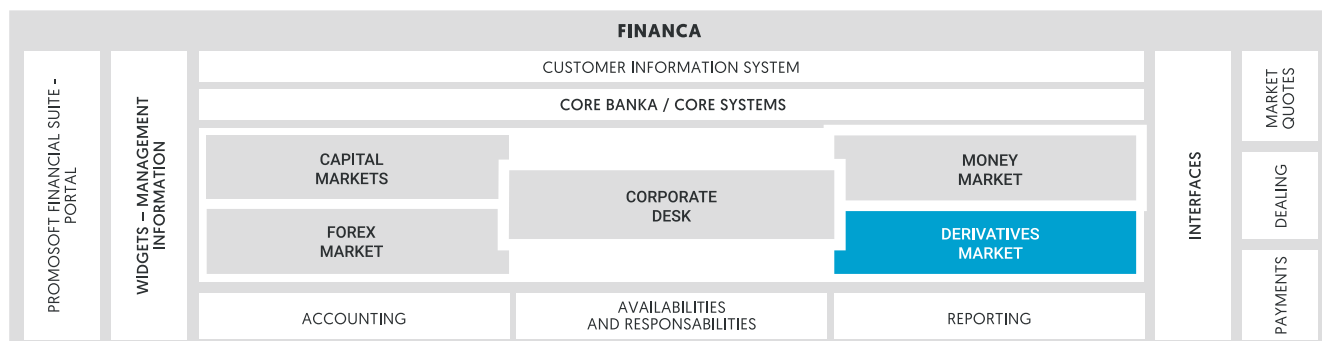
Period	Open	High
Jun 06 .....	110.52	110.7
Sep 06 .....	110.27	110
Sep 06 .....	133.21	133
Dec 06 .....		
Jun 06 .....		
Sep 06 .....		
Dec 06 .....		



## Derivatives Market.

Integrada nas aplicações Promosoft Financial Suite (PFS) - **DERIVATIVES MARKET** é uma solução parametrizável que automatiza a gestão de contratos, realizados no Mercado de Derivados.

A solução engloba dois produtos base, Futuros e IRS (Interest Rate Swaps).



## Funcionalidades

- Parametrização à medida de cada Instituição considerando os produtos base, Futuros e Interest Rate Swap;
- Registo de transações de Futuros e IRS;
- Gestão integrada das operações, validação, alteração, anulação ou cancelamento;
- Gestão de contas margens em Futuros e fechos de posição;
- Gestão de fluxos financeiros IRS;
- Disponibilização de informação das transações realizadas, cotações de mercado Futuros atualizadas e resultados apurados;
- Gestão de posição viva, com automatização contabilística, reavaliação de Futuros, fechos de posição, manutenção de contas margem, e periodificação de juros IRS e respectivos pagamentos/recebimentos de juros IRS, alterações/cancelamentos de transações;
- Straight-Through Processing - Processamento completo de transações;
- Gestão mensagens SWIFT (formatação, tratamento, e recepção para IRS);
- Indicadores de Gestão – resultados, reavaliação futuros, contas margem, risco crédito;
- Interface Web – Portal PFS, Widgets.

## Vantagens

- Gestão end-to-end de todo o negócio;
- Flexibilidade e customização adequada aos mercados de instalação, de acordo com as características específicas dos produtos financeiros;
- Gestão de risco operacional, através da definição de limites em função do contexto (definição de margens de actualização e negociação de cotações e taxas de juro, limites de crédito por contraparte, limites por utilizador na realização de transações e níveis de autoridade/autorização);
- Celeridade na implementação (time-to-market);
- Contabilização integrada com o Core Banking ou soluções de terceiros on-line.

