



PLATEFORME MODULAIRE N3

BANK – CORPORATE – ASSET MANAGEMENT

CORPORATE

DERNIERE MAJ : 09/09/2011



Agile Information Technology



Avec une couverture complète des opérations et des flux financiers, la plateforme modulaire N3 offre une solution intégrée évolutive et en temps réel pour la gestion de la trésorerie d'entreprise.

Couverture instrumentale

Dette long terme

- Dépôts / Emprunts
- Lignes de crédit
- Titres de créance : BMTN, CDN, BTAN, ECP, etc.
- Pensions livrées

Change

- Comptant / Terme
- Swaps de change
- Options de change vanilles, barrières activantes et désactivantes, digitales
- Accumulateurs
- Gestion des reports et dénouements

Instruments de couverture

- Swaps de taux standards, asynchrones, amortissables
- Cross currency swaps
- Equity swaps
- Swaps de variance
- Basket equity swaps
- F.R.A.
- Caps-floors
- Swaptions

Placement

- Achats / Ventes d'actions
- Souscriptions / rachats de parts d'OPCVM
- Obligations : OAT, FCC, Convertibles, amortissables, zéro-coupon, à revenu fixe ou variable, etc.
- Options sur titres
- Emissions obligataires
- Prêts de titres
- Gestion des OST

Produits structurés

- Plafond, reverse, look back, cliquets, best of, etc.
- Corridor de taux, corridor de change
- Binaire, barrière, participatif, intéressement

Matières premières

- Contrats physiques
- Options
- Swaps

Marchés organisés

- Contrats futures d'indices, de taux, de titres
- Options sur contrats futures, indices, sur actions, etc.

Positionnement Front & Middle-office

Pricer n'importe quelle opération

- Pricing immédiat sur tous les instruments de marché dès la pré-saisie
- Justification des calculs directement à l'écran
- Méthodes de valorisation paramétrables
- Calcul des coefficients grecs
- Structures de volatilités multidimensionnelles
- Récupération des données en temps réel

Environnement de saisie optimisé

L'environnement de saisie offre toutes les possibilités d'une intégration efficace et adaptée à tout contexte :

- Saisie, pré-saisie par volet
- Saisie réelle, simulée, réservée
- Importation automatique par fichier
- Génération automatique des confirmations, tickets etc.
- Contrôles immédiats pilotés par des contraintes
- Fonctions utilisateurs : duplication, navigation, recherche, présélection, tri, etc.

Suivi d'activité

Les analyses se présentent sous une forme détaillée ou synthétique organisées selon un choix de plus de 800 éléments d'informations - statiques ou calculs :

- Suivi des opérations : production d'états statistiques d'activité multicritères
- Suivi des positions : inventaires, encours, positions, etc. selon une analyse multicritères (secteur d'activité, rating, zone géographique, ...)
- Suivi de la trésorerie : suivi d'intérêts, remboursements, échéances, frais et commissions, positions de change, etc.
- Suivi des résultats : P&L, couru, portage, prix de revient, plus-value, amortissement de surcote, ...

Suivi des risques

L'environnement Risques de marché comprend la valorisation MtM des instruments, l'analyse de la sensibilité sous de multiples aspects :

- Simulation : saisie, impact sur les valorisations – reportings, sur courbes, matrice de volatilité, etc.
- Matrices de stress testing
- Méthodes de valorisation paramétrables
- Calcul de VaR historique, Var Monte-Carlo
- Historisation des taux de marché
- Rétroactivité des calculs de valorisation

La plateforme N3 met en application au quotidien les fonctions Straight Through Processing. L'indépendance entre le front et le back est parfaitement intégrée.

BANK – CORPORATE - ASSET MANAGEMENT

Normes IFRS

Le module de gestion des couvertures gère les fonctionnalités suivantes :

- Natures de risques : taux / change / crédit
- Intentions de gestion à travers les portefeuilles
- Relations de couverture 1/1, 1/N, etc.
- Tests d'efficacité prospectifs et rétrospectifs
- Reporting de justification
- Historisation des composants efficaces et inefficaces
- Génération de CRI d'efficacité et d'inefficacité
- Double comptabilisation GAAP et IFRS

Suivi des limites

L'environnement de limites permet la définition de contraintes dans une approche globale et évolutive:

- Analyse multicritères : contrepartie, ratios, etc.
- Contre valorisation des encours dans une devise
- Introduction de filtres paramétrables
- Agrégation selon le tiers, groupe ou toute hiérarchie
- Présentation par instrument, maturité, catégorie
- Matrice de pondération multicritères : durée, rating, etc.

Positionnement Back-office

Piste d'audit

La piste d'audit assure la conservation des liens et des modifications :

- Suivi des statuts et journalisation des traitements
- Gestion des modifications
- Génération automatique d'extournes contextuelles suite à une annulation : comptabilité, trésorerie, CRO, CRE, messages Swift, etc.

Gestion des événements

La gestion événementielle comprend un ensemble de traitements Back-office permettant un suivi automatique des opérations :

- Traitement des échéances : expirations, remboursements, tombées d'intérêts
- Arrêtés mensuels : réescompte, réévaluation
- Traitement des appels de marge
- Liquidation et mise à jour des positions sur les instruments fongibles
- Production des fichiers de CRE personnalisables

Comptabilisation

Le système comprend un traducteur comptable complètement intégré permettant la production d'une comptabilité auxiliaire espèces ou matière :

- Traduction de tous les événements Back-office en mouvements comptables historisés dans une comptabilité auxiliaire
- Etats comptables standards : balances, extraits de comptes, justificatifs de soldes, ...
- Exportation personnalisable vers le site central

Règlementation

La plateforme permet, via ses fonctions de modélisation de rapports et d'interfaces, un paramétrage totalement personnalisé des restitutions réglementaires :

- Fichiers de données nécessaires au traitement BAFI
- Déclarations des émissions de TCN
- Déclarations des opérations de change
- Comptes rendus de paiements
- Données nécessaires aux déclarations CAD
- Reporting de justification IAS-IFRS

Automates S.T.P.

Les automates permettent une exécution séquentielle d'un ensemble de tâches élémentaires. L'automatisation permet de générer automatiquement :

- Des traitements Back-office : échus, réescompte, etc.
- Des courriers : confirmations et avis clientèle
- Des écritures comptables
- Des mises à jour des données de marché
- Des exports de fichiers : comptabilité, positions, CRE, etc.
- Des messages Swift
- Des fonctions générales : reporting de production, imports-exports, rapprochements, matrices de risques, états réglementaires, etc.

Rapprochements

Ce module permet de s'affranchir d'un outil externe dédié aux travaux de rapprochements. L'intégration de cette fonctionnalité permet :

- Des rapprochements de flux, mouvements, positions, etc.
- Des sources multiples : compensateurs, dépositaires, systèmes internes, etc.
- Un paramétrage complet : règles de tolérance, clefs de rapprochements, transcodification, etc.

Pour personnaliser le standard, la plateforme dispose d'un environnement « Système » totalement intégré. L'administrateur a la possibilité de personnaliser les écrans de saisie, le reporting, les interfaces, le workflow, les traitements, les contrôles, etc. le tout, sans aucune programmation.

Messagerie R/L

La production des fichiers à l'attention de systèmes de règlement livraisons est totalement paramétrable sous différents formats :

- Génération des messages Swift
- Génération des fichiers fax, mails
- Intégration de fichiers externes pour une mise à jour automatique de statuts
- Gestion des annulations

Gestion des relations filiales / groupe

Gestion de la trésorerie des filiales :

- Gestion des comptes courants intragroupe
- Prévisions, rapprochements de trésorerie
- Reporting de trésorerie filiale : soldes, journaux, fiches en valeur

Gestion des opérations : prêt/emprunt, change, effets

Connexion bancaire, analyse des mouvements

Comptabilisation

Workflow d'appels de fonds

Publication du reporting

Cut off time groupe

Gestion de la trésorerie groupe

Cash pooling

Reporting de trésorerie Groupe :

- Soldes consolidés
- Trésorerie nette
- Analyse des écarts
- Contrôle des opérations bancaires : échelles d'intérêts, agios et frais

Opérations de trésorerie :

- Virements de trésorerie
- ZBA
- Opérations en compte
- Budgets

Personnalisation à tous les niveaux

La plateforme dispose d'un environnement très puissant dédié à la personnalisation. L'administrateur a la possibilité, sans aucune programmation, de personnaliser :

- La saisie des opérations
- Les interfaces
- Les règles de gestion
- Le reporting
- Le niveau d'automatisation
- Les accès
- Etc.

Personnalisation des définitions

Le système permet d'introduire des critères libres conduisant à un schéma de données extensible dynamiquement. Les informations ainsi créées sont actives vis-à-vis de tout traitement :

- Tous types de hiérarchies pour les tiers, portefeuilles, instruments
- Critères libres complémentaires
- Saisie personnalisée
- Statuts spécifiques

Personnalisation du reporting

La plateforme comprend un outil dédié à la modélisation de rapports, totalement intégré. Plus de 800 fonctions de calculs sont disponibles :

- Livraison du système avec plus de 150 rapports standards
- Analyses multicritères
- Possibilité d'enchaînement automatique
- Personnalisation de la structure : libellés, largeurs, formats, agrégation, arborescence, etc.
- Exportation sélective sur outil bureautique
- Outils de recherche, tri, présélection
- Aucune programmation

Personnalisation des interfaces

Le système dispose d'une fonctionnalité de modélisation d'interfaces qui permet de générer des fichiers exportés selon un format spécifié, sans programmation. Son usage est d'une portée globale :

- Fichiers règlementaires
- Génération de CRO, CRE, CRI
- Alimentation des systèmes périphériques : comptabilité, trésorerie, infocentre, etc.

La plateforme N3 peut être installée selon trois configurations : Directement sur les serveurs clients, hébergée par l'éditeur ou en SaaS.

BANK – CORPORATE - ASSET MANAGEMENT

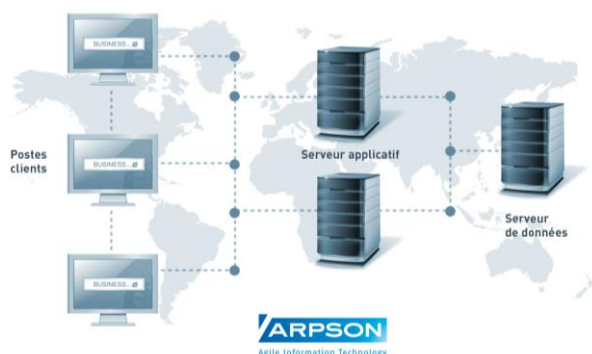
3/tiers sur les serveurs clients

Cette architecture présente trois niveaux :

La partie cliente installée sous Windows 98, NT, 2000, XP, 7, Vista qui gère l'affichage et la relation avec le serveur applicatif

La partie serveur de traitements installée sous Windows Vista, 7, 2003, XP, 2008, où s'exécutent les traitements et calculs de l'application Arpson

La partie serveur de données, qui fonctionne sur tout système supportant Oracle à partir de la version 8 (Windows, Unix, etc.)



Hébergée par ARPSON ou SaaS

Communication des postes clients avec le serveur Web assurée via Internet

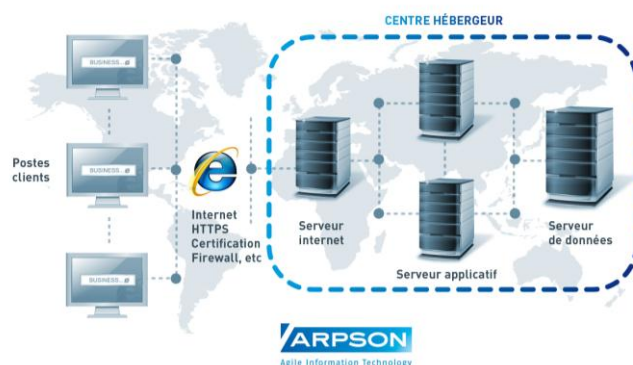
Connexion sécurisée via protocole « https »

Les aspects techniques sont externalisés (la maintenance des serveurs, les sauvegardes de données, etc.)

Les coûts d'exploitation sont largement simplifiés (la maintenance, les sauvegardes)

Accès sécurisé, protégé et confidentiel pour le client à cet environnement aux heures et jours ouvrés

Disponibilité garantie > 98%



Maintenance assurée pour toutes les installations

Correction continue de la plateforme

Service de hotline

Mises à jour régulières des nouvelles versions de la plateforme

Sécurité pour les connexions hébergées et SaaS

Connexion SSL 128 Bits

Certification SSL pour identification du serveur

Certification SSL (X 509) pour identification du client

Filtrage de l'adresse IP sur Firewall

Authentification ARPSON : combinaison login / mot de passe

Les + Service interface Data Feed

ARPSON propose un service d'alimentation du référentiel en données de marché, en provenance des grands contributeurs de flux. Les données récupérées sont : les taux, les cours de change, les volatilités, les equities, les commodities, etc. Ces données sont récupérées en clôture, pour la valorisation Back-office, ou en temps réel pour le Front.

Les + Services inclus dans le SaaS

Time to market réduit : accès direct à la plateforme standard

Création des utilisateurs et affectation des profils

Mutualisation des évolutions applicatives

Supervision de l'alimentation en données de marché

Supervision de la génération des interfaces

Synthèse d'activité périodique : nombre de connexions, nombre de deals créés, temps de résolution des erreurs

Prestation de sauvegarde pour les installations hébergées et SaaS

Stockage redondant (Raid 5)

Stockage quotidien en accès distant dans les locaux d'un prestataire offrant toutes les garanties de sécurité

Plateforme protégée 24/24h et 7/7j par vidéo surveillance,

Accès limité au personnel autorisé,

Protection contre les incendies, etc.

PRA



Qui nous sommes

ARPSON est un fournisseur de plateforme logicielle offrant aux banques, trésoriers et asset managers la solution la plus performante de son secteur pour la gestion des opérations de marché, de trésorerie et d'actifs.

Fondée en 1995, la société ARPSON est née de la volonté d'hommes passionnés par la maîtrise des systèmes complexes, désireux de combiner la meilleure technologie aux problématiques les plus pointues. En ciblant la France comme premier marché, ARPSON devient rapidement leader, avec des clients appartenant chacun à un segment d'activité différent, permettant ainsi l'émergence d'une plateforme financière globale, multi-métiers.

Modulaire et ouverte, la plateforme s'adapte aux besoins de ses clients, aujourd'hui et dans l'avenir, en couvrant les principaux axes de gestion : Front-office, Risk, Cash, Règlementation, Back-office et Comptabilité.

Porté par des collaborateurs motivés et performants, ARPSON n'a de cesse de concevoir, déployer et maintenir ses solutions. Avec plus de 1000 utilisateurs répartis sur près de 100 références, ARPSON a su s'imposer, en France, comme le principal acteur du marché et amorcer solidement son développement à l'international.



Agile Information Technology

176 avenue Charles de Gaulle
92200 Neuilly sur Seine

| T | +33 (0)1 46 43 91 91
| F | +33 (0)1 46 43 91 90
| E | sales@arpson.com
| S | www.arpson.com