Автоматизация операций с фьючерсными контрактами с фиксированной датой в Diasoft FA# Treasury

Компания «Диасофт», активно поддерживая инновации Московской Биржи (МБ) на финансовых рынках, разработала решение по поддержке операций с фьючерсными контрактами с фиксированной датой – модуль «Учет сделок с поставочными фьючерсами с фиксированной датой контрактов, заключаемых на валютной секции МБ».

Одной из ключевых особенностей сделок является **возможность полного или частичного прекращение встречных однородных обязательств** до наступления даты исполнения. Указанные обязательства прекращаются в ходе утренней клиринговой сессии, проводимой в расчетный день, следующий за днем заключения контрактов, после начисления вариационной маржи.

Продукт предназначен для обеспечения автоматизации бизнес-процессов бэк-офисного сопровождения собственных сделок с поставочными фьючерсами с фиксированной датой контрактов, заключаемых на Валютном рынке Московской Биржи по валютным парам USD/RUB, EUR/RUB и CNY/RUB.

Решение позволяет автоматизировать следующие бизнес-процессы:

- регистрация договора – основания для совершения сделок;
- автоматическая регистрация сделок;
- импорт биржевых комиссий;
- осуществление расчетов по итогам клиринга;
- учет биржевых комиссий;
- автоматическая и ручная регистрация справедливой стоимости;
- учет справедливой стоимости, промежуточных платежей и прекращения признания ПФИ;
- учет сделок на области «Г»;
- корректировка учета на области «Г» на величину вариационной маржи;
- корректировка учета на области «Г» на прекращаемую величину требований/обязательств;
- завершение сделки.

Контакты для связи:
Департамент продаж:
тел: +7 495 780-75-75
e-mail: sales@diasoft.ru