



Treasury Derivaten

Met Treasury Derivaten beschikt u over een compacte en laagdrempelige applicatie om uw derivaten te administreren en te waarderen. De module werkt nauw samen met de module Treasury Leningen. In de Leningenmodule kunnen derivaten en leningen worden gebundeld tot financieringsstructuren. Op een eenvoudige en heldere manier wordt in beeld gebracht wat de effecten van derivaten zijn op uw financieringsportefeuille.

De basis van module wordt gevormd door 6 instrumenten: interest rate swap, cap, floor, collar, FRA en swaption. Nadat u een aantal contractkenmerken heeft vastgelegd, berekent het systeem automatisch de verwachte kasstromen en waarde van het derivaat op basis van het gekozen scenario. Door flexibele invoeropties en de mogelijkheid om derivaten en leningen te bundelen, kunt u naast de 6 basisinstrumenten ook vele afgeleide financieringsvarianten vastleggen. De module Derivaten sluit nauw aan bij uw basisadministratie. Het systeem kan journaalposten aanmaken die kunt importeren in uw basisadministratie. Betalingen en ontvangsten worden tot op de dag nauwkeurig berekend. Wanneer gewenst kunt u de betalingen direct

klaarzetten voor uw electronic bankingsysteem. Daarnaast verwerkt u de toekomstige kasstromen automatisch in de module Treasury Kasstromen.

Net als bij de module Treasury Leningen is het mogelijk om via autorisatie en accordering een functiescheiding aan te brengen in front en backoffice. Natuurlijk worden alle mutaties binnen een derivaat vastgelegd in een audit trail. U heeft dus snel inzichtelijk wie op welke tijdstip een wijziging heeft doorgevoerd. Naast de grafische mogelijkheden binnen de module kunt u rapporten exporteren naar spreadsheet en tekstverwerker. Op die manier maakt u zelf eenvoudig bedrijfsspecifieke rapportages.

Door frequent overleg te voeren met klanten, gebruikersgroepen en treasuryadviseurs volgt Aareon de regelgeving en trends voor de publieke sector op de voet. Hierdoor bent u ervan verzekerd dat de software uw treasuryproces optimaal blijft ondersteunen.

Belangrijke functies

Administreren en consolideren

U kunt de portefeuille van meerdere bedrijven vastleggen en deze cijfers, wanneer nodig, consolideren.

Flexibiliteit in invoer

Door de flexibiliteit van het systeem is het mogelijk om varianten op de standaard aanwezige derivaten (swap, cap, floor, FRA, collar, swaption) vast te leggen,

Accordering en autorisatie

Door de functieaccoring te gebruiken kunt u functiescheiding waarborgen tussen de front en de backoffice.

Journalisering

De functie journalisering stelt u in staat om de basisadministratie eenvoudig bij te werken.

Audittrack en logging

Door logging en audittrack kunt u precies laten zien wie wat wanneer in welk derivaat heeft gewijzigd.

Aanmaken betalingsbestanden (Clieop03)

De betalingsverplichtingen kunnen middels clieop03- bestanden direct naar uw electronic bankingpakket worden gestuurd.

Voorbeelden van standaardrapportages

Betaalstaat

De betaalstaat laat u tot op de dag nauwkeurig zien wat u aan wie moet betalen. Hierbij wordt rekening gehouden met bank holidays en de voorwaarden uit het derivatencontract.

Renterisicoportefeuille

De renterisicoportefeuille laat zien wanneer er rente aanpassingen en herfinancieringen zijn en welk deel van deze risico's met derivaten is afgedekt.

Meerjarenoverzicht derivaten

Met dit overzicht kunt u de ontwikkeling van uw derivatenportefeuille over een door u zelf in te

stellen periode inzichtelijk maken op basis van een door u te definiëren scenario.

Waarde derivaten per tegenpartij

Met dit overzicht ziet u direct wat de waarde van uw derivaten per tegenpartij is.

Hedgingoverzicht en structuren

Het hedgingoverzicht laat zien welke derivaten aan welke leningen zijn gekoppeld en wat de gevolgen zijn van de hedge. Samengestelde producten (bijvoorbeeld capped lening of extendible lening) kunnen in Treasury als een structuur worden vastgelegd.

Stamgegevens naar spreadsheet

Met dit overzicht kunt u alle gegevens van uw leningenportefeuille, inclusief berekende waardes, naar een spreadsheet exporteren. Hierdoor beschikt u over een krachtige dataset voor eigen rapportages.

Voordelen

Integratie met Treasury Leningen

De module Derivaten voorziet in een aantal specifieke rapportages en sluit verder naadloos aan bij de module Leningen. Door de derivaten selectief wel en niet mee te nemen in de rapportages wordt de invloed van de derivaten op de leningen eenvoudig zichtbaar.

Automatische signaleringsfunctie

Op basis van de vastgelegde contracten worden automatische signaleringen aangemaakt. Hierdoor wordt u tijdig gewaarschuwd voor komende renteconversies en breaking clauses.

Journalisering naar basisadministratie

Door de flexibele uitvoer van journaalposten kan Treasury Derivaten dienst doen als subadministratie van uw basisadministratie.

Integratie met Treasury Kasstromen en Vastgoed Meerjarenbegroting

De kasstromen uit derivaten worden automatisch opgenomen in de kasstroom prognose en de meerjarenbegroting.

Hedging en structuren

Financieringsstructuren en hedgeposities kunnen worden vastgelegd en hierover kan worden gerapporteerd.