



## Adéquation des fonds propres

### Principales Fonctionnalités :

- Détermination de la position nette par devise de cotation, type d'actif et type d'émetteur (éligibilité),
- Traitement des Obligations Convertibles
  - \* Simulation de Conversion,
- Risque sur les produits de taux
  - \* Risque général, (Duration - Echancier),
  - \* Risque spécifique,
- Risques sur les titres de propriété
  - \* Risque général,
  - \* Risque spécifique,
- Traitement spécifique des OPCVM,
- Risque de Règlement / Livraison,
- Risque de Change,
- Grands Risques par client et émetteur,
- Instruments dérivés (Monep - Matif),
- Calcul de l'exigence en Fonds Propres,
- Etats réglementaires 4009, 4002, 4003, 4006, SB, QLB...,
- Télétransmission auprès de la Commission Bancaire.

**WinCAD™** est un module autonome de la gamme de Gestion des Risques WinRisk du Groupe SCENARIO.

Application Client/Serveur fonctionnant sous environnement Windows (98/2000 et NT).

**WinCAD™** et **WinCAD™ Light\*** répondent de manière opérationnelle aux directives 95-02 / 97-03 / 97-04 de la Commission Bancaire.

**WinCAD™** s'intègre au back-office duquel il reçoit:

- les valeurs et les cours
- les positions titres et espèces
- les non dénoués
- les émetteurs
- les valeurs compensables

Nature	Titres de Créances	Titres de Propriété	Coeff	Titre Créances Detenu	Titre Propriété Detenu	TOTAL DETENU EN KE
Mac 00	0	0	8,00	0	0	0
Mac 10	0	0	0,00	0	0	0
Mac 20	0	0	2,00	0	0	0
Mac 21	0	0	0,25	0	0	0
Mac 22	0	0	1,00	0	0	0
Mac 23	0	0	1,50	0	0	0
Mac 30	0	599 113	4,00	0	21 525	21 525
Mac 31	4 396	0	8,00	352	0	352
Mac 40	0	1 108	2,00	0	22	22
Mac 41	0	0	4,00	0	0	0
Risques Spécifiques ->				352	21 547	21 899

Exigence en fonds propres par nature d'émetteur

### Quelques références de WINCAD™

- Gilbert Dupont (Crédit du Nord)
- HSBC CCF Securities
- Raymond James International

### Caractéristiques des Progiciels SCENARIO :

- Modules métiers s'appuyant sur une base technique unique
- Gestion des Habilitations par profils/fonctions/données
- Multilingues, Multidevises,
- Piste d'audit fonctionnelle et applicative
- Import / Export MS Office (Excel...)
- Archivage des documents reçus et émis (mails, fax, reportings...)

Conception et réalisation certifiées ISO 9001:2000

Au générique de nos références :

