



Поддержка основных типов операций казначейства в ПО Fc-TMS, май 2021

В таблице представлены возможности поддержки основных типов операций банковского казначейства в двух версиях ПО Fc-TMS — лайт-версии и полнофункциональной.

Лайт-версия системы не требует подключения к основной АБС банка и поэтому может использоваться в любой кредитной организации без дополнительных доработок.

Дополнительно в таблице представлены данные по демо-версии системы, предназначенной для ознакомления с интерфейсом ПО Fc-TMS. Эта версия не включает модулей и настроек, обеспечивающих связь с внешними источниками данных. Соответственно, в ней отсутствуют основные возможности коммерческих версий, что в некоторой степени компенсируется наличием тестовых данных (сокращение «т/д» в таблице), которые доступны для просмотра. Демо-версию системы Fc-TMS можно скачать с сайта fincode.ru.

| Тип операции | Демо-версия | Лайт-версия | Полная версия |
|--|-----------------|-------------|---------------|
| Операции на денежном рынке | | | |
| Ручная регистрация сделки МБК в любой валюте | да | да | да |
| Формирование распоряжений в по учету | да | да | да |
| Формирование подтверждений для контрагента формата SWIFT/TELEX | да ¹ | да | да |
| Открытие счетов в АБС по шаблону | да ² | нет | да |
| Начисление % в АБС | т/д | нет | да |
| Формирование платежных поручений в АБС (перечисление основного долга и %) | да ² | нет | да |
| Досрочное/частичное погашение МБК (распоряжения и учет в АБС) | нет | нет | да |
| Пролонгация сделки | да | да | да |
| Перенос в АБС основного долга по сроку | да ² | нет | да |
| Отражение сделки в платежной позиции | да | да | да |
| Контроль лимита на контрагента | да | нет | да |
| Контроль максимального размера риска на одного заёмщика (Н6) | да | нет | да |
| Операции на валютном рынке | | | |
| Ручная регистрация валютной сделки | да | да | да |
| Автоматический импорт сделок из торгового терминала WEB2L и/или MICEX, включая сделки СВОП | т/д | да | да |
| Формирование распоряжений по учету | да | да | да |
| Формирование платежных поручений в АБС (перечисление средств) | да ² | нет | да |
| Формирование подтверждений по сделке формата SWIFT/TELEX | да ¹ | да | да |
| Открытие счетов в АБС по шаблону (для срочных сделок) | да ² | нет | да |
| Неттинг валютных сделок | да | да | да |
| Формирование распоряжений по учету неттинга | да | да | да |
| Формирование платежных поручений в АБС (перечисление средств) по неттингу | да ² | нет | да |
| Формирование подтверждений по неттингу формата SWIFT/TELEX | да ¹ | да | да |
| Учет в АБС форексных сделок с НКЦ | т/д | нет | да |
| Учет в АБС форексных сделок с банками-контрагентами | нет | нет | да |
| Учет в АБС сделок СВОП (Т+3) | т/д | нет | да |
| Операции на рынке ценных бумаг | | | |
| Автоматический импорт параметров ценных бумаг из справочника НРД | т/д | нет | да |
| Ручная регистрация сделок на ОРЦБ/внебиржевом рынке | да | нет | да |
| Автоматический импорт сделок из торгового терминала WEB2L и/или MICEX, включая сделки РЕПО | т/д | нет | да |

1 Тестовые сообщения могут быть сформированы, но без связи с внешними системами не могут быть отправлены

2 Поскольку отсутствует связь с АБС, открытие счетов и создание документов осуществляется в режиме эмуляции

| | | | |
|---|-----------------|-----------------|----|
| Автоматический импорт сделок с корзиной РЕПО из БД АРМ Луч-НРД | т/д | нет | да |
| Автоматический импорт портфеля акций и облигаций из БД DeronNet бэк-офис | т/д | нет | да |
| Открытие счетов в АБС по шаблону (для облигации; сделок РЕПО, сделок «Т+2» и «Т+3») | да ² | нет | да |
| Операции с векселями | | | |
| Ручная регистрация сделок с собственными векселями | да | нет | да |
| Ручная регистрация сделок с учтенными векселями | да | нет | да |
| Сделки на рынке деривативов | | | |
| Ручная регистрация сделок с фьючерсами и опционами | да | нет | да |
| Автоматический импорт сделок из торгового терминала QUIK | т/д | нет | да |
| Открытие счетов в АБС по шаблону | да ² | нет | да |
| Автоматический импорт котировок фьючерсов из справочника ММВБ | т/д | да | да |
| Операции с наличной валютой | | | |
| Загрузка курсов валютно-обменных операций в АБС | нет | нет | да |
| Оповещение касс о смене курсов обмена валют | нет | нет | да |
| Онлайн контроль валютно-обменных операций | т/д | нет | да |
| Ручная регистрация банкнотных сделок | да | да | да |
| Формирование подтверждений по банкнотным сделкам формата SWIFT/TELEX | да ¹ | да | да |
| Валютные операции с клиентами | | | |
| Ручная регистрация сделок, включая валютные форварды | да | да | да |
| Автоматическая регистрация конверсионных сделок, совершенных в системе ДБО «БСС-Частный клиент» | т/д | нет | да |
| Открытие счетов в АБС по шаблону (для форвардных сделок) | да ² | нет | да |
| Учет в АБС форвардных сделок (открытие, перенос по сроку, закрытие, неттинг) | т/д | нет | да |
| Сделки с клиентами по неснижаемому остатку | | | |
| Ручная регистрация сделок | да | нет | да |
| Автоматическая регистрация сделок по заключенным соглашениям | т/д | нет | да |
| Формирование распоряжений по учету % | да | нет | да |
| Формирование подтверждений по сделке в системе ДБО iBank2 (при наличии технической возможности) | да | нет | да |
| Контроль платежной позиции | | | |
| Онлайн расчет/прогноз платежной позиции в рублях | т/д | да ³ | да |
| Онлайн расчет/прогноз платежной позиции в любой валюте | т/д | да | да |
| Автоматическое обновление платежного календаря | т/д | нет | да |
| Контроль открытой валютной позиции | | | |
| Онлайн прогноз ОВП, с учетом форексных и валютообменных сделок | т/д | да ⁴ | да |
| Точный расчет ОВП по всем видам операций, проведенных по балансу в АБС | т/д | нет | да |
| Контроль лимитов на контрагентов | | | |
| Ручное заведение лимитов на контрагентов | да | нет | да |
| Формирование протоколов по установленным лимитам | да | нет | да |
| Автоматический пересчет фактически выбранных лимитов | т/д | нет | да |
| Контроль влияния операций казначейства на основные показатели деятельности банка | | | |
| Автоматический расчет капитала банка | т/д | нет | да |
| Автоматический расчет коэффициента рублевого фондирования | т/д | нет | да |
| Автоматический расчет всех обязательных нормативов ЦБ | т/д | нет | да |
| Автоматический расчет процентной маржи | т/д | нет | да |
| Расчет доходности по валютным операциям и операций с ценными бумагами | т/д | да ⁵ | да |
| Обработка сообщений SWIFT (ISO 15022) | | | |

3 Только для корсчетов контрагентов, для которых подключен обмен документами через сеть SWIFT

4 Только с учетом форексных сделок

5 Только расчет доходности по операциям с безналичной валютой

| | | | |
|--|-----|-----|----|
| Импорт сообщений SWIFT из текстовых файлов в формате RJE | да | да | да |
| Ручное заведение основных типов сообщений SWIFT (по финансовым расчетам, общей группы, запросов/ответов) | да | да | да |
| Автоматическое отслеживание статусов исходящих сообщений SWIFT | т/д | да | да |
| Автоматический прием входящих сообщений SWIFT | т/д | да | да |
| Автоматический контроль подлинности сообщений SWIFT методом LAU | нет | нет | да |