



Omgeo CrossCheckSM

Eliminación del costo y riesgo de la conciliación manual de carteras de derivados

- ALERT
- Benchmarks
- Central Trade Manager
- Connect
- CrossCheck
- MarketMatch
- OASYS Global
- ProtoColl
- Transaction Report

Una solución alojada centralmente para la administración de excepciones que permite una comparación automatizada de carteras de derivados entre contrapartes y con otras fuentes, incluyendo DTCC Trade Warehouse

La conciliación de carteras de derivados es un problema generalizado en la industria que se ha convertido en tema prioritario para las administradoras de inversiones, brokers y reguladores debido a los mayores costos y riesgos asociados a las posiciones no conciliadas. Usted ahora tiene la oportunidad de reducir estos costos, automatizando sus procesos de conciliación y colaborando con sus contrapartes y otras organizaciones en el seno de una de las comunidades más seguras y confiables del mundo financiero: Omgeo.

Omgeo recientemente adquirió de Global Electronic Market (GEM) una solución de conciliación de carteras de reconocido prestigio en la industria. El sistema, llamado Omgeo CrossCheck, se basa en el estándar FpML y le ofrece un modelo de alta calidad y de efectividad comprobada en el mercado, especialmente diseñado para instrumentos derivados. Se trata de un servicio alojado centralmente que automatiza la comparación de carteras de derivados entre administradoras de inversiones, brokers/operadores y terceras partes. La comparación de los datos económicos (fecha de negociación, valor teórico, tasas de interés, etc.), la información sobre los pagos y la valuación de posiciones y carteras se basan en criterios de casación personalizados

CrossCheck le permite minimizar los riesgos y las consecuencias de las carteras no conciliadas en lo que respecta la anticipación de pagos, requerimientos de colateral, acontecimientos crediticios y otras situaciones. Las empresas se encuentran ahora en mejores condiciones para lograr economías de escala en sus empresas, al tiempo que administran con eficacia los riesgos durante períodos de tensión en el mercado, lo que permite altos niveles de transparencia y eficiencia.

El historial probado de Omgeo

Todos los hechos durante el ciclo de vida de las operaciones, se trate de renta variable, renta fija o derivados, se ajustan a un mismo patrón: los clientes desean procesos más rápidos, mayores niveles de automatización, una administración eficaz del riesgo y una mejor productividad y capacidad. En Omgeo siempre nos esforzamos por aprovechar al máximo nuestros conocimientos y así ayudar a que los clientes alcancen sus objetivos. Pensamos seguir haciéndolo en el futuro a medida que nuestras actividades se desplazan hacia el universo de los derivados, del mismo modo que lo hemos venido haciendo en el entorno de renta variable y renta fija. Con una comunidad consolidada de 6.000 clientes en 46 países que trabajan de manera integrada en un entorno de colaboración, Omgeo unifica operaciones a lo largo y ancho de la industria de inversiones y cuenta con un probado historial de creación de comunidades y soluciones innovadoras para facilitar la administración y comunicación de datos a las contrapartes dentro de un entorno seguro.

Una conciliación en tres sentidos con DTCC Trade Information Warehouse

En el universo de derivados de crédito, Omgeo le brinda un nivel de eficiencia y transparencia incomparable. Omgeo ha celebrado un acuerdo con DTCC Trade Information Warehouse mediante el cual los clientes de Omgeo que también son clientes del servicio Deriv/SERV de DTCC pueden recibir un flujo automático de datos pertinentes de operaciones de derivados crediticios desde Warehouse hasta CrossCheck. Gracias a este flujo de datos, los clientes pueden comparar los registros de sus carteras con los datos en Warehouse, y así asegurarse de que coincidan con la llamada “copia dorada” de los datos de las operaciones correspondientes a las posiciones con todas las contrapartes que



usan Deriv/SERV. CrossCheck es la única solución comercial disponible en el mercado que respalda un modelo de conciliación multilateral en el que un cliente puede conciliar operaciones simultáneamente con contrapartes, Trade Information Warehouse y proveedores de servicio como sociedades depositarias y prome brokers.

Aumente su capacidad: permita que Omgeo realice la casación

Una vez que se haya instrumentado la automatización total del proceso de casación, su atención puede centrarse exclusivamente en la administración de las excepciones que se presentan en el servicio. Como resultado, se reducen considerablemente los costos operativos y aumentan la capacidad y la productividad.

Mejor administración del riesgo

CrossCheck le permite aprovechar las siguientes ventajas a la hora de minimizar los costosos riesgos operativos y de mercado asociados con las carteras no conciliadas:

- **Administración proactiva de fallas**
La capacidad de seguimiento centralizado para la administración de fallas/excepciones brinda a todas las partes la posibilidad de realizar un seguimiento proactivo a la hora de identificar, asignar y resolver excepciones para una posición concreta, en vez de simplemente reaccionar cuando surgen problemas
- **Control sobre los datos**
Ofrece un motor de comparación flexible y sofisticado, que le permite adecuar criterios para atender a los datos y situaciones de riesgo de contrapartes específicas
- **Capacidades de seguimiento para auditorías**
En un entorno de regulaciones mundiales cada vez más estrictas, usted tiene la capacidad de producir con rapidez y efectividad registros en caso de discrepancias graves o de una auditoría

Automatización eficiente

Con su personal de operaciones actual podrá incrementar de manera notable su capacidad para realizar conciliaciones más frecuentes y precisas en todas las carteras.

Este nivel de transparencia, sumado al acceso a los datos en Warehouse y la automatización desde CrossCheck, garantiza que todas las partes puedan entender con mayor precisión y eficiencia sus exposiciones al riesgo.

- **Recopilación automatizada de datos sobre posiciones**

CrossCheck recoge los datos de las contrapartes, eliminando así un elemento que actualmente consume una tercera parte o más del esfuerzo realizado por muchas administradoras de inversiones

- **Eliminación del esfuerzo de transformación de datos**

CrossCheck se encarga de establecer la transformación de datos, proporcionando a cada usuario la capacidad de trabajar con el servicio central para garantizar la adecuada configuración de la transformación de sus datos

- **Comunicación automatizada multilateral**

Le permite enviar a las contrapartes la información sobre fallas relacionada con datos de operaciones de ambas partes, eliminando la necesidad de intercambios de correo electrónico tediosos e ineficaces

- **Interfaz de usuario intuitiva**

Los equipos de operaciones y otros usuarios verifican que la interfaz es fácil de aprender y navegar

Servicio al cliente

Una vez instalado CrossCheck, usted podrá dar información sobre posiciones conciliadas a clientes y terceras partes, con la tranquilidad de saber que ha actuado en el mejor interés de su contraparte y que está al tanto de cualquier discrepancia que exista.

- **Visión central de la totalidad de la cartera**

Trabaje con una perspectiva central de toda la cartera en lugar de hacerlo con varios sistemas diversos (sistemas separados para CDS, IRS, Renta variable, etc.) a fin de reducir el tiempo y el esfuerzo de resolución

- **Transparencia para sus clientes**

La conciliación proactiva le da la oportunidad de ofrecer a sus clientes

información transparente sobre sus posiciones

- **Resolución eficaz de conflictos**
Obtenga acceso al historial de auditorías para solucionar conflictos y discrepancias de forma oportuna, aliviando así a sus recursos internos

Principales características técnicas

- **Capacidades avanzadas de mapeo de datos**
Capacidad de agregar múltiples tramos de una posición para hacerla coincidir con la de la contraparte
- **Opciones múltiples para el envío de datos**
Envíe datos mediante transferencia de archivos segura o importación de archivos a través de la interfaz
- **Desglose de resultados en estadios concretos**
Consulte con rapidez los resultados de acuerdo con las categorías Casados, No casados, Aceptados, Cursados

- **Interfaz de usuario de filtros por preferencias**

Los resultados se pueden filtrar de acuerdo con varios criterios, incluyendo: Fuente (broker/operador, custodio, Trade Warehouse, etc.), tipo de producto, divisa, contraparte, fechas

Respaldo de productos derivados

Swaps de incumplimiento crediticio (*Credit Default Swaps o CDS*) y opciones, swaps de tasas de interés y opciones sobre swaps (swaptions), contratos de techos y pisos de tasas de interés, swaps y opciones de renta variable, swaps de renta fija, opciones sobre bonos OTC, swaps de inflación, swaps CCY, operaciones de divisas al contado y a plazo, swaps y opciones de divisas, swaps y opciones de energía, swaps de commodities e instrumentos exóticos/híbridos.

Una interfaz intuitiva con base en la web permite que los usuarios dominen rápidamente y utilicen el servicio

Match Summary Ted Sanborn 4 | OMG IM 1

Summary Rollup Summary Net Positions All Positions My Positions Matched Partial Broken Unmatched Alleged Rolled Up Accepted

Selection ... [hide]

Inputs
 Base Source: OMGEO IM 1 | Other Source: Omgeo BK1 | Counterparty: Omgeo BK1
 Data Set: All OTC | Branch: -(Any)- | Fund: -(Any)-
 As-Of: 2010-01-22

Product Characteristics
 Product: -(Any)- | Currency: -(Any)- | Asset Class: -(Any)-
 Underlying: -(Any)- | Und ID:

Other Filters
 Show: Match Summary | Select Multiple: | Search:

Sorting/Grouping
 Group By: Fund

Fund	Base Net	Match	Partial Match	Unmatched	Accepted	Alleged	Accepted Alleged	Other Net	Action
K11-Managed Bond Fund	507	492	13	1	1	0	0	506	▲
K12-Emerging Markets Fund	475	458	16	1	0	0	0	474	▲
K19-USD LIBOR Fund B	699	680	18	1	0	3	1	702	▲
K21-USD LIBOR Fund A	233	219	13	1	0	0	0	232	▲
K33-Total Return Fund	785	751	30	0	4	0	0	785	▲
K4-Pension Fund of XYZ Corp	210	208	2	0	0	0	0	210	▲
Totals	2909	2808	92	4	5	3	1	2909	

Records 1 to 6

Filtros de selección flexibles y poderosos er permiten clasificar y agrupar los datos para detectar problemas sistémicos

La automatización del proceso de casación le permite comenzar el día analizando los resultados de la casación y rápidamente indagar para comenzar a resolver fallas

América

Omgeo LLC
22 Thomson Place
Boston, MA 02210
tel +1 866 49 OMGEO
askomgeoamerica@omgeo.com

Europa

Omgeo Ltd
Aldgate House
33 Aldgate High Street
Londres EC3N 1DL
tel +44 20 7369 7777
askomgeoeuropa@omgeo.com

Asia

Omgeo Pte Ltd
18 Science Park Drive
Singapore 118229
tel + +65 6411 6888
askomgeoasia@omgeo.com

Japón

Omgeo K.K.
Palaceside Building
1-1-1, Hitotsubashi, Chiyoda-ku
Tokio 100-0003
tel + 813 5218 6621
askomgeojapan@omgeo.com

Sobre Omgeo

Omgeo ofrece certeza en las operaciones post-transacción mediante la automatización y confirmación oportuna de los datos económicos de las operaciones ejecutadas entre administradoras de inversiones y brokers/operadores. Omgeo hace posible que, diariamente, una eficiente comunidad de más de 6.000 clientes de servicios financieros en 46 países administre la casación y el manejo de excepciones de asignaciones de operaciones, confirmaciones e instrucciones de liquidación. Las principales organizaciones confían en Omgeo para ayudarles a administrar una industria de inversiones de creciente complejidad, al ofrecerles estabilidad operativa y soluciones que complementan el enfoque en la rentabilidad en una época caracterizada por volúmenes de negociación cada vez mayor. Para todos los países, clases de activo y ciclos de vida de operaciones, Omgeo representa el parámetro mundial de eficiencia operativa a lo largo y ancho de la industria de inversiones. Omgeo se creó en 2001 y es propiedad conjunta del DTCC y Thomson Reuters.

Para más información sobre las soluciones de Omgeo, le pedimos que se ponga en contacto con Tom Trepanier al + 1 617 856 1152 (thomas.trepanier@omgeo.com) o visitar www.omgeo.com.



www.omgeo.com