Ludus Tuli

S_GAVAL

SISTEMA de GESTIÓN y
ADMINISTRACIÓN de VALORES

Copyright LudusTuli

ALCANCE

- **S_GAVAL** es un *sistema informático* que implemeta la gestión y control de las inversiones financieras y derivados de las Corporaciones de Seguros y Financieras teniendo como principales objetivos:
  - Gestión de Inversiones Financieras
  - Información y Control de Inversiones
  - Asignación de activos-pasivos
  - Cumplimiento de requisitos legales

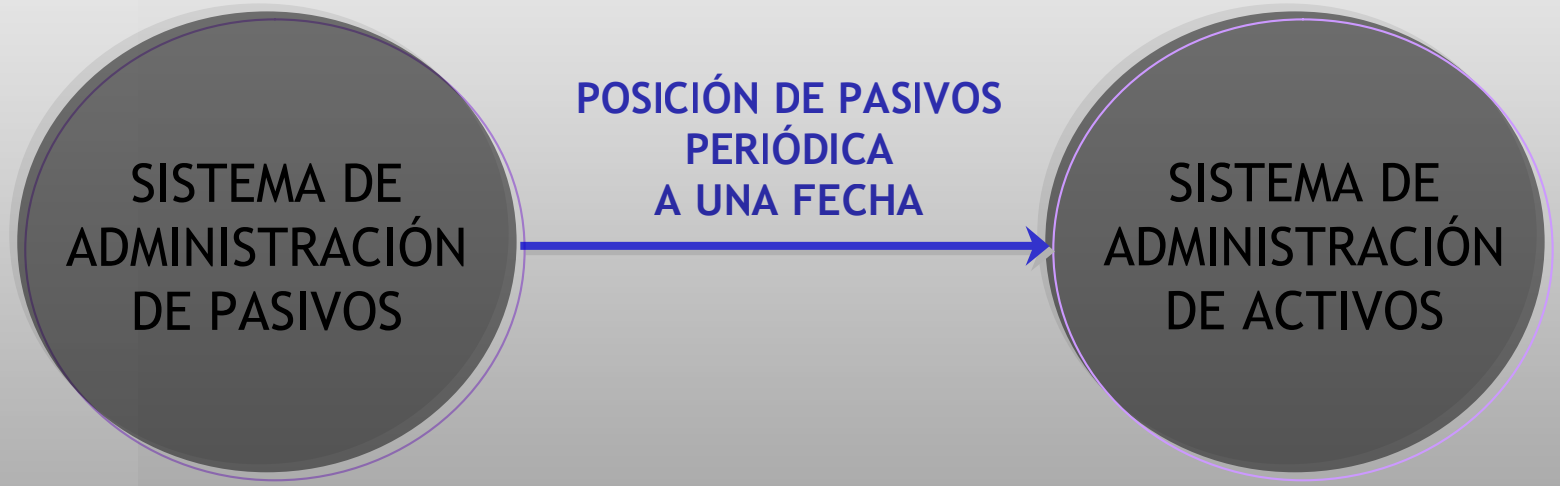
Copyright LudusTuli

ESTRUCTURA INTERNA

- Utilización de fichas de productos, que registran el histórico de las operaciones
- Asignación de Código Interno a las Inversiones
- Clasificación de las Inversiones: Indexadas, estructuradas, swapeadas,.....
- Clasificación por tipo de Cartera: Ordinaria, especulativa, a vencimiento,.....
- Clasificación de tipos de inversión por productos de pasivo
- Control y seguimiento del ciclo de vida de cada activo
- Solución Multicompañía
- Reporte Nacional e Internacional

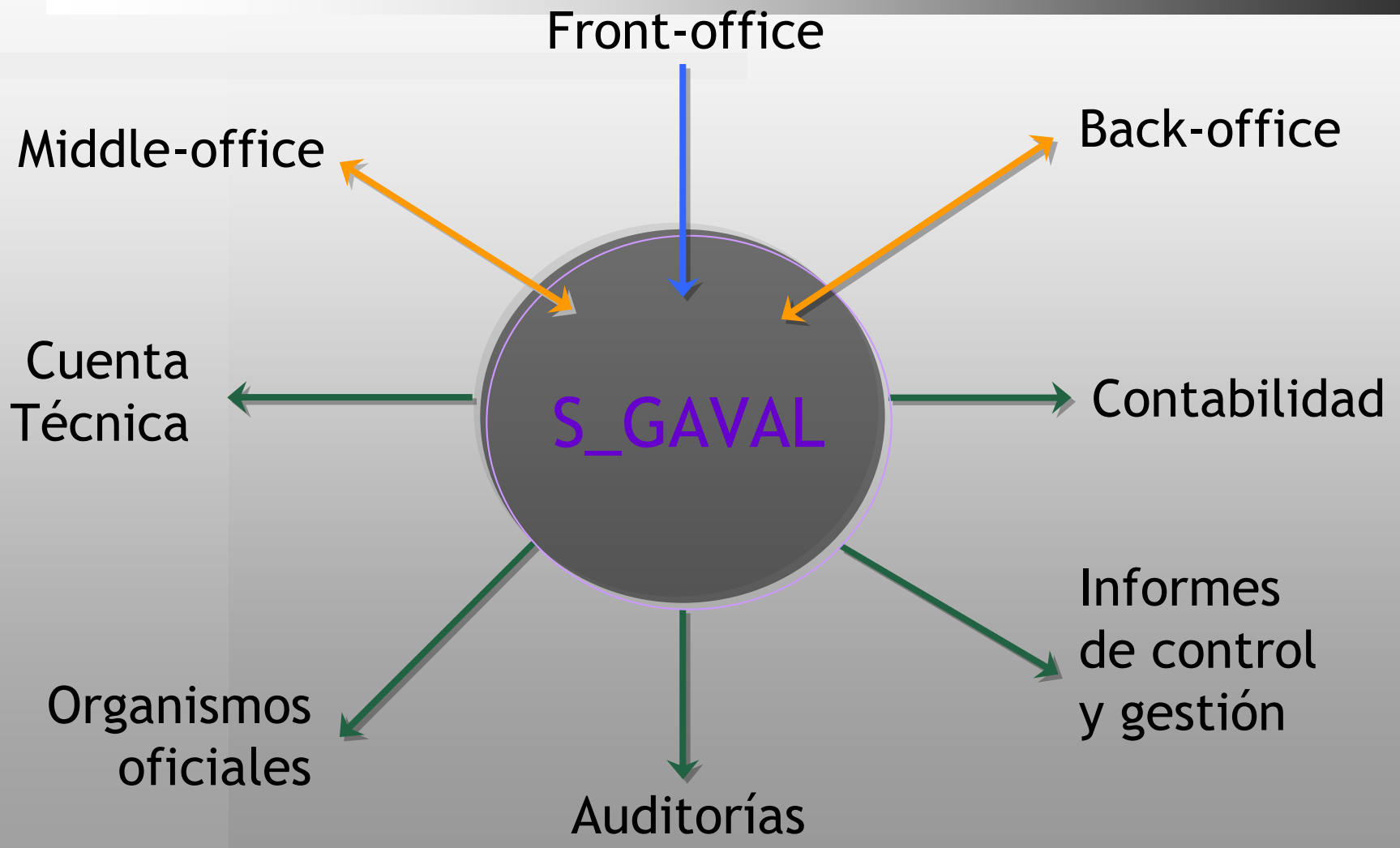
Copyright LudusTuli

ESTRUCTURA de SITUACIÓN PERIFÉRICA



Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

GESTOR de CONTROL INTERNO



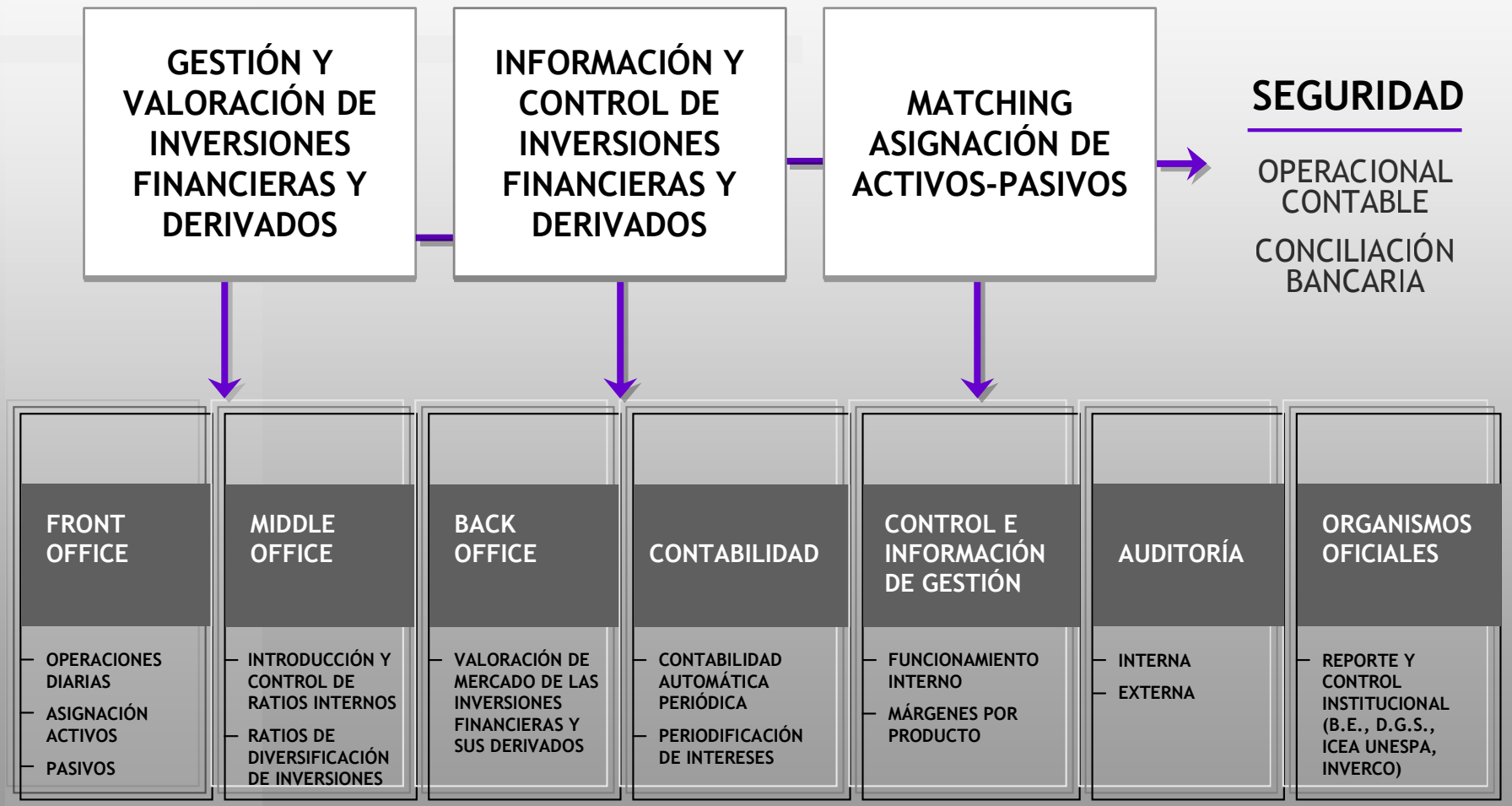
Copyright LudusTuli

USUARIOS y/o DESTINATARIOS

- **Front Office.** Operaciones diarias/Asignación de activos-pasivos
- **Middle Office.** Introducción y control de Ratings internos y ratios de diversificación de inversiones
- **Back Office.** Realización y valoración de mercado de las inversiones financieras y sus derivados
- **Contabilidad.** Contabilidad automática periódica de todas las operaciones y periodificación de intereses
- **Control e información de Gestión del funcionamiento interno del producto.**
- **Cuenta técnica.** Rentabilidad por producto
- **Auditorías Interna y Externa.**
- **Organismos Oficiales.** Bco España, DGS, ICEA, UNESPA, INVERCO…

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

S_GAVAL



Copyright LudusTuli

DINÁMICA de SERVICIO

- Independencia funcional de los usuarios/destinatarios del sistema
- Garantía de cumplimiento de controles internos
- Secuencia de servicio “On Line” de todas las operaciones

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

MODELO de TRABAJO y CONTROL

- Se ha desarrollado para cumplir con Solvencia II en entorno de Seguros y Basilea II en el bancario.
- Seguridad y consistencia basada en controles cruzados y conciliaciones:
  - Operacional, Contable, Bancaria …
- Genera la información necesaria para realizar los controles citados con la periodicidad elegida:
  - Informes, ficheros, boletas …

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

ACTIVOS FINANCIEROS y DERIVADOS

- Renta fija, Fondos de Inversión, Depósitos, Repos, Simultáneas, Futuros, Opciones, Swaps, Asset swaps, calls, puts.
- Maneja diferentes tipos de Carteras de Inversiones y Derivados en función de clasificaciones y tipos de valoración
- Productos estructurados y garantizados
- De todas las inversiones y derivados calcula:
  - Plusvalías o Minusvalías, Límites, periodificaciones de EVR o DVR, periodificación de intereses, cupón corrido de compra, intereses de títulos comprados antes de la emisión, valoración por coste medio, cupón implícito (TIR) y explícito, carteras a vencimiento y ordinaria, fiscalidad de operaciones
- Reporte bajo criterios nacionales e internacionales

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

ASIGNACIÓN ACTIVOS-PASIVOS

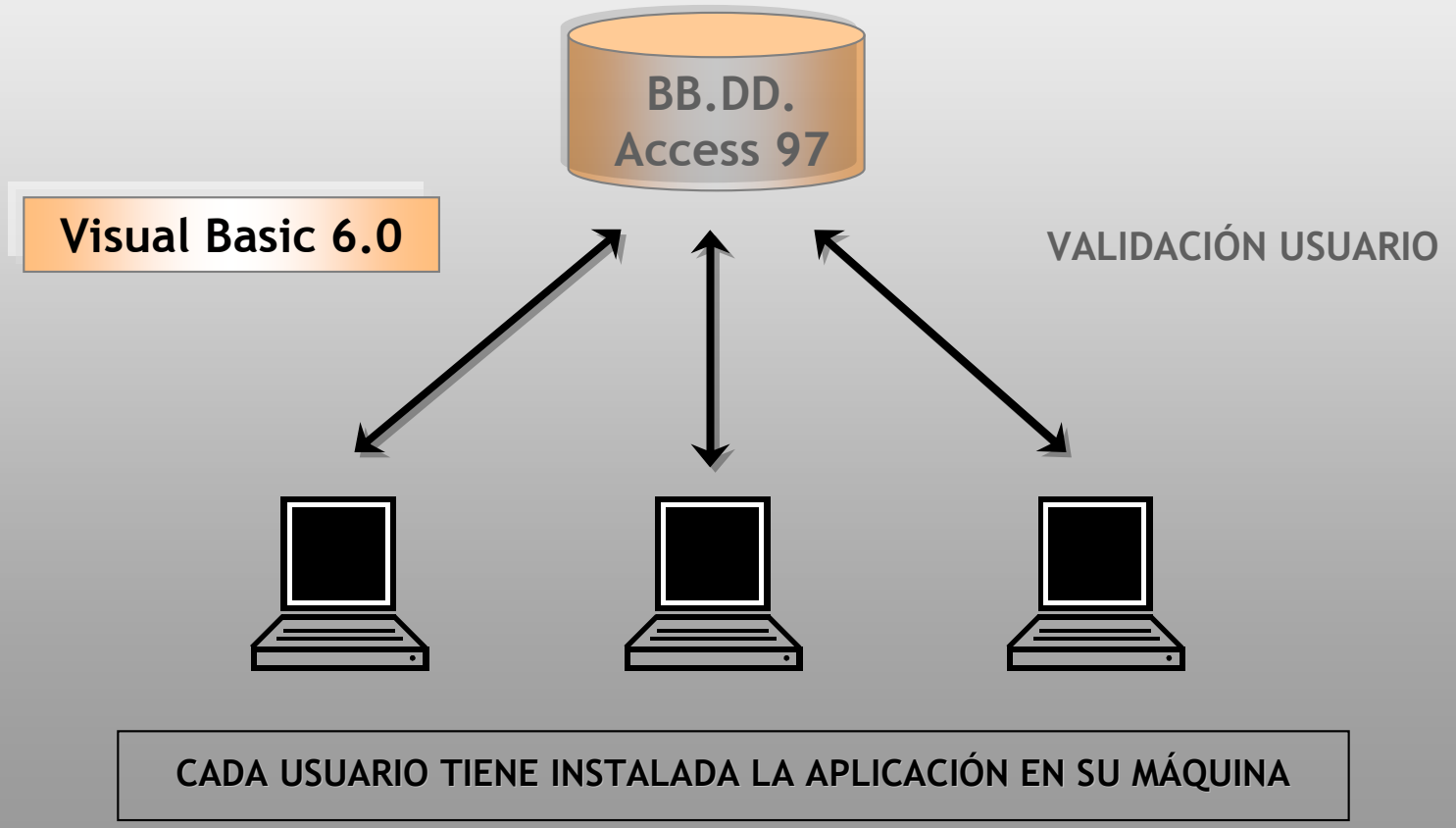
- Permite la asignación de las inversiones financieras y sus derivados a los productos de pasivo (Reservas Matemáticas), para valorar su rentabilidad

- Proporciona la Información financiera para el cálculo del Margen Técnico-Financiero por productos (Cuenta Técnica), mediante un informe de ingresos y gastos financieros de los subyacentes y derivados por productos

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

ARQUITECTURA TECNOLÓGICA ACTUAL

REPOSITORIO CENTRAL



Copyright LudusTuli

ARQUITECTURA TECNOLÓGICA FUTURA

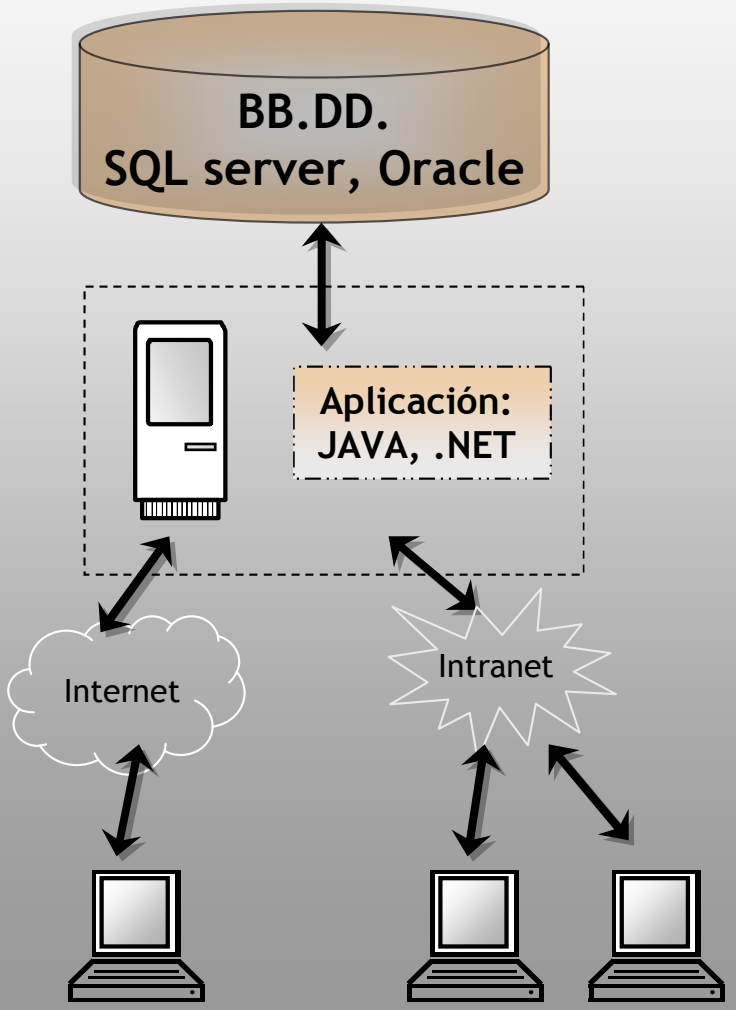
Servidor Web:
IIS, Apache…

LA APLICACIÓN RESIDE EN EL SERVIDOR AL QUE SE CONECTAN LOS USUARIOS

VALIDACIÓN USUARIO

LOS USUARIOS SE CONECTAN DE FORMA REMOTA EN LA INTRANET O INCLUSO A TRAVÉS INTERNET

Internet Explorer



Copyright LudusTuli

SEGURIDAD

- Restricciones de Acceso
- Máscaras de usuarios
- Administrador del Sistema
- Pistas de Auditoría

Copyright LudusTuli
Copyright LudusTuli

S_GAVAL

Copyright LudusTuli