



Suite Middle Office

Il sistema più semplice e veloce
per la contabilizzazione degli
ordini/eseguiti

L'obiettivo del progetto ALG Middle Office è quello di potersi frapporre in modo efficace tra i due ambienti fondamentali di un'organizzazione finanziaria: il Front Office ed il Back Office.

Notoriamente le due aree aziendali sopra citate hanno da sempre esigenze, modalità operative e soprattutto linguaggi diversi che portano ad inutili quanto dispendiose perdite di tempo nella normale amministrazione operativa di una giornata borsistica.

In dettaglio, gli operatori finanziari del Front Office dovrebbero avere come unico obiettivo la negoziazione degli ordini nel minor tempo possibile ed ai migliori prezzi di mercato, senza essere distratti da problematiche di tipo amministrativo / contabile che, seppur fondamentali, costituiscono per un operatore una gravosa perdita di tempo.

Non da meno, le risorse contabili di una società finanziaria devono giornalmente combattere con la "Quadratura" giornaliera delle operazioni, spesso ostacolata da qualche imprecisione degli operatori finanziari che a volte non specificano correttamente alcune informazioni fondamentali circa gli ordini trattati (Es.: il codice cliente o il prezzo di chiusura o la modalità di esecuzione o addirittura la quantità ordinata e/o eseguita).

Se, a tutto questo, si aggiunge un sistema informativo che per la sua origine e natura predilige un settore rispetto ad un altro, il caos e la difficoltà ad operare sono garantite.

Un applicativo di Middle Office ha quindi come obiettivo, da un lato, l'interfacciamento con i mercati per la raccolta, l'interpretazione e l'accorpamento degli ordini con i rispettivi eseguiti nonché la funzione di informativa agli operatori di quanto sta succedendo e, dall'altro, la predisposizione di tutte le informazioni, compresi gli eseguiti cliente, necessari alla parte Back Office per procedere alle sole operazioni di caricamento dei dati, già quadrati, sugli archivi contabili ufficiali della Società per le esecuzioni delle successive procedure amministrative.

In questo modo, entrambi i settori traggono un vantaggio immediato derivato dalla correttezza dei dati trasmessi e, di conseguenza, dalla mancanza di ulteriori, onerose quanto superflue fasi di controllo, verifica e correzione.

Progetto ALG Middle Office è composto da più moduli che interagiscono tra di loro.

I moduli interessati al Progetto sono i seguenti:

- Clori
- Balio
- Xanthe
- Zefiro

Clori

E' il modulo che si connette direttamente al mercato configurato. Il suo compito è quello di ricevere tutta l'operatività relativa al mercato interconnesso.

Balio

Il suo compito è quello di leggere la messaggistica ricevuta da Clori e normalizzarla nel database.

Xanthe

Si occupa di leggere i dati memorizzati da Balio e di applicare le regole impostate.

Zefiro

E' l'applicazione vera e propria di Middle Office. Legge i dati "regolarizzati" da Xanthe e fornisce il client operativo per l'utente finale.

Unitamente a questi moduli, il Progetto ALG Middle Office comprende anche due moduli di utilità: ALG Scheduler e ALG Monitor. Il primo dà la possibilità di schedulare le applicazioni in base alle proprie esigenze; il secondo modulo dà la possibilità di monitorizzare l'andamento delle procedure e di intervenire da remoto.

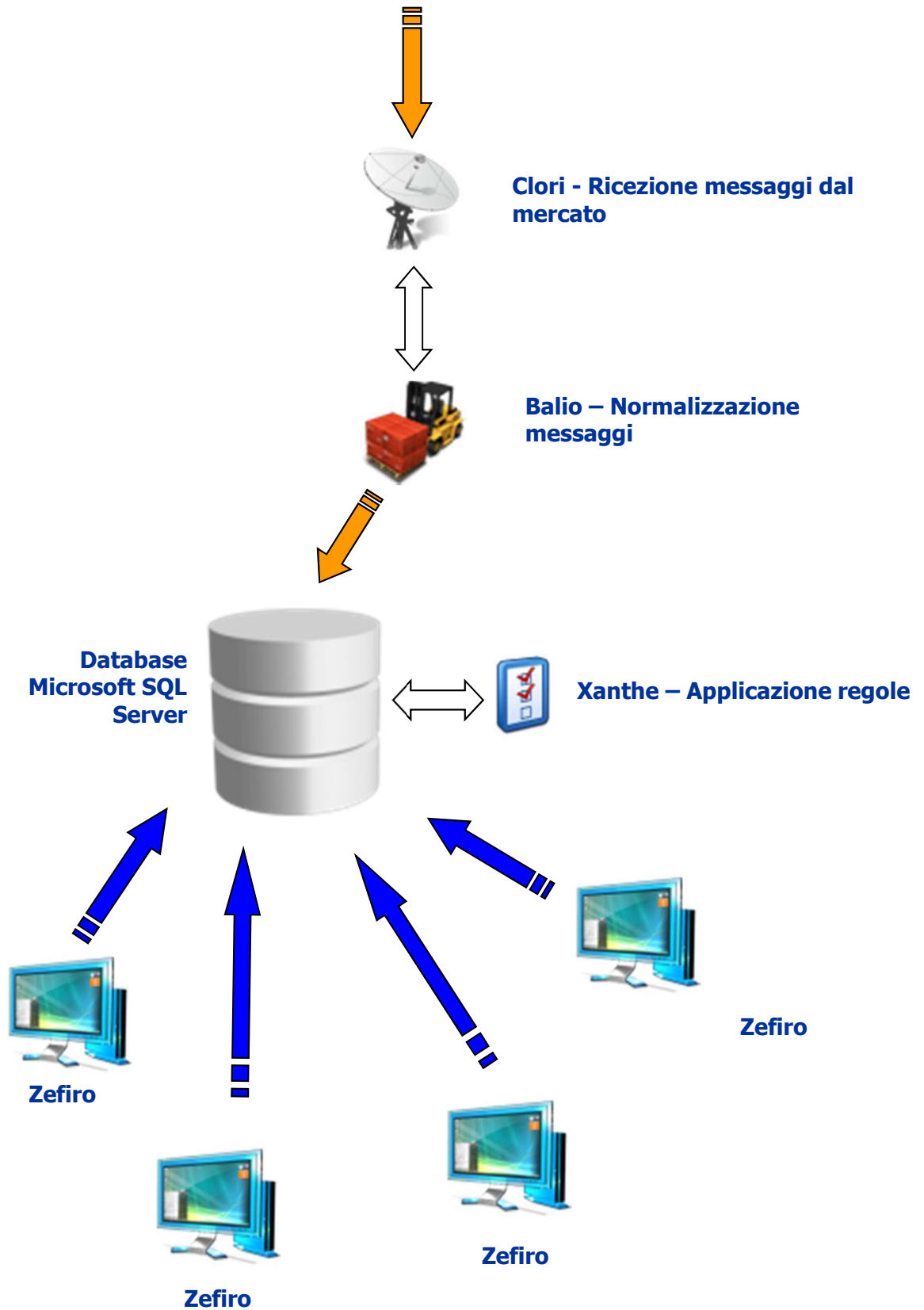
...Zefiro, personificazione del vento dell'ovest o del Nord-ovest, vento leggero, simile alla brezza, messaggero della Primavera.

I suoi regni sono "i luoghi dove si alza la stella della sera, dove il sole estingue i suoi ultimi fuochi (Ovidio, Metamorfosi)"

Si unì all'arpia Celeno dalla quale ebbe Xanthe e Balio, i cavalli immortali di Achille.

Successivamente ebbe in Clori sua moglie...

Mercati di Negoziazione



Il Progetto ALG Middle Office è un'applicazione di middle office a 360 gradi: oltre ad essere completo nell'operatività giornaliera (gestione ordini singoli, curando, splitting; gestione anagrafiche clienti, titoli; gestione mercati Italia, Estero...), ha come punto di forza la possibilità di connettersi a qualsiasi piattaforma di interconnessione ai Mercati. Attualmente sono già configurate 4 tipologie di connessione attraverso le API (Application Programming Interface) proprietarie:

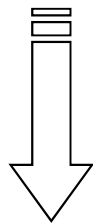
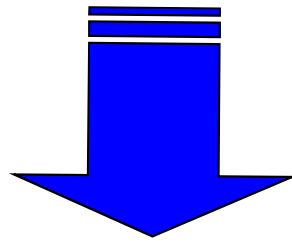
- API GL Trade (Sungard)
- API FastTrack (List)
- Protocollo FIX
- API Sphera

Ciò non toglie il fatto che, avendo le specifiche di interfacciamento, si possono sviluppare moduli ad-hoc anche per altre piattaforme.

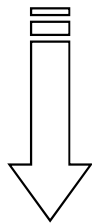
Altro punto di forza è la capacità di interfacciarsi con qualsiasi applicativo di Back Office: con la relativa documentazione è possibile creare procedure personalizzate.

E' gestito l'invio a Back Office del singolo ordine in real time nel momento in cui si chiude (automaticamente o manualmente), oppure attraverso un unico flusso a fine giornata.

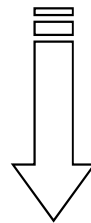
Trading Rooms
&
Middle Office Operators



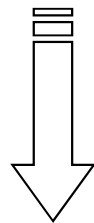
Stampe



Fax Clienti



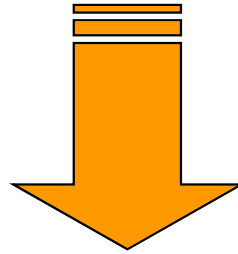
Mail



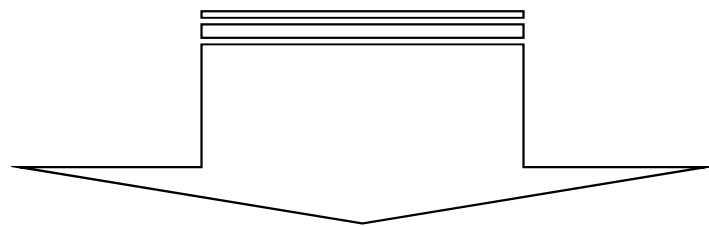
Scarichi vs
BackOffice

Funzione importante dell'ambiente che compone ALG Middle Office è il Registro Ordini: poiché vengono memorizzati e storicizzati su database tutti i messaggi che arrivano dal mercato, lo stesso database può essere consultato in qualsiasi momento per ricercare operazioni su clienti/titoli.

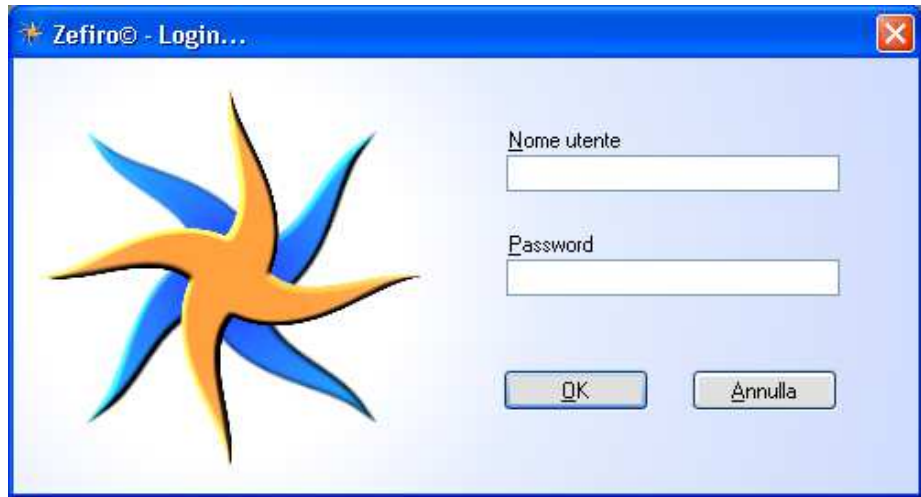
Mercati di Negoziazione



Zefiro



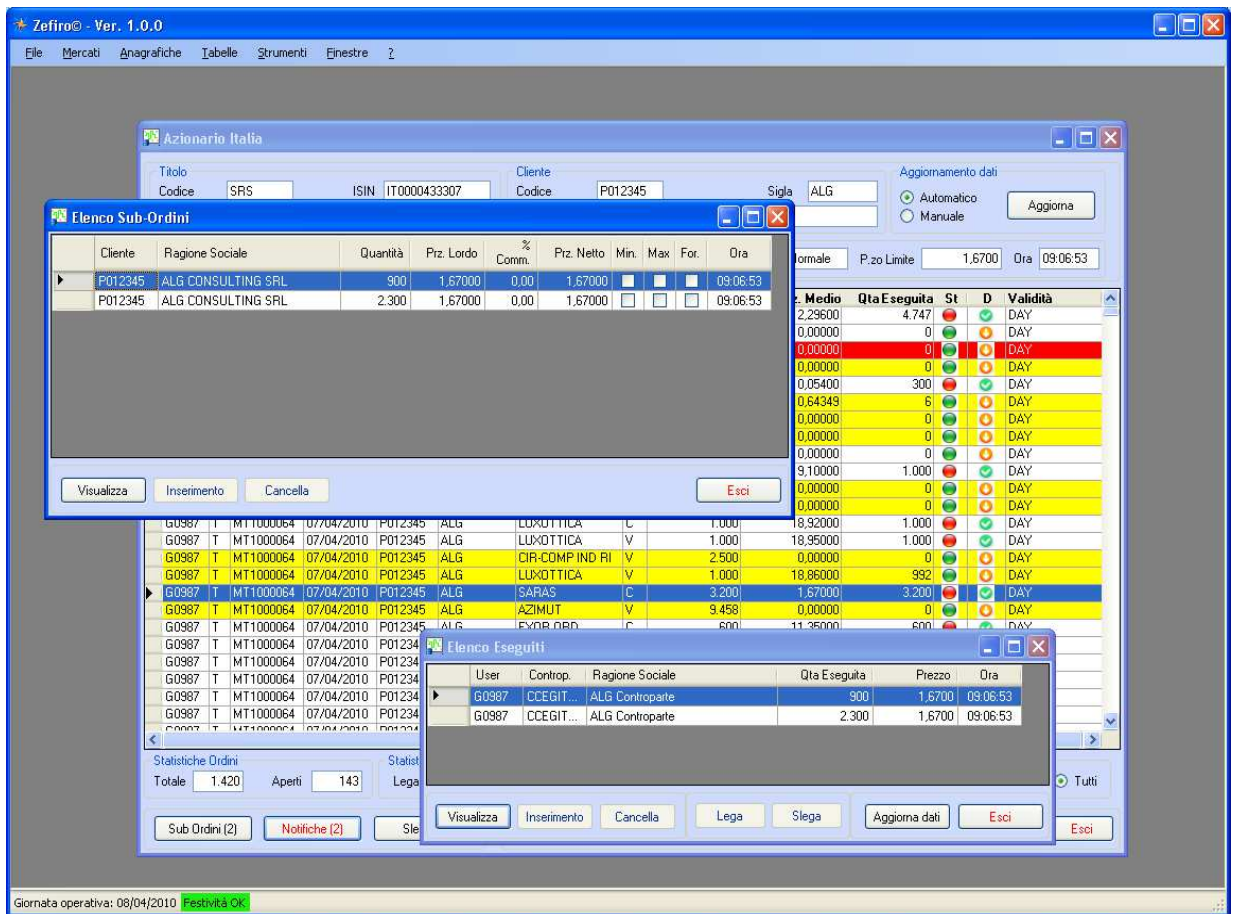
Registro Ordini



Login applicazione

Giornata operativa: 08/04/2010 Festività OK

Maschera principale Elenco Ordini



Maschera principale Elenco Ordini con Elenco Sub-Ordini ed Elenco Eseguiti del mercato per l'ordine selezionato

L'ambiente operativo del progetto ALG Middle Office consente di ridurre drasticamente gli oneri economici attraverso una semplice attività di gestione e controllo dei flussi provenienti dai vari mercati.

Caratteristiche Operative :

- × **Importazione dati da tutti i mercati di negoziazione Italia**
- × **Importazione dati da tutti i mercati di negoziazione Estero**
- × **Generazione Automatica e/o Manuale degli Ordini / Sub-Ordini**
- × **Gestione Sub-Ordini (Splitting) per gruppi di Clienti**
- × **Gestione Automatica e/o Manuale dell'incrocio Ordini / Eseguiti Mercato con calcolo in RealTime del Prezzo Medio e della Quantità Eseguita**
- × **Numero decimali personalizzabile su Quantità, Prezzi e Commissioni su ogni singolo cliente**
- × **Metodologia di calcolo prezzi (Arrotondamento o Troncamento) personalizzabile**
- × **Applicabilità della commissione minima generica e/o personalizzata per cliente/mercato**
- × **Gestione commissione Broker**
- × **Gestione spese piazza**
- × **Funzione controllata della Legatura / Slegatura degli Eseguiti Mercato per Ordine**
- × **Gestione delle Notifiche Fittizie di Mercato (c.to Errori, c.to Proprietà, Fuori Borsa)**
- × **Gestione tabelle anagrafiche con importazione automatica da Back Office**
- × **Invio mail di conferme in tempo reale ai clienti che ne richiedono**
- × **Generazione flussi di output verso Back Office**
- × **Diversificazione dei profili Utenti per differenti figure aziendali**
- × **Gestione esposizione mirata per Trader, per Stazione di Negoziazione, per Cliente**
- × **Gestione completa della ricerca Ordine, Sub-Ordine ed Eseguito Mercato operativa su tutte le informazioni o sulla loro combinazione**
- × **Reports statistici a richiesta**
- × **Gestione dettagliata del LOG operazioni con registrazione di tutti gli eventi**
- × **Registro Ordini**

ALG Middle Office

The image shows two overlapping software windows. The top window, titled 'Elenco Sub-Ordini', displays a table with columns: Cliente, Ragione Sociale, Quantità, Prz. Netto, % Comm., Prz. Lordo, Min., Max., For., and Ora. The bottom window, titled 'Dettaglio Sub-Ordine', shows a form for editing order details, including fields for Cliente, Ragione Sociale, Riferimento, and various price and commission fields, along with checkboxes for 'Forzatura dei valori', 'Commissione minima', and 'Commissione massima'.

Cliente	Ragione Sociale	Quantità	Prz. Netto	% Comm.	Prz. Lordo	Min.	Max.	For.	Ora
X003269	ALG CONSULTING SIM	3.700	0,5040	0,00	0,5040	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	11:53:13
X003268	ALG MIDDLE SIM	5.000	0,5040	0,00	0,5040	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	11:53:13
X003267	GIOVANNI ROSSI	2.700	0,5190	0,00	0,5190	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	11:53:13

La Gestione di tutte le informazioni necessarie alle varie aree aziendali (Front, Middle e Back Office) non è mai stata così semplice ed immediata.

The image shows two overlapping software windows. The top window, titled 'Elenco Eseguiti', displays a table with columns: User, Controp., Ragione Sociale, Qta Eseguita, Prezzo, and Ora. The bottom window, titled 'Dettaglio Notifica', shows a form for notification details, including fields for Controparte, Ragione Sociale, Ora Esecuzione, Quantità, Prezzo Operazione, and a 'Spese' section with fields for Broker, Piazza, % Spesa, and Spesa.

User	Controp.	Ragione Sociale	Qta Eseguita	Prezzo	Ora
G0250	CCEGITR0001	CONTROPARTE CASSA	3.700	0,5040	11:53:13
G0250	CCEGITR0001	CONTROPARTE CASSA	5.000	0,5040	11:53:13
			2.700	0,5190	11:53:13

ALG Middle Office

Dettaglio Ordine

Identificativo Ordine
Data: 02/03/2010 | Tipo Ordine: Normale | Ora: 09.00.20
Chiave: 091013084131028 | Riferimento: MT100006487586 | PDN: PDN1234567

Segno
 Compera
 Vendita

Titolo
ISIN: IT0001479374 | Giorni Valuta: 3 | Tipo: Day
Descrizione: LUXOTTICA | Tipo Titolo: Azionario
Cod. ABI: LUX | Convertibile:

Parametri Tempo
Data validità: | Ora validità: |

Cliente
Codice: P012345 | Rag. Sociale: ALG CONSULTING SRL | Sigla: ALG | Tipo: C

Dati Ordine
Divisa: Euro | Quantità: 1.000 | Data valuta: 07/04/2010
Rif. Cliente: ALG | Prezzo Limite: 19,2000 | Ordine Padre: |
Tipo Conto: Customer | Piazza: Milano (MIL)

Note
Note: |

Dati Eseguito
Quantità: 1.000 | Prezzo Medio: 19,10000 | Ora Ultima Notifica: 09.00.25

Periodo
 Trading
 After Hour

Esci | Salva

Dalla gestione degli Ordini alla chiusura della giornata...

Tutte queste operazioni non sono mai state progettate in modo così semplice e lineare...

Chiusure

Selezione periodo
Periodo: Trading

Selezione Mercato
Mercato: Azionario Italia

Fax
Creazione Fax | Invio Fax
 Provvisori

Scarichi
Scarico BackOffice

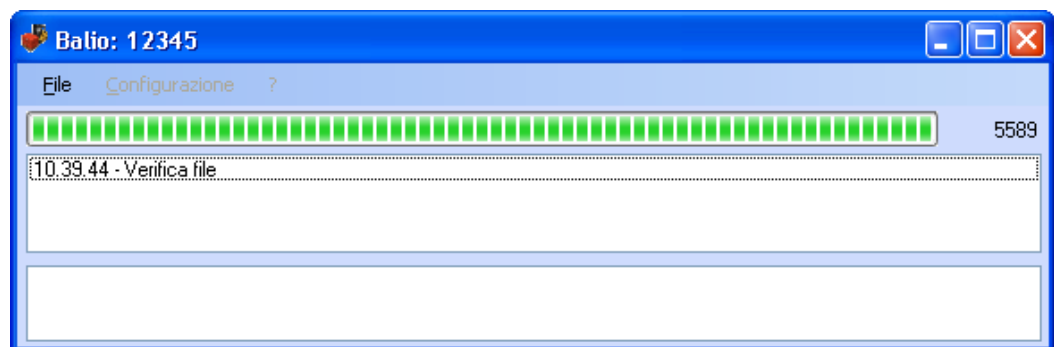
Esci

ALG Middle Office

Moduli che compongono il progetto ALG Middle Office:
dalla connessione al Mercato (Clori), alla normalizzazione dei messaggi (Balio), all'applicazione delle regole (Xanthe)



Clori



Balio



Xanthe

ALG Middle Office

Il progetto ALG Middle Office non è un pacchetto chiuso, ma è facilmente implementabile in base alle richieste dell'utente.

Avendo a disposizione tutte le informazioni riguardanti l'ordine e tutti i suoi eseguiti, si riescono a soddisfare tutte le esigenze che i clienti richiedono sulle proprie operazioni, sia eseguite che inesequite.

