

Kyriba Commodities Risk Management

KYRIBA FACT SHEET

La solution Commodities Risk Management de Kyriba permet aux organisations financières de suivre, d'évaluer et de comptabiliser des transactions de couverture sur matières premières, en complément des couvertures de change et des taux d'intérêt déjà disponibles par la plateforme.

Kyriba prend en charge le workflow complet avec la tenue de position, les évaluations de marché et la comptabilité de couverture.

Tenue de position

Kyriba vous permet de suivre vos positions en traitant les instruments de couverture sur matières premières au comptant, à terme ainsi que les swap. Il est aussi possible de diviser les swaps en strips à terme pour des désignations de couverture manuelles et automatiques.

La solution Kyriba propose également des échéanciers de swaps structurés, des méthodes de fixings asiatiques et des circuits d'approbation sur l'ensemble des instruments de couverture de matières premières.

Fonctionnalités axées sur la valeur Kyriba Commodity Risk



Les fonctionnalités de tenue de position de Kyriba intègrent une solution de Business Intelligence pour créer des vues sur les prévisions d'exposition et les couvertures associées.



La mise en place et l'approbation du fixing, en plus de l'approbation du dénouement cash avec la génération du paiement sont également intégrés.



Les courbes à terme sont fournies pour les valorisations, les évaluations « Mark-to-Market » et le reporting des positions.



Kyriba propose des fonctionnalités de désignations de couverture automatiques, avec la prise en charge des couvertures partielles.

Kyriba propose aussi l'intégration automatique de l'ensemble des données du marché depuis la solution ou à partir de sources de données externes.

Valorisations

Kyriba prend en charge les évaluations Mark-to-Market, calculées à partir des données de marché récupérées.

Données de marché

Kyriba prend en charge plusieurs taux du marché et courbes en partenariat avec Refinitiv. Les courbes des matières premières incluent des strips à terme et des points au comptant facultatifs. Les courbes des taux d'intérêt sont utilisées pour escompter des flux à terme.

Les fixings des matières premières, les taux au comptant et à terme sont également utilisés pour calculer le montant de règlement et les prévisions des montants de règlement à terme. Vous pouvez en option, souscrire à la redistribution de taux de contribution de Refinitiv.

Comptabilité de couverture

La solution Kyriba intègre aussi la comptabilité des dérivés et de couverture selon les normes IFRS9 et ASC 815, avec la comptabilisation automatique des écritures vers votre ERP.

La couverture des matières premières peut être évaluée et désignée au niveau global (ou en utilisant la nouvelle fonctionnalité de couverture partielle de Kyriba). Les utilisateurs peuvent procéder à des désignations manuelles mais le système peut aussi automatiquement faire correspondre les sous-jacents avec les livraisons au sein des strips des transactions de la couverture dérivée. Cela permet l'évaluation et la gestion des attributions de couverture à un niveau granulaire tout en autorisant le suivi des dérivés au niveau des strips par les utilisateurs du front office.



Business Intelligence, reports et tableaux de bord

Le reporting et les tableaux de bord visuels, flexibles et faciles à personnaliser, fournissent des informations complètes sur les expositions, ainsi que les activités et performances des couvertures sur matières premières mises en place.

Pour en savoir plus sur les matières premières, les évaluations et la couverture, consultez le site www.kyriba.fr et demandez une démonstration dès aujourd'hui.