

Blotter

**Документация, содержащая описание функциональных
характеристик программного обеспечения**

Аннотация

Этот документ содержит описание функциональных характеристик ПО **Blotter**.

Функциональные характеристики

Blotter – это система используемая для мониторинга состояния текущего инвестиционного портфеля при торговле различными финансовыми инструментами. На основании потоков рыночных данных, сделок и статической информации система в режиме реального времени рассчитывает финансовый результат (P&L) портфеля и различные метрики, такие как позиции, балансы и риски. Так же, по запросу система позволяет формировать отчеты с детальной информацией и расчетами на уровне сделок.

Набор функциональных характеристик ПО включает:

- загрузка, хранение различных торговых данных
 - сделки
 - котировки
 - кривые дисконтирования
 - поверхности волатильности
 - статическая (справочная) информация
- расчеты справедливой стоимости, рисков, финансового результата по различным валютным инструментам, таким как спот, форвард, своп, фьючерс
- агрегация расчетов до уровня всего портфеля
- отображение торговой информации и результатов расчетов в реальном времени с помощью клиентского приложения
- выгрузка детальной торговой информации и результатов расчетов по запросу в формате Excel-таблиц