

# **SAP S/4HANA** - Financial Products Subledger

# Agenda

- Introdução
- Visão geral da solução incluindo demonstração
- Conclusão

# FPSL – Financial Product Subledger



Harmonized User Experience

**SAP Analytics Cloud (SAC)**



Finance Processes and Capabilities

**SAP S/4HANA  
Finance (GL)**

**SAP S/4HANA for  
financial products  
subledger (FPSL)**

**Profitability &  
Performance  
Management (PaPM)**

**Regulatorios  
(Cadocs)**



Holistic view on integrated and trusted data

**Financial Services Data Platform (FSDP)**



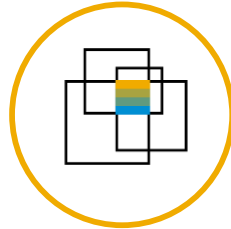
**Sistema Produtos e Core Bancário**

# Agenda

- Introdução
- Visão geral da solução incluindo demonstração
- Conclusão

# Solução S/4HANA FPSL (financial products subledger)

Pode ser integrado com qualquer sistema contábil.



Escopo para produtos bancários e contratos de seguro



Criação e parametrização de eventos contábeis



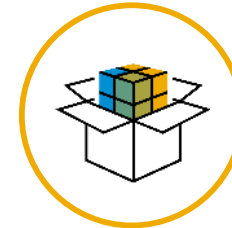
Motor de calculos de valor justo e valor contábil com diferente metodologias.



Dashboards usando SAP Fiori UI



Inclui modelos com a configuração de ponta a ponta para os padrões de IFRS 9, IFRS 17 e outros GAAPs



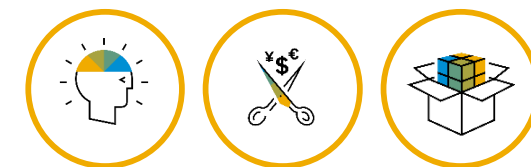
Pode ser implementado “on premise” ou “on Cloud”



Concebido para alta performance e grande volume de dados.



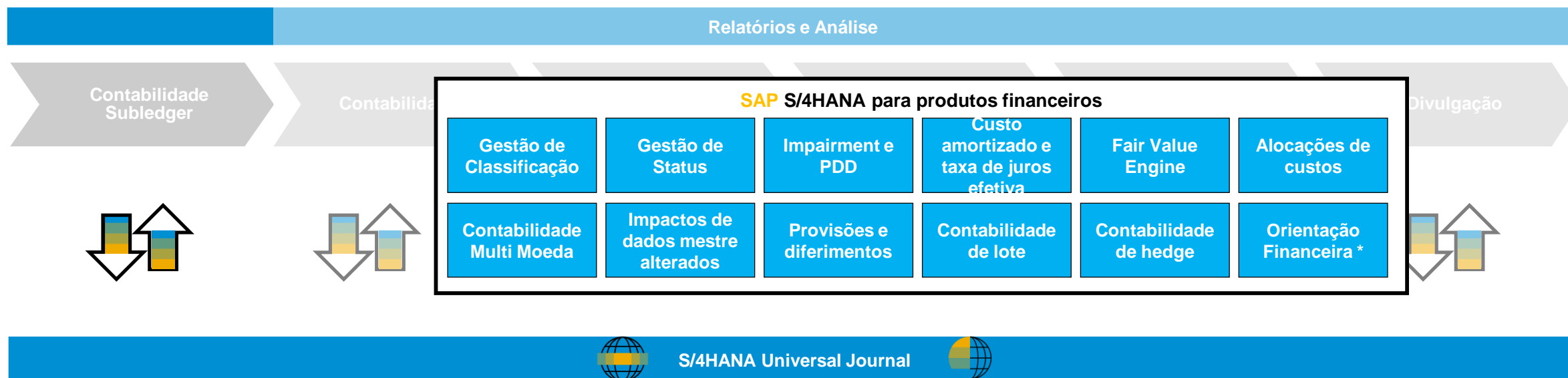
# SAP S/4 HANA FPSL subledger para produtos financeiros



## SAP FPSL

- é um subledger multi-GAAP e multi-entidade
- inclui um motor de regras de eventos contábeis centralizado e calculadoras especializadas
- vem com um modelo de dados escalonável com suporte do “Advanced HANA Data Volume Management”
- Objetivo: liberar os sistemas produto das tarefas de cálculo e provisão do risco.
- fornece integração nativa com a contabilidade do SAP S/4HANA, possibilidade de drill down

Entidades



# SAP FPSL - Produtos Bancários Cobertos (no momento)

Opções	Swap	Termos	Empréstimos
<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Stock Option</li> <li>■ Opção de títulos</li> <li>■ Opção com barreira</li> <li>■ Opção Digital</li> <li>■ Opção de Índice</li> <li>■ Opção de índice futuro</li> <li>■ Opção de moeda</li> <li>■ Opção de futuro do Títulos</li> <li>■ Cap</li> <li>■ Floor</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Swap simples</li> <li>■ Swap Taxa flutuante para flutuante)</li> <li>■ Swap de taxas de juros entre moedas</li> <li>■ Swap com Amortização</li> <li>■ Swaption</li> <li>■ Reverse Floating Swap</li> <li>■ Rollercoaster Swap</li> <li>■ Swap</li> <li>■ Step-Up Swap</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Forward Rate Agreement (FRAs)</li> <li>■ Forward Swap</li> <li>■ Forward Deposit</li> <li>■ Forward Loan</li> <li>■ Ação/Ttulo a termo</li> <li>■ Currency Forward (NDF)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Empréstimo juros fixos</li> <li>■ Empréstimo juros variáveis</li> <li>■ Empréstimos SAC</li> <li>■ Empréstimos (Tabela Price)</li> <li>■ Empréstimo c/ amortização irregular</li> </ul>
Contas	Renda Variável	Renda Fixa	Futuros
<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Conta corrente</li> <li>■ Poupança</li> <li>■ Conta Overnight</li> <li>■ Depósito a prazo (CDBs, LC)</li> <li>■ Depósitos com Aviso</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Ações</li> <li>■ Stock Warrant</li> <li>■ Index Warrant</li> <li>■ Currency Warrant</li> <li>■ Bond Warrant</li> <li>■ Direitos de Subscrição</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Título c/ taxa flutuante</li> <li>■ Título c/ taxa fixa</li> <li>■ Step-Up Bond</li> <li>■ Título multimoedas</li> <li>■ Zero Cupom Bond</li> <li>■ Warrant Bond</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Futuro de Indices</li> <li>■ Futuro de Taxa de juros</li> <li>■ Futuro da moeda</li> </ul>
Transações	Fundos de investimento	Produto de Garantia	Garantias Recebidas
<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Empréstimo de ações</li> <li>■ Repo / Reverse Repo</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Fundo de Ações</li> <li>■ Fundo Renda Fixa</li> <li>■ Fundo Imobiliário</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Garantia bancária</li> <li>■ Fiança</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ Hipoteca</li> <li>■ Penhor</li> <li>■ Alienação Fiduciária</li> </ul>





# SAP S/4HANA para subledger de produtos financeiros

Projetado para desempenho de ponta



## Processamento em tempo real

de transações operacionais de negócios



## Processos rápidos de final de período

para reduzir o tempo de fechamento



## Tratamento eficiente de vários GAAPs

por meio da abordagem GAAP central: as postagens independentes de GAAP são armazenadas apenas uma vez.



## Gerenciamento eficiente de alto volume de dados

por meio de Scale-Out: escalabilidade em nível de banco de dados para sub-livro baseado em contrato único melhora o TCO



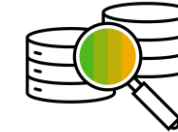
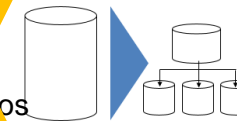
## Armazenamento otimizado de TCO de dados históricos

através do horário comercial - dependente  $2^{WL}$  particionamento de nível

**GAAP Central  
Abordagem**  
Eliminação de  
Redundâncias

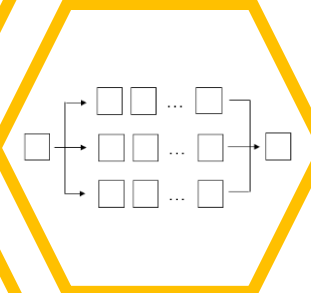


**Dimensionar**  
Escalabilidade  
no banco de dados  
Nível

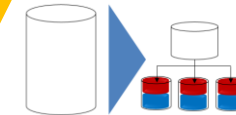


**HANA** Modelo  
de dados  
otimizado

**Processamen  
to em paralelo**  
na aplicação  
Nível do  
Servidor

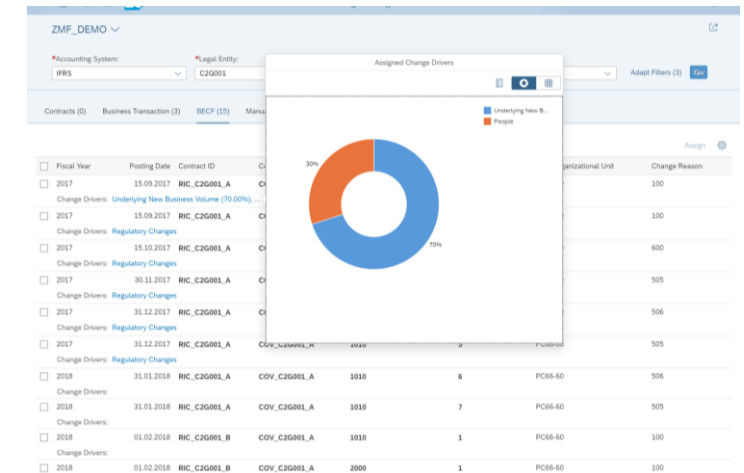
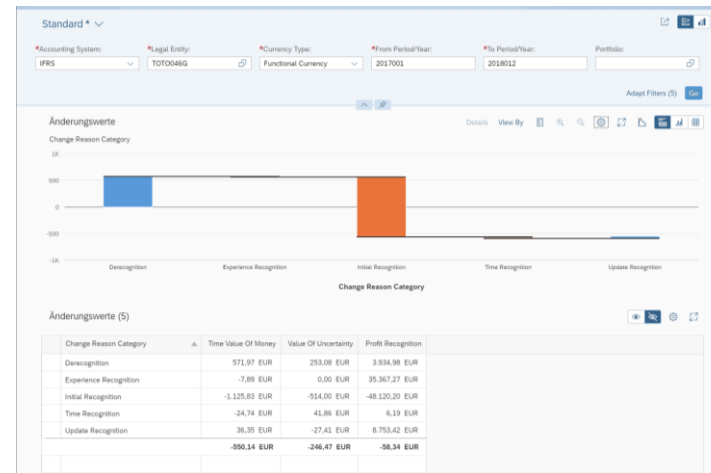


**Avançado  
Gerenciamento  
de volume de  
dados do banco  
de dados HANA  
recursos**



# SAP S/4HANA para subledger de produtos financeiros

## Experiência do usuário baseada em SAP Fiori



## Workplace de contadores e atuários

- Razão aberto por posição, Balancete, DRE e Notas Explicativas
- Monitoramento e Reprocessamento
- Ajustes manuais e atividades

## Cockpit Análise de variações

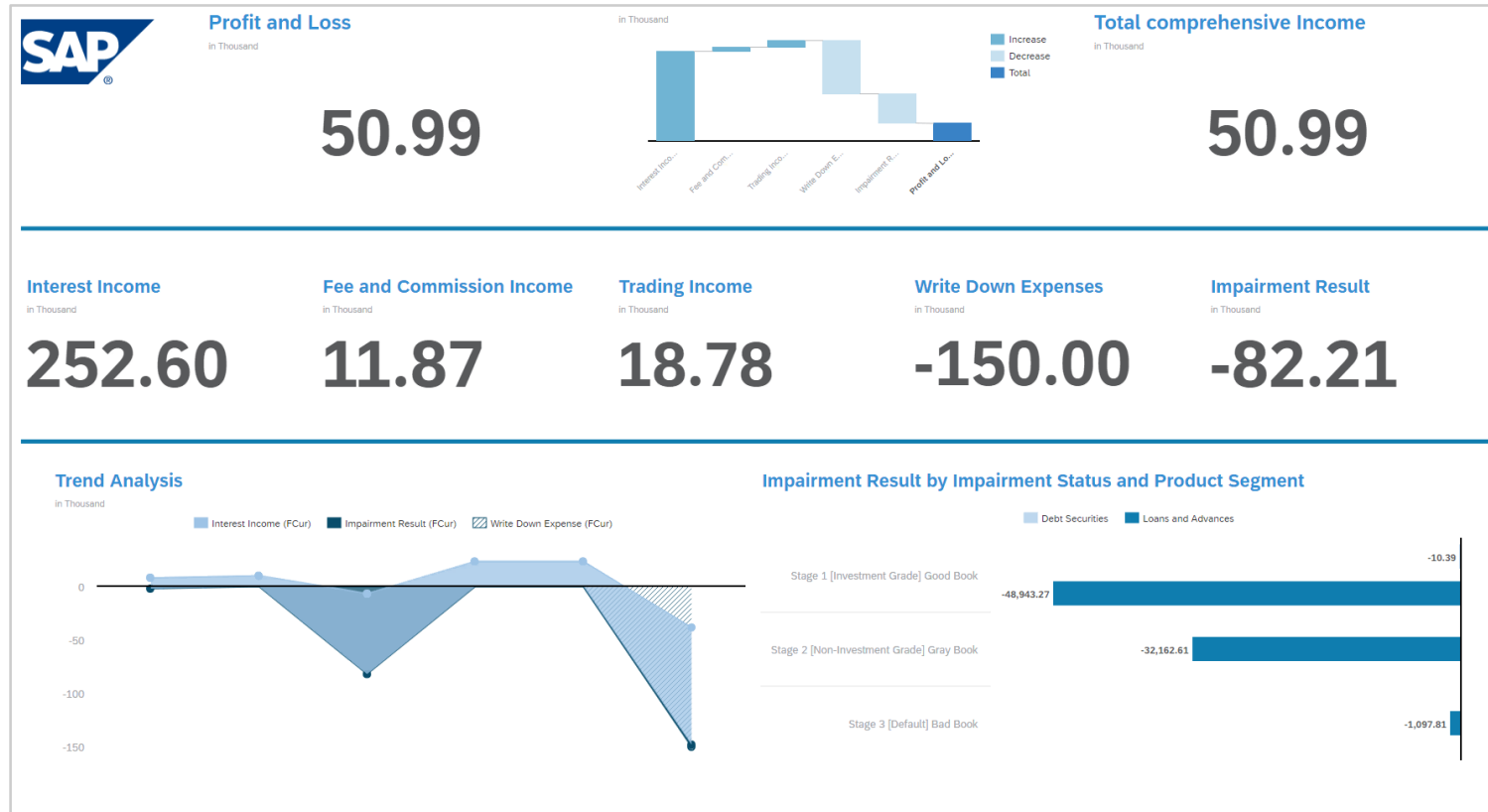
- Encontre e explique variações significativas nos saldos por posição
- Fatiar e dividir por n dimensões (posição, carteira, produto)
- Visualização, por exemplo, por gráfico em cascata

## Atribuir motivos de mudança

- Selecione o gatilho: contratos, transações comerciais, alterações de fluxo de caixa ou lançamentos manuais
- Atribua um ou vários motivos de mudança com pesos
- Exibir motivos de mudança atribuídos



# Painel de finanças - SAP Analytics Cloud e alimentado com dados de contabilidade do SAP S/4HANA para subledger de produtos financeiros



## SAP Analytics Cloud: One | Nuvem

- Solução de software como serviço de última geração construída a partir do spracima
- Descubra, visualize, preveja, aja e colabore - tudo em um só lugar
- Simplifica o processo de extração de relatórios
- Os dados auditáveis e granulares da Contabilidade, que podem ser consumidos em tempo real, sem extração
- Sem replicação de dados e, portanto, sem necessidade de reconciliação de dados, redução significativa do TCO
- Interface de usuário intuitiva e flexível para criar e compartilhar seus próprios relatórios analíticos

# Agenda

- Introdução
- Visão geral da solução
- Conclusão

# Referencias – Subledger de Productos Financieros (FPSL)



Postfinanz Luxemburgo



**Thank you.**