



Integriertes Asset Management mit Anlagegrenzprüfung

Das Standardsoftware-Produkt **Allocare AMS** unterstützt seit Jahren effiziente Prozesse im internationalen Umfeld des modernen Asset Management und ist bei Banken, Versicherungen, Asset Managern und Vermögensverwaltern erfolgreich im Einsatz. Als Asset Management-Softwareprodukt deckt **Allocare AMS** auch die Anforderungen der deutschen Fondsgesetze (InvG 2007/ DerivateV) vollumfänglich ab. Dadurch sind bei Depotbanken und bei Asset Management-Gesellschaften in Deutschland hochinteressante Einsatzkonzepte entstanden. Einerseits werden die gesetzlichen Anforderungen erfüllt und andererseits echte Mehrwerte geschaffen, wie z.B. Abbildung der vertraglichen Fondsregeln oder integriertes Performance- und Risikoreporting.

Das transaktionsbasierte Standardsoftware-Produkt **Allocare AMS** bietet in einer Datenhaltung ideale Voraussetzungen für ein integriertes Asset Management. Zu den Kernfunktionalitäten des Tools gehören:

- Flexible Portfolio Analyse
- Performance Messung (TWR, MWR, IRR) mit beliebiger Strukturierung
- Performance Attribution / Fixed Income Attribution
- Benchmark-, Modellportfolios
- Beliebige Portfolio-/Fonds-Konsolidierungen
- Abbildung aller Finanzinstrumente inklusive strukturierte Produkte
- Order Management
- Risiko-Kennzahlen
- Anlagerichtlinien-Editor zur Parametrierung von gesetzlichen und vertraglichen Grenzen
- Regelsets für verschiedene länderspezifische Gesetze (InvG, DerivateV, VAG, UCITS, BVV2)
- VaR mit Backtesting
- Stresstesting / Szenarioanalysen
- Automatisierbares Kundenreporting in verschiedenen Sprachen
- Standardschnittstellen zu Marktdatenanbietern, Kernbanken- und Fondsbuchhaltungssystemen
- Webbasierter Online-Zugriff (**Allocare AMS Web**)

Dieser Funktionsumfang erlaubt, einfach und schnell, echte Mehrwerte in unterschiedlichen Organisationen zu schaffen. Als Zusatzmodule werden im gleichen System Regelsets für verschiedene Fondsgesetze (z.B. InvG 2007 / DerivateV) angeboten. Damit lassen sich eine beliebige Anzahl von Fonds auditkonform prüfen.

Allocare AMS bei Asset Managern

Seit mehr als vier Jahren ist **Allocare AMS** bei einem grossen Asset Manager in Deutschland (Düsseldorf/Frankfurt) als Mastersystem im Einsatz. Alle fondsrelevanten Transaktionen werden dabei erfasst. Die Orderprozesse mit integrierter Anlagegrenzprüfung sind für alle Asset-Klassen für Advisory- und Outsourcing-Mandate effizient umgesetzt. Die Grenzprüfung wird

sowohl ex ante als auch ex post durchgeführt. Die für das InvG und die DerivateV (einfacher & qualifizierter Ansatz) notwendigen Wertpapier-, Emittenten- und Marktdaten werden automatisiert via Standardschnittstelle zu verschiedenen SIX Telekurs-Produkten in **Allocare AMS** geladen. Diese Datenversorgung beinhaltet auch Intraday-Preise, historische Preise, Ratings und Konzernstrukturen. Kapitalmassnahmen (Corporate Actions) werden ebenfalls eingelesen und in den verschiedenen Fonds automatisiert verarbeitet. Die Daten können, abhängig von Berechtigungen, jederzeit manuell angepasst oder ergänzt werden. Natürlich können in diesem Umfeld darüber hinaus Performance- und Risikoberechnungen für beliebige Zeiträume bis auf Einzeltitelebene vorgenommen werden.

Allocare AMS bei Depotbanken

Allocare AMS ist auch für Depotbanken eine echte und kostengünstige Alternative zu spezialisierten Produkten oder zu Fondsbuchhaltungssystemen, um korrekt dokumentierte Anlagegrenzprüfungen durchzuführen („**BaFin-Modell 2**“). Alle relevanten Transaktions- und/oder Positionsdaten werden aus verschiedenen Quellsystemen – eigene Kernbankenmodule oder unterschiedliche Fondsbuchhaltungssysteme – gesammelt und in die **Allocare AMS**-Datenbank periodisch eingelesen. Die Wertpapier- und Marktdatenversorgung erfolgt über die Standardschnittstelle zu den SIX Telekurs-Produkten. Dadurch stehen alle notwendigen Daten für die vorgeschriebenen Grenzprüfungen mit dem Standardregelset und auch für weitergehende „Portfolio und Risk Management“-Auswertungen jederzeit tagesaktuell zur Verfügung. Im zweiten Halbjahr 2009 sind bei zwei Depotbanken in Deutschland (Hannover/Düsseldorf) entsprechende Einführungsprojekte gelaufen.

Technologie

Allocare AMS basiert auf einer Client-Server-Architektur, welche aktuell unter der Datenbanksoftware **MS SQL Server 2005/2008** läuft und auf der Clientseite Windows XP, Vista und Windows 7 unterstützt.



Unternehmen

Allocare ist einer der **führenden Hersteller** von **Asset Management-Software** im **deutschsprachigen Raum**. Seit nun mehr zehn Jahren unterstützt das Standardprodukt **Allocare AMS** effiziente Prozesse im internationalen, arbeitsteiligen Umfeld des Portfolio und Fonds Management. Kaum ein anderes System am Markt bietet diese Integration von Portfolioanalyse und -bewertung, Order Management, Anlagerichtlinienprüfung, automatisiertes

(Kunden-)Reporting und Risiko Management (VaR mit Backtesting). Das **Schweizer Unternehmen** beschäftigt an seinem Hauptsitz in Altishofen (Luzern) und an seiner Niederlassung in Zürich zur Zeit 34 Mitarbeiter, mehr als die Hälfte davon in der Entwicklung. Die deutsche Niederlassung ist in Frankfurt a/M domiziliert. Allocare unterhält **Kooperationen** mit spezialisierten Beratungshäusern in der Schweiz und in Deutschland.

Produkte und Dienstleistungen

ALLOCARE AMS deckt die komplexen Anforderungen des **modernen Asset Management** vollständig ab – von der Abbildung der Anlageziele und -strategien über umfassende Order Management-Funktionalitäten (Einzel-/Sammelorders, Umschichtungen anhand von Modellen) mit **integrierter Prüfung der Anlagerichtlinien** bis zur Buchung und Bewertung aller Geschäfte für beliebige Fonds und/oder Portfolios. Mächtige Performance- und Risikoanalysewerkzeuge (Analysis Tree, Analysis Matrix) bieten die Möglichkeit der Durchsicht auf alle relevanten Informationen (z.B. Fund of Funds) und stellen die notwendige Transparenz während des gesamten Orderprozesses sicher. Dabei können Daten nach beliebigen Merkmalen und verschiedensten Methoden bis auf Einzeltitelebene auf jeden Stichtag und/oder für frei wählbare Perioden ad hoc angezeigt werden. Mit dem **flexibel automatisierbaren Reporting** wird der Mehrwert für Sie und Ihre Kunden sichtbar. Allocare AMS deckt die Anforderungen

der deutschen Fondsgesetze (**InvG/DerivateV**) vollumfänglich ab, unterstützt überdies **GIPS** (Global Investment Presentation Standards) sowie länderspezifische Richtlinien für Luxemburg (UCITS) und die Schweiz (BVV2).

Allocare AMS ist in kürzester Zeit in bestehende IT-Landschaften integrierbar und bietet **Standard-Schnittstellen** zu den bekannten Marktdatenanbietern (SIX Telekurs, Bloomberg), zu Kernbankensystemen (**Avaloq, finnova, Olympic**) und zu mehr als zehn verschiedenen Depotbanken.

ALLOCARE AMS Web erlaubt einen einfachen, schnellen und benutzerspezifisch parametrisierbaren Online-Zugriff via Internet-Browser auf eine Allocare AMS-Datenbank im eigenen Look&Feel. Ein gesicherter Zugriff kann von einem beliebigen Standort aus erfolgen. Eröffnen Sie ein Demo Account unter <http://amsweb.allocare.com>.

Kunden

Allocare AMS ist bei Privat- und Depotbanken, Versicherungen, Vermögensverwaltern (mehr als 30), Family Offices und Asset Managern seit Jahren erfolgreich im Einsatz. Einige Beispiele aus der Kundenliste:



Allocare bietet selbstverständlich die notwendige Unterstützung von der Software-Implementierung bis hin zum (Online-)Support.

Allocare AG
Kantonsstrasse 3
CH-6246 Altishofen
Tel. +41 62 748 65 65

Allocare AG
Stampfenbachstrasse 138
CH-8006 Zürich
Tel. +41 44 368 31 00

Allocare GmbH
Weissfrauenstrasse 12-16
D-60311 Frankfurt a/M
Tel. +49 69 505 092 432

www.allocare.com
info@allocare.com