

Allocare AMS – Compliance

Fondsmanager müssen gesetzliche Anlagerichtlinien erfüllen, Investoren vertragliche/kundenspezifische ... eine kombinierte Lösung

ALLOCARE AMS ermöglicht schnell und einfach vertragliche/kundenspezifische und gesetzliche Anlagerichtlinien zu prüfen. Eine zentrale Datenhaltung, ad-hoc Auswertungen oder vorberechnet in Statistiken auf einem individuellen Daten Set (beispielsweise Transaktionen, Bestände oder Zeitreihen wie Performance oder Risiko Kennzahlen) sind bestmögliche Voraussetzungen, um Verletzungen jederzeit erkennen und bearbeiten zu können.

The screenshot displays the 'Analysis of Portfolio Constraints' report for the period 30.04.2018 - 30.04.2018. The report lists various checks and their compliance status. A table of constraints is also shown in the 'Change Constraint' dialog.

Check	Main Description Constraint Description (Set)	Type Method	Violated Set(s)	Limit(s)	Difference	Current value
30.04.2018	<input checked="" type="checkbox"/> Allocation Limit	(C) PM	1			
	<input checked="" type="checkbox"/> - Equities	Value %		35.00 .. 55.00	6.81	61.81
	<input checked="" type="checkbox"/> - Bonds	Value %		25.00 .. 35.00		25.32
	<input checked="" type="checkbox"/> - Commodities	Value %		0.00 .. 8.00		-
	<input checked="" type="checkbox"/> - Real Estate	Value %		0.00 .. 7.00		3.41
	<input checked="" type="checkbox"/> Default BVV2 (2009)	(L) BVV2 (2009)				
	<input checked="" type="checkbox"/> - Receivables per principal (Art. 54)					
	For Each Holding					
	Adecco	BVV2 Exp (+AI) %				
	Bombardier	BVV2 Exp (+AI) %				
	British Telecom	BVV2 Exp (+AI) %				
	E.ON INTERN FINANCE	BVV2 Exp (+AI) %				
	Germany	BVV2 Exp (+AI) %				
	GK:195376	BVV2 Exp (+AI) %				
	Holcim US Fin	BVV2 Exp (+AI) %				
	HSBC Holdings PLC	BVV2 Exp (+AI) %				
	Italy	BVV2 Exp (+AI) %				
	Pfizer	BVV2 Exp (+AI) %				

Working Selection	For Each	Method	Value
Issuer Risk <3%			
Asset Category <> Liquidity	Issuer	{Value %}	<= 3.00
Asset Category <> Money Market			
Asset Category <> FX			

Allocare AMS Standard Report für Anlagerichtlinien-Prüfung

Constraint Definition

Kernfunktionalitäten

- **Constraint Editor** zum Prüfen von Anlagerichtlinien in einem benutzerfreundlichen Editor
- **Pre-trade Prüfungen** auf Orders
- Auswertungen **ad-hoc** oder **vorberechnet** in Statistiken
- **Drill Down Möglichkeit** zur Prüfung von Fonds oder deren Zusammensetzung
- **Breach Workflow** zur Überwachung und Bearbeitung von

Constraint Verletzungen (Breaches) mit kundenspezifischem Prozess.

- **Audit Trails** halten fest, wer die Prüfung durchgeführt hat, Datum/Zeit der Berechnung von Statistiken sowie deren Ergebnisse (erfüllt, verletzt, Bandbreite)
- **Standard Reports** unterstützen Sie beim Präsentieren der Ergebnisse (Investoren, Compliance Officer, ...)

Verfügbare länderspezifische Regelsets in Europa (Auszug)

- **Schweiz:** Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV2), Kollektivanlagenverordnung (KAG)
- **Deutschland:** Bausparkassengesetz (BauSparkG), Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) / Derivateverordnung (DerivateV), Versicherungsaufsichtsgesetz (VAG)
- **Oesterreich:** Investmentfondsgesetz (InvFG), Pensionskassengesetz (PKG)
- **Luxemburg:** Undertakings for collective investment in transferable securities (UCITS V)
- **Irland:** Undertakings for collective investment in transferable securities (UCITS V)

Allocare AMS – Compliance

The screenshot displays the Allocare AMS interface. The main window shows a 'Portfolio Analysis Tree 5 (Stand...)' for 'Lucerne-2' as of 27.01.2015. The tree structure includes:

- Lucerne-2 (Client Portfolio)
 - Liquidity: 326'717 (5.26%)
 - Equities: 2'095'836 (33.76%)
 - CH: 508'117 (8.18%)
 - ABB N: 1'100.00
 - CS Group N: 1'000.00
 - iShs SMI R CH: 5'000.00
 - DE: 5'000.00
 - ETF iShares Core DAX (R) UCIT...: 5'000.00
 - Prime Office REIT: 100'000.00
 - FR: 5'000.00
 - ANF IMMOBILIER: 5'000.00
 - Tour Eiffel: 2'000.00
 - US: 1'000.00
 - Apple: 1'000.00
 - Bonds

An overlaid 'Constraints Monitor' dialog box shows a violation for 'Lucerne-2 - No U.S. Equities - No U.S. Equities'. The violation details are:

Working Selection	For Each	Method	Value	Current Value
Lucerne-2 - No U.S. Equities - No U.S. Equities				
Risk Country = US	Investment Object:			
Asset Category = Equities	Apple	(Position Count)	= 0	1

The dialog box also includes controls for 'Level' (Overview, Standard, Detail, Textual) and 'Status' (Passed, Threshold, Violation, Error), along with 'Accept', 'Skip', and 'Cancel' buttons.



Allocare AMS –
Order Simulation im Analysis Tree

„Pre-trade“-Verletzung – „Accept“ oder „Skip“ für nächste Schritte

Unternehmen & Kunden

Allocare AG – ein unabhängiges Schweizer Unternehmen mit 40 Mitarbeitern – entwickelt seit 2001 Asset Management Software für Performancemessung, Risikoanalyse und Compliance. Das professionelle Standardsoftware-Paket **Allocare AMS** wird kontinuierlich weiterentwickelt und ist bei rund 50 Endkunden in verschiedenen Segmenten wie Banken, Versicherungen, Corporates, Institutionelle Anleger, Family Offices, Fonds Manager und unabhängige Vermögensverwalter im Einsatz.

Allocare AMS und **Allocare WEB** erfüllen hohe Anforderungen im Asset Management, beispielsweise Portfolioanalyse, Order-routing, Prüfung von Anlagegrenzen (pre- & post-trade), Risikomessung (VaR), browser-basierter Web-Zugriff (auch Tablets) und bieten auch ein vollständig integriertes Kundenreporting.



Dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen wurden ausschließlich für allgemeine Marketing und/oder Informationszwecke zur Verfügung gestellt und kann urheberrechtlich geschützte Informationen und Marken enthalten, welche im Eigentum der Allocare AG, ihrer verbundenen Unternehmen und/oder ihrer Lizenzgeber stehen. Die Vervielfältigung, Verbreitung, Veränderung oder sonstige Nutzung bedarf der vorherigen schriftlichen Zustimmung der Allocare AG. Copyright © 2018 Allocare AG. Alle Rechte vorbehalten.