

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.

Check	Main Description Constraint Description (Set)	Type	Method	Violated Set(s)	Limit(s)	Difference	Current value
30.04.2018	Allocation Limit	(C) PM		1			
☒	· Equities	Value %			35.00 .. 55.00	6.81	61.81
✓	· Bonds	Value %			25.00 .. 35.00		25.32
✓	· Commodities	Value %			0.00 .. 8.00		-
✓	· Real Estate	Value %			0.00 .. 7.00		3.41
☒	Default BVV2 (2009)	(L) BVV2 (2009)		3			
✓	· 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) %					
	Hölm US Fin	BVV2 Exp (+AI) %					
	HSCC Holdings PLC	BVV2 Exp (+AI) %					
	Italy	BVV2 Exp (+AI) %					
	Pfizer	BVV2 Exp (+AI) %					

Allocare AMS Standard Report für Anlagerichtlinien-Prüfung

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

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), Kollektivanlagegesetz (KAG)
- **Deutschland:** Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) / Derivateverordnung (DerivateV)
- **Liechtenstein:** Undertakings for collective investment in transferable securities (UCITS V)
- **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 'Portfolio Analysis Tree 5 (Stand...)' window. The 'Portfolio' is set to 'Lucerne-2' with a valuation date of 27.01.2015. The tree shows a hierarchy: Lucerne-2 (Client Portfolio) -> Liquidity -> Equities -> CH -> CS Group N (1'000.00). A 'Constraints Monitor' dialog box is overlaid, showing a violation for 'Risk Country = US' with a current value of 1. The dialog includes options for 'Working Selection', 'For Each', 'Method', 'Value', and 'Current Value'. It also has radio buttons for 'Level' (Overview, Standard, Detail, Textual) and checkboxes for 'Status' (Passed, Threshold, Violation, Error). Buttons for 'Accept', 'Skip', and 'Cancel' are at the bottom.



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 © 2019 Allocare AG. Alle Rechte vorbehalten.