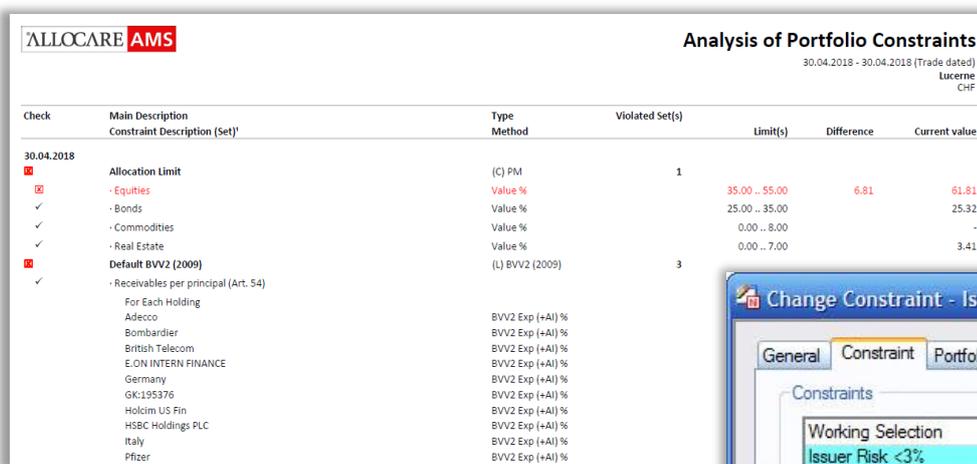


Allocare AMS – Compliance

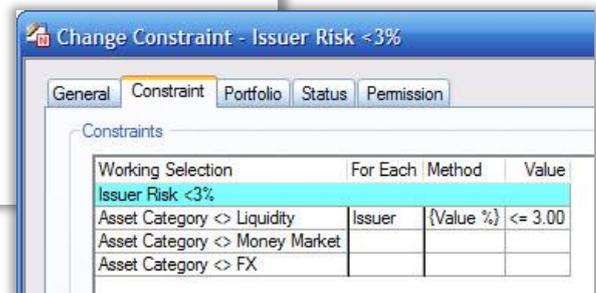
Fondsmanager müssen gesetzliche Anlagerichtlinien erfüllen, Investoren vertragliche/kundenspezifische ... eine kombinierte Lösung

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) %					
	HSC 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)
- **Lichtenstein:** 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 has 'Accept' and 'Skip' 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 © 2019 Allocare AG. Alle Rechte vorbehalten.