

Ihre umfassende Investment Compliance-Lösung

Anlagegrenzen in Allocare AMS

Fondsmanager müssen gesetzliche, Vermögensverwalter vertragliche und kundenspezifische Anlagegrenzen erfüllen – wir bieten eine kombinierte Lösung.

Allocare AMS ermöglicht schnell und einfach vertragliche, kundenspezifische und gesetzliche Anlagegrenzen zu prüfen.

Eine zentrale Datenhaltung und ad-hoc oder periodische Prüfungen sind bestmögliche Voraussetzungen, um Verstöße jederzeit erkennen und bearbeiten zu können.

Optional erzeugen Regelverletzungen Breaches, welche mittels definierbarem Workflow überwacht, behoben und wenn notwendig an die Aufsicht oder Investoren gemeldet werden.

Check	Globale Beschreibung Bezeichnung Anlagerschiene	Typ Methode	Verletzte Regel(n)	Grenze(n)	Differenz	Aktueller Wert
LI 553 - Deckung Derivate	- Deckung Zahlungsverpflichtungen aus Derivaten	(L) UCITS LI Wert Diff	0	>= 0		19'768'437
LI 553(2) - Commitment-Ansatz	- Max. 100% Global Exposure	(L) UCITS LI UCITS Global Exp % (incl. Zielfonds)	0	<= 100.00		7.54
LI 554(1) - Max. 20% Einlagen pro Kreditinstitut	- Max. 20% Einlagen pro Kreditinstitut	(L) UCITS LI	1			
Je Holding						
	HSBC Holdings PLC	Wert %		<= 20.00	10.53	30.53
LI 554(2) - OTC Kontrahentenrisiko	- OTC Exposure mit Kreditinstituten und Netting	(L) UCITS LI Wert %	0	<= 10.00		
	- OTC Exposure mit Kreditinstituten ohne Netting	Wert %		<= 10.00		
	- OTC Exposure mit Nicht-Kreditinstituten und Netting	Wert %		<= 10.00		
	- OTC Exposure mit Nicht-Kreditinstituten ohne Netting	Wert %		<= 5.00		
LI 554(3) - Emittenten >5% nicht mehr als 40%	- Emittenten >5% nicht mehr als 40%	(L) UCITS LI UCITS Exp %	0	<= 40.00		
	- Overview - Issuers >5%					
LI 554(3) - Max. 10% Geldmarktinstrumente pro Konzern	- Max. 10% Geldmarktinstrumente pro Konzern	(L) UCITS LI UCITS Exp %	0	<= 10.00		
LI 554(3) - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern	- Max. 10% Wertpapiere pro Konzern	(L) UCITS LI	1			
Je Holding						
	HomeXon	UCITS Exp %		<= 10.00		
LI 554(4) - Max. 20% in Kombination pro Konzern	- Max. 20% in Kombination pro Konzern	(L) UCITS LI	1			
Je Holding						
	HSBC Holdings PLC	UCITS Exp %		<= 20.00		
LI 554(5) - Öffentliche Emittenten	- Max. 35% pro öffentlichen Emittenten	(L) UCITS LI UCITS Exp %	0	<= 35.00		
LI 554(6) - Covered Bonds		(L) UCITS LI	0			

Allocare AMS - Standard Report für Anlagegrenzprüfung

Constraint	Working Selection	For Each	Method	Value
Status	Max. 10% Wertpapiere pro Konzern			
Portfolio	Expose (Eco Exp)	(Holding)	(UCITS Exp %)	<= 10.00
Permission	UCITS LI Instruments = Transferable Securities			
	UCITS LI Issuer Group <= Public Issuer			
	UCITS LI Issuer Group <= Public Guarantor			
	UCITS Risk Domicile <= EEA			
	or			
	UCITS LI Issuers <= Credit Institute			
	or			
	UCITS LI Instruments <= Covered Bonds			

Allocare AMS - Constraint Definition

Kernfunktionalitäten

- **Constraint Editor** zur einfachen Erstellung und Änderung von Prüfregeln
- **Pre-trade Prüfungen** auf Orders, ad hoc oder automatisiert im Orderprozess
- **Post-trade Prüfungen** auf Positionen, periodisch und automatisiert oder jederzeit ad hoc
- **Constraint Monitor** zur Visualisierung der Prüfergebnisse
- **Drill Down** und **Auflösung** von Fonds mit Berücksichtigung in den Prüfregeln
- **Breach Workflow** zur Überwachung und Bearbeitung von Regelverletzungen (Breaches) mit kundenspezifischem Prozess
- **4-Augenprinzip, Versionierung** und **Berechtigungskonzept** zur auditkonformen Abbildung der Compliance-Prozesse
- **Audit Trails** zur Nachvollziehbarkeit der Prüfergebnisse und -statistiken (wer, wann, was)
- **Compliance Standardreports** zur Präsentation der Ergebnisse für Investoren, Compliance Officer und für die Aufsicht

Verfügbare länderspezifische Regelsets in Europa

- **Schweiz:** Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV2), Kollektivanlagengesetz (KAG)
- **Deutschland:** Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) / Derivateverordnung (DerivateV)
- **Luxemburg:** Undertakings for collective investment in transferable securities (UCITS), Specialized Investment Funds (SIF), Reserved Alternative Investment Funds (RAIF)
- **Österreich:** Investmentfondsgesetz (InvFG), Pensionskassengesetz (PKG)
- **Liechtenstein:** Liechtenstein: Gesetz über bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (UCITSG)
- **Irland:** Undertakings for collective investment in transferable securities (UCITS V)

Unser Unternehmen

GRÜNDUNG
2001

MITARBEITENDE
50+

INSTALLATIONEN
50+

LÄNDER
10+

Die **Allocare AG** (www.allocare.com) ist ein unabhängiges Schweizer Softwareunternehmen und einer der führenden Anbieter von Asset & Wealth Management Software im Schweizer Markt. Ausschliesslich in der Schweiz werden innovative Lösungen rund um die bewährte Standardsoftware **Allocare AMS** und Weblösung **Allocare WEB** entwickelt. Das Kundenportfolio besteht aus mehr als 50 grösstenteils langjährigen Kunden im Banken und Vermögensverwaltungsumfeld in der Schweiz und im Ausland.

Seit 2021 gehört die **Allocare Data AG** mit Sitz in Zürich (vormals numas SA) zur Allocare-Gruppe. Das Fintech-Unternehmen unterstützt seit 2016 Kunden im Data Management, insbesondere Family Offices und Vermögensverwalter, bietet Reporting-Services und unterhält mit **Allocare CLOUD** eine auf Allocare AMS und Allocare WEB basierende Service- und Portfolio Management-Plattform.

Unsere Produkte

ALLOCare AMS

ALLOCare WEB

ALLOCare CLOUD

Unsere Services

- Einführungsunterstützung
- Support
- Data Management
- Reporting-Services
- Software as a Service (SaaS)

ALLOCare AMS **ALLOCare WEB**

Tree	Investment Object Identifier ISIN	Nominal/Quantity	Clean Price	Fx Ref/Local	Value	Value %
Aktien-Portfolio					20'048'658	100.00
Liquidity					6'882'405	34.33
Equities					13'166'253	65.67
CHF				1.0201	2'170'463	10.83
EUR				1.0000	10'830'919	54.02
BMW I	DE0005190003	10'000.00	EUR 100.6000	1.0000	1'006.000	5.02
DAX Future Dec 2023	FDAX DEC/23	-4.00	EUR 11'600.0000	1.0000	-1'160.000	-5.79
Deutsche Bank N	DE0005140008	100'000.00	EUR 6.9120	1.0000	691'200	3.45
Deutsche Post N	DE0005552004	25'000.00	EUR 28.4050	1.0000	710'125	3.54
ENGIE	FR0010208488	50'000.00	EUR 13.0250	1.0000	651'250	3.25
Eni N	IT0003132476	50'000.00	EUR 15.0980	1.0000	754'900	3.77
Fresenius I	DE0005785604	20'000.00	EUR 49.0100	1.0000	980'200	4.89
Heineken	NL0000009165	36'000.00	EUR 96.3000	1.0000	3'466'800	17.29
ING Groep	NL0000303600	50'000.00	EUR 11.3200	1.0000	566'000	2.82
iShs EUSTX 50	DE0005933956	30'000.00	EUR 35.1400	1.0000	1'054'200	5.26
LANXESS	DE0005470405	15'000.00	EUR 52.4400	1.0000	786'600	3.92
Merck	DE0006599905	10'900.00	EUR 91.6600	1.0000	999'094	4.98
Siemens N	DE0007236101	2'500.00	EUR 129.8200	1.0000	324'550	1.62
USD					164'871	0.82

Allocare AMS – Portfolio View im Analysis Tree mit Orders

Kontakt



David Popp

Sales / Presales
+41 62 748 65 63
sales@allocare.com
+41 62 748 65 65

Allocare AG

Kantonsstrasse 3
CH-6246 Altishofen
+41 62 748 65 65
www.allocare.com

Signaustasse 10
CH-CH-8008 Zürich
+41 44 521 11 40

Working Selection	For Each	Method	Value	Current Value
Aktien-Portfolio - LI \$54(3) - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern	(Holding):			
Expose (Eco Exp)				
UCITS LI Instruments = Transferable Securities	ABB	(UCITS Exp %)	<= 10.00	4.82
UCITS LI Issuer Group => Public Issuer	BMW	(UCITS Exp %)	<= 10.00	5.02
UCITS LI Issuer Group => Public Guarantor	Deutsche Bank	(UCITS Exp %)	<= 10.00	3.45
UCITS Risk Domicile => EEA	Deutsche Post	(UCITS Exp %)	<= 10.00	3.54
or	ENI	(UCITS Exp %)	<= 10.00	3.77
UCITS LI Issuers => Credit Institute	Fresenius	(UCITS Exp %)	<= 10.00	4.89
or	GDF Suez	(UCITS Exp %)	<= 10.00	3.25
UCITS LI Instruments => Covered Bonds	Heineken	(UCITS Exp %)	<= 10.00	17.29
	HSBC Holdings PLC	(UCITS Exp %)	<= 10.00	0.19
	IBM	(UCITS Exp %)	<= 10.00	0.63
	ING Group	(UCITS Exp %)	<= 10.00	2.82
	LANXESS	(UCITS Exp %)	<= 10.00	3.92
	Merck	(UCITS Exp %)	<= 10.00	4.98
	Nestle	(UCITS Exp %)	<= 10.00	0.00
	Siemens	(UCITS Exp %)	<= 10.00	1.62

Allocare AMS – Pre-trade-Prüfergebnisse mit Verletzung

Referenzen

