

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.

The screenshot displays the 'Überprüfung Portfolioeinstellungen' (Portfolio Settings Check) interface. It features a table with columns for 'Check', 'Globale Beschreibung', 'Typ', 'Verletzte Regel(n)', 'Grenze(n)', 'Differenz', and 'Aktueller Wert'. The table lists various constraints such as 'LI 553 - Deckung Derivate', 'LI 552(2) - Commitment-Ansatz', and 'LI 554(1) - Max. 20% Einlagen pro Kreditinstitut'. A dialog box titled 'Change Constraint - LI 554(3) - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern' is overlaid on the right, showing a table for defining constraints with columns for 'Working Selection', 'For Each', 'Method', and 'Value'. The dialog includes options for 'Status' and 'Permission' and buttons for 'Add', 'Change', 'Delete', 'OK', 'Cancel', 'Apply', 'Operation', and 'Help'.

Allocare AMS - Standard Report für Anlagegrenzprüfung

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 das browserbasierte Zusatztool Allocare WEB entwickelt. Das Kundenportfolio besteht aus mehr als 50 grösstenteils langjährigen Kunden im Banken und Vermögensverwaltungsumfeld im In- und Ausland. Seit 2021 gehört auch numas SA (www.numas.ch) mit Sitz in Zürich vollumfänglich zur Allocare-Gruppe. Die 2016 gegründete numas SA ist ein Start-up in der Fintech-Branche. Das Unternehmen unterstützt Kunden, insbesondere Family Offices und Vermögensverwalter, im Data Management und unterhält mit numas WMS eine auf Allocare AMS und Allocare WEB basierende Service Plattform an.

Unsere Produkte

- Order Management
- Performance Measurement
- Risk Management
- Reporting



Unsere Services

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

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
Product Management

+41 62 748 65 63
sales@allocare.com
+41 62 748 65 65

Allocare AG

Kantonsstrasse 3
CH-6246 Altshofen
www.allocare.com

Working Selection	For Each	Method	Value	Current Value
Aktien-Portfolio - LI \$54(3) - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern - Max. 10% Wertpapiere pro Konzern				
Expose (Eco Exp)	{Holding}			
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

