

Für eine integrierte Umsetzung ihrer Portfolio Strategie



XENTIS Front Office – für das Asset- und Portfoliomanagement

Das XENTIS Front Office (XFO) bietet ein umfangreiches Funktionsspektrum zur Fonds- und Portfolioanalyse sämtlicher Asset-Klassen. Mit einer intuitiven Benutzeroberfläche, schnellen Antwortzeiten sowie individuell modellierbaren Abfragen und Analysen unterstützt das XFO den Portfoliomanager effizient bei der Durchführung des Investment-Prozesses.

Im XFO können die Vermögensstruktur detailliert ausgewertet und Handelsentscheidungen getroffen werden. Die daraus resultierenden Orders können nach erfolgtem Pre-Trade Compliance Check nahtlos im XENTIS Middle und Back Office weiterverarbeitet und schliesslich direkt an Marktteilnehmer gesendet werden.



VORTEILE DER XENTIS FRONT OFFICE LÖSUNG

1. Zugriff auf gesamte Datenbasis

Das XFO hat Zugriff auf sämtliche geladenen Fonds-, Instrumenten- und Positionsdaten. Sämtliche Ereignisse wie Handelsgeschäfte, Corporate Actions und Kursänderungen werden im XENTIS Investment Book of Record (IBOR) fortlaufend berücksichtigt, sodass im Front Office stets aktuelle Bestandsdaten vorliegen. Zeitraubende, manuelle Bestandsabgleiche entfallen, Investitionsentscheidungen werden erleichtert und operative Risiken minimiert.

2. Integration im modularen XENTIS

Das XFO ist vollständig in die ganzheitliche XENTIS-Lösung integriert. So werden beispielsweise Orders, welche über das XFO generiert werden, automatisch einer Pre-Trade Compliance Prüfung unterzogen, basierend auf den im Compliance Modul hinterlegten Prüfregelein. Weiter werden die Orders dem nachgelagerten Order Workflow übergeben und können in einem Order Dashboard überwacht und bearbeitet werden. Soll-Strukturen wie z.B. Benchmarks, Modellportfolios oder Asset-Allokation-Strukturen können aufgesetzt und in XFO Analysen zu Vergleichszwecken und für Rebalancings herangezogen werden.

3. Flexibilität und Individualität als Standard

Das XFO verbindet die Vorteile von Standardsoftware mit dem Komfort einer individuellen, auf kundenspezifische Anforderungen zugeschnittenen Lösung. So können beispielsweise die in Auswertungen/Analysen benutzten Datenfelder ohne Unterstützung des Softwareherstellers beliebig erweitert und direkt zur Verfügung gestellt werden. Ebenso hat der Anwender die Möglichkeit, auf den eigenen Anwendungszweck zugeschnittene Auswertungen über eine intuitiv aufgebaute Modellierung zu erstellen oder den Orderworkflow anzupassen.

FUNKTIONALE ÜBERSICHT



Auswertungen und Analyse

- Aktuelle oder historische Auswertungen von frei wählbaren Portfolios, Carve-Outs und Konsolidierungen («Slice & Dice»)
- Unterstützung aller gängigen Anlageklassen inkl. Look-Through
- Real-time Sicht auf Bestände (IBOR) sowie Bewertungen und Kennzahlen über frei wählbare Stichtage
- Soll-Ist-Vergleich inklusive Überwachung von strategischen und taktischen Zielwerten (Asset Allokation) sowie den definierten Bandbreiten
- Modellierungstool für individuelle und kundenspezifische Gestaltung



Einfache Ordereingabe (Quick Order)

- Als Stück-/Nominalwert oder als Prozentwert
- Als Ordermenge oder Zielwert (bspw. Kauf 500 Stück oder Zielwert 500 Stück)

FUNKTIONALE ÜBERSICHT



Rebalancing

- Angleichung des Ist-Wertes an einen Soll-Wert durch Generierung von Ordervorschlägen
- Verwendung von verschiedenen Sollstrukturen möglich (bspw. Referenzportfolio, Modellportfolio, Benchmark).
- Berücksichtigung von Orderparametern wie Mindestabweichung, Mindestbetrag und die Erstellung gerundeter Zielmengen



Globale Aktionen

- Massen-Rebalancing über mehrere Portfolios gleichzeitig zur maximalen Effizienzsteigerung
- Kauf / Verkauf mit verschiedenen Filtern und Zielwertdefinitionen
- Weitere Aktionen wie Titeltausch, Sektoranpassung, Devisen Hedging oder Cash Rebalancing



Pre-Trade Compliance

- Integriertes Investment-Compliance-Modul zur Prüfung von Einzel- oder Sammelorders
- Vorgefertigte Country-Rule-Sets für länderspezifische Regulatorien (u.a. CH, DE, LUX, AT, LIE)
- Konfigurierbare Arbeitsabläufe zur Bearbeitung von Grenzverletzungen



Performance

- Performanceberechnung auf Ebene Fonds/Mandat, konsolidierter Portfolios, Benchmark und frei definierbaren Kategorien (Carve-Outs)
- Performanceberechnung von Positionen in Positions- und Bewertungswährung
- Feingranulare und frei definierbare Brutto-/Nettosichten
- Performance-Kontribution und Performance-Attribution
- Berechnungsmethoden: TWR, MWR, IRR



Technische Komponenten

- Detailliert konfigurierbare Zugriffsberechtigung auf funktionaler und Datenobjekt-Ebene
- Vollständige und revisionssichere Aufzeichnung von Änderungen
- Verfügbar in mehreren Sprachen

IHR PORTFOLIO IMMER IM BLICK



Portfolio Übersicht

Asset Analyse

Performance Analyse

Profidata AG

Bändliweg 30
8048 Zürich
Schweiz

+41 44 736 47 47
info@profidata.com
www.profidata.com

swiss made
software

PROFIDATA