

carQORT — мидл-офис управляющей компании

Владимир Курляндчик
Директор по развитию ARQA Technologies





О компании

- Ведущий российский разработчик ПО для проведения и учета операций на финансовых рынках
- Полная линейка программных решений «front-to-back» для банков, инвестиционных и управляющих компаний
- Доступ к торгам на 30+ основных международных торговых площадках
- 300+ клиентов
- 160+ сотрудников
- Корпоративное присутствие в Новосибирске, Москве, Лондоне и Киеве
- 15 лет работы



Решения для УК

- Терминал доверительного управляющего TrustManager
- Инфраструктурные решения для оптимизации торговли
- Мидл-офис для управляющих компаний capQORT



Основные задачи carQORT

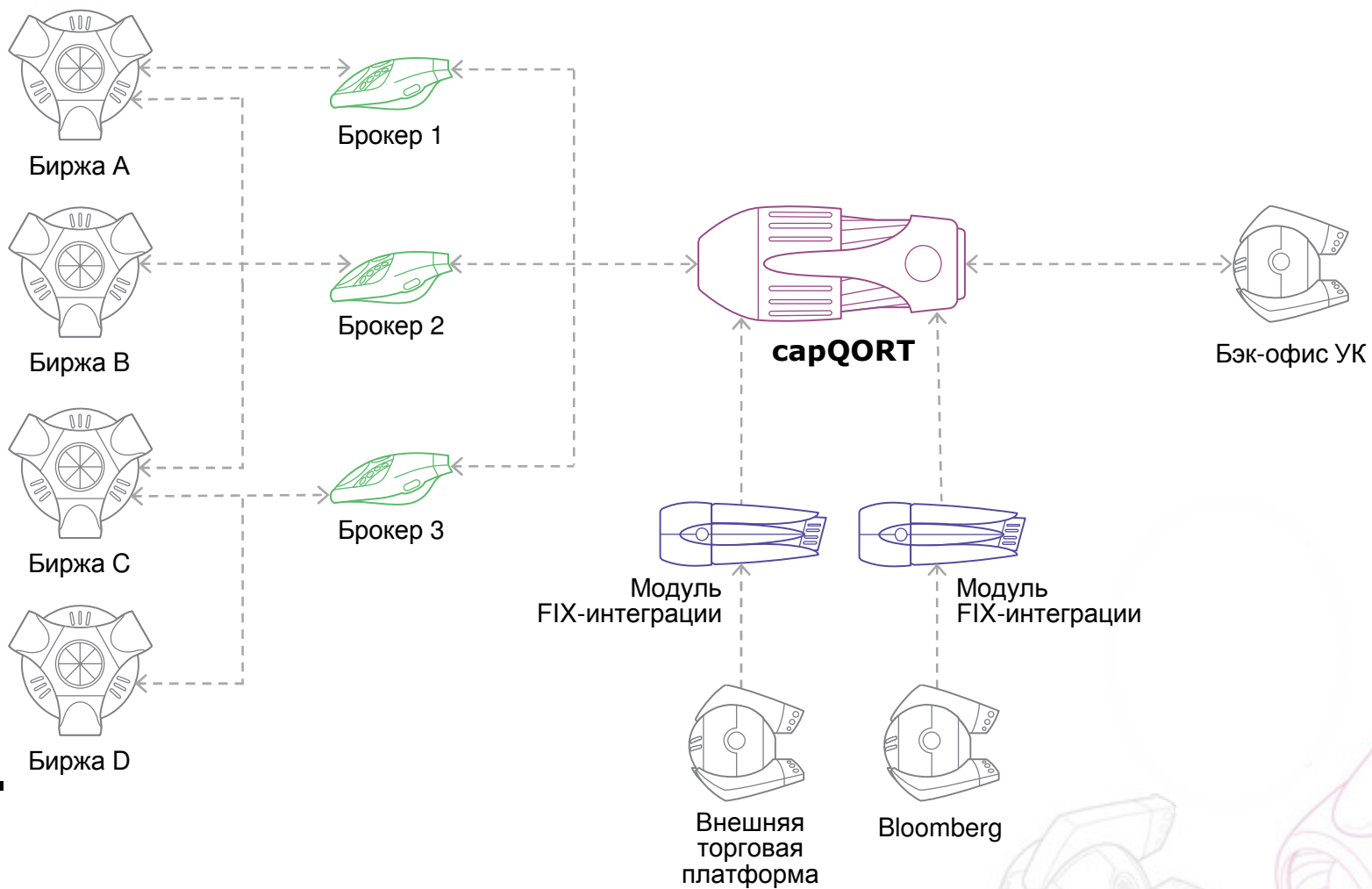
- Ведение онлайн позиций по портфелям и группам портфелей
- Торговые операции
- Мониторинг и контроль ограничений
- Расчет вознаграждений управляющего
- Отчетность



Пользователи carQORT

- Управляющие
- Риск-менеджеры
- Compliance-офицеры
- Сотрудники мидл-офиса

carQORT в инфраструктуре УК





Типы операций

- Биржевые и внебиржевые сделки:
 - СПОТ, РЕПО, РПС с ценными бумагами
 - на покупку / продажу валюты, сделки SWAP
 - с производными инструментами (фьючерсы, опционы)
 - с депозитами
- Операции на зарубежных площадках
- Неторговые операции клиентов
- Корпоративные действия



Ведение позиций

- В режиме онлайн с учетом торговых и неторговых операций
- Отражение как фактической, так и плановой позиции
- В разрезе активов и мест хранения
- С учетом задолженностей



Контроль ограничений

- Контроль портфелей:
 - по договорным требованиям
 - регуляторный
 - по внутренним требованиям УК
- Режимы контроля:
 - pre-trade
 - post-trade
 - end-of-day
- Типы контроля pre-trade:
 - «запрещено»
 - «требуется подтверждения»
 - «с уведомлением»

Типы ограничений

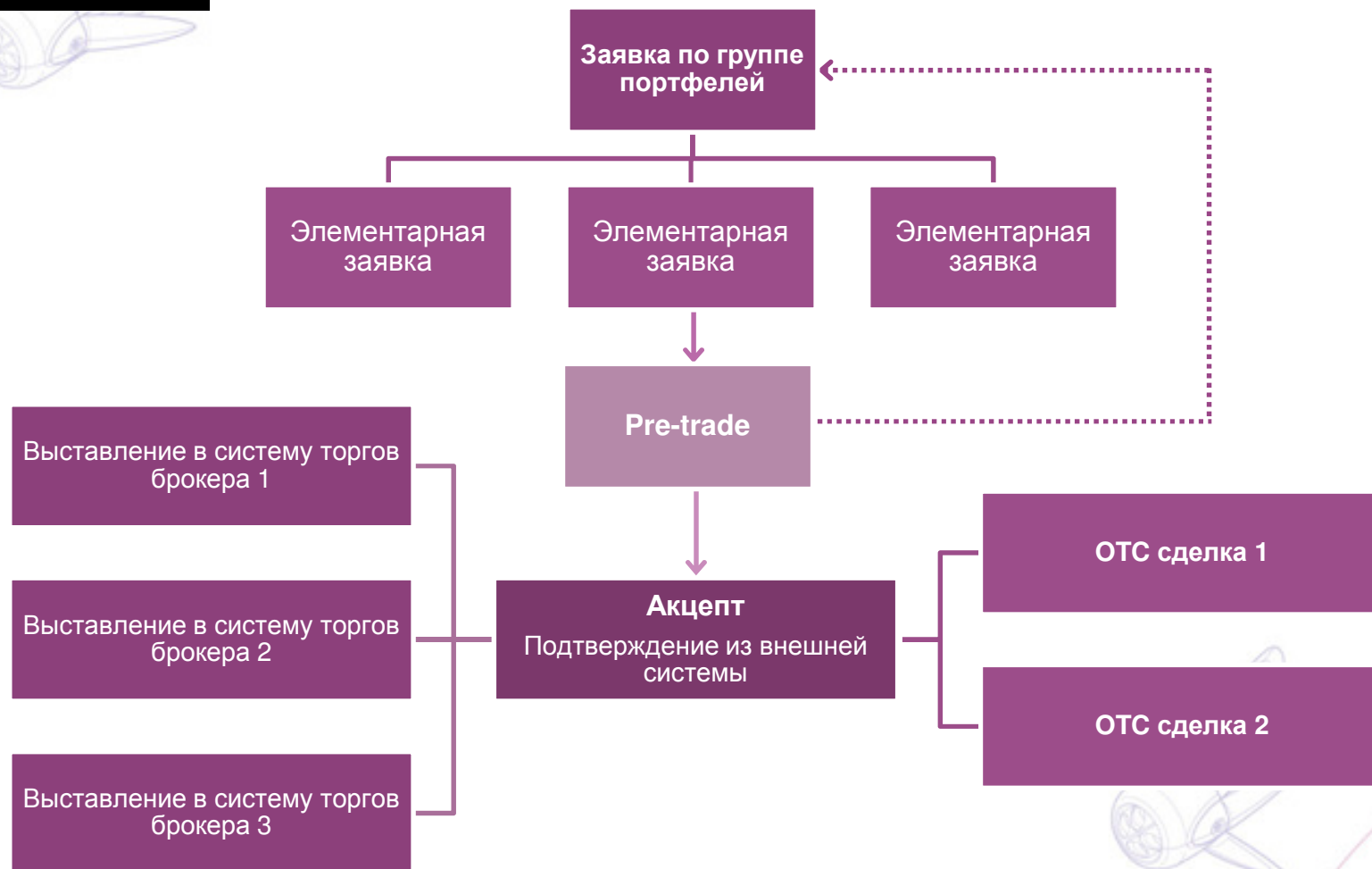
Тип	Описание
На структуру портфеля	На стоимости отдельных частей портфеля или на соотношение таких стоимостей
На заявки	На типы операций и на отклонение цены
На контрагентов	На объём обязательств по неисполненным сделкам
На изменение портфеля	На изменение портфеля относительно выбранных модельных портфелей и/или бенчмарков
На дюрацию	На дюрацию или модифицированную дюрацию по облигациям
На позицию по ПФИ	На уровень покрытия открытой позиции по ПФИ



Мониторинг нарушений

- Ведение журнала нарушений
- Рассылка сообщений
- Контроль устранения нарушений

Заявки





Расчет вознаграждений

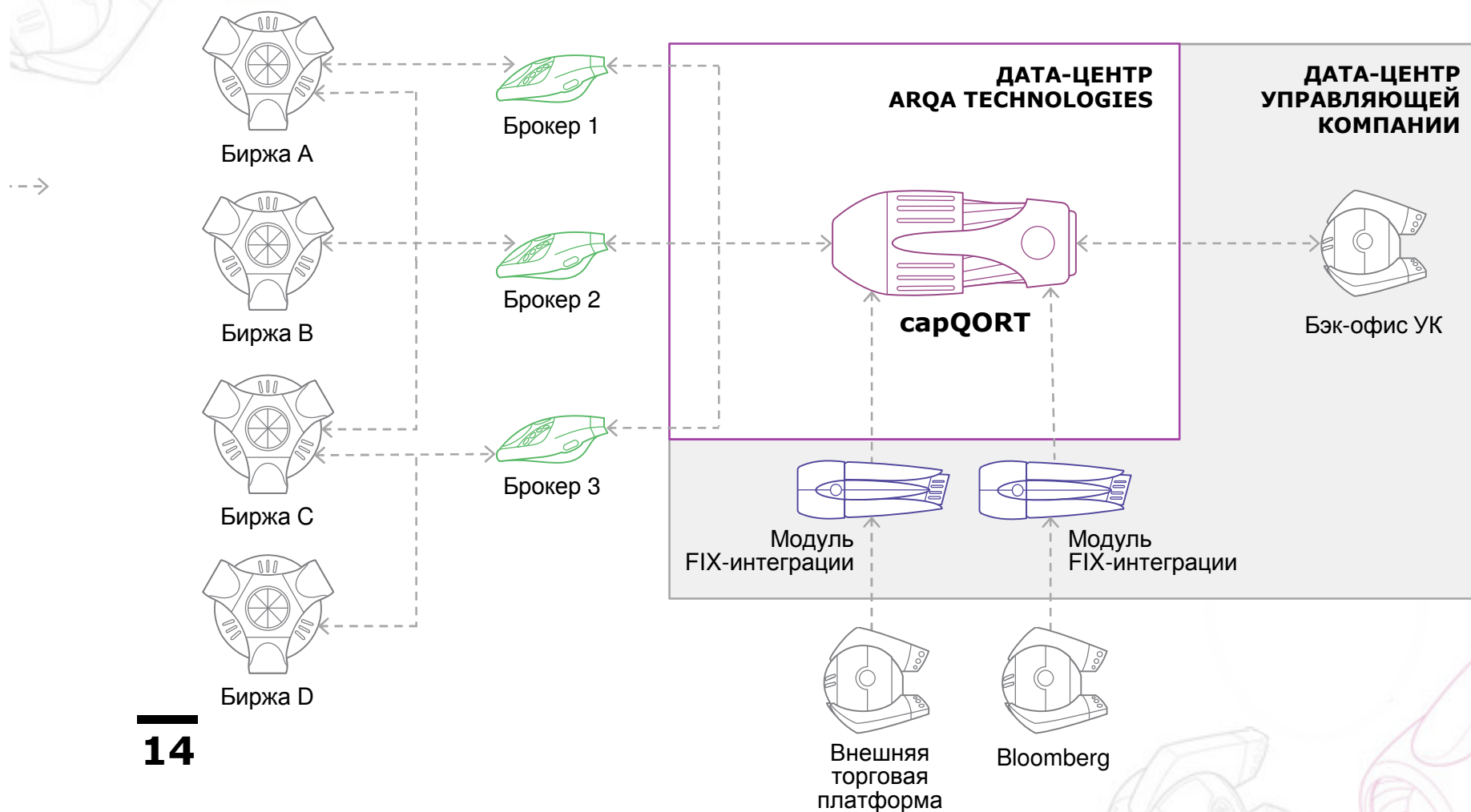
- За управление:
 - как процент годовых за среднее СЧА периода управления
 - как среднее от процента за СЧА каждого дня периода управления
- За успех:
 - как процент от превышения фиксированной доходности
 - как процент от превышения доходности модельного портфеля
 - как процент от превышения доходности бенчмарка



Отчетность

- По изменению портфелей за период
- По сделкам, движениям, комиссиям
- Эффективность управления с отражением доходности по FIFO, LIFO или Avg

Варианты распространения





Ближайшие планы

- Алгоритмы ребалансировки портфелей
- Сложные механизмы post-trade риск-менеджмента



Контакты

| Консультации и тестирование

+7 (383) 219-16-19

sales@arqatech.com

| Техническая поддержка

+7 (383) 219-16-99

qortsupport@arqatech.com

