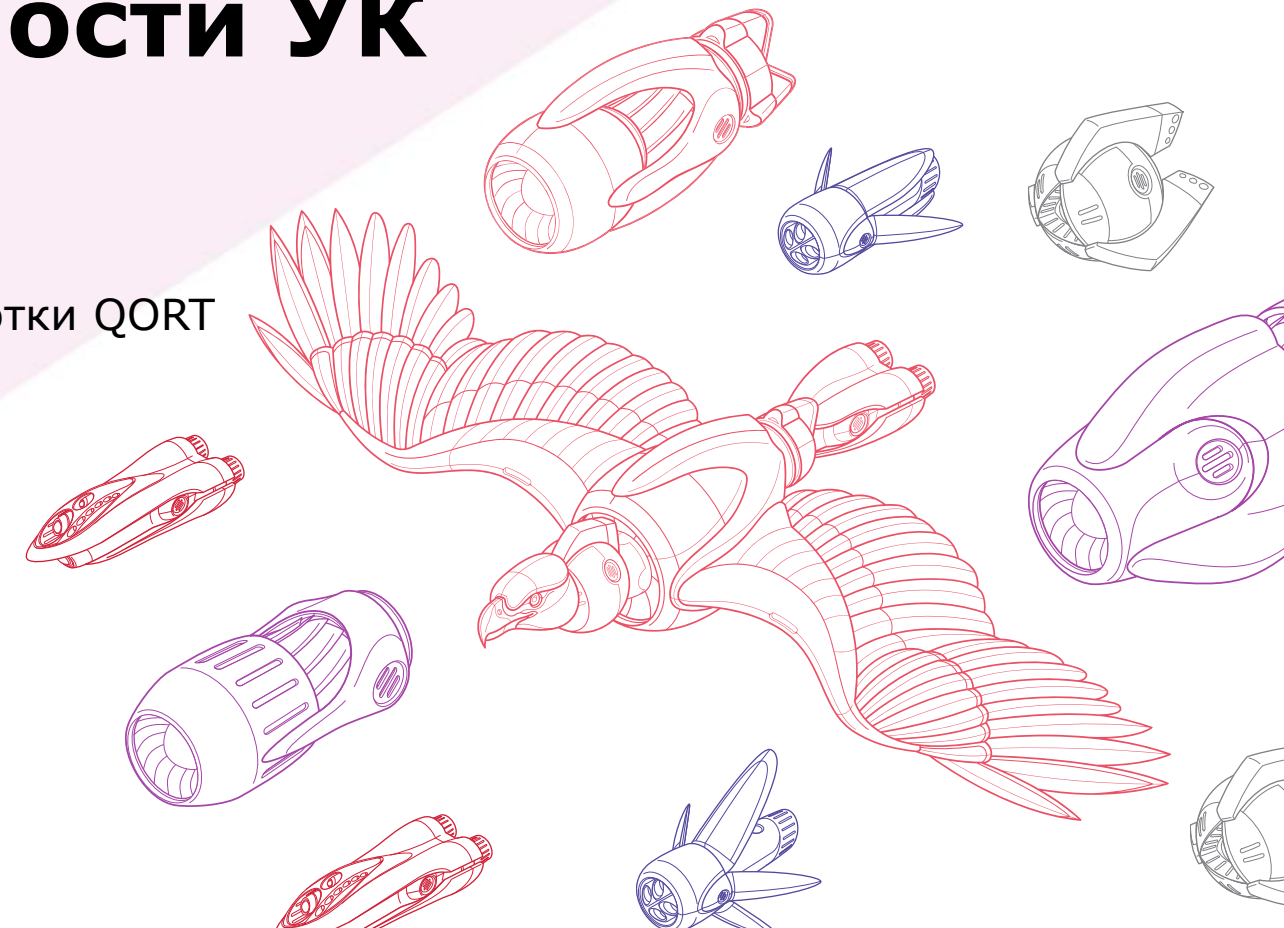
capQORT:
новый уровень автоматизации деятельности УК

Алексей Бабурин,
Руководитель разработки QORT



О компании

ARQA TECHNOLOGIES

Ведущий российский разработчик программного обеспечения для проведения и учета операций на финансовых рынках

quik

Фронт-офисная платформа для организации собственных операций и обслуживания клиентов при торговле на российских и зарубежных финансовых рынках

mid port

Автоматизированный мидл-офис инвестиционной компании или банка

cap port

Автоматизированный мидл-офис управляющей компании

back port

Автоматизированный бэк-офис инвестиционной компании или банка

Потребности управляющих компаний

- Разделений ролей и соответствующих им функций
- Учет параметров и данных, необходимых с точки зрения законодательной регламентации деятельности управляющих компаний
- Хранение исторических данных
- Простая технологическая схема организации управления разными портфелями через разных брокеров

QORT:
база для мидл-офиса УК

Предпосылки

- Агрегация данных за исторический период времени
- Расширяемая справочная система
- Возможность одновременного подключения сервера QORT к нескольким серверам QUIK

«capital» + QORT = capqort

Основные задачи

- Ведение позиций по портфелям в режиме онлайн
- Торговые операции
- Мониторинг и контроль ограничений
- Расчет вознаграждений управляющего
- Отчетность и аналитика

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
- История изменений, механизм внесения изменений задним числом

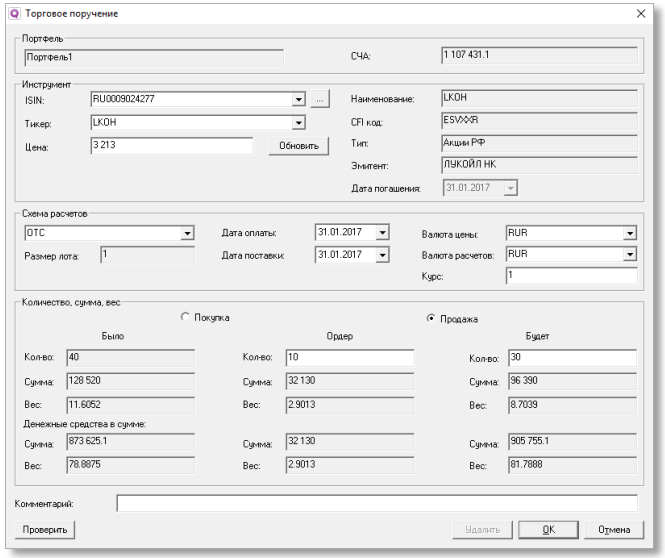
Обработка поручений

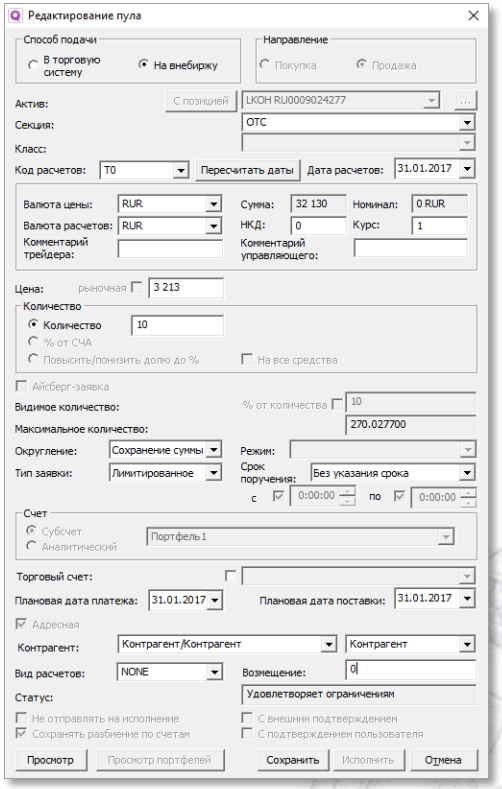
Управляющий

- Формирование поручения
- Проверка поручения
- Передача на исполнение
- Комментирование поручения

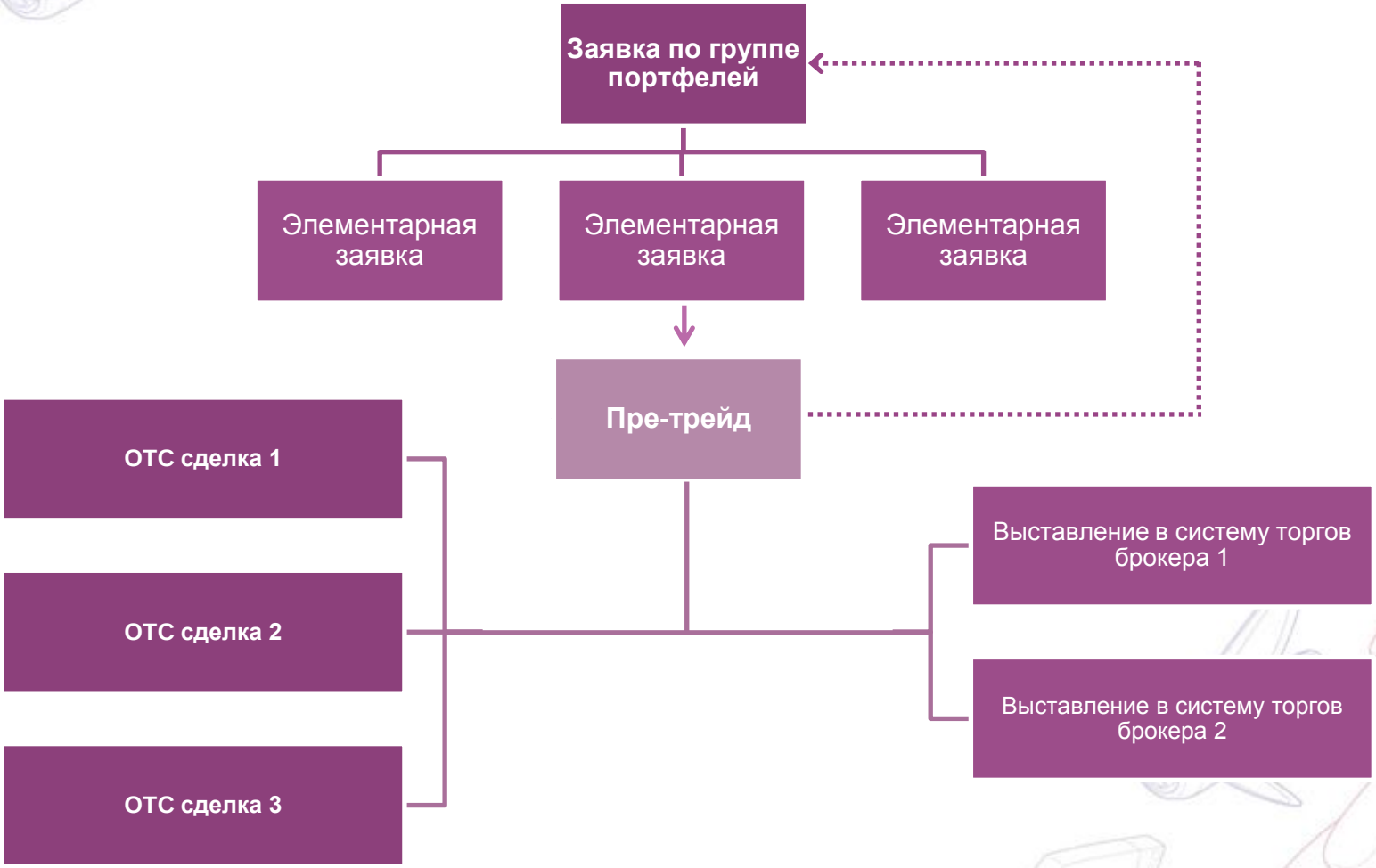
Трейдер

- Уточнение деталей поручения
- Исполнение поручения





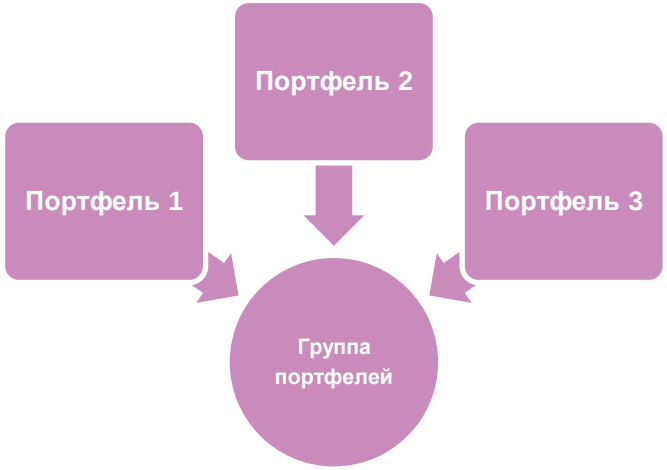
Исполнение групповых заявок



Ограничения

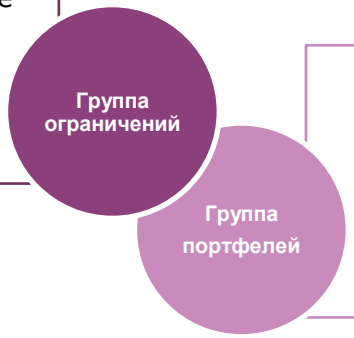
- Контроль портфелей (регуляторный, по договорным требованиям)
- Режимы контроля:
  - pre-trade:
    - тип «запрещено»
    - тип «требует подтверждения»
    - тип «с уведомлением»
  - post-trade
  - end-of-day
  - тестирование ограничений
- Журнал нарушений

Гибкость настроек ограничений портфелей



Например:

- Законодательные акты
- Декларации доверительного управляющего



Например:

- Портфели пенсионных накоплений
- Портфели стратегии ИИС

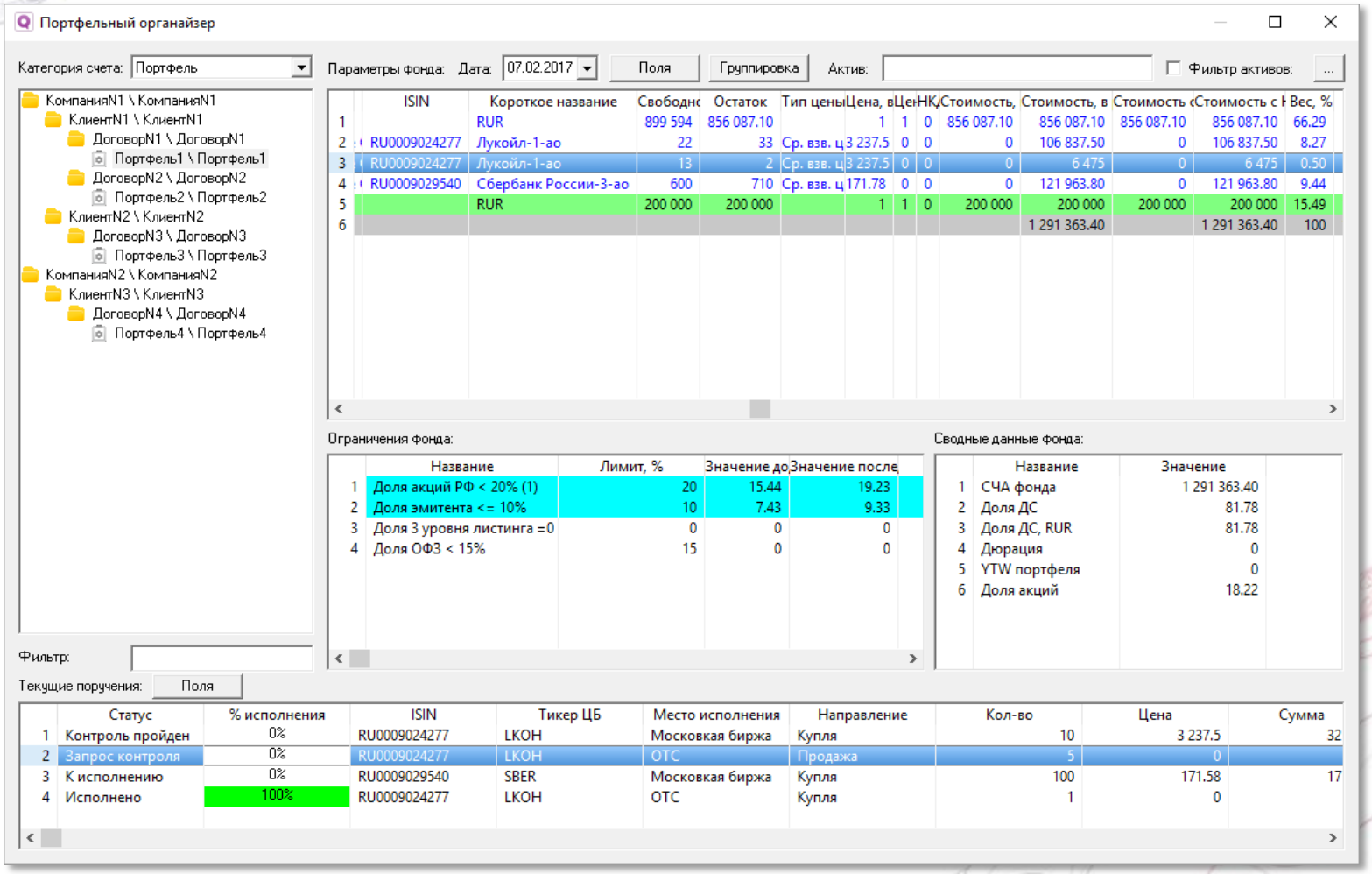
Типы ограничений

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 по неисполненным сделкам и адресным заявкам
На отклонение от структуры модельного портфеля	На изменение относительно выбранного модельного портфеля
На дюрацию	На дюрацию или модифицированную дюрацию по облигациям
На позицию по ПФИ	На уровень покрытия открытой позиции по ПФИ
Длящееся нарушение	На количество нарушений базового ограничения в заданном периоде

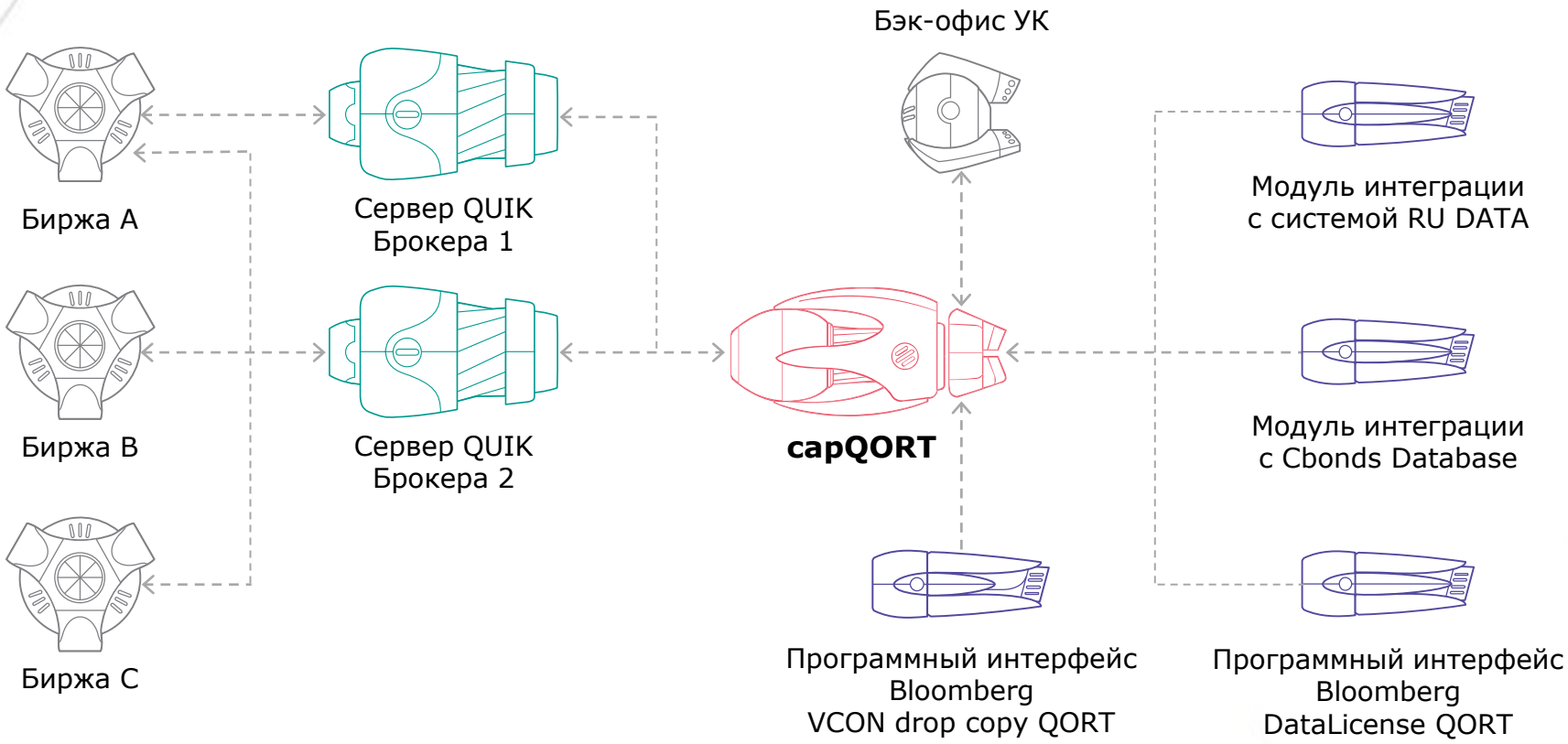
Группы инструментов

- Явно заданный список
- Подбор:
  - по видам инструментов
  - по эмитентам и гарантам
  - по индустриям
  - по рейтингам агентств
  - по кодам государственной регистрации, CFI
  - по дополнительным признакам (ликвидность, бумага для квалифицированного инвестора, вхождение в котировальный список и т.д.)
  - по сроку до погашения/оферты
- Иерархия ранее созданных групп

Портфельный органайзер

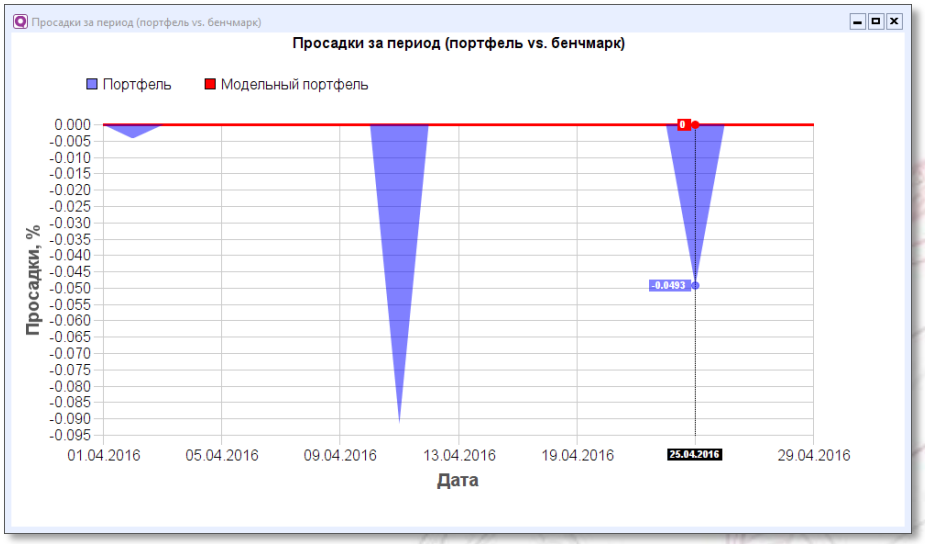


capQORT в инфраструктуре УК



Отчетность

- По изменению портфеля за период
- По сделкам, движениям, комиссиям (в виде таблиц, с возможностью внесения изменений)
- Эффективность управления с отражением доходности по FIFO, LIFO или Avg
- Сравнение структуры портфеля с модельным портфелем
- VaR-анализ по портфелям



Сервисные возможности

- Служба расписаний
- Средства внутреннего контроля стабильности работы и полноты данных
- Системный мониторинг
- Ролевая система прав доступа

Контакты

Консультации и тестирование

+7 (383) 219-16-19

sales@arqatech.com

Техническая поддержка

+7 (383) 219-16-99

qortsupport@arqatech.com

qort