



# О компании

---



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



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



Автоматизированный мидл-офис инвестиционной компании или банка



Автоматизированный мидл-офис управляющей компании



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

$$\text{«capital»} + \text{QORT} = \text{cap qort}$$



# Основные задачи

---

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

# Ведение позиций

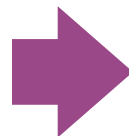
---

- 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



## Треjder

- Уточнение деталей поручения
- Исполнение поручения

Торговое поручение

Портфель: Портфель1 СЧА: 1107 431.1

Инструмент: ISIN: RU0009024277 Наименование: UKOH  
Тикер: UKOH CF1 код: ESVOXX  
Цена: 3213 Обновить Тип: Акции РФ  
Эмитент: ПАОКП НК  
Дата погашения: 31.01.2017

Схема расчетов: ОТС Дата оплаты: 31.01.2017 Валюта цены: RUR  
Размер лота: 1 Дата поставки: 31.01.2017 Валюта расчетов: RUR  
Курс: 1

Количество, сумма, вес		Ордер		Будет	
Было	Ордер	Количество	Сумма	Количество	Сумма
Количество: 40	Количество: 10	Количество: 30		Количество: 30	
Сумма: 128 520	Сумма: 32 130	Сумма: 96 390		Сумма: 96 390	
Вес: 11.6052	Вес: 2.9013	Вес: 8.7039		Вес: 8.7039	
Денежные средства в сумме:		Сумма: 32 130		Сумма: 905 755.1	
Сумма: 873 625.1	Сумма: 32 130	Сумма: 905 755.1		Сумма: 871 7888	
Вес: 78.8875	Вес: 2.9013	Вес: 81.7888			

Комментарий:   
Проверить Удалить ОК Отмена

Редактирование пула

Способ подачи: В торговую систему На внебиржу  
Направление: Покупка Продажа

Актив: С позиций UKOH RU0009024277  
Секция: ОТС  
Класс:   
Код расчетов: T0 Пересчитать даты Дата расчетов: 31.01.2017

Валюта цены: RUR Сумма: 32 130 Номинал: 0 RUR  
Валюта расчетов: RUR НКД: 0 Курс: 1  
Комментарий трейдера:   
Комментарий управляющего:   
Цена: рыночная 3 213

Количество: 10  
% от СЧА:   
Повысить/понизить долю до % На все средства

Айсберг-заявка  
Видное количество: % от количества 10  
Максимальное количество: 270.027700

Округление: Сохранение суммы Режим:   
Тип заявки: Лимитированное Срок поручения: Без указания срока  
с 0:00:00 по 0:00:00

Счет: Субсчет Аналитический Портфель 1

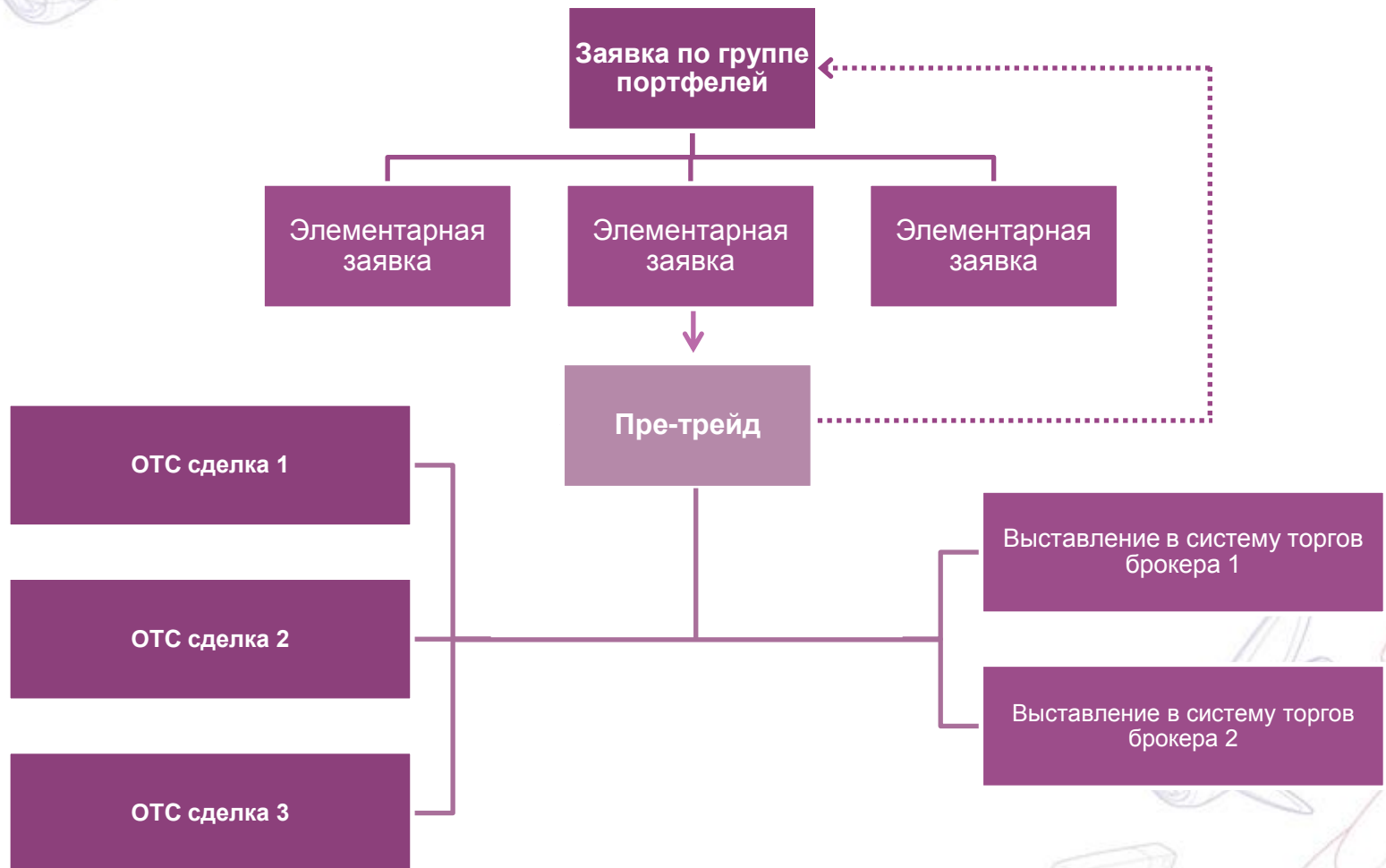
Торговый счет:   
Плановая дата платежа: 31.01.2017 Плановая дата поставки: 31.01.2017

Адресная  
Контрагент: Контрагент/Контрагент Контрагент  
Вид расчетов: NONE Возмещение: 0

Статус: Удовлетворяет ограничения  
Не отправлять на исполнение С внешним подтверждением  
Сохранять разбиение по счетам С подтверждением пользователя

Просмотр Просмотр портфелей Сохранить Исполнить Отмена

# Исполнение групповых заявок



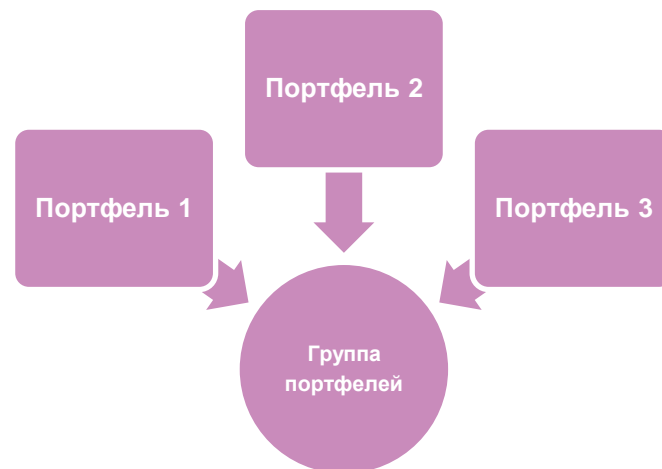


# Ограничения

---

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

# Гибкость настроек ограничений портфелей



## Например:

- Законодательные акты
- Декларации доверительного управляющего

Группа ограничений

## Например:

- Портфели пенсионных накоплений
- Портфели стратегии ИИС

Группа портфелей

# 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

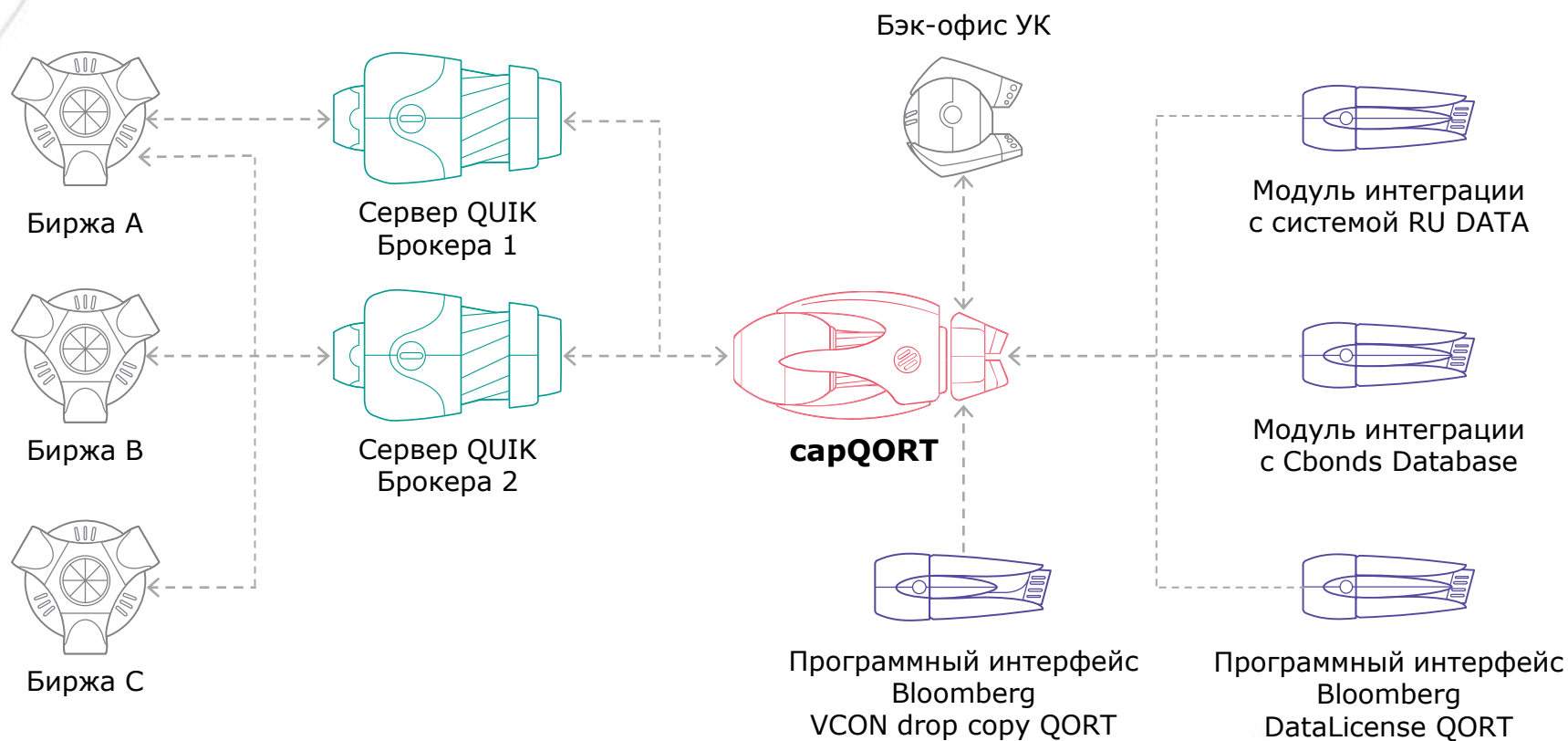
# Группы инструментов

---

- 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

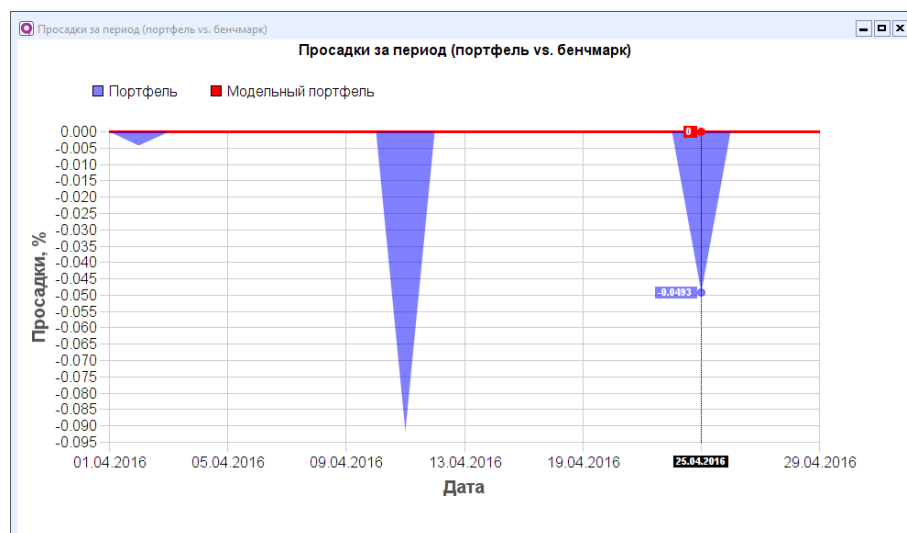


# capQORT в инфраструктуре УК



# 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](mailto:sales@arqatech.com)

## Техническая поддержка

---

**+7 (383) 219-16-99**

[qortsupport@arqatech.com](mailto:qortsupport@arqatech.com)

