

RO.FIX

System zarządzania ryzykiem dla towarzystw funduszy inwestycyjnych

Riskout sp. z o.o.

- Spółka powstała w odpowiedzi na rosnące zapotrzebowanie na wysoko wyspecjalizowane podmioty zajmujące się obsługą instytucji finansowych
- Wykwalifikowana kadra z doświadczeniem zdobywanym w domach maklerskich i towarzystwach funduszach inwestycyjnych
- Doświadczenie z zakresu księgowości, ewidencji papierów wartościowych, emisji obligacji, tworzenia aplikacji w Excelu, zarządzania ryzykiem

Podstawowe funkcje systemu

- **Wczytywanie danych i wycena instrumentów**
 - pobieranie i wgrywanie danych do systemu w oparciu o ogólnodostępne źródła danych (strony GPW, banków centralnych, brokerów)
 - wyliczanie parametrów dla krzywych rentowności i analiz VaR
 - możliwość wgrywania danych w oparciu o serwisy Reuters lub Bloomberg*
 - codzienna automatyczna wycena instrumentów w oparciu o wczytane dane lub według skorygowanej ceny nabycia

* klient musi posiadać dostęp do serwisów we własnym zakresie

Podstawowe funkcje systemu

- **Księgowanie kosztów**

- księgowanie kosztów na podstawie zdefiniowanego preliminarza oraz urealnianie kosztów na podstawie faktur
- dla kosztów limitowanych księgowanie refundacji tych kosztów przez towarzystwo na rzecz funduszu
- elastycznie księgowanie kosztów w oparciu o ręcznie zdefiniowane parametry ich naliczania

Podstawowe funkcje systemu

- Ewidencja lokat środków pieniężnych
 - zakładanie lokat w oparciu o salda środków pieniężnych funduszu
 - możliwość zakładania lokat o dowolnym horyzoncie czasowym
 - osobne zdarzenia dla zakładania lokat, naliczania należnych odsetek oraz rozliczania lokat z wyciągami bankowymi

Podstawowe funkcje systemu

- **Raporty ryzyka i portfela**
 - wygodne raportowanie i przeglądanie jednym kliknięciem
 - możliwość zapisu wygenerowanych raportów w Excelu i w systemie
 - możliwość komentowania raportów, jak i poszczególnych jego pozycji
 - tworzenie raportu za okres na podstawie raportów zapisanych w systemie

Podstawowe funkcje systemu

- **Całkowita ekspozycja i limity inwestycyjne**
 - łatwe definiowanie limitów wynikających z przepisów prawa, a także z indywidualnych strategii poszczególnych funduszy
 - analiza na poziomie przekroczeń, ostrożnościowa, jak również pełna informacja o wykorzystaniu każdego z limitów
 - dane kwotowe i procentowe, ze wskazaniem podstawy każdego limitu

Podstawowe funkcje systemu

- **Analiza Value-at-Risk**
 - tworzenie klas i czynników ryzyka oraz przypisywanie ich do poszczególnych instrumentów w modelu CAPM
 - Analiza VaR dla poszczególnych czynników ryzyka, sumaryczna dla klas, jak również dekompozycja dla pojedynczych instrumentów
 - wyliczanie historycznych parametrów i tworzenie symulacji zmian VaR

Podstawowe funkcje systemu

- **Luka i projekcja płynności**
 - wyliczanie luki płynności w dowolnie zdefiniowanych horyzontach czasowych
 - uwzględnianie przeterminowanych przepływów dodatnich oraz wyliczanie luki z ich uwzględnieniem, jak i bez uwzględniania
 - wyliczanie projekcji płynności portfela dla instrumentów notowanych na rynkach finansowych z uwzględnieniem poziomu ich płynności

Podstawowe funkcje systemu

- **Raporty portfela**

- przeglądanie bieżącego i historycznego stanu portfela
- dane dotyczące bieżących wycen, cen nabycia, wyniku na pozycji, udziału pozycji w portfelu
- dane w podziale na pojedyncze instrumenty, zbiorczo według rodzaju instrumentu oraz zbiorczo według emitenta

Dodatkowe funkcje systemu

- **Zlecenia i transakcje**

- rejestr transakcji prowadzony zgodnie z przepisami rozporządzenia
- podział na zlecenia oczekujące na realizację, zrealizowane i anulowane
- zlecenia gotówkowe, jak i sell-buy-back oraz buy-sell-back
- składanie, realizowanie i anulowanie zleceń z uwzględnieniem źródła decyzji inwestycyjnej, osoby odpowiedzialnej oraz składającej zlecenie

Dodatkowe funkcje systemu

- Zarządzanie podmiotami
 - ewidencja podmiotów współpracujących z funduszami
 - podział na funkcje (np. depozytariusz, uczestnik funduszu, zarządzający, agent transferowy, bank, broker itp.)
 - przechowywanie podstawowych danych (nazwa, adres, NIP, regon) jak również innych (adresy korespondencyjne, dane rejestrowe, rachunki)

Dodatkowe funkcje systemu

- **Rozbudowany plan kont**
 - rachunkowość prowadzona w oparciu o konta księgi głównej, jak i dowolnie definiowane księgi pomocnicze
 - przeglądanie sald i definiowanie parametrów dla dowolnie wybranych kont
 - moduł rozrachunki umożliwiający weryfikację danych zaksięgowanych w systemie z danymi zaksięgowanymi bezpośrednio z wyciągów bankowych

Dodatkowe funkcje systemu

- **Pełna księgowość**
 - księgowania na kontach księgi głównej, jak i ksiąg pomocniczych
 - brak możliwości usunięcia operacji z systemu - zaksięgowana pozycja musi zostać wyksięgowana przez odwrotną operację (storno)
 - przeglądanie sald i definiowanie parametrów dla dowolnych kont
 - możliwość automatyzacji księgowania oraz łączenia wielu dekretów księgowych w jedną całość za pomocą dokumentów księgowych

Podstawowe funkcje systemu

- **Ewidencja instrumentów finansowych**
 - tworzenie i ewidencja instrumentów w oparciu o rodzaje, definiowanie ich parametrów i łączenie instrumentów z rynkami
 - kontrola poprawności wprowadzonych danych dotyczących instrumentu ze zdefiniowanymi parametrami
 - automatyczne wyliczanie przepływów pieniężnych dla instrumentów

Architektura systemu



Aplikacja kliencka
MS Excel lub strona www*

Zapytanie



Baza danych
lokalna lub zdalna

Wyniki



Dlaczego MS Excel?

- Akceptowalny i powszechnie używany program
- Łatwość dostosowania do różnych wersji pakietu Office
- Prostota obsługi
- Możliwość dowolnego przetwarzania otrzymanych wyników bez konieczności importowania danych z systemów zewnętrznych
- Obsługa różnych formatów (.pdf, .txt., .csv)

Dlaczego MS SQL Server?

- Bardzo wydajny, stabilny i technologicznie dojrzały produkt
- Wysoki poziom zabezpieczeń
- Możliwość jednoczesnej pracy wielu klientów
- Skalowalność do potrzeb klienta
- Elastyczność w zarządzaniu dostęпами do funkcji
- Rozbudowany system ewidencji wykonywanych operacji