

SIX Financial Information und gd inside

Ermittlung und Überwachung von Bewertungskursen.

SIX Financial Information

SIX Financial Information ist eine weltweit führende Anbieterin von erstklassigen Finanzdatendienstleistungen und -lösungen für die Finanz- und Versicherungsbranche, Industrieunternehmen und den Mediensektor. SIX Financial Information beschafft direkt und in Echtzeit Finanzdaten aus weltweit über 1500 Quellen und deckt damit alle wichtigen internationalen Börsenplätze ab. Mit 24 internationalen Geschäftsstellen verknüpft SIX Financial Information die Vorteile lokaler Präsenz mit globaler Abdeckung, um Finanzspezialisten in den Bereichen Anlageberatung, Portfolio Management, Finanzanalyse und Wertschriftenverwaltung ein umfassendes Datenangebot und Know-how zu bieten.

apiD

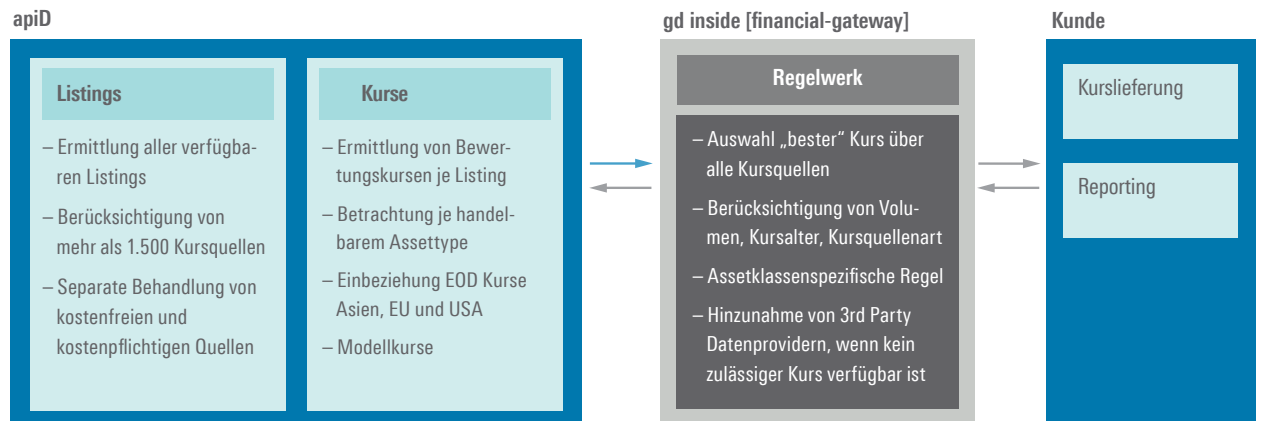
apiD ist eine Programmierschnittstelle zur Gestaltung vielseitiger Lösungen auf Basis der umfassenden Wertpapierdatenbank und Echtzeitkurse von SIX Financial Information. apiD lässt sich in Ihre Internet-, Intranet- und Extranet-Applikationen einbauen, so dass Sie leicht Zugriff auf Quotes, Wirtschaftsberichte und Corporate Actions haben, um nur einige Beispiele zu nennen. Offene technische Schnittstellen für die Datenlieferung und -integration beschleunigen die Entwicklungszyklen um ein Vielfaches. Die Plattform basiert auf Java- und XML-Branchenstandards und lässt sich rasch im Internet, Intranet oder in mobilen Umgebungen implementieren.

gd inside

gd inside fungiert als spezialisierter Dienstleister für alle Fragen rund um das Thema Finanzmarktdatenmanagement: Beratung, Beschaffung, Entwicklung, Integration und Betrieb. Damit schlägt gd inside als fachlicher Übersetzer und technischer Gateway die Brücke zwischen Fachabteilung und IT, Kunde und Dienstleister bzw. zwischen Dienstleister und dem Markt. Das spezialisierte Kernteam von gd inside setzt sich aus Senior Experts mit jeweils über 25-jähriger Berufspraxis in der Finanzbranche und der Entwicklung zusammen. Diese Kompetenz ermöglicht es gd inside Referenz- und Marktdaten fachlich korrekt, transparent sowie performant und technisch flexibel in Systemlandschaften einzubinden und diese Komponenten auch zu betreiben.

financial-gateway

Die Lösungsplattform financial-gateway von gd inside ermöglicht es, ad hoc oder ereignisgesteuert Datenrequests zu stellen. Die Daten werden anschließend über Entscheidungsbäume und detaillierte, produkt- und assetklassenspezifische Regelwerke abgearbeitet und customized an den Kunden ausgeliefert. Financial-gateway basiert auf dem apiD Datenfeed, der es ermöglicht, je nach Instrumententyp assetklassenspezifische Daten für alle verfügbaren Quellen abzuholen. Diese werden nach Standardregeln und kundenindividuellen Parametervorgaben aufbereitet, ggf. mit 3rd Party Daten angereichert und prozessgesteuert inklusive Reporting bereitgestellt. Die Auslieferung erfolgt mittels ftp/sftp oder WebGUI.



Verbindung zwischen dem Datenangebot von SIX Financial Information und dem gd inside financial-gateway.

Valuation Pricing Solution (VPS) von gd inside und SIX Financial Information

KARBV Anforderungen

In der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung (KARBV) sind die wesentlichen Anforderungen beschrieben, die eine Kapitalverwaltungsgesellschaft bei der Bewertung von Vermögensgegenständen in Sondervermögen zu berücksichtigen hat. Dabei wird unterschieden zwischen der Bewertung mit handelbaren Kursen und der Bewertung mit Verkehrswerten

Valuation Pricing Solution (VPS)

SIX Financial Information sammelt Kursdaten von derzeit ca. 1.500 Kursquellen (Börsen, Kontributoren, Preis-berechnern etc.) und normalisiert diese, sodass die Kurse und deren Kursarten über alle Kursquellen vergleichbar sind. Diese sind, neben der Kursquelle selbst, in der Datenbank von SIX klassifiziert abgelegt und stehen auch für Kunden von reinen (regelwerksfreien) Kurslieferungen zur Verfügung.

Pro Instrument werden alle kundenspezifisch verfügbaren Kurse ermittelt und über ein zentrales Regelwerk je Asset ein marktkonformer Bewertungskurs ausgeliefert. Basis hierfür sind neben fachlichen Aspekten (best practice) die Berücksichtigung von Kursaktualität, Volumen, Liquidität des jeweiligen Handelsplatzes und vordefinierte Prioritätenlisten sowie kundenspezifische Konfigurationen.

Die VPS Bewertungskurslösung hat damit Zugriff auf interne Steuerungselemente (z.B. Best Trading Venues und Marktlevel-Klassifizierungen) sowie auf alle für den Kunden freigeschalteten Kursquellen inkl. bereitgestellter Modellpreise. Kurse von kostenpflichtigen Quellen werden nur abrechnungspflichtig, wenn diese als bester Bewertungskurs in der Kurslieferung ausgegeben werden (Abrechnungsmodelle der kostenpflichtigen Quellen variieren).

Ziel des VPS-Regelwerkes ist die größtmögliche Automatisierung der Kursermittlung nach KARBV bei gleichzeitiger voller Transparenz durch ein laufendes Reporting/Monitoring. Wertpapierspezifische Vorgaben, z.B. auf Wunsch von Investoren oder Mandanten, können durch Vorgabe einer zu verwendenden Kursquelle durch den Kunden das Regelwerk pro Asset übersteuern. Der nachgeschaltete Usage-Report ermöglicht eine nutzerbasierte Abrechnung und vermeidet eine unnötige Bevorratung von Daten.

Der Betrieb der Lösung erfolgt auf einer voll automatisierten Plattform mit Back-up-Server und Monitoring. Die Zuspiegelung von eigenen Daten bzw. 3rd party Daten ist möglich und wird täglich im Report mit ausgewiesen. Für Up- und Download-Funktionen wird eine grafische Benutzeroberfläche bereitgestellt.

Funktionalitäten:

- Tägliche Ermittlung eines aktuellen, marktkonformen Bewertungskurses je Asset
- Verwendung von Kursen aus 1.500 Quellen unter Berücksichtigung von Kursaktualität, Volumen und Liquidität
- Instrumentenklassenspezifisches und transparentes Regelwerk
- Mögliche Einbindung von Modellpreisen und lizenzpflichtigen Preisen sowie externen Quellen/Providern
- Übersteuerungsmöglichkeit (Vorgabe einer fixen Kursquelle je Asset) bzw. Steuerung über Quellen-Priorisierungen
- Reporting aller zur Verfügung stehenden sowie ausgelieferten Quellen

Ihre Vorteile:

- Klar definierte Prozesse und spezifische Regelwerke ermöglichen eine hohe Automatisierung bei gleichzeitig voller Transparenz im Falle von Audits
- Zugriff auf die umfangreiche SIX Datenbank (inkl. lizenzpflichtiger Quellen und Modellpreise)
- Erübrigt eine eigene, aufwändige Datenhaltung
- Nutzungsgenaue Abrechnung auch bei Einsatz von Modellpreisen
- Einbindung weiterer Quellen/Vendoren ermöglicht größtmögliche Flexibilität
- Projektrisiko, manuelle Aufwände und operationelle Risiken im laufenden Betrieb werden durch kundenindividuelle Überwachungsprozesse gesenkt

Bei Fragen wenden Sie sich einfach an das Verkaufsteam von SIX Financial Information. Wir helfen Ihnen gerne weiter.

SIX Financial Information
Deutschland GmbH
Theodor-Heuss-Allee 108
D-60486 Frankfurt am Main

T + 49 69 717 0
sales.de@six-financial-information.com
www.six-financial-information.com

gd inside GmbH
Theodor-Heuss-Strasse 6
D-63533 Mainhausen
Deutschland

T +49 700 843 625 328
info@gd-inside.de
www.gd-inside.de