

Post Trade Processing

Bruggererfaringer ved BLS Capital

Agenda

Post Trade Processing modulet – brugererfaringer

- Indlægsholdere
- Lidt om historikken, processen og modulet
- Brugererfaringer ved BLS Capital med modulet
 - Præsentation
 - Live demo
- Spørgsmål & kommentarer

Hvem er jeg?



Henrik Bach

Business System Consultant

Post Trade Processing

Lidt om historikken

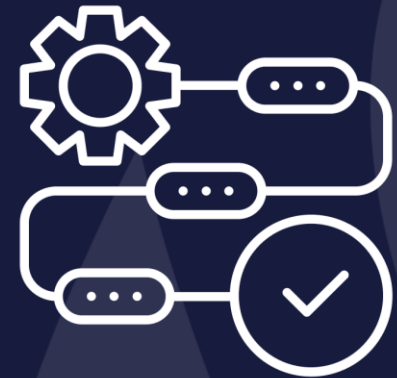
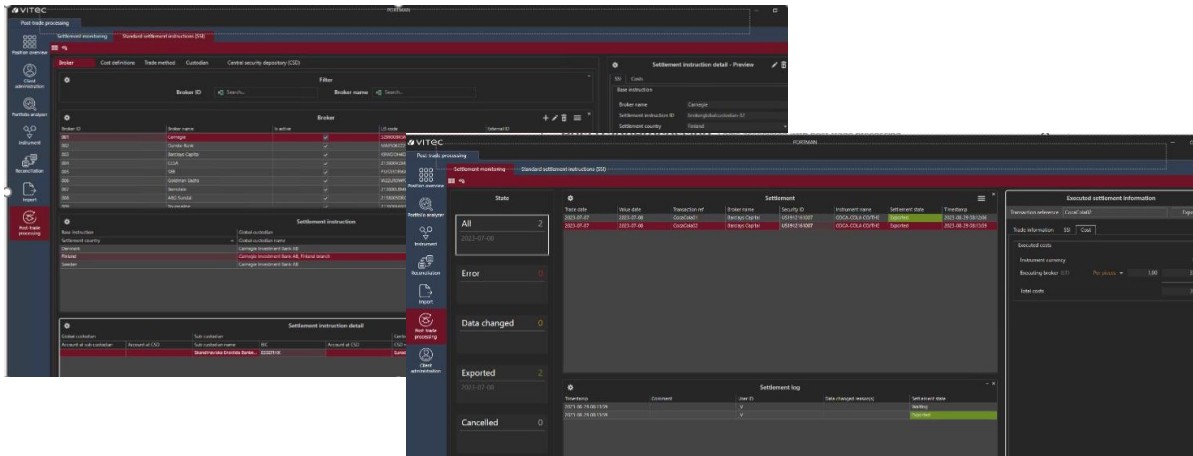
- Fra tanker på en PP til brugerfaringer med modul



Post Trade Processing

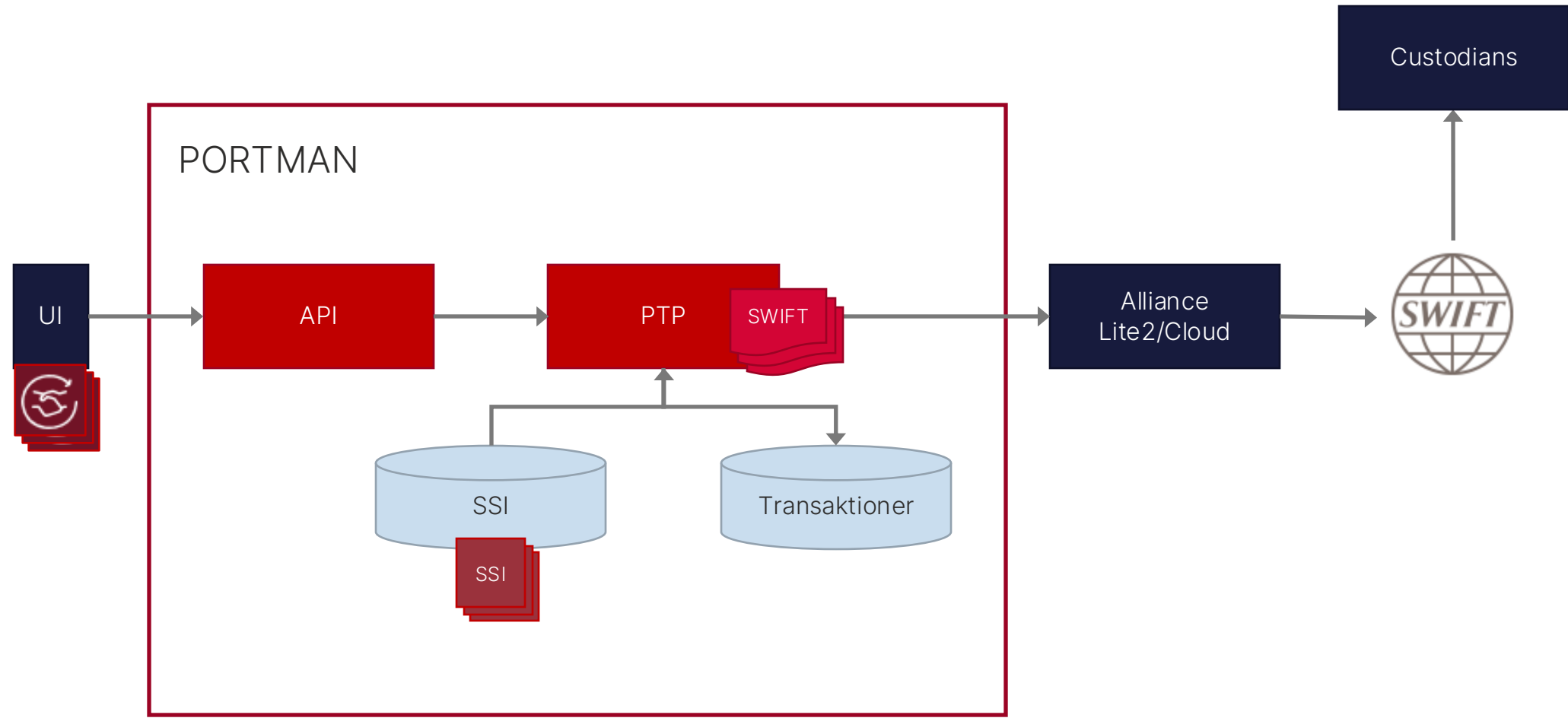
Modulet

- Værktøjet i PORTMAN til at håndtere afviklingsprocessen og fremsendelse af instruktioner til depotbankerne
 - SSI sæt – omkostninger – overblik over flowet
 - Fremstilling af transaktionen
 - Fremstilling af SWIFT - MT 541 / MT 543



Post Trade Processing

Processen



Hvem er vi?



Jacob Brinch Kristensen
Middle Office Analyst

Klavs Holten
Chief Operating Officer

Lidt om BLS Capital

Ital

- Grundlagt 2008
- 25 ansatte
- Investeringsunivers
 - 2 long-only aktie strategier
 - 18 porteføljer
 - 35-40 aktier
 - 8 markeder
 - 5 valutaer
 - 5 depotbanker
- Handelsomfang
 - 2.300 blokke / 10.000 allokeringer

The logo for BLS Capital is displayed in white text on a dark blue background. The letters 'BLS' are in a large, bold, serif font, with three horizontal lines above each letter. Below 'BLS', the word 'CAPITAL' is written in a smaller, all-caps, sans-serif font. The background features a large, faint, light blue circular graphic element.

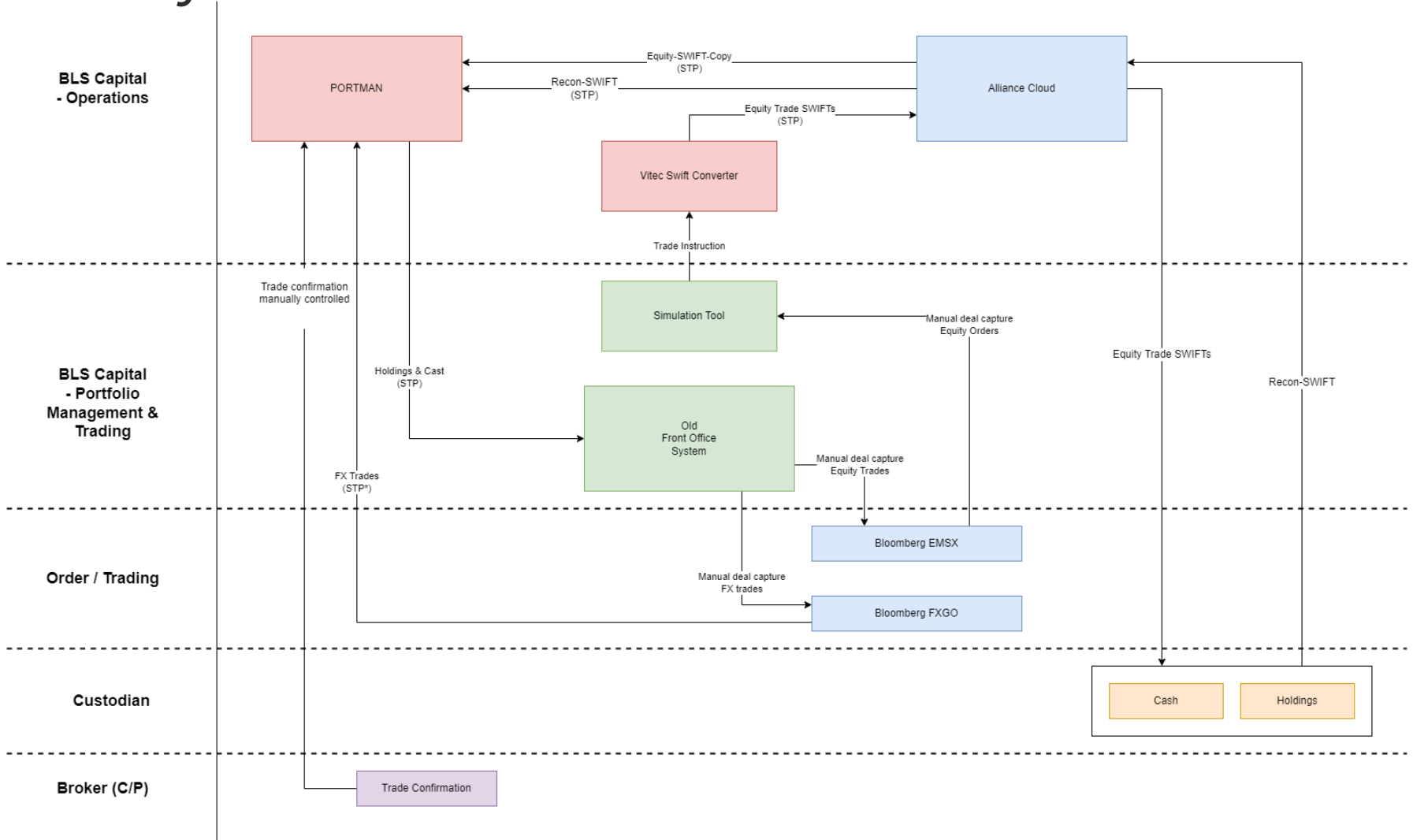
Post Trade Processing

Interessen for modulet

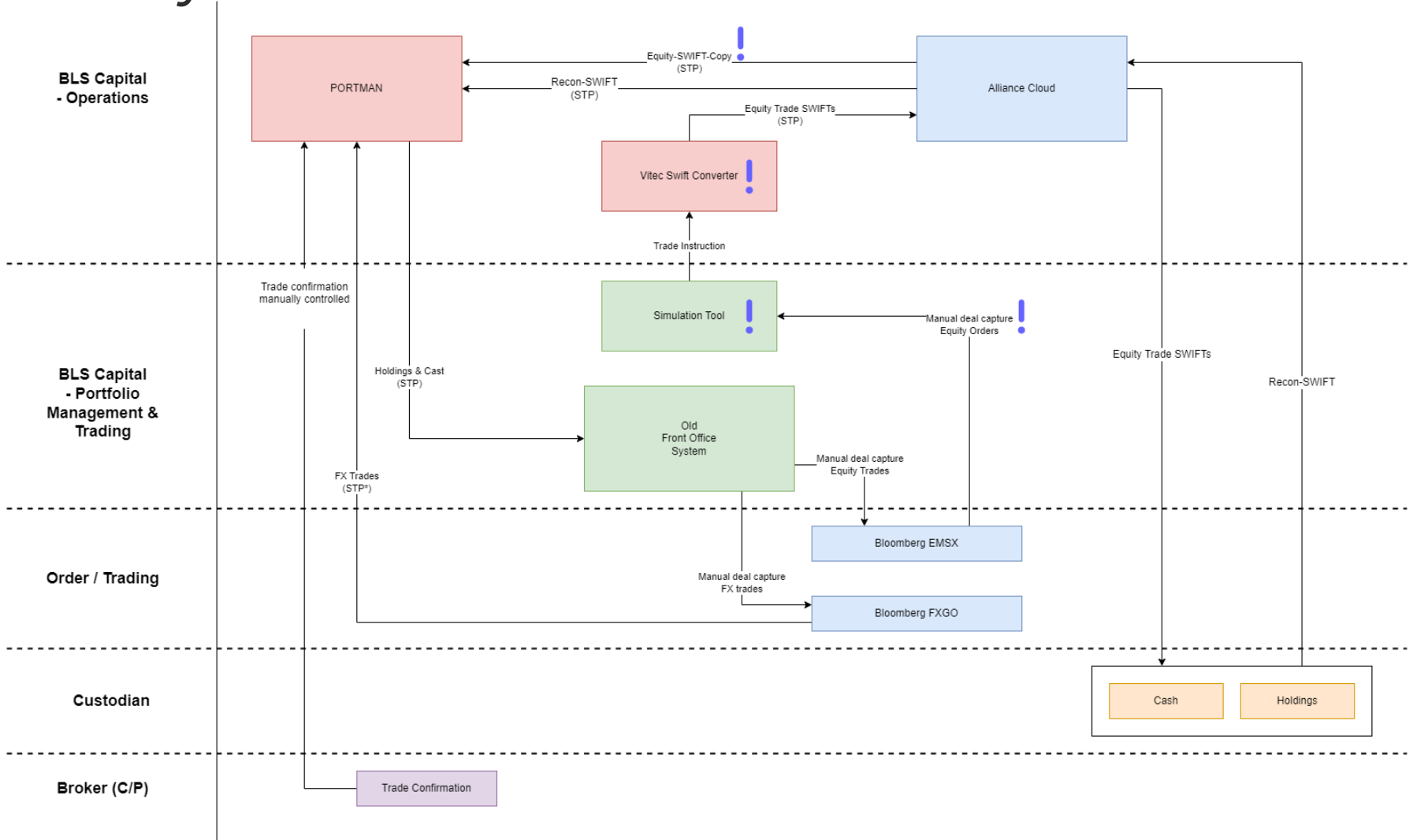
- Komplekst systemlandskab
 - Mange bevægelige dele
 - Manuelle processer
 - Komplex fejlsøgning/-håndtering
- Ønsket om et mere simpelt og automatiseret flow
 - Reducere manuelle processer
 - Reducere tekniske fejlkilder
 - In-sourcing af handelsflow



Gammelt systemlandskab



Gammelt systemlandskab



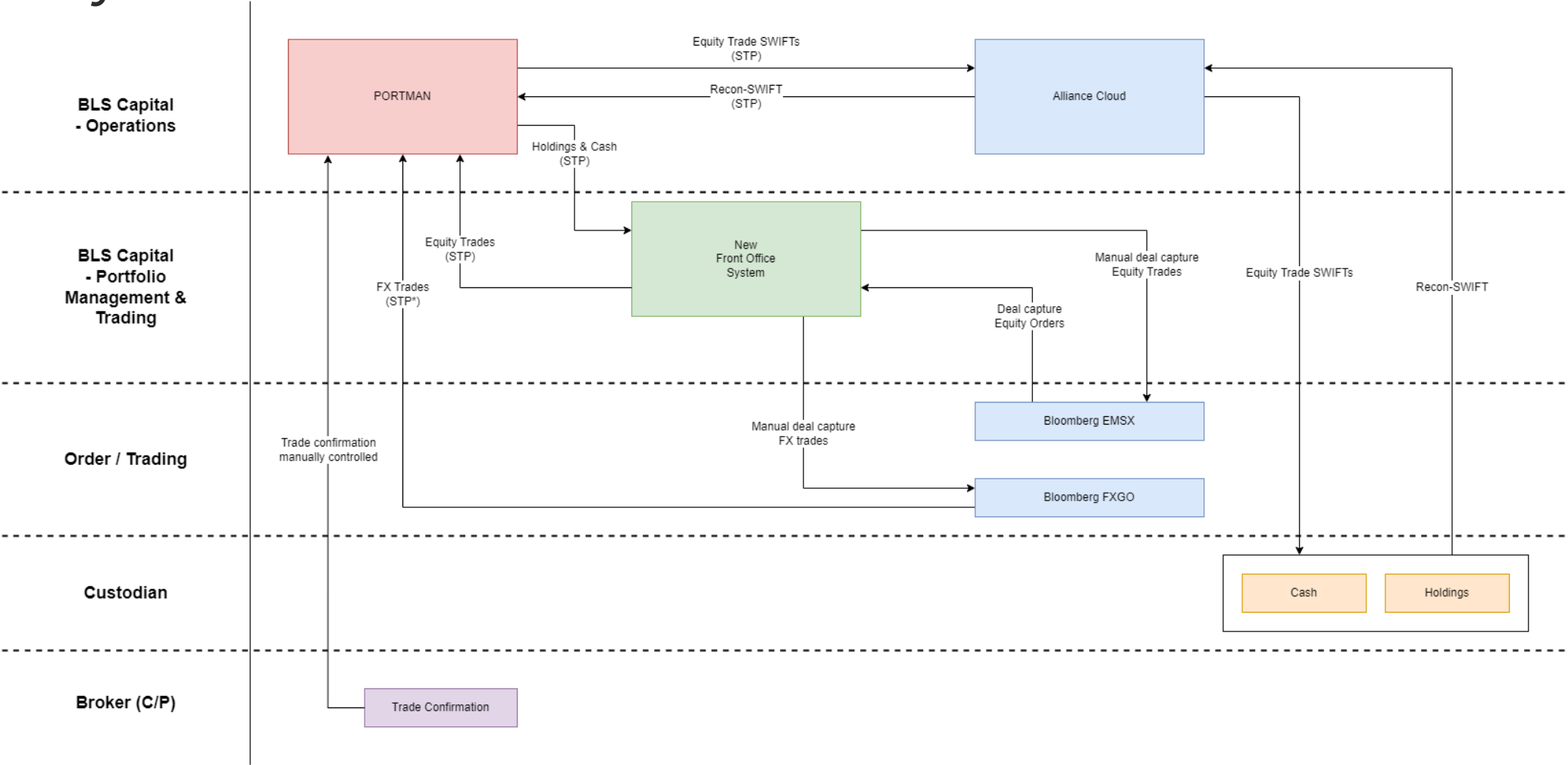
Gammelt systemlandskab

Hvordan kunne PTP hjælpe os?

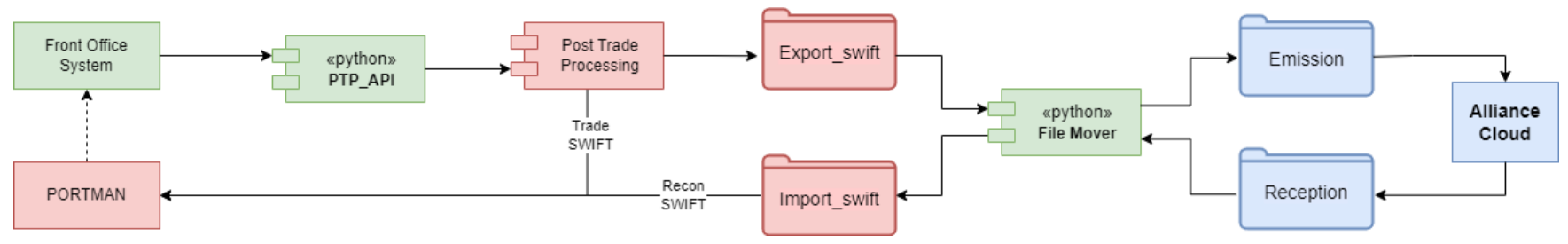
- Equity-SWIFT-Copy
 - Handler indlæses direkte i PORTMAN
 - Undgår kopi-SWIFT'er
- Vitec Swift Converter
 - Erstattet af integreret PTP-modul
 - Fjerner ekstern service
- SSI register
 - Fuldt integreret i PORTMAN



Nyt systemlandskab – med PTP



Handelsflowet – med PTP



- Fuldt automatiseret efter Front Office system
 - Få sekunder fra Allokering til handel i PORTMAN
- To ikke-standard komponenter
 - Script til PTP-API'et
 - Script til at flytte SWIFT'er til og fra PORTMAN

Live demo

Implementering af PTP

Gode erfaringer

- Beta-version
 - Adgang nogle måneder før frigivelse til Live
 - God dialog med Vitec
- Systemlandskab og operationelt flow
 - Reduceret risiko og færre fejlkilder
- Integreret SSI register
- 3402-erklæring
 - Positiv feedback fra revisorer

