

Udvidet Positionsstyring i IDEAS

Hvem er jeg?



Lars Bech Larsen

Service Delivery Manager

Positionsstyring

Fordele

- Et positionstræ
 - Giver et bedre overblik
- Mulighed for
 - Én arbejdsproces eller flow ➔ én positionsbog
 - Nemmere afstemning
 - Konsolidering
 - Styring af lines
 - Funktionsadskillelse

Positionsstyring

Positionstræ i flere niveauer

- Anlægsbeholdninger i EUR og USD
- Handelsbeholdninger i DKK
- Spekulative beholdninger
- CEO Invest

Forskellige positionstyper

Profit/loss: ikke blande valutaer

Standard		
Position Name	Currency	Position Type
Anlæg EURO - Anlæg i EURO		
Anlæg NEURO	EUR	Limited
Anlæg PIIGS	EUR	Limited
Anlæg USD - Anlæg i USD		
Anlæg USD	USD	Standard
CEO Invest - Direktør Investorer		
CEO Norden	DKK	Limited
CEO Europa	DKK	Limited
CEO USA	DKK	Limited
CEO Obligationer	DKK	Limited
Handel - Handelsafd.		
Aktier	DKK	Standard
Realer	DKK	Standard
Stater	DKK	Standard
UFonds Europa	DKK	Standard
UFonds Amerika	DKK	Standard
UFonds Asien	DKK	Standard
Spekulativt EUR - Spekulativt EUR		
Spekulativt EUR	EUR	DayTrade
Spekulativt USA - Spekulativt USA		
Spekulativt USA	USD	DayTrade

Konsoliderede positionsbøger

2 beholdninger giver bedre overblik!

Amerika

Europa

Alt opgjort i DKK

Konsoliderede positioner (G)	
Standard	
Comment	
☐	Konsolideret Amerika
☐	UF Amerika
☐	CEO USA
☐	Spekulativt USA
☐	Konsolideret Europa
☐	UF Europa
☐	Anlæg NEURO
☐	Anlæg PIIGS
☐	Spekulativt EUR
☐	CEO Europa

Konsoliderede positionsbøger

Overvejelser

- Opgørelse af samlet eksponering i volume
- Opgørelse i samme valuta
 - Uanset positionsbogens valuta
- Samme aktivtype

Positionsstyring

Primo-positioner

- Hvor har vi golden source ?
- Overnattende positioner i IDEAS
- Indlæsning via API
- Indlæsning fra Backoffice
- Indlæsning via XML-filer

Positionsstyring

Opdateringer

- Ved handel
 - På markedet
 - Internt
- Portefølje-flyt
- Backoffice leverer
- Justering via API'et

Positionsstyring

Traditionelt overblik


pos::position(pos::positiontask) US3453708600 Ford Motors (Alm. overblik)

Standard

Actions

Name Long	Currency	Position Name	Calc Currency	Position	Position Type
Ford Motors	 USD	UFonds Amerika	 DKK	388,00	Standard
Ford Motors	 USD	CEO USA	 DKK	12.450,00	Limited
Ford Motors	 USD	Spekulativt USA	 USD	-2.950,00	DayTrade


pos::position(pos::positiontask) DE000PAG9113 P911 (Alm. overblik)

Standard

Actions

Name Long	Currency	Position Name	Calc Currency	Position	Position Type
P911	 EUR	UFonds Europa	 DKK	-117,00	Standard
P911	 EUR	Anlæg NEURO	 EUR	2.500,00	Limited
P911	 EUR	Spekulativt EUR	 EUR	-997,00	DayTrade

Konsoliderede positionsbøger

Konsolideret overblik!

pos::position(pos::positiontask) US3453708600 Ford Motors (Konsolideret overblik, Q)					
Standard Actions					
Name Long	Currency	Position Name	Calc Currency	Position	Position Type
Ford Motors	 USD	Cons Amerika	 DKK	9.888,00	Consolidated

pos::position(pos::positiontask) DE000PAG9113 P911 (Konsolideret overblik, Q)					
Standard Actions					
Name Long	Currency	Position Name	Calc Currency	Position	Position Type
P911	 EUR	Cons Europa	 DKK	1.386,00	Consolidated

Positionsstyring

Eksponering i valuta

- Opgørelse af samlet eksponering per valuta

 Positioner (Consolidated)	
Standard Actions	
Name Long	Market Val 
+ Currency : EUR	1.375.643,32
+ Currency : USD	123.204,48

Positionsstyring

Settlement Positions

- Opgørelse af position per valørdato

pos::settlementposition(pos::positiontask) Realer 35NYKI A44 BB (G)				
Standard Actions				
ISIN	Currency	TradeDate	SettlDate	SettlPos
DK0009788333	DKK	15-09-2023	19-09-2023	51.000.000,00
DK0009788333	DKK	15-09-2023	26-10-2023	64.000.000,00
DK0009788333	DKK	15-09-2023	30-10-2023	3.000.000,00
DK0009788333	DKK	15-09-2023	31-10-2023	36.000.000,00
DK0009788333	DKK	15-09-2023	20-11-2023	-31.000.000,00

Positionsstyring

Linestyring

- Er det interessant at have i IDEAS?
- I DKK og i valutakoder?
- Per positionsbog?
- Per aktivtype?
- Andet?

Positionsstyring

Funktionsadskillelse

- Visning begrænset til bestemt funktion
 - Treasury
 - Sales Dealer
 - Market Maker
 - Andet?
- Bogføring?
- Position Type

Positionsstyring

Opsamling

- Positionstræ
 - Valg af opgørelsesvaluta
 - Position Type
- Konsoliderede positionsbøger
- Primo-positioner
- Opdatering af positioner
- Bedre overblik med konsoliderede positionsbøger!
- Eksponering i valuta
- Settlement Positions

Positionsstyring

Er disse emner interessante?

☐ Linestyling?

☐ Funktionsadskillelse?

☐ Andet?

- Tag fat i Lars

Spørgsmål & kommentarer

