

# Fund of Funds

# Hvem er jeg?



Peer Larsen

Product Owner – Team Integrations

# Agenda

## Fund of funds (FoF)

### Hvad bruges FoF til?

- Præsentation af forretningsdomænet, dvs. FoF struktur

### Hvad kan man i PORTMAN med FoF?

- Organisering af FoF strukturen
- Registrering af transaktioner
- FoF X-ray
- NAV beregninger

### Hvorfor modernisering af FoF i PORTMAN?

- Inspiration fra kunder og samarbejdspartner bl.a. Lægernes Pension & Bank, TRYG og CMP
- Begrænsninger i den eksisterende IT understøttelse
- Effektivisering af betalinger
- Facilitering af STP, dvs. API

# Fund of funds

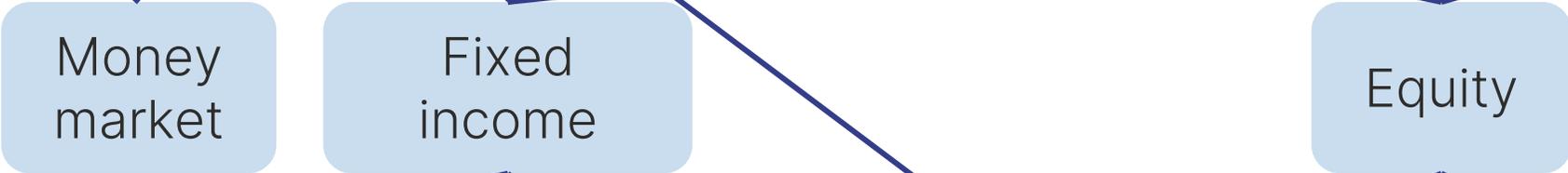
Struktur



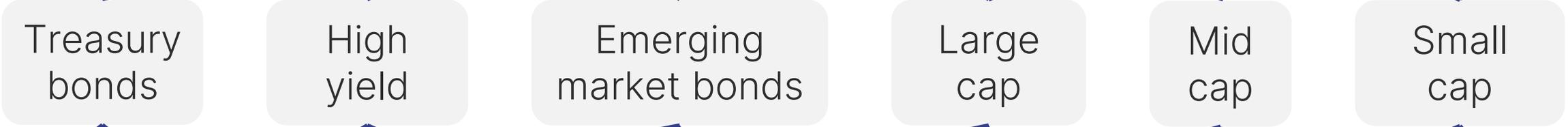
Risc profile



Class



Quality



Market



# Agenda - modernisering

## Fund of Funds modernisering

### Effektivisering af betalinger

- Ind- og udbetalinger til strukturen
- Udbetalinger fra fond
- Rebalancering

### Strategisk Asset Allocation

- Forslag til rebalancering

### Valutaer

- Fonde og betalinger i forskellige valutaer

### Stamdata

- Nyt koncept for fonde

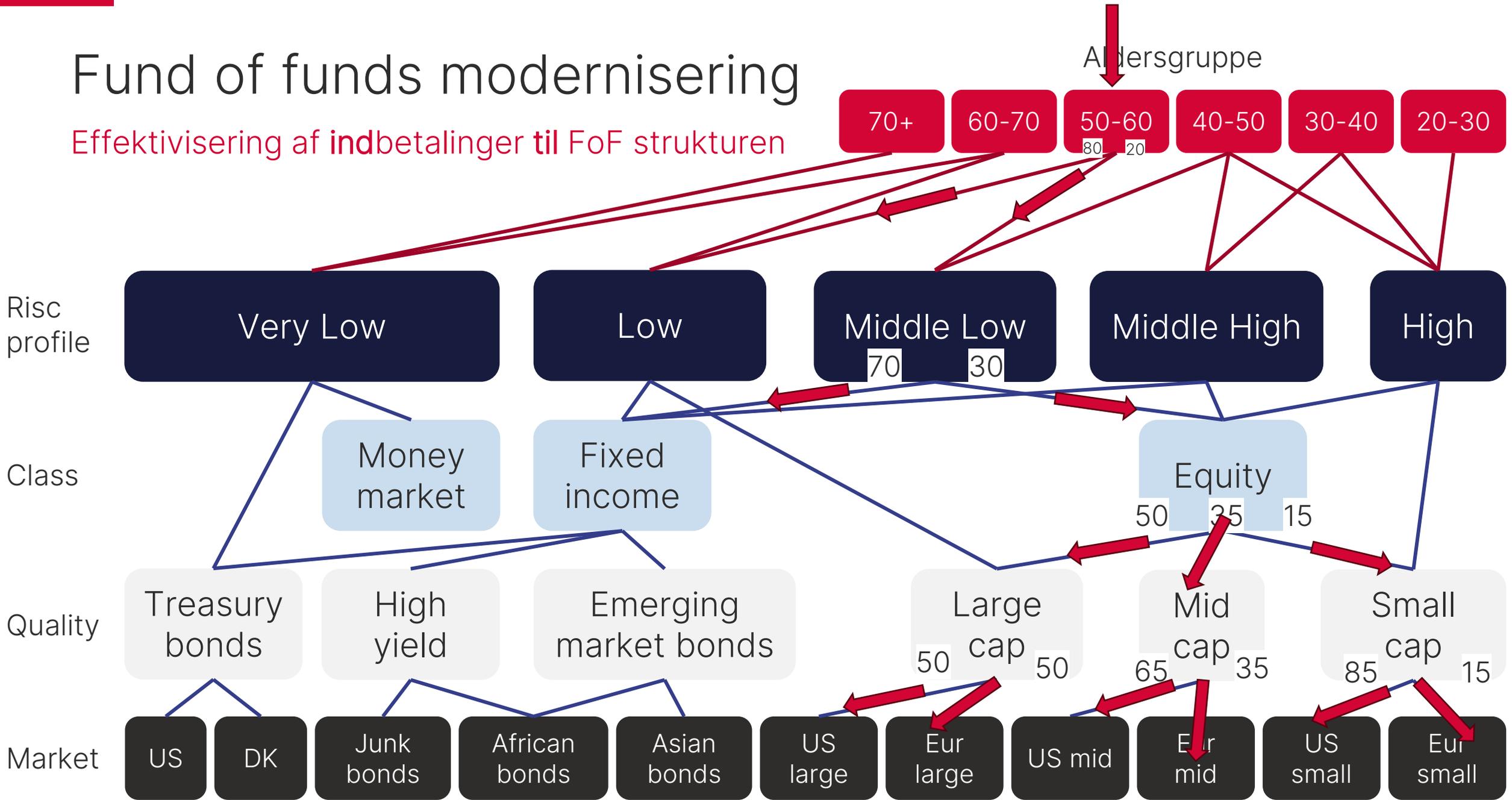
### GUI -> API

- API: Integrationer, STP mv.
- GUI: Overblik og mulighed for indgriben



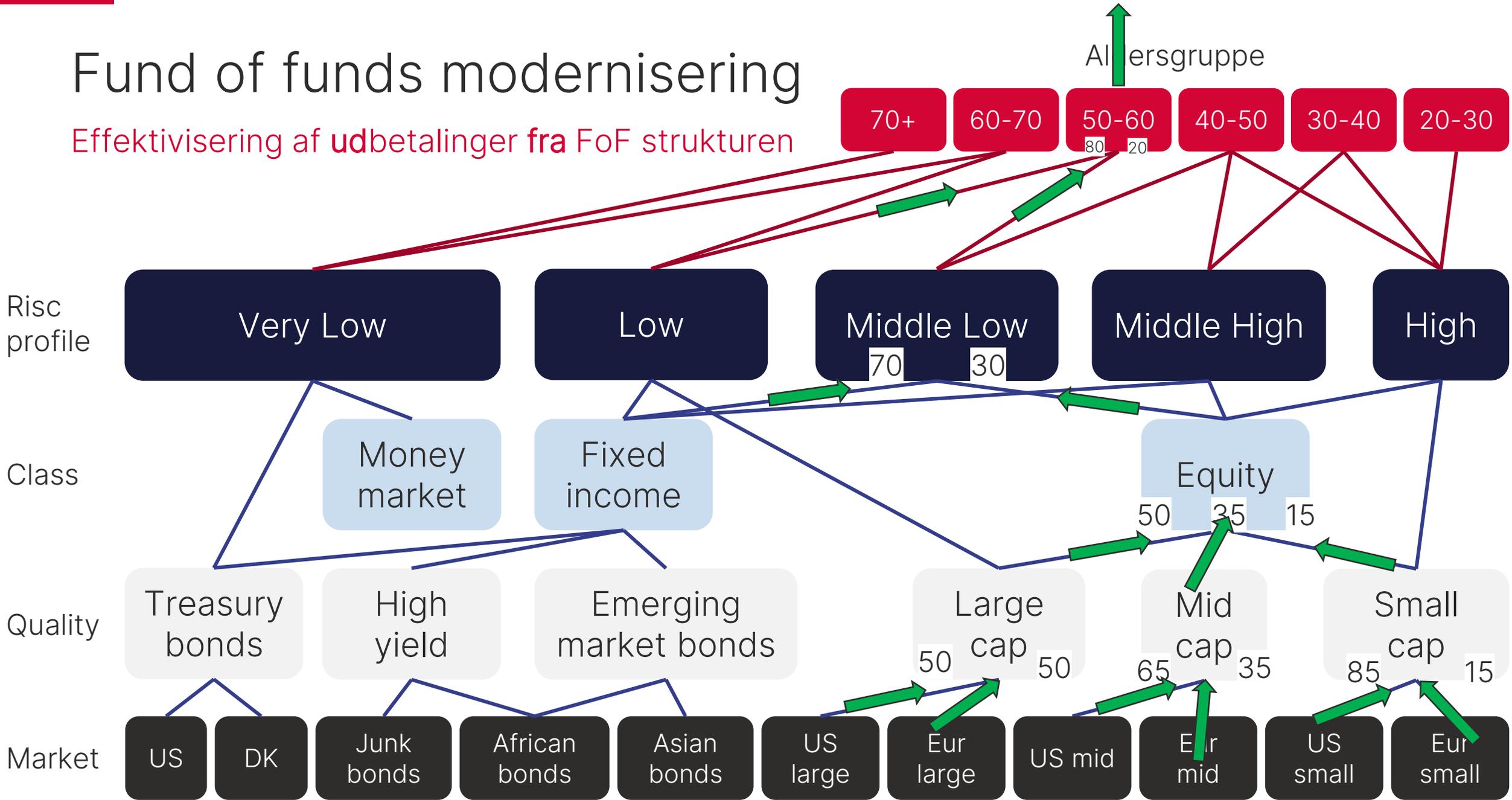
# Fund of funds modernisering

Effektivisering af indbetalinger til FoF strukturen



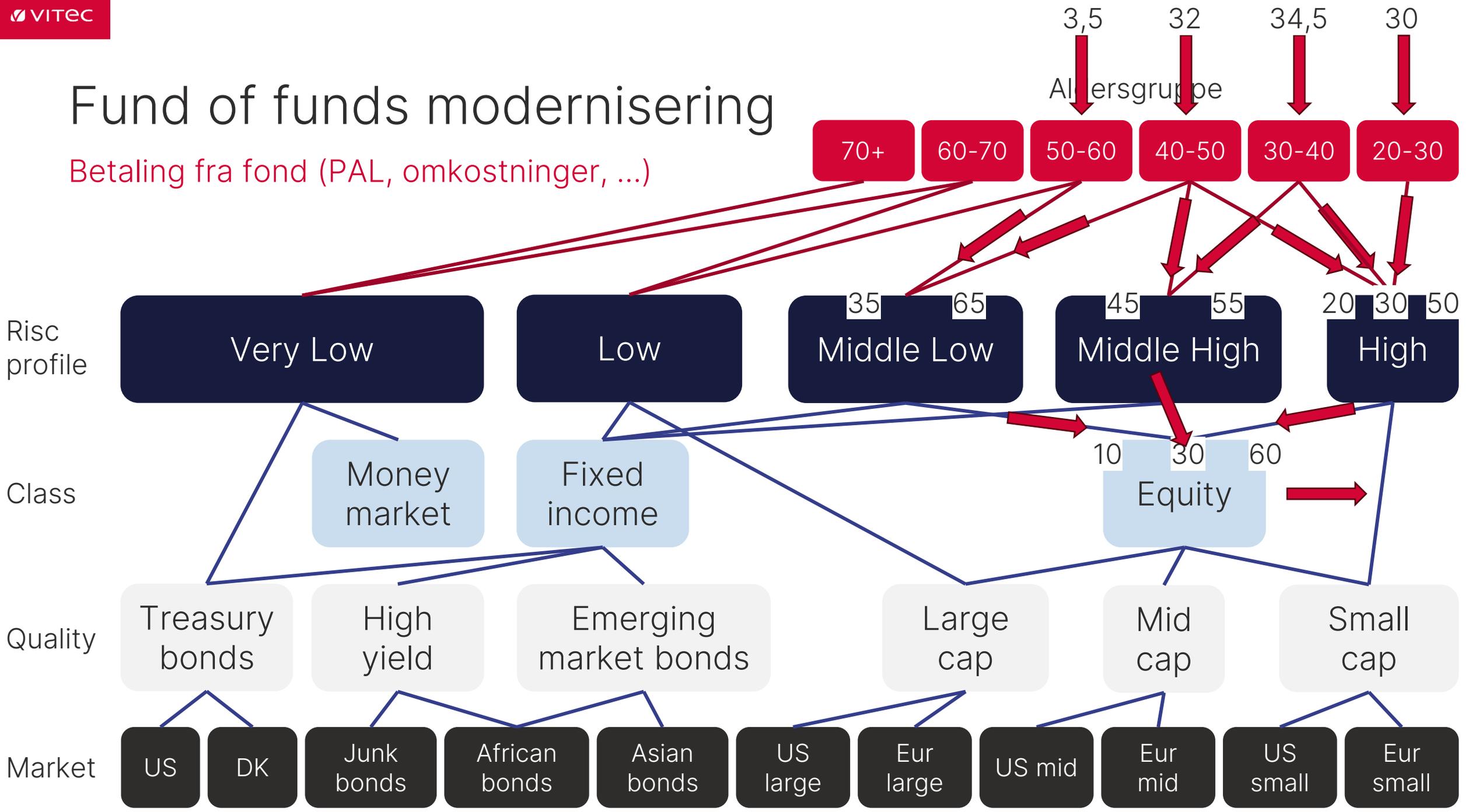
# Fund of funds modernisering

Effektivisering af udbetalinger fra FoF strukturer



# Fund of funds modernisering

Betaling fra fond (PAL, omkostninger, ...)



# Fund of funds modernisering

Rebalancing

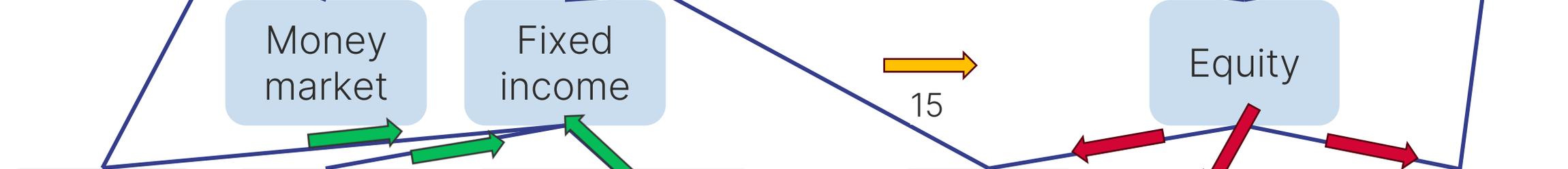
Aldersgruppe

- 70+
- 60-70
- 50-60
- 40-50
- 30-40
- 20-30

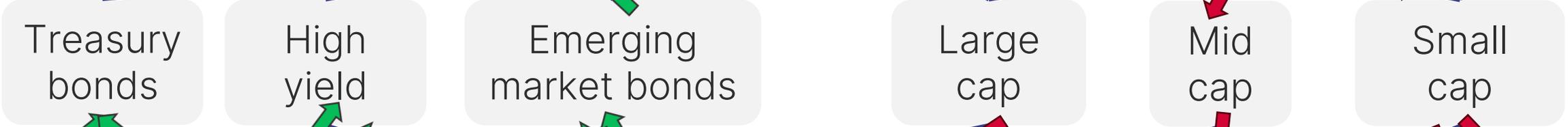
Risc profile



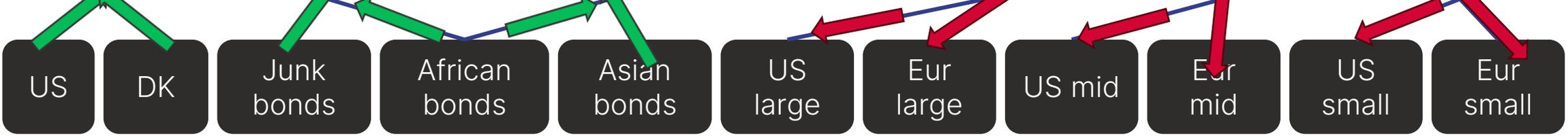
Class



Quality

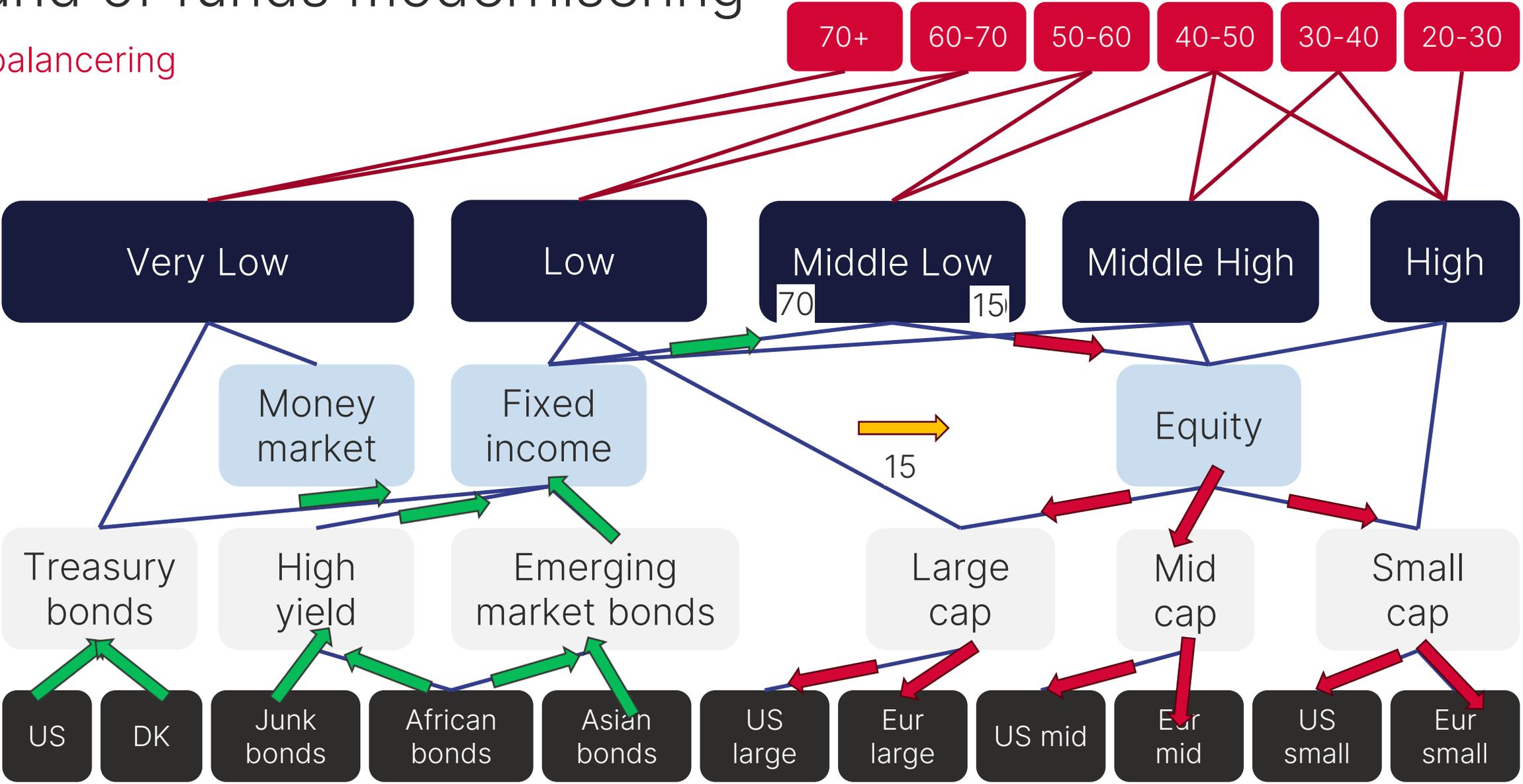


Market



70      15

15



# Fund of funds modernisering

Strategisk Asset Allokering (SAA)

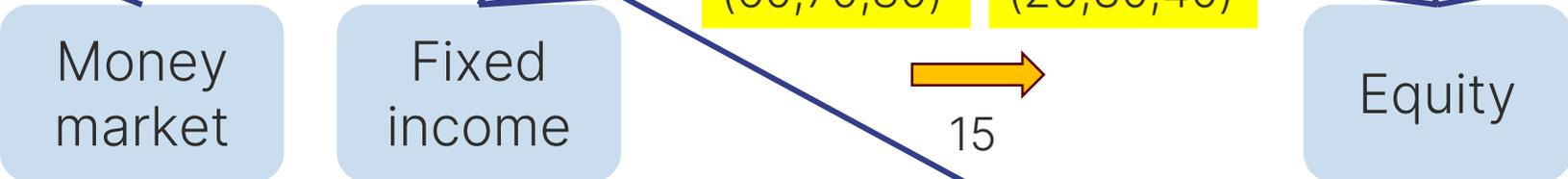
Aldersgruppe

- 70+
- 60-70
- 50-60
- 40-50
- 30-40
- 20-30

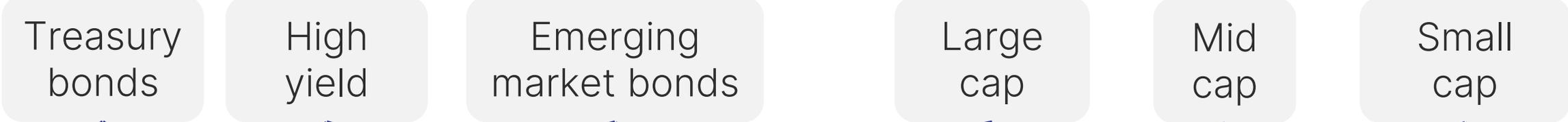
Risc profile



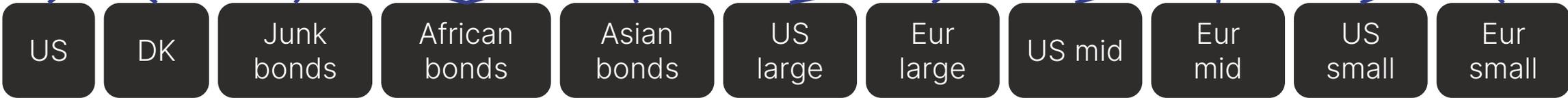
Class



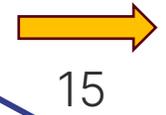
Quality



Market



(60,70,80) (20,30,40)



# Fund of funds modernisering

Betalinger i forskellige valutaer

Aldersgruppe

- 70+
- 60-70
- 50-60
- 40-50
- 30-40
- 20-30

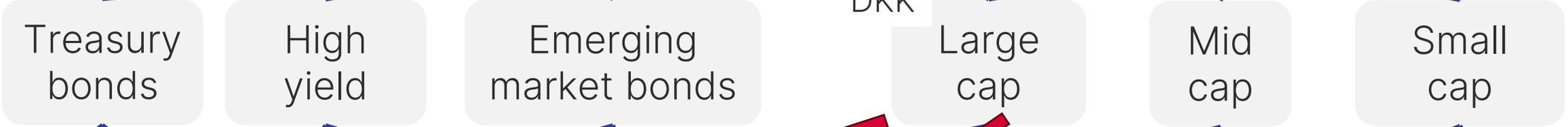
Risc profile



Class



Quality



Market



DKK

SEK

DKK

DKK

USD

EUR

DKK/SEK  
USD/SEK el. DKK?  
EUR/SEK el. DKK?

US large

Eur large

US mid

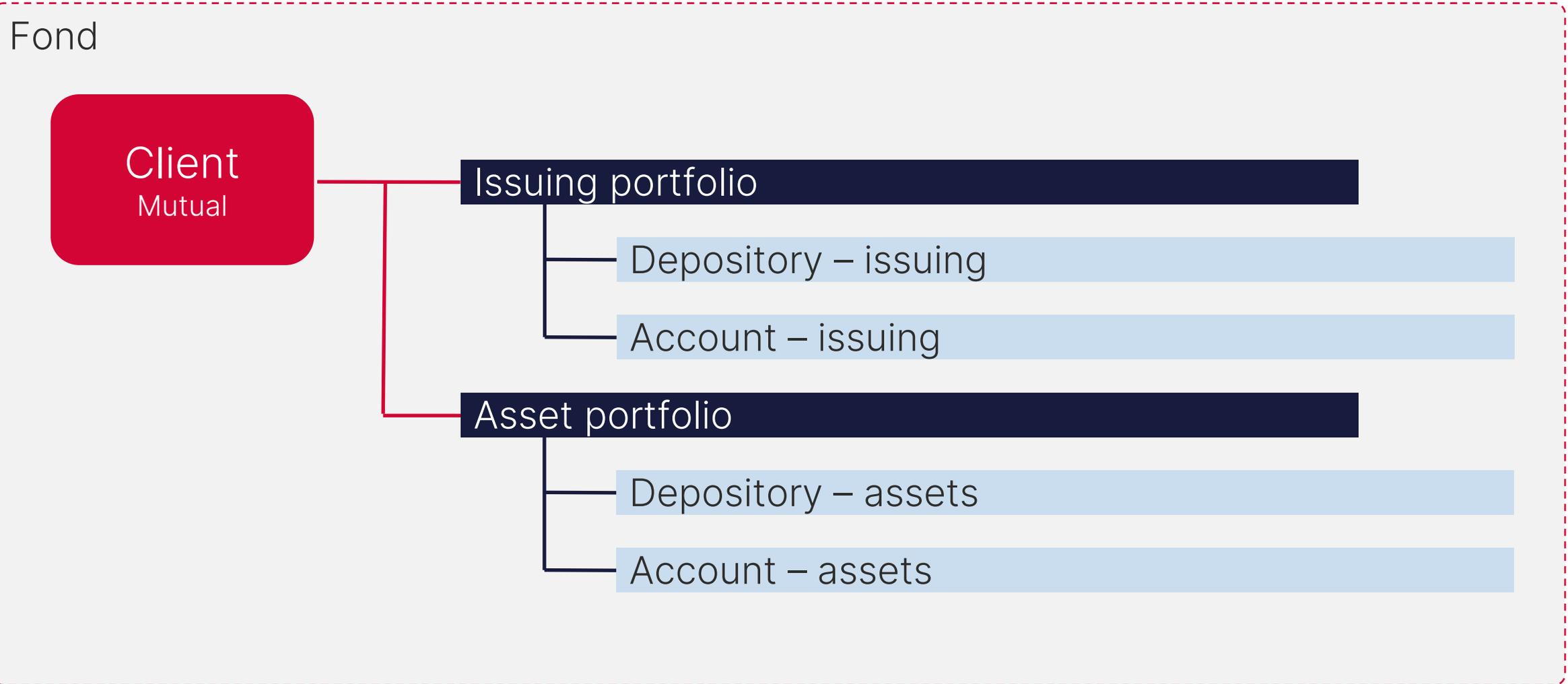
Eur mid

US small

Eur small

# Fund of funds modernisering

Simplificering af fonde



# Fund of funds modernisering

## Simplificering af fonde

The image shows a 'Mutual fund data (Change)' dialog box with the following fields and values:

- ID code: PBU\_FOF\_201 2 - Aktier
- Validity date: 31/12/2024
- Trust type: Other fund
- Type of fund: Share
- Reporting information: To be reported to Fund Collect:
- Calculation of purchase- and ask price: Formula: Method 1
- Round off method buy/redemp.: Closest
- Round off purchase/ask price: 0,01 hundredth curr.
- Round off intrinsic value: No round off

The XML data in the background is as follows:

```
<client>
  <clientid>0000000101</clientid>
  <entry>
    <funddata>
      <foffund>
        <instrument source="InstrumentId" ccy="DKK">PM_FOF_101</instrument>
        <clientid>0000000101</clientid>
        <issuingportfolioid>0000000101-001</issuingportfolioid>
        <assetportfolioid>0000000101-002</assetportfolioid>
      </foffund>
      <subfundrelations>
        <instrument source="InstrumentId" ccy="DKK">PM_FOF_201</instrument>
        <instrument source="InstrumentId" ccy="DKK">PM_FOF_301</instrument>
      </subfundrelations>
    </funddata>
  </entry>
  <suboriginate>TEST</suboriginate>
</client>
```

# Fund of funds modernisering

GUI -> API

## API understøtter STP

- Ind- og udbetalinger
- Skat og omkostninger
- Rebalancering
- Registrering af stamdata, fonde, struktur

## GUI understøtter menneskelig indgriben

- Overblik, status (OK, advarsel, fejl, ...)
- Håndtering af fejlsituationer
  - Som i en vis udstrækning også vil betyde
    - håndtering af betalinger
    - registrering af stamdata



# Disclaimer

Dette materiale er udarbejdet af Vitec Aloc.

Materialet er udarbejdet alene til orientering for kunder eller andre, som materialet er udleveret til.

Materialet er informationsmateriale, og udgør ikke et tilbud fra Vitec. Moduler eller features nævnt i præsentationen er kun indeholdt i den endelige leverance såfremt disse er nævnt i den endelige kontrakt.

Alle råd og informationer i materialet er baseret på kilder som Vitec vurderer er pålidelige, men Vitec er hverken ansvarlig for fuldstændigheden eller nøjagtigheden af oplysningerne eller for direkte eller indirekte tab, som kan opstå på grund af fejl eller mangler heri.

Materialet bliver ikke opdateret, når først det er printet ud eller afleveret elektronisk.

Vitec har ophavsretten til materialet, som er udleveret til kundens personlige brug, og ikke til offentliggørelse noget sted.

Vitec Aloc A/S, (CVR nr. 14788484), Cortex Park Vest 3, 5230 Odense M