

Modernisering

PORTMAN core funktionalitet

Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

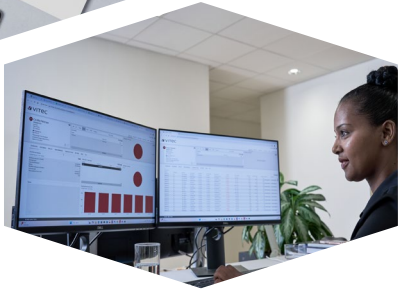
Kunde
konfig.



Rounding
rules

Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Hvem er jeg?



Lennart Damgaard
Senior Solution Architect

Modernisering af instrumenter i PORTMAN

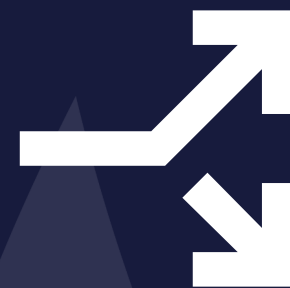


Modernisering af optioner

Optioner omlægges til ny datamodel i PORTMAN.

- Datavalidering
- Datakonvertering
- Oprydning i stamdatafelter
- Ny brugergrænseflade
- Eksisterende import påvirkes ikke
- Ny XML-import stilles tilgængelig (beta)

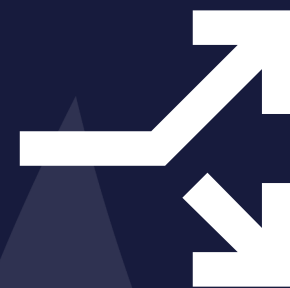
Ændringen følger omlægningen af forwards og futures.



Modernisering af optioner

Cap/floors og swaptioner

- Modelleres som optioner
- Kraftig forenkling af stamdataregistreringen
- Optimeret til plain vanilla forretninger
- Automatisk konvertering
- Øvrig funktionalitet uændret



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

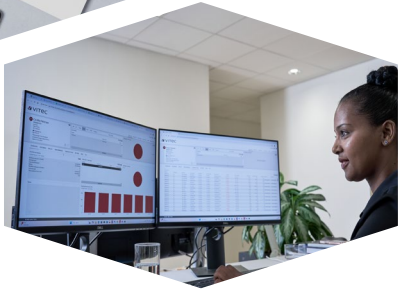
Kunde
konfig.



Rounding
rules

Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Obligationer

Modernisering af obligationer

Analyse påbegyndes nu

- Generel model for alle obligationstyper
 - F.eks. fixed, floating, T-bills, ABS/MBS, etc
- Identificering af irrelevante felter
- Afstemmes med fremtidig modellering af lån og swaps



Modernisering af obligationer

Samspil med øvrige data

- Udtrækninger
- Cash flows
- Floating rates
- Indeksfaktorer
- Par amount factors
- Pool factors
- Events



Modernisering af obligationer

Administration og flows

- Fixings
- Generering af cash flows
- Opdatering af cash flows
- Flette cash flows med eksterne kilder



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

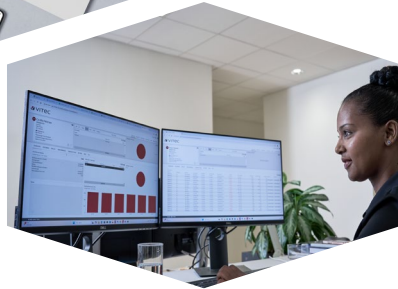
Kunde
konfig.



Rounding
rules

Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Kunde konfig.

Kundekonfiguration

I PORTMAN version 7.43 introducerede vi PORTMAN System configuration.

Modul i brugergrænsefladen underlagt brugerrettigheder til administration af systemkonfigurationer.

Eksempel:

I System configuration kan afstemningsmetoden for beholdningsafstemning angives



Kundekonfiguration

Baggrunden for det nye modul er ønsket om at kunne ændre konfigurationer uden nedlukning af PORTMAN serveren.

Væsentlig forenkling af konfigurationsændringer, der nu kan gennemføres uden ny PORTMAN installationspakke og brug teknikere.

Dette er en forudsætning for ændring af PORTMAN driften fra 24/6 til 24/7.

Konfigurationer flyttes løbende til System configuration.



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

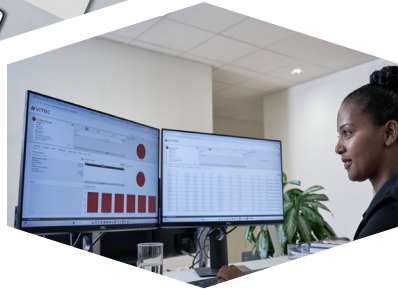
Kunde
konfig.



Rounding
rules

Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Rounding rules

Rounding rules

PORTMAN version 7.45 indeholder generel understøttelse af de nye rounding rules.

Afrundingsreglen angives direkte på stamdata for:

- Bond
- Equity
- Fund



Rounding rules

PORTMAN 7.45 indeholder:

- Initialisering af rounding method felt på stamdata
- Afrundingsregel indgår i importformater
- Gælder for:
 - udtrækninger, kuponer
 - udbytter, aktie- og tegningsretter, split, spaltning, fusion
- Understøttelse af løbende implementering på afviklingscentraler
- Udfasning af quick fix for danske obligationer



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

Kunde
konfig.



Rounding
rules

Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Udfasning af
Stamdata

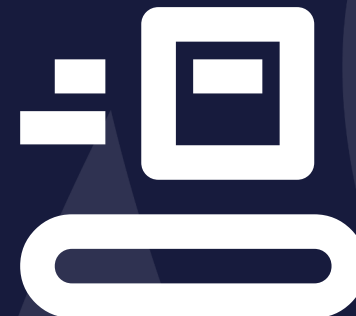
Distributed data

Fra og med PORTMAN version 7.45 leveres ikke nye data til følgende registre:

- CIC, NACE
- GICS, ICB
- LEI, MIC
- Kalendere

Data kan fortsat importeres fra andre kilder.

Alle data kan administreres fra brugergrænsefladen.

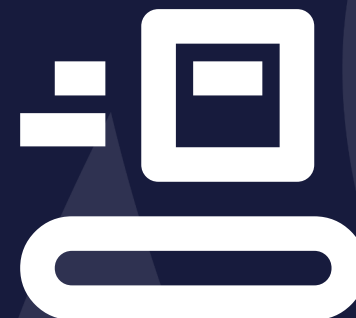


Distributed data

Med den nye tilgang afkobles opdatering af data med timing af PORTMAN opdateringer.

Allerede registrerede data risikerer ikke at blive overskrevet af en efterfølgende PORTMAN installation.

Dataene – pånær LEI – er forholdsvis statiske.



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Optioner

Obligationer

Kunde
konfig.



Rounding
rules

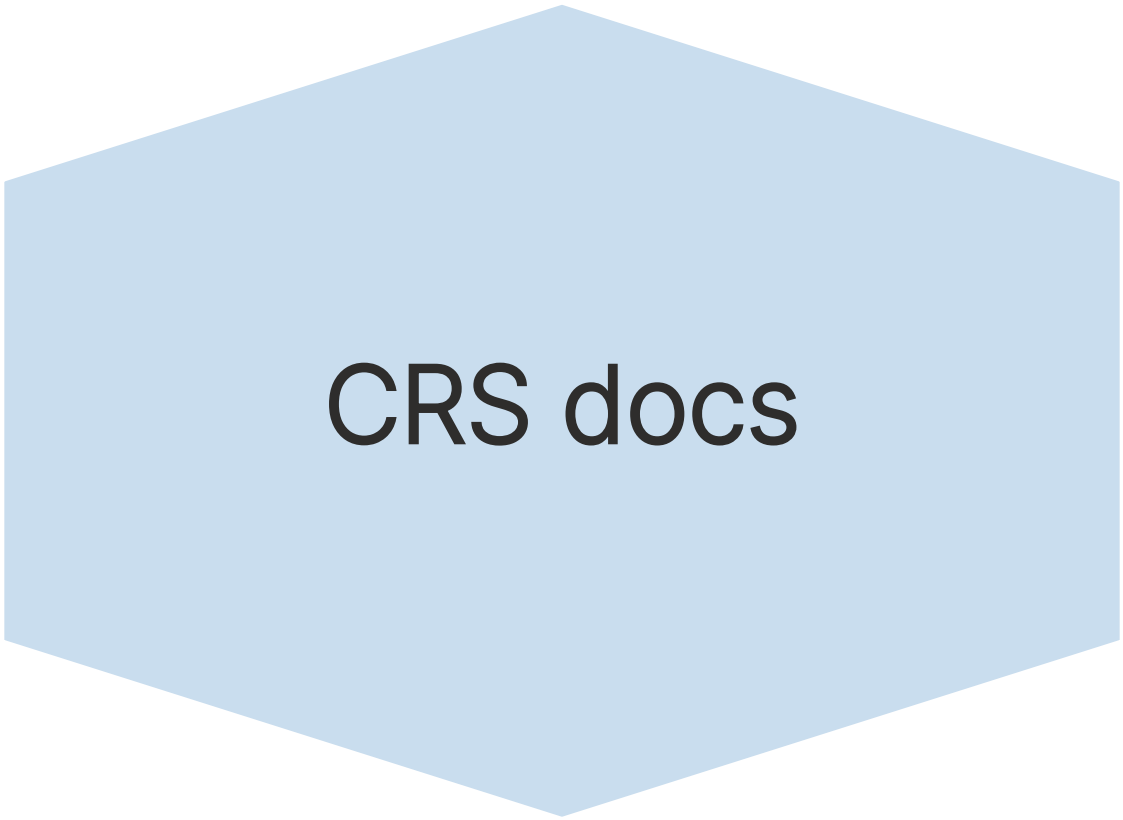
Udfasning af
Stamdata

CRS docs



Modernisering

PORTMAN core funktionalitet



Hvem er jeg?

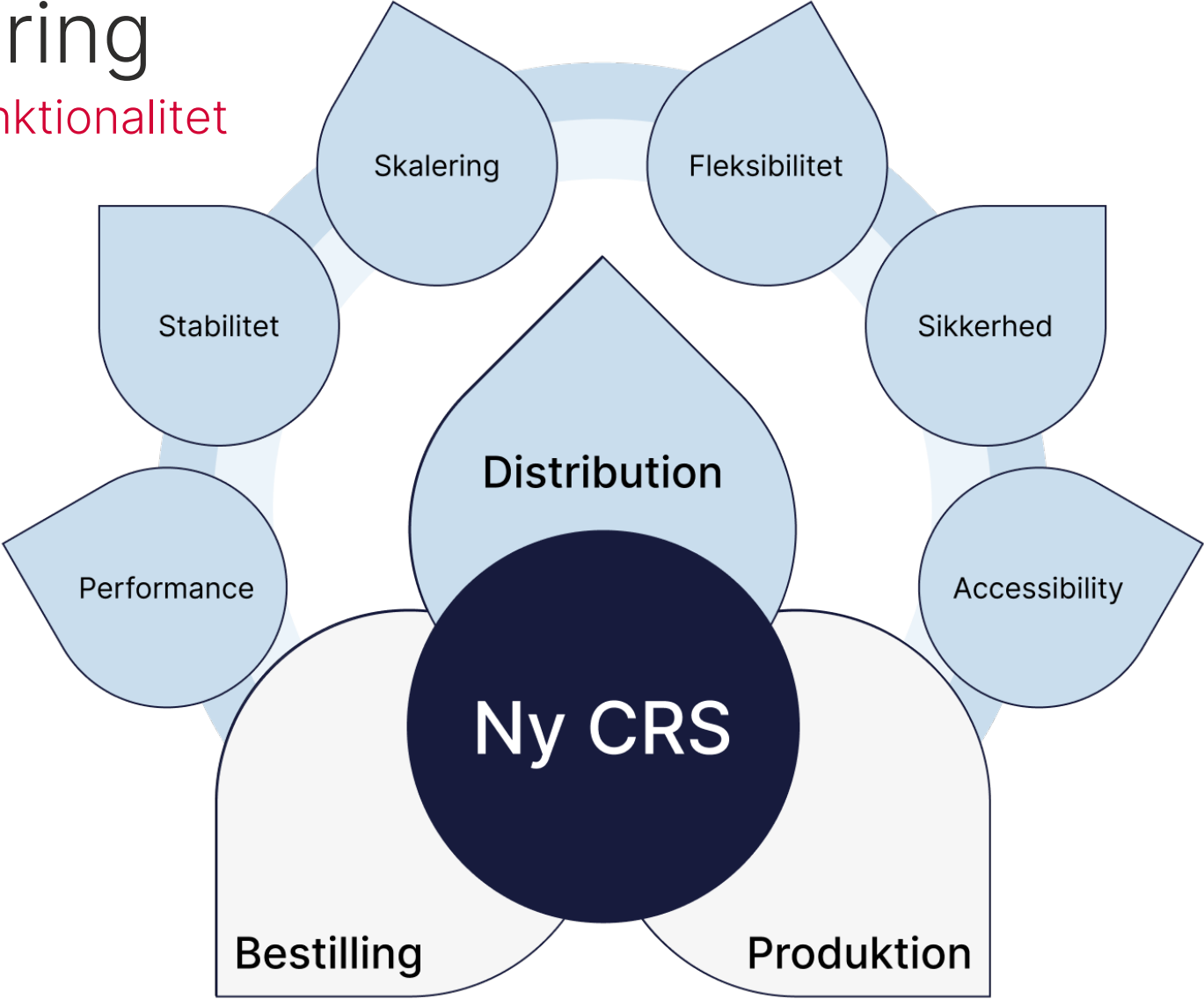


Katja Broch

Product Owner - Team Reporting

Modernisering

PORTMAN CRS funktionalitet



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