



Quantax[®] News

A Special Issue

This is a special issue of Quantax News on the occasion of the 12th FinanceForum, which takes place on 5/6 November 2002 at the Kongresshaus in Zurich.

Exceptionally, this special issue is in German. The next regular issue will describe the changes in release 4.1, and will be in English again.

This issue presents some highlights of reports and multi-entity support.

Spezialausgabe zum FinanceForum November 2002

In dieser Ausgabe

- 1 Quantax am FinanceForum 2002
- 2 Partnerschaft mit talkfinance
- 3 Highlights von Quantax 4.1

COMIT Gruppe
Pflanzschulstrasse 7
CH-8004 Zürich
Tel. +41 1 298 9200
www.comit.ch
quantax@comit.ch

Willkommen

Willkommen am zwölften FinanceForum, das am 5./6. November im Kongresshaus Zürich stattfindet. Die COMIT Gruppe ist am Stand 68 mit den Themen Quantax, Client Facing Solutions, Integrated Banking Solutions, Technologies und SWORD präsent.

Wir werden eine Entwicklungsversion von Quantax 4.1 mit real-time Reports und Mandantenfähigkeit zeigen.

Quantax ASP mit unserem Partner

talkfinance ltd.
the company for financial solutions.

Die COMIT Gruppe freut sich, eine Partnerschaft mit *talkfinance ltd.* anzukünden:

talkfinance ltd. offeriert als *Business und Application Service Provider (BSP/ASP)* den Betrieb einer umfassenden Handels- und Riskmanagement-Lösung basierend auf Quantax. Das Angebot umfasst das fachliche und

technische Outsourcing und die Integration mit der Kundenplattform.

talkfinance ltd. bietet dem Kunden eine breite Palette von Dienstleistungen im Bereich Front-, Middle- und Backoffice an, welche modular kombinierbar sind. Im Sinne des Straight-Through-Processing (STP) stellt talkfinance ltd. damit die ganze Prozesskette vom Deal-Entry, Valuation, P&L-Tracking, Risk Profile Analysis, Backoffice und General Ledger im ausgelagerten Betrieb zur Verfügung. Der Unterhalt von Preis- und Referenzdaten sowie Reports ist dabei ein Kernelement.

Für weitere Informationen steht Ihnen Herr Thomas Oeschger, CEO, +41 41 760 20 00 oder info@talkfinance.ch gerne zur Verfügung.

Highlights von Quantax 4.1

Quantax Professional 4.1 befindet sich zur Zeit in Entwicklung. Die nächste Ausgabe von Quantax News wird das Release detailliert beschreiben.

In dieser Ausgabe stellen wir die Highlights vor: Realtime Reports, Mandantenfähigkeit und Portfolio @ a Glance.

Quantax Realtime Reports

Quantax 4.1 erlaubt, alle Reports, die mit einem festem (aber dennoch dynamischen) Portfolio definiert sind, mit Realtime-Updates zu verfolgen. Transaktionen und Preisänderungen werden typischerweise innert 2-3 Sekunden angezeigt (länger für komplexe Reports und grosse Portfolios).

Die Implementation mit „synchroner Push-Technologie“ ist sehr effizient und läuft dennoch auf jedem Browser, da nur Standard-HTML und JavaScript eingesetzt werden. Es ist keine spezielle Konfiguration notwendig; alle entsprechenden Reports können auf Knopfdruck in einem separaten Fenster real-time betrachtet werden, während Quantax weiterhin normal benutzt werden kann. Jeder Report wird für mehrere Benutzer gleichzeitig nur einmal erstellt und up-to-date gehalten.

Risk Advice Services

Mandantenfähigkeit

Quantax ist nun voll mandantenfähig: Mehrere Institutionen können ein gemeinsames System benutzen, und die Stammdaten können je nach Bedarf gemeinsam oder getrennt verwaltet werden.

Dies erlaubt einerseits einen ASP Betrieb, wie er von *talkfinance ltd.* offeriert wird, andererseits aber auch eine flexible Organisation in grösseren Institutionen.

Die Implementation ist äusserst flexibel gehalten, und erlaubt mannigfaltige Organisationsformen:

Jedes Quantax-Objekt (Deal, statische Daten, Preise, Reports) gehört einer Entität an. Jedem Benutzer wird eine Entität, in der er Objekte erstellen kann, sowie optional mehrere Lese-Entitäten zugewiesen. Die letzteren enthalten gemeinsame Daten, wie z.B. Wertschriften, Preise und gemeinsame Reports. Deals und eigene Reports sowie statische Daten speichert der Benutzer in seiner Schreib-Entität ab.

Entsprechend autorisierte Benutzer

können ihre zugewiesenen Entitäten wechseln, und so z.B. Auswertungen über mehrere Organisationseinheiten erstellen.

Portfolio @ a Glance

Der Report *Portfolio @ a Glance* kombiniert eine flexible Vermögensübersicht mit Gewinn/Verlust, Performance (TWR, MWR, oder IRR), und Risikokennzahlen.

Die Darstellung kann nach bis zu drei Kriterien hierarchisch erfolgen, wobei die Kriterien aus Instrument Typ, Buch, Land, Sektor, Rating, Gegenpartei und Long/Short Position frei wählbar sind.

In jedem dieser Kriterien kann die Auswahl der Elemente von Benutzer gesteuert werden; so können für das Kriterium Land z.B. einzelne Europäischen Länder detailliert ausgewiesen werden, während andere Länder und Kontinente zusammengefasst werden.

Dies erlaubt, dem Spezialisten eine detaillierte Darstellung seines speziellen Interessengebietes zu zeigen, während der Normalbenutzer eine Übersichtsdarstellung bekommt.

Portfolio @ a Glance Thu, 31 Oct 2002 19:11:20 +0100

Investment	Quantity	Value in USD	% of Portfolio (click to view trxs)	Ccy	Break-even price	Scenario Price	Profit/Loss Total in USD	Profit/Loss 12M in USD	Profit/Loss MTD in USD	Profit/Loss YTD in USD
Total Assets		362,685,734	100				165,000,444	165,000,444	-17,657,681	163,855,819
CASH PRODUCTS		353,068,354	97.3				240,480,808	240,480,808	-25,174,840	240,321,216
CALL	99,985,000	67,144,247	18.5	CHF	101.89		-770,859	-770,859	2,447,188	-930,076
CHF call	99,985,000	67,144,247	18.5	CHF	101.89		-770,859	-770,859	2,447,188	-930,076
FRA	-100,000,000	-215,406	-0.1	AUD	0.4		-10,768	-10,768	1,996	-10,990
AUD fra	-100,000,000	-215,406	-0.1	AUD	0.4		-10,768	-10,768	1,996	-10,990
FX CASH		-2,579,346	-0.8				-1,396,646	-1,396,646	-6,233,881	-1,391,679
EUR-USD fxcash	50,000,000	1,987,030	0.5	EUR	0.09	0.9	121	121	121	121
USD-CHF fxcash	191,250,000	-4,566,376	-1.3	USD	-0.2	1.5	-3,383,676	-3,383,676	-6,234,002	-3,378,709
IRS		4,359,969	1.2				-951,772	-951,772	-951,772	-951,772
CHF irs	0	6,576,557	1.8	CHF			-950,410	-950,410	-950,410	-950,410
USD irs	-15,000,000	-2,216,588	-0.6	USD	14.77		-1,362	-1,362	-1,362	-1,362
LOAN		88,984,206	24.6				42,924,428	42,924,428	-31,550,655	42,919,307
CHF loan	49,500,000	32,117,112	8.9	CHF	-0.97		32,437,630	32,437,630	-31,385,812	32,437,661
EUR loan	50,000,000	46,827,590	12.9	EUR	102.56		447,293	447,293	-172,497	442,142
USD loan	10,000,000	10,039,505	2.8	USD	100.32		7,653	7,653	7,653	7,653
MISCELLANEOUS CASH	310,016,667	195,374,684	53.9	CHF	0.95		11,112,284	11,112,284	11,112,284	11,112,284
misc misc	310,016,667	195,374,684	53.9	CHF	0.95		11,112,284	11,112,284	11,112,284	11,112,284
COMMODITIES	1,500	112,500	0.0	USD	75.0		0	0	0	0
COMM	1,500	112,500	0.0	USD	75.0		0	0	0	0
heating oil	1,500	112,500	0.0	USD	75.0	75.0	0	0	0	0
EQUITIES		10,101,555	2.7				232,000	232,000	227,672	0
EQUITY		10,101,555	2.7				232,000	232,000	227,672	0
ABB Namen	12,150	115,425	0.0	CHF	14.25	14.25	0	0	7,214	0