

SLIB PORTFOLIO MANAGER

PRESENTATION GENERALE

Présent depuis 20 ans sur Euronext et les places étrangères, SLIB met son expertise au service des métiers de la gestion de portefeuilles avec son offre SLIB Portfolio Manager. Apporter des solutions innovantes aux problématiques quotidiennes des gérants, rendre plus fluide le traitement des opérations pour leur permettre de se concentrer sur les décisions de gestion et ainsi optimiser vos engagements vis-à-vis de vos clients, constituent les principaux objectifs de notre offre.

SLIB Portfolio Manager répond aux besoins de la **gestion conseillée** (compte en assistance, gestion de la relation avec le client) et de la **gestion discrétionnaire** (compte sous mandat de gestion, gestion industrialisée).

SLIB Portfolio Manager couvre en mode STP l'intégralité des processus de gestion de portefeuilles : analyse des positions, simulations, ré-équilibrage, gestion des contraintes, traitement et passage des ordres.

Parfaitement ouvert et interfaçable, SLIB Portfolio Manager peut être couplé avec le système back-office et le carnet d'ordres de votre choix, dont le carnet d'ordres SLIB OMS.



POINTS FORTS

- Modélisation souple et dynamique permettant de refléter fidèlement vos univers d'investissement
- Des fonctions à forte valeur ajoutée vous permettent d'analyser les positions et les écarts par rapport à la modélisation, d'enregistrer directement des ordres, de demander un rebalancing automatique
- Gestion STP du passage d'ordres avec couplage à un OMS : les ordres générés peuvent être globalisés pour optimiser les coûts de négociation
- Reporting intégrant les performances, leur benchmarking et leur historique sur 5 ans ; simulations incrémentales avec mise à jour des positions titres et cash
- Traçabilité des opérations pour répondre aux règles déontologiques
- L'utilisation possible en mode « déconnecté » au cours de la journée permet aux conseillers d'être mobiles
- Interface graphique conviviale : multi fenêtrage, configuration de perspective propre à l'utilisateur, utilisation de l'arborescence, drag and drop, pilotage d'une fenêtre par une autre
- L'utilisation en mode ASP offre une alternative économique avantageuse qui vous permet de réduire vos dépenses informatiques

FONCTIONNALITES

Intégration des flux externes

SLIB Portfolio Manager est un outil ouvert, conçu pour intégrer facilement des flux de données externes provenant soit de vos propres systèmes d'information, soit des logiciels SLIB (positions comptables valorisées avant/après OST, opérations du jour, compteurs fiscaux, bases tiers et comptes, base valeurs et cours, carnet d'ordres).

Gestion des référentiels

Une gestion intelligente des référentiels permet de distinguer les données 'externes' alimentées à partir des flux reçus et non modifiables dans SLIB Portfolio Manager, des données 'privées' spécifiques à l'outil alimentées automatiquement ou manuellement.

Gestion de la sécurité

Le module sécurité gère les accès au produit : profils autorisés, mots de passe. La confidentialité des informations des comptes est également garantie.

Modélisation

Un paramétrage souple permet au gestionnaire de définir la façon dont il désire modéliser les portefeuilles de ses clients. Jusqu'à 4 niveaux de consolidation sont disponibles.

- Mode de regroupement des valeurs : poche d'actifs
- Poids de chaque regroupement de valeurs : grille d'allocation
- Affectation de ces grilles aux différents portefeuilles en fonction des modes de gestion

Position de Gestion

La position de gestion précise est tenue en temps réel. Elle prend en compte :

- L'initialisation à partir du flux quotidien des positions comptables après OST valorisées
- L'intégration du flux quotidien des ordres actifs après OST
- Les ordres et simulations du jour, au fil de l'eau
- Les modifications, suppressions des simulations, au fil de l'eau
- Les annulations d'ordres au fil de l'eau

Les informations de conformité par rapport à la grille d'allocation et des poches d'actifs par rapport au modèle de gestion sont calculées en temps réel à partir de cette position.

Consultation / Analyse

De nombreuses consultations sont disponibles dans les catégories suivantes :

- Accès par compte
- Accès avec regroupement de comptes
- Analyse de conformité des comptes
- Analyses transversales des positions
- Reporting automatique à posteriori

Performances

Le module de gestion des performances alimente une base de données stockant quotidiennement les informations suivantes :

- Valorisation début de journée
- Valorisation fin de journée
- Apports et retraits du jour
- Avoir géré moyen du jour
- Performance du jour

Le stockage de la performance quotidienne et des différents montants permettent de restituer les informations suivantes :

- Performances mensuelle, trimestrielle, semestrielle, annuelle
- Performance entre 2 dates
- Performances sur des groupes de comptes (tiers, gestionnaire, objectif de gestion ...)

Benchmarks

Les benchmarks sont des portefeuilles fictifs constitués de valeurs ou d'indices. Une performance quotidienne est calculée sur ces benchmarks et comparée à la performance des portefeuilles clients ayant le même profil de gestion.

Saisie des ordres

Les étapes de la saisie d'un ordre sont :

- Identification du compte ou des comptes concernés
- Saisie des caractéristiques de l'ordre
- Présentation des ordres sur le ou les comptes sélectionnés : ordre détail / ordres globaux
- Présentation des informations de conformité pour les comptes avec prise en compte des ordres proposés
- Ajustement des ordres clients, recalcul des ordres globaux et des informations de conformité des comptes modifiés
- Validation en mode ordre ou en mode simulation

Rebalancing

Le rebalancing permet de réajuster les portefeuilles sur leurs grilles d'allocation et modèles de gestion en générant automatiquement des ordres. Le rebalancing est demandé pour un compte ou plusieurs comptes.

Un lancement automatique pourra être planifié en cas d'un dépassement spécifique enregistré au niveau de la grille d'allocation et des modèles.

La validation du rebalancing peut être faite en mode simulation ou ordre.

Carnet d'Ordres

Le carnet d'ordres est alimenté quotidiennement par un flux en provenance de l'OMS reprenant l'ensemble des ordres clients validés encore actifs. En cours de journée, le carnet est alimenté automatiquement avec les ordres validés dans l'outil. En cas de regroupement d'ordres client en un ordre global, une référence commune est affectée sur les ordres client et l'ordre global.

Un lien permanent est mis en place entre le carnet d'ordres de l'outil et le carnet d'ordres de l'OMS. Ce lien permet de :

- Transmettre au fil de l'eau les lots d'ordres produits
- Recevoir un acquittement sur les lots d'ordres transmis

L'utilisateur peut consulter les ordres ou annuler les ordres à négocier.

Contraintes Individuelles

La gestion des contraintes va permettre en fonction de critères liés au compte et à la valeur : de bloquer à priori le passage des ordres et l'enregistrement des négociations, de détecter et lister à posteriori les comptes ne respectant pas les contraintes. Sont prises en compte :

- Les contraintes réglementaires
- Les contraintes de gestion (définies par la société)
- Les contraintes individuelles (définies par le client)

Simulations

Les simulations sont alimentées en cours de journée lorsque le gestionnaire choisit d'enregistrer une simulation en lieu et place d'un ordre à partir de la saisie d'un ordre ou du rebalancing. Leur présentation reprend exactement celle des ordres avec la constitution de lots, de groupes; d'ordres clients et d'ordres regroupés.

Les simulations viennent mettre à jour les positions de gestion temps réel. Les données de conformité sont recalculées. L'utilisateur peut empiler plusieurs simulations dans la même journée : un lien est alors géré entre les simulations.

L'utilisateur peut :

- Consulter les simulations
- Modifier
- Supprimer une simulation
- Valider une simulation

Reporting

L'outil permet une édition de CRG (Compte-Rendu de Gestion) reprenant :

- Le bilan global du compte
- Le détail du portefeuille
- La répartition selon la grille d'allocation associée
- Les dernières opérations enregistrées
- Un comparatif de la performance avec différents indices sélectionnés