



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

SOLVA REPORTING FENION GMBH



Stefan Fischer MSc
Managing Partner



Mag. Nikolaus Sernetz
Managing Partner



DI Alexander Adamenko
Managing Partner



SOLVA

SOLVA REPORTING.

Im Rahmen des Solva Reporting wird die erforderliche Eigenkapitalhinterlegung für Investmentfonds auf Look-Through Basis berechnet. Die Solvabilität wird auf Basis der jeweiligen Risikogewichte gemeinsam mit dem Kreditrisiko des Issuers getrennt für on-balance und off-balance Positionen dargestellt. Im Wesentlichen werden an die Kreditinstitutionen zwei verschiedene Templates zur Verfügung gestellt, nämlich die Darstellung des Währungs-Exposures und KSA-Risikogewichte nach Ländern.

SOLVA PRODUCTION

Produktion von Solva Reporting gemäß aktueller regulatorischer Anforderungen

Solva-Deckblatt bestehend aus einer Währungs-Allokation für alle im Portfolio enthaltenen Währungen.

KSA-Risikogewichte nach Ländern bestehend aus einer Allokation der Risikogewichte dargestellt hinsichtlich ihres Länder-Exposures.

Hohe Sicherheit und durch externen Auditor geprüfte Logik

Schnelle Lieferung und hohe Datenqualität

Solva-Deckblatt

Fonds: 5456
Währung: ELR
ISIN: AT*****
LEI: *****

Fondsvermögen		Währungsgesamposition (aktivische Ausrichtung)	
Fondsvermögen aus Solva:	2.516.048.279,63	Währung	10.403.155,38 0,69
Fondsvermögen aus Bewertung:	2.516.048.279,63	Gold	-
Differenz:	0,00	N.A.	-
		Total	10.403.155,38 0,69

Durchschnittliche Gewichtungsziffer
Durchschn. Gew. Ziffer: 7,69%
risikogewichteter KSA-Positionswert: 116.598.469,50

Gliederung der Währungspositionen										
Whg	Betrag (aktiv)	in %	Betrag (passiv)	in %	aktivische Ausrichtung		passivische Ausrichtung		Nettoposition	in %
HUF	532.809,85	0,04	0,00	0,00	532.809,85	0,04	0,00	0,00	532.809,85	0,035
CHF	187.213.230,99	12,35	-84.370.027,16	-5,57	187.213.230,99	12,35	-84.370.027,16	-5,57	9.870.345,93	0,051
Total	187.746.040,84	12,38	-84.370.027,16	-5,57	187.746.040,84	12,38	-84.370.027,16	-5,57	10.403.155,38	0,686

Gliederung Gold und N.A.						anzurechnender Betrag	
Whg	Betrag (aktiv)	in %	Betrag (passiv)	in %			
Total Gold und N.A.					0,00	-	
Übertrag total Währungen (aktivische Ausrichtung)					10.403.155,38	0,69	
Währungsgesamposition (aktivische Ausrichtung)					10.403.155,38	0,69	

N.A. = Nicht aufgliederbare Fondsanteile nach Artikel 353 (3) CRR (EU-Verordnung Nr. 575/2013)

KSA-Risikogewichte nach Ländern

Fonds: 5456
Währung: EUR
ISIN: AT*****
LEI: *****

Durchschnittliche Gewichtungsziffer
Risikogewicht gemäß Art. 132 (1) CRR II i.V.m. Art. 132c (1) CRR II (= alternativer LTA)
marktbewerteter risikogew. KSA-Positionswert gem. CRR II

Risikogewichteter KSA-Positionswert (in %FV) nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers (gem. Artikel 130 (1) CRD-IV)

Emittentland ID	Emittentland	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA-Positionswert in % am Fondsvermögen	festgelegte Kapitalpuffer der Länder in % (Anlagen ohne Gewähr; Quellen: ESRB und BIS)
BE	Belgien					
DE	Bundesrep. Deutschland					
DK	Danemark					
FR	Frankreich					
KR	Südkorea					
NO	Norwegen					
SE	Schweden					
Zwischensumme						
BF-Artikel 140 (4) CRD IV selbst						
Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014						
Total						

Details zu den Positionen mit Herkunftsland-Prinzip gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014:

ISIN	Positionsbezeichnung	Bemessungsgrundlage	Bemessungsgrundlage in % am Fondsvermögen	mit Landquote bzw. Risikogewicht gewichteter KSA-Positionswert in EUR	risikogewichteter KSA-Positionswert in % am Fondsvermögen

SOLVENCY RATIO

Die Solvency Kennzahl wird von Kreditinstituten verwendet, um die notwendige Eigenkapitalhinterlegung für das Halten eines Investmentfonds zu bestimmen.

REPORTING TEMPLATES

Solva reporting

Solva-Deckblatt

KSA-Risikogewichte nach Ländern

Solvency ratio

RWA



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

KONTAKT



ADRESSE

Hoher Markt 4, 1010 Wien



TELEFON

+43 (1) 908 11 80



EMAIL

office@fenion.at



Mag. Nikolaus Sernetz
Managing Partner

IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

KONTAKT

Fenion GmbH
Hoher Markt 4
1010 Wien
Bereich: IT-Dienstleistungen
UID: ATU72994405
FN: 483557p
FB-Gericht: Wien
E-Mail: office@fenion.at

SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

