

Erläuterungen IP.Performance Portal

INHALT

1	ZUGANG IP.PERFORMANCE	2
2	MENÜSTRUKTUR IP.PERFORMANCE	3
2.1	Send a request	3
2.2	Request Status and Export	6
2.3	Views	8
3	REPORT SPEZIFIKATIONEN	9
3.1	Sheet Info	9
3.2	Sheet Report	9

1 ZUGANG IP.PERFORMANCE

Der Zugang zum IP.Performance-Portal erfolgt über IP.Risk online unter dem folgenden Link:

<https://iprisk.ipconcept.com>



Abbildung 1: Zugang IP.Risk online

Sie können sich hier mit ihren normalen Nutzerdaten einloggen. Anschließend sehen Sie, neben den Menüpunkten, die zum Risikoportal gehören, auch den Menüpunkt IP.Performance.



Abbildung 2: Zugang IP.Performance

2 MENÜSTRUKTUR IP.PERFORMANCE

Im IP.Performance-Portal können Sie

- Performance-Berechnungsprozesse anstoßen (Menüpunkt „Send a request“, siehe Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.**)
- den Status angestoßener bzw. abgeschlossener Berechnungsprozesse kontrollieren (Menüpunkt „Request Status and Export“, siehe Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.**)
- Performance-Reports exportieren (Menüpunkt „Request Status and Export“, siehe Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.**)
- Report-Ergebnisse anzeigen und filtern (Unterpunkte von „Reports and Views“, siehe Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.**)

2.1 Send a request

Um einen Report anzustoßen wählen Sie „Send a request“. Es öffnet sich die folgende Ansicht:

IPConcept

Keine Anfrage(n) selektiert

Daten laden ▶

Fonds ^

Bitte auswählen v

Berichtsdatum (Endtermin) ^

☒ NIW Datum benutzen

26.08.2025 [Calendar Icon] - +

Berichtsperiode (Starttermine) ^

☒ DTD (Starttermin: 07.10.2014)

☐ MTD (Starttermin: 30.09.2014)

☐ YTD (Starttermin: 30.12.2013)

☐ Benutzerdefinierter Starttermin:

[Calendar Icon]

Berichte ^

☐ STD_PE: Standard

☐ PDC_PE: Product

Abbildung 3: Auswahlmöglichkeiten für den Request

Wählen Sie den Fonds aus, den Sie reporten möchten. Die verfügbaren Fonds finden Sie über das Dropdown-Menü. Über die Eingabe im Suchfeld können Sie die verfügbaren Fonds weiter eingrenzen.

Abbildung 4: Fondsauswahl aus Dropdown-Menü

Abbildung 5: Fondsauswahl durch Suche (Textfeld)

Anschließend wählen Sie den Fonds durch Klick auf die entsprechende Position in der Liste.

Abbildung 6: Fondsauswahl durch Suche (Auswahl)

Unter **Berichtsdatum (Endtermin)** legen Sie das Enddatum des Reports fest. Unter **Berichtsperiode (Starttermine)** können Sie eine oder mehrere Report-Perioden bzw. Startzeitpunkte für den Reporting-Zeitraum definieren. Wählen Sie hierzu eine oder mehrere der vordefinierten Perioden DTD, MTD, oder YTD oder legen Sie über das Datumsfeld bei Benutzerdefinierter Starttermin ein beliebiges Startdatum fest.

Unter **Berichte** stehen dann schließlich zwei Report-Typen zur Auswahl: STD_PE und PDC_PE.

Beide Report-Typen enthalten Stichtags- und kumulierte Werte für den Fonds und die einzelnen Assets. Im PDC_PE Report ist zusätzlich noch eine kumulierte Zeile für jeden Produkt-Typ enthalten, beispielsweise für Aktien.

Sobald alle Inputparameter gemäß Ihren Wünschen eingestellt sind, bereiten Sie die Anfrage durch einen Klick auf den Button **Daten laden** vor.

IPConcept

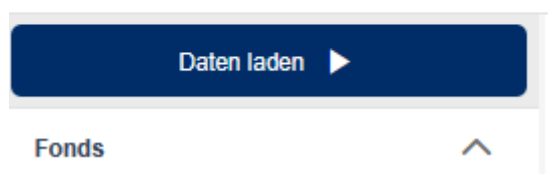


Abbildung 7: Anfragen in Liste aufnehmen

Die Anfrage erscheint dann in einer Liste auf der rechten Seite, in der die Report-Parameter nochmals kontrolliert werden können. Wählen Sie alle Reports die Sie anstoßen möchten über die Kontrollkästchen aus und senden Sie die Requests durch Klick auf das Feld „* Anfrage(n) senden“ ab.



Abbildung 8: Anfragen anstoßen

Sobald die Anfragen abgesendet wurden aktualisiert sich die Übersicht auf der rechten Seite. Unterhalb der Report-Liste werden die abgesendeten Report-Anfragen aufgelistet. Noch weiter unterhalb findet sich nun eine Ansicht in der der Status der Anfragen überprüft und abgeschlossene Reports exportiert werden können. Diese Ansicht ist identisch mit der View „Request Status and Export“ die im folgenden Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.** erläutert wird.

2.2 Request Status and Export

Unter diesem Menüpunkt können Sie den Status der von Ihnen angestoßenen Performance-Reports kontrollieren sowie die Ergebnisse exportieren.

Wie bei einer View in IP.Risk üblich, werden nach Klick auf „Daten laden“ alle Report-Daten angezeigt, die den Filterkriterien im linken Menüband entsprechen. Die Filterkriterien sind dabei individuell konfigurierbar. Beispielsweise kann auf Eigenschaften wie Datum, Request ID oder Fonds ID gefiltert werden. Der Filter ist so voreingestellt, dass alle Reports der letzten zehn Tage angezeigt werden. Dies entspricht dem typischen Anwendungsfall den Status eines gerade angestoßenen Reports zu kontrollieren und ihn nach Abschluss zu exportieren. Selbstverständlich können aber auch ältere Requests angezeigt und die zugehörigen Reports exportiert werden.

IPConcept

Download icon | Daten laden | Heart icon

Inserted [X] [^]

☐ Seit

☐ Zwischen

☒ Letzte(n)

10 [v] Tag(e) [v]

pfReqID [X] [v]

FundNo [X] [v]

pfReqDesc [X] [v]

ReportType [X] [v]

Username [X] [v]

+ Hinzufügen [v]

Sortieren [v]

Abbildung 9: Ansicht Status und Export

Das Ergebnis der Abfrage wird in tabellarischer Form angezeigt. Requests mit Status „PRep2 done“ sind abgeschlossen und können exportiert werden.

IPConcept

Buttons: Daten laden, Exportoptionen verbergen

Exportformat: XL SX, Download, Keine Datei(n) selektiert

pfReqID	Status	RepStatus	ExportStati	FundNo	FundName	pfReqDesc	ReportType	cat	shc	Period	NiwDate
2	PRep2 done	Done	-	IPVISION	-	PERF_PDC_PE	PDC_PE	-	-		07.10.201
1	PRep2 done	Done	-	IPVISION	-	PERF_STD_PE	STD_PE	-	-		07.10.201

Abbildung 10: Export-Spezifikation

Die Requests die Sie exportieren möchten legen Sie über die entsprechenden Auswahlkästchen fest. Das Dateiformat ist im Feld „xlsx“ standardmäßig auf MS Excel (xlsx) eingestellt und kann auf xml geändert werden.

Pro Export-Request und Report-Typ muss jeweils ein Report-Format ausgewählt werden. Dies geschieht über die Felder, die nach Auswahl der Reports in der zweiten Zeile erscheinen. Für jeden Report-Typ (wie STD_PE oder PDC_PE) erscheint ein Auswahlfeld.

IPConcept

Buttons: Daten laden, Exportoptionen verbergen

Exportformat: XL SX, Download, 2 Dateien exportieren

ReportVarianten: PF_PDC_MEDIUM, PF_STD_MEDIUM

pfReqID	Status	RepStatus	ExportStati	FundNo	FundName	pfReqDesc	ReportType	cat	shc	Period	NiwDate
2	PRep2 done	Done	-	IPVISION	-	PERF_PDC_PE	PDC_PE	-	-		07.10.201
1	PRep2 done	Done	-	IPVISION	-	PERF_STD_PE	STD_PE	-	-		07.10.201

Abbildung 12: Auswahl Report-Variante

Diese Varianten legen fest welche Spalten und welche Detail-Levels¹ im exportierten Report enthalten sind. Insbesondere die Auswahl Small macht das resultierende File deutlich übersichtlicher. Eine Übersicht welche Spalten in welchem Report Type enthalten sind, finden Sie weiter unten in dieser Beschreibung.

¹ So enthält der Report PF_PDC_SMALL beispielsweise nur Performance-Zahlen auf Ebene des Fonds (Level 1) und der Assetklassen (Level 2), wohingegen die Reports PF_PDC_MEDIUM und PF_PDC_LARGE auch Performance-Zahlen auf Ebene der Einzelpositionen (Level 3) enthalten. Dahingegen erhalten die PF_STD-Reports stets Performance-Zahlen auf der Ebene des Fonds (Level 1) und der Einzelpositionen (Level 2).

2.3 Views

Anstatt den Report herunterzuladen können Sie sich die Ergebnisse auch direkt im Portal ansehen. Sie wählen den gewünschten Report-Typ im Menü aus, PE_STD oder PDC_PE. Dadurch gelangen Sie in eine Übersicht, in der Sie ebenfalls zwischen Small, Medium und Large wählen können.

Wie für eine View in IP.Risk online üblich können Sie im linken Reiter Filter einstellen. Hierbei können Sie Filterkriterien für jede im Report vorhandene Spalte festlegen. Unbedingt empfehlenswert ist das Filtern auf eine spezifische Request-ID (pfReqID). So ist sichergestellt, dass nur Daten zu einem einzigen Reporting-Lauf angezeigt werden. Verwenden Sie hier die pfReqID eines Requests den Sie angestoßen haben oder suchen Sie eine geeignete pfReqID über die View „Request and Status Export“ (siehe Abschnitt **Fehler! Verweisquelle konnte nicht gefunden werden.**). Selbstverständlich können aber auch verschiedene Request-IDs miteinander verglichen werden. Die Abfrage wird durch Klick auf ‚Daten laden‘ durchgeführt. Wenn Sie das Ergebnis der Abfrage exportieren möchten, können Sie über den Downloadbutton zwischen verschiedenen Exportformaten wählen.

Exportoptionen verbergen

XLSX

Download

1 Datei exportieren

PF_STD_LARGE

PF_STD_LARGE

PF_STD_MEDIUM

PF_STD_SMALL

	RepStatus	ExportStati	FundNo	FundName	pfReqDesc	ReportType
	Done	-	IPVISION	-	PERF_PDC_PE	PDC_PE
	Done	-	IPVISION	-	PERF_STD_PE	STD_PE

Daten laden

CSV

Excel

XML

pfReqID	FundNo	IVI	histor
	IPVISION	1	29.04.
	IPVISION	2	29.04.
	IPVISION	2	29.04.
	IPVISION	2	29.04.
	IPVISION	2	29.04.
	IPVISION	2	29.04.

FundNo

1

4

IPVISION

IPVISION

Abbildung 13: Views, Exportmöglichkeiten

3 REPORT SPEZIFIKATIONEN

Der folgende Abschnitt beschreibt den Aufbau und Inhalt des Standard Performanceberichts im XLSX-Format.

3.1 Sheet Info

In diesem Tabellenblatt können Sie die Konfiguration zum Report nachvollziehen. Enthalten sind:

- PReqID: die Request ID des Reports, eine fortlaufende Nummer im System
- RequestDesc: QSUI, ein technischer Eintrag
- RepCCY: Währung des Reports
- Fundno: Fonds ID
- Fundname: Fondsname
- ShareClasses: leer, es wird immer der komplette Fonds reportet
- PeriodDesc: ausgewählte Periode des Reports (DTD, MTD, YTD) oder custom
- RefDateBegin: Startdatum des Reports bezogen auf Marktpreise
- RefDateEnd: Enddatum des Reports bezogen auf Marktpreise
- NiwDateBegin: Startdatum des Reports bezogen auf die Feststellung des Nettoinventarwerts
- NiwDateEnd: Enddatum des Reports bezogen auf die Feststellung des Nettoinventarwerts
- e: Environment, „p“ für Produktion, ein technischer Eintrag
- ReportType: ausgewählter Report Type STD_PE oder PDC_PE
- TimeStart: Startzeitpunkt, Zeitpunkt wann der Report gestartet wurde
- TimeEnd: Endzeitpunkt, Zeitpunkt wann der Report beendet wurde

3.2 Sheet Report

Die aufgeführten Spalten im Sheet Report hängen von der gewählten Spezifikation (Small, Medium und Large) ab. In der Auswahl Large sind schlussendlich alle Spalten enthalten.

Für die Konfiguration **Small** sind nur Spalten in Berichtswährung enthalten.

Explizit sind das:

- PReqID: die Request ID des Reports, eine fortlaufende Nummer im System
- FundNo: die Fonds ID der Buchhaltung
- Lvl: Dieses Feld und insbesondere die verfügbare Filteroption dienen dazu, den Performancebericht in verschiedene Ebenen zu gruppieren. Es gilt: Je größer die Zahl desto granularer sind die angezeigten Daten.
- History: RefDateEnd, das Enddatum des Reports bezogen auf Marktpreise
- Instrument: Technischer Identifier der Position
- Descriptor: Beschreibung der Position (z.B. Name eines Wertpapiers).
- ISIN: ISIN des Wertpapiers, falls verfügbar.
- Product: Produkttyp der Position (z.B. equity)
- IC: eindeutige Währung der Position, falls verfügbar
- Position: Stückzahl oder Nominal der Position
- pvDirty_RC: Positionswert in Berichtswährung inklusive aufgelaufener Stückzinsen

- priceClean: Preis in Positionswährung exklusive aufgelaufener Stückzinsen (clean price)
- priceDirty: Preis in Positionswährung inklusive aufgelaufener Stückzinsen (dirty price)
- plTotal_RC: Gewinn oder Verlust (profit and loss, PL) einer Position im Laufe des Betrachtungszeitraums in Berichtswährung
- pcTotal_RC: Performance-Beitrag (performance contribution, PC) über den Betrachtungszeitraums in Berichtswährung
- twrTotal_RC: Zeitgewichtete Rendite (time weighted return, TWR) über den Betrachtungszeitraums in Berichtswährung
- Terminated: noch im Bestand (false) oder ausgelaufen/verkauft (true)

Bei den Konfigurationen Medium und Large kommen noch diverse Spalten hinzu.

Für den Medium Report sind das insbesondere die Aufteilung der PL, TWR und PC Werte nach ihrer Herkunft:

- Div_RC: Erträge aus Dividenden
- Int_RC: Erträge aus Zinsen
- Fees_RC: Gebührenkosten, bei Assets in der Regel die Transaktionskosten
- Mrkt_RC: Erträge aus Marktpreisen

Für den **Large** Report kommen insbesondere Werte in Positionswährung und Wechselkurseffekte hinzu:

- FxRate: Wechselkurs von Positions- zu Berichtswährung
- Werte wie PV und PL in Positionswährung (dort fehlt die Endung _RC im Spaltennamen)
- Aufteilung der PL, TWR und PC in Effekte aus Wechselkurseffekten (RFx) und Effekte ohne Wechselkurseffekte (RnFx)