



arketipa - Immagina e comunica

PROMETEIA

RISK & PORTFOLIO MANAGEMENT

AMPro System

PROMETEIA

via Marconi 43, 40122 Bologna (BO) Italy • tel. +39 0516480911 • fax +39 051220753 • www.prometeia.it • email: info@prometeia.it

PROMETEIA

Risk & Portfolio Management

**Controllo
dei rischi finanziari
e guida alle scelte
di investimento**

L' *ampliamento delle opportunità di investimento a disposizione dei professionisti e dei clienti dell'industria dell'asset management aumenta le occasioni per generare rendimento, rendendo tuttavia più complessa la misurazione e l'attività di controllo dei rischi di portafoglio. In assenza di adeguati strumenti di analisi, ottenere ed organizzare le informazioni, valutare le scelte di investimento ex ante e verificare le performance ex post può risultare realmente complesso e molto oneroso.*

LA SOLUZIONE

I sistemi di monitoraggio e gestione dei rischi assoluti e relativi nell'Asset Management richiedono:

- Un modello di analisi corretto e adatto alle tipologie di strumenti utilizzati
- La gestione di una rilevante quantità / qualità di dati di mercato in input al modello
- La coerenza tra il modello finanziario e il processo decisionale di investimento.

Queste sono le principali tematiche sulle quali abbiamo maturato esperienze di eccellenza a supporto dei processi di valutazione dei portafogli di investimento. Le soluzioni individuate rappresentano i fattori distintivi della nostra offerta a supporto dei *portfolio manager*, dei *risk manager* e degli altri attori chiamati a valutare giorno per giorno le scelte di investimento.

AMPro (*Asset Management Pro*) incorpora queste esperienze e rappresenta una soluzione integrata, solida e flessibile per la gestione di portafoglio, dall'ottimizzazione alla misurazione ed attribuzione del

rischio ex ante fino alla analisi della performance e degli altri indicatori ex post.

Il modello di riferimento utilizza metodologie di simulazione per potere valutare in modo robusto e preciso anche gli strumenti più complessi (derivati, strutturati ecc.).

L'alimentazione dei motori di calcolo è realizzata con informazioni di mercato coerenti con i modelli finanziari utilizzati ed è curata da un team di analisti e ingegneri finanziari che provvede, giorno per giorno, ad interfacciare i migliori data provider e a fornire il flusso di elaborazioni necessarie curandone la qualità e l'accuratezza.

Infine, la consulenza a supporto dell'interpretazione dei risultati e l'attività di personalizzazione e integrazione del servizio nel processo di investimento costituiscono gli ulteriori elementi distintivi del nostro approccio.



AMPro permette di:

- Analizzare e attribuire il rischio ex ante utilizzando un approccio di simulazione storica in *full evaluation*
- Gestire e analizzare portafogli azionari e/o obbligazionari, coprendo sia gli strumenti più semplici che quelli più complessi
- Attribuire le performance di portafoglio (*performance attribution*) ai diversi attori del processo di investimento e alle diverse categorie di asset type
- Elaborare misure ex post (quali gli indicatori di *Risk Adjusted Performance*) su qualunque finestra temporale a partire da dati giornalieri
- Ottimizzare il portafoglio sia a livello strategico che tattico con la possibilità di scegliere tra diverse funzioni obiettivo
- Effettuare analisi multi-livello mediante *drill down* sulle variabili di interesse (dalle asset class alle asset type, fino ai singoli strumenti finanziari)
- Gestire i limiti operativi dei gestori con meccanismi di *alerting*
- Generare reportistica personalizzata per gli utenti e esportare/importare i dati su Excel o in altri formati di uso comune.

PROMETEIA