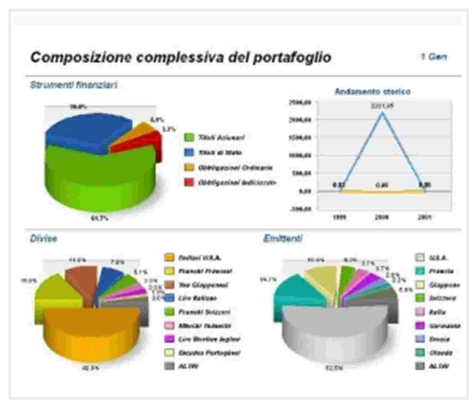
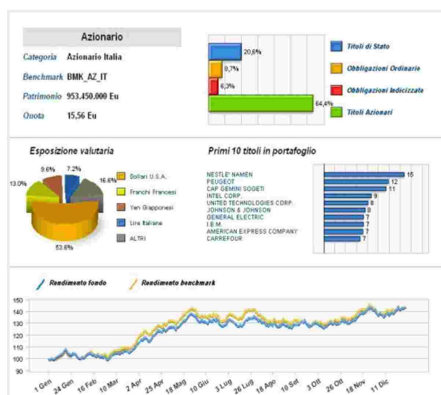


> **Tieni sotto controllo i tuoi investimenti bilanciando rischio e rendimento, per ogni portafoglio e posizione**



Per analizzare, elaborare scenari e simulazioni What-if, prendere decisioni

Definisci una chiara e proficua politica di rischio. Valuta il corretto rischio per i tuoi investimenti. Contieni il rischio d'immagine della tua azienda. Aumenta la trasparenza del modello di rischio per ogni trader.

- 1 - Sviluppa differenti profili di rischio.
- 2 - Costruisci portafogli.
- 3 - Crea scenari e simulazioni.
- 4 - Acquista e vendi secondo profili di rischio predeterminati.
- 5 - Analizza le performance assolute e relative.

Un unico strumento garantisce:

- Importazione automatica dei valori dal sistema di Back-Office aziendale.
- Importazione e storicizzazione di quote di mercato e indici forniti da diverse fonti, anche con differenti codici di anagrafiche.

- Affidabilità dei dati e coerenza nei risultati.
- Velocità di analisi, per vecchi e nuovi portafogli.
- Facile previsione e proiezione dei risultati.
- Stima di differenti scenari, con distribuzione della probabilità di rendimento sull'orizzonte temporale selezionato.

Per le Banche

- Obiettivo: minimizzare possibili perdite.
- Orizzonte temporale: breve termine, effetto immediato.
- Miglior indicatore: VaR ("Value at Risk"), perdita massima per un Portafoglio, con una confidenza del 95%.

Per i fondi pensione

- Obiettivo: garantire il capitale.
- Avversità al rischio.
- Orizzonte temporale: lungo termine.

Per i fondi di investimento:

- Obiettivo: superare un Benchmark di prodotti in termini di rendimento (ReVaR & TE).
- ReVaR, "Relative Value at Risk", massima perdita rispetto al Benchmark con una confidenza del 95%, su un orizzonte temporale di 1-3 mesi.
- TE, "Tracking Error", standard deviation dell'"Excess Return" rispetto al Benchmark.
- Orizzonte temporale: 6 mesi - 3 anni.

Per le fondazioni bancarie

- Obiettivo: garantire il capitale e preservare il circolante per pagamenti periodici e puntuali.
- Orizzonte temporale: ad esempio, 1 anno.
- Il rendimento deve essere superiore al tasso di rivalutazione del TFR / 401K.
- Il rendimento deve essere superiore alla somma dei pagamenti periodici.
- Calcolate la probabilità di Shortfall.

