

# BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer

Financial Risk- und Portfoliomanagement

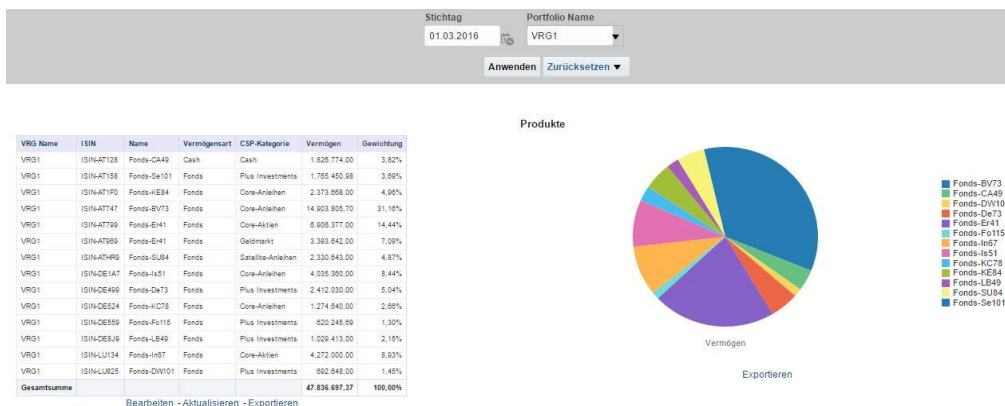
## Die Komplettlösung für Risk- und Portfoliomanager im Veranlagungsbereich

### BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer - Volle Kontrolle über Ihre Finanzportfolios

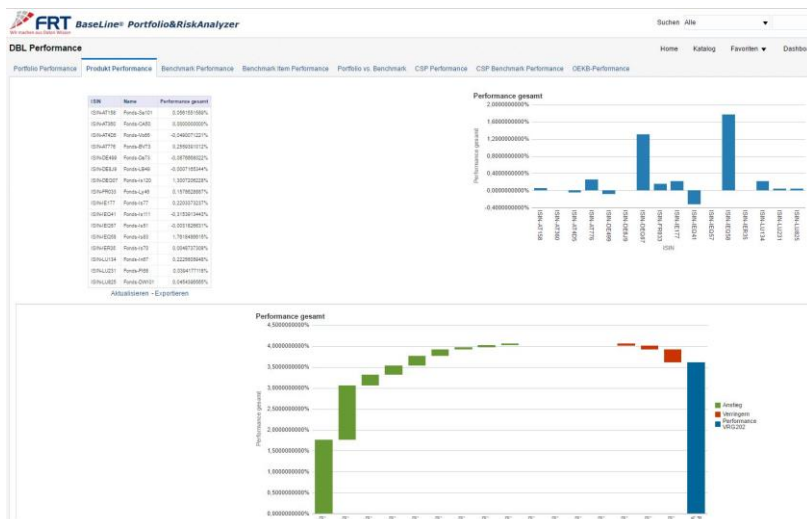
Die umfassende Softwarelösung für das Risiko- und Asset/Portfoliomanagement erlaubt Finanzinstitutionen wie Pensions- und Vorsorgekassen, Vermögensverwaltungen, Privatbanken, Versicherungen etc. die **volle Kontrolle** über ihre veranlagten Vermögen.

### Alle wichtigen Berichte und Analysen auf Knopfdruck

BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer kann für das externe Standard- und AdHoc- Reporting bei Aufsichtsbehörden, Kunden, Partnern und das interne Portfolio- und Riskmanagement eingesetzt werden. Standardberichte wie der aktuelle Vermögensstand, Grenzwert- Risk- und Performanceberechnungen etc. sind **auf Knopfdruck** abrufbar.

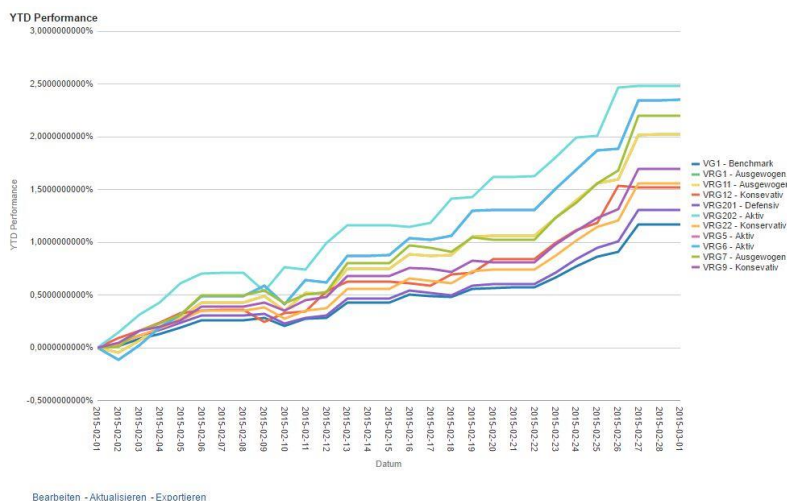


Alle gängigen Finanzprodukte wie Aktien, Derivate, Fonds, Anleihen aber auch Cashveranlagungen und Ausschüttungen, in unterschiedlichen Währungen werden berücksichtigt und gehen in die **unterschiedlichen Kennzahlen** (z.B. VaR Varianz/Kovarianz, VaR historisch, Volatilität) und Performanceberechnungen, Simulationen und Szenarien ein.



## Schnelle Beantwortung bei Ad Hoc Anfragen und Analysen

Mit *BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer* erhalten Asset- und Riskmanager das richtige Instrument, rasch auf **Ad Hoc Anfragen z.B seitens der Finanzbehörden** zu reagieren. Funktionen für die Durchrechnung von Fonds und Dachfonds bis auf Einzeltitel, geben ihnen volle Transparenz über die Veranlagungsstruktur. Mächtige Analysemöglichkeiten z.B für Simulation und „What-if“- Analyse stehen zusätzlich bereit.



## Hohe Datenqualität durch Automatisierung und Plausibilitätschecks

Die Datenübernahme erfolgt weitgehend automatisiert, mit Funktionen für die Prüfung der Korrektheit der Daten. Dies sorgt für eine **hohe Datenqualität**. Beliebige Datenlieferanten wie Bloomberg, Reuters, FundsXML, SWIFT, Software Systems und weiteren Informationsbrokern können integriert werden. Veränderungen in den Veranlagungen werden mit den tatsächlich abgerechneten Umsätzen aus dem Finanzsystem (z.B. SAP) automatisiert übertragen, aber auch schwebende Transaktionen sind berücksichtigt.

## Sicherheit durch Technologie des Marktführers

*BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer* basiert auf mächtigen Standardsoftwarekomponenten der neuesten Softwaretechnologie des weltweit führenden Herstellers (Oracle). Die Lösung ist einfach erweiterbar und ohne Zusatzaufwand auch sofort auf **mobilen Geräten** einsetzbar.

### Funktionen:

- Erfassung beliebiger Veranlagungsportfolios auf Produktebene
- Berechnung des täglichen Vermögensstandes der Veranlagungsportfolios
- Auflösung und Gliederung des Veranlagungsportfolios bis auf Einzeltitel
- Berücksichtigung „schwebender“, noch nicht abgerechneter Transaktionen
- Prüfung gesetzlich vorgegebener bzw. vereinbarter Veranlagungsgrenzwerte
- Benchmark/Performanceberechnung für Portfolios, Produkte, Benchmarks
- Simulation/Modelling, „What-if“ Analyse geplanter Veranlagungen (z.B. ex-Ante)
- Berechnung beliebiger Risikokennzahlen wie VaR, Integration von Statistikfunktionen
- Cash-Flow Darstellung
- Übernahme schon vorberechneter Kennzahlen

## Sie wollen mehr über *BaseLine® Portfolio&RiskAnalyzer* erfahren?

FRT Consulting GmbH

<http://www.frt.at/kontakt/>

Telefon:

Bitte „Baseline“ im Feld „Text“ eintragen

+43 1 373 12 12