



# okular OPTIRIS

Optimierte Risk-Return-Steuerung und Parameterschätzung



# Optimieren Sie Ihre Gesamtbank-Anlagestrategie

Finden Sie Antworten auf die unterschiedlichen Fragestellungen im Rahmen der Gesamtbankallokation bzw. Asset Allocation und okular OPTIRIS gibt Ihnen die Sicherheit, Ihre Entscheidung für eine Zielposition auf fundierter Basis zu treffen.

## Strategische Vermögensanlage im Rahmen der Gesamtbanksteuerung

okular OPTIRIS liefert Ihnen fundierte Steuerungsimpulse zur Definition Ihrer Gesamtbank-Anlagestrategie. Auch in einem volatilen Umfeld verstetigen Sie mit Hilfe von okular OPTIRIS langfristig Ihre Erträge.



## Exakter Überblick über die Zusammensetzung Ihres Vermögens

Komfortable Auswertungen machen die Rendite und das Risiko der einzelnen Risikoklassen transparent und zeigen auf, welche Diversifikationseffekte auf Basis von Korrelationen vorliegen. Identifizieren Sie so Ihre optimale Vermögensbilanz und planen Sie deren schrittweise Umsetzung.

## Analyse und Optimierung der Vermögensbilanz

In okular OPTIRIS können Sie Schätzer für Rendite, Risiko und Korrelation ermitteln und plausibilisieren. Grundlage sind hierbei Zeitreihen von Performance-Indizes, die die einzelnen Risikoklassen repräsentieren. Zur fachlichen Fundierung verfügt die Software zusätzlich über eine Zeitreihenanalyse.

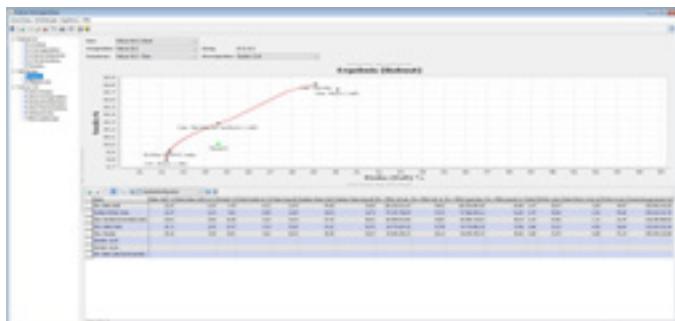
## Risiken ausbalancieren

okular OPTIRIS ermittelt gemäß Ihrer individuellen Risikostrategie die optimale Risiko-Rendite-Position. Der Optimierungsrechner schlägt Ihnen vorteilhaftere Allokationen Ihres Vermögens vor. Sie erhalten so eine Vermögensstruktur, die Risiko und Rendite ausbalanciert.

## Ihre Vorteile auf einen Blick

- ✓ *umfassende Analysemöglichkeiten*
- ✓ *Optimierungslösungen vom Markowitz-Ansatz bis zur robusten Optimierung*
- ✓ *voll integriert in die okular-Familie*

okular OPTIRIS unterstützt Sie bei Szenariorechnungen. Die flexible Parametrisierung bietet Ihnen verschiedene Varianten und Entscheidungsalternativen.



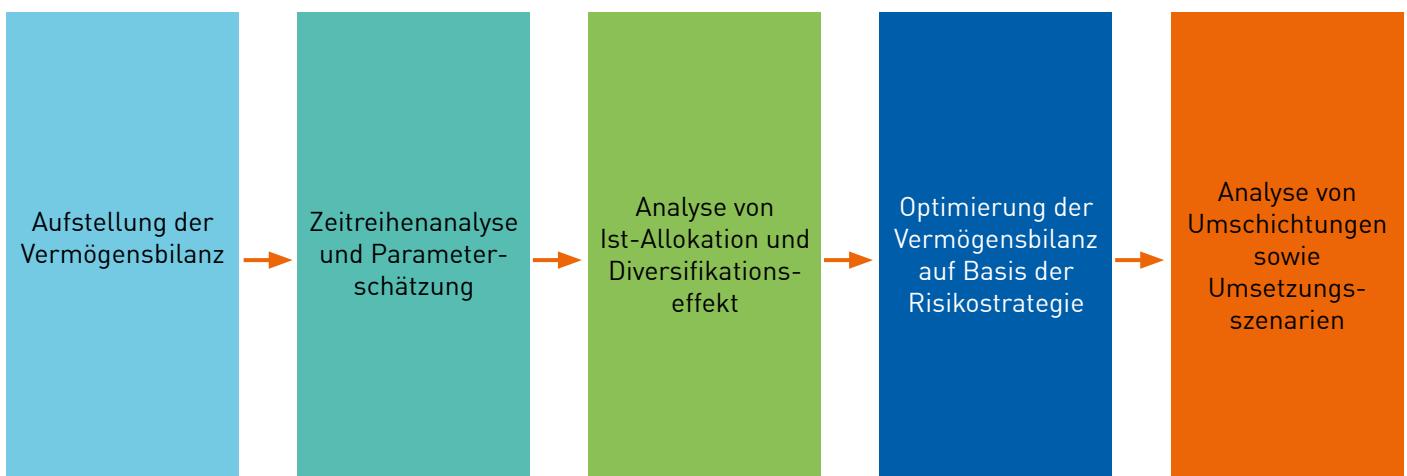
okular OPTIRIS – Optimierungsergebnis mit Darstellung der effizienten Linie



okular OPTIRIS – Analyse der Soll-Ist-Vermögensbilanz inkl. Wertentwicklung

## Flexible Parametrisierung für mehr Sicherheit

okular OPTIRIS unterstützt Sie bei Szenariorechnungen. Die flexible Parametrisierung bietet Ihnen verschiedene Varianten und Entscheidungsalternativen. Dies erlaubt Ihnen die Beantwortung unterschiedlicher Fragestellungen im Rahmen der Gesamtbankallokation bzw. Asset Allocation und gibt Ihnen die Sicherheit, Ihre Entscheidung für eine Zielposition auf fundierter Basis zu treffen.



## Ihre Ansprechpartner

Britta Kortmann  
Methoden- und Produktmanagement

Britta.Kortmann@parcIT.de  
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 219  
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

---



Vertrieb:  
Jochen Kleibrink  
Leiter Vertrieb

Jochen.Kleibrink@parcIT.de  
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 475  
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

parcIT GmbH  
Erftstraße 15  
50672 Köln  
Info@parcIT.de  
www.parcIT.de