

10 Punkte,
auf die Sie bei der
Performanceattribution
achten sollten.

10 Prüfpunkte

- 1 Werden die Eingangsdaten und Analysen auf Vollständigkeit und Konsistenz geprüft und können die Berichte bedarfsweise mit ergänzenden Daten angereichert werden?
- 2 Werden die Eingangsdaten und Analyseergebnisse revisionssicher archiviert und die Prozesse regelmäßig unabhängig geprüft?
- 3 Ist bei Bedarf eine benchmarknahe Neubewertung möglich, damit höchste analytische Präzision garantiert ist?
- 4 Ist die Lösung ausreichend flexibel hinsichtlich der Attributionsverfahren (Brinson- oder Multi-Faktor-Analysen), der Analyseintervalle (monatlich bis täglich) und der Analysetiefe (Assetklassen, Einzeltitel)?
- 5 Können Sie in den Analysemodellen diejenigen Messpunkte definieren, die für den Investitionsprozess relevant sind?
- 6 Bilden die Modelle Anlageinstrumente und Assetklassen in der gewünschten Breite und Tiefe ab?
- 7 Können Derivate entsprechend ihrem Einsatzzweck (Asset-Allokation, Durationssteuerung, Absicherung) in die Beitragsanalysen einbezogen werden?
- 8 Steht ausreichend qualifiziertes Personal zur Verfügung, um die Analyseergebnisse bei Bedarf auf Augenhöhe mit den Entscheidern zu erörtern?
- 9 Ist das Reporting ausreichend flexibel, um hinsichtlich Inhalt, Aufbau und Layout auch auf individuelle Wünsche eingehen zu können?
- 10 Greifen Sie auf die besten am Markt verfügbaren Modelle und Systeme zurück, werden diese laufend weiterentwickelt und ist damit Ihre Investition über mehrere Jahre sicher?

IDS GmbH – Analysis and Reporting Services
Königinstraße 28, 80802 München, Deutschland

Weitere Informationen über IDS und alle
unsere Produkte finden Sie auf
www.InvestmentDataServices.com

© IDS GmbH – Analysis and Reporting Services
Alle Rechte vorbehalten. Alle Angaben ohne Gewähr.
Februar 2012