

Analyse und Optimierung der Strategischen Asset Allokation eines rentenlastigen Anlageportfolios

Kunde / Branche	Versorgungswerk
Projektbeschreibung	<p>Analyse und Optimierung der Strategischen Asset Allokation eines rentenlastigen Anlageportfolios</p> <ul style="list-style-type: none"> • Abbildung der Ist-Situation auf Marktebene • Abbildung der bekannten Restriktionen • Berücksichtigung von Kapital-Zu- und Abflüssen • Analyse der Ist-Situation auf Marktebene in Bezug auf Planrendite und Worst-Case Rendite (Konfidenzintervall) in verschiedenen Szenarien (z.B.: Basisszenario, Inflation, Deflation) mit einem Planungshorizont von 10 Jahren • Durchführung einer Optimierung auf Marktebene unter den Restriktionen in Hinblick auf Zielrendite, Planrendite und Worst-Case Rendite • Interpretation der Analyse und Optimierung im Hinblick auf eine etwaige Neuausrichtung bzw. Überarbeitung der bestehenden Asset Allokation
Leistung	<ul style="list-style-type: none"> • Portfolio-Abbildung, -Simulation und -Optimierung sowie Entwicklung von Maßnahmen
Technologie	Excel, VBA, Proprietäre Bewertungssysteme, Portfoliooptimierungstool VSA
Fachlicher Input	Portfolioadvisory- und Portfoliomanagement-Knowhow
Umfang	1-2 Senior Berater, 3-4 Wochen
Tags	Strategische Asset Allokation, Portfoliooptimierung, Szenariosimulation