

OLYMPIC[®]

BANKING SYSTEM

OLY-PAM

*Portfolio & Asset
Management System*

INTRODUZIONE

OLY-PAM (Portfolio & Asset Management System) è lo strumento di lavoro per eccellenza dei gestori patrimoniali. È un prodotto che grazie alla sua ricchezza di funzioni è rivolto sia ai gestori patrimoniali, sia ai responsabili della clientela.

Tramite OLY-PAM viene offerta ai gestori patrimoniali una vasta scelta di funzionalità che si basano sulla ricchezza del sistema OLYMPIC Banking System, nonché un'interfaccia utente molto potente e di facile uso.

MODULO INTEGRATO IN TEMPO REALE

OLY-PAM è parte integrante del prodotto OLYMPIC Banking System. Ciò significa che i gestori patrimoniali possono servirsi di tutti i dati disponibili in OLYMPIC Banking System e questo permette loro un'elaborazione delle informazioni in tempo reale.

OLY-PAM, grazie alla sua architettura tecnica orientata oggetto, è completamente integrabile. Le diverse fasi che compongono la procedura di gestione (negoziazione, esecuzione, contabilizzazione) si svolgono in tempo reale. La perfetta temporizzazione di OLY-PAM è garantita da un'architettura "N-Tier", da un modello di base dati relazionale, dalla programmazione Java e da sistemi ERI di duplicazione dati.

COPERTURA FUNZIONALE

OLY-PAM è in grado di soddisfare tutte le esigenze dei gestori patrimoniali, grazie alle numerose funzioni disponibili, elencate qui di seguito:

- **Strategie d'investimento**
- **Liste degli investimenti consigliati**
- **Gestione del rischio**
- **Obblighi e restrizioni d'investimento**
- **Ribilanciamento dei portafogli**
- **Imputazione dell'attivo e generazione automatica degli ordini**
- **Ordini collettivi**
- **Valutazioni dei portafogli**
- **Calcolo delle prestazioni**
- **Interrogazioni ed analisi in tempo reale**

ARCHITETTURA FUNZIONALE DI OLY-PAM

Consultazione PAM	Clienti & Posizioni	Portafogli & Posizioni	Strumenti & Posizioni
Gestione Patrimoniale	Definizione delle strategie	Collegamento dei portafogli alle strategie	Ribilanciamento dei portafogli
	Applicazione norme legali	Collegamento dei clienti alle norme legali	Investimenti consigliati
	Generazione degli ordini	Reporting relativo alla prestazione	Valutazioni clienti
Parametrizzazione PAM	Gestione del sistema	Definizioni del sistema	Parametri locali del sistema

STRATEGIE

Le strategie rappresentano il punto cruciale all'interno della procedura della gestione patrimoniale. Consentono al gestore di situarsi rispetto al suo piano d'investimento e di adottare eventuali contromisure quali, per esempio, la copertura rischi, la speculazione, il riposizionamento, la conservazione o l'investimento.

La prestazione di un portafoglio dipende soprattutto dalla ripartizione del patrimonio che, nel contesto internazionale di oggi, diventa sempre più complessa a causa del gran numero di piazze e di valute disponibili.

OLY-PAM dispone di un nuovo modo di ordinare e raggruppare gli investimenti: assi, gerarchie, filtri e strategie a più dimensioni.

Oltre alla classica strategia a due dimensioni, che combina paese e tipo d'investimento, OLY-PAM permette oramai di definire delle rappresentazioni grafiche a più dimensioni, lasciando però ai gestori un certo margine tattico che permette loro di seguire la propria filosofia d'investimento e quindi di non dover necessariamente aderire completamente alla ripartizione consigliata.

Con OLY-PAM, i gestori hanno in mano lo strumento per poter misurare l'impatto della loro strategia tramite verifica, a video, di un singolo portafoglio o di un insieme di portafogli collegati fra loro. Possono visualizzare la ripartizione a partire dallo strumento stesso (azioni, obbligazioni, conti correnti, ecc.).

Ai gestori viene pure offerta la possibilità di simulare un cambio di strategia, cioè di rapportare ad una nuova strategia, ma senza doverlo collegare, un portafoglio già associato ad una strategia precedente.

Le verifiche possono essere fatte anche sulle strategie che non sono state definite originariamente.

PRESTAZIONE

OLY-PAM rispetta gli standard di mercato per quanto riguarda la valutazione delle prestazioni. Difatti, queste ultime vengono calcolate a livello delle singole posizioni, permettendo così di fornire gli elementi necessari per l'analisi del cash flow e dell'attribuzione della prestazione. Il calcolo della prestazione realizzata e la possibilità di proiettare la valutazione della stessa, rappresentano un altro grande vantaggio di OLY-PAM. I calcoli possono essere eseguiti sia in tempo reale (per un intervallo qualsiasi), sia periodicamente e senza limitazione alcuna delle divise utilizzate.

La prestazione viene calcolata a livello delle posizioni, ma il calcolo può essere allargato anche ad altri livelli (categoria patrimoniale, valuta, paese, portafoglio, cliente, gestore, ecc.).

RIBILANCIAMENTO

OLY-PAM offre un processo informatizzato estremamente flessibile per il ribilanciamento delle posizioni associate alle strategie definite. Il processo di ribilanciamento di OLY-PAM fa uso di liste fisse create dagli analisti finanziari interni o di consigli provenienti dall'esterno. Per ottenere un'efficienza ottimale, questi investimenti consigliati vengono integrati da OLY-PAM nel processo di gestione globale, così da permettere una scelta degli strumenti.

OLYMPIC Banking System dispone già di programmi d'aggiornamento dei dati delle società finanziarie più conosciute (Telekurs, Bloomberg, Reuters, ecc.). Ciononostante, esiste la possibilità di creare dei collegamenti con altre interfacce per dati finanziari.

Il processo di ribilanciamento genera automaticamente gli ordini

d'acquisto e di vendita, che possono essere ancora modificati manualmente in caso di necessità.

ORDINI

Tramite OLY-PAM si possono inserire degli ordini per tutti gli strumenti definiti in OLYMPIC Banking System. L'utente può inserire, attraverso una sola operazione, degli ordini globali per un gruppo di clienti. È possibile, per esempio, aumentare o ridurre di X percento una determinata posizione, oppure rettificare la posizione per raggiungere una certa percentuale. Tutti gli obblighi d'investimento, indipendentemente dal loro tipo, vengono presi in considerazione nella generazione degli ordini, ciononostante, l'utente dispone della necessaria autonomia per modificare o annullare tali ordini.

Gli ordini inseriti tramite OLY-PAM seguono lo stesso flusso di quelli inseriti direttamente in OLYMPIC Banking System. Ciò permette a OLY-PAM di visualizzare in tempo reale e indipendentemente dalla loro provenienza, tutti gli ordini presenti nel sistema.

VALUTAZIONE

OLY-PAM dispone di una vasta scelta di fattori di valutazione. Una volta stabilito il contesto e la struttura di lavoro, si procede, dapprima, alla valutazione a livello delle posizioni, per poi passare ad altri livelli (categorie patrimoniali, divise, paesi, portafogli clienti, ecc.).

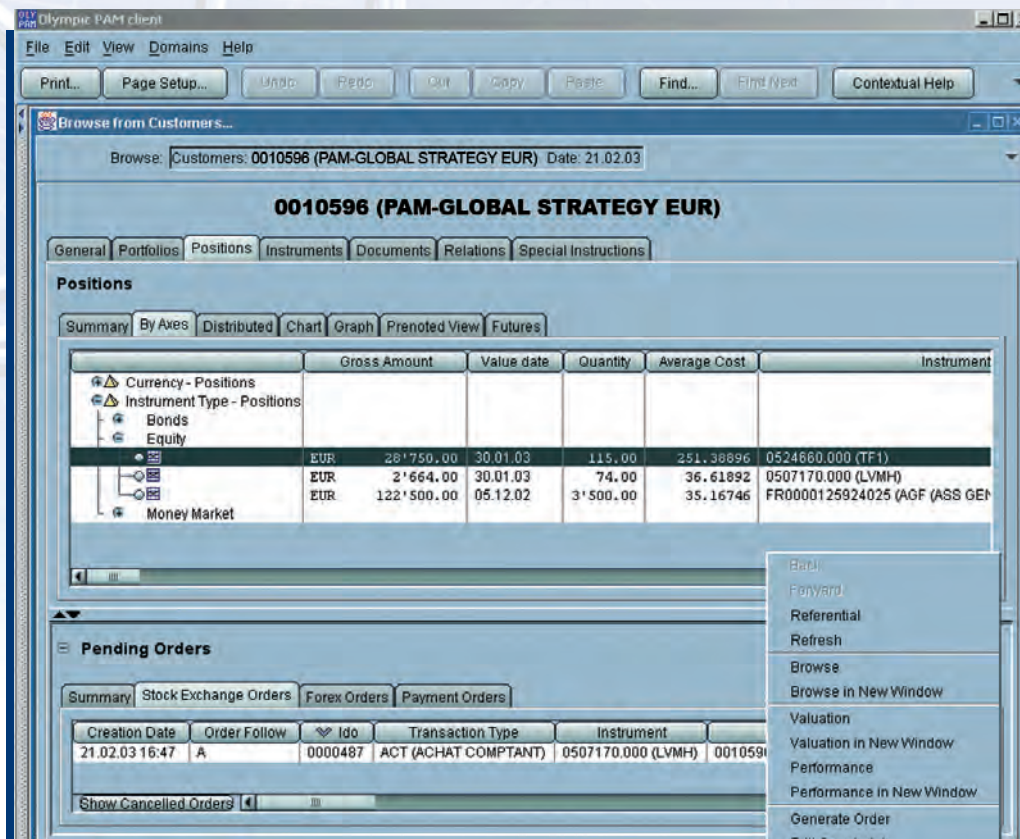
La valutazione, effettuata nella valuta desiderata, può avvenire in tempo reale o essere retrodatata. Bastano pochi secondi per generare i grafici.

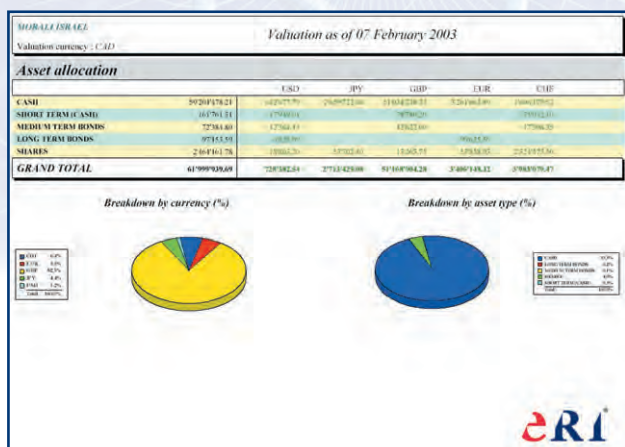
NAVIGAZIONE

Stile di gestione, strumento, valuta, importo, zona geografica,...sono tutti criteri che con OLY-PAM possono essere combinati fra di loro per trovare una risposta efficace al bisogno di strutturare le svariate politiche e strategie d'investimento.

OLY-PAM utilizza le più recenti tecnologie informatiche ed è in grado di offrire il massimo della comodità nella navigazione e visualizzazione.

Le rappresentazioni, le manipolazioni, i controlli e le registrazioni di dati facilitati sono altrettante misure complementari che permettono di ridurre la ripetitività e la complessità che scaturiscono da una gestione di numerosi portafogli.





REPORTING

OLYMPIC Client Reporting offre la possibilità di impostare in maniera flessibile rapporti di alta qualità.

ERI può esservi d'aiuto nel definire ed implementare rapporti specifici, sfruttando la ricchezza d'informazioni della base dei dati di OLYMPIC.

SICUREZZA

La sicurezza di OLY-PAM è implementata in un contesto più ampio, ossia quello dell'amministrazione del sistema OLYMPIC, per garantire una sicurezza ed una protezione dei dati totali.

La sicurezza viene applicata sia a livello funzionale che a livello dei dati. I diritti d'accesso e le autorizzazioni vengono conferiti per una determinata area, con eventuali limitazioni supplementari concernenti certe attività specifiche, in linea con la struttura della banca.

ERI

ERI è una società internazionale specializzata nella concezione, sviluppo, distribuzione e supporto del software bancario integrato ed in tempo reale OLYMPIC Banking System.

Presente sulle maggiori piazze finanziarie europee, ERI si distingue per la sua politica: quella di essere sempre vicino ai suoi clienti. A conferma di ciò, la troviamo a Ginevra, Londra, Lugano, Lussemburgo, Parigi, Singapore e Zurigo.

Una delle priorità di ERI, che conta più di 500 collaboratori altamente qualificati, è quella di mantenere sempre alta la qualità del servizio mettendo a disposizione dei clienti, a loro piena soddisfazione, tutti quegli elementi che possono contribuire al successo del loro progetto: consulenza, gestione di progetti, analisi, sviluppo, parametrizzazione, supporto e manutenzione.

Ad oggi, più di 300 clienti di 50 paesi in Europa, USA, America del Sud, Giappone ed Asia, hanno già scelto OLYMPIC Banking System.

Per contattare ERI

Email: eri@eri.ch Internet: www.eri.ch www.olympic.ch

Marketing-Sales Email

GINEVRA	Tel. + 41	22 342 12 29	Fax + 41	22 343 09 12	gvamkt@gva-eri.ch
LONDRA	Tel. + 44	207 947 4008	Fax + 44	207 947 4127	ldnmkt@ldn-eri.co.uk
LUGANO	Tel. + 41	91 913 95 00	Fax + 41	91 913 95 01	lugmkt@lug-eri.ch
LUSSEMBURGO	Tel. + 352	46 10 50 1	Fax + 352	22 42 22	luxmkt@lux-eri.lu
PARIGI	Tel. + 33	1 55 37 85 85	Fax + 33	1 45 74 36 37	parmkt@par-eri.fr
SINGAPORE	Tel. + 65	6622 5959	Fax + 65	6622 5960	asiamkt@sin-eri.sg
ZURIGO	Tel. + 41	44 204 93 00	Fax + 41	44 204 93 01	zrhmk@zrh-eri.ch

