



# SLG AllocationEngine

Risiko

Ertrag

Optimierung



[www.slg.co.at](http://www.slg.co.at)

**Wir lassen die  
Zahnräder Ihres  
Anlageportfolios  
perfekt  
ineinandergreifen!**

---

Optimieren Sie Ihr Anlageportfolio selbständig. Reden Sie auf Augenhöhe mit Fondsmanagern, wenn es um die Diversifizierung Ihres Anlageportfolios geht.

Mit der SLG AllocationEngine ist es möglich, das Portfoliorisiko zu berechnen sowie eine Optimierung der Gewichte der Indizes, die ein Anlageportfolio repräsentieren, durchzuführen. Die Methodik orientiert sich dabei an der Portfoliotheorie von Harry M. Markowitz.

Sie können die verwendeten Index-, Fonds- und Kursdaten selbst bestimmen und jederzeit anpassen. Analysieren Sie Ihr Anlageportfolio selbst, ohne dabei auf andere angewiesen zu sein.

Dabei können Sie Fragen beantworten wie:

- ▲ Ist mein Portfolio effizient bzw. wie weit ist es von der Effizienzlinie entfernt?
  - ▲ Wie müssten die Anlagen umgeschichtet werden, um denselben Ertrag mit weniger Risiko zu erzielen?
  - ▲ Welche Asset-Allokation wäre vorzunehmen, um bei einem bestimmten Risikoappetit den maximalen Ertrag zu erzielen?
  - ▲ Wie groß ist die Verlustwahrscheinlichkeit des aktuellen Portfolios?
-

# Die SLG AllocationEngine



## Technik und Methoden – einfach und schnell

Die SLG AllocationEngine verfügt über eine leicht bedienbare Excel-Oberfläche. Die Ergebnisse werden in einem Excel-Bericht dargestellt. Im Hintergrund arbeitet ein leistungsstarker Rechenkern.

Mit den von SLG bereitgestellten Marktdaten (Volatilitäten und Korrelationen) oder eigener Marktdaten wird das Portfoliorisiko mittels Varianz-Kovarianz-Ansatz berechnet.

Das Tool bietet verschiedene Optimierungsvarianten:

- ▲ Maximierung des Ertrags bei gegebener Portfoliovolatilität
- ▲ Minimierung der Volatilität bei gegebenem erwarteten Ertrag
- ▲ Minimale Volatilität
- ▲ Maximaler Ertrag
- ▲ Minimale Verlustwahrscheinlichkeit

Dabei können beliebig viele Nebenbedingungen (z. B. maximaler Aktienanteil) individuell erfasst werden, um so den Vorgaben einer Anlagerichtlinie entsprechen zu können.



## Bericht und Bedingungen

Der Nutzer sieht auf einen Blick das Portfoliorisiko, den erwarteten Ertrag und die Verlustwahrscheinlichkeit des aktuellen Portfolios (1). Die Effizienzlinie, die aus allen ausgewählten Indizes berechnet wird, zeigt den Vergleich zum aktuellen Portfolio (2).

Für die Optimierung können Anlagegrenzen pro Index (3) und weitere Nebenbedingungen individuell angegeben werden (4). Die Optimierung führt entsprechend der gewählten Methodik (5) zu einer neuen Gewichtung (6).

