

IC Meeting - Beispiel

Ziel der Zusammenarbeit

SIM Research unterstützt das CIO Team des Kunden taktische Anlageentscheide innerhalb der bestehenden Vorgaben/Bandbreiten zu fällen.

Erwartungen an SIM Research

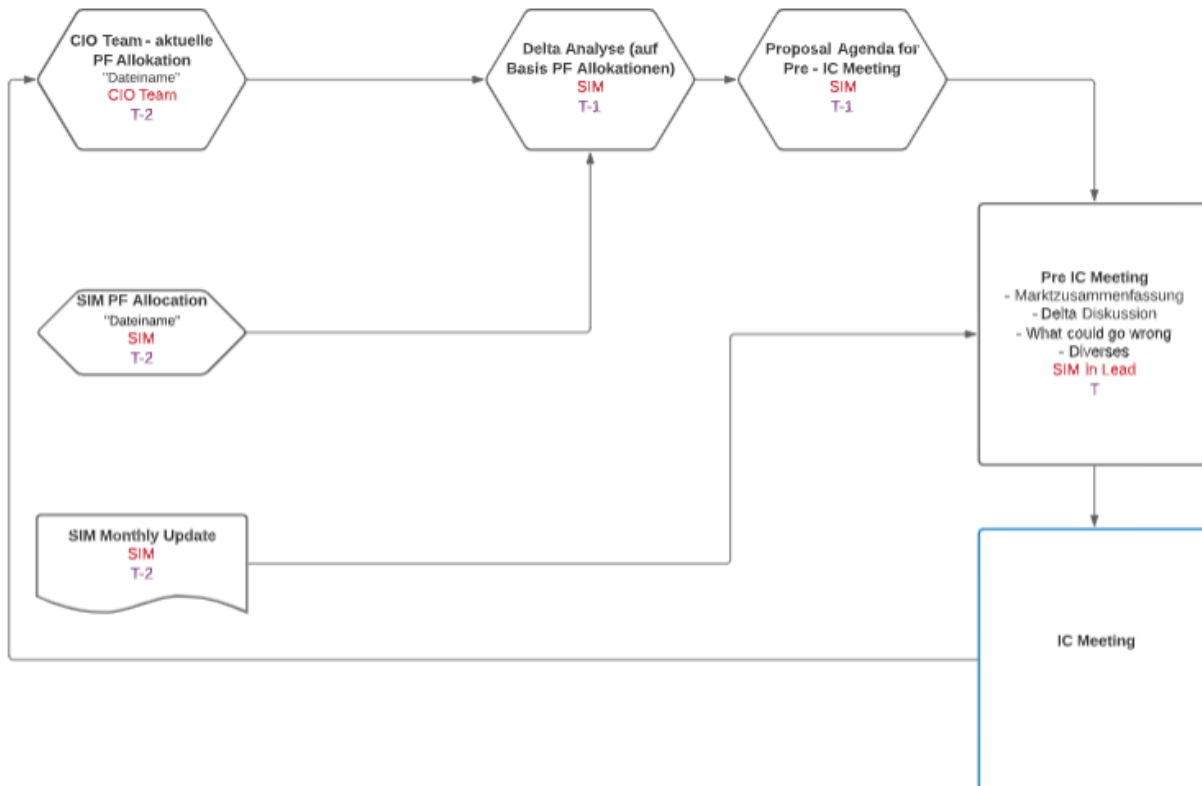
1. SIM Research macht einen eigenen Allokationsvorschlag und kann Abweichungen oder Veränderungen begründen. Begründen meint, dass die Aussagen modellbasiert überprüfbar (fundiert) sind und betrachtete Größen transparent gemacht werden können.
2. SIM Research macht eine verbale Zusammenfassung der wichtigsten Marktveränderungen. Diese Diskussion soll interaktiv erfolgen, um alle offenen Fragen des Kunden zu beantworten.
3. SIM Research bereitet die Informationen und Meetings so vor, dass das CIO Team möglichst wenig Zusatzbelastung in Form von Verantwortlichkeiten und Vorbereitungsarbeiten hat.
4. SIM Research passt sich den Bedürfnissen des CIO Teams an und optimiert Prozesse, Diskussionen und Outputs dementsprechend.

Arbeitsweise

Das CIO Team und SIM Research trifft sich monatlich zu einer ca. einstündigen Diskussion (e-Meeting). SIM Research stellt ein monatliches Markt-Update bis am 12. jedes Monats zur Verfügung und macht eine eigene Einschätzung der taktischen Asset Allokation. SIM Research stellt eine Agenda für die Diskussion bereit.

Die Agenda basiert auf dem Output vom SIM Monthly Update und dem Marktrisiko Cockpit und von der Delta-Analyse zwischen der Kunden-TAA und der SIM Research TAA.

Informationsfluss und Verantwortlichkeiten



Anmerkung: SIM Research ist nicht Teil des IC Meetings (blauer Kasten).

Vorbereitung – Dokumente

SIM Research Inputs:

- SIM Monthly Update
- Marktrisiko Cockpit
- Hilfsdatei Asset Allocation (vom Kunden definierte Struktur)
- Agenda für das Meeting, inklusive allfälliger Zusatzlektüre

CIO Team Input:

- Hilfsdatei Asset Allocation (aktuelles PF oder eigene neue Einschätzung)

Vorbereitung – Ablauf

1. SIM Research schickt Monthly Update an CIO Team (T-2).
2. SIM Research erarbeitet eine Einschätzung des neuen Portfolios in der Datei „Hilfsdatei Asset Allokation (T-2).
3. CIO Team macht Einschätzung des neuen Portfolios in der Datei «Hilfsdatei Asset Allokation oder teilt das aktuelle Portfolio mit SIM Research (T-2).
4. SIM Research erstellt eine Übersicht der folgenden Deltas:
 - In der Positionierung der Asset Allokation (Hilfsdatei Asset Allokation) zwischen dem CIO Team und SIM Research.
 - In der Positionierung der Asset Allokation (Hilfsdatei Asset Allokation) zwischen SIM Research (T-30) und SIM Research (T).
5. SIM Research erstellt eine Agenda für das Pre IC Meeting und stellt sowohl Agenda wie alle Dokumente dem CIO Team zur Verfügung.

Pre IC Meeting – Struktur der Agenda

- Kurzes Markt-Highlight von SIM Research
- Diskussion der Delta-Analyse
 - Kongruenz zwischen Markt-Highlight und SIM Research Portfolioallokation
 - Unterschiede zwischen Kunde und SIM Research
 - Grundsätzliche Veränderungen in der Risikowahrnehmung und der daraus folgenden Allokationsveränderungen

Koordination und Nachbesprechung der Meetings

Die Koordination und Nachbesprechung zwischen dem Kunden und SIM Research findet telefonisch statt. Zu klären sind hierbei Optimierungen im Ablauf, Aufnahme von Themen, welche den Kunden interessieren und Terminkoordinationen.