

CASE STUDY



MoneyController ha scelto FIDA per disporre di un database estremamente completo e sviluppare algoritmi per l'ottimizzazione e la valutazione del rischio di portafoglio.

Scenario

MoneyController aveva la necessità di estendere la copertura del database della sua piattaforma, sia in termini di quantità di strumenti che di profondità delle informazioni. Voleva inoltre un sistema di computazione integrata per l'analisi e l'ottimizzazione di portafoglio.

Soluzione

FIDA ha creato un database dedicato ed un webservice che fa fluire i dati direttamente all'applicazione di MoneyController. Il Database attualmente è dotato di oltre 18.000 strumenti (MOT ed obbligazioni TLX – fondi – ETF – mercati azionari italiani ed esteri), aggiornati a cadenza giornaliera e con uno storico di almeno 5 anni.

	Obiettivo da te indicato	Risultato dell'analisi	Scostamento
Rendimento atteso	5 %	3.17 %	🟡
Rischio (V.A.R. 1 anno)	5 %	21.32 %	🔴
Rischio (Deviazione standard)	6.06 %	16.45 %	🔴
Rischio (Indice di Sharpe)	0.45	0.05	🔴

Risk free: 2.27%

■ <10%
 ■ 10%-35%
 ■ 35%-50%
 ■ >50%

- ▶ Rendimento atteso
- ▶ Deviazione standard
- ▶ Cono di capitalizzazione
- ▶ Indice di Sharpe
- ▶ V.A.R. a 15 giorni - 3 mesi - 1 anno
- ▶ Duration
- ▶ Duration modificata

Ottimizza il tuo portafoglio

Descrizione	ISIN	Valuta
BGF Emerging Europe C2 EUR	LU0147383045	EUR
BGF Emerging Europe E2 EUR	LU0099830497	EUR
BGF Emerging Market Bond A2 \$	LU0200680600	USD
BGF Emerging Market Bond A2 EUR	LU0200683885	EUR
BGF Emerging Market Bond B2 \$	LU0200681160	USD
BGF Emerging Market Bond C2 \$	LU0200681673	USD
BGF Emerging Market Bond E2 \$	LU0200681830	USD
BGF Emerging Market Bond E2 EUR	LU0200684180	EUR
BGF Emerging Markets A2 \$	LU0047713382	USD
BGF Emerging Markets A2 EUR	LU0171275786	EUR

Pagina 4 di 42

Le principali funzioni della piattaforma sono:

- Strumento di ricerca
- Strumenti di costruzione del portafoglio ed i principali indicatori di computazione statistica
- Ottimizzazione di portafoglio grazie all'MVO efficient frontier

Eravamo in ricerca da tempo di un Partner Globale in grado di fornirci tutti quegli elementi utili per la crescita del nostro prodotto. Con FIDA, ci siamo riusciti.

Un database onnicomprensivo, condizione essenziale per il processo di calcolo, la flessibilità degli sviluppatori di dare vita alle nostre idee, un'assistenza costante e la capacità di fronteggiare notevoli incrementi di traffico fanno di FIDA il nostro partner ideale.

Bruno Mazzola
Business Development Manager

Vantaggi

Grazie alla cooperazione con FIDA, Moneycontroller è ora in grado di fornire ai suoi clienti una piattaforma che può render possibile l'applicazione di complesse elaborazioni su un database molto esteso e costruito al fine di garantire la massima flessibilità in un'interfaccia di facile utilizzo.