



Julius Bär

Projekt „Einführung neuer Titelarten im Kundenreporting der Bank Julius Bär

Roger Dicech

BMPI Trends in Client Reporting
Zürich, 2. Oktober 2008

Ausgangslage

- Altes Klassifizierungssystem: Rund 20 Haupttitelarten
- Fehlende Anlageklassen für
 - Alternative Anlagen
 - Strukturierte Produkte
 - Immobilienanlagen
- Anlagefonds
 - Keine Möglichkeit zur Klassifizierung von Anlagefonds
 - Funktion zur Aufteilung von Anlagefonds in Anlageklassen und Währungen vorhanden („Fonds-Splitting“)

Anforderungen der verschiedenen Stakeholders



Gewählter Lösungsansatz

- Die Kundensicht beinhaltet eine Kombination von juristischer und Risiko-Sicht
- Reduktion von ursprünglich rund 20 Haupttitelarten auf 12 Gruppen (+1 technische)
- Schaffen einer neuen Gruppe für **Alternative Anlagen** mit zusätzlichen Untergruppen
- Schaffen zusätzlicher Untergruppen zur genaueren Zuteilung von **Anlagefonds** (z.B. Aktienfonds)
- Aufgabe “**Anlagefonds-Splitting**”
- Schaffen zusätzlicher Untergruppen für **Strukturierte Produkte**

Muster-Report

Julius Bär

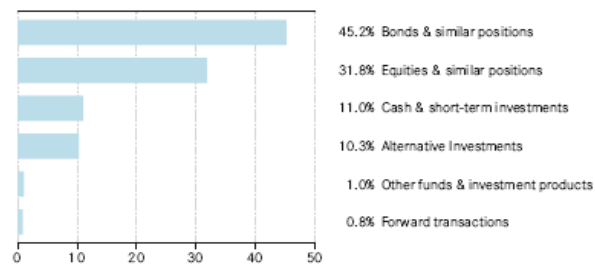
Asset Allocation

Portfolio 1111.1111 11.11
Reporting as per 30.7.2008, in JPY

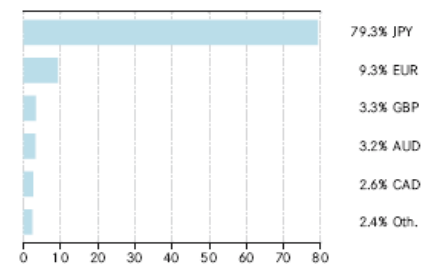
Asset Allocation

	Total	%	JPY %	EUR %	GBP %	AUD %	CAD %	Oth. %
Cash & short-term investments	333'730'044	11.0	4.7	2.7			2.6	1.0
Forward transactions	25'019'089	0.8	39.7	-17.0				-21.8
Bonds & similar positions	1'370'619'379	45.2	13.8	8.7	3.3	3.2		16.2
Equities & similar positions	964'187'861	31.8	21.1	7.0				3.7
Alternative Investments	312'345'316	10.3		7.9				2.4
Other funds & investment products	29'405'717	1.0						1.0
Total Value	3'035'307'406	100.0	79.3	9.3	3.3	3.2	2.6	2.4
Whereof accrued interest	27'693'279							

Allocation by Asset Class



Allocation by Currency

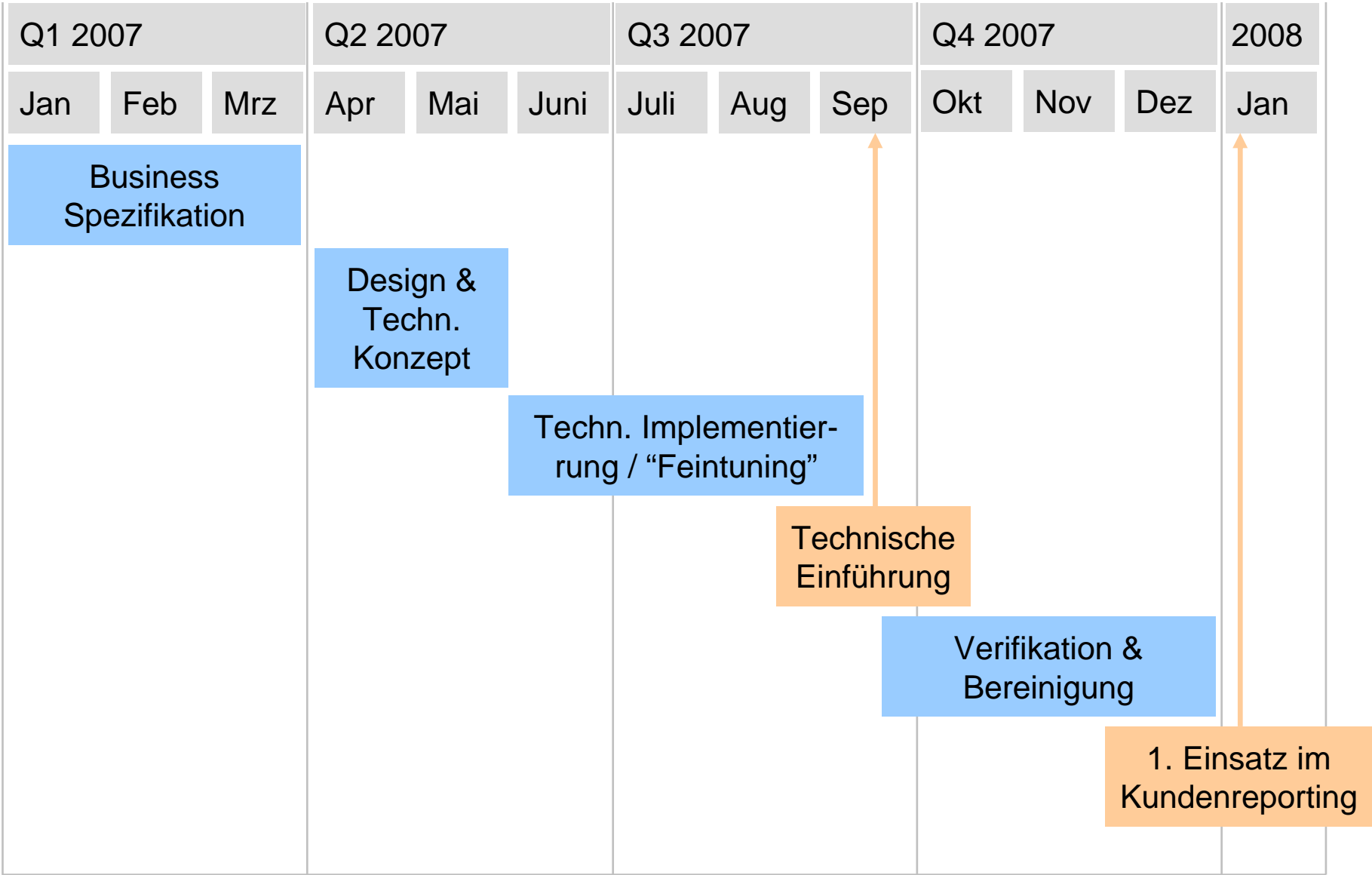


Exchange Rates

1 JPY	159.845527 EUR
1 GBP	221.884356 JPY
1 AUD	94.051617 JPY
1 JPY	109.139319 CAD

Page 2 of 19 | For explanations see last page

Projektplan



Herausforderungen & Grenzen

- Bedürfnisse und Anforderungen der verschiedenen Stakeholder auf eine Linie zu bringen
- Finanzinformationen für die Gruppen Anlagefonds und Strukturierte Produkte: Datenverfügbarkeit und -qualität
- Finden von Lösungen für unerwartete Problemstellungen
- Aufsetzen der erforderlichen Prozesse und Verantwortlichkeiten für den täglichen Unterhalt der neuen Gliederungsstruktur

Julius Bär