



# 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

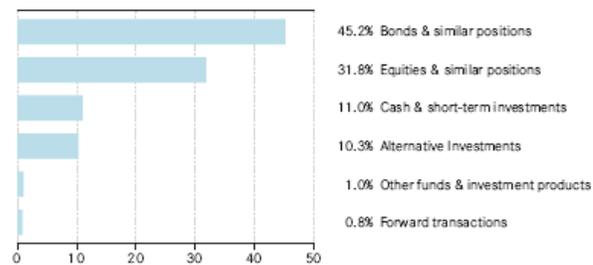
## Asset Allocation

Portfolio 1111.1111 11.11  
Reporting as per 30.7.2008, in JPY

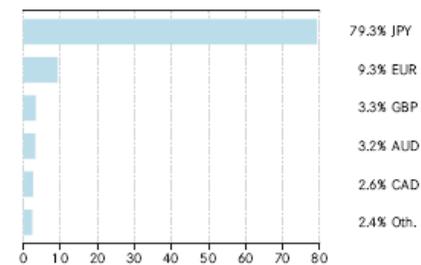
### Asset Allocation

	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
<b>Total Value</b>	<b>3'035'307'406</b>	<b>100.0</b>	<b>79.3</b>	<b>9.3</b>	<b>3.3</b>	<b>3.2</b>	<b>2.6</b>	<b>2.4</b>
Whereof accrued interest	27'693'279							

### Allocation by Asset Class



### Allocation by Currency

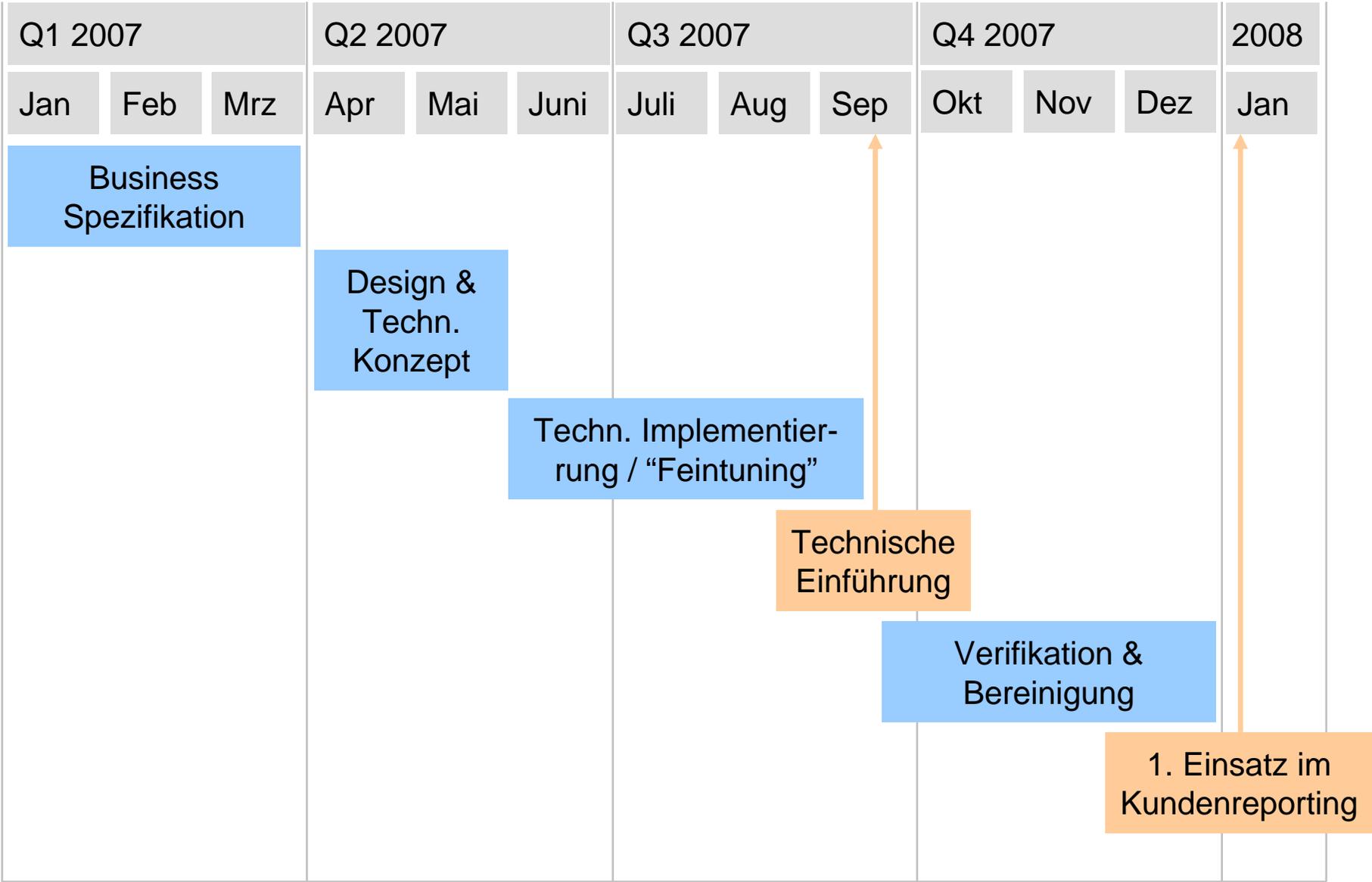


### Exchange Rates

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