



**Robo Advisory und
quantitatives Asset-Management**

Unsere Services im Überblick

Robo Advisory und quantitatives Asset-Management

Wir bieten Cutting-Edge-Lösungen in drei Bereichen an:

Robo Advisory, quantitative Depotanalyse und quantitatives Asset-Management

Robo Advisory

- Testing, Modellierung und Validierung
- Implementierung und Softwaredesign
- Vorstudien und Testing
- Digitale und quantitative Lösungen zu regulatorischen Fragen

Quantitative Depotanalyse

- Renditeprognosen und Simulations-Tools
- Instrumenten-Universen Analysen (z.B. ETFs) und Performance-Analysen
- Digitale und quantitative Lösungen zu regulatorischen Fragen

Quantitatives Asset-Management

- Entwicklung von Tools für Asset-Manager
- Modellierung, Validierung und Implementierung
- Vorstudien und Testing
- Unterstützung bei regulatorischen Themen

Robo Advisor Algorithmics-Tool

Robo Advisor Algorithmics ist ein Tool, das Modelle und Methoden enthält, die in Robo Advisors und dem quantitativen Asset-Management verwendet werden. Diese können mit individuellen Assets simuliert und Backtesting-Analysen mit verschiedenen Performancemaßen durchgeführt werden.

Modellierung

Modelle und Methoden sind individualisier- und erweiterbar und somit an unterschiedliche Bedürfnisse anpassbar

Validierung

Unabhängige Validierung der Methodik eines Robo Advisor anhand verschiedener Methoden und Modelle



Vorstudien

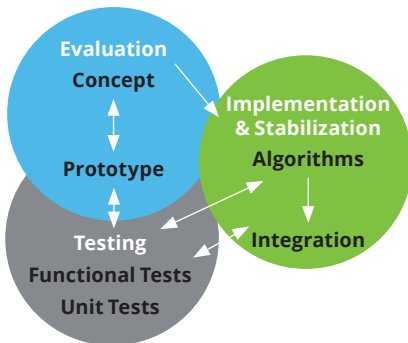
Unabhängige Analyse und Testing von Portfolio-managementstrategien im Rahmen von Vorstudien inklusive „Make or buy“-Entscheidungen

Implementierung

Fachliche Grundlage zur Implementierung eines Robo Advisor

Beispielprojekt

Unser Team hat kürzlich den produktiven Kern eines State-of-the-Art Robo Advisor für eine große Bank implementiert.



Das Projekt kombiniert quantitative Modellierung und professionelles Softwaredesign

In einem ersten Schritt wurde das mathematische Konzept der quantitativen Algorithmen evaluiert und durch Prototyp-Algorithmen getestet. Dies ermöglichte einen effizienten Implementierungsprozess der getesteten und validierten Methoden und Modelle in einer Produktionssprache.

Der Projekt-Scope umfasste die mathematische Evaluierung, Implementierung und das Testing der Kernalgorithmen eines Full-Scale Robo Advisor einschließlich automatisierter Risikofaktorenschätzung und deren Abhängigkeit, Simulation und Portfoliooptimierung unter verschiedenen Randbedingungen.

Kontakt



Frank Müller

Partner

Tel: + (0)69 75695 6225

Mobil: + (0)151 5807 0379

frmueller@deloitte.de



Dr. Thomas Moosbrucker

Partner

Tel: +(0)211 8772 3864

Mobil: +(0)151 5800 0102

tmoosbrucker@deloitte.de



Dr. Manuel Wittke

Senior Manager

Tel: + (0)211 8772 3540

Mobil: + (0)151 5800 4708

mwittke@deloitte.de



Dr. Mikhail Beketov

Senior Manager

Tel: +(0)30 25468 5943

Mobil: +(0)151 5807 1324

mbeketov@deloitte.de

Deloitte.

Diese Veröffentlichung enthält ausschließlich allgemeine Informationen, die nicht geeignet sind, den besonderen Umständen des Einzelfalls gerecht zu werden, und ist nicht dazu bestimmt, Grundlage für wirtschaftliche oder sonstige Entscheidungen zu sein. Weder die Deloitte GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft noch Deloitte Touche Tohmatsu Limited, noch ihre Mitgliedsunternehmen oder deren verbundene Unternehmen (insgesamt das „Deloitte Netzwerk“) erbringen mittels dieser Veröffentlichung professionelle Beratungs- oder Dienstleistungen. Keines der Mitgliedsunternehmen des Deloitte Netzwerks ist verantwortlich für Verluste jedweder Art, die irgendetwas im Vertrauen auf diese Veröffentlichung erlitten hat.

Deloitte bezieht sich auf Deloitte Touche Tohmatsu Limited („DTTL“), eine „private company limited by guarantee“ (Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach britischem Recht), ihr Netzwerk von Mitgliedsunternehmen und ihre verbundenen Unternehmen. DTTL und jedes ihrer Mitgliedsunternehmen sind rechtlich selbstständig und unabhängig. DTTL (auch „Deloitte Global“ genannt) erbringt selbst keine Leistungen gegenüber Mandanten. Eine detailliertere Beschreibung von DTTL und ihren Mitgliedsunternehmen finden Sie auf www.deloitte.com/de/UeberUns.

Deloitte erbringt Dienstleistungen in den Bereichen Wirtschaftsprüfung, Risk Advisory, Steuerberatung, Financial Advisory und Consulting für Unternehmen und Institutionen aus allen Wirtschaftszweigen; Rechtsberatung wird in Deutschland von Deloitte Legal erbracht. Mit einem weltweiten Netzwerk von Mitgliedsgesellschaften in mehr als 150 Ländern verbindet Deloitte herausragende Kompetenz mit erstklassigen Leistungen und unterstützt Kunden bei der Lösung ihrer komplexen unternehmerischen Herausforderungen. Making an impact that matters – für rund 264.000 Mitarbeiter von Deloitte ist dies gemeinsames Leitbild und individueller Anspruch zugleich.