

Neue EIPC Initiative „Guidance for Recipients of Investment Reporting“ (GRIP)

Dimitri Senik

7. Oktober 2004

*connectedthinking

PRICEWATERHOUSECOOPERS 

Neue EIPC Initiative „Guidance for Recipients of Investment Reporting“

Struktur der Guidance

Ausgangslage:

Nachfrage der Kunden nach einem transparenten und umfassenden Investment Management Reporting

Zielgruppe:

- institutionelle Kunden
- High-Net-Worth Individuals

Umfang:

Die Guidance betrifft das Investment Reporting für bestehende Vermögensverwaltungskunden

Zeitplan:

Die Guidance soll bis Ende 2005 erarbeitet und verabschiedet werden

Weshalb das EIPC?

- Als ein Sub-Committee des Investment Performance Council (IPC) und ein unabhängiges Gremium stellt das EIPC eine grössere Akzeptanz in der Investment Management Branche sicher
- Das EIPC ermöglicht eine grössere geographische Vertretung (setzt sich aus Repräsentanten von mehr als 20 europäischen Ländern zusammen)
- Gute Infrastruktur und Verfügbarkeit der Ressourcen. Die Guidance soll von einer spezialisierten Arbeitsgruppe innerhalb vom EIPC erarbeitet werden (Vertreter von 6 Ländern)

Inhalt der Guidance

Fragebogen-Format (Fragen, welche Kunden an ihre Manager bzgl. Reporting stellen sollten / können) bzgl. folgender Bereiche und Komponente des Reportings :

- Investment-Prozess (Prozess der Anlageentscheidungen, Umsetzung der Anlagestrategie, etc.)
- Zugrundeliegende Portfolio-Daten (bspw. Quelle der Preise)
- Performance (bspw. Attribution-Analyse, Methodologie, wie MWR vs. TWR)
- Fees (transparente Offenlegung der Gebühren und Kosten, deren Behandlung bei der Performance-Berechnung, etc.)
- Compliance (bspw. Einhaltung der Kundenanlagerichtlinien, Kontrollprozesse)
- Risk Management-Prozess
- Composite-Vergleiche (bspw. Vergleich mit Peer-Portfolios im Composite)
- Marktanalysen, etc.

Ihre Meinung?

© 2004 PricewaterhouseCoopers. All rights reserved. PricewaterhouseCoopers refers to the network of member firms of PricewaterhouseCoopers International Limited, each of which is a separate and independent legal entity.

PRICEWATERHOUSECOOPERS 