



# Portfolio Analysis

Andrea Ierardi - Darya Shlyk



# Descrizione del business case

## Descrizione di sintesi

**L'obiettivo:** sviluppare uno strumento grafico di supporto al processo decisionale del business del cliente in un contesto dei mercati finanziari.

**Come:** creazione di una dashboard interattiva che risponde alle principali esigenze informative del cliente mettendo in rilievo gli indicatori di prestazione chiave e facendo ricorso a dei grafici per agevolare una corretta ed immediata analisi della situazione di mercato.

### In Pratica:

- Stima dei valori di interesse:
  - *Balance Value*
  - *Market Value*
  - *Net Income*
- Estrazione delle informazioni qualitative e quantitative dei portafogli
- Costruzione di elementi di visualizzazione e grafici

# Descrizione del business case

## Approccio seguito

### Strumenti:

- Power BI per il preprocessing dei dati e per la costruzione della dashboard

### Dati:

- Dati Qualitativi (Data, Nazione, Portafoglio ecc.)
- Dati Numerici (Codice interno titolo, Valori storici ecc.)

#### Quantitative

- Codice interno titolo
- Valore nominale Iniziale
- Valore nominale Finale
- Valore di carico LC Iniziale
- Valore di carico LC Finale
- Valore storico LC Iniziale
- Valore storico LC Finale
- Valore teor/mer LC Iniziale
- Valore teor/mer LC Finale
- Sovracopertura
- Redditi Totale

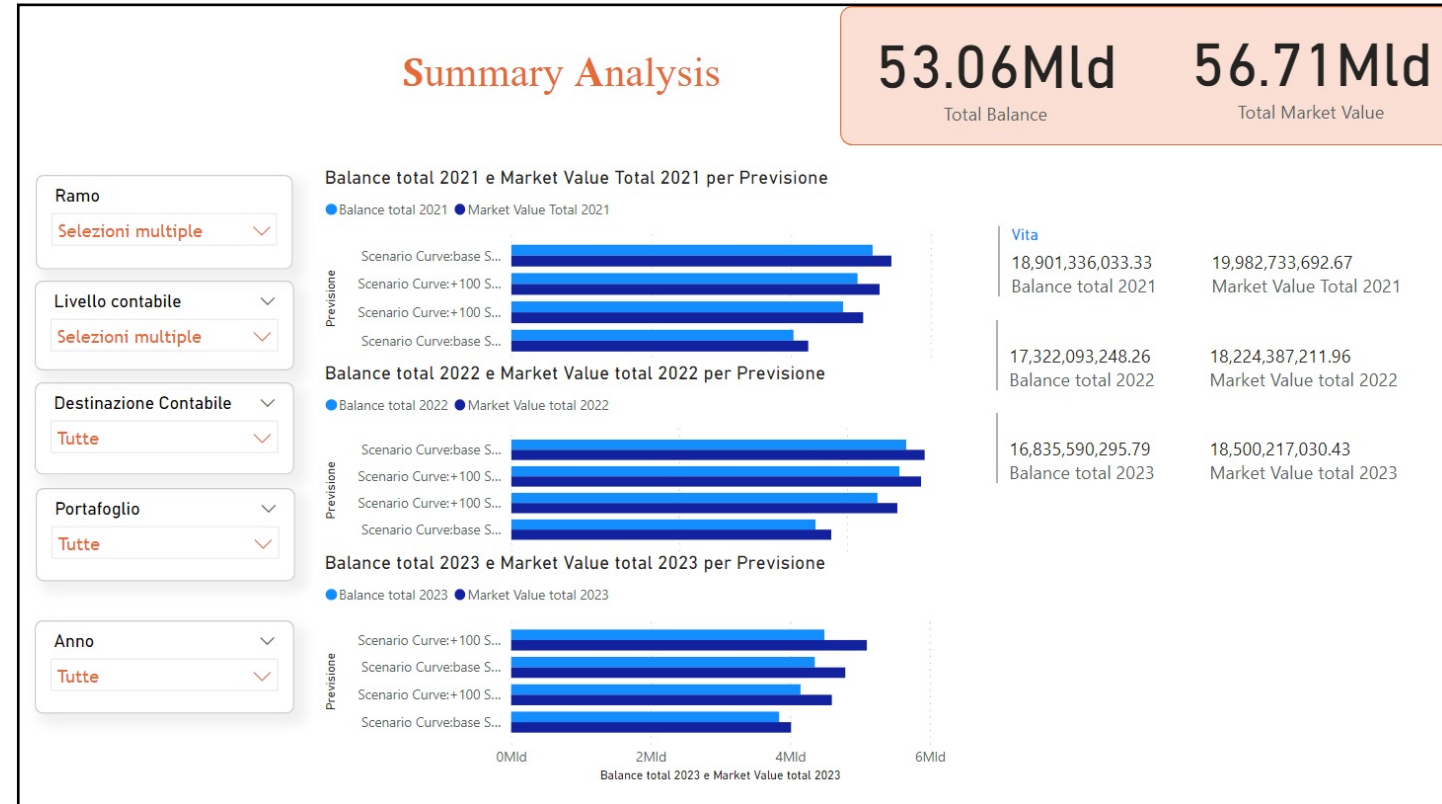
#### Qualitative

- Codice interno titolo
- Naz IE
- Data Estinz.
- Settore
- Cod. Ptf
- Portafoglio
- Ramo
- Tipo Bilancio
- Livello contabile
- Data Inizio
- Data Fine
- Divisa
- Tipo Tasso
- Tipologia Asset Sofia
- Destinazione Contabile
- Comparto
- Nome Previsione
- Previsione
- Rating Moody's
- Stage

### Traformazioni:

- Estrazione dei periodi T, T+1, T+2 da Data di Inizio
- Stima dei valori di Bilancio, Mercato per ogni periodo
- Calcolo di misure per il portafoglio degli asset:
  - General Balance value
  - Net Income
  - Maturity
- Calcolo dei valori aggregati di Bilancio e di Mercato per ogni periodo

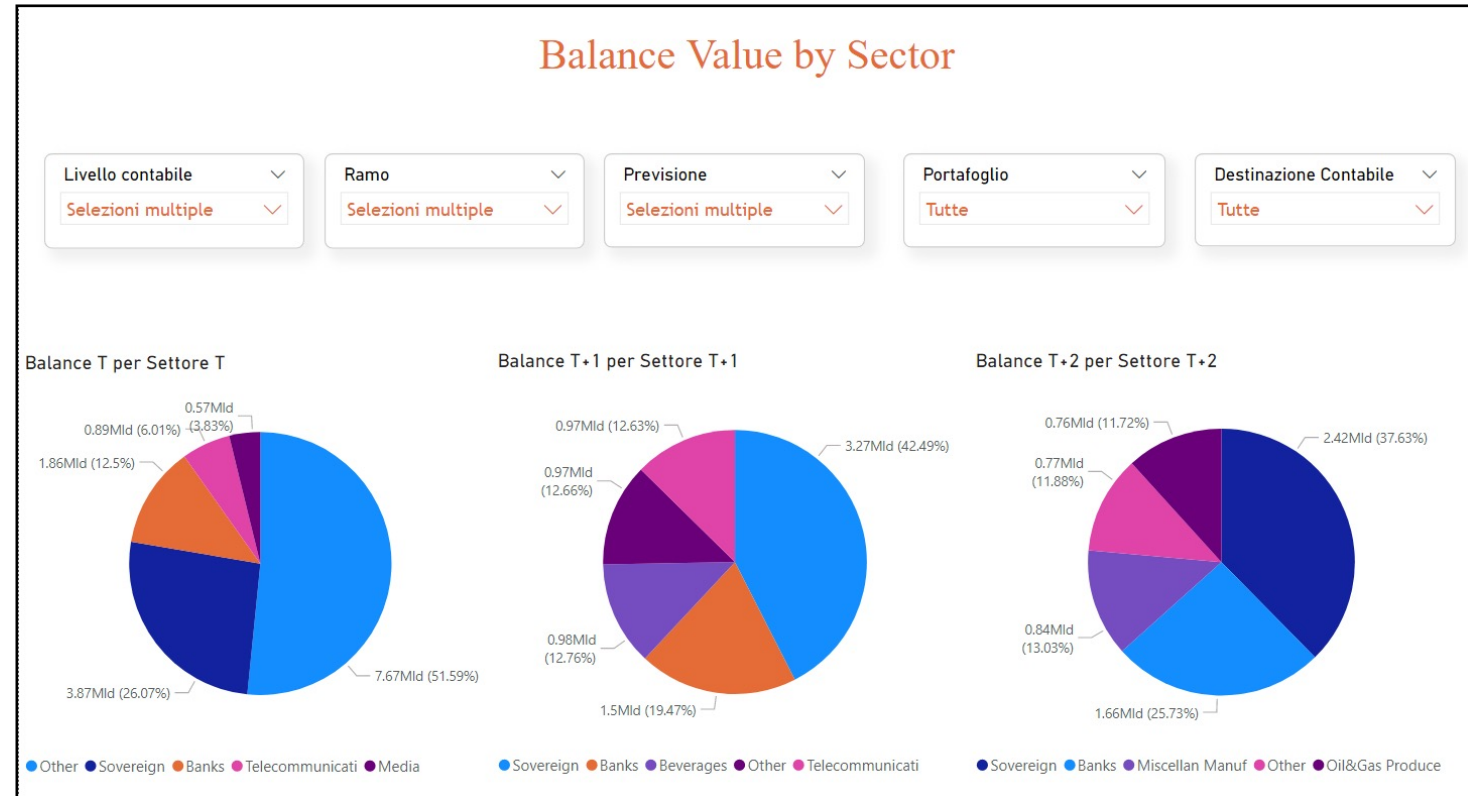
# Dashboard Summary Analysis



- Sintesi dei principali valori di Bilancio e di Mercato
- Confronto immediato dei valori di bilancio e di mercato
- Valutazione delle performance degli strumenti presenti in portafoglio in diversi scenari.

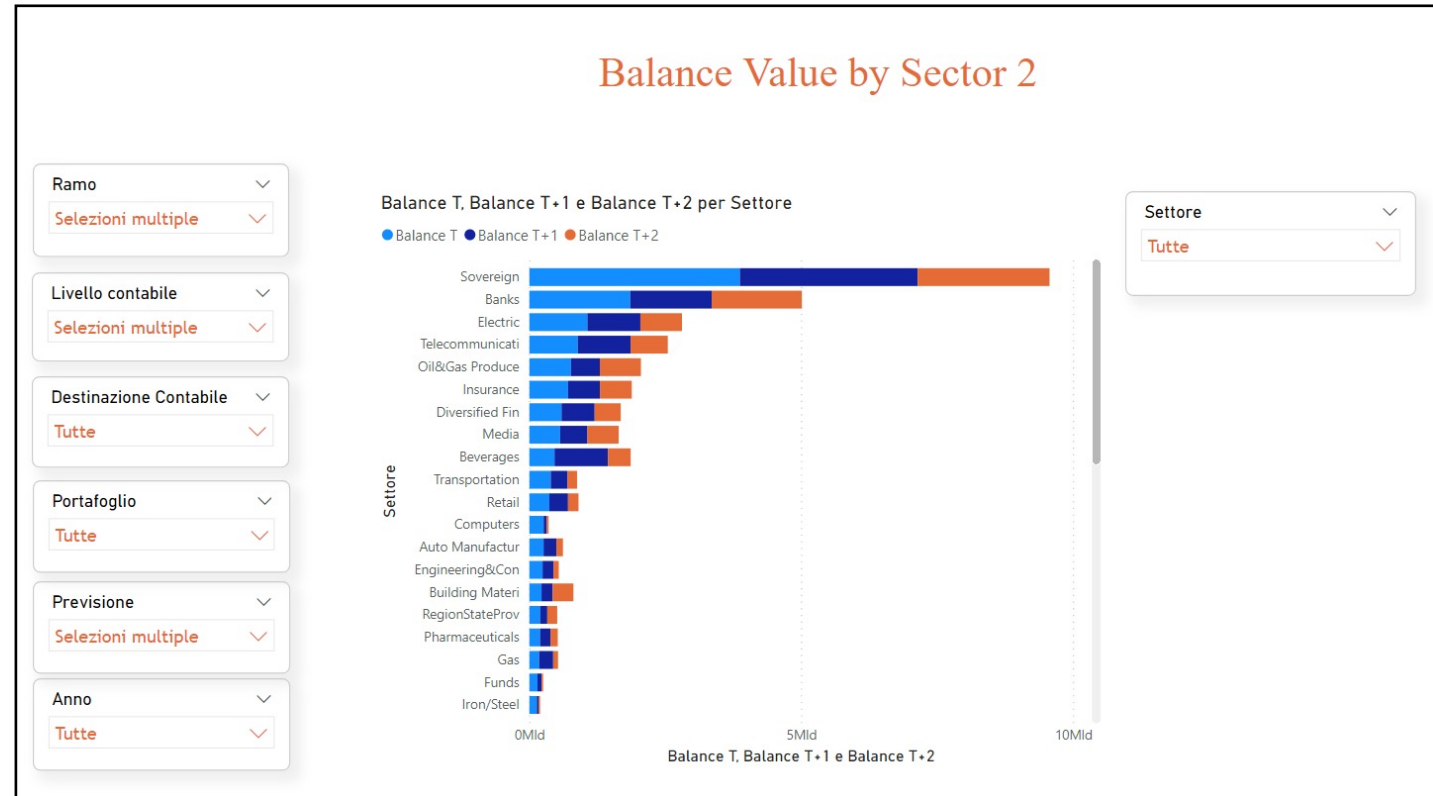


# Dashboard Balance Value by Sector (1 / 2)



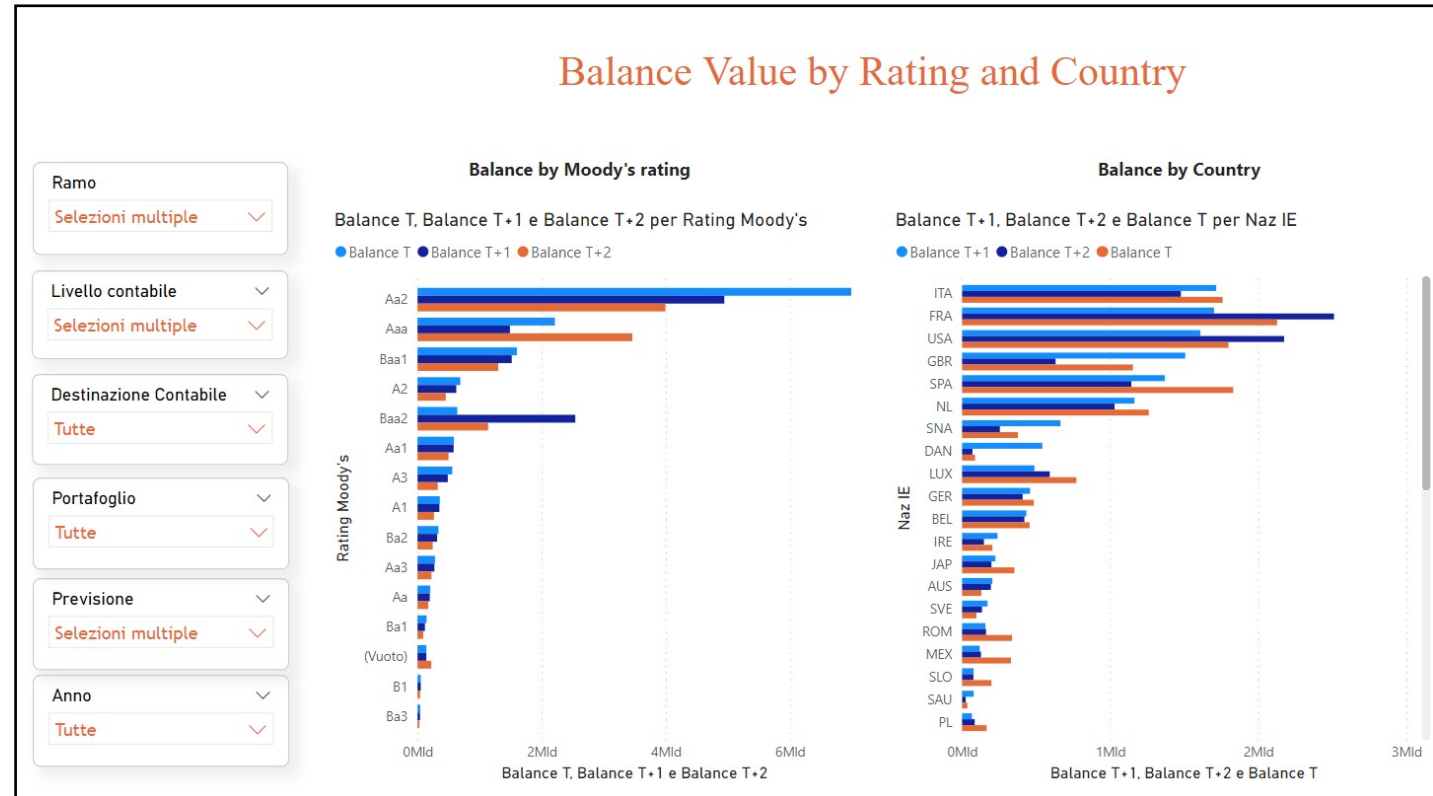
- Valori di bilancio con focus sul settore di riferimento.
- I grafici a torta supportano la raffigurazione dei 5 migliori risultati e i relativi settori.

# Dashboard Balance Value by Sector (2 / 2)



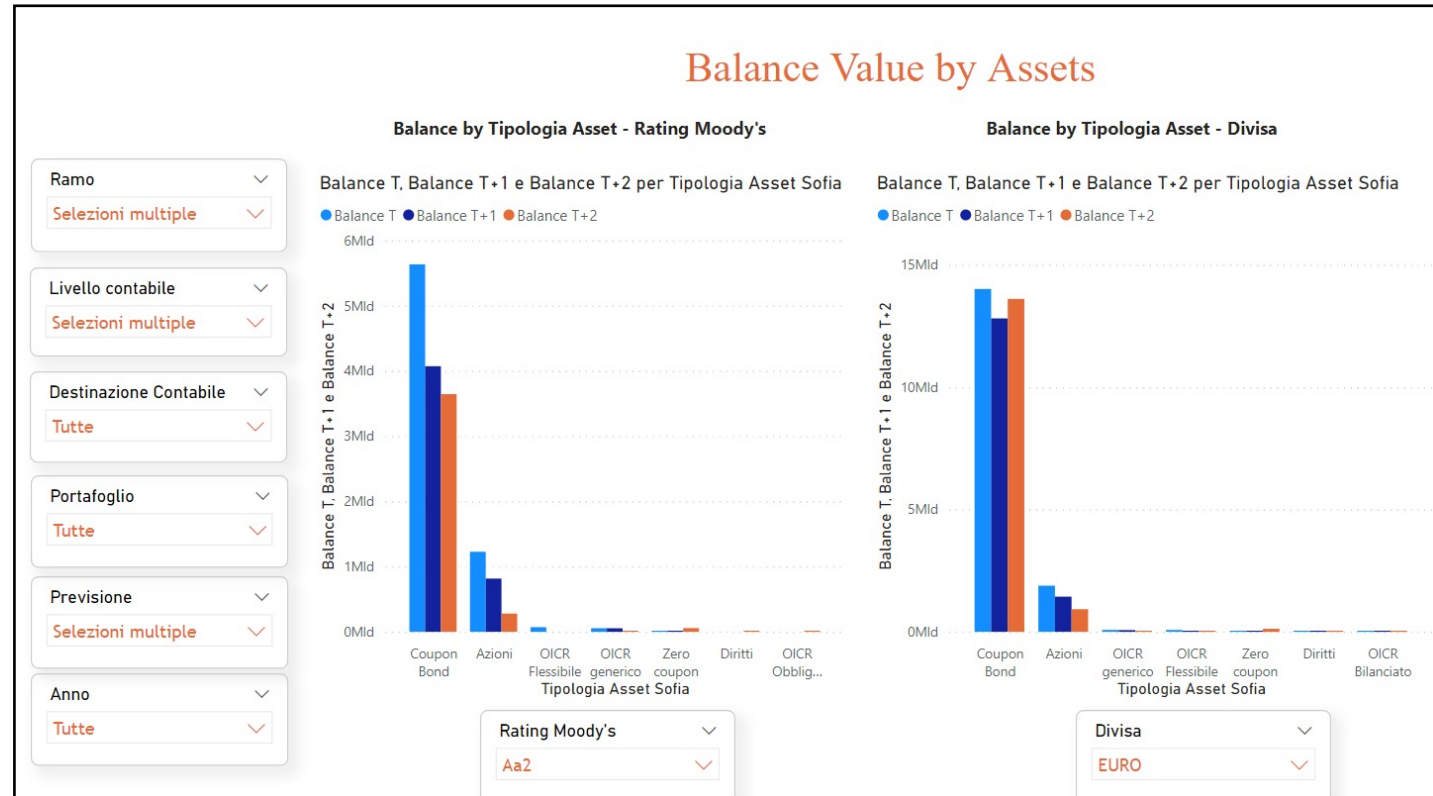
- Zoom sui valori di bilancio nel settore di riferimento grazie ad un grafico a barre.
- Possibilità di selezione di settori multipli o unici per un'analisi più specifica

# Dashboard by Rating and Country



- Analisi comparata dei dati di bilancio per il Moody's rating
- Analisi dei dati di bilancio per paese

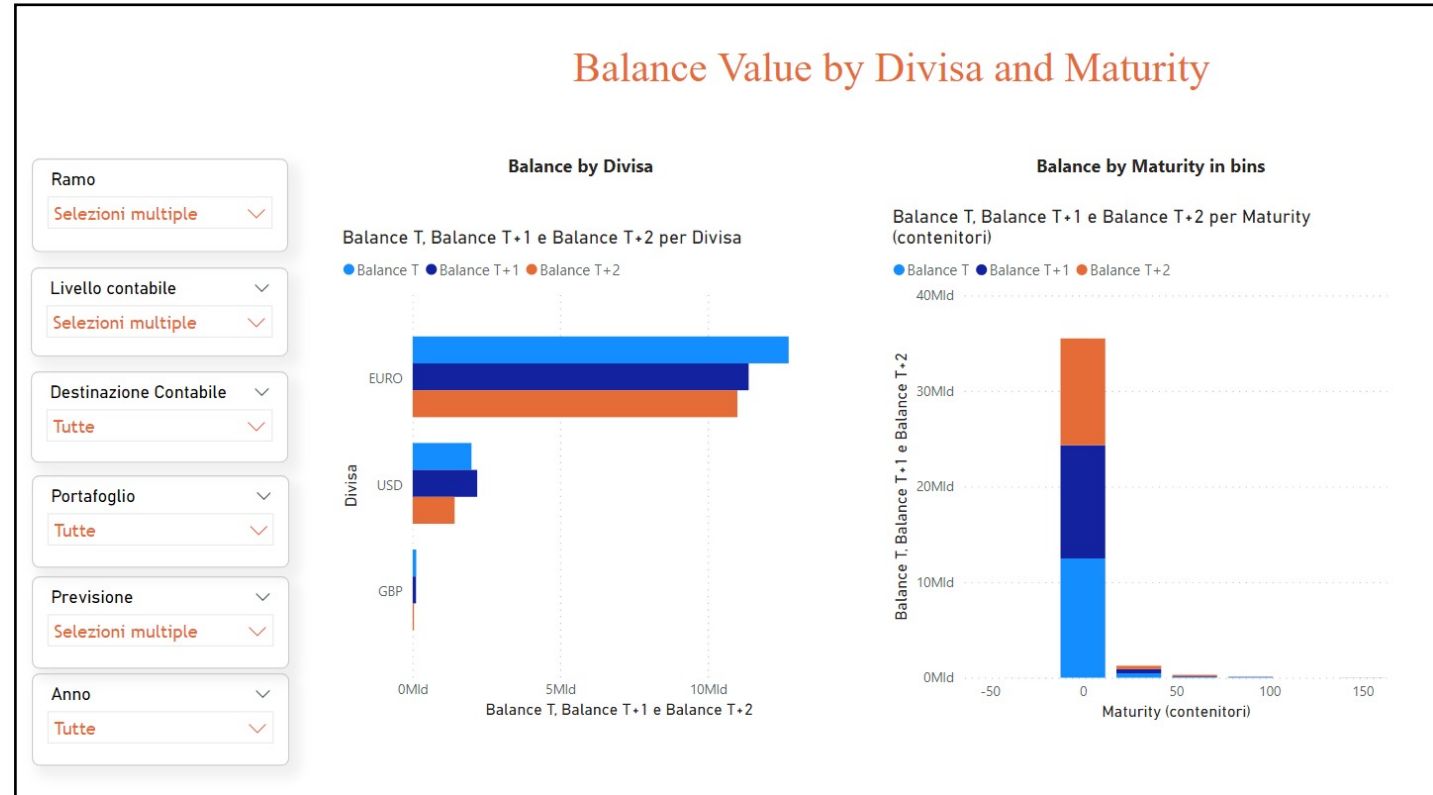
# Dashboard Balance Value by Assets



- Rappresentazione della performance degli strumenti finanziari per tipologia e divisa
- Possibilità di selezione di rating e divisa per i singoli grafici per un'analisi più specifica



# Dashboard Balance Value by Divisa and Maturity



- Visualizzazione dei valori di bilancio in riferimento alla divisa
- Visualizzazione dei valori di bilancio per maturità con divisione in contenitori (bins)



Grazie per l'attenzione!