



okular ZIABRIS KPM-EG

Modul Kreditportfoliomodell für Eigengeschäfte



Stabiler Erfolg für das Eigengeschäft KPM-EG in ZIABRIS



Credit Value at Risk Ihres Eigenhandels

Den Erträgen im Eigengeschäft stehen nicht zu vernachlässigende Adressrisiken gegenüber. Das Modul Kreditportfoliomodell für Eigengeschäfte in okular ZIABRIS macht die Migrations- und Spreadrisiken in Ihrem Eigengeschäftsportfolio transparent und ermöglicht Ihnen eine zielgerichtete Steuerung.

Barwertige (wertorientierte) Steuerung

Für die barwertige (wertorientierte) Steuerung werden die erwartete Netto-Performance, der Credit Value at Risk (CVaR) und der Expected Shortfall (ES) des Eigengeschäftsbestandes ausgewiesen. Im Zusammenspiel mit weiteren Berichtsgrößen können Sie schnell und zielgerichtet die Auswirkungen des Adressrisikos im Eigengeschäft auf Ihre Vermögensposition analysieren. So erkennen Sie Risikotreiber, identifizieren Klumpenrisiken und steuern Ihr Risiko gezielt.

okular ZIABRIS sowie das Modul „Kreditportfoliomodell im Eigengeschäft“ bieten Ihnen umfassende Rollen-, Rechte- und Protokollierungsfunktionen.

Periodische Steuerung

Für die periodische Steuerung werden die Auswirkungen auf die GuV ermittelt. Hierbei werden die erwartete und die unerwartete GuV-Belastung im Portfolio unter Berücksichtigung von Zinsentwicklungsszenarien und unter Anwendung des strengen und gemilderten Niederstwertprinzips für jedes Geschäft berechnet.

Abdeckung regulatorischer Anforderungen

okular ZIABRIS sowie das Modul „Kreditportfoliomodell im Eigengeschäft“ bieten Ihnen umfassende Rollen-, Rechte- und Protokollierungsfunktionen. Für diese okular-Software liegt eine Be-

scheinigung über die Prüfung durch unabhängige Wirtschaftsprüfer nach Prüfungsstandard IDW PS 880 vor.

Integration in okular ZIABRIS

Bewährte Funktionen aus okular ZIABRIS stehen Ihnen auch im Modul „Kreditportfoliomodell im Eigengeschäft“ zur Verfügung und führen in Verbindung mit der integrierten Datenhaltung zu effizienten Bewertungs- und Steuerungsprozessen, denen eine einheitliche methodische Basis zugrunde liegt.

Simulationsmodell: Migrations- und Spreadrisiko

- Berechnung des unerwarteten Verlustes über eine Verlustverteilung
- Methode: Credit Metrics
- Migrationsrisiko über Migrationsmatrizen
- Spreadrisiko über Credit-Spread-Verteilungen
- Korrelation zwischen Migrations- und Spreadrisiko parametrisierbar

Spreadshift-Modell

- analytisches Modell
- Bewertung von Skontros im Genossenschaftlichen FinanzVerbund
- Bewertung des unerwarteten Verlustes am Skontro
- Trägt den Spezifika des verbundinternen Marktes Rechnung.

Wertpapiere im Bestand von ZIABRIS
Ermittlung und Analyse in einer separaten Auswertungsmaske
Validierung und Angemessenheitsprüfung für Methodik und Parameter

Auswertungen und Kalkulationsergebnisse zugleich
Datenbasis für ein umfangreiches Adressrisikoreporting

Funktionsumfang okular ZIABRIS KPM-EG

simulationsbasierter Ansatz für ...	<ul style="list-style-type: none">... Migrationsrisiko... Spreadrisiko... Ausfallrisiko
umfangreicher Produktkatalog	<ul style="list-style-type: none">· Anleihen· Cashflows· Geld-/Kapitalmarktgeschäfte· Transparenzfonds
Optionspreisrechner für ...	<ul style="list-style-type: none">... Aktienoptionen... Devisenoptionen... Zinsoptionen (inkl. einfacher und mehrfacher Kündigungsrechte)
Positionsführung und -bewertung	<ul style="list-style-type: none">· Cashflow-Analysen· Preisrechner
Szenariotechnik zur Risikobewertung	<ul style="list-style-type: none">· Over-Night-Risiko· Simulationsrechnung· GuV-Größen
individuelle Parametrisierung	<ul style="list-style-type: none">· aktueller Stichtag und Planungshorizont von bis zu einem Jahr· segmentspezifische Migrationsmatrizen, Credit-Spreads, Korrelationen und Credit-Spread-Verteilungen· Historisierung der Kalkulationsparameter
flexible Kalkulationseinstellungen	<ul style="list-style-type: none">· Korrelation zwischen den Risikoarten· barwertige und periodische Ergebnisgrößen· Migrations- und Spreadrisiko kann gemeinsam oder separat betrachtet werden.
Simulation von Alternativszenarien	<ul style="list-style-type: none">· Stress- und Krisenszenarien· Neugeschäft simulieren über Steuerungsmaßnahmen· Credit-Spread- und Zinsszenarien
detaillierte Analyse	<ul style="list-style-type: none">· Nachvollziehbarkeit der Ergebnisse über Zwischenergebnisexporte· Analyse der Ergebnisse auf Portfolioebene und Geschäftsebene· umfangreicher Ergebnisexport in XLSX- und CSV-Format

Ihre Ansprechpartner

Besa Ahmeti
Methoden- und Produktmanagement

Besa.Ahmeti@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 441
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

Dr. Martin Bialek
Methoden- und Produktmanagement

Martin.Bialek@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 450
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

Christian Levihn
Methoden- und Produktmanager

Christian.Levihn@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 461
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

Vertrieb:
Jochen Kleibrink
Leiter Vertrieb

Jochen.Kleibrink@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 475
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

parclT GmbH
Erfststraße 15
50672 Köln
Info@parclT.de
www.parclT.de

