



okular ZIABRIS

Marktrisikosteuerung/Depot-A



Zukunftssichere Eigengeschäftssteuerung in ZIABRIS

Analysen

okular ZIABRIS stellt täglich durchführbare Modellbewertung von Wertpapieren und Derivaten auf Einzelgeschäftsbasis zur Verfügung. So können z. B. Cashflows und Barwerte, basierend auf aktuellen Marktdaten oder auf Marktdaten-Szenarien, berechnet und analysiert werden. Mittels historischer Simulation kann der korrelierte Value at Risk für Risikofaktoren, Zinsen, Kurse und Volatilitäten ermittelt werden. Weiterhin sind in der barwertigen Steuerung Ex-ante-/Ex-post-Performance-Messungen möglich. Steuerungsmaßnahmen können dabei berücksichtigt werden.

Simulationen

Für die periodische Steuerung simuliert okular ZIABRIS Jahresabschlüsse gemäß HGB. So können Buchwerte, Ergebnisse, Zu- und Abschreibungen sowie stille Reserven/Lasten auf künftige Bewertungsstichtage simuliert werden.

Berichte

Die Ergebnisse werden auf Einzelgeschäftsebene oder aggregiert ausgewiesen. Regelmäßig benötigte Auswertungen zu Produkten, Portfolios und Risikoarten lassen sich als Standardreports hinterlegen und jederzeit aktuell abrufen. Darüber hinaus können alle Ergebnisse aus okular ZIABRIS komfortabel in andere Programme übertragen und dort innerhalb individueller Reportings



Risikomessverfahren in okular ZIABRIS

Szenario-Rechnungen	<ul style="list-style-type: none">• Für Zinsen, Wechselkurse, Kurse (Aktien, Fonds), Volatilitäten und Spreadkurven• Ad-hoc-Szenarien und Entwicklung über einen Zeitablauf• barwertig und periodisch• Simulation und Performance-Rechnungen• Stresstests
historische Simulation	<ul style="list-style-type: none">• für historische Zinsen, Wechselkurse, Kurse (Aktien, Fonds), Volatilitäten und Spreadkurven• Kombination oder separate Betrachtung der Marktdaten• dynamisch (Performance)• Summen-Cashflow oder Einzelgeschäfte
Monte-Carlo-Simulation	<ul style="list-style-type: none">• für Migrations- und Spreadrisiken• Kreditportfoliomodell für Eigengeschäfte• barwertig und periodisch• Berücksichtigung der periodischen Zinsentwicklung

okular ZIABRIS unterstützt die Bewertung und Risikomessung des Eigenbestandes aus barwertiger und periodischer Sicht.

weiterverarbeitet werden. Die Batchfähigkeit ermöglicht zudem die zeitliche Verlagerung von rechenintensiven Auswertungen.

Kenngrößen

okular ZIABRIS liefert zu allen gängigen Finanzprodukten ein umfassendes Spektrum betriebswirtschaftlicher Kenngrößen, z. B. Restlaufzeit, Einstandsrendite, Duration, PVBP, Convexity oder Optionsgriechen. Über frei definierbare Felder können beliebige Zusatzinformationen je Einzelgeschäft aufgenommen werden, nach denen in den Auswertungen auch gefiltert werden kann.

Bankindividuelle Limits

okular ZIABRIS verfügt über ein flexibles Strukturlimitsystem, das über individuelle Konfigurationen Ihre bankindividuellen Limit-

strukturen abbildet. Im Sinne einer Auswirkungsanalyse können die Limitauslastungen sowohl unter Berücksichtigung von Marktdatenentwicklungen als auch von Steuerungsmaßnahmen analysiert werden.

Adressrisiken im Eigengeschäft

Mit dem in okular ZIABRIS integrierten Modul „Kreditportfolio-modell für Eigengeschäfte (KPM-EG)“ können in ZIABRIS Adressrisiken im Eigengeschäft gemessen werden. Mittels Monte-Carlo-Simulation können hierbei sowohl Migrations- als auch Spreadrisiken betrachtet werden. Der berechnete Credit Value at Risk sowie viele weitere Berichtsgrößen können dabei sowohl für die barwertige als auch die periodische Sicht ermittelt werden. Die Eigengeschäfte können mit ihren Ergebnissen aus KPM-EG nach okular KRM überführt und dort mit dem adressrisikobehafteten Kundengeschäftsbestand analysiert werden.

Risikosteuerung im Eigengeschäft – Umsetzung von Anforderungen z. B. gem. MaRisk sowie KWG

Bewertung	Risiko-Messung	Performance-Messung	Limitierung	Workflow
<ul style="list-style-type: none"> Anleihen Schuldscheine Interbankengeschäfte Aktien, Fonds Zinsderivate Aktienderivate FX-Derivate Kreditderivate 	<ul style="list-style-type: none"> barwertig periodisch Stichtag Horizont Zu-, Abschreibungen, stille Res. Zins-, Bewertungsergebnis VaR, Credit VaR 	<ul style="list-style-type: none"> Ex-ante Ex-post Bücher je Risikoart 	<ul style="list-style-type: none"> Marktpartner (bilanziell, Derivate) max. Einzellimit (Emittent, Asset-Klasse, Bonität) schlechte Bonität 	<ul style="list-style-type: none"> Transaktionen Vier-Augen-Prinzip Marktgerechtigkeit Handel Abwicklung Kontrolle

einheitliche Methoden, Rechenkerne, Marktdaten, Marktdatenszenarien
Nutzung in ZIABRIS und allen okular-Programmen

Ihr Ansprechpartner ...

Dr. Martin Bialek
Methoden- und Produktmanagement

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

Dr. Matthias Schlecker
Methoden- und Produktmanagement

Matthias.Schlecker@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 424
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

... mit EGS/Marktrisiko:

Dr. Gregor Wergen
Methoden und Produktmanagement

Gregor.Wergen@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 170
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
Erfstraße 15
50672 Köln
Info@parclT.de
www.parclT.de

