



Alle Risikodaten für Ihr Unternehmen

Der VaR-Daten-Service von SLG – Korrelationen und Volatilitäten regelmäßig ins Haus geliefert



VaR-Daten-Service

Die zuverlässige Grundlage für
Ihr Risiko-Management

Sie arbeiten mit dem Value-at-Risk-Konzept? Dann benötigen Sie aktuelle und korrekte Marktdaten für Währungen, Zinsen oder Rohstoffe. Diese Arbeit nehmen wir Ihnen ab: Wir sammeln die Datenhistorie, prüfen sie auf Konsistenz und berechnen Volatilitäten und Korrelationen nach internationalem Standard.

Vorteile für Sie:

- ▲ Sie müssen sich nicht mit historischen Daten, Statistik, Korrelations- und Volatilitätsberechnung beschäftigen.
- ▲ Die Verwendung extern generierter Daten unterstützt das Prinzip der Funktionstrennung zwischen Handel und Bewertung.
- ▲ Sie ersparen sich die Wartung von Schnittstellen zu einem Marktdatensystem.

VaR-Daten-Service

Die zuverlässige Grundlage für Ihr Risiko-Management

Um bewerten zu können, wie hoch Ihr Risiko ist, benötigen Sie vollständige und passend zu Ihrem Unternehmensrisiko aufbereitete Marktdaten. Aus diesen errechnen wir für Sie Volatilitäten und eine Korrelationsmatrix, die Sie direkt in Ihr Risiko-Management-System oder auch in Ihr Excel-Tool importieren können. Unsere VaR-Daten unterstützen Sie beim Erreichen dieses Ziels.

VaR-Daten-Service (Musterauszug)

		EUR XS	EUR R030	EUR R090	EUR R180	EUR R360	EUR S02	EUR S03	EUR S04	EUR S05	EUR S07	EUR S10	...
EUR XS													...
EUR R03	Volatilitäten	1	0,567	0,507	0,305	0,127	0,103	0,082	0,061	0,029	0,003	...	
EUR R09		0,567	1	0,745	0,561	0,221	0,153	0,119	0,12	0,105	0,071	...	
EUR R180	0,001	0,507	0,745	1	0,863	0,291	0,208	0,163	0,16	0,129	0,09	...	
EUR R360	0,002	0,305	0,561	0,863	1	0,342	0,273	0,21				...	
EUR S02	0,007	0,127	0,221	0,291	0,342	1	0,961	0,9				...	
EUR S03	0,012	0,103	0,153	0,208	0,273	0,961	1	0,972	0,951	0,935	0,896	...	
	Risiko-faktoren	0,018	0,082	0,119	0,163	0,231	0,947	0,972	1	0,988	0,972	0,933	...
		0,023	0,061	0,12	0,16	0,221	0,932	0,951	0,988	1	0,976	0,944	...
		0,031	0,029	0,105	0,129	0,196	0,914	0,935	0,972	0,976	1	0,977	...
EUR S10	0,045	0,003	0,071	0,09	0,169	0,868	0,896	0,933	0,944	0,977	1	...	
...		
EUR S05	0,023	0,061	0,12	0,16	0,221	0,932	0,951	0,988	1	0,976	0,944	...	
EUR S07	0,031	0,029	0,105	0,129	0,196	0,914	0,935	0,972	0,976	1	0,977	...	
EUR S10	0,045	0,003	0,071	0,09	0,169	0,868	0,896	0,933	0,944	0,977	1	...	
...		

Das bieten Ihnen die VaR-Daten:

- ▲ Wechselkurse und Zinssätze für zahlreiche Währungen
- ▲ Aktienindizes, Rohstoffe und Anleihen
- ▲ Individuelle Zusammenstellung der benötigten Risikofaktoren
- ▲ Berechnung von Volatilitäten und Korrelationsmatrizen
- ▲ Historische Tages- oder Monatsdaten als Datengrundlage
- ▲ Exponentielle Gewichtung der Datenhistorie
- ▲ Zustellung per E-Mail oder FTP-Server im Tages-, Wochen- oder Monatszyklus

Vom VaR-Daten-Service zum Risikobericht:

- ▲ Die gelieferten VaR-Daten können direkt in Ihr Treasury-System, das SLG Gesamtrisiko-Tool oder in ein beliebiges Excel-Tool importiert werden.
- ▲ Anhand der Korrelationsmatrix ist es Ihnen zukünftig möglich, auch ein diversifiziertes Risiko zu berechnen.
- ▲ Basierend auf den erstellten VaR-Berichten können Sie gezielt Ihr Risiko steuern.

Kontakt



Jochen Schwabe
Partner
js@slg.co.at



Martin Winkler
Partner
mw@slg.co.at