



# SLG RiskEngine

## Risiko-Management in einer völlig neuen Dimension



[www.slg.co.at](http://www.slg.co.at)

### Finanzrisiken auf Knopfdruck managen

Risiken bewerten, analysieren und optimieren, Sicherungsszenarien testen, Kursveränderungen durchspielen.

Keine einheitlichen Sicherungsquoten mehr für alle Währungen, keine „Bauchentscheidungen“, keine kontraproduktiven Transaktionen, keine unnötigen Kosten.

Die SLG RiskEngine befreit Sie von mühsamer Excel-Akrobatik und macht ein Ende mit Sicherungsentscheidungen „im Blindflug“: Mit wenigen Klicks können Sie

- ▲ das Risiko aus Wechselkurs-, Zins- und Rohstoffpreisveränderungen berechnen
- ▲ die Konzernrisikoposition ermitteln
- ▲ das Gesamtrisiko für Konzern und Tochtergesellschaften darstellen

Ab sofort ist als Zusatzmodul eine automatische Optimierungsfunktion verfügbar. Die Optimierung in der SLG RiskEngine bietet die Möglichkeit,...

- ▲ die Beiträge zum Gesamtrisiko auf monatlicher Basis darzustellen, daraus
- ▲ wahlweise jährliche oder monatliche Ober- und Untergrenzen für Sicherungsquoten abzuleiten und
- ▲ für ein gewünschtes maximales FX-Gesamtrisiko ... per Knopfdruck einen effizienten Sicherungsvorschlag zu ermitteln.

# Der SLG RiskEngine



## Technik und Methoden – einfach, aber nicht simpel

Die SLG RiskEngine verfügt über eine leicht bedienbare Excel-Oberfläche. Die Ergebnisse werden in Excel-Berichten dargestellt, deren Aufbau und Design Sie selbst bestimmen. Im Hintergrund arbeitet ein leistungsstarker Rechenkern. Als Datengrundlage für die Risikoberechnung dienen geplante Cashflows, Finanzpositionen und Derivate, geliefert aus Ihrem System oder manuell erfasst. Dabei können gängige Derivate zur Sicherung von Devisen-, Zins- und Rohstoffrisiken abgebildet werden. Und bei Rohstoffen können Sie außerdem Preisgleitklauseln anwenden.

Das diversifizierte Risiko (berücksichtigt Korrelationen zwischen Risikofaktoren) wird mittels Monte-Carlo-Simulation oder Varianz-Kovarianz-Ansatz berechnet.

Die Optimierung findet bei gegebenem Risikoappetit je nach Kriterium (geringste Kosten, geringste Anzahl von Transaktionen, Minimierung der Linienausnutzung) das optimale Sicherungsportfolio auf Knopfdruck! Um das zu erreichen verwendet die SLG RiskEngine eine genetische und eine skalare Optimierung.



## Im Risiko-Cockpit – Gesamtrisiko und Simulation von Szenarien

Im „Cockpit“ der SLG RiskEngine: Der Nutzer sieht auf einen Blick das Risiko je Währung und gesamt. Für die wichtigsten Währungen können per Schieberegler auf einfachste Weise Sicherungsquoten eingestellt werden (3). Die Optimierungsfunktion liefert für ein gewünschtes maximales Risiko (1) automatisch die optimalen Sicherungsquoten (3). Dabei lassen sich Grenzen für die Quoten je Währung und Monat definieren (2).

