



# 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 einzustellen und
- ▲ für ein gewünschtes maximales FX-Gesamtrisiko ... per Knopfdruck einen effizienten Sicherungsvorschlag zu ermitteln.

# Die 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. 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 Optimierungsfunktion der SLG RiskEngine 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 RiskEngine einen genetischen Algorithmus (für Anzahl der Transaktionen) und ein Gradientenverfahren für alle anderen Kriterien.



## Im Cockpit – Gesamtrisiko und Simulation von Szenarien

Im „Cockpit“ der SLG RiskEngine: Der Nutzer sieht auf einen Blick das Risiko je Währung und gesamt (1). Für die wichtigsten Währungen können per Schieberegler auf einfachste Weise Sicherungsquoten eingestellt werden (4). Die Optimierungsfunktion liefert für ein gewünschtes maximales Risiko (2) automatisch die optimalen Sicherungsquoten (4). Dabei lassen sich Grenzen für die Quoten je Währung und Monat definieren (3).

Minimierung von	Sicherungsvolumen										
Zielrisiko nach Sicherung	2.500	2. Auswahl des Optimierungskriteriums, des gewünschten Zielrisikos und Art der Sicherungsgrenzen		Sicherungsquoten		Sicherung neu		Sicherungsquote MIN		Sicherungsquote MAX	
Konstante Sicherungsquoten	1										
Monatliche Grenzen (CfaR)	0										
Simulation FX Sicherungen											
Währung	Grundposition (Position, CF)	Risiko aktuell	Risikobeitrag aktuell	Sicherungsquoten	Sicherung neu	Risiko neu	Risikobeitrag neu	Sicherungsquote MIN	Sicherungsquote MAX	in TEUR	
USD	52.253	7.252	6.631	78% < >	-40.992	1.563	605	0%	100%		
HUF	-16.010	1.104	-5	0% < >	0	1.104	134	0%	100%		
KRW	13.151	1.855	1.249	34% < >	-4.484	1.222	465	0%	100%		
MXN	-10.623	2.319	-317	41% < >	4.382	1.362	335	0%	100%		
CNY	-9.616	1.290	-970	0% < >	0	1.290	-289	0%	100%		
CAD	9.349	1.298	722	0% < >	0	1.298	439	0%	100%		
UAH	-3.711	1.864	-126	0% < >	0	1.864	751	0%	0%		
VND	2.802	376	337	0% < >	0	376	145	0%	0%		
JPY	-2.299	335	-168	0% < >	0	335	-47	0%	100%		
GBP	-1.318	182	-77	0% < >	0	182	-39	0%	100%		
<b>Gesamt</b>	121.132	<b>7.276</b>			<b>49.859</b>	<b>2.500</b>					
	in % von EBIT	20,8%				7,1%					
1. Diversifiziertes Gesamtrisiko je FX											
4. Per Knopfdruck werden die optimierten Sicherungsquoten berechnet											
3. Definition von minimalen und maximalen Sicherungsquoten je Währung											