

Risk Management Gain



Anwendungsbereiche

- Marktrisiko-Management:** Berechnung von Value-at-Risk (VaR) und weiteren Risikomassen | Zuordnung spezifischer Risikokomponenten | Einfacher Wechsel zwischen Währungen, Benchmarks und Zinskurven | Aktive Identifikation und Steuerung von Risikopositionen
- Kreditrisiko-Management:** Analyse von Zinsstruktureffekten | Unterstützung von CreditMetrics® und von CreditRisk+ | Definition von Zinskurven | Berechnung von Risikopositionen und erwarteten Verlusten | Import von externen Cashflows | Dynamische Zuweisung von Kreditrisiken | Berechnung von Marginal-Credit-Risks
- Operationales Risikomanagement:** Basel-II-konformes Operationales-Risiko-Modul | Definition und Monitoring von KRI und risikomindernden Massnahmen | Datenqualitätsprüfungen | Workflow-Kontrolle und Exception-Handling | Bietet Unterstützung für die Konformität zu SOX
- Titelbewertung / Mark-to-Market:** Berechnung von theoretischen Preisen (erweiterte Unterstützung von Derivaten und strukturierten Produkten) | Definition eigener Benchmarks unter Verwendung von Modell-Portfolios, synthetischen Instrumenten und Baskets
- Limit-Management:** Einsatz flexibler Trigger und Alarme bei Verletzung von Limits | Automatische Initiierung von Workflows | Unterstützung von Volumens-, Performance- und Risikolimits
- Performance und Risk-Attribution:** Zuweisung von Positionen zu Portfolios durch Verwendung von Boole'schen Operatoren | Speicherung von Allokations-Definitionen für den weiteren Gebrauch | Benutzerdefinierte Klassifikationsschemata und zusammengesetzte Benchmarks
- Simulation:** Anwendung von Szenarien, Stress-Tests und Simulationen auf Portfolios, Gruppierungen und Baskets | Monte-Carlo-Simulationen | Analyse von Währungs- und Preiseffekten von Kauf- und Verkaufstransaktionen | Definition von Gruppen mit Boole'schen Operatoren
- Workflow-Management:** Definition von Bedingungen und Regeln für das Routing und die Archivierung von Daten und Reports | Belieferung zahlreicher Zielsysteme | Aufbau einer zentralen Risikoberechnungs-Plattform
- Exception-Handling / Data-Scrubbing:** Bereinigung und Reconciliation verschiedener Datenquellen | Definition des Exception-Handlings und der Qualitätschecks bei fehlerhaften Daten | Intuitive Fehlerbehebung
- Risiko- und Performance-Reporting:** Verwendung von schlüsselfertigen oder massgeschneiderten Risiko- und Performance-Reports | Anreicherung von Reports mit internen Daten | Konformität mit AIMR (GIPS) und IASB (IFRS)

Die All-in-One-Lösung für Risikomanagement

Import und Export		Unterstützte Instrumente	Unterstützte Kennzahlen
	IMP EXP Oracle DB2 MS-SQL Informix InterBase Sybase ODBC XML ASCII CSV HTML Access Excel, etc.	Nicht-Derivate Aktien Fonds Commodities Währungen Indizes Zinssätze Swaps	$f_{(x)}$ Value-at-Risk: Varianz/Kovarianz Historisch Monte-Carlo RiskMetrics Marginal- und Component-VaR Marginal-Credit-Risk
	REP Benutzerspezifische Reports Formate: Print, On-Screen, Text, PDF, HTML	Anleihen (Null-) Kuponanleihen Wandelanleihen Floater	$f_{(x)}$ Total-Risk: Spezifisches Risiko Risikoaversion Volatilität T-Statistik Implizite Volatilität
	SYS Proprietäre Systeme Plug-On-Konzept	Derivate Futures Forwards FRA Plain-Vanilla-Optionen Warrants Strukturierte Produkte	$f_{(x)}$ Skill: Informationskoeffizient (Appraisal-Ratio) Value-Added Information-Ratio
	MOD Weitere Module: Datenmanagement Geschäftsprozessmanagement Workflow-Management	Exotische Optionen Asian-Options Barrier-Options Binary-Options Compound-Options Quanto-Options Dual-Asset-Options Collar-Swaptions Ratchet-Options	$f_{(x)}$ Fixed-Income: Preis BPV Duration Konvexität Modifizierte/Preis-Duration Stückzinsen
	PRG SQL VBScript JScript Perl Python Delphi-Script XSLT		$f_{(x)}$ Zinsen: Schnelle Renditerechner AIBD ISMA Moosmüller Braess Fangmeyer IRR
			$f_{(x)}$ Optionen: Price Delta Gamma Rho Theta Vega Cost-of-Carry
			$f_{(x)}$ Benchmarking: Alpha Beta Tracking-Error
			$f_{(x)}$ Return: Active-Return Specific-Return Excess-Return
			$f_{(x)}$ Risikoadjustierte Performance: Sharpe-Index Treynor-Index
			$f_{(x)}$ Statistische Indikatoren: MAV MACD Stochastik

Unterstützte Methoden

Basel II: Revidierter Standardansatz (RSA) | IRB-Basisansatz | Fortgeschrittener IRB-Ansatz | Basisindikatoransatz (BIA) | Fortgeschrittene Bemessungsansätze (AMA)

Barwertanalyse | Maturity-Ladder-Analyse | Time-Horizon-Analyse | Cashflow-Analyse | Cashflow-Projektion | Backtesting

Black-Scholes | Garman-Kohlhagen (FX-Optionen) | Reiner-Rubinstein | Kemna-Vorst

Binomial- und Trinomialbaumrechnungen | GARCH | ARMA | Principal Component Analysis | Bootstrapping | Newton-Raphson



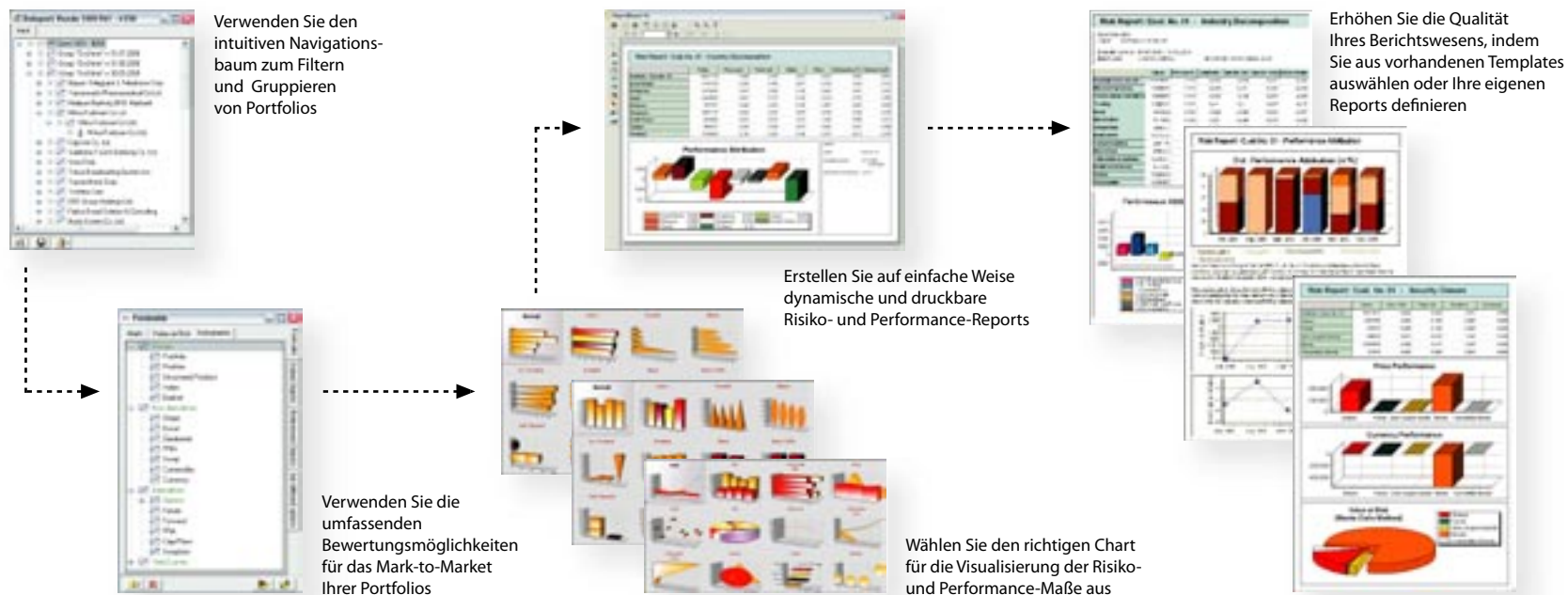
Österreich
AIM Software GmbH
Gonzagagasse 16
A-1010 Wien
Tel: +43 (1) 512 46 52
office@aim-sw.com
www.aim-sw.com

Schweiz
AIM Software AG
Rösslimatte 7
CH-8808 Pfäffikon
office@aim-sw.com
www.aim-sw.com

USA
AIM Software plc.
67 Wall Street, 22nd floor, Suite 2211
New York, NY 11005
Tel: +1 (212) 859 3498
office@aim-sw.com
www.aim-sw.com

Hongkong
AIM Software Ltd
555 Hennessy Road
East Point Centre, Room 1302
Hongkong, Causeway Bay
Tel: +852 2833 4684
office@aim-sw.com
www.aim-sw.com

GAIN Risk Management – Die interaktive Plattform für Risikomanagement



Nutzung von Synergien für genauere Ergebnisse

Die GAIN Risk-Management-Plattform ermöglicht mit ihrem Risikomanagement-Ansatz die Nutzung umfangreicher Synergien: Die Konnektivität zu Datenfeeds kann mit Funktionen für Datenmanagement, der Vor- und Nachverarbeitung von Daten, einer umfangreichen Titelbewertung und mit Risikoanalyse kombiniert werden.

Viele Risikomanagement-Systeme übersehen, dass Risiko auch durch eine schlechte Datenqualität und die unzureichende Kommunikation von Ergebnissen entsteht.

Qualität & Präzision

- Verbessern Sie die Qualität Ihrer Input-Daten mit Integritätschecks und Cleansing
- Arbeiten Sie mit unvollständigen Daten und generieren Sie neue Zeitreihen, basierend auf vordefinierten Verteilungen
- Berechnen Sie Volatilitäten und Korrelationen unter Verwendung eigener historischer Zeitreihen
- Modifizieren Sie Volatilitäts- und Korrelationsmatrizen

Kompatibilität

- Unterstützung von 15+ End-of-Day- und Real-Time-Datenfeeds
- Ermöglicht den dynamischen Import und Export zu nahezu jedem Softwarepaket und Datenbanksystem
- Offene und skalierbare Architektur
- Benutzerdefinierte Import- und Exportformate

Kostenersparnis

- All-in-One-Lösung für Markt-, Kredit- und operationales Risiko
- Hoher Investitionsschutz bei Wechsel der zugrundeliegenden Systeme (schnelle Parametrisierung)
- Reduziert die Wartungskosten durch integrierte Support-Tools signifikant
- Reduziertes Risiko und beschleunigter ROI durch Integrationsmöglichkeit

Zeitersparnis

- Beschleunigte Integration durch intuitive Parametrisierung
- Archivierung von Reports, Templates und verarbeiteten Daten
- Verwendung von Skriptsprachen zur Reduktion des Aufwands der Erstellung von Schnittstellen
- Verwendung von schnellen Rendite-rechnern und Funktionsoptimierern

Bedienung

- Einfache Aggregation von Risiko und Performance über Branchen, Risikogruppen und Portfolios
- Kontextbezogene Darstellung von Ergebnissen und Reports
- Clipboard-Unterstützung | Excel-ähnliche Benutzeroberfläche
- Einfache graphische Definition von Makros, Formularen, Workflows und Reports

Reporting

- Interaktive Definition von benutzer-spezifischen Real-Time- und Serienreports
- Export von Ergebnissen zu Word, Excel, Powerpoint, HTML, XML und PDF für die weitere Verarbeitung
- Integriertes Web-Content-Management-System für die Schaffung massgeschneiderter Webpages
- Benutzeroberfläche und Reports mehrsprachig

Sicherheit

- Umfangreiches Fehler-Logging und Audit-Trail
- Detailliertes Rechte- und User-Management
- Definition des gewünschten Exception-Handlings für Fehler in den Quelldaten
- Schnittstelle zu NT-Domainservern, Active-Directory, LDAP oder anderen Security-Layers

Extras

- Unterstützung externer Plug-Ins für Spezialfunktionen
- Mächtige Scripting- und Entwicklungsumgebung für Erstellung eigener Oberflächen und Funktionen
- Integrierter Task-Scheduler und Workflow-Manager
- Konnektivität zu Web-Application-Servern

GAIN Risk Management – Von der Risikoanalyse zur Risikokontrolle

Der modulare Ansatz von GAIN Risk Management unterstützt den schrittweisen Aufbau einer vollwertigen Risk-Management-Plattform, die zunehmend wachsende Bedürfnisse in Einklang mit dem dafür benötigten Aufwand bringt.

GAIN Risk Management fördert die Qualität von vor- und nachgelagerten Prozessen, wie Prüfungen der Datenqualität und graphisches Reporting und ermöglicht dadurch eine Ausweitung der reinen Risikoanalyse hin zur effizienten Risikokontrolle.

Gutes Risikomanagement beginnt an der Datenquelle

Durch die Unterstützung von 15+ Datenfeeds gewährt GAIN Zugang zu hochqualitativen statischen Daten, Ereignismeldungen und Preisdaten für eine unerreichte Anzahl von Instrumenten. Die Verbindung einer intuitiven Benutzeroberfläche mit automatisierten Abläufen und geprüften Datenmodellen ermöglicht eine Reduktion des operationalen Risikos durch die Vermeidung fehlerhafter Datenübernahmen.