



Treasury Risk Cockpit

In den letzten Jahren sind die **Volatilitäten** an den Kapitalmärkten gestiegen. Insbesondere kleinere Banken kommen zunehmend unter Ertragsdruck. Die benötigten Erträge könnten teilweise aus einem aktiv gesteuerten A-Depotgeschäft kommen.

Als Grundlage für in engen Zeitabständen zu treffenden Steuerungsentscheidungen wird ein **Reporting** benötigt, das relevante Informationen **in hoher Qualität** und **schneller Frequenz** liefert. Das Reporting muss die Bedürfnisse der jeweiligen Bank abbilden und flexibel auf Veränderungen in den Märkten eingehen können und neuen Anforderungen in der Bank gerecht werden.

Die Verfügbarkeit eines zeitnahen und zuverlässigen operativen Reportings wird zunehmend zu einem **strategischen Erfolgsfaktor** der Banksteuerung. Aufgrund der **starken Datenarchitektur** beobachten wir starke Einschränkungen in der Reporting-Bereitstellung durch eine aufwendige **manuelle Datenverarbeitung**. Eine schnelle Verbesserung der Situation durch Lösungen des gruppeninternen IT-Providers ist eher unwahrscheinlich.



Dr. Oliver Reiß



Zorka Horozova-Malle



Jörg Arndt

Unsere Lösung

Treasury Risk Cockpit

Ein **Individuelles Datenverarbeitungstool** mit relevanten Grundfunktionalitäten für ein zeitnahes Steuerungsreporting in hoher Datenqualität. **Sämtliche Positionssysteme** werden angebunden.

Im Produktivbetrieb werden die Bestandsdaten automatisiert hochgeladen, normalisiert und mit mehreren **Plausibilitätsprüfungen** verifiziert. Manuelle Korrekturen sind in dieser Phase möglich und werden systemseitig dokumentiert. Das vorläufige Ergebnis ist eine **einheitliche Datenbasis** für die benötigten Reports. Neue Report-Anforderungen können darüber hinaus durch den Fachbereich selbstständig hinzugefügt werden.

Ihre Experten werden durch die automatisierten Bestandsdaten-Abstimmungen **entlastet** und können sich auf Ergebnisanalysen konzentrieren.

Steuerungsrelevante Reports werden in hoher Qualität zeitnahe generiert.

Eine Reihe weiterer **QuickWins** sind mit der Integration und dem Einsatz des Cockpits verbunden.

Das Treasury-Risk-Cockpit benötigt keinen Server und ist unabhängig von IT und den System Providern. Das Reporting-Tool wird direkt vom Fachbereich eingesetzt, und zwar ohne laufende Betriebskosten. SQL- und Excel-Download-Funktionalitäten erleichtern das tägliche Handling. Mandantenfähigkeit, IT-Sicherheit, Modularer Aufbau für Treasury, Risk, Finanzen und vieles mehr....



Reportings

- ✓ **Performance Report**
- ✓ **Liquiditätsreport**
- ✓ **Exposure-Report**
- ✓ **Sensitivitäten-Report**
- ✓ **Limit- und Auslastungs-Report**
- ✓ **Risiken: Zinsänderung, Spreads etc.**
- ✓ **HGB, Bewertungseinheiten etc.**

Tiefe

- ✓ **Gesamt-/Teilportfolien /Positionen**
- ✓ **Spezialfonds-Bestände**
- ✓ **Derivate-Portfolien**

Simulationen

- ✓ **Szenarien**
- ✓ **Zinsschocks**
- ✓ **Planungssimulationen**

Unsere Gruppe
an 15 Standorten
www.mt-ifs.de
www.hyand.dev

Lassen Sie uns
miteinander reden
zorka.horozova-malle@mt-ifs.de