Risikomanagement

Die Kennziffern des Risikomanagements werden auf Basis der Data-Marts kalkuliert und in entsprechenden Reports zur Verfügung gestellt. Folgende Reports sind verfügbar:

- Value at Risk (VaR)
- Conditional Value at Risk (CVaR)/Expected Shortfall (ES)
- Interest Rate Risk in the Banking Book (IRRBB)
- Credit Spread Risiko
- Konzentrationsrisiken

FlexFinance

© FERNBACH Financial Software S.A.