

FlexFinance stellt Data Marts bereit, welche Daten zur Steuerung des Marktrisikos beinhalten. Diese Daten werden gemäß **BCBS (= Basel Committee on Banking Supervision)** benötigt, um damit die Anforderung an die Eigenkapitaldeckung zu definieren. Die Marktrisiken werden in Zins-, Devisen- und Wertpapierkursrisiko unterschieden. Bezüglich der damit verbunden Eigenkapitalanforderungen werden Devisen- und Wertpapierkursrisiko nur auf Positionen im Handelsbestand gerechnet; dem gegenüber muss das Zinsrisiko für alle Positionen berücksichtigt werden.

In den Data Marts finden Sie alle Daten sowohl zur Differenzierung der Finanzprodukte und Kontrahenten als auch alle benötigten Einzelbestandteile wie sie für das Reporting oder die Steuerung des Marktrisikos benötigt werden.

- Netto-Risikobeträge
- RWA (Risk-weighted assets)
- Sensitivitäten zur Preisbildung bei Optionen (Delta/Gamma/Vega/Theta)
- VaR (Value at Risk)
- Stressed VaR

Verarbeitet bzw. in die Berechnung einbezogen werden sowohl on-balance Positionen als auch das außerbilanzielle Engagement der Bank.

- Loans/Money Markets
- FX-Deals
- Bonds/Promissory Notes
- Equities/Funds
- FRA (Forward Rate agreements)
- IRS (Interest Rate Swaps)
- Swaptions
- Forward deals
- Caps/Floors/Collar
- Options/Futures
- Credit derivatives

FlexFinance ermöglicht die parallele Berechnung nach verschiedenen regulatorischen Ansätzen (Standard-, IRB, CAD-Approach); deren Verwendung für das Meldewesen muss allerdings vom jeweiligen nationalen Recht zugelassen sein.

Hier ein Beispiel für einen Marktrisikoreport in FlexFinance basierend auf diesen Data Marts:

Total		All positions		Positions		Net positions		Positions subject to capital charge		Own funds requirements		Total risk exposure amount	
		Long 010	Short 020	Long 030	Short 040			050		060		070	
TRADED DEBT INSTRUMENTS IN TRADING BOOK													
General risk		010								0.00		1,238,757,389.00	
		012	129,355,356.00	200,000.00						0.00		0.00	
		013	0.00	0.00									
		020			1,927,180,425.00	784,229,403.00		0.00		0.00			
		030			347,065,687.00	143,621,326.00							
		040			2,335,134.00	783,946.00							
		050			112,344,138.00	13,461,304.00							
		060			200,897,634.00	134,601,415.00							
		070			31,488,721.00	844,662.00							
		080			232,247,896.00	143,630,208.00							
		090			1,238,888.00	421,109.00							
		100			21,030,834.00	2,523,700.00							
		110			209,878,207.00	140,685,339.00							
		120			1,357,867,142.00	490,777,883.00							
		130			2,335,134.00	793,946.00							
		140			112,344,138.00	13,461,304.00							
		150			200,897,634.00	134,601,415.00							
		160			31,488,721.00	844,662.00							
		170			12,345,234.00	1,461,428.00							
		180			898,456,221.00	339,478,118.00							
		190			0.00	0.00							
		200			0.00	0.00							
		210											
		220											
		230											
		240											
		250											
		251											
		260											
		270											
		280											
		290											
		300											
		310											
		320											
		330											
		340											
		350											
		360											
		370											
		380											
		385											
		390											
		400											
		410											
		420											
		430											
		440											
		450											
		460											
		470											
		480											
		490											
		500											
		510											
		520											
		530											
		540											
		550											
		560											
		570											
		580											
		590											
		600											
		610											
		620											
		630											
		640											
		650											
		660											
		670											
		680											
		690											
		700											
		710											
		720											
		730											
		740											
		750											
		760											
		770											
		780											
		790											
		800											
		810											
		820											
		830											
		840											
		850											
		860											
		870											
		880											
		890											
		900											
		910											
		920											
		930											
		940											
		950											
		960											
		970											
		980											
		990											
		1000											
		1010											
		1020											
		1030											
		1040											
		1050											
		1060											
		1070											
		1080											
		1090											
		1100											
		1110											
		1120											
		1130											
		1140											
		1150											
		1160											
		1170											
		1180											
		1190											
		1200											
		1210											
		1220											
		1230											
		1240											
		1250											
		1260											
		1270											
		1280											
		1290											
		1300											
		1310											
		1320											
		1330											
		1340											
		1350											
		1360											
		1370											
		1380											
		1390											
		1400											
		1410											
		1420											
		1430											
		1440											
		1450											
		1460											
		1470											
		1480											
		1490											
		1500											
		1510											
		1520											
		1530											
		1540											
		1550											
		1560											
		1570											
		1580											
		1590											
		1600											
		1610											
		1620											
		1630											
		1640											
		1650											
		1660											
		1670											
		1680											
		1690											
		1700											
		1710											
		1720											
		1730											
		1740											
		1750											
		1760											
		1770											
		1780											
		1790											

Für solche in FlexFinance definierte Reports stehen außerdem folgende Standardfunktionen zur Verfügung:

- **Umfangreiche Drilldownmöglichkeiten**
- **Vergleichsmöglichkeit des Reports für unterschiedliche Buchungstage**
- **Den Nachweis der Regel je Reportinginhalt** und
- Eine manuelle Editierung verbunden mit Konsistenzprüfung