

# UnRisk

## UnRisk FACTORY

Automatisiertes Risikomanagement



## Was ist die UnRisk FACTORY?

Hohe Anforderungen von regulatorischer Seite, der interne Druck das Risiko Controlling zu verbessern – auch kleinere und mittlere Finanzinstitutionen brauchen umfassendes Risikomanagement zu einem leistbaren Preis. Die oft kleine Mitarbeiteranzahl in den entsprechenden Abteilungen verlangt nach hochautomatisierten Lösungen. Die UnRisk FACTORY bietet die Bewertung und das Risikomanagement für eine Vielzahl von verschiedenen Instrument-Typen über alle relevanten Asset-Klassen hinweg.

Alle Berechnungen können auf Einzelinstrument bzw. Portfoliolevel durchgeführt werden. Darüber hinaus können Instrumente beliebig gruppiert und die erforderlichen Kennzahlen aggregiert werden. Alle relevanten Risiken, wie Markt-, Kredit- und Liquiditätsrisiko können mit der UnRisk FACTORY berechnet und überwacht werden. Die UnRisk FACTORY kombiniert die Datenpersistierung und das Datenmanagement mit der bewährten hoch performanten UnRisk Bewertungs-Engine, die auch in den QUANT Produkten von UnRisk zum Einsatz kommt.

## Funktionen der UnRisk FACTORY

### Administration

- Flexibles User- und Rollenmanagement, viele Möglichkeiten für die Parametrierung von Daten und Parametern, intelligentes System zum Scheduling von Tasks, umfassende Monitoring und Audit-Funktionalität

### Abdeckung

- Zinsen, Aktien, Indizes, Fonds, Inflation

### Marktdaten

- Definitionen, Einstellungen, Tagging-Möglichkeiten und Templates für alle relevanten Marktdaten stehen zur Verfügung
- Frei definierbare Szenarien und Stresstests unter denen die Instrumente und Portfolien bewertet werden können
- Umfassende Value at Risk Berechnungen
- Abdeckung von Modell- und Methodenrisiko



### Offene Interfaces

- Werkzeuge zum Zugriff auf die UnRisk FACTORY Database

### Exposure Engine

- Diese kann als Option in die UnRisk FACTORY integriert werden und liefert relevante Kennzahlen wie CVA, DVA, PFE, ...

## Vorteile der UnRisk FACTORY

- ✓ **AUTOMATION** - umfangreiche Möglichkeiten Aufgaben zu automatisieren
- ✓ **BEDIENBARKEIT** - intuitives Web Front-End
- ✓ **OPEN ACCESS** - offene Schnittstellen erlauben Zugriff auf relevante Ergebnisse
- ✓ **SICHERHEIT UND AUDITIERBARKEIT** - ausgeklügeltes Berechtigungskonzept und umfassendes Logging bieten exakte Nachvollziehbarkeit
- ✓ **PERFORMANCE** - inhärente Parallelisierung führt zu schnellen Ergebnissen
- ✓ **UMFANG** - große Abdeckung an Instrument-Typen, Methoden und Modellen
- ✓ **FLEXIBILITÄT** - individuelle Szenarien und Stresstests