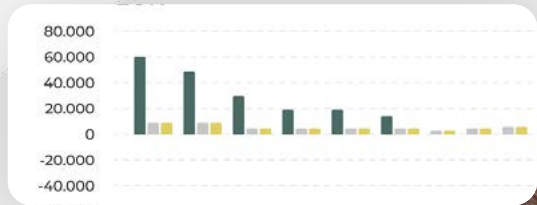




NOMENTIA



Total Risk - Detailed Data

for "Group" from view of "Group"
per 31-08-2020 / Valuation type "Standard"
all values in kEUR

Risk Factor	Cashflows	Hedges	Open P...	Unrealised G/L (CF)
AED	-2.992	0	-2.992	36
AUD	43.557	-4.025	39.532	-189

NOMENTIA RISK MANAGEMENT

Kokonaisvaltainen altistumisanalyysi, suojaus, riskienhallinta ja raportointi yhdessä paikassa. Hallitse riskejä ja suojausta jäsennellyllä ja järjestelmällisellä tavalla voittojen realisoimiseksi ja tappioiden välttämiseksi päivittäisessä kaupankäynnissä.

Ota yhteyttä →

Uskomattoman tehokas riskienhallintapaketti

Tunnista riskitekijät

Lyhyen ja pitkän aikavälin riskien ennustaminen ja analysointi yhteisö-, liiketoimintayksikkö- tai konsernitason.

Automatsoi suojaus

Hyödynnä automatisoituja suojausehdotuksia riskialttiuden vähentämiseksi.

Mittaa tuloksia

Ymmärrä valitsemasi suojausstrategian vaikutus erilaisia riskilaskelmia hyödyntämällä.

Optimoi suojausportfoliot

Tunnista kustannustehokkaat suojaukset halutulle riskitasolle.

Laajenna riskienhallintakyvykkyyttäsi

Integraatiot	Keskitä	Ennusta ja analysoi positioita	At-risk calculation	Optimoi suojausportfoliot
<ul style="list-style-type: none">• Hae kaikki olennainen tieto ERP:stä ja muista järjestelmistä.• Tuo organisaation laajuiset altistustiedot yhteen.• Rikasta ja täydennä dataa päivityksillä.• Integrooi markkina-tietolähteet volatiliiteetin ja korrelaation laskemiseksi.• Mahdollista automatisoitu, kaksisuuntainen viestintä kaupan-käyntialustojen kanssa.	<ul style="list-style-type: none">• Analysoi positiot yrityksen, liike-toimintayksikön tai konsernitason mukaan.• Muodosta lyhyen aikavälin positio-ennusteita yhdistämällä tiedot rahoitusvaroista ja veloista lähdejärjestelmistä saataviin tietoihin, kuten tilauksiin ja todellisiin kassavirtoihin.• Luo pitkän aikavälin ennusteita muuntamalla budjettitiedot ennustetuiksi positioiksi.• Käytä historiallisten kassavirtojen jatkeena viimeisintä kasvuennustetta.	<ul style="list-style-type: none">• Hyödynnä järjestelmän generoimia suojausehdotuksia riskiposition pienentämiseksi.• Varmista treasury-yhdistysten ja rajoitusten noudattaminen tarkistus- ja hyväksymisprosesseilla.• Hyödy kokonaisvaltaisesta prosessista minkä tahansa elektronisen kauppapaikan kanssa (360T, FXall, Bloomberg ja muut).• Luo automaattisesti sisäisiä back-to-back-kauppoja, kun suojaat keskitetyksi paikallisia riskejä.• Linkitä suojatut kohteet kaupan jälkeisten kenttien kautta.• Hyödynnä mukautettavia FX/IR- ja hyödykesopimustyyppisiä. Suorita skenaario-analyysi simuloimalla suojauksia ja niiden vaikutusta positioihin ja riskeihin.	<ul style="list-style-type: none">• Käytä varianssi/kovarianssi-lähestymistapaa tai Monte Carlo -simulointeja.• Huomioi valuuttakorrelaatiot.• Käytä value-at-risk (VaR) tai cashflow-at-risk (CfaR) -menetelmiä riskialtiuden laskemiseen.• Käytä inkrementaalista CfaR:ia arvioidaksesi tietyn valuutan suojauksen vaikutusta riskeihin.• Määrittele parametrit kuten riskijakso, omistusaika, luottamusväli ja muut parametrit joustavasti.	<ul style="list-style-type: none">• Tunnista kustannustehokkaat suojaukset mille tahansa riskitasolle.• Simuloi suojauskustannuksia.• Yhdistä kiinteät suhdelluvut suojausportfolioiden optimointiin joustavasti.• Minimoi tarvittavien suojauskauppojen määrä ja/tai volyymit.

Enemmän kuin vain valuuttariskien hallinta-alusta



Arvostimme sitä, että Nomentia oli mukana sparraamassa heti ensimmäisestä päivästä alkaen. He eivät halunneet vain myydä meille riskienhallintajärjestelmää, vaan heidän käytännön kokemuksensa auttoi meitä ymmärtämään miten korrelaatiovaikutukset ja erilaiset kassavirran maturiteetit kannattaa ottaa huomioon riskienhallintamallia rakennettaessa.”

Strategic Projects Finance and Controlling, Drägerwerk AG & Co. KGaA

NOMENTIA

Nomentialla on maailmanlaajuisesti yli 1400 asiakasta. Nomentian avulla voit rakentaa kassanhallintateknologiakokonaisuutesi alusta asti tai valita nykyisiä työkalujasi täydentävät ratkaisut. Ratkaisuvaihtoeukkojamme kuuluvat maksuliikenteen automaatoratkaisut, likviditeetin hallinta, kassavirtaennusteet ja kassanäkyvyys, pankkitilien, pankkiyhteyksien ja takausten hallinta, sisäinen pankki, maksujen täsmäytys, riskienhallinta ja varainhallinnan työnkulut ja raportointi.