



AMS

ASSET MANAGEMENT SUITE

- AMS entstand aus einer, mit der Universität Wien gemeinsam entwickelten Risk-Management-Lösung.
- Das Produkt ist bei mehr als 10 Kunden in Österreich und der Slowakei im Einsatz. Dazu zählen Banken, Vermögensverwalter und Versicherungen. Mit diesen erfolgte die gemeinsame Weiterentwicklung der Asset Management Suite.

LEISTUNGSMERKMALE VON AMS

- Abdeckung verschiedener kritischer Geschäftsbereiche in einem integrativen System:
 - Front Office
 - Risikomanagement
 - Controlling
 - Performancemessung
 - Back Office
 - Kontenführung
- Umfassende Abdeckung der heute im Asset Management üblichen Finanzinstrumente
- Die skalierbare, modulare Architektur unterstützt sehr große Finanzdienstleister ebenso wie kleinere Unternehmen
- Ausgezeichnetes Preis/Leistungs-Verhältnis
- Rasche Integration und Inbetriebnahme
- CPB SOFTWARE AG ist ein kundenorientierter Lösungsanbieter mit vielen Referenzen zufriedener Anwender
- Lokale Betreuung und Installationen in verschiedenen Ländern

KUNDENSEGMENTE

- Banken
- Privatbanken
- Versicherungen
- Pensionsfonds
- Vermögensverwaltungen
- Unternehmen mit eigenem Treasury
- Broker

MODULARE ARCHITEKTUR

- RiskVantage (Risikomanagement)
- Positionsführung
- Portfolioanalyse und -bewertung
- Order- und Transaktionsmanagement
- Performancemodul
- Limitüberwachung

AMS FUNKTIONALITÄTEN IM DETAIL

- Darstellung typischer Risikoindikatoren für einzelne Positionen, gesamte Portfolios oder Fonds
- Value at Risk (VaR) : Begrenzung von Verlusten, die mit einer definierbaren Wahrscheinlichkeit, innerhalb eines wählbaren Zeitraums, nicht überschritten werden
- Simulation von Hedgegeschäften. Visualisierung der korrespondierenden Auswirkungen auf VaR.
- Berechnung und Darstellung erwarteter Cashflows von aktuell- en Beständen auf Basis Nominal- und Kurswert.
- Erkennung von Liquiditätseingüssen bzw. -überschüssen in Form von Charts und Grafiken
- Unterstützung unterschiedlicher Kursdienste (e.g. REUTERS, Bloomberg)
- Tägliche Berechnung des Nettovermögens (NAV) für Fonds, wie auch für Privatvermögen oder eigene Portfolios

- Diverse Vermögens-Kenngrößen („Griechen“) werden real-time berechnet und dargestellt. Ebenso die Volatilität basierend auf einer Volatilitätsmatrix.
- Schlüsselindikatoren wie abgegrenzte Zinsen, Zinserträge, Kuponzinsen und Fälligkeiten werden ermittelt und dargestellt
- Szenarioanalysen : Auswirkungen potentieller Marktveränderungen (Währungskurse, Zinssätze, Börsen) auf den Marktwert des betroffenen Portfolios
- Schnittstellen zu bestehenden Accountingsystemen
- Performanceanalyse nach Branchen und Regionen
- Performancevergleich mit frei definierbaren Benchmarks

Sowohl gesetzliche als auch interne Limits werden überwacht, frühzeitige Warnungen ermöglichen dem Management oder Riskcontrolling rechtzeitige Reaktion

