

Evaluierung eines Riskomanagementsystems

Unternehmen	Umsetzung - Vorgehensweise	Ergebnis
Wertpapierhandelsbank	<ul style="list-style-type: none"> • Evaluierung der Service Levels von Anbietern gängiger Handelsplattformen und Riskomanagementsysteme: <ul style="list-style-type: none"> • Orderrouting und Positionsführung aller gängigen EUREX-Produkte • Management aggregierter Delta-Positionen • Kalkulation der Risikomessgrößen • Zeitnahes Pricing • MIS-Reporting • Entwicklung eines Anforderungskataloges zur Ermittlung der Leistungsbreite und -tiefe der Anbieter • Vorbereitung von und Unterstützung des Mandanten bei Vendorenbesuchen und Präsentationen von Abwicklern • Erstellung von „Micro“-Business Cases durch die Analyse von Lizenz-, Implementierungs- und Wartungskosten • Kalkulation der Gewinnschwellenmengen vor dem Hintergrund der Kosten unterschiedlicher Abwickler 	<ul style="list-style-type: none"> • Kalkulation und Dokumentation von Business Cases für unterschiedliche Zielszenarien • Ableitung einer „Shortlist“ für die Kombinationen aus Vendoren und Abwickler • Handlungsempfehlung an den Vorstand
Ausgangssituation		
<p>Der Mandant plante die Ausweitung des Handelsvolumens (Kasse und Derivate) im proprietären Geschäft als auch die Erweiterung seines Angebotsportfolios für institutionelle Kunden.</p>		
Aufgabenstellung		
<p>Evaluierung eines Risikomanagement- und Positionsführungssystems, das eine Reduzierung operationeller und eine Optimierung marktbedingter Risiken erlaubt.</p>		