



EnerRISK-Risikomanagementsystem

EnerRISK ist eine Softwareplattform zur Errechnung des Value at Risk (VaR) eines Handelsportfolios.

Die Datenbasis bildet eine relationale Datenbank, in der die an der Börse gehandelten Produkte per Eingabe oder mittels Schnittstellen zu Datenanbietern archiviert werden. In der momentan vorliegenden Version 1.0 wird der VaR von Linearen Portfolios nach der im RiskMetrics-Technical Dokument von J.P.Morgan/Reuters veröffentlichten Vorgangsweise berechnet. Für die Version 2.0 ist geplant auch Nichtlineare Portfolios zu unterstützen.

EnerRISK

- **Operative Überwachung des Value at Risk für lineare Portfolios**

Funktionen für Energiehandelsunternehmen

- Berechnung des VaR auf Portfolio- oder Portfoliogruppenbasis
- Einbettung in das operative Energiehandelsmanagementsystem

Funktionen für Energieversorgungsunternehmen/Lieferanten

- Risikomanagement im Rahmen der Beschaffung und Mittelfristplanung

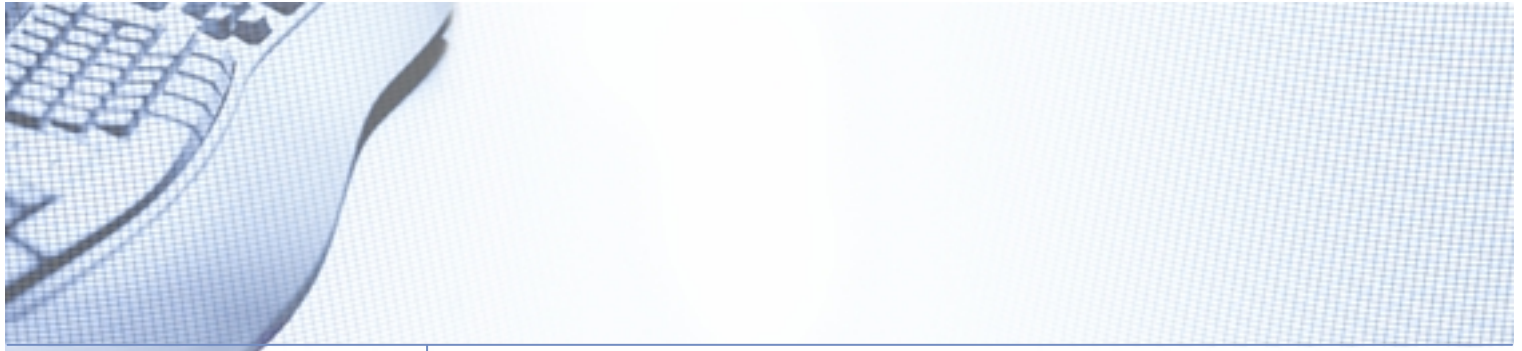
Leistungsmerkmale

- Berechnung einer Price Forward Curve anhand von Börsedaten
- Mapping der börsennotierten Standardprodukte auf Constant Mature Forward Produkte
- Berechnung der Varianz Kovarianz Matrix der einzelnen Constant Mature Forwards
- Berechnung des VaR für lineare Portfolios
- Anzeige des VaR im Handelssystem unmittelbar nach Eingabe eines neuen Geschäfts

Technische Voraussetzungen

Server

- Oracle ab 8.1.7/SQL Server 2000
- Windows 2000
- Oracle Client 9i
- Oracle OLEDB Provider 9i



CC 7A 39 15 C0 DA 40 15 C0 15
92 D8 46 02 45 40 F0 02 45 02
60 98 BB 83 F4 F0 61 83 F4 83
DA B0 2F 62 D6 61 49 62 D6 62
CC 7A 39 15 C0 DA 40 15 C0 15
92 D8 46 02 45 40 F0 02 45 02
60 98 BB 83 F4 F0 61 83 F4 83
DA B0 2F 62 D6 61 49 62 D6 62

HAKOM

Client

- Windows 2000 oder XP
- Internet Explorer 6.0
- Oracle OLEDB Provider 9i