



Eigenhandel

ITREXS³ GmbH

Schäfergasse 8
65428 Rüsselsheim
Germany

Tel. +49 6142 6902 0
Fax +49 6142 6902 25

www.itrexs.de

Depot A

- **Realtime Händlerposition**
- **Risikocontrolling**
- **IHS Verwaltung**
- **Internes Meldewesen**

Straight Through Processing

Modul Eigenhandel Depot A

Freie Gliederung der Nostro-Bestände z.B. nach

- *Bilanzpositionen*
- *Gattungsarten*
- *Händler*
- *Trading/Anlagebestand*
- *Refinanzierung, etc.*

Gewinnermittlung und Geldbuchung

- Berechnung der Einstandskurse nach Durchschnittsmethode
- Tägliche Gewinn-/Verlustermittlung bei Verkäufen, Glattstellungen, Shortpositionen
- Ermittlung Wertpapier- und Devisengewinn
- Gewinn/Verlust auf Einzelpositionen und Bestand
- Zinsabgrenzung/Agio auf Bestandsposition
- Generierung Geldbuchungen für Bilanzkonten
- Schnittstelle Geldbuchungen/Abstimmung (DTA-Format)
- Abschreibung nach Niederstwertprinzip
- Währungsbuchungen
- Bewertung offener Geschäfte

Bestandsführung und Abstimmung

Depots können zu Gruppen konsolidiert werden. Die Zuordnung von Bilanz- und Zinskonten zu den einzelnen Nostrodepots erfolgt automatisch.

- Aktueller und valutarischer Bestand
- Abstimmung der realisierten Gewinne/Verluste mit den GuV-Konten
- Stornofunktion mit automatischer GuV- Neuberechnung

Information und Analyse

- Kennzahlenermittlung: Renditeberechnung, Duration, modified Duration, Convexity

- Umsatzstatistik nach Wertpapier, Zeitraum, Händler, Depotgruppen etc.
- Offene Devisenpositionen
- Cash-Flow-Analyse in EURO und Währung für Zinsen und Rückzahlungen
- Fälligkeitsstruktur
- Analyse nach Emittenten, Länder, Renditen, Duration, Laufzeit, etc.
- Tagesumsatzstatistik mit historischem Nachweis (Bestand, Zinsanspruch, realisierte GuV, unrealisierte GuV, Provision, Anzahl Geschäfte nach Aktien/Renten und Währungen getrennt)

Reporting

- Erstellung individueller SQL-Reports mit integriertem Reportingtool (Impromptu)
- Standardreports

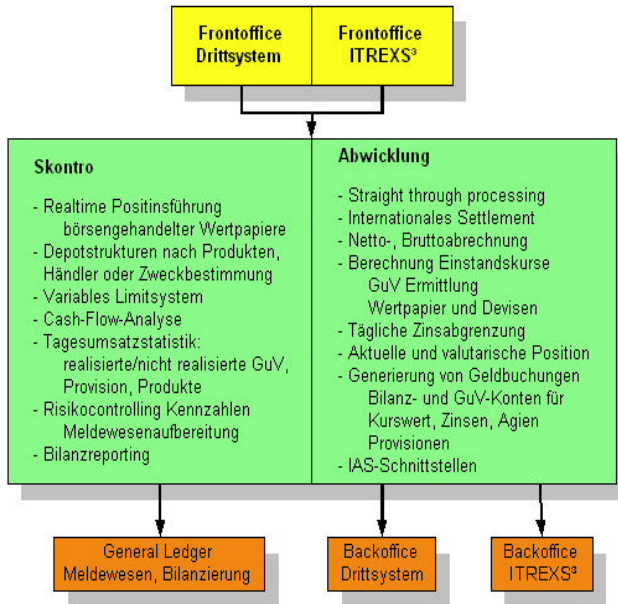
Internes Meldewesen

- Bilanznachweis
- Gewinn/Verlust, Abschreibung, Kursreserve
- Lombardfähigkeit
- nicht börsenfähige Wertpapiere
- Datenaufbereitung für Grundsatz I, BISTA Anlage E, KWG §§ 13, 14,
- Emissionsstatistik
- Auslandsstatus

Risikocontrolling

- Positionsrisiko
- Zinsänderungsrisiko
- Fremdwährungsrisiko
- Adressenausfallrisiko
- Szenarien Best- und Worstcase
- Cash-flow-Analyse
- Limitauslastung Volumenlimit, Verlustlimit, Emittenten- Kontrahentenlimit, Risikolimit
- Risikoreport
- Value at Risk Varianz/ Kovarianz (optional)

Realtime Händlerposition



IHS Eigenemissionen

- Verwaltung der Gattungs- und Emissionsdaten
- Führen Emissionsbestand
- Abverkauf
- Einlösung/Tilgung
- Ermittlung von Agien nach verschiedenen Methoden (Zerobonds, Emissionsrendite anteilige Zinsen und anteiliges Agio/Disagio, Geldbuchung)
- Abgrenzung von Agien und Zinsen
- Tilgung und Auflösung von Agien
- Generierung, Geldbuchung
- Reporting
- Betriebswirtschaftliche Bewertungen
- Wertaufholung, Agien, aufgelöste Agien
- Kennzahlenermittlung
- Meldewesen

Produkte

- Inhaber/Schuldverschreibungen
- Sparbriefe
- Hypothekenpfandbriefe
- Pfandbriefe
- Schuldscheindarlehen
- Certificates of Deposit

Verzinsung

- Standard, Plain Vanilla
- Anleihen mit verkürztem oder verlängertem Coupon
- Floater (FRN) mit Cap und Floor
- Stufenzinsanleihe, Step up, Step down
- Zerobonds, auf- und abgezinst
- Strukturierte Anleihen Plain Vanilla

Zusatzmodule für den Eigenhandel

Options & Futures

- *Geschäftserfassung*
- *Abrechnung*
- *Bestandsführung*
- *Margenberechnung*
- *Gewinnermittlung*
- *Bestandsanalyse*
- *Finanzmathematik* Kennzahlen und Risiken
- implizierte Volatilität
- Gamma
- Delta
- Vega
- Theta
- Deltaäquivalent
- Gammafaktor Risiko
- Vegafaktor Risiko
- theoretischer Preis.

Money Market & Zinsderivate

- *Tagesgeld*
- *Termingeld*
- *Lombardkredite*
- *SWAP*
- *FRA*
- *CAP/FLOOR*

Bewertung nach Bilanzierungsgrundsätzen und Risikoaspekten

- Prämienuordnung taggenau
- Ergebnisermittlung nach Produkt und Bewertungseinheiten
- Einzelbewertung der Cash-Flows
- Optionspreismodelle nach Black & Scholes
- Barwertmethode interne Ermittlung Diskontfaktoren und Forwardsätzen
- Limite nach Bewertungseinheiten

Devisengeschäfte

- *Devisenkassa*
- *Devisentermin*
- *Devisenoption*
- Positionsführung Kassageschäfte
- Terminüberwachung
- Risikobewertung
- Bewertung Handelsergebnis
- Optionspreismodelle B&S oder Binominal

Schnittstellen

- Gattungen WM-Daten-Service
- EUREX-/XETRA-Interfache Value API, (optional)
- Meldewesen BAIS/Samba/Abacus fire
- FIX-Protokoll
- MQ-Services (Forex, UBS)
- Reuters TRIARCH
- Telekurs
- Fides Kursservice
- S.W.I.F.T.-Interface