

Egger Group: PoC zur Risikosimulation für das Treasury Risk Management



Projektziele

Eigenentwicklung eines Systems zur Simulation verschiedener Value at Risk-Kennzahlen.

- Ablösung eines Blackbox-Systems zur Simulation von Wechselkursrisiken
- Monte-Carlo-Simulationen für verschiedene konzernübergreifende Risikopositionen, mit datengestützten Verteilungen und Berücksichtigung von Faktoren wie Kurskorrelationen, Forwardpreisen und Zinssatzentwicklung
- Konfigurierbare Berechnung des Values at Risk für verschiedene Zeithorizonte und Aggregationslevel
- Automatisierung der Berechnungen mit anschließender Aufbereitung und Visualisierung der Ergebnisse
- Datenanbindung an VORSYSTEM

Kundennutzen

- Transparente Berechnung der Wechselkursrisiken
- Ablösung von komplexen und zeitaufwändigen Excelberechnungen
- Umfassende Entscheidungsgrundlage für das Hedging der Risikopositionen
- Validierung der Vorgehensweisen zur Simulation von Preis- bzw. Mengenrisiken
- Hohes Sparpotenzial durch automatisierte Berechnungen
- Möglichkeit der Risikoanalyse auf verschiedenen Aggregationsebenen (Werk, Land, Währung...)

Peter Kofler, Head of Corporate Development/Risk Management:

„In kürzester Zeit entstanden spannende Einblicke und wertvolle Erkenntnisse. Zielorientiertheit, Kompetenz und Einsatz machten eine schnelle Umsetzung des PoC möglich! Ich danke Braincourt für dieses partnerschaftliche Projekt und die professionelle Arbeit und freue mich auf die weitere Umsetzung des gesamten Projekts.“

Projektetails

| | |
|---------------------------------|----------------------------|
| Projektdauer: | 3 Monate |
| Anwender/ Projektbeteiligte: | Treasury, Risikomanagement |
| Eingesetzte Tools: | KNIME, Python, SAP BW, Git |