

# TREASURY MANAGEMENT

## COLLATERAL OPTIMIZER UND MANAGEMENT INFORMATION SYSTEM

Sopra Steria Consulting hat zwei Module als Softwarelösung für den Einsatz im Treasury Management entwickelt. Der Einsatz beider Module ermöglicht den systemseitigen Transfer in das gewünschte zukunftsorientierte Treasury Management Business Model und deckt operative wie strategische Anforderungen ab. Mit dem Entwicklungsansatz der „individualisierten Standardsoftware“\* sind wir in der Lage, jedes Modul effizient auf Ihren Bedarf individuell zu adaptieren und ressourcenschonend zu implementieren.

### Zentralisiertes und effizientes Collateral Management mit dem Collateral Optimizer

Das Management von Sicherheiten wird im effizienten Business Model als zentrale Funktion verstanden. Als Systemkomponente hat Sopra Steria Consulting den Collateral Optimizer (COpt) entwickelt.

Folgende Kernfunktionalitäten zeichnen ihn aus:

- Auswertung des zentralen Asset-Bestands und des Credit Support Annex (CSA) Inventars
- Übersetzung der Risikodaten als Erfüllungsgröße
- Effiziente und optimierte Collateral-Allokation
- Bedarfsgerechte P&L-Verteilung

#### Zentrale Inventare: Collateral & CSA

Die zentralen Inventare und die zu besichernden Posten stellen die Grundlage des Handelns dar und sind individuell konfigurierbar.

Das Collateral-Inventar setzt sich aus den zur Verfügung gestellten Assets zusammen. Hier werden alle notwendigen Informationen mitgeführt, um die gewünschte Operationalität zu gewährleisten. Als Gegenstück führt der COpt die zu besichernden Risikopositionen mit. Auf Basis der individuellen CSA wird im Ergebnis für jede Transaktion die optimale Besicherung gewählt.

Das CSA Inventar ist für jede Counterparty in Bezug auf unterschiedliche Gruppen (bspw. Produkte, Handelsbereiche) hinterlegbar.

#### Allokation

Der COpt erlaubt grundsätzlich zwei unterschiedliche Allokationstypen:

- a) Die tägliche Allokation bedient die Margin Call Disposition von Über- und Unterdeckung.
- b) Die generelle Prüfung der Collateral-Allokation auf Basis aller freien und zugeordneten Assets ist eine ganzheitliche und zeitlich unabhängige Komponente.

Durch diese Unterscheidung wird die tägliche Disposition der „Margin Calls“ durchgeführt und darüber hinaus durch die generelle Opportunitätsprüfung im Rahmen der Optimierung der gesamten Collateral-Zuordnung angeboten. Damit sind Sie in der Lage, operative und strategische Ziele (bspw. Prozessoptimierung, Kostenreduzierung etc.) effektiv umzusetzen.

#### Individuelle Konfiguration

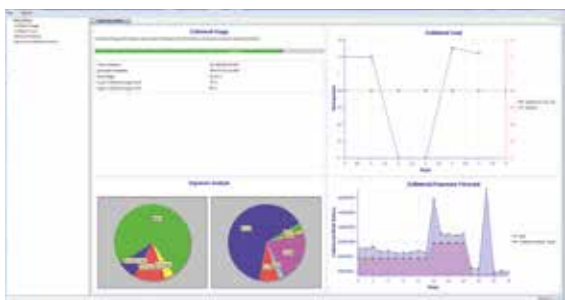
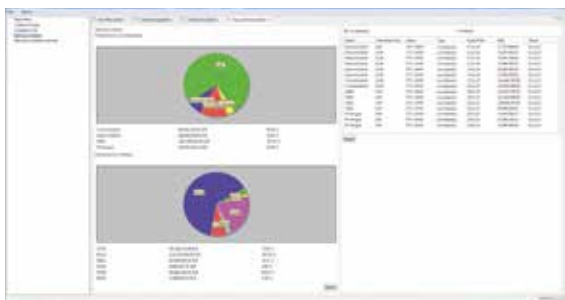
Zur effizienten Zuordnung der Assets als Collateral werden individuell gewichtete Parameter angewendet. Diese Option berücksichtigt sowohl Kriterien des Assets als auch die Struktur der zu besichernden Risikoposition. Darüber hinaus wird als Baseline der jeweils gültige CSA abgedeckt.

\* Details zur „individualisierten Standardsoftware“ finden Sie in unserer Informationsbroschüre unter <https://www.steria.com/de/loesungen/treasury-management/>

## MIS: aggregierte Übersicht und Detailauswertung mit dem Management Information System

Das Cockpit-Konzept im MIS liefert Ihnen die notwendigen und gewünschten Informationen aus Collateral- und Risikodaten schnell und verlässlich. Damit behalten Sie stets den Überblick und wissen, welchen Kurs Sie einschlagen.

Die Gesamtübersicht bereitet für Sie alle wesentlichen Informationen auf. Detailinformationen, Szenario-Betrachtungen und Reporting-Funktionalitäten werden über entsprechende Funktionsmenüs zur Verfügung gestellt.



### Collateral Usage

Im Rahmen der Collateral-Inventar-Detailbetrachtung und abgeleiteter Auswertungen wird eine Sichtung der Asset-Bestände nach verschiedenen Selektionskriterien ermöglicht: in use/not in use/not eligible. Damit stellen wir die Basisinformation zur effizienten Strukturierung des Collateral-Portfolio bereit.

### Collateral Cost

Ein wichtiger Bestandteil der Bereitstellung von Assets als Collateral ist das interne Transfer Pricing. Im COpt ist diese Stellgröße neben den Refinanzierungskosten als Nukleus für ein Kosten-Ertrags-reporting definiert und im MIS entsprechend angewandt.

### Exposure-Analyse

Im Rahmen der Exposure-Analyse werden die Risikopositionen strukturiert und stehen sowohl im MIS-Portal als auch über Download-Funktion zur Detailauswertung zur Verfügung.

### Collateral/Exposure-Analyse

Das MIS geht über das vergangenheitsorientierte Reporting hinaus und bietet Forecasting-Funktionalitäten an. Durch den Einsatz von entsprechenden Szenarioanalysen sind Sie schnell und effizient in der Lage, Situationen einzuschätzen und operative sowie strategische Entscheidungen zu treffen. Auch dies ist konsistent wieder für beide Seiten - Collateral und Risiko - umgesetzt.

### Efficient Customizing

Neben den im MIS-Cockpit aufgeführten Standardübersichten bieten wir im Rahmen des Konzeptes zur „individualisierten Standardsoftware“ die Möglichkeit, Ihre individuellen Anforderungen an das Informationsportal schnell und effizient umzusetzen.

## Kontakt

Weitere Informationen unter: [www.soprasteria.de/loesungen/software/treasury-management](http://www.soprasteria.de/loesungen/software/treasury-management). Gerne stehen wir zu einer DEMO-Präsentation zur Verfügung und freuen uns über Ihre Rückmeldung!

