



Berücksichtigung des Kontrahentenrisikos und des Multi-Curve-Ansatzes in SAP TRM

Key words/ Schlagworte:
IFRS 13, Multi-Curve-Ansatz, Risk Management, Kontrahentenausfallrisiko

Düsseldorf, den 16.11.2015 – Das international tätige IT-Beratungsunternehmen bdf consultants GmbH steht Ihnen zur Seite und hilft Ihnen bei der Implementierung der neuen Prozesse in Ihrem SAP-System.

Für die Berücksichtigung existierender Basis-Spreads müssen je nach Zinszahlungsfrequenz (Tenor) unterschiedliche Zinskurven für die Bewertung herangezogen werden (Multi-Curve-Ansatz). Darüber hinaus müssen auch die Kontrahentenausfallrisiken der Geschäftspartner über Credit Spreads in die Bewertung eingehen (Credit Value Adjustment).

Die Kontrahentenausfallrisiken werden in SAP-TRM über einen Aufschlag des Credit Spreads auf den risikofreien Zinssatz berücksichtigt im Zuge der Diskontierung der Zahlungsströme.

Bezüglich der Bewertung werden ein risikofreier Fair Value und ein Fair Value mit Berücksichtigung von Credit Spreads ermittelt. Die sich ergebende Differenz bildet dann da CVA und DVA (Debt Value Adjustment) eines Geschäfts.

SAP bietet hierfür einen neuen Lösungsansatz, um diesen Anforderungen gerecht zu werden. Über das Zinskurven-Framework sind sämtliche Anpassungen möglich und mit unserer langjährigen Erfahrung im Bereich Risiko-Management werden wir alle eventuell aufkommenden Herausforderungen bewältigen und mit Ihnen zusammen das Projekt zum Erfolg führen.

Wie setzen die Bewertungsmethodik für Sie in SAP-TRM um und unterstützen bei der Auswahl der passenden Marktdaten und Marktdatenanbieter, bei der Erstellung von Zinskurven in SAP, stellen die Zuordnung der Credit-Spreads und der Spread-kurven zu den Finanzgeschäften sicher und erstellen, falls gewünscht, auch Reports.

Firmenprofil bdf consultants GmbH

Das international tätige IT-Beratungsunternehmen bdf consultants GmbH ist spezialisiert auf die Planung, Einführung und Optimierung von SAP-Lösungen und -Komponenten für das Financial Supply Chain Management (FSCM), Treasury Management (TRM), Risk Management und das Product Lifecycle Management (PLM). bdf consultants hat in diesen Bereichen langjährige Branchen-, Prozess- und Beratungserfahrung und unterstützt als zuverlässiger Partner Unternehmen aller Größen effizient bei der Umsetzung ihrer IT-

Strategien und Projekte und bei der Verbesserung und Wertsteigerung der Geschäftsprozesse. So profitieren Kunden von IT-Lösungen, die betriebliche Abläufe nachhaltig optimieren und wirtschaftlicher machen und eine vorausschauende Unternehmenssteuerung erlauben. Einen wichtigen Beitrag dazu leisten die von bdf consultants entwickelten und vollständig in SAP ERP integrierten Add-On-Lösungen bdfCPC (Cash-Cockpit), das bdfLQP (Liquidity Planing) und das DCC (Document Control Center), die für eine reibungslose Dokumentenlogistik und ein durchgängig transparentes Cash-Management sorgen. Der 2001 gegründete IT-Dienstleister hat Niederlassungen in Düsseldorf und München.

Copyright:

- No part of this publication may be reproduced or transmitted in any form or for any purpose without the express permission of bdf*. The information contained herein may be changed without prior notice.
- PCC-DCC, PCC-MCC, PCC-ECC, PCC-ACC, PCC-GSC and other bdf products and services mentioned herein as well as their respective logos are trademarks or registered trademarks of bdf in Germany and other countries.
- Some software products marketed by bdf and its distributors contain proprietary software components of other software vendors.
- SAP, R/3, ECC, SAP NetWeaver, Duet, PartnerEdge, ByDesign, SAP Business ByDesign, and other SAP products and services mentioned herein as well as their respective logos are trademarks or registered trademarks of SAP AG in Germany and other countries.