



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

BERECHNUNG SCR-SCHOCK PARAMETER FENION GMBH



Stefan Fischer MSc

Managing Partner
Mobile: +43 664 49 79 111



Mag. Nikolaus Sernetz

Managing Partner
Mobile: +43 664 39 39 993



DI Alexander Adamenko

Managing Partner
Mobile: +43 660 70 58 943



BERECHNUNG DER SCR SCHOCK PARAMETER.

Das Marktrisiko ergibt sich aus der Höhe oder Volatilität der Marktpreise von Finanzinstrumenten. Das Marktrisiko, dem das Unternehmen ausgesetzt ist, wird anhand der Auswirkung von Veränderungen finanzieller Variablen wie Aktienkursen, Zinssätzen, Immobilienpreisen und Wechselkursen gemessen.

FENION
QUANT

KALKULATION MARKTRISIKO

- Kalkulation der SCR Schock-Parameter auf Basis des Look-Through-Approach
- Berechnung verschiedener Stress-Szenarien (u.a. Simulation einer Verschiebung der Zinskurven)
- Daten-Validierungen und / oder Enrichment (u.a. LEI, CIC, NACE Codes)
- Durchführung automatisierter Qualitätskontrollen
- Integration der Berechnungen in das Solvency II TPT
- Ausweis der Parameter in einem eigens erstellten Solvency II Fact Sheet



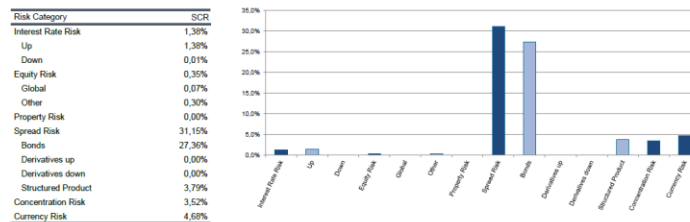
Solvency II Fact Sheet Fenion Eur - Class G

Date as at 31.08.2020

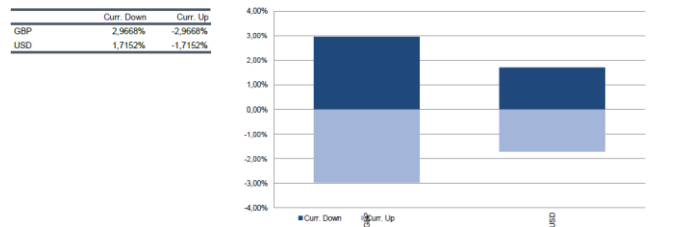
Key Information

Fund: Fenion Eur - Class G
 Portfolio Currency: EUR
 NAV: 364.655.594,87 EUR SCR (aba): 120.945.158,21 EUR
 SCR: 33,17 %

SCR Breakdown by Risk Category



Currency Risk



Concentration Risk



MARKTRISIKO

- Interest Rate Risk
- Equity Risk
- Real Estate Risk
- Spread Risk
- FX Risk
- Concentration Risk



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

KONTAKT



ADRESSE

Mariahilfer Straße 136, 1150 Wien



TELEFON

+43 (1) 908 11 80



EMAIL

office@fenion.at



Mag. Nikolaus Sernetz
Managing Partner

IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

KONTAKT

Fenion GmbH
Mariahilfer Straße 136
1150 Wien
Bereich: IT-Dienstleistungen
UID: ATU72994405
FN: 483557p
FB-Gericht: Wien
E-Mail: office@fenion.at

SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

