

## Presseinformation

### ITS Release 10.0.0

*Im ITS Release 10.0.0 von ecofinance wurden die neuen Herausforderungen im Zahlungsverkehr berücksichtigt und etliche Ergänzungen im Risk Management vorgenommen. Dazu gehören die Einführung neuer Risikokennzahlen, vielfältigere Bewertungsmöglichkeiten und Erweiterungen im Hedge Accounting.*

**Graz, 06. Dezember 2010 – Die ecofinance Finanzsoftware & Consulting GmbH, eines der führenden Softwarehäuser im internationalen Treasury Management, liefert ihr neues Release ITS 10.0.0. Unternehmerische Entscheidungen werden heute mehr denn je auf Basis von Kennzahlen getroffen. Mit dem Herbstrelease steht jetzt auch der Conditional Value at Risk (cVaR) zur Verfügung. Das neue Release berücksichtigt darüber hinaus das Kontrahentenrisiko (Ausfallrisiko) bei Bewertungen und bietet absolute und relative Toleranzwerte bei Effektivitätstests, wodurch die Auswirkungen durch kleinere Wertänderungen besser gesteuert werden können. Neue Importmöglichkeiten und Prüfroutinen verbessern neben den laufenden Anpassungen für EBICS den Zahlungsverkehr.**

### Von Payment Factory bis Prüfroutinen

Basierend auf den Eigenschaften einer Zahlung über Zahlungsformat-Regeln wird in der Payment Factory das optimale Zahlungsformat automatisch ermittelt, nachdem der User einmal festgelegt hat, in welchen Fällen welches Format erwünscht ist. Durch eine Vielzahl an Such- und Filterkriterien schlägt das System automatisch das optimale Format für den kostengünstigen Zahlungsverkehr vor.

Fehlerprävention auf höchstem Niveau stellt die neue Doppeleinreichkontrolle sicher, gefordert vor allem im Massenzahlungsverkehr. Hier werden sämtliche Zahlungen auf Dubletten geprüft und der Nutzer erhält per E-Mail oder

**ecofinance**  
**Finanzsoftware & Consulting GmbH**  
Hannelore Molzbichler  
Arche Noah 11  
8020 Graz, Austria  
Fon ++43 (0)316 / 90 80 30  
hannelore.molzbichler@ecofinance.com  
www.ecofinance.com

**p.co communications**  
Petra Reppert  
Potsdamer Str. 5  
80802 München  
Fon ++49 (0)89 / 99 01 97-11  
Fax ++49 (0)89 / 99 01 97-29  
petra.reppert@p-co-com.de  
www.pco-communications.de

## Presseinformation

Alert einen Hinweis im Falle einer Doppelzahlung. Die lückenlose Prozess-Dokumentation gewährleistet zugleich absolute Revisionsicherheit.

Durch Prüfroutinen werden auch BICs und IBANs automatisiert vom System geprüft. Komfortabel für den User ist der Import des BICPlusIBAN Verzeichnisses. Im Bereich des Deutschen Bundeszahlungsverkehrs können weitere Directories (BLZ-Verzeichnis der Deutschen Bundesbank, SEPA-Clearer Directory der Deutschen Bundesbank) importiert und entsprechende Zahlungsdetails mit Prüfroutinen überwacht werden.

## Risikobewertung

Schon bisher bietet ITS Tools für Simulationen, Szenarioanalysen, Limitverwaltung und -überwachung für das Risk Management. Auch Hedge Accounting inklusive Effektivitätstests und die Berechnung von Risikokennzahlen werden unterstützt. Dazu gehören Value-at-Risk- oder Cashflow-at-Risk-Berechnungen für Einzelgeschäfte oder individuell definierte Portfolios. Im neuen Release wird bei der Berechnung des VaR auch der Conditional Value at Risk (cVaR) ermittelt. Dieser entspricht dem erwarteten Verlust, wenn die VaR-Schwelle überschritten wird.

Bei der Bewertung von nicht standardisierten Zinsinstrumenten sind Convexity Adjustments zu berücksichtigen. Ein klassisches Beispiel ist ein Constant Maturity Swap. Zur korrekten Darstellung wird eine Anpassung der Forward (Swap) Rate durchgeführt, die Zinsanpassung durch das Convexity Adjustment korrigiert. Die Entscheidung über eine Anpassung kann auf der Ebene des Einzelgeschäfts getroffen werden.

Mit dem Release 10.0.0 ist auch die Berechnung des Kontrahentenrisikos (Ausfallrisiko) bei Bewertungen enthalten. Die Messung erfolgt mittels CDS (Credit Default Swap) Spreads, welche einen Aufschlag auf die faire Zinskurve darstellen. CDS Kurven können für Firmen, Institute und Emittenten definiert werden. Abhängig vom

**ecofinance**  
**Finanzsoftware & Consulting GmbH**  
Hannelore Molzbichler  
Arche Noah 11  
8020 Graz, Austria  
Fon ++43 (0)316 / 90 80 30  
hannelore.molzbichler@ecofinance.com  
www.ecofinance.com

**p.co communications**  
Petra Reppert  
Potsdamer Str. 5  
80802 München  
Fon ++49 (0)89 / 99 01 97-11  
Fax ++49 (0)89 / 99 01 97-29  
petra.reppert@p-co-com.de  
www.pco-communications.de

## Presseinformation

Marktwert des Geschäftes können für die Bewertung unterschiedliche CDS Spreads herangezogen werden. Beispiel positiver Marktwert: "Bewertung auf Basis CDS Spreads des Instituts", negativer Marktwert: "Bewertung auf Basis CDS Spreads der Firma".

Für die Effektivitätsermittlung von Sicherungsbeziehungen können jetzt auch Toleranzwerte individuell festgelegt werden. Durch Definition der absoluten und relativen Toleranzen sind die Auswirkungen auf die Effektivität bei kleinen Wertänderungen besser zu steuern. Diese ergeben sich bei der Ermittlung der Buchwertanpassung des Grundgeschäftes oder auch bei der Wertänderung des Sicherungsgeschäftes.

Weitere Informationen auch unter [www.ecofinance.com](http://www.ecofinance.com)

4 191 Zeichen

### **ecofinance Finanzsoftware & Consulting GmbH**

*ecofinance ist eines der führenden Softwarehäuser im internationalen Treasury Management. Seit 1984 stellt das Unternehmen als kompetenter und verlässlicher Partner für weltweit agierende Konzerne sein Integrated Treasury System ITS zur Verfügung. Die enge Zusammenarbeit mit verschiedenen Universitäten und Experten erlaubt zugleich die profunde und konsequente Weiterentwicklung der Softwaremodule. Durch integrierte Softwarelösungen und individuelle Betreuung unterstützt ecofinance Konzerne im Treasury-, Cash- und Risk-Management, in der Finanzplanung, beim Zahlungsverkehr und im Reporting. ITS ist weltweit im Einsatz, Konzerngesellschaften werden einfach und sicher in das System eingebunden. Kreditinstitute können ihren Firmenkunden als Application Service Provider (ASP) mit der Software von ecofinance Zugang zu professionellem Cash-Management, Cash-Pooling und Treasury-Management bieten. Zahlreiche Unternehmen und namhafte Banken nutzen seit über 20 Jahren die integrierten Systeme von ecofinance. Dazu gehören Bilfinger Berger, Schörghuber Unternehmensgruppe, Bosch, Müller Drogeriemärkte, Deutsche Bahn, Flughafen München, STRABAG, Zumtobel, ZF Friedrichshafen, REWE, Wilh. Werhahn, Giesecke & Devrient, Lindt u.v.a.m. Namhafte Banken wie die UniCredit Group, Commerzbank, Raiffeisen Zentralbank oder Swedbank nutzen die integrierten ecofinance Systeme. Weitere Infos unter [www.ecofinance.com](http://www.ecofinance.com).*

**ecofinance**  
**Finanzsoftware & Consulting GmbH**  
Hannelore Molzbichler  
Arche Noah 11  
8020 Graz, Austria  
Fon ++43 (0)316 / 90 80 30  
[hannelore.molzbichler@ecofinance.com](mailto:hannelore.molzbichler@ecofinance.com)  
[www.ecofinance.com](http://www.ecofinance.com)

**p.co communications**  
Petra Reppert  
Potsdamer Str. 5  
80802 München  
Fon ++49 (0)89 / 99 01 97-11  
Fax ++49 (0)89 / 99 01 97-29  
[petra.reppert@p-co-com.de](mailto:petra.reppert@p-co-com.de)  
[www.pco-communications.de](http://www.pco-communications.de)