

Speedwell Calculation Services

SCS ist ein web-basierter Service für die Bewertung und Berichterstattung von indexbasierten Wetterrisikoabsicherungsverträgen

SCS ist ein post-trade Dienst, welcher alle notwendigen Informationen für das Management eines Wetterrisikoabsicherungsvertrages verfügbar, und seine tägliche Wertänderung leicht verständlich macht. SCS verknüpft die neuesten Wetterbeobachtungswerte mit numerischen Wettervorhersagen, um automatisiert die aktuelle Tagesbewertung und die Risikometrik zu generieren.

- **Risikobewertung:** Mark-to-Market (MTM) und Mark-to-Model Bewertungen für komplexe Wettertransaktionen. Die Derivatsbewertung entspricht den höchsten Industriestandards.
- **Risikoberichterstattung:** Verschiedene Risikomaße sind innerhalb der SCS verfügbar. Standard-Risikomaße wie Wert-im-Risiko (VaR), die Griechen und der Wahrscheinliche Höchstschaden (PML) werden täglich berechnet.

End of Day Risk Reports

End of Day Risk Reports are calculated between 2pm and 4pm UK local time and provide independent mark to model values, value at risk measures and sensitivities.

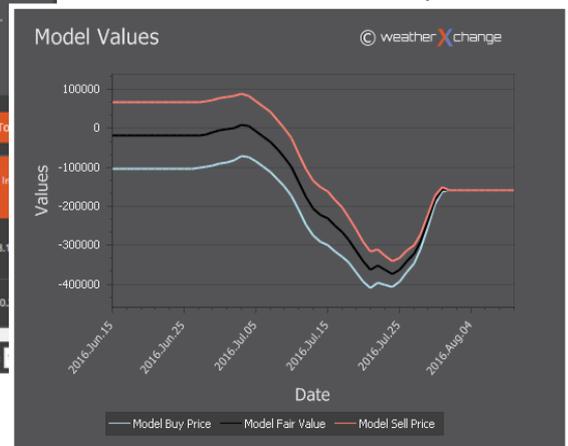
Reporting Date: 14/07/2016 Refresh Export To

Executed Contract Name	Buy?	Counterparty	Model Fair Value	Model Buy Price	Model Sell Price	Expiry VaR 97.5%	Expiry VaR 99%	Expiry VaR 99.9%	Model Index Average	Model Index StDev
Miami TMax Jul-Aug-16	False		165	126	204	-350	-350	-350	2.16	3.1
long Miami	True		500	500	500	300	300	300	30.10	10.0

Page 1 of 1 (2 items) 1 Page size:

Betrachtung der Risikometriken für mehrere Verträge gleichzeitig

Betrachtung historischer Bewertungen: Graphenformat



Historical Values Summary Export To Excel

Calculation Date	Model Fair Value	Model Index Average	Model Index StDev	Partial Index With Forecast	Partial Index Date With Forecast	Model Buy Price	Model Sell Price	Delta	Gamma	Vega
2016-Jun-30	149	514.89	3.34	494.50	2016-Jun-29	142	156	10.00	0.00	0.00
2016-Jun-29	161	516.84	6.74	476.00	2016-Jun-28	148	174	161.02	0.00	0.28
2016-Jun-28	159	516.92	9.65	455.50	2016-Jun-27	141	178	159.42	0.91	1.23
2016-Jun-27	157	516.45	12.39	434.50	2016-Jun-26	135	180	157.23	0.03	2.05
2016-Jun-26	160	517.20	15.25	415.00	2016-Jun-25	140	185	158.24	0.60	2.23

Betrachtung historischer Bewertungen: Tabellenformat

Eingangsfenster SCS auf der WX Plattform

SCS ist über die weatherXchange® Plattform erhältlich. Mit nur wenigen Klicks kann der Nutzer eine detaillierte Risikobewertung und –berichterstattung für Middleoffice und Backoffice erstellen. Die Bewertungen können auf der WX Plattform numerisch und graphisch dargestellt werden, aber auch in eine Datei exportiert und in die jeweils verwendete Unternehmenssoftware integriert.



Speedwell Calculation Services Ltd und weatherXchange Ltd sind vollständige Tochtergesellschaften der Speedwell Associates Group, welche seit 1999 Services im Wetterrisikomarkt anbietet.

Die weatherXchange® Plattform unterstützt neue wie auch bisherige Hedger beim Zugang zur indexbasierten Wetterrisikoabsicherung indem sie kostenlose pre-trade Strukturierungswerkzeuge, einen kostenlosen automatisierten Preisvergleich sowie kostenpflichtige post-trade Dienste inklusive Settlement Diensten und Speedwell Calculation Services anbietet. weatherXchange Ltd wird von der Financial Conduct Authority autorisiert und reguliert.