

# UnRisk

## UnRisk EXCEL

Umfassende Analysen im Spreadsheet-Format



## Was ist UnRisk EXCEL?

UnRisk EXCEL basiert auf der UnRisk Bewertungs-Engine und erlaubt die Bewertung einer Vielzahl von Finanzinstrumenten ohne spezifische Programmierkenntnisse. Bewertungsergebnisse und die zugrunde liegenden Daten werden im Spreadsheet gemeinsam verwaltet. Mit Hilfe von UnRisk EXCEL können Bewertungen und Szenarioanalysen effizient berechnet werden und Analysten können zielgerichtet Lösungen erarbeiten. Im Paket enthalten sind Spreadsheet-Templates, deren Verwendung

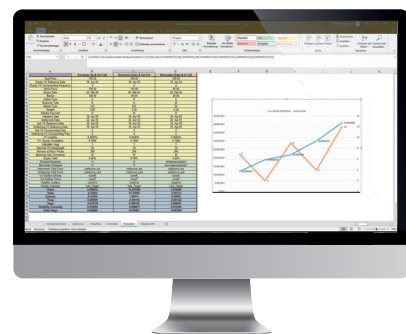
rasche Produktivität garantieren.

Die Bewertungs-Engine selbst bietet optimierte Routinen für das Bewerten und das Kalibrieren vieler Instrumente und Modelle. Es kommen verschiedene numerische Methoden wie (Quasi-) Monte Carlo, Finite Differenzen, Finite Elemente und Optimierung zum Einsatz, wobei besonderer Wert auf Stabilität und die finanzmathematischen Details gelegt wird.

## UnRisk EXCEL Abdeckung

### Instrumente:

- Zinsinstrumente und Derivate:  
Anleihen und Swaps einschließlich Range Accrual-, Spreads-, Target Redemption-, Step-Up-, ... Features, Caps & Floors, Swaptions, festverzinsliche Anleihen, Anleiheoptionen, FX gebundene Anleihen und Swaps, ...
- Optionen: Vanilla Options, Barrier Options, Digital Options, Path Dependent Options, ...



- Convertibles
- Inflationsgebundene Derivate: Inflationsgebundene Anleihen, Inflationsgebundene Swaps, ...
- Kreditderivate: CDS, TRS, CLN, N-th to Default, ...
- Rohstoffderivate: Futures, Optionen, ...
- FX Derivate: Vanilla Options, Barrier Options, Digital Options, Path Dependent Options, ...

## Vorteile und Funktionen von UnRisk EXCEL

- ✓ Bewertung von (komplexen) Finanzinstrumenten unter verschiedenen Modellen und Szenarien innerhalb von Microsoft Excel
- ✓ Unterstützt eine Vielzahl an verschiedenen Instrument-Typen und berücksichtigt die finanzmathematischen Details
- ✓ Unterstützt fortgeschrittene Kalibrierungstechniken mit Regularisierung
- ✓ Daten und Ergebnisse an einem Ort
- ✓ Flache Lernkurve – keine Programmierkenntnisse erforderlich
- ✓ Templates und eine Vielzahl an Beispielen sorgen für schnelle Produktivität

# UnRisk

**ADDITIVE**  
SOFT- & HARDWARE FÜR TECHNIK & WISSENSCHAFT

**ADDITIVE Soft- und Hardware für  
Technik und Wissenschaft GmbH**

Max-Planck-Str. 22b • 61381 Friedrichsdorf  
Tel.: +49 6172 5905 - 134 • Fax: +49 6172 77613  
<http://www.additive-mathematica.de>  
[mathematica@additive-net.de](mailto:mathematica@additive-net.de)