



## Bestellfax „Faktorsensitivitäten“ Abonnement für Faktorsensitivitäten zu Focus ALM 4

<b>Firma</b>	AlmafinJaeger, a SunGard Company	<b>Fax Nr. 052 / 560 60 99</b>
<b>Von</b>	.....	<b>Anzahl Seiten: 1</b>
<b>Mitteilung</b>	Abonnement: Faktorsensitivitäten	<b>Datum</b> .....

Für die Berechnung der **Value-at-Risk**-Grössen im ALM stellt AlmafinJaeger den Focus ALM Usern auf quartalsweiser Basis aktualisierte Faktorsensitivitäten zur Verfügung. Diese werden anhand einer Faktoranalyse aus den historischen Zinsveränderungen errechnet und beschreiben die Dynamik der Zinsstruktur. Ein auf dieser Basis ermittelter Value-at-Risk eignet sich beispielsweise als **internes Zinsrisikomass** für die Meldung zuhanden der SNB.

Die Daten können von unserer Homepage bezogen und in Focus ALM importiert werden.

- Jahrespauschale** für 4 quartalsweise Updates:
- CHF (4 Updates): CHF 1200.—
  - Euro (4 Updates): CHF 1200.—
  - USD (4 Updates): CHF 1200.—
  - Andere Währungen: je CHF 1200.—
- .....

- Die Faktorsensitivitäten werden standardmässig für folgende Gridpoints geliefert: 1M, 2M, 3M, 6M, 9M, 12M, 2Y, 3Y, 4Y, 5Y, 6Y, 7Y, 8Y, 9Y, 10Y. Zusätzliche Gridpoints-Sets sind auf Anfrage erhältlich.
- Die Daten sind jeweils zu Monatsbeginn auf unserer Website [www.alfafinjaeger.com](http://www.alfafinjaeger.com) (Download Area) verfügbar.
- Die Preise verstehen sich exkl. MWSt. Die Rechnungsstellung erfolgt nach der Erteilung des Passworts resp. zu Beginn der Abonnementsperiode.
- Die zur Verfügung gestellten Marktdaten sind als vertraulich zu betrachten und dürfen nicht an Drittparteien weitergeleitet werden.

Besten Dank für Ihren geschätzten Auftrag.

Der Auftraggeber:

Bank:.....

Unterschrift:.....

Name/Funktion:.....

01.10.2006