



# PORTFOLIO- UND RISIKOMANAGEMENT

## QUANTITATIVE BEWERTUNG UND BENCHMARKING IM RISIKOMANAGEMENT

**Komplexe quantitative Problemstellungen, wie Sie im Risikomanagement, der Energiebeschaffung oder im Energiehandel und -vertrieb auftreten, erfordern oft komplexe Bewertungsansätze und -methoden. Meist lassen sich diese in einfachen Excel-Auswertungen nur unzureichend abbilden. Es sind leistungsfähigere Analyse-Werkzeuge und -Modelle erforderlich.**

### NUTZEN

B E T steht Ihnen mit langjähriger Beratungserfahrung, weitreichender Marktübersicht und -expertise sowie einem umfangreichen Werkzeug-/Modellportfolio bei quantitativ getriebenen Problemstellungen zur Seite. In diesem Rahmen können beispielsweise die folgenden Bewertungen durchgeführt werden:

- Monte-Carlo Analysen auf Basis von Spot- und Forward-Preis-Simulationen
- Anwendung stochastischer Verfahren (z. B. Intrinsic Rolling, LSMC) zur Bewertung flexibler Assets und Verträge
- Prüfung und Kalkulation von Risikoprämien im Vertrieb durch Berechnung mit marktbasierter stochastischen Modellen
- Qualitative und quantitative Prüfung sowie Benchmarking von Price-Forward-Curves
- Analyse und Benchmarking von Prognosegüte sowie Ausgleichsenergiekosten im Branchenvergleich
- Quantitative Bewertung von Handelsstrategien und -risiken

### VORGEHENSWEISE

B E T identifiziert die wesentlichen Wert- bzw. Risikotreiber. Je nach Bedarf kommen erprobte Ansätze und Werkzeuge zur Erfassung, zur Bewertung sowie zum kontinuierlichen Monitoring und Reporting zum Einsatz. Gemeinsam mit Ihnen stimmen wir den benötigten Datenumfang ab, definieren relevante Szenarien und Berechnungsfälle und führen die Analysen im gewünschten Detaillierungsgrad durch.

### PROJEKTERGEBNISSE

Von der vorstandstauglichen Entscheidungsvorlage über eine detaillierte Methoden-/Prozessdokumentation bis hin zur Nutzbar-machung unserer Expertentools – wir stellen die Projektergebnisse im geeigneten Format für Sie bereit. Gerne unterstützen wir Sie auch bei den weiteren Schritten – von der Umsetzungsplanung, Lasten-hefterstellung und Dienstleistungsausschreibung bis zur Begleitung und Implementierung neuer Prozesse oder (IT-) Werkzeuge.



**Peter Edel**  
Berater

+ 49 241 47062-411  
peter.edel@bet-energie.de