

# PORTFOLIOMANAGEMENT

## Handelsgeschäfte effizient verwalten

Die **effiziente Strukturierung und intelligente Bewirtschaftung** von Absatz- und Erzeugungsmengen sind wesentliche Bausteine für **marktfähige Beschaffungsprozesse** von Energieversorgungsunternehmen. Mit dem Energiedatenmanagementsystem für Beschaffung und Vertrieb **robotron\*energy sales** optimieren Sie diese Prozesse. Das Robotron-Modul **Portfoliomangement** ermöglicht Ihnen, unabhängig von der Größe Ihres Portfolios, die strategische Bewirtschaftung Ihrer Verträge in verschiedenen Ausprägungen. Dabei werden verschiedene Wirtschaftsgüter unterstützt, wie Strom, Gas, Zertifikate sowie lagerfähige Brennstoffe.

### Ein Modul – Mehrere Optionen.

#### Vertriebsportfoliomanagement

Bewirtschaften Sie Ihre Absatzmengen kundengruppenscharf.

#### Erzeugungsportfoliomanagement

Bewirtschaften Sie Ihre Erzeugungsmengen nach Erzeugungsanlagen.

#### Handelsportfoliomanagement

Realisieren Sie den Handel mit Energie, Herkunftsnachweisen, Emissionsberechtigungen und Finanzderivaten auf dem Termin-, Day-Ahead, Intraday- und Day-After-Markt.

Aus der Cloud stellen wir alle für die Strom- und Gasbeschaffung im Energiemarkt notwendigen Funktionen flexibel abrufbar für Sie bereit.



# Unsere Lösung im Überblick

## Handelsgeschäfte

- ▶ intuitiver Wizard zum Anlegen von Handelsgeschäften
- ▶ Möglichkeit für vollautomatisches Anlegen von Handelsgeschäften mit freikonfigurierbaren Regeln
- ▶ Abbildung beliebig vieler Preiskomponenten, z. B. Festpreis, PFC-Bepreisung, Preisformeln
- ▶ Unterstützung verschiedener Geschäftstypen: physische Termin- und Kurzfristgeschäfte, Beschaffung von Lastgängen, Optionen, Swaps, Währungssicherungsgeschäfte und Kapazitäten
- ▶ Handelsgeschäfte-Import der Plattform Trayport
- ▶ vollautomatisierte Datenübergabe als Basis für REMIT-Meldungen

## Konfiguration und Überwachung von Preiszeitreihen

- ▶ Berechnung von Price-Forward-Curves (PFC)
- ▶ automatisierter Preisimport, z. B. von EEX-Settlement-Preisen
- ▶ tabellarische Tools für das Überwachen von Preistrends mit Kennzahlen-Visualisierung, wie Volatilität und VaR unter Berücksichtigung von Haltedauer und Wahrscheinlichkeit
- ▶ PFC-Skalierung und Plausibilisierung

## Gewährleistung Revisionsicherheit

- ▶ Speicherung aller Aktionen im Logbuch

## Risikomanagement

- ▶ Überwachung von Kennzahlen und Speicherung der Resultate für historische Auswertungen
- ▶ Definition von Limits für Beschaffer, Kontrahenten und Kennzahlen
- ▶ flexible Kennzahlenberechnung

## Bücher und Auswertungen

- ▶ Abbildung unternehmensspezifischer Portfolios
- ▶ beliebig komplexe Berechnungen an Buchlinien mit dem Formeleditor
- ▶ flexible Auswertungsoptionen in konfigurierbaren Übersichten, bspw. offene Position, Mark-to-Market, Value at Risk
- ▶ grafische und tabellarische Auswertungen mit vielfältigen Konfigurationsmöglichkeiten
- ▶ einfache Anbindung an Excel

## Automatische Verarbeitung von Positionen

- ▶ automatisierter Ausgleich offener Positionen
- ▶ regelbasierte Weiterverarbeitung von Handelsgeschäften
- ▶ automatische Erstellung von Spotgeboten
- ▶ Unterstützung rollierender Beschaffungsstrategien



Abbildung der kompletten Wertschöpfungskette aus einer Hand



modulare Systemarchitektur für maximale Flexibilität



hoher Automatisierungsgrad und Datenverfügbarkeit



Integrationsfähigkeit in die gesamte Robotron-Energiemarkt-Plattform

## IHR KONTAKT ZU UNS!

**Robotron Datenbank-Software GmbH**  
Telefon: +49 351 25859-0  
E-Mail: [sales@robotron.de](mailto:sales@robotron.de)  
[www.robotron.de](http://www.robotron.de)

**Robotron Schweiz GmbH**  
Telefon: +41 71 225 76 00  
E-Mail: [info@robotron.ch](mailto:info@robotron.ch)  
[www.robotron.ch](http://www.robotron.ch)

Stand: 05/2023