19.02.2018 Helaba startet mit Currency Overlay Programm für Firmenkunden Banken

Helaba startet mit Currency Overlay Programm für Firmenkunden

Die Helaba startet in Kooperation mit der Helaba Invest das Currency Overlay Programm HI-actiFX speziell für Firmenkunden.

Hierfür nutzt die Helaba das langjährige Know-how ihrer Tochtergesellschaft, die diese Methodik bereits erfolgreich im Rahmen ihrer Fonds-Management-Mandate einsetzt.

Bei HI-actiFX handelt es sich um eine aktive Währungsmanagementstrategie, bei der Sicherungsentscheidungen auf Basis von Fundamentaldaten und marktstimmungsorientierten Prognosemodellen getroffen werden, die vor nachteiligen Kursentwicklungen schützen und an vorteilhaften Kursentwicklungen partizipieren lassen sollen.

Hierzu verwendet die Helaba Invest ein regelbasiertes System. Auf Basis eines rein mathematisch-statistischen Verfahrens werden Handelssignale erzeugt und das Währungsrisiko aktiv gesteuert. Dabei wird die Wahrscheinlichkeit künftiger Kursentwicklungen in einem datenintensiven Verfahren mit verschiedenen Modellen in unterschiedlichen Betrachtungszeiträumen prognostiziert und täglich eine Sicherungsquote ermittelt.

»Mit dem Currency Overlay Programm HI-actiFX reagiert der Helaba Konzern auf die sich ändernden Märkte und Anforderungen im Treasury der Firmenkunden.«

Hans-Dieter Kemler
Vorstandsmitglied der Helaba

„Mit dem Currency Overlay Programm HI-actiFX reagiert der Helaba Konzern auf die sich ändernden Märkte und Anforderungen im Treasury der Firmenkunden“, sagt Hans-Dieter Kemler, Mitglied des Vorstandes der Helaba und u.a. zuständig für die Bereiche Kapitalmärkte sowie die Helaba Invest. „In Kundengesprächen wird deutlich, dass im Treasury von Unternehmen im Management von Fremdwährungszahlungen zwar erhebliche Risiken, aber auch Chancen bestehen, für die nachvollziehbare Lösungen gesucht werden“, ergänzt Dr. Hans-Ulrich Templin, Mitglied der Geschäftsführung der Helaba Invest und verantwortlich für das Overlay Management.

Die Komplexität bzw. Unvorhersehbarkeit der Währungsmärkte sowie die Expansion in immer neue Länder führt dazu, dass das Management von Fremdwährungsrisiken verstärkt in den Fokus bei groß- und mittelständischen Unternehmen in Deutschland rückt. Denn Veränderungen von Währungskursen nehmen direkten Einfluss auf das Unternehmensergebnis. Im Euro-Niedrigzinsumfeld kann es auf Grund der Zinsdifferenz in Drittländern zudem teuer sein, langfristig Fremdwährungspositionen zu sichern.

Darüber hinaus steigen unternehmensseitig die Anforderungen an Rechnungslegung, Compliance und Regulatorik bei gleichzeitiger Verknappung der Ressource Mensch. Insofern wird es für Treasury-Abteilungen immer wichtiger, strategisch maßgeblich Inhalte und Prozesse zu standardisieren und zu automatisieren.

Kontakt



Ursula-Brita Krück

stv. Pressesprecherin

+49 69 / 91 32 - 21 92

LinkedIn

Nachricht schreiben