

Utilisez un biais statistique pour optimiser  
votre gestion du risque de change

OptionX

Essai gratuit disponible exclusivement  
sur Bloomberg Terminal

[APPS OPTIONX <GO>](#)



Cliquez pour planifier la démo



Trésorerie Générale

**Trésorerie Générale:** spécialiste de trésorerie, CFO, gestion des risques, direction générale



Secteur Bancaire

**Banques:** Bureaux des ventes et des taux, équipes de stratégie et de recherche



Fonds de Pension  
et de Couverture

**Fonds:** Gestionnaires de portefeuille, bureaux exposés (in)directement aux changes

### Gestion des Risques

- Obtenez une image Claire et concise du risqué de perte inhérent à votre couverture de change spécifique.
- Réduisez considérablement le temps passé à prendre des décisions de couverture dans diverses conditions de marché.
- Améliorez les procédures de surveillance et de contrôle des risques.
- Réduisez les coûts globaux en améliorant les prix des banques et des courtiers.

### Outil de Couverture Unique

- Employez un modèle mathématique unique qui ne repose pas exclusivement sur les chemins d'échantillonnage de la volatilité implicite dans les estimations de la volatilité.
- Bénéficiez de niveaux de couverture optimisés tirés de 5 décennies de données de volatilité et de taux d'intérêt.
- Déterminez des trajectoires de paiement positives avec des périodes de l'exposition sous-jacente au risque de change, illustré dans le tableau *Best Hedge*.

### Éléments clés

- ✓ Basé sur des règles
- ✓ Entièrement automatisé
- ✓ Plus de 500 paires de devises
- ✓ Réduction du temps préparatoire
- ✓ Réduisez les frais en améliorant les prix et la stratégie

### OptionX ApS

Jaegersborg Allé 1, 2920 Charlottenlund, Danemark

Téléphone Copenhague +45 25945050  
Londres +44 (020) 3608 8103  
New York +1 (646) 813-8103

Web: [optionx.ai](http://optionx.ai)  
Email: [bloomberg@optionx.ai](mailto:bloomberg@optionx.ai)

## Comment OptionX va-t-il me donner un avantage positif dans la couverture de mon exposition aux devises?

OptionX utilise un modèle de calcul exclusif, qui utilise les périodes de détention du risque de change sous-jacent pour mesurer la performance d'une stratégie de couverture spécifiée. Cela laisse au spécialiste en couverture une réponse claire à une question clé en matière de couverture: le biais statistique et les probabilités en faveur d'une performance rentable sur la période de détention spécifiée de la stratégie de couverture ou doivent-ils être suivis par une autre approche, telle que l'avenir.

## Quelle est la particularité d'OptionX?

Le calcul du système OptionX fournit quelque chose, ce qui n'existe pas actuellement sur le marché: la capacité de mesurer un résultat, par lequel le prix de la période de détention concernée ainsi que la probabilité et la taille du gain sont tous pris en compte dans formuler les structures de couverture les plus optimales et les plus bénéfiques. Ceci est fait dans un logiciel rapide et facile à utiliser qui donne accès à plus de 500 paires de devises.

## Utilisez les outils d'analyse non conventionnels d'OptionX pour redéfinir votre risque de marché

- OptionX fournit un aperçu alternatif de la volatilité implicite, ce qui, à notre avis, est imparfait dans la mesure où la plupart des fluctuations importantes des devises ont tendance à se dérouler de manière brutale et à céder la place à une évaluation erronée du risque ultime.
- OptionX donne un aperçu clair des compromis entre les stratégies d'options en temps réel et les contrats de change à terme.
- Les risques liés aux devises ont tendance à être plus dangereux lorsqu'ils sont difficiles à observer par la distribution en forme de cloche. OptionX utilise un modèle mathématique unique qui fournit une analyse de risque qui corrige directement cette lacune.
- Sur les marchés à faible volatilité et à taux négatifs, les participants au marché ont tendance à oublier la probabilité d'événements rares. OptionX propose une approche statistique plus complète du risque extrême.

## Quel est l'argumentaire éclair?

L'application OptionX est le seul système financier à fournir un accès à des stratégies de couverture multidevises en temps réel, entièrement automatisées et basées sur des règles. OptionX bénéficie de plusieurs décennies de données historiques comprenant plus de 500 paires de devises. OptionX génère en quelques secondes plusieurs stratégies de couverture alternatives, toutes personnalisées en fonction des paramètres de risque du client et présentées dans une solution de livraison neutre du point de vue banque / courtier.

Currency pair	DISTANCE	CLOSING BELOW STRIKE	TRADING BELOW STRIKE	IMPLIED PROBABILITY	OPTION PRICE (%)
<b>GBPUSD</b>					
Expiry					
<b>6 months</b> 06/04/20	-1 %	95.65 %	100.00 %	44.76 %	2.47
Risk type	-3 %	76.09 %	95.65 %	34.50 %	1.83
<b>Receivables</b>	-5 %	60.87 %	80.43 %	25.09 %	1.36
Notional	-7 %	41.30 %	60.87 %	17.10 %	1.00
1,000,000 GBP	-9 %	26.09 %	41.30 %	10.84 %	0.72
Max unfavourable move	-11 %	15.22 %	26.09 %	6.35 %	0.49
<b>6%</b> 1.1499	-13 %	13.04 %	15.22 %	3.41 %	0.32
Max cost of structure	-15 %	10.87 %	13.04 %	1.67 %	0.20
<b>3%</b>	-17 %	6.52 %	10.87 %	0.73 %	0.11
FX Forecast (Optional)	-19 %	6.52 %	6.52 %	0.29 %	0.06
<b>1.25</b>					
Calculate					
Total Cost					
<b>9%</b>					