

STRESSTESTS

BEISPIELPROJEKTE

LSI Stresstest

(Bankenverband)

- Fachkonzeptionelle Umsetzung der Anforderungen von BaFin und Bundesbank für einen Bankenverband
- Entwicklung eines IT-Toolsets für alle Risikoarten

EBA-Stresstest: PL & PMO

(Landesbank)

- Externe Gesamt-Projektleitung und PMO
- Risikoartenübergreifende Methodik und Ergebnisinterpretation
- Reporting und Ad-Hoc-Rechnungen
- Template Produktion mit dem 1 PLUS i Template Aggregator

Interne Stresstests

(Softwareanbieter)

- Fachliche Gesamtkonzeption ICAAP/ILAAP-Stresstest für eine Banksteuerungs-Software
- Entwicklung der erforderlichen Stresstest-Typen
- Erstellung Muster-Szenarien und Parameter



Ihr erfahrener
Partner

EBA-Stresstest: Kreditrisiko & NII

(div. Institute)

- NII: Konzeption und Entwicklung einer IT-Lösung für ein Retail-Institut auf Basis von Access/VBA
- Kreditrisiko: Methodische Umstellung auf IFRS9, IT-Lösung für ein Retail-Institut (Access/VBA)

Interne Stresstests

(Bausparkasse)

- Review der bestehenden internen Stresstests
- Gap-Analyse hinsichtlich EBA-GL
- Neukonzeption des internen Stresstestprogramms
- Entwicklung inverser Stresstests inkl. IT-Tools

Validierung Stresstest

(Supranationales Institut)

- Erstellung eines Validierungskonzepts und -berichts für den Kreditrisikostresstest
- Durchführung eines Model Reviews