

BAUSPARKASSE - IRRBB

Projektziele

- ≡ Interpretation und Korrektur einer in 2019 erstellten Gapanalyse zum IRRBB
- ≡ Weiterentwicklung des IRRBB-Rahmenwerks im Zusammenklang mit der Risikotragfähigkeit
- ≡ Insbesondere: Ablösung des strittigen Replikationsansatzes

Arbeitspakete:

Cashflow-Modellierung

- ≡ Vorschlag und Implementierung einer Methode zur Ableitung von Cashflows für die Berechnung des barwertigen IRRBB

Governance

- ≡ Weiterentwicklung der IRRBB-Strategie sowie der Dokumentation der ablauforganisatorischen Gestaltung im Zusammenhang mit dem IRRBB-Management

Stresstesting

- ≡ Einführung einer Verwundbarkeitsanalyse
- ≡ Untersuchung wesentlicher Zweitrundeneffekte in den Stressszenarien der normativen Sicht

CSRBB

- ≡ Ableitung Methodik für Umsetzung CSRBB

Wesentlichkeitsanalysen

- ≡ Untersuchung der Optionsarten und Überprüfung der Angemessenheit der Messmethoden