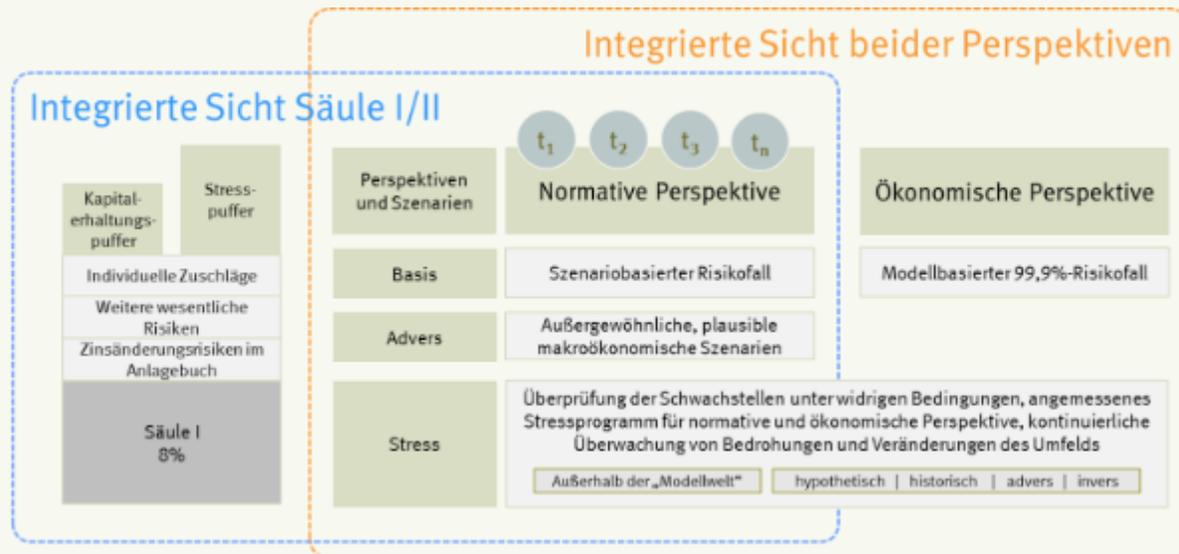


1 PLUS i – IHR ERFAHRENER PARTNER

BEI DER UMSETZUNG AUFSICHTS- UND INSTITUTSKONFORMER RTF-KONZEPTE

Was wir können:

- ≡ Aufbau und Konzeption der gesamten RTF (normativ und ökonomisch)
- ≡ Aufbau und Konzeption von substanzwertorientierten- oder barwertigen Modellen und GuV-Methoden
- ≡ Unterstützung und Entscheidungen bzgl. Modellparametern wie Haltedauer und Konfidenzniveau, mathematischen Modellen und expertenbasierten Schätzungen für wesentliche Risikoarten
- ≡ Einbindung der Risikotragfähigkeitsberechnung in den Steuerungs- und Strategiekreislauf sowie das Reportingsystem
- ≡ Ableitung und Aufbau eines Limitsystems auf der Ebene der Gesamtbankoptimierung und Aktualisierung von Limitsystemen
- ≡ Optimierung Berichtswesen im Zusammenhang mit dem ICAAP
- ≡ Analyse bereits bestehender individueller Umsetzungen des aufsichtsrechtlichen Rahmenwerks



- ≡ Implementierung einfacher Kreditrisikomodelle
- ≡ Implementierung Spread-VaR-Modelle
- ≡ Implementierung VaR-Modelle für Markt- und Fundingrisiko sowie für Restwerttrisiken