

PRIVATBANK (AUTOBANK) - UMSETZUNG DES NII IM RAHMEN DES IRRBB

Projektziele

- ≡ Sicherstellung der aufsichtsrechtlichen Konformität
- ≡ Fachliche und technische Umsetzung der Ermittlung des NII
- ≡ Erarbeitung und Umsetzung der Zins-Stressszenarien
- ≡ Testdurchführung und -dokumentation
- ≡ CSRBB
- ≡ Integration in die Steuerung inkl. Anpassung der Governance

Arbeitspakete:

Margenentwicklung	≡ Durchführung von Analysen der Historie zur Margenentwicklung mit Fokus auf Zinsänderungen
Datenqualität	≡ Unterstützung von Analysen und Verbesserungen der Datenqualität
Stresstesting	≡ Unterstützung Umsetzung / Dokumentation Zins-, Volumen- und Margenstress sowie „Earnings“
CSRBB	≡ Ableitung Methodik für Umsetzung CSRBB mit Blick auf NII
Governance	≡ Unterstützung bei der Ableitung und Implementierung der Governance (schriftlich fixierte Ordnung, Reporting, Integration in die Steuerung mit Ableitung eines Aufgreifkriteriums / Limits)