

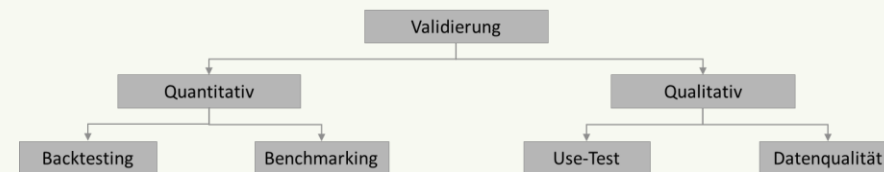
# BAUSPARKASSE - VALIDIERUNG SÄULE 2

## Projekthalte und -ziele:

- Gesamtkonzeption zur Validierung (Meta-Konzept) für alle Module:
  - **Modellrisiko: Inventar- und Scorekarte**
  - **Validierungskonzept**
  - **Validierungsbogen**
  - **Validierungsbericht**
- Alle wesentlichen Modelle und Modellparameter der Unternehmenssteuerung
- Modellierung barwertig und GuV-orientiert
- Durchführung Erstvalidierung
- Dokumentation bzw. Erstellung Validierungsberichte
- Quantitative und qualitative Einschätzung der Sachgerechtigkeit und des erforderlichen Anpassungsbedarfs

## Herausforderungen und Umsetzung des Projektes:

- Durchführung einer Gap-Analyse vorab
- Ausklammern von Säule 1
- Umgang mit neuer RTF-Welt?
- Separierung zwischen Planung und RTF/Kapitalplanungsprozess
- Inwiefern kann/ muss vereinheitlicht oder konsolidiert werden und inwiefern ist es sinnvoll zwar konsistent zu bleiben aber dennoch abzuweichen?



<b>Modul Adressrisiko:</b> Geldanlagen/Kunden
<b>Modul Marktpreisrisiko:</b> MPR barwertig/Zinsspannen
<b>Modul OpRisk</b>
<b>Modul Liquiditätsrisiko</b>
<b>Modul RTF/KPP</b>
<b>Modul Planung</b>
<b>Modul Kollektiv, NBI, Ablauffiktion</b>
<b>Modul Modellrisiko</b>
<b>Prozessuale Regelungen für die Validierung</b>