

≡ KREDITRISIKO UND GESAMTBANKSTEUERUNG

BEISPIELPROJEKTE

Adressrisikomessung

(Diverse Institute)

- Konzeption und Validierung Kreditportfoliomodell (diverse Institute)
- Parametrisierung Korrelationen Credit Metrics

Revisionsprüfung Adressrisiko

(Bausparkasse)

- Prüfung der Steuerungsstrategie und der Umsetzung der Maßnahmen
- Analyse der Modellparametrisierung
- Eingesetztes Kreditportfoliomodell KPM EG

Basket-Transaktionen

(Bankenverbund)

- Fachkonzeption, Erstellung und Wartung Pricing-Tool für verbundinterne Verbriefungs-Transaktionen
- Bewertetes Transaktionsvolumen: > 13 Mrd.€



Ihr erfahrener
Partner

Reporting

(Bankenverband)

- Entwicklung eines integrierte Risikoberichts zur Abdeckung der Berichtsanforderungen an die RTF und Strukturkennzahlen

Lifetime-EL in der neuen RTF

(Bausparkasse)

- Konzeption „neue RTF“ mit PWB aus Lifetime-EL gem. IFRS9
- Validierung Projektion PWB und Stufentransfer

Ratingkompetenz

(Diverse Institute)

- Entwicklung und Validierung von Ratingverfahren
- Prozessuale und organisatorische Ausgestaltung Validierungsfunktion