



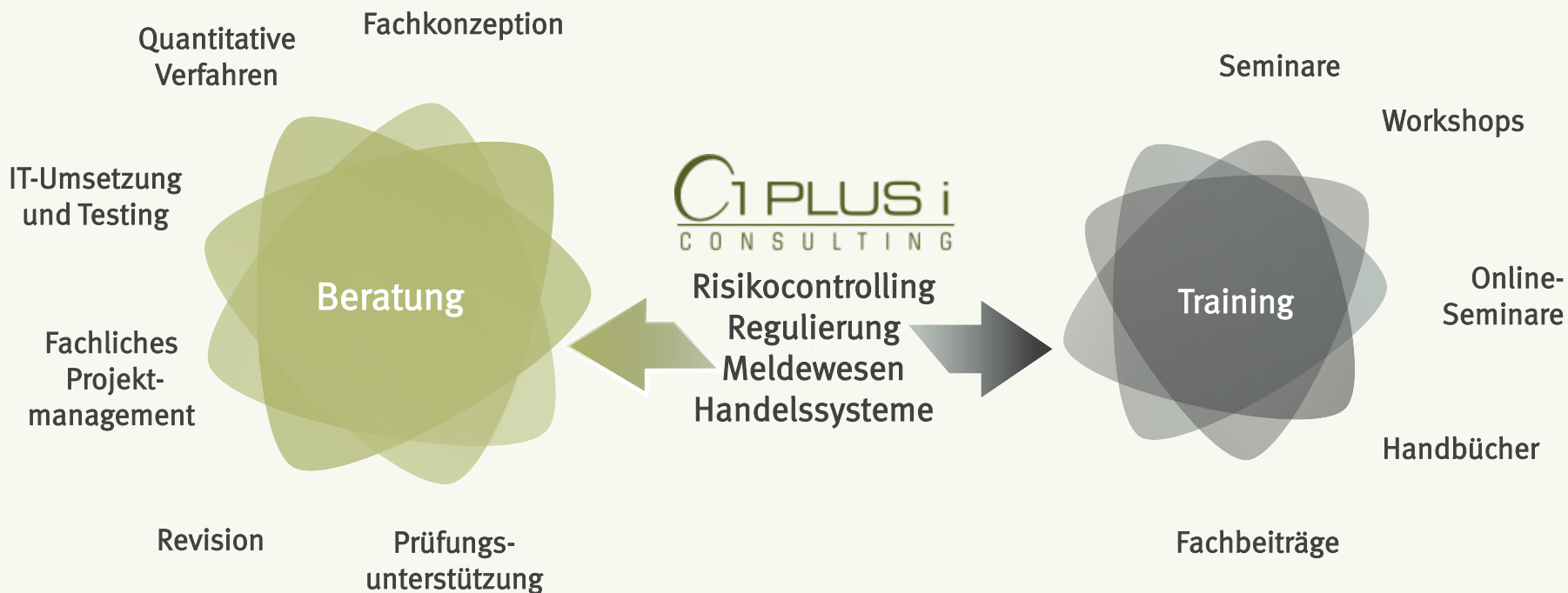
Dr. Walter Gruber
Dr. Christian Stepanek

☰ **WILLKOMMEN**

Kundensymposium 19. März 2026



≡ 1 PLUS I – BERATUNG UND TRAINING AUS EINER HAND



Mehr als 40 Mitarbeiter



Kunden: Mehr als 350 Banken,
Finanzdienstleister und
banknahe Rechenzentren



Seit 2003 am Markt

UNSERE BERATUNGSFELDER IM ÜBERBLICK

Regulierung & Meldewesen



CRR

COREP (KSA, IRBA, etc.)

EMIR | SFTR | MMSR

MiFID II | MiFIR

DORA

BRRD | SRM-VO | SAG

Sonstiges Meldewesen

SFDR | CSRD | ESG-Offenlegung

Risikomanagement



SREP & MaRisk

ICAAP & RTF

Risikomodelle

ESG-Risiko

Ratingverfahren

IRRBB & Marktrisiko

Stresstesting

Validierung und Modellrisiko

ILAAP

Systeme



Meldewesensoftware

Handelssysteme

Gesamtbanksteuerung

IDV-Anwendungen

Schnittstellen

Übergreifende Themen



Interne
Revision



Test-
management



Fachliches
Projektmanagement



Reporting



Künstliche
Intelligenz

≡ KUNDENSYMPOSIUM 2026

UNSERE THEMATISCHEN SCHWERPUNKTE



Meldewesen nach CRR III: Zukunft & Optimierungsmöglichkeiten



Künstliche Intelligenz als Transformationsmotor in Banken



DORA & digitale Resilienz



ESG in Regulatorik & Steuerung



Regulatorische Trends

≡ AGENDA

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

≡ SCHWERPUNKT MELDEWESEN

Meldewesen

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

≡ SCHWERPUNKT KÜNSTLICHE INTELLIGENZ

KI

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotoool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

≡ SCHWERPUNKT DORA

DORA

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

≡ SCHWERPUNKT ESG

ESG

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

≡ SCHWERPUNKT REGULATORISCHE TRENDS

Reg. Trends

Uhrzeit	RAUM: KOONS	RAUM: CHRISTO 1	RAUM: CHRISTO 2
11:00	RWA-Optimierung (Immotool) Dr. Jochen Klement, Benedict Luse	DORA: Eine Management-Perspektive Friederike Krüsemann, Lukas Görnert	Offenlegungspflichten zu ESG-Risiken Araz Hussein, Dr. Christian Stepanek
12:00	Mittagsbuffet		
13:15	KI Governance & Risk Management Dr. R. Reinwald, Dr. Chr. Stepanek	European Single Access Point (ESAP) Hendryk Braun, Lukas Dehler	ESG-Risikoplan Henning Heuter, David Kamm
14:00	Kleinbankenregime Anita Schacht, Henning Heuter	Zukunft des aufsichtl. Meldewesens Dr. R. Reinwald, Henning Schneider	DORA IKT-Drittparteienmanagement Friederike Krüsemann, Lukas Görnert
14:45	Kaffeepause		
15:15	Einsatz von KI in der Revision Stephan Bellarz (DZ Bank AG)	RWA-Optimierung durch Wahlrechte Linda Schöche, Thorsten Gendrisch	Prozessoptimierung im Meldewesen Matthias Schupp, Dr. Christian Stepanek
16:00	Veränderung der Finanzwelt durch KI Dr. Silvio Andrae (DSGV)		
16:45	Verabschiedung & Get-Together		

NEUES REPORTING FRAMEWORK?! WAS IST FÜR MEIN INSTITUT RELEVANT?

Immer wieder veröffentlicht die Aufsicht neue Anforderungen an das Meldewesen. Deren Umsetzung kann oft mit Herausforderungen verbunden sein:

- Welche Anforderungen gelten für mein Institut konkret?
- Wie sind die einzelnen Datenpunkte zu interpretieren?
- Wie muss mein Datenhaushalt angepasst werden?

Die Konsequenz? Unsicherheiten, die im schlimmsten Fall zu einem Malus für Ihr Institut führen können. Profitieren Sie von unseren Erfahrungen im Umgang mit Meldewesen-Updates:

- **Interpretation:** Was möchte die Aufsicht mit den Neuerungen erreichen?
- **Roadmap:** Welche konkreten Schritte können wir unternehmen, um den Anforderungen zu entsprechen?
- **Automatisierung:** Wie können IT-Systeme gezielt modernisiert werden, um in Zukunft möglichst wenig Aufwand zu haben?
- **Schulung/Monitoring:** Wie etablieren wir Prozesse, um zukünftige Updates proaktiv und revisionssicher zu integrieren?

Von Erstanalyse bis Implementierung: Wir begleiten Sie mit praxiserprobten Tools und unserem Expertenwissen.

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**



Erstinformation

Kennenlernen der Rahmenbedingungen Ihres Instituts u. Abstimmung von Inhalten bestehender Prozesse

Sondierung

Übersicht über Möglichkeiten der Neuerungen des aufsichtsrechtlichen Meldewesens

Angebot für mögliche Unterstützung

Analyse der Anforderungen, Definition der relevanten Meldeinhalte, Umsetzung

C1 PLUS i
CONSULTING

Dr. Raphael Reinwald
raphael.reinwald@1plusi.de

Henning Schneider
henning.schneider@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 58 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 58 79 95 55 www.1plusi.de

ANGEKÜNDIGTE DORA-PRÜFUNG? KEINE PANIK!

DORA ist nach wie vor in aller Munde und mittlerweile stehen die ersten Prüfungen an. Bedingt durch wenig Prüfungspraxis ergeben sich viele Fragen:

- Ist unser Institut DORA-compliant?
- Was können wir vorbereitend auf eine DORA-Prüfung tun?
- Wie sehen DORA-Prüfungen überhaupt aus?

Die Konsequenz? Unsicherheiten, die bei Prüfungen zum Fallstrick werden können.

Profitieren Sie von unseren Prüfungserfahrungen zu DORA:

- Was ist wirklich relevant bei aufsichtlichen DORA-Prüfungen?
- Wie können wir unser Institut durch interne Prüfungen auf externe Prüfungen vorbereiten?
- Wie sieht ein adäquater Prüfungsleitfaden für unser Institut aus?
- Wie können wir als interne Revision die Fachbereiche ideal unterstützen, um DORA bestmöglich zu reviewen und zu integrieren?

Vorprüfung, interne Vorbereitung, Interview-Training? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die DORA-Prüfungen!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstinformation

Kennenlernen der Rahmenbedingungen Ihres Instituts u. Abstimmung von Inhalten des Workshops

Workshop

Übersicht über Möglichkeiten der Unterstützung, Darstellung der Prüferfahrung (Institut), Skizzierung Arbeitsprogramm

Angebot für mögliche Unterstützung

Vorbereitung der Prüfung, Unterstützung während der Prüfung und bei der Bearbeitung der Feststellungen

C1 PLUS i
CONSULTING



Henning Heuter
M 0163 – 41 75 872
henning.heuter@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

EMIR REFIT: DATENQUALITÄT BLEIBT IM FOKUS

Mit dem Go-Live von EMIR Refit im April 2024 wurden die Anforderungen an das Derivate-Transaktionsmeldewesen grundlegend erweitert.

Viele Institute kämpfen weiterhin mit Datenqualitätsproblemen sowie zu niedrigen Pairing- und Matchingquoten. Gleichzeitig gewinnt das Thema erneut an Bedeutung:

Ab dem 29. April 2026 werden zusätzliche Felder im Reconciliation-Prozess geprüft, wodurch die Anforderungen an konsistente Meldedaten weiter steigen.

- Wie entwickeln sich die Pairing- und Matchingquoten unter EMIR Refit?
- Wo entstehen Datenqualitätsprobleme im Reportingprozess?

- Welche Prozesse und Systeme müssen weiter optimiert werden?

Die Konsequenz? Datenqualität wird zum zentralen Erfolgsfaktor im EMIR-Reporting.

Profitieren Sie von unserer langjährigen Erfahrung im Transaktionsmeldewesen:

- Welche Datenquellen beeinflussen die Qualität der EMIR-Meldungen?
- Wie identifizieren Sie Ursachen für Pairing- und Matchingbreaks?
- Wie können Datenqualität und Konsistenz nachhaltig verbessert werden?
- Wie bereiten Sie Ihr Institut auf die erweiterten Reconciliation-Anforderungen vor?
- Wo und Wann ist eine Selbstanzeige notwendig?

Datenanalyse, Reportingprozesse, Datenqualität, technische Umsetzung? Wir haben viele Ideen und Ansätze für eine effiziente Optimierung Ihres EMIR-Reportings!

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Erstinformation

Einordnung der aktuellen Herausforderungen im EMIR-Reporting und erste Bewertung der Datenqualität Ihres Instituts

Analyse und Workshop

Gemeinsame Analyse von Datenquellen, Reportingprozessen und Matchingquoten sowie Identifikation zentraler Optimierungspotenziale

Umsetzung und Optimierung

Ableitung konkreter Maßnahmen zur nachhaltigen Verbesserung der Datenqualität

C1 PLUS i
CONSULTING



■ **Lukas Dehler**
M 0163 - 8462027
lukas.dehler@1plusi.de

Postfach 130211 70911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

ESAP KOMMT AB 2026 – IST IHR INSTITUT VORBEREITET?

ESAP ist auf dem Weg – und viele Institute stehen erst am Anfang der Umsetzung.

Mit dem European Single Access Point (ESAP) entsteht eine zentrale EU-Plattform für Unternehmens- und Finanzinformationen. Für Banken bedeutet dies: Zahlreiche bestehende Offenlegungen werden künftig zentral zugänglich und müssen strukturiert, konsistent und technisch anschlussfähig bereitgestellt werden. Gleichzeitig sind viele Fragen noch offen:

- Welche Offenlegungen werden künftig über ESAP verfügbar sein?
- Wie müssen Daten strukturiert und technisch bereitgestellt werden?

- Welche Auswirkungen hat ESAP auf die bestehende Reporting- und Daten-Architektur?

Die Konsequenz? Neue Anforderungen an Datenqualität, IT-Architektur und Governance.

Profitieren Sie von unserer Erfahrung in regulatorischen Daten- und Reporting-Projekten:

- Welche Datenquellen und Prozesse sind ESAP-relevant?
- Welche Datensammelstellen können genutzt werden?
- Wie gestalten wir eine nachhaltige Daten- und Governance-Struktur?
- Wie bereiten wir unser Institut frühzeitig auf die Umsetzung vor?

Impact-Analyse, Reporting-Prozesse, Datenarchitektur, technische Anbindung? Wir haben viele Ideen und Ansätze für eine effiziente ESAP-Umsetzung!

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Konsolidierter ESAP-Umsetzungsplan



Workshop

Übersicht über gemeinsame Analyse ESAP-relevanter Daten, Darstellung der Prozesse, Systeme und Zielbilder, Skizzierung eines Umsetzungsvorgehens

Phase 1

Unterstützung Erst-Go-Live am 10. Juli 2026:
- Prospekt-Verordnung
- Leerverkaufs-Verord.
- Transparenz-Richtlinie Inkl. organ. Verortung

Folgephasen

Umsetzungsbegleitung der Anforderungen für die kommenden Phasen 2028 und 2030 mit 1 PLUS i

C1 PLUS i
CONSULTING



Lukas Dehler
M 0163 - 8462027
lukas.dehler@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

OFFENLEGUNG VON ESG-RISIKEN GEMÄß CRR III

Wer ist betroffen und ab wann?

Alle Institute und das gem. EBA/CP/2025/07
bereits ab 31.12.2026!

Was wird gefordert?

Qualitative Angaben zu ESG-Risiken sowie
quantitative Offenlegungs-Templates, z. B.:

- THG-Emissionen im Kreditportfolio
- Energieeffizienz Immobiliensicherheiten
- Kredite mit physischem Klimarisiko

Operative Implikationen

Daten beschaffen, fachlich bewerten,
methodisch & technisch umsetzen und in
Prozesse integrieren.

*Enge Verzahnung von Meldewesen, Finanzen
und Risikomanagement!*

Beratungsangebot

Unterstützung bei technischer/ fachlicher
Umsetzung, Datenhaltung, Methodik sowie
Befüllung der Offenlegungsbögen – effizient
und reversionssicher.

- Regulatorische Analyse: Anforderungen
strukturieren, Offenlegungspflichten
ableiten, Lücken identifizieren.
- Methodik & Konzeption: Fachliche/
technische Konzepte entwickeln,
Bewertungsmethoden für ESG-Risiken
festlegen und Datenquellen identifizieren.
- Technische Umsetzung: Ob in einer
bestehenden Meldewesensoftware oder
einer Toollösung – Implementierung,
Testing und Dokumentation sind
unumgänglich.

Ob SNCI oder börsen-
notiertes Institut – wir
machen Sie fit für die
**Offenlegung von ESG-
Risiken**

**MELDEN SIE SICH
GERNE BEI UNS.**

Erstinformation

Wir stellen Ihnen die
aufsichtlichen
Anforderungen an Ihr
Institut vor

Workshop

Analyse technischer
Umsetzungsmöglich-
keiten, Identifikation
von Herausfor-
derungen und Schnitt-
stellen im Institut

Angebot für mögliche Unterstützung

Fachkonzeption,
technische
Umsetzung und
Integration in die
Gesamtbank

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Christian Stepanek
M 0163 – 41 76 644
christian.stepanek@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

ERSTELLEN SIE MIT UNS IHREN ESG-RISIKOPLAN

Durch die neuen Paragraphen 26c und 26d KWG werden das ESG-Risikomanagement und der ESG-Risikoplan zur Vorgabe. Je nach Institutsgröße ist mehr oder weniger Zeit für die Umsetzung, um darzustellen, wie sich Ihr Institut möglichen Entwicklungspfaden auf dem Weg zu einer klimaneutralen EU stellt, welchen Risiken Ihr Institut ausgesetzt ist und wie Sie damit umgehen. Profitieren Sie von unseren umfangreichen Erfahrungen und entscheiden Sie sich für die *richtige Dosis ESG*.

Je nach Umsetzungsstand sehen wir verschiedene Ansätze:

- Sind Nachhaltigkeitsrisiken bei Ihnen bislang nicht ausreichend in Inventur, Risikomessung und Szenarien, Reporting und Strategie umgesetzt? Dann sind wir Ihr Partner für die vollständige Umsetzung des ESG-Risikomanagements und des ESG-Risikoplane.
- Fehlt Ihnen der ESG-Risikoplan, die Nachhaltigkeitsrisiken sind aber bereits fest in das Risikomanagement integriert? Dann lassen Sie uns gemeinsam eine Struktur für das Dokument erarbeiten und die Inhalte in einen Plan zusammenführen.
- Haben Sie ESG schon in Ihr Risikomanagement integriert und den Risikoplan erstellt? Dann wäre unsere GAP-Analyse passend für Sie!

GAP-Analyse, Strukturierung des Plans oder vollständige Umsetzung? Wir haben viele Ideen und Ansätze für ESG-Risikomanagement und ESG-Risikoplan!

**MELDEN SIE SICH EINFACH
BEI UNS.**

Erstinformation

Kennenlernen der Rahmenbedingungen Ihres Instituts und Abstimmung von Inhalten des Workshops

Workshop

Übersicht über Möglichkeiten der Unterstützung, Darstellung unserer Umsetzungserfahrung, Skizzierung eines Arbeitsprogramms

Angebot für mögliche Unterstützung

Gap-Analyse, Erarbeitung einer Struktur für den Plan oder die vollständige Umsetzung

C1 PLUS i
CONSULTING



Henning Heuter
M 0163 – 41 75 872
henning.heuter@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

DAS FENSTER SCHLIEßT SICH: T+1 SETTLEMENT

Die Implementierung des verkürzten Settlement-Zyklus von t+2 auf t+1 beginnt:

- Go-Live am 11. Oktober 2027
- Konkrete operative Implementierungsmaßnahmen stehen bei einem Großteil der Institute noch aus.
- Bei Verzögerungen drohen Settlement-Fails und Strafzahlungen gemäß CSDR-REFIT.

Seit dem 3. Februar 2026 sind *Industry Handbook* und *Readiness Survey* veröffentlicht, womit der Startschuss für die Implementierungsphase gefallen ist.

Die ESMA-RTS erfordern, dass Ende 2026 alle wesentlichen operativen Prozesse im Einsatz sind, um ab Anfang 2027 die Testphase zu beginnen.

Diese kritischen Bereiche sollten Sie im Fokus haben:

- Wertpapiergeschäfte über Währungs-grenzen hinweg bedeuten ein verkürztes Zeitfenster, um FX-Transaktionen erfolgreich bis 00:00 Uhr vollständig durchzuführen.
- Durch t+1 fehlt nach Handelsabschluss ein ganzer Werktag, um Corporate-Action-Verarbeitungsfehler zu identifizieren und zu korrigieren.
- Investmentfonds arbeiten häufig mit T+3/4 für Subscriptions und Redemptions. Das kann unter t+1 zu Liquiditätsproblemen führen.
- Weitere kritische Aspekte und Informationen finden Sie in unserem neuen Fachbeitrag.

Weitere Informationen und Unterstützung zum Handlungsbedarf? Wir haben Ideen und Ansätze!

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Erstinformation

Austausch zu den Anforderungen unter einem Settlement in t+1 und dem aktuellen Stand in Ihrem Institut

Workshop

Übersicht über erforderliche Anpassungen im Institut, gemeinsame Entwicklung eines Arbeitsprogramms

Angebot für mögliche Umsetzungen

Konkretes Arbeitsprogramm und Umsetzung mit 1 PLUS i

C1 PLUS i
CONSULTING



David Kamm
M 0177 – 2980746
david.kamm@1plusi.de

Postfach 130211 70911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg P0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

HANDELSREGULIERUNG IM FOKUS – IST IHR INSTITUT OPTIMAL AUFGESTELLT?

Die Anforderungen im Handels- und Transaktionsmeldewesen bleiben hoch und entwickeln sich kontinuierlich weiter. Vorgaben aus EMIR, MiFIR, SFTR, MMSR oder FINFRAG betreffen zahlreiche Handelsaktivitäten und Reportingprozesse. Auch neue Themen zu RIS, SIU oder den angedachten Vereinfachungen zur Marktinfrastruktur führen zu Umsetzungserfordernissen. Gleichzeitig steigen die Anforderungen an Datenqualität, Transparenz und technische Schnittstellen. Viele Institute stehen daher vor zentralen Fragen:

- Sind die Handels- und Transaktionsmeldungen vollständig und regulatorisch compliant?

- Wie stellen Sie eine stabile und effiziente Reportingarchitektur sicher?
- Welche Rolle spielen Datenqualität, Delegationsmodelle und zukünftige regulatorische Vorgaben?

Die Konsequenz sind fortlaufende Herausforderungen an Prozesse, Systeme und Governance im Handelsmeldewesen.

Profitieren Sie von unserer langjährigen Erfahrung:

- Wie können Datenqualität und Konsistenz im Transaktionsmeldewesen nachhaltig verbessert werden?
- Wie gestalten Sie eine robuste Reporting- und Governance-Struktur in der Handelsregulatorik?

Impact-Analyse, Reporting-Prozesse, Datenarchitektur, technische Anbindung? Wir haben viele Ideen und Ansätze für eine effiziente Umsetzung der Handelsregulierung

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Analyse und Einordnung

Analyse der regulatorischen Anforderungen sowie der bestehenden Prozesse, Systeme und Reportingstrukturen Ihres Instituts

Zielbild und Umsetzungskonzept

Entwicklung eines Zielbilds für Transaktionsmeldungen, Datenarchitektur und Reportingprozesse – von der Softwareauswahl bis zur Umsetzung

Implementierung und Betrieb

Begleitung bei Implementierung, Testing und Go-Live sowie Unterstützung im laufenden Betrieb und bei der Optimierung der Datenqualität

C1 PLUS i
CONSULTING



☰ **Lukas Dehler**
M 0163 - 0462027
lukas.dehler@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 - 56 79 94 →
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

HANDELS- SYSTEME

Neue Marktbedingungen, regulatorische Vorgaben und technologische Entwicklungen – all dies führt zu vielfältigen Herausforderungen, die sowohl strategisch als auch operativ an moderne Handelssysteme adressiert werden müssen:

- Anpassung bestehender Handelssysteminfrastruktur oder Neueinführung
- Kosteneinsparung durch Standardlösungen unter Berücksichtigung der sich ändernden Marktbedingungen
- Sicherstellung von Compliance und Auditierbarkeit
- Umsetzbarkeit bestehender und künftiger regulatorischer Reporting-Anforderungen

Um diesen Herausforderungen erfolgreich zu begegnen, bieten wir Ihnen umfassende und individuell zugeschnittene Beratungsleistungen. Unser Ansatz verbindet technisches Know-how mit tiefem Verständnis für regulatorische und prozessuale Anforderungen:

- Gemeinsame Entwicklung einer zukunfts-sicheren Handels-IT-Infrastruktur
- Analyse und Optimierung von Handelsprozessen/-reportings zur Effizienzsteigerung
- Unterstützung im Softwareauswahlprozess
- Entwicklung und Umsetzung von Migrationsstrategien, -runbooks und -mappings
- Besetzung von Projekt- und Testmanagementrollen nach Best Practices
- Begleitung von NPPs inkl. Abbildung und Verarbeitung im System

Sind Veränderungen an Ihrem Handelssystem bevorstehend? Egal ob Konsolidierung, Release, Neueinführung oder schlicht eine Schnittstellenanpassung?

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstgespräch

Austausch zu den Rahmenbedingungen in Ihrer Handelssysteminfrastruktur und Erarbeitung erster Handlungsvorschläge

Projektplanung

Skizzierung eines Umsetzungsplans, Definition Projektvorgehensmethoden, Aufwandsschätzung

Umsetzungs- begleitung

1 PLUS i als Schnittstelle zwischen den Fach- und IT-Bereichen in diversen Funktionen

C1 PLUS i
CONSULTING



Lukas Zetzel
M 0163 - 31 75 736
lukas.zetzel@1plusi.de

Postfach 130211 70911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg 0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

ÜBERPRÜFEN SIE MIT UNS IHRE ICAAP-METHODIK

Das Vorhandensein eines adäquaten Risikocontrollingrahmens zur ökonomischen und normativen Steuerung ist zentral für die Überlebensfähigkeit eines Institutes. Es stellen sich viele Fragen wie beispielsweise:

- Sind die verschiedenen Risikomethoden „state of the art“?
- Erfüllt unsere Risikotragfähigkeitskonzeption „übliche Standards“?
- Was sind mögliche „offene Flanken“ für die Bankenaufsicht?

Die Konsequenz? Unsicherheiten, die bei Prüfungen zu gravierenden Feststellungen führen können. Profitieren Sie von unseren umfangreichen Umsetzungs- und Prüfungserfahrungen bei den Risikomethoden:

- Wie sieht ein adäquates Risikoreporting- und Limitsystem aus?
- Wie können wir die verschiedenen ökonomischen und normativen Risikomethoden unter der Beachtung des Proportionalitätsprinzips implementieren?

Wir richten uns dabei an den Fachbereich und zusätzlich auch an die Interne Revision:

- Wie sieht ein adäquater ICAAP-Prüfungsleitfaden für unser Institut aus?
- Wie können wir als Interne Revision die Fachbereiche ideal unterstützen, um den ICAAP-Rahmen zu reviewen und zu integrieren?

Implementierungen, Optimierung der Umsetzung, Prüfung der ICAAP-Methoden? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die ICAAP-Methodik!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstinformation

Kennenlernen der Rahmenbedingungen Ihres Instituts u. Abstimmung von Inhalten des Workshops

Workshop

Übersicht über Möglichkeiten der Unterstützung des Fachbereichs und der Revision, Darstellung der bisherigen Umsetzungserfahrung, Skizzierung eines Arbeitsprogramms

Angebot für mögliche Unterstützung

Überprüfung der aktuellen ICAAP-Methodik, Eruiierung von Optimierungsmöglichkeiten, Implementierung von Risikotools

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Walter Gruber
M 0163 - 31 75 079
walter.gruber@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55

www.1plusi.de

IMMOTOOL – UNERWARTETE VERLUSTE BERECHEN- UND STEUERBAR MACHEN

Kreditrisiken sind mit Abstand die wesentlichste Risikokategorie im Bankgeschäft, die Besicherung mit Grundpfandrechten davon am weitesten verbreitet.

Mit der CRR III sind zwei Ansätze zur Unterlegung in der Säule I aufgenommen worden: der Loan-Splitting und der Whole-Loan Ansatz:

- der Loan-Splitting Ansatz liefert durchschnittliche, kontinuierliche Risikogewichte in Abhängigkeit des Immobilienwertes

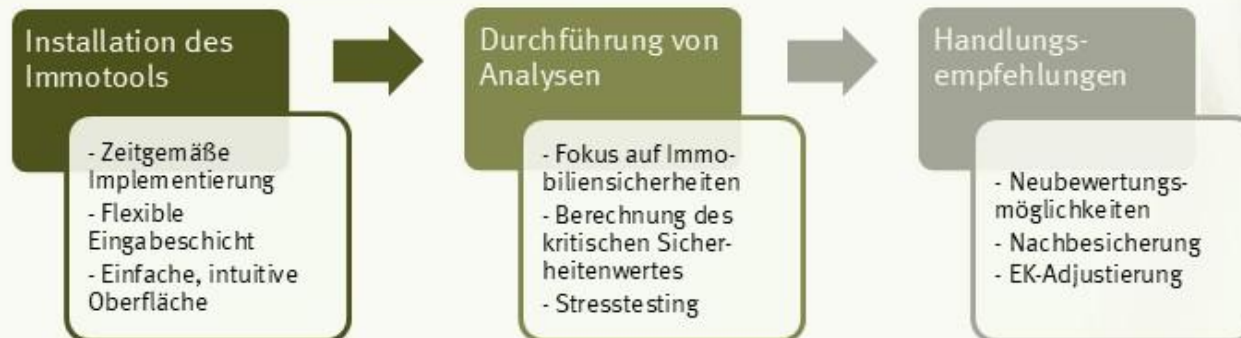
- der Whole-Loan Ansatz liefert in Abhängigkeit vom ETV stufenweise konstante RWAs.
- durch einen Rückgang der Immobilienpreise kann es zu signifikanten Steigerungen der RWAs kommen.

Gerne zeigen wir Ihnen mit Hilfe unseres Immotools:

- die Höhe des bestehenden Sicherungspuffers bzw. kritischen Sicherheitenwertes
- Möglichkeiten der Beeinflussung der RWAs, z.B. durch mögliche Neubewertungen der Immobiliensicherheiten
- Neugeschäfts-Potenzial
- die Integration des Besicherungs-VaR in das Reporting

Analyse, Workshops, Hilfstools, Optimierungsmodule? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die Optimierung im Meldewesen!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**



C1 PLUS i
CONSULTING

Dr. Jochen Klement
M 0163 - 41 75 074
jochen.klement@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

ZIEL: VERBESSERUNG VON KAPITALQUOTEN UND RISIKOSTEUERUNG.

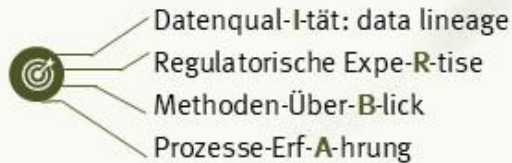
LÖSUNG: IRBA

Die Entscheidung für den IRBA betrifft nicht nur die Modellierung von Ausfallwahrscheinlichkeiten, sondern beinhaltet auch diverse prozessuale, methodische und technische Themen:

- Die IRBA-Einführung erfolgt immer im Institut – auch bei Poollösungen.
- Die Credit Risk Control Unit (CRCU) verantwortet die Ratingverfahren im Institut – Aufbau der Einheit mit IRBA-geschultem Personal.
- Die IRBA-Modelle sind im Institut zu validieren – auch bei Poollösungen.

- Das Meldewesen wird durch die IRBA-Einführung deutlich komplexer – aufgrund von Neuerungen und auslaufenden Wahlmöglichkeiten gilt dies auch für Bestandshäuser.
- IRBA-Ratingsysteme sind durch die interne Revision jährlich zu prüfen.
- Bei der Einführung des IRBA ist ein Überblick über die Themen und Schnittstellen in der Gesamtbank erforderlich.

Der IRBA erfordert in seiner Erstumsetzung sowie in der dauerhaften Anwendung ...



Gap-Analyse, Workshops, SAQ-Befüllung, fachliches PMO bei der IRBA-Einführung? Wir sind Ihr Partner für den IRBA!

MELDEN SIE SICH GERNE BEI UNS.

DAS BERATUNGSANGEBOT VON 1 PLUS i

Methoden	Meldewesen	Zulassungsprozess
Validierung	Revision	CRCU Credit Risk Control Unit
Prozessuale Themen	Fachliche Gesamtkoordination	IRBA-Seminar

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Christian Stepanek
M 0163 – 41 76 644
christian.stepanek@1plusi.de

Postfach 130211 90114 Nürnberg T0911 – 56 79 94 99 F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

KI-RISIKEN VERSTEHEN, STEUERN UND REGULATORISCH EINBETTEN

KI bietet Banken große Effizienzpotenziale – verlangt aber zugleich klare Regeln für Governance, Transparenz und Risikosteuerung.

- Wie integriert man KI-Modelle in bestehende Governance-Strukturen?
- Wie werden KI-Risiken im OpRisk - Framework und unter DORA erfasst?
- Welche Dokumentation und Validierung fordern MaRisk AT 4.3.5, ECB Internal Model Guide und der EU AI Act?
- Und wie bleibt auch komplexe KI erklärbar?

Unsere Lösung:

Wir unterstützen Banken dabei, KI-Anwendungen strukturiert, nachvollziehbar und regulatorisch konform in Risiko- und Governanceprozesse einzubetten – von der Use-Case-Klassifikation bis zur Validierung und laufenden Modellüberwachung. Genauso unterstützen wir die Revision die bankinternen KI-Anwendungen aufsichtskonform zu prüfen.

Unser Beratungsangebot:

- Erstellung Model Governance für KI-Anwendungen
- Einbindung ins Modellrisikomanagement
- Integration in das Operational Risk Framework
- Validierung von KI-Modellen

KI-Governance, Risk Management und Validierung? Wir haben viele Ideen und Ansätze!

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Erstinformation

Abstimmung der Rahmenbedingungen und Ziele

Workshop

Analyse vorhandener KI Use Cases und Einordnung in Governance, Risiko- und Validierungsprozesse

Angebot für mögliche Unterstützung

Konkretes Arbeitsprogramm und Umsetzung mit 1 PLUS i

1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Christian Stepanek
M 0163 – 41 76 644
christian.stepanek@1plusi.de

Postfach 130211 90114 Nürnberg T0911 – 56 79 94 99 F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

PROZESSOPTIMIERUNG MELDEWESEN

MANUELLE ANPASSUNGEN SIND UNVERZICHTBAR – ODER TEILWEISE DOCH?

Es gibt viele Gründe für manuelle Veränderungen an Ergebnissen der Meldewesensoftware:

- Übrig gebliebene Restaufgaben aus einem Projekt
- Für die Änderungen lohnt sich eine Softwareanpassung nicht oder diese ist depriorisiert
- Kurzfristige Anpassungen sind notwendig, insb. am Ende des Gesamtprozesses

*Die Konsequenz? Die Eingriffe werden zum neuen Standardprozess! Ist das notwendig?
Nein!*

Meist erfolgen manuelle Anpassungen ohne Not, denn mit kleinen Tools oder auch einfachen Routineabfragen auf Datenbanken kann der manuelle Aufwand reduziert oder sogar vollständig vermieden werden.

Beispiele für Effizienzpotenziale:

- Korrektur von Positionen bspw. wegen falschen Risikogewichten
- Wie bekomme ich alle Informationen in der Struktur für die Eingabe?
- Aufschlüsselung von Wertberichtigungen auf Einzelpositionen und Zusammenfassung für die Meldungen, u.v.m.

Herausforderung meistens mit 1 PLUS i:

Häufig fehlt die Übersicht über die Verbesserungspotenziale und die Kapazität für technische Umsetzungen. Wir unterstützen sie dabei – fachlich, methodisch und technisch.

Erstanalyse, Workshops, Hilfstools, Optimierungs-module? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die Meldewesen-Optimierung!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstinformation

Austausch zu den Rahmenbedingungen und Abstimmung der Workshopinhalte

Workshop

Erfassung und Priorisierung der manuellen Aufwandstreiber in den Meldungen Ableitung von Handlungsmaßnahmen

Angebot für mögliche Optimierungsmodule

Konkretes Arbeitsprogramm und Umsetzung von Vereinfachungen mit 1 PLUS i

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Christian Stepanek
M 0163 – 41 76 644
christian.stepanek@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

OFFENLEGUNG – ZIELGERADE MIT HINDERNISSEN

Viele Banken arbeiten schon lange an den Umsetzungen, die sich durch die CRR III ergeben haben. Es geht auf die Zielgerade mit dem Pillar 3 Data Hub dieses Jahr. 2027 wird die Umsetzung der letzten 3 Themen gefordert:

- Offenlegungen bei den ESG Risiken, wie die klimabezogenen Kreditexposures, die NACE-basierte Sektoranalyse oder die Transitional- und Physikal-Risk-Kennzahlen
- Die Meldeanforderungen des Marktrisikos, darunter die detaillierte Darstellung von Beteiligungspositionen, Handelsbuchpositionen und Eigenmittelanforderungen nach allen drei Ansätzen

- Die aggregierte Darstellung von Exposure ggü. Schattenbanken

Gerne helfen wir Ihnen mit unserer in den letzten Jahren gesammelten Expertise in den verschiedensten Projekten rund um die Umsetzungen der CRR III. Profitieren Sie von unseren Projekterfahrungen (zu CRR III):

- Analyse von offenen Gaps und Restaufgaben zur CRR III mit anschließender Umsetzung
- Kurzfristige Analysen und Anpassungen für den Pillar 3 Data Hub
- Analyse und Implementierung der offenen Anforderungen für 2027 (ESG, Equity)
- Konsistenz zu den sonstigen Meldungen
- Workshops zur weiteren Vertiefung/ Sensibilisierung der CRR III

Analyse, Workshops, Hilfstoools, Optimierungsmodule? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die Optimierung im Meldewesen!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**



C1 PLUS i
CONSULTING

Dr. Jochen Klement
M 0163 - 41 75 074
jochen.klement@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

REGULATORIK OHNE ROULETTE – MIT KI

Verwandeln Sie regulatorische Unsicherheit in Ihren strategischen Wettbewerbsvorteil. Präzise. Sicher. Souverän.

Das PROBLEM: Regulatorische Komplexität lähmt Ihr Geschäft.

-  **Informationsflut:** Ständig neue Gesetze, Verordnungen, Anforderungen und Richtlinien - national wie international.
-  **Fehlende Passgenauigkeit:** Allgemeine Informationen helfen nicht bei spezifischen Herausforderungen Ihres Unternehmens.
-  **Hoher Aufwand:** Manuelle Recherche ist ineffizient, zeitraubend und fehleranfällig.
-  **KI-Halluzinationen:** Standard-KI-Lösungen liefern oft unzuverlässige Ergebnisse.

Die LÖSUNG: Der REGULATION NAVIGATOR

Wissensbasiertes Regulatorik-LLM: Präzise Antworten auf spezifische Fragen durch passgenaue Recherche in eigenem, wissensbasierten Regulatorik-LLM.



RAG-basierte Wissensbasis: Retrieval-Argumented-Generation nutzt aktuelle und regulatorisch relevante Dokumente Daten für höchste Genauigkeit und Nachvollziehbarkeit.



Individuell erweiterbar: Der Navigator ist flexibel und individuell an Ihre Fragestellungen erweiterbar.



DSGVO-konform und sicher: eigener Data Hub bei einem zertifizierten, deutschen, Anbieter.



1 PLUS i - FÜR REGULATORISCHE EXZELLENZ. Der Regulation Navigator verbindet modernste KI-Technologie mit deutschen Datenschutzstandards – damit Sie sicher, schnell und zukunftsfähig durch jede regulatorische Herausforderung navigieren.

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Erstinformation

Austausch zu den Rahmenbedingungen und Abstimmung der Workshopinhalte

Workshop

Übersicht über Möglichkeiten der Umsetzung und Darstellung des Navigators. Gemeinsame Skizzierung eines Arbeitsprogramms

Angebot für möglichen Regulation Navigator

Konkretes Arbeitsprogramm und Umsetzung von Vereinfachungen mit 1 PLUS i

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Raphael Reinwald
M 0163 – 31 75 748
Raphael.reinwald@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

AM ENDE WAR ES DOCH WIEDER KNAPP – STARTEN SIE DIE PHASE 2 DER CRR III- IMPLEMENTIERUNG!

Bei Großprojekten mit harter Deadline zeigt sich immer wieder das gleiche Muster: Trotz guter Planung gewinnt am Ende der Pragmatismus. Dieser führt dazu, dass

- Termintreue wichtiger ist als eine fundierte Implementierung der Anforderungen und
- Optimierungspotenziale (z.B. Wahlmöglichkeiten) nicht gehoben werden.

Die Konsequenz? Es werden Punkte „in die Linie“ übergeben und die dortigen Priorisierungslisten werden immer länger! Gleichzeitig ungenutzt: Möglichkeiten, die aufsichtlichen Anforderungen kapitalschonender zu erfüllen – gerade beim KSA, der auch für

IRB-Banken wegen des ansteigenden Outputfloods in den nächsten Jahren immer wichtiger wird.

Nutzen Sie diese Potenziale gezielt. Gemeinsam mit Ihnen identifizieren und realisieren wir institutsindividuelle RWA-Optimierungsmöglichkeiten, beispielsweise durch:

- Einsparungen im Retailgeschäft, z.B. Immobiliengeschäft, Spezialfinanzierungen
- Nutzung von Übergangsregelungen zur Abmilderung der Einführung der CRR III, beispielsweise beim Outputfloor oder bei Kreditkonversionsfaktoren
- Nutzung von Wahlrechten für eine dauerhafte Senkung der Eigenmittelunterlegung, etwa bei Fremdwährungsexposures oder Beteiligungen
- RWA-optimierte Sicherheitenverteilung

Erstinformation, Workshop, Optimierungsmöglichkeiten? Wir haben viele Ideen und Ansätze für die Hebung von RWA-Potenzialen!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstinformation

Austausch zu potenziellen Themengebieten für eine RWA-Optimierung Ihres Portfolios

Workshop

Vertiefte Diskussion Ihrer prioritären Themengebiete; Ersteinschätzung zu Signifikanz und Aufwand

Angebot für mögliche Optimierungsmodule

Konkretes Arbeitsprogramm; Umsetzung Verbesserungen mit 1 PLUS i

C1 PLUS i
CONSULTING



Linda Schöche
M 0177 - 09 95 071
linda.schoeche@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 79 94
90114 Nürnberg F0911 – 56 79 95 55 www.1plusi.de

TESTEN – LUST ODER FRUST?

Fast Jeder war schon einmal direkt oder indirekt damit konfrontiert: TESTEN – Herausforderung oder Routine. Welche Fragen beschäftigen Sie?

- Immer zu wenig Zeit am Ende des Tages? Ist mein Testprozess schon ausreichend optimiert oder habe ich noch Verbesserungspotenzial?
- Test-Tools (Jira/Xray, Quality Center etc.) – was hilft mir weiter, um meine Aufgaben in komplexen Projekten zu meistern?

Steigende regulatorische Anforderungen im Bankenumfeld, eine immer höhere

Komplexität, kürzere Software-Release-Zyklen, erweiterte Dokumentationen, häufigere und intensivere Prüfungen machen Projekte anspruchsvoller und haben Auswirkungen auf die Anforderungen und Qualität im Software Testing.

Wollen Sie von unseren Erfahrungen im Software Testing profitieren, zum Beispiel

- Benötigen Sie operative Testunterstützung durch Best Practice Ansätze?
- Lassen sich Testaktivitäten automatisieren, um effizienter meine Testziele zu erreichen?
- Regressionstests – wurden sie berücksichtigt und wie sind sie im Testprozess umzusetzen?
- Welche Tools können mich bei meinen Testaktivitäten entlasten und effizienter machen?

Erstanalyse, Workshop, Testunterstützung, Testoptimierung?

MELDEN SIE SICH EINFACH BEI UNS.

Erstinformation

Austausch zu den Rahmenbedingungen Ihres Testumfelds und Abstimmung der Workshopinhalte

Workshop & Training

Identifikation von Optimierungsoptionen und Training der Mitarbeiter nach ISTQB Standard

Testmanagement & Testdurchführung

Testfalldefinitionen, Test- & Defectmanagement

C1 PLUS i
CONSULTING



Lukas Zetzel
M 0163 - 31 75 736
lukas.zetzel@1plusi.de

Postfach 130211 70911 - 56 79 94 99
90114 Nürnberg P0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

IST IHR VALI- DIERUNGS- UND MODELLRISIKO- FRAMEWORK PASSEND?

Die Überprüfung der im Institut eingesetzten Modelle und Verfahren sowie die Einschätzung ihrer Grenzen und Schwächen ist eine grundlegende aufsichtliche Anforderung:

- Welche Modelle werden alle einer Validierung unterzogen? Unterscheidung: Ökonomische versus normative Risikomodelle, „sonstige wichtige“ Modelle.

- Gibt es ein geeignetes Modellinventar?
- Welche quantitativen Validierungsmethoden (Backtesting, Benchmarking) sind implementiert?
- Welche qualitativen Validierungsmethoden (Datenqualität, Use Test) sind implementiert?
- Wie sieht das Scoring der Modellschwächen aus?
- Wie werden Modellrisikopuffer ermittelt?
Wir richten uns dabei an den Fachbereich und zusätzlich auch an die Interne Revision:
- Wie sieht ein adäquater Prüfungsleitfaden für Ihr Institut aus?
- Wie können wir als interne Revision die Fachbereiche ideal unterstützen, um das Rahmenwerk Validierung / Modellrisiko zu reviewen und zu integrieren?

Implementierungen, Prüfung der Validierungs- und Modellrisikokomponenten, Optimierung der Umsetzung? Wir haben viele Ideen und Ansätze für Ihr Validierungsteam!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**

Erstinformation

Kennenlernen der Rahmenbedingungen Ihres Instituts u. Abstimmung von Inhalten des Workshops

Workshop

Übersicht über Möglichkeiten der Unterstützung des Fachbereichs und der Revision, Darstellung der bisherigen Umsetzungserfahrung, Skizzierung eines Arbeitsprogramms

Angebot für mögliche Unterstützung

Überprüfung und Weiterentwicklung des aktuellen Validierungs- und Modellrisikorahmenwerks

C1 PLUS i
CONSULTING



Dr. Walter Gruber
M 0163 - 31 75 079
walter.gruber@1plusi.de

Postfach 130211 90114 Nürnberg T0911 - 56 79 94 99
F0911 - 56 79 95 55 www.1plusi.de

WOCHENENDHANDEL: NEUE CHANCEN FÜR DIE KUNDENBINDUNG

Der Handel mit Finanzinstrumenten am Wochenende gewinnt zunehmend an Bedeutung. Getrieben durch den 24/7-Krypthandel erwarten viele Anleger eine kontinuierliche Handelbarkeit auch für klassische Finanzinstrumente wie Aktien und ETFs. Für Banken entstehen dadurch neue Chancen zur Kundenbindung – gleichzeitig ergeben sich zusätzliche regulatorische Anforderungen.

Vorgaben aus MaRisk, CRR sowie MiFID und MiFIR gelten auch außerhalb der regulären

Handelszeiten und müssen entsprechend berücksichtigt werden. Gleichzeitig stellen eingeschränkte Marktliquidität, Preisbildung und operative Prozesse Institute vor neue Herausforderungen.

- Welche regulatorischen Anforderungen sind für Wochenendhandel relevant?
- Welche Auswirkungen ergeben sich auf Risikosteuerung, Liquidität und Meldewesen?
- Welche Anpassungen sind für Prozesse, Systeme und Governance erforderlich?

Die Konsequenz? Umsetzung des Themas im Kontext eines „NEUEN Produkte und Märkte Prozesses (NPP), um alle betroffenen Bereiche korrekt zu berücksichtigen.

Impact-Analyse, Handelsprozesse, Risikosteuerung, technische Umsetzung?
Wir haben viele Ideen und Ansätze für eine effiziente Umsetzung des Wochenendhandels!

**MELDEN SIE SICH
EINFACH BEI UNS.**



C1 PLUS i
CONSULTING



Raphael Röken
M 0163- 4175544
raphael.roeken@1plusi.de

Postfach 130211 T0911 – 56 7994 99
90114 Nürnberg F0911 – 56 7995 55 www.1plusi.de