



Risikomanagement *Zukunftsorientierte Ausrichtung im IDH durch Standardisierung*

Themenbereich: Banksteuerung

Messe-Stand: BS07

Fragen beantwortet
Ihnen Ihre zuständige
Kundenberatung.

Risikomanagement mit dem IDH – Vorbemerkungen

Der Integrierte Datenhaushalt (IDH) stellt eine zentrale Informationsablage dar. Mit der Nutzung des IDH kann somit insbesondere den steigenden regulatorischen Anforderungen an eine konsistente Datenhaltung und Datenqualität (zum Beispiel BCBS 239) begegnet werden. Hierdurch wird ein mit dem Meldewesen konsistentes und abgestimmtes integriertes Risikomanagement (Reporting und Portfoliosteuerung) ermöglicht.

Marktpreis- und Liquiditätsrisiko (MPR, LQR)

Mit dem Projekt »IDH Risikomanagement MPR-LQR« werden die durch die SR gelieferten Fachkonzepte für ein neues Risikomanagement – Marktpreisrisiko und Liquiditätsrisiko – umgesetzt. Die vollständige Umsetzung der auf das Marktpreis- sowie Liquiditätsrisiko bezogenen Fachkonzepte ist aktuell für das OSPlus-Release 21.0 geplant. Ab diesem Zeitpunkt beginnt der Rückbau der aktuellen Anwendungen. Damit die neuen Anwendungen umfassend getestet und erprobt werden können, werden sowohl für MPR als auch für LQR Vorversionen für eine begrenzte Anzahl von Instituten ab OSPlus-Release 19.1 zum Einsatz kommen. Wir informieren Sie über den aktuellen Stand der zeitlichen Planung und geben einen Ausblick auf die umzusetzenden Inhalte der neuen Anwendungen.

Operationelles Risiko (OpRisk)

Das von der SR entwickelte Standardverfahren zur Berücksichtigung operationeller Risiken in der Risikotragfähigkeit, das »OpRisk-Schätzverfahren«, wird mit dem Release 18.1 in die bestehende OSPlus-Anwendung »Operationelle Risiken« integriert. Ziel der Integration in das OSPlus-Portal ist es, den Anwendern eine konsistente Datengrundlage für die Messung aller operationellen Risiken und darauf ansetzender Verfahren zu bieten. In den Folge-Releases erfolgt die Anbindung des OpRisk an den IDH. Informieren Sie sich über den aktuellen Stand der Planung.

Bitte umdrehen >>



Seite 02

Adressenrisiko (ADR)

Die vollständige Umsetzung der auf das Adressenausfallrisiko bezogenen Fachkonzepte beginnt mit dem OSPlus-Release 18.1. Dabei bietet die neue Datenbereitstellung für das Adressenrisiko folgende Vorteile:

- Der Integrierte Datenhaushalt stellt eine einheitliche Datenbasis für die Anwendungen der Banksteuerung dar, so dass anwendungsübergreifend die Daten und Methoden schrittweise harmonisiert werden.
- Flexible Parametrisierung durch individuelle Erfassung verschiedener Szenarien, beispielsweise bzgl. Ausführungshäufigkeit der Datenbereitstellung und Parametereinstellungen
- Reduzierung manueller Aufwände, beispielsweise Wegfall der Anlieferung offener Schnittstellen
- Automatisierte Einbindung weiterer adressenrisikorelevanter Daten neben dem Kredit- und Depot-A-Geschäft, beispielsweise Positionen aus Fonds inkl. zugehöriger Cashflows und S-Kreditbasket-Informationen
- Nachvollziehbarkeit der Datenherkunft (sogenannte Data Lineage) wird schrittweise ermöglicht

CPV ist eine Anwendung, die durch die SR entwickelt und gepflegt wird und den Instituten durch die SR bereitgestellt wird. Die SR stellt Ihnen die weiterentwickelte Anwendung CPV R5.8 am Stand vor.

Fragen beantwortet
Ihnen Ihre zuständige
Kundenberatung.