

INTERNE REVISION

REGULATORIK

ICAAP

RISIKOMANAGEMENT

KREDITRISIKO

C1 PLUS i
CONSULTING

≡ EXPERTISE VON 1 PLUS i IN DEN THEMENFELDERN EINER GANZHEITLICHEN UND MODERNEN INTERNEN REVISION

<p>ICAAP</p> <ul style="list-style-type: none"> › Risikoinventur › Kapitaladäquanz: Normative und ökonomische Perspektive › Kapitalplanung und Stresstests 	<p>Sanierung und Abwicklung</p> <ul style="list-style-type: none"> › Indikatorensystem und Belastungsanalysen › Handlungsoptionen und Governance › Strategische Unternehmensanalyse, Abwicklungsstrategien, -prozesse, -instrumente 	<p>Modellvalidierung</p> <ul style="list-style-type: none"> › Validierungskonzept › Methodenhandbuch Validierung › Validierungsbericht
<p>ILAAP</p> <ul style="list-style-type: none"> › Angemessenheit der Liquiditäts- und Refinanzierungsposition › Liquiditätsadäquanz: Normative und ökonomische Perspektive › Stresstests zur Beurteilung der Angemessenheit der Liquidität 	<p>Risikoreporting (inkl. BCBS 239)</p> <ul style="list-style-type: none"> › Mindestinhalte an Risikoberichte (BT 3 MaRisk) › Aktualität und Flexibilität › Aussagekraft und Verständlichkeit 	<p>Pricingmodelle (Derivate, strukturierte Produkte)</p> <ul style="list-style-type: none"> › Adäquanz des Instrumentenmodells › Kalibrierung an Marktdaten › Verfügbarkeit von Preisquotierungen / Cashflow-Modellierung
<p>MiFID II und EMIR</p> <ul style="list-style-type: none"> › Product Governance › Handelsplatz- und Clearingpflicht › Transaktionsmeldungen (VHT, NHT, Art. 26, EMIR Art. 9) 	<p>Modellrisiko</p> <ul style="list-style-type: none"> › Modellinventarisierung › Scoring der Modellschwächen / Erstellung von Heatmaps › Modellrisikopuffer 	<p>Marktrisiko</p> <ul style="list-style-type: none"> › Risikofaktorspektrum › Schätzung der statistischen Parameter › Adäquanz des Marktrisikomodells

IRB-Prüfung	Stresstesting inkl. EBA-Stresstests	Anforderungen an Auslagerungen
<ul style="list-style-type: none"> › Ausfalldefinition › Schätzung der Parameter (PD, LGD, CCF, EaD) › Use test und Model Change Policy 	<ul style="list-style-type: none"> › Hypothetische, historische und inverse Stresstests › Beurteilung der Stresstestmethodik und -ergebnisse in Säule 1 und 2 › Satellitenmodelle für gestresste Risikoparameter 	<ul style="list-style-type: none"> › Risikoanalyse und Proportionalitätsprinzip › Ausgestaltung des Auslagerungsvertrags › Zentrales Auslagerungsmanagement
Kreditrisiko	Meldewesen – COREP und AnaCredit	
<ul style="list-style-type: none"> › Ausfall-, Migrations- und Spreadrisiken › CVA-Risiko › Konzentrationsrisiken 	<ul style="list-style-type: none"> › Forderungsklassenzuordnung › Vollständigkeit der abgedeckten Risikopositionen › Meldespezifische Besonderheiten als Folge von Basel III 	
Operationelles Risiko	IFRS 9	
<ul style="list-style-type: none"> › Schadensfalldatenbank › Self Assessment › OpRisk-Framework 	<ul style="list-style-type: none"> › Kategorisierung von Finanzinstrumenten › Stage-Zuordnung › Methoden zur Ermittlung des Expected Loss 	

WIE 1 PLUS i SIE UNTERSTÜTZEN KANN

- › Maßgeschneiderte Gap-Analyse der internen Methoden und Prozesse
- › Überprüfung des internen risikoorientierten Prüfungsplans
- › Mitwirkung bei der risikoorientierten Prüfungsplanung und -durchführung

1 PLUS i GmbH
Postfach 130211
90114 Nürnberg
T: 0911 – 56 79 94 99
F: 0911 – 56 79 95 55
info@1plusi.de
www.1plusi.de