

Profil

- Bank, Frankfurt/ Main
- Basel2/ SolvV: Interner Rating-Ansatz AIRB
- Rollen von ft consult: Senior Consultant, Business Analyst

Ausgangslage und Zielsetzung

- Vorbereitung der Einführung des fortgeschrittenen Ansatzes AIRB für ausgewählte Meldewesen-Portfolien
- Vorbereitung einer technischen Einbindung für die konzerneigene AIRB-Systemlösung (Kreditrisiko-Ergebnisermittlung) in die Abacus-Verarbeitungsprozesse
- Berücksichtigung unterschiedlicher IT-Systeme aufgrund der Konzernstruktur (Inland/ Ausland)

Vorgehen

- Step1: Technische Umstellung auf Konzernlösung bei Ergebnisallokation Kreditrisiko
- Vergleich der bisherigen KSA- und FIRB-Ergebnisse zwischen System Abacus und dem konzernweiten Kalkulator (Eigenlösung)
 - Analyse der notwendigen Anpassungen in der Datenvorverarbeitung und -anlieferung
 - Ableitung der Prozessumstellungen durch Einbezug der Konzernlösung
- Step 2: Vorbereitung zur AIRB-Einführung für bestimmte Meldewesen-Portfolien
- Erarbeitung Proof-of-Concept bzw. notwendige Anpassungen für Schnittstellen
 - Test: Verifikation der berechneten AIRB-Ergebnisse in der Konzernlösung
 - Rück-Mapping der Konzernergebnisse auf Abacus-Format zwecks Formularerstellung für externes Reporting Deutschland