

Profil

- Kreditinstitut, Berlin
- Optimierung Marktdatenversorgung für das Risiko Controlling
- Rolle ft consult: Business Analyst

Ausgangslage und Zielsetzung

- Nutzung von Credit Spread-Kurven zur Bestimmung von Adressausfallrisiken, Spreadrisiken, Fair Values nach IFRS und illiquiden Aktienpreisen
- Qualitativer Verbesserungsbedarf der den Berechnungen zugrunde liegenden Marktdaten vor dem Hintergrund veränderter regulatorischer Anforderungen
- Identifikation und Bewertung von Optionen zur Beseitigung der vorliegenden Marktdaten-Qualitätsdefizite sowie Ausarbeitung eines Lösungsvorschlags

Vorgehen

- Herausarbeitung und Systematisierung der durch regulatorische Veränderungen gegebenen Anforderungen an das Risiko Controlling
- Ableitung fachlicher und technischer Kriterien zur Bewertung alternativer Lösungen zur Bereitstellung von Credit Spread-Kurven
- Identifikation und Kontaktierung von 11 Anbietern für die Bereitstellung von Credit Spread-Kurven sowie Einholung entsprechender detaillierter Informationen
- Bewertung der verschiedenen Lösungsoptionen auf Basis der zuvor definierten fachlichen und technischen Kriterien unter Einbezug kaufmännischer Aspekte
- Auswahl einer präferierten Lösung und Ausarbeitung eines entsprechenden Fachkonzepts
- Erarbeitung eines Vorschlags zur weiteren Vorgehensweise sowie Erstellung und Präsentationen einer entsprechenden Entscheidungsvorlage