



Aufbau neuer Marktrisiko-Plattform

Effiziente Kapitalsteuerung, verbesserte Produktbewertungen und Compliance durch Technologie

Bestehende Marktrisikoplattformen geraten zunehmend unter Druck: FRTB verschärft die regulatorischen Anforderungen, strukturierte Produkte treiben die Modellkomplexität und Legacy-Architekturen stossen bei Monte-Carlo-VaR-Berechnungen an ihre Performancegrenzen. Oepfelbaum begleitet Banken bei der vollständigen Ablösung und Neuentwicklung dieser Plattformen, ohne Unterbruch des laufenden Reportings, mit direktem Einfluss auf Kapitalanforderungen und Steuerungsfähigkeit.

UNSER BEITRAG

Oepfelbaum bringt fachliche Risikokompetenz und technische Exzellenz aus einer Hand. Wir verantworten Architekturdesign, Implementierung, Szenariodesign, Performance-Tuning und Regressionstests – und übernehmen auf Wunsch auch die Teilprojektleitung. Wir kennen die regulatorischen Leitplanken, verstehen die Modelllogik hinter FRTB und können beides direkt in belastbare Systemarchitektur übersetzen.

HERAUSFORDERUNG

- Legacy-Plattformen sind unter FRTB regulatorisch kaum mehr belastbar. Kapitalunterlegung und Modellkonformität stehen auf dem Spiel und Nachbesserungen am Altsystem sind keine langfristige Option.
- Komplexe Bewertungen mit Monte-Carlo-Simulationen bei strukturierten Produkten limitieren die operative Steuerungsfähigkeit im Handel. Lange Berechnungszeiten verhindern bei nicht-skalierbaren Risikoplattformen Intraday-fähige Risikosteuerung.
- Migration und Neuentwicklung müssen bei laufendem Betrieb unter strengen Anforderungen an Datenqualität, Konsistenz und Auditierbarkeit erfolgen.

LÖSUNGSANSATZ



Zielbild: Eine skalierbare, revisionssichere Marktrisikoplattform mit konsistenter End-to-End-Abdeckung von P&L, Greeks, VaR, Stresstest und FRTB als tragfähige Grundlage für regulatorische Konformität und effiziente Kapitalsteuerung.



Umsetzung: Implementierung auf Basis von Szenario-Rechnungen, direkt integriert im Handels- und Risikosystem: performante Architekturgestaltung, konsistente Datenmodelle und umfassenden Testing für stabile Ergebnisse in der Parallelphase.

BUSINESS IMPACT



Kapitaloptimierung: Zuverlässige und verbesserte Risikomessung unter FRTB ermöglichen Optimierungen bei der Eigenmittelunterlegung mit direktem P&L-Effekt.



Effizienz & Steuerung: Schnellere, stabilere Berechnungen reduzieren manuelle Eingriffe im Risikocontrolling und verbessern Limit- und Portfolioentscheidungen im Tagesgeschäft.



Regulierung: Auditierbare, modellkonforme Softwarelösung mit vollständig retrospektiver Reproduzierbarkeit schafft Sicherheit gegenüber Prüfern und Aufsichtsbehörden.