

MODEL RISK MANAGEMENT UND DIE ROLLE DER INTERNEN REVISION

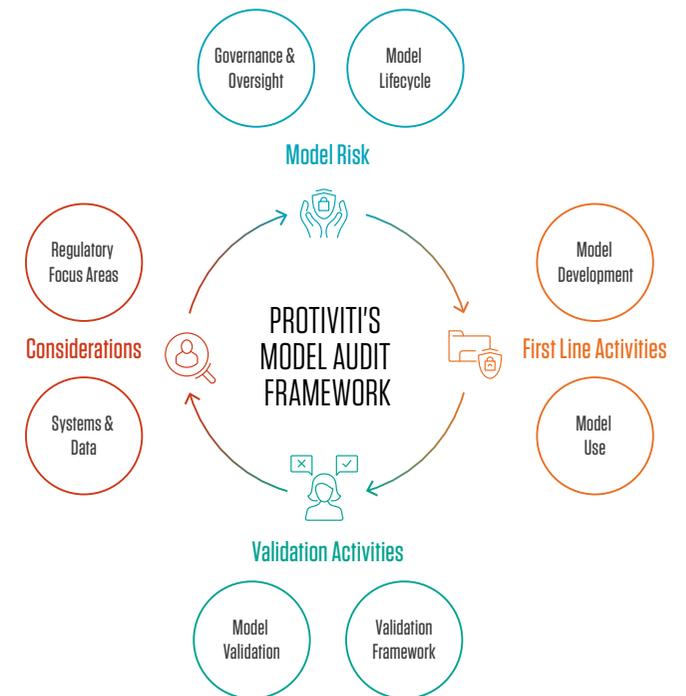
Modellrisikomanagement spielt auch in kleinen und mittelständischen Finanzinstituten eine wichtige Rolle. Modelle dienen ihnen beispielsweise zur Erfüllung ihrer ICAAP-Anforderungen, zur Berechnung interner Ratings und zur optimalen Bepreisung. Entsprechend wichtig ist eine unabhängige Überprüfung der Modellrisiken. Wir helfen Ihnen, solche Risiken zu identifizieren und zu reduzieren.

Modellrisiken effizient senken

Beim Einsatz von quantitativen Modellen in Finanzinstituten sind Modellrisiken unvermeidlich. Diese Risiken können aufgrund unvollständiger oder falscher Informationen oder unzureichender Prozesse bereits bei der Modellentwicklung entstehen. Auch können sich fehlerhafte Modellergebnisse negativ auf Geschäftsentscheidungen auswirken. Die Aufsichtsbehörden sind sich der Gefahren bewusst, die Modellrisiken für Institute darstellen, und legen einen Fokus auf dieses Thema.

Gerade in kleinen und mittelständischen Unternehmen wird eine unabhängige Validierung von Modellen aufgrund von Personalengpässen nicht immer effektiv durchgeführt. In diesen Fällen kann auch die Interne Revision als unabhängige Partei einspringen.

Wir helfen Finanzinstituten, ihr Modellrisiko zu reduzieren, indem wir unser regulatorisches Wissen, Best Practices, Modellierungs- und Validierungserfahrung aus zahlreichen Modellprüfungen unterstützend zur Verfügung stellen.



Unser Rahmenwerk für Modellprüfungen zeigt alle wichtigen Aufgaben während einer Modellprüfung sowie mögliche Validierungstätigkeiten, die die Revision übernehmen kann.



85 Standorte | 25 Länder | 9000 Mitarbeitende

Protiviti berät Unternehmen praxisorientiert und auf Augenhöhe in den Bereichen Strategie, Organisations- transformation und -optimierung, ESG, Digitale Transformation, Risiko- management, Interne Revision und Kontrollsysteme, Compliance sowie IT. Gemeinsam finden wir individuelle Lösungsansätze, um Ihr Unternehmen zukunftssicher aufzustellen. Face the Future with Confidence.

»In unserer Prüfungspraxis haben wir gemerkt, dass sich die Revision immer mehr mit den Modellen selbst und nicht nur mit den umgebenden Prozessen befassen sollte«

DENIS LIPPOLT, DIRECTOR

Unsere Services im Model Risk Management

Unsere Expertise bei Modellprüfungen umfasst:

- alle Risikoarten
- Stresstests
- Modellanwendungen
- Rollen und Verantwortlichkeiten
- Modellrisikomanagement
- Modellimplementierung

Wir halten unsere Kunden über regulatorische Änderungen stets auf dem Laufenden. Für eine verbesserte Effizienz setzen wir bei Revisionsprojekten Machine-Learning-Algorithmen ein und beraten unsere Kunden, wie sie Advanced-Analytics-Methoden in ihre Revisionspraxis einbinden können.

Wenn größere Umstellungen in Unternehmen anstehen, bieten wir projektbegleitende Prüfungen an. Auch bei der ICAAP-Umstellung auf die normative und ökonomische Perspektive oder bei der Umsetzung des neuen Standardansatzes für operationelle Risiken (OpRisk) unterstützen wir Sie gerne.

Darüber hinaus bieten wir externe Schulungen zu Modellprüfungen inklusive regulatorischer Anforderungen, Model Governance und Modellrisikomanagement an.

Unsere FRM- oder CFA-zertifizierten Fachleute im Model-Services-Team verfügen durch viele Modellprüfungen in kleinen und mittelständischen Finanzinstituten über umfassende Erfahrung. Die Teammitglieder besitzen weitreichende mathematische und regulatorische Kenntnisse und Programmiererfahrung, um Modellimplementierung nachvollziehen zu können.

CHECKLISTE UNSERE SERVICES



BEWERTEN

Mit unserem Spezialwissen über quantitative und regulatorische Themen sowie Best Practices bewerten wir zuverlässig Ihr Modellrisiko-Management und Ihre Governance.



PRÜFEN

Wir prüfen Ihre Modellentwicklungs- und Validierungsprozesse und deren Compliance, führen eine unabhängige Validierung durch und prüfen die Implementierung inklusive Datenquellen und -verarbeitung.



ANWENDEN

Wir wenden ML-Algorithmen bei Revisionsprojekten an, automatisieren Ihre Revisions-tätigkeiten und Prozesse und beraten Sie zum Einsatz von Advanced-Analytics-Methoden in der Revision.

Ansprechpartner



PETER GRASEGGER

Managing Director

+49 173 653 89 22

peter.grasegger@protiviti.de



DENIS LIPPOLT

Director

+49 172 698 30 48

denis.lippolt@protiviti.de

KONTAKTIEREN SIE UNS!

+49 69 963 768 100

contact@protiviti.de

www.protiviti.de

