



LSI Stresstest

Befüllung der aufsichtlichen Meldebögen Markt- und Adressrisiko
Fondsplanung auf Basis von VR-Control Auswertungen



Unterstützungsleistungen der parclT zum LSI-Stresstest

Zwischen dem 01. April und dem 31. Mai 2022 werden BaFin und Bundesbank zum wiederholten mal den aufsichtlichen LSI-Stresstest durchführen, an dem fast alle genossenschaftlichen Primärinstitute verpflichtend teilnehmen müssen.

LSI-Stresstest im Zeitraum 01.04. – 31.05.2022

Im Rahmen des LSI-Stresstests verlangt die Aufsicht von den Instituten die Befüllung eines Excel-Templates mit einer Vielzahl verschiedener Kennzahlen, Planzahlen sowie Kalkulations-

ergebnissen. Da im Rahmen des Stresstest fast ausschließlich steuerrelevante Kennzahlen sowie daraus abgeleitete Werte abgefragt werden, kann die Befüllung des Templates im Wesentlichen aus VR-Control heraus erfolgen.

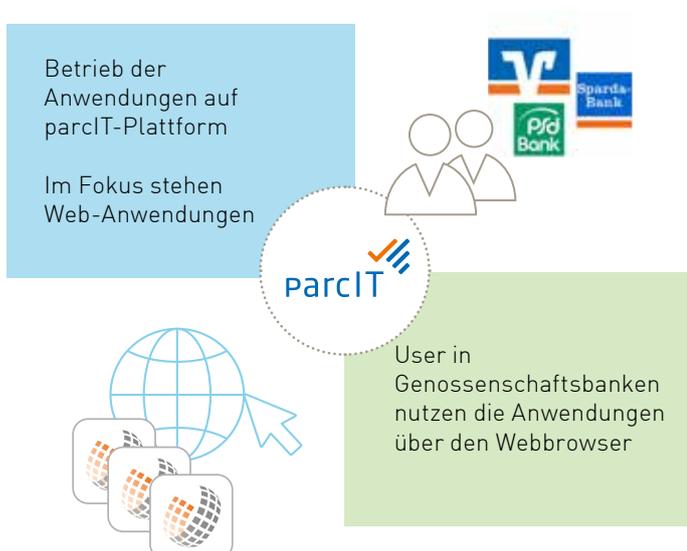
Allerdings sind zur Ableitung der geforderten Werte teilweise technisch sehr aufwändige und komplexe Kalkulationsschritte notwendig.

okular-Tools als Befüllungshilfe

Im Rahmen der durch den BVR koordinierten Unterstützungsleistungen stellt die parclT über entsprechende okular-Tools Befüllungshilfen zum **Markt- und Adressrisiko Template** sowie ein **Fondsplanungstool** zur Verfügung, welche die Befüllung der aufsichtlichen Templates vereinfachen.

Die grundsätzliche Funktionsweise der Tools sieht dabei vor, dass mittels VR-Control Datenexporte und/oder Kalkulationsergebnisse erzeugt werden, welche dann im okular-Tool hochgeladen werden.

Die Webanwendung führt bei Bedarf weitergehende Aggregationen oder Nebenrechnungen durch, um die im aufsichtlichen Template geforderten Kennzahlen zu ermitteln. Diese können dann unmittelbar über die Zwischenablage in das aufsichtliche Template übertragen werden, bzw. dienen im Falle des Fondstools als Korrekturwerte. Dabei sind die bankindividuellen Daten für die parclT oder andere zu keiner Zeit sichtbar und werden insbesondere nicht gespeichert.



Maßgeschneiderte Anwendungen erleichtern Ihnen die Befüllung der aufsichtlichen Meldebögen für Markt- und Adressrisiko sowie die Fondsplanung auf Basis von VR-Control-Auswertungen.

Automatisierte Aggregationen und Nebenrechnungen

Mit den neuen okular-Tools erhalten Sie komfortable Anwendungen, welche stets aktuell gehalten werden, damit auch eventuell kurzfristige aufsichtliche Änderungen an Methodik oder Templates im LSI-Stresstest kein Problem darstellen.

Möglichkeit zur Verwendung prototypischer VR-Ratings im ST-Adressrisiko

Die Befüllungshilfe zum ST-Adressrisiko bietet die optionale Möglichkeit einer Verwendung prototypischer Ratings für ausgewählte VR-Ratingverfahren. Damit ermöglichen wir Ihnen, unabhängig von einer Implementierung in agree21, von den

Unterstützungsleistungen auf einen Blick

- ✓ Befüllungstools zu den Templates ST-Adressrisiko, ST-Marktrisiko sowie Fondsplanungstool
- ✓ Importschablonen für Parameter
- ✓ Bereitstellung prototypischer VR-Ratings zur Berücksichtigung von Weiterentwicklungen
- ✓ fachliche Expertise

aktuellen Weiterentwicklungen der VR-Ratingverfahren zu profitieren. Dazu stellt die parclIT für jedes weiterentwickelte VR-Ratingverfahren auf Basis des aktuellsten, durch die Gremien abgenommenen Entwicklungsstands für jeden Kunden ein prototypisches Rating bereit. Der Anwender kann dann in der Befüllungshilfe entscheiden, ob für das jeweilige Ratingverfahren die ursprünglichen Ratings durch die prototypischen Ratings ersetzt werden sollen.



Kontakt:

Dr. Jürgen Braun
Methoden- und Produktmanagement

E-Mail: Juergen.Braun@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75-116



Vertrieb:
Jochen Kleibrink
Leiter Vertrieb

Jochen.Kleibrink@parclT.de
Tel. +49 221 - 5 84 75 - 475
Fax +49 221 - 5 84 75 - 302

parclT GmbH
Erfstraße 15
50672 Köln
Info@parclT.de
www.parclT.de