

upDATE 2023

IKS-Neuentwicklung in ORM

Köln, 04.05.2023
Thomas Niessen, Alexander Tiebing,
parcIT GmbH

Disclaimer



Mit der Aushändigung dieses Dokuments verpflichten wir Sie, dieses absolut vertraulich zu behandeln und ohne schriftliche Zustimmung der parcIT GmbH Dritten nicht zugänglich zu machen. Hiervon ausgenommen ist die Vorlage des Dokuments im Rahmen bankaufsichtlicher Prüfungsprozesse

Diese Verpflichtung gilt auf unbegrenzte Zeit. Sie entfällt, soweit die Informationen seitens der parcIT GmbH der Öffentlichkeit bekannt oder allgemein zugänglich gemacht werden oder wenn Sie zur Weitergabe der Information rechtlich verpflichtet sind.

Sie stellen die parcIT GmbH von allen Ansprüchen Dritter frei, die durch die Verletzung der Vertraulichkeit entstehen.

Agenda

1. Verlustdaten- und Risikomanagement mit ORM

2. Das neue Modul „IKS-Dokumentation“ in ORM

Agenda

1. Verlustdaten- und Risikomanagement mit ORM

2. Das neue Modul „IKS-Dokumentation“ in ORM



Die Software-Suite okular/VR-Control und weitere Anwendungen über alle Steuerungsbereiche

Rating	VR-Rating Firmenkunden VR-Rating Privatkunden VR-Rating Immo VR-Rating Erneuerbare Energien Rating-Rechenkern
Adressrisiko	KRM ZIABRIS (KPM-EG) Ausfall- und Verlustdatensammlung
Marktrisiko/ Liquiditätsrisiko	ZIRIS ZIABRIS
Gesamtbank- steuerung	ZIRIS SIMON KOS OPTIRIS
Operationelle Risiken	ORM
Kundengeschäfts- steuerung	CBS IDP
Meldewesen/ Accounting	SOLVARIS MEASURE IT! HEDGE IT!

Software-Suite okular/VR-Control

- ✓ markterprobte Standardsoftwaremodule für professionelle Steuerung
- ✓ bei über 1.000 Banken im Einsatz
- ✓ okular/VR-Control® ist die Standardsoftwarelösung für das Risikomanagement und Controlling der Volks- und Raiffeisenbanken
- ✓ rund die Hälfte aller Privatbanken und Spezialkreditinstitute in Deutschland setzen auf die Steuerung mit okular

Risikomanagement

Anforderungen an Ihr Institut

✓ Identifikation und Bewertung Ihrer wesentlichen operationellen Risiken

✓ Einführung einer Verlustdatenbank zur Dokumentation der eingetretenen Risiken

✓ Erfüllung Ihrer Dokumentationspflichten und Revisionsicherheit

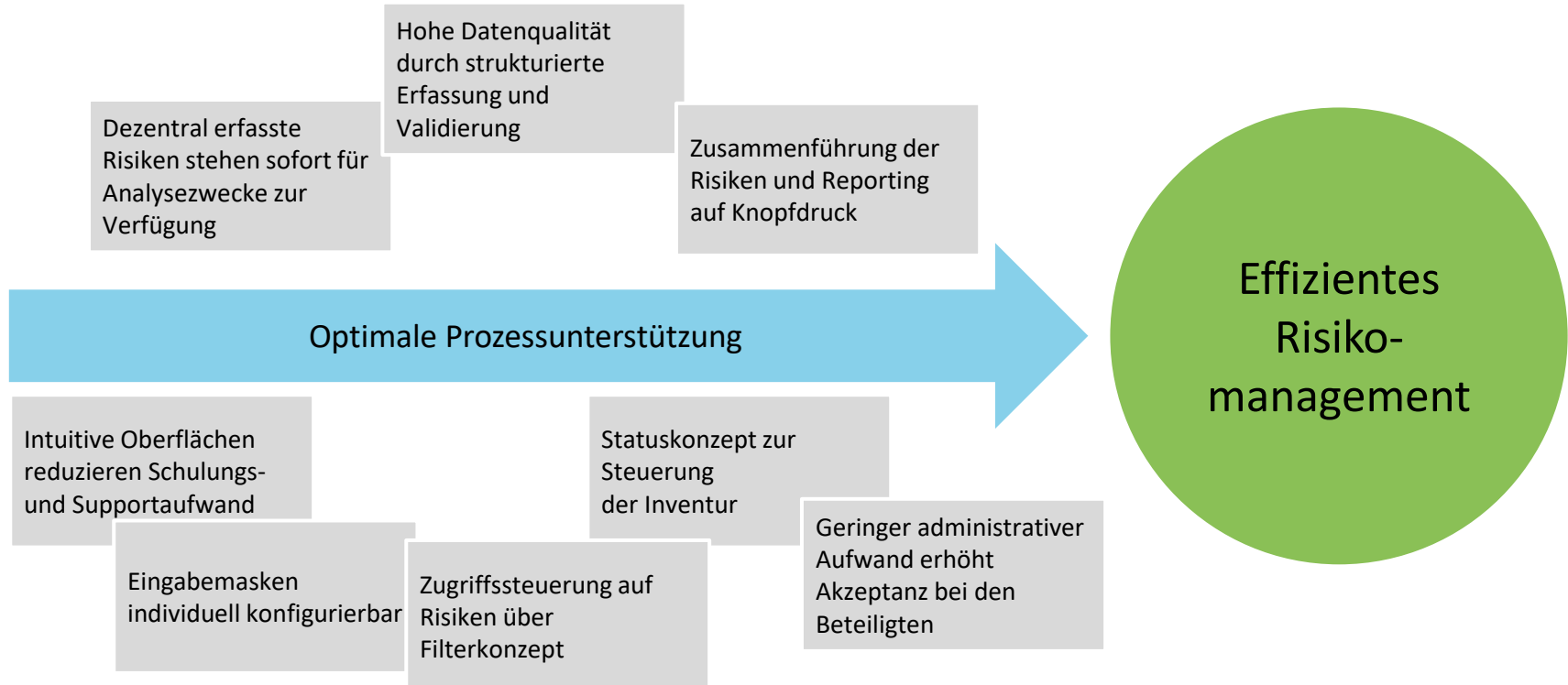
✓ Steuerung Ihrer wesentlichen Risiken über Maßnahmen, deren Umsetzung Sie verfolgen

✓ Einsatz eines Frühwarnsystems zur Risikosteuerung

Bereits erfüllt mit dem Basismodul von ORM!

Effiziente Risikoinventur

Optimale Unterstützung Ihres Risikomanagement-Prozesses



Risikomanagementprozess

Optimale Prozessunterstützung in der Softwarelösung

Risikoinventur/ Verlustdaten- sammlung

- ✓ Identifikation
- ✓ Organisatorische Einordnung
- ✓ Eintrittshäufigkeit
- ✓ Auswirkung
- ✓ Verlustdaten erfassen

Analyse

- ✓ Risiko-Matrix
- ✓ Identifikation wesentlicher und bestandsgefährdender Risiken
- ✓ Ableitung Risikostrategie

Steuerung

- ✓ Maßnahmen und Maßnahmenfortschritt
- ✓ Laufende Überwachung (Zeit, Kosten)
- ✓ Frühwarnsystem
- ✓ Backtesting

Aggregation

- ✓ Portfolio-betrachtung
- ✓ Monte-Carlo-Simulation des Value at Risk zur Ableitung der Risikotragfähigkeit

Reporting

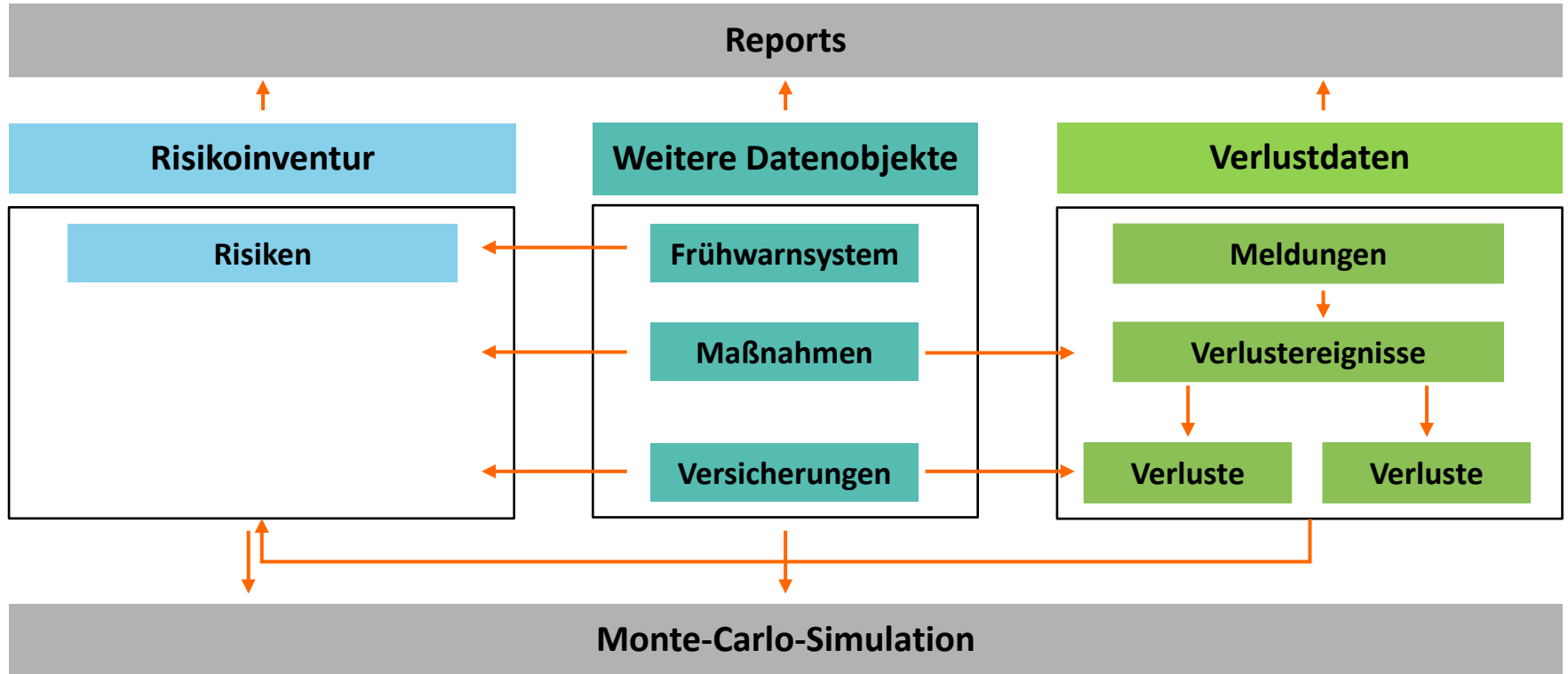
- ✓ Berichte für unterschiedliche Adressaten (z.B. Geschäftsleitung, Wirtschaftsprüfer)
- ✓ Flexible Standardberichte (per Knopfdruck), Export nach Excel

Unterstützung des Workflows

- ✓ Statuskonzept - vier Augen Prinzip
- ✓ Rechte- und Rollenkonzept - Zugriffssteuerung

Die bisherige Struktur von ORM

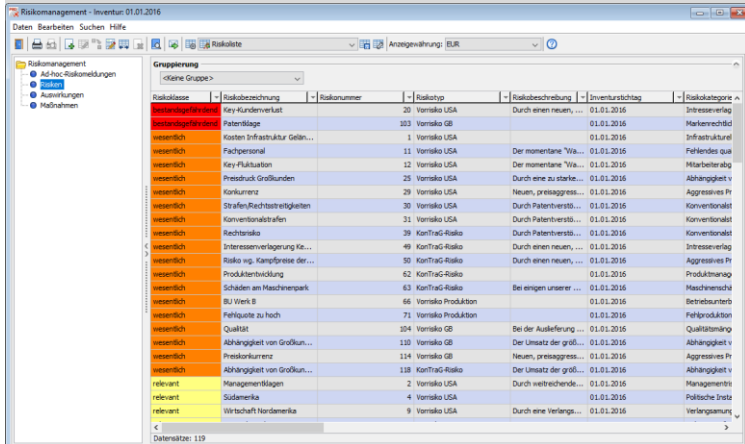
Unterschiede Risikoinventur, Verlustdaten und weitere Datenobjekte



Auswertungen und Berichtswesen Adressatengerecht und effizient

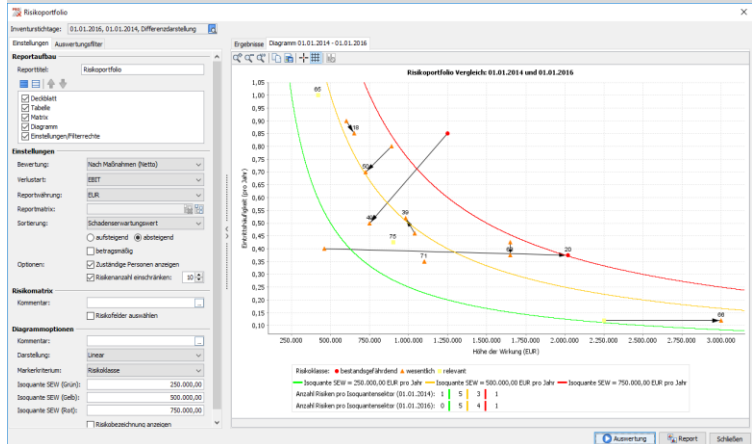
Ad-hoc-Reporting

- ✓ Tabellarische Anzeige der Daten
- ✓ Spalten können konfiguriert und diese gespeichert werden
- ✓ Export nach Excel, CSV, etc. zur weiteren Analyse



Standard-Reporting

- ✓ Reporting per Knopfdruck
- ✓ Einstellungsmöglichkeiten je Bericht
- ✓ Filterung der Risiken
- ✓ Ausgabe als PDF



Standard-Reporting

Auswahl zentraler Berichte

Standard-Berichte für
unterschiedliche
Fragestellungen

Aggregation

Ex-Ante:

Aggregation der Risiken nach unterschiedlichen Dimensionen, z.B. Risikokategorie, Gesellschaft, Geschäftseinheit

Bewertung und
Veränderung der
Risiken

Risikoportfolio:

Bewertung und Vergleich der Risiken im Portfolio, Veränderung von Risiken im Zeitablauf, Isoquantendarstellung

Risiko-Matrix,
Risikoklasse,
Top 10

Risiko-Analyse:

Analyse und Reporting der Risikomatrix
Drill-Down je Feld, Top-10-Analyse

Maßnahmen

Maßnahmenbericht:

Überwachung des Maßnahmenfortschritts,
Einhaltung von Deadlines und Budgets

Dokumentation
der Inventur

Inventurbericht:

Umfassende Darstellung der erfassten Daten (Risiken, Maßnahmen, Frühwarnindikatoren), Kommentierung und Gesamteinschätzung

Module in ORM

Standardsoftware – individuell anpassbar auf Ihre Anforderungen

Dezentrales Risikomanagement

- ✓ Web-Client
- ✓ Statuskonzept
- ✓ Schreibtischfunktion
- ✓ E-Mail-Funktion

Fachliche Erweiterungen

- ✓ Risiko-Cluster und Konsolidierung
- ✓ Mehrwährungsfähigkeit
- ✓ Versicherungsmanagement (light)
- ✓ Versicherungsmanagement (extended)
- ✓ Monte-Carlo-Simulation
- ✓ Szenario-Simulation
- ✓ Verteilungsfunktionen
- ✓ Katalog der Ursachen
- ✓ Erweitertes Datenpooling
- ✓ IKS-Dokumentation


Funktionale Erweiterungen


- ✓ Dokumentanhänge
- ✓ Sammelbearbeitung
- ✓ Kommentare zu fremden Risiken
- ✓ Individuelle Felder
- ✓ LDAP-Authentifizierung
- ✓ Sprachmodul Englisch
- ✓ Active Communication Server
- ✓ GP- oder Maßnahmen-Import
- ✓ Datawarehouse-Export

ORM - Basismodul

Risiko-Inventur	Maßnahmen	Reporting	Inventur-vergleich	Frühwarn-system	Verlust-datenbank	(neuer) Standard-und BI-Ansatz
Self-Assessment	Berechtigungs-konzept	Multi-User-Fähigkeit	Protokollierung	Im-/Export	Anwender-dokumentation	Externe Ereignisse

 = Im Lizenzumfang der Atruvia enthalten

 = Zusatzmodule auch für Atruvia freigegeben

 = Zusatzmodule nicht für Atruvia freigegeben

Agenda

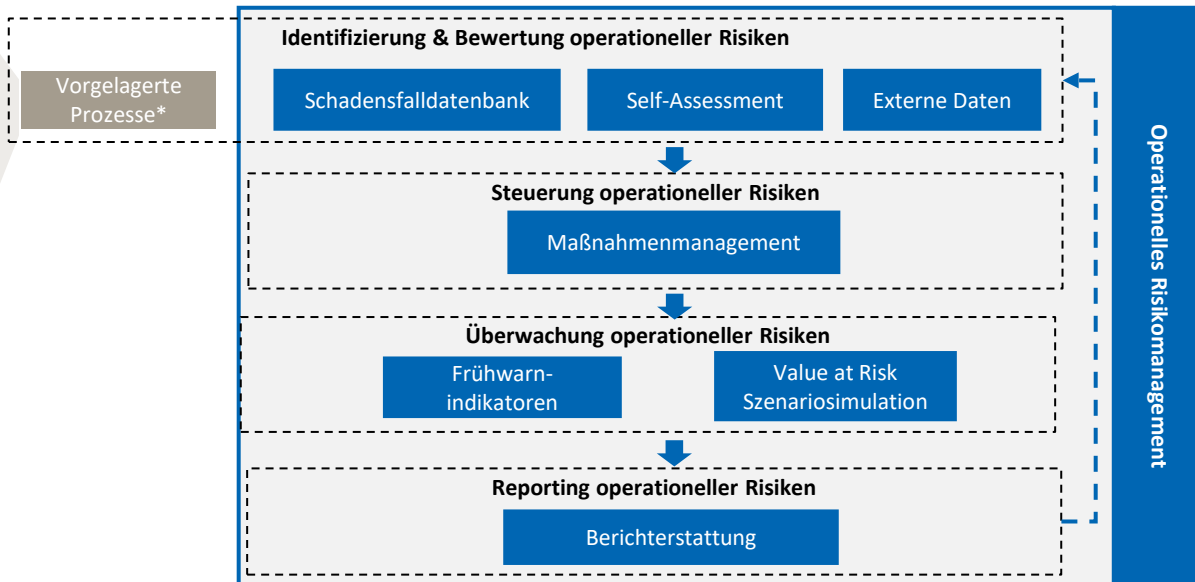
1. Verlustdaten- und Risikomanagement mit ORM

2. Das neue Modul „IKS-Dokumentation“ in ORM

Einleitung IKS-Dokumentation

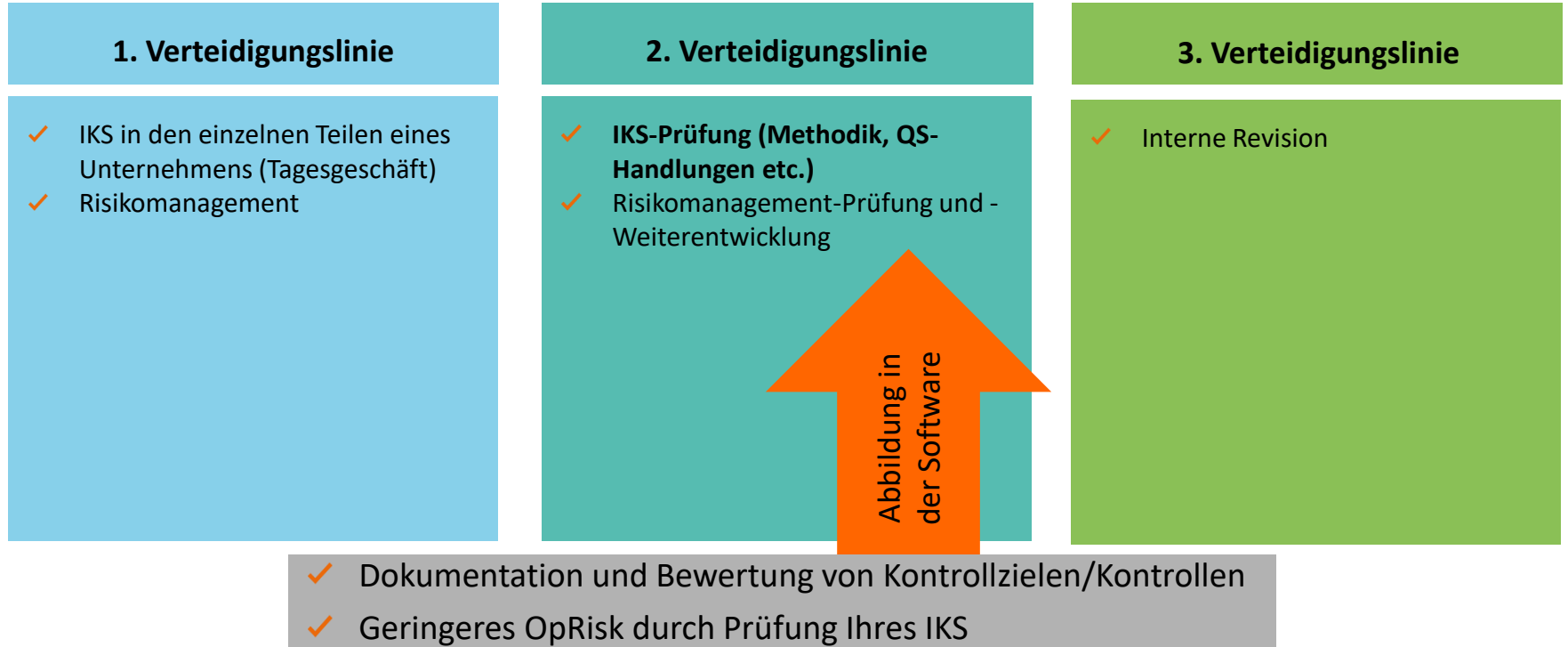
Die vorgelagerten Prozesse spielen bei der Identifizierung operationeller Risiken eine wichtige Rolle

- Compliancerisiken:**
 - ✓ Risikoanalyse zu Gefährdungen
 - ✓ Rückstellungen
- Verhaltensrisiken:**
 - ✓ Beschwerdemanagement
 - ✓ Kundenklagen
 - ✓ Prüfungsfeststellungen
- IKT-Risiken:**
 - ✓ IT-Risikomanagement
 - ✓ Informationsrisikomanagement
 - ✓ Datenschutzmanagement
 - ✓ Notfallmanagement (BCM)
- Weitere operationelle Risiken:**
- Drittbezugsrisiken:**
 - ✓ Auslagerungs- /Fremdbezugsmgt.
- Prozessrisiken:**
 - ✓ Internes Kontrollsystem
 - ✓ Prüfungsfeststellungen
- Betrugsrisiken:**
 - ✓ Betrug durch Kunden
- Personalrisiken:**
 - ✓ Personalfälle zu Arbeitsrechtsverletzungen
- Modellrisiken:**
 - ✓ Hinweise aus Modellvalidierung
- Sonstige OpRisk:**
 - ✓ Sachschäden



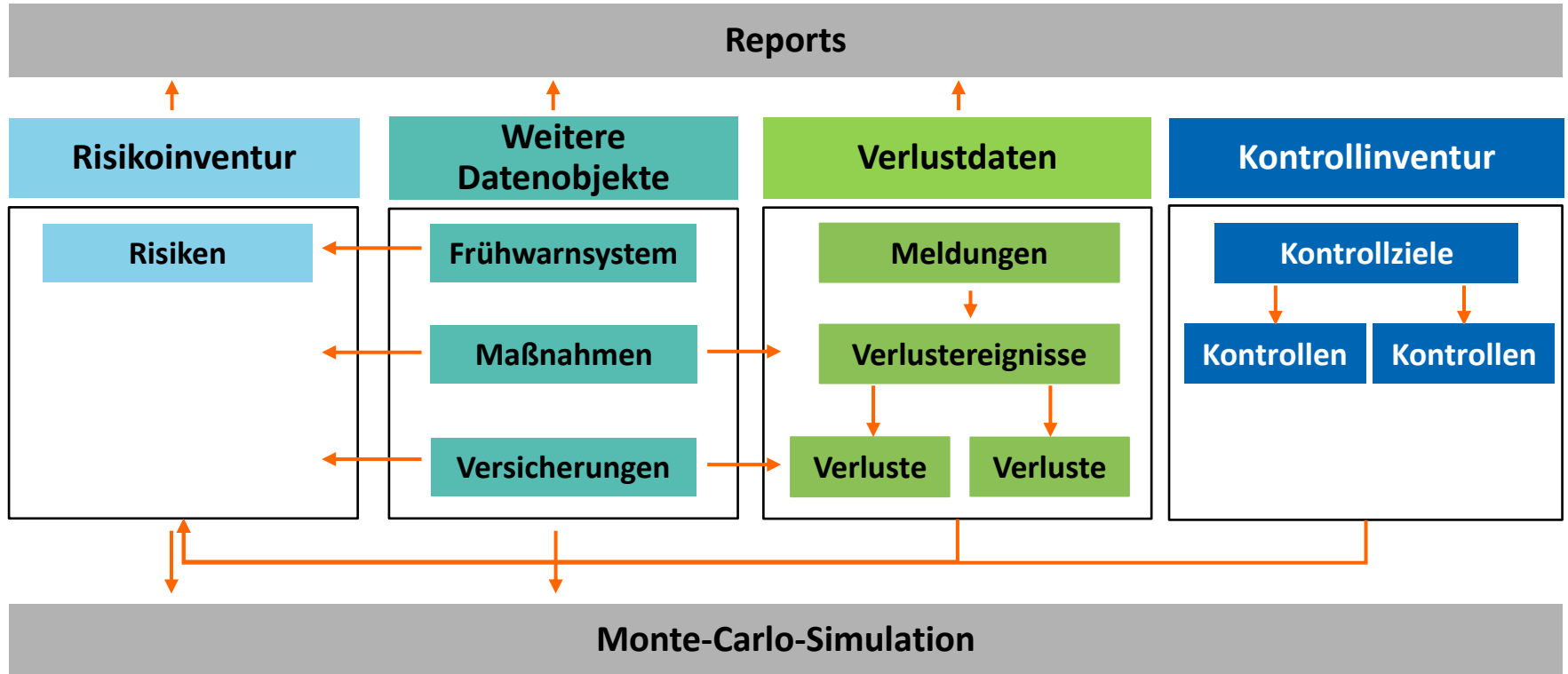
* Exemplarische Aufzählung der Prozesse

Die IKS-Dokumentation als Teil der drei Verteidigungslinien Ihres Instituts



Erweiterte Struktur von ORM

Eingliederung des IKS-Moduls in die bisherige Struktur



Parametrisierung	<ul style="list-style-type: none">✓ Einmalige Definition der Kataloge, E-Mail-Regeln und des Statuskonzepts✓ Zuordnung der Rechte, Filter und Zuständigkeiten
Kontrollinventur	<ul style="list-style-type: none">✓ Anlage einer Kontrollinventur✓ Parametrisierung mit Hilfe der Neuanlageoptionen
Kontrollziele	<ul style="list-style-type: none">✓ Anlage der Kontrollziele✓ Verknüpfung mit den angelegten Katalogen
Kontrollen	<ul style="list-style-type: none">✓ Anlage der Kontrollen und Verknüpfung mit einem Kontrollziel, Katalogen und Risiken✓ Regelmäßige Prüfung der Kontrollen auf Angemessenheit und Wirksamkeit
Auswertungen	<ul style="list-style-type: none">✓ Auswertung der Kontrollen und Kontrollziele mittels personalisierbarer Tabellenkonfigurationen✓ Kontrollvergleich über mehrere Kontrollinventuren

IKS-Prozess

Softwareunterstützung in ORM



Zusatzmodule inkl. IKS-Modul können Sie kostenpflichtig erwerben

Bitte wenden Sie sich je nach Ausgangslage an folgende Ansprechpartner

parcIT GmbH

- ✓ Nutzer von agree21 und VR-Control mit einer ORM-Lizenz bei Interesse an einer Nutzung von Zusatzmodulen und IKS
- ✓ ORM-Eigenanwender oder Interessenten für eine Lizenzierung über die parcIT (keine Nutzung von agree21 und VR-Control) bei Interesse an einer Lizenzierung von ORM und Zusatzmodulen inkl. IKS

Atruvia AG

Nutzer von agree21 und VR-Control **ohne eine ORM-Lizenz**

- ✓ Volks- oder Raiffeisenbank, PSD Banken und Sparda-Banken der Atruvia AG
- ✓ Privatbank oder Spezialbank

→ Bei Interesse an einer Lizenzierung von ORM im Leistungsumfang der Atruvia AG

Sopra Financial Technology GmbH

- ✓ Nutzer von okular bei der Sopra Financial Technology GmbH mit einer ORM-Lizenz bei Interesse an einer Nutzung von Zusatzmodulen und IKS

Ihre Ansprechpartner

Alexander Tiebing
Methoden- und Produktmanagement
Alexander.Tiebing@parclT.de
+49 221 - 5 84 75 - 3249

Thomas Niessen
Beratung und Vertrieb
Thomas.Niessen@parclT.de
+49 221 - 5 84 75 - 2023



Vielen Dank für Ihre Aufmerksamkeit.

