

Kontrahentenrisiko

Numerische Verfahren zur Berechnung von Credit und Debt Valuation Adjustments

Programm / Ausschreibung	BASIS, Basisprogramm, Budgetjahr 2016	Status	abgeschlossen
Projektstart	01.09.2016	Projektende	30.09.2017
Zeitraum	2016 - 2017	Projektlaufzeit	13 Monate
Keywords			

Projektbeschreibung

Ziel des vorliegenden Projektes ist die Entwicklung eines Softwaresystems, das es auch kleineren und mittleren Finanzinstitutionen (Banken um die drei Milliarden. Bilanzsumme bzw. veranlagtem Vermögen von über einer Milliarde, Versicherungen) sowie der Industrie erlaubt, verschiedene Komponenten des Kontrahentenrisikos zu berechnen. Die Anforderungen der (Finanzmarkt-)Aufsicht zur Berücksichtigung des Kontrahentenrisikos haben sich in jüngerer Vergangenheit stark erhöht. Die quantifizierte Höhe des Kontrahentenrisikos wirkt sich auch auf das benötigte Eigenkapital der Institution aus (CVA Aufschlag für Over The Counter (OTC) gehandelte derivative Finanzprodukte). Die Ergebnisse der Berechnung des Kontrahentenrisikos müssen dann, unter Einbeziehung eben dieser regulatorischen Gesichtspunkte so aufbereitet werden, dass diese in verschiedenen organisatorischen Einheiten (etwa: Risikomanagement Handel von Finanzinstrumenten) verwendet werden können.

Projektpartner

- MathConsult GmbH.