

FINAPU - OP Risk 2

FinAPU - Steuerung operationeller Risiken

Programm / Ausschreibung	BASIS, Basisprogramm, Budgetjahr 2020	Status	abgeschlossen
Projektstart	01.03.2020	Projektende	28.02.2021
Zeitraum	2020 - 2021	Projeklaufzeit	12 Monate
Keywords			

Projektbeschreibung

Aufbauend auf die bisherigen Erkenntnisse aus der Forschungstätigkeit hat sich das Innovationspotential des Projekt-Teams gezeigt. Im neuen Forschungsprojekt sollen die bisherigen „Lessons learned“ angewandt werden und neue Themengebiete erforscht werden. Das Forschungsprojekt unterteilt sich in zwei Bereiche, die wiederum in einen fachlich-mathematischen und in einen technischen Teil untergliedert sind.

Erforschung Operationeller und prozessualer Risiken und deren Lösungsansätze:

Im Rahmen der CRD IV Richtlinie (Messung, Berechnung und Unterlegung des operationellen Risikos mit Eigenmitteln) und den Entwürfen der Europäischen Bankenaufsicht EBA (<https://www.eba.europa.eu/regulation-and-policy/operational-risk>) rückt das Thema OP-Risk immer mehr in den Vordergrund. Die Anwendungen von FinAPU und die Expertengespräche zeigen, dass das OP-Risk Thema immer mehr an Bedeutung gewinnt und innovative und Lösungswege gesucht werden.

Grundlagenforschung im BIG Data – Bereich und (Weiter-) Entwicklung von Risikomodellen

Die Schwerpunkte in diesem Themenbereich liegen somit bei:

Backtesting der bereits entwickelten Risikomodelle (AuDiT Country Rating, AuDiT Corporate Rating)

Modellentwicklung und Kalibrierung des im zweiten Forschungsjahr begonnenen AuDiT Insurance Rating und AuDiT

Corporate Early Warning sowie die Umsetzung in FinAPU

Untersuchung der Auswirkung von volkswirtschaftlichen Entwicklungen auf die Ausfallswahrscheinlichkeit von Unternehmen

Projektpartner

- FinAPU Solutions GmbH