

## Vergleich von verschiedenen Methoden für die Berechnung von Credit Valuation Adjustments

<b>Kunde / Branche</b>	<b>Inhouse</b>
<b>Projektbeschreibung</b>	<p><b>Vergleich der vereinfachten, aufsichtsrechtlichen Methoden (CEM, SA-CCR) mit einem fortgeschrittenen Ansatzes für die Berechnung des EaD für Credit Valuation Adjustments</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Prototypenhafte Implementierung der Current Exposure Methode (CEM)</li> <li>• Prototypenhafte Implementierung des SA-CCR</li> <li>• Prototypenhafte Implementierung eines fortgeschrittenen „best practice“- Ansatzes zur Berechnung des EaD für CVA (geeignet für die Berechnung von IFRS Fair Value Adjustments)</li> <li>• Vergleich der Expected Loss CVA-Barwertkorrekturen aus den drei implementierten Ansätzen und Analyse der Resultate</li> </ul>
<b>Leistung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Konzeption und Umsetzung der drei Ansätze CEM, SA-CCR und fortgeschrittener „best practice“-Ansatz zur Berechnung des EaD</li> <li>• Berechnung der jeweiligen Expected Loss CVA-Barwertkorrekturen aufbauend auf dem EaD</li> <li>• Testrechnungen für beispielhafte Derivate zwecks Vergleich der resultierenden Effekte auf PuL bzw Bilanz</li> <li>• Publikation der Ergebnisse</li> </ul>
<b>Technologie</b>	Excel/VBA
<b>Fachlicher Input</b>	Fachwissen Risikomanagement, CVA und IFRS Bilanzierung sowie Kenntnisse der aufsichtsrechtlichen Anforderungen
<b>Umfang</b>	Ca 60 Personentage
<b>Tags</b>	CVA, CEM, SA-CCR, fortgeschrittener CVA Ansatz, Fair Value Adjustments