

Geno Bank Consult GmbH • Postfach 7849 • 48042 Münster

An die
für den **Bereich Unternehmenssteuerung**
verantwortlichen Vorstände

*Bitte auch an die für die Risikoinventur
zuständigen Mitarbeiter/-innen weiterleiten!*

Mecklenbecker Straße 235-239
48163 Münster

Ansprechpartner:

Nicola Winkler

Mobil: 0151 14827832

E-Mail: nicola.winkler@genobc.de

http:// www.genobc.de

USt-IdNr DE 126037637

Münster, 05.10.2017

Konsistente und nachvollziehbare Durchführung der aufsichtsrechtlich geforderten Risikoinventur – Update 2018

Sehr geehrte Damen und Herren,

neue aufsichtsrechtliche Anforderungen an das Risikomanagement und das damit in Verbindung stehende Meldewesen machen es erforderlich, die Methodik zur Identifizierung und Bewertung der bankgeschäftlichen Risiken regelmäßig zur überprüfen und ggf. anzupassen. Um Sie hierbei bestmöglich zu unterstützen, bieten wir Ihnen regelmäßig ein Update unserer in der Praxis bewährten MS Excel-Datei zur strukturierten Durchführung und Dokumentation einer Risikoinventur nebst Musterarbeitsanweisung an.

Folgende Entwicklungen haben wir zum Anlass genommen, unser zuletzt im Juli 2017 angepasstes Leistungspaket „Risikoinventur“ erneut zu aktualisieren:

- Ab dem 01.01.2018 ist die mit der CRR eingeführte Liquiditätsdeckungsquote LCR zu 100 % zu erfüllen. Zeitgleich entfällt die Meldepflicht für die Liquiditätskennzahl aus der bisherigen Liquiditätsverordnung (LiqV). Hierdurch ergeben sich u.a. Auswirkungen auf die **Bewertung des Liquiditätsrisikos**.
- Durch die Geschäftsmodellprüfung im Kontext der europäischen Bankenaufsicht rückt die **Beurteilung des strategischen Risikos** zunehmend in den Fokus aufsichtsrechtlicher Prüfungshandlungen.
- In die Angemessenheitsnachweise der Union Investment wurden neue Risikokennziffern zur **Quantifizierung der Risiken aus Fonds** aufgenommen.

Seite 2 von 3

zum Schreiben der Geno Bank Consult GmbH vom 05.10.2017

Um Ihnen den Umgang mit der MS Excel-Datei zu erleichtern, haben wir neben den inhaltlichen Anpassungen auch verschiedene funktionale Erweiterungen vorgenommen.

- Einbau von Formeln zur automatisierten Weiterverarbeitung von eingegebenen Daten und Berechnungsergebnissen
- Kennzeichnung von Eingabefeldern
- Schutz von Formeln und Tabellenblättern vor unerlaubten Änderungen

Zudem wurde die MS Excel-Datei um einen Prozess zur Ableitung und Dokumentation des Umfangs der nach AT 4.1 Tz. 8 MaRisk erforderlichen jährlichen Überprüfung der Angemessenheit der Methoden und Verfahren zur Beurteilung der Risikotragfähigkeit sowie um einen Prozess zur Überprüfung der Angemessenheit der abgeleiteten Wesentlichkeitsgrenze ergänzt.

Für die Bestellung des Updates 2018 (Version 6.3.0) verwenden Sie bitte das beigefügte Bestellformular.

Gerne unterstützen wir Sie auch vor Ort bei der Durchführung und Dokumentation einer Risikoinventur.

Für Rückfragen steht Ihnen Frau Nicola Winkler (Tel.: 0151 14827832 | E-Mail: nicola.winkler@genobc.de) gerne zur Verfügung.

Die Auslieferung des Update-Paketes erfolgt Anfang November 2017.

Freundliche Grüße

Geno Bank Consult GmbH



Martin Finke

Antwort

FAX: 0251 / 7186 1199

Geno Bank Consult GmbH
Mecklenbecker Straße 235-239
48163 Münster

Absender:

Institut:
Ansprechpartner:
Funktion:
Tel.-Nr.:
E-Mail:

oder per E-Mail an: nicola.winkler@genobc.de

Risikoinventur

- Wir sind bereits Nutzer des Leistungspaketes „Risikoinventur“ [Version 6.2.0, Stand: 30.06.2017] und bestellen das **Update 2018** zu einem Gesamtpreis von 175,00 € zzgl. Umsatzsteuer.
- Wir bestellen das Paket „Risikoinventur“, bestehend aus einer Musterarbeitsanweisung und einer MS Excel-Datei zu einem Gesamtpreis von 750,00 € zzgl. Umsatzsteuer.
- Wir sind an einem individuellen **Angebot zur Unterstützung bei der Durchführung einer Risikoinventur** interessiert.
- Wir sind an einem **Workshop „Risikoinventur“** interessiert.
- Wir wünschen weitere Informationen zu den Unterstützungsangeboten der Geno Bank Consult und bitten um Kontaktaufnahme.

.....
Ort, Datum

.....
Unterschrift