



Geno **Bank Consult**

Leitfaden

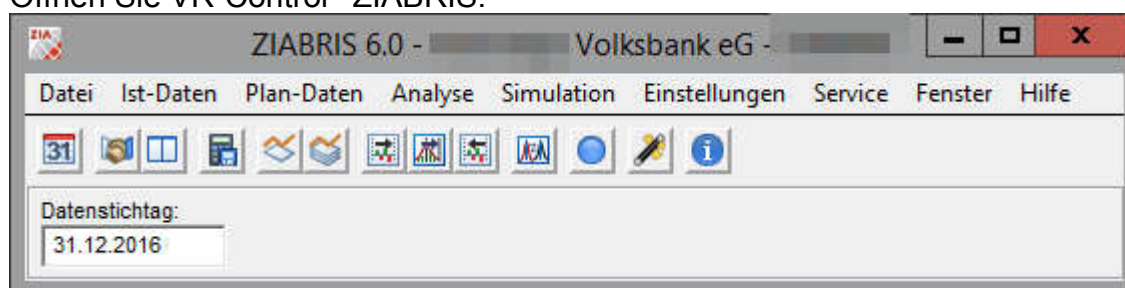
Erstellung von Geschäftslisten
mit VR-Control[®] KPM-EG 6.0

Geno Bank Consult
Juli 2017

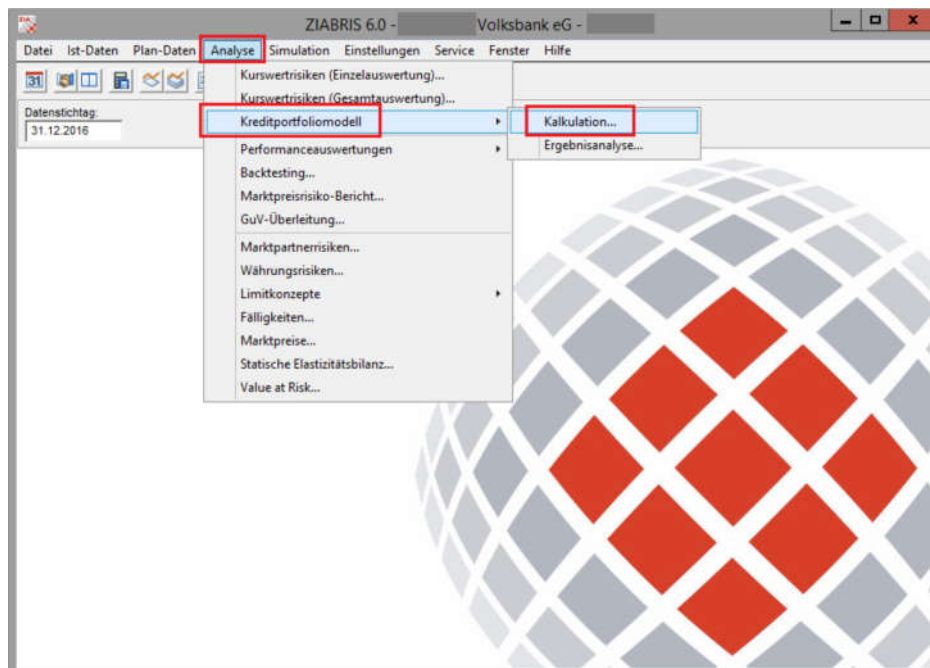
Voraussetzung für die Teilnahme an der Geno Bank Consult Studie zur Kreditportfolioanalyse Eigengeschäfte ist die vollständige Parametrisierung in VR-Control® KPM-EG!

Die Studie basiert auf einer barwertigen und einer periodischen Geschäftsliste aus VR-Control® KPM-EG. Nachfolgend wird die Erzeugung dieser Geschäftslisten mit standardisierten Einstellungen beschrieben. Die standardisierten Einstellungen sind notwendig, um die Vergleichbarkeit der Ergebnisse zu gewährleisten.

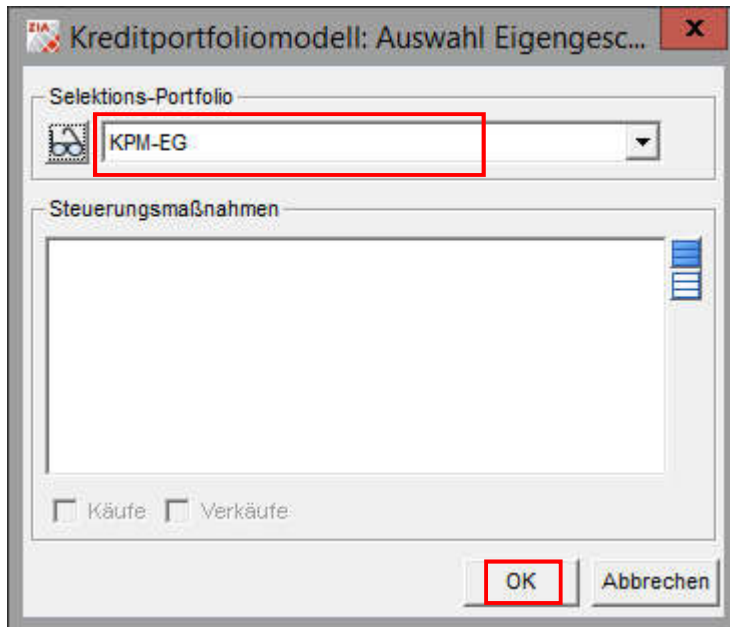
Öffnen Sie VR-Control® ZIABRIS.



Stellen Sie das Auswertungsdatum auf den „**30.06.2017**“ und klicken Sie anschließend unter „**Analyse / Kreditportfoliomodell**“ auf „**Kalkulation**“:



Es öffnet sich folgende Maske: Wählen Sie aus dem Selektionsportfolio das Selektionsportfolio aus, welches den für KPM EG relevanten Bestand enthält und klicken Sie auf „**OK**“.



Es öffnet sich das nachfolgende Fenster, in dem Sie bitte die **Einstellungen identisch mit denen in den beiden nachfolgenden Abbildungen übernehmen!** Wir benötigen sowohl die **barwertige als auch die periodische Geschäftsliste!**

Für die Ratingstruktur wählen Sie bitte diejenige aus, unter der die aktuellen Standardparameter der parclT für 12 Monate importiert wurden.

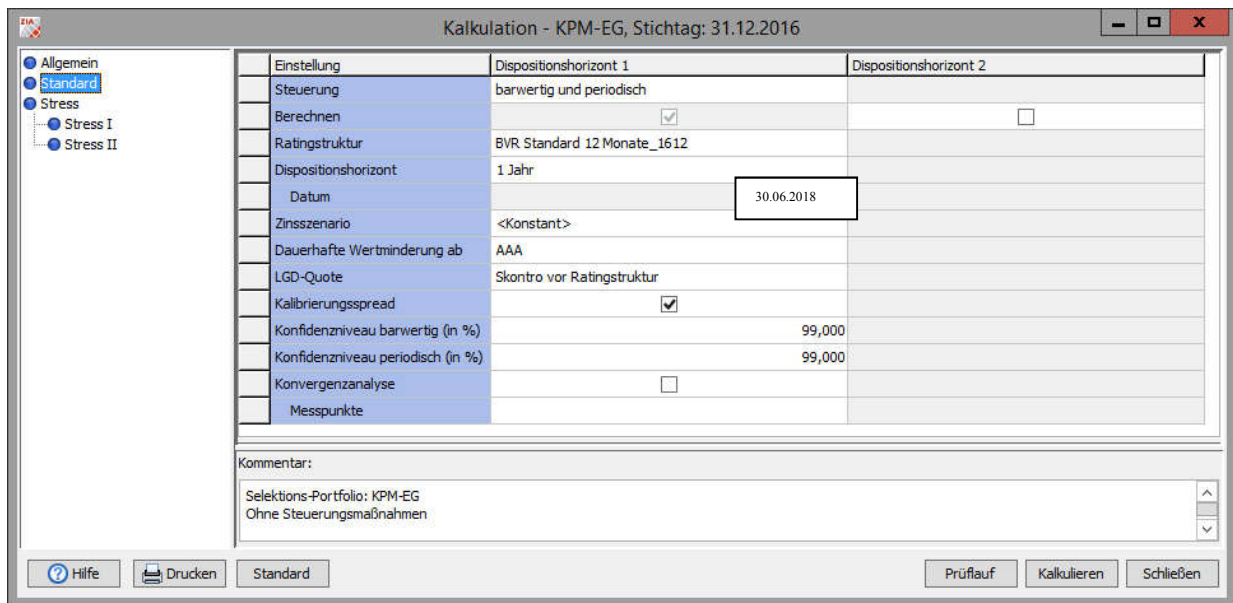
Kalkulation - KPM-EG, Stichtag: 30.06.2017

Einstellung	Wert
Ergebnisname	Ergebnis Studie
Risikobetrachtung	Migrations- und Spreadrisiko
Risikolose Zinsstruktur	Swaps
Anzahl Simulationsschritte	5.000.000
Anzahl Kalkulationsläufe	2
Zwischenergebnisse exportieren	<input type="checkbox"/>
Pfad für Zwischenergebnisexport	
Ergebnisse bereitstellen für	
VR-Controlling Report BVR	<input type="checkbox"/>
Data Warehouse	<input type="checkbox"/>

Einstellung	Kalkulation 1	Kalkulation 2
Kalkulationsart	Standard, DH1	Standard, DH1
Steuerung	barwertig	periodisch
Ratingstruktur	BVR Standard 12 Monate_1612	BVR Standard 12 Monate_1612
Dispositionshorizont	30.06.2018	30.06.2018
Zinsszenario		<Konstant>
Dauerhafte Wertminderung ab	AAA	AAA
LGD-Quote	Skontro vor Ratingstruktur	Skontro vor Ratingstruktur
Kalibrierungsspread	Ja	Ja
Konfidenzniveau barwertig (in %)	99,000	
Konfidenzniveau periodisch (in %)		99,000
Konvergenzanalyse	Nein	Nein
Messpunkte		
Simulationsmodell		
Ratingverschlechterung		
Korrelationsänderung (für Migrationsrisiken)		
Korrelationsänderung (für Spreadrisiken)		
Eingabemodus		
Shift CS-Verteilung-pauschal		
Shift CS-Verteilung-individuell		
Standard		
Gedekte Anleihen		
Staaten		
Unternehmen		
Sonstige		
Finanzgruppe gedeckt		
Finanzgruppe ungedeckt		
Finanzgruppe sonstige		
Spread-Shift-Modell		

Kommentar:
Selektions-Portfolio: KPM-EG
Ohne Steuerungsmaßnahmen

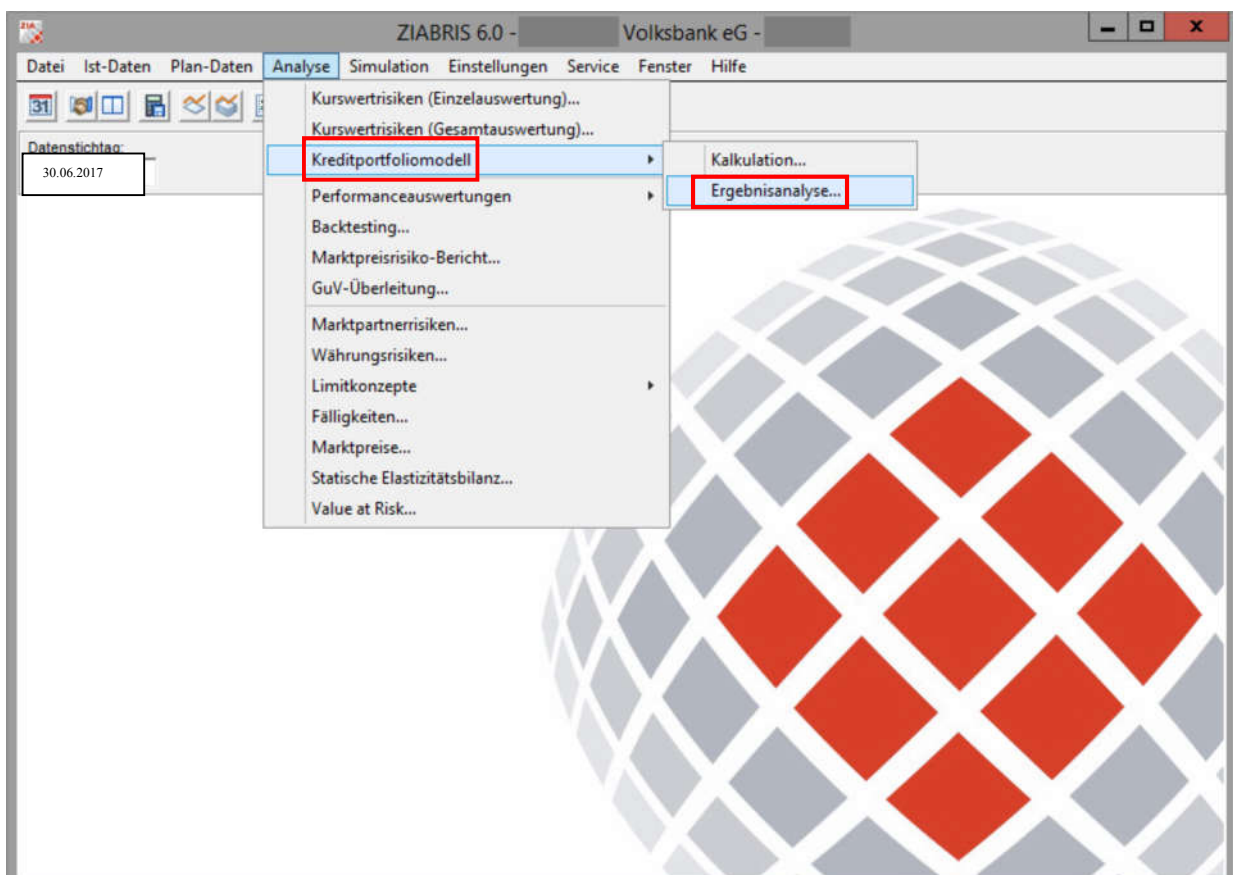
Hilfe Drucken Standard Prüfauf Kalkulieren Schließen



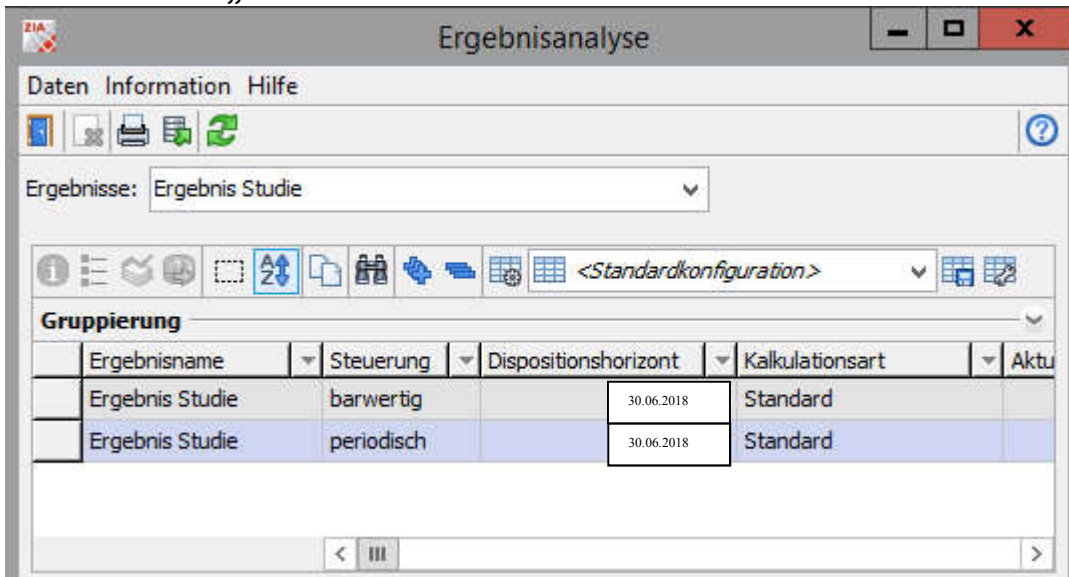
Einstellung	Dispositionszeitraum 1	Dispositionszeitraum 2
Steuerung	barwertig und periodisch	
Berechnen	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Ratingstruktur	BVR Standard 12 Monate_1612	
Dispositionszeitraum	1 Jahr	
Datum	30.06.2018	
Zinsszenario	<Konstant>	
Dauerhafte Wertminderung ab	AAA	
LGD-Quote	Skontro vor Ratingstruktur	
Kalibrierungsspread	<input checked="" type="checkbox"/>	
Konfidenzniveau barwertig (in %)		99,000
Konfidenzniveau periodisch (in %)		99,000
Konvergenzanalyse	<input type="checkbox"/>	
Messpunkte		

Kommentar:
Selektions-Portfolio: KPM-EG
Ohne Steuerungsmaßnahmen

Danach starten Sie über den Button **„Kalkulieren“** den Kalkulationslauf. Beide Kalkulationen werden durchgeführt. Nach erfolgter Kalkulation öffnet sich automatisch das Ergebnisfenster, welches Sie andernfalls auch über „Analyse > Kreditportfoliomodell > Ergebnisanalyse“ erreichen können.



Rufen Sie über **„Information / Geschäftsliste“** die Geschäftslisten auf:

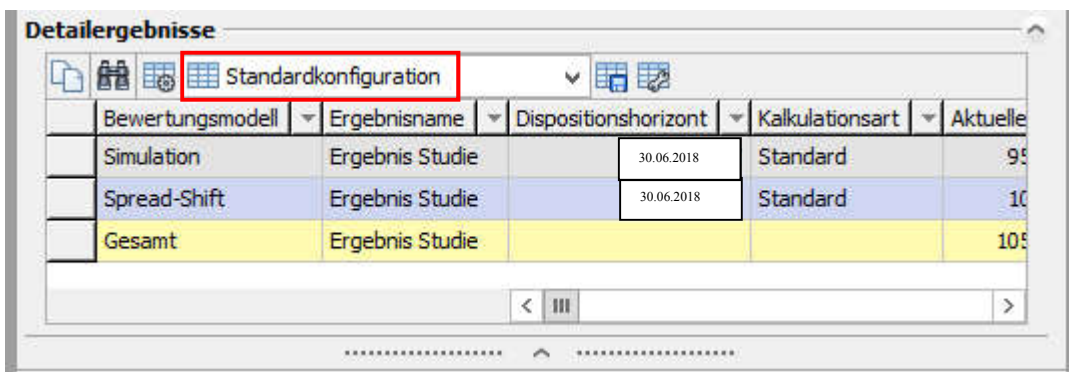


The screenshot shows the 'Ergebnisanalyse' window with a menu bar (Daten, Information, Hilfe) and a toolbar. Below the toolbar, there is a dropdown menu for 'Ergebnisse' set to 'Ergebnis Studie'. A second toolbar contains various icons and a dropdown menu for '<Standardkonfiguration>'. Below this is a 'Gruppierung' section with a table of results.

Ergebnisname	Steuerung	Dispositionshorizont	Kalkulationsart	Aktu
Ergebnis Studie	barwertig	30.06.2018	Standard	
Ergebnis Studie	periodisch	30.06.2018	Standard	

Markieren Sie zunächst die Ergebniszeile der periodischen Auswertung.

Wählen Sie für diese Analyse die „Standardkonfiguration“ der Detailergebnisse aus, um alle relevanten Informationen in der Geschäftsliste auszuweisen:



The screenshot shows the 'Detailergebnisse' window with a toolbar and a table of results. The 'Standardkonfiguration' option in the toolbar is highlighted with a red box. The table below shows detailed results for 'Ergebnis Studie'.

Bewertungsmodell	Ergebnisname	Dispositionshorizont	Kalkulationsart	Aktuelle
Simulation	Ergebnis Studie	30.06.2018	Standard	95
Spread-Shift	Ergebnis Studie	30.06.2018	Standard	10
Gesamt	Ergebnis Studie			105

Untersuchen Sie bitte die Geschäftsliste im Hinblick auf Vollständigkeit des Eigenanlagevolumens. Daneben achten Sie bitte darauf, dass alle Geschäfte mit „OK“ in der Fehleranalyse ausgewiesen werden. Sollte die Geschäftsliste aus Ihrer Sicht in Ordnung sein, exportieren Sie sie bitte über „Auswertung > Export“ mit dem Namen **„per_KPMEG_JJ(Jahr)MM(Monat)_GAD-NR.xls“ (oder csv) (lieber xls)**

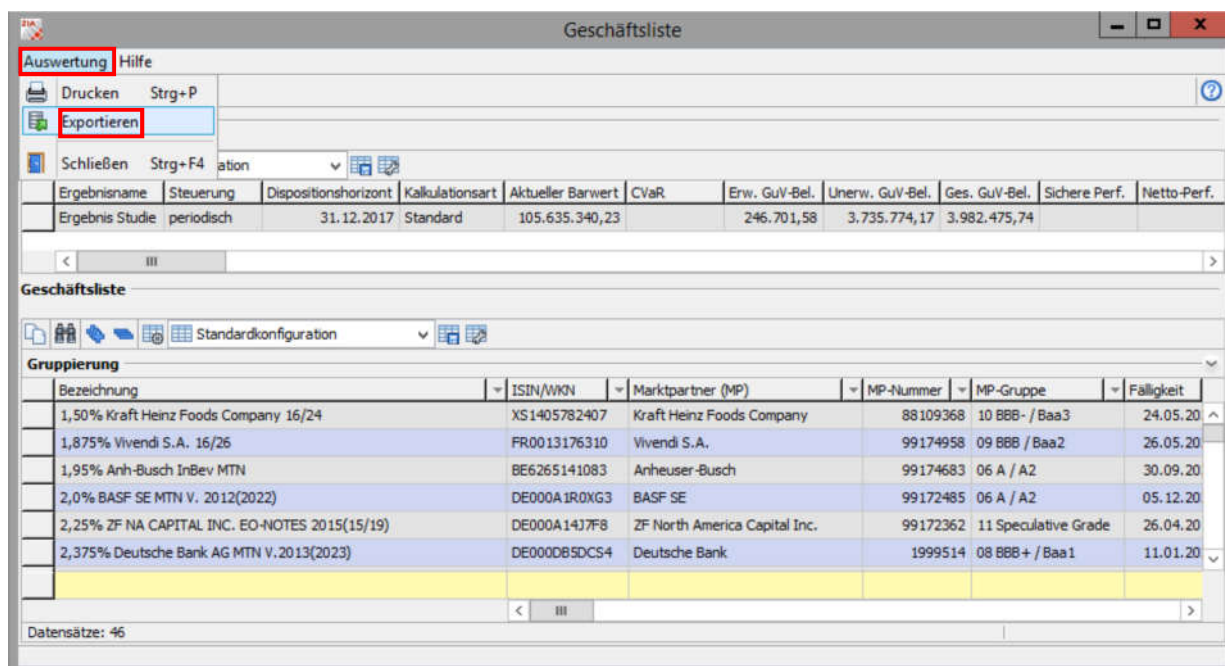
Dabei verwenden Sie bitte das Jahr und den Auswertungsmonat sowie Ihre tatsächliche GAD-Nummer (Beispiel: per_KPMEG_1706_0815.xls).

Im Anschluss an die Erstellung der **„periodischen“** Geschäftsliste erstellen Sie bitte den Export für die **barwertige Kalkulation**.

Hierzu gehen Sie wieder zurück auf die Ergebnisübersicht, wählen aber mit der Maus die barwertige Steuerungsart aus:

Die so erstellte Geschäftsliste exportieren Sie bitte über „**Auswertung** > **Export**“ mit dem Namen

„**bar_KPMEG_JJ(Jahr)MM(Monat)_GAD-NR.xls**“ (oder csv)(lieber xls)



Ergebnisname	Steuerung	Dispositionshorizont	Kalkulationsart	Aktueller Barwert	CVaR	Erw. GuV-Bel.	Unerw. GuV-Bel.	Ges. GuV-Bel.	Sichere Perf.	Netto-Perf.
Ergebnis Studie	periodisch	31.12.2017	Standard	105.635.340,23		246.701,58	3.735.774,17	3.982.475,74		

Bezeichnung	ISIN/WKN	Marktpartner (MP)	MP-Nummer	MP-Gruppe	Fälligkeit
1,50% Kraft Heinz Foods Company 16/24	XS1405782407	Kraft Heinz Foods Company	88109368	10 BBB- / Baa3	24.05.20
1,875% Vivendi S.A. 16/26	FR0013176310	Vivendi S.A.	99174958	09 BBB / Baa2	26.05.20
1,95% Anh-Busch InBev MTN	BE6265141083	Anheuser-Busch	99174683	06 A / A2	30.09.20
2,0% BASF SE MTN V. 2012(2022)	DE000A1R0XG3	BASF SE	99172485	06 A / A2	05.12.20
2,25% ZF NA CAPITAL INC. EO-NOTES 2015(15/19)	DE000A1437F8	ZF North America Capital Inc.	99172362	11 Speculative Grade	26.04.20
2,375% Deutsche Bank AG MTN V.2013(2023)	DE000DB5DCS4	Deutsche Bank	1999514	08 BBB+ / Baa1	11.01.20

Die fertigen Dateien senden Sie bitte bis zum **11. August 2017** an martin.heineke@genobc.de.

Bei Fragen oder Problemen wenden Sie sich an:

Martin Heineke (Martin.Heineke@GenoBC.de oder 0160 / 82 40 426) oder

Dr. Carsten Breitmeyer (Carsten.Breitmeyer@GenoBC.de oder 0151/14 82 78 72)

bzw.

Nicola Winkler (Nicola.Winkler@GenoBC.de oder 0151/14 82 78 32).