

## Solvabilitätskennzahl-Reporting Risikogewichtsermittlung gemäß Solvabilitätsverordnung (SolvV).



## Ermöglicht den Kundenbetreuern, die aufsichtsrechtlichen Anforderungen ihrer institutionellen Investoren bei der Ermittlung der Risikogewichte gemäß SolvV zu erfüllen.

Aus der „Verordnung über die angemessene Eigenmittelausstattung von Instituten, Institutsgruppen und Finanzholdinggruppen (Solvabilitätsverordnung–SolvV)“ ergibt sich eine Reihe aufsichtsrechtlicher Anforderungen. Investoren sind dazu verpflichtet, die Risikogewichte ihrer Kapitalanlagen in regelmäßigen Abständen an die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) zu melden. Die Ermittlung dieser Risikogewichte kann an Dritte ausgelagert werden.

IDS GmbH – Analysis and Reporting Services (IDS) bietet die Berechnung dieser aufsichtsrechtlich geforderten Risikogewichtung an, insbesondere die Ermittlung der Solvabilitätskennzahl und die Aufschlüsselung der Fremdwährungsposition.

Zu den Berechnungsmethoden gehören der „Kreditrisiko-Standardansatz“ (KSA) und der auf „internen Ratings basierende Ansatz“ (IRBA). Bei Letzterem kommen die vereinfachte Durchschau oder die T038-Auslegung der BaFin zur Anwendung.

Mit dem von IDS angebotenen Solvabilitätskennzahl-Reporting profitieren Fondsverwalter von durch Wirtschaftsprüfer testierten Berechnungsmethoden.

IDS bietet vordefinierte Berichte und fertigt neue Berichte entsprechend den Wünschen des Kunden an.

### **Eigenschaften**

- Anwendung der marktgängigen Berechnungsansätze KSA und IRBA
- Auf die Bedürfnisse der Anleger zugeschnittenes Reporting
- Umfangreiche Qualitätskontrollen
- Unterstützung bei Rückfragen aufgrund langjähriger Erfahrung
- Aufbau und Bedienung von speziellen Schnittstellen zum Kunden

## Nutzen

- Geringer Implementierungsaufwand auf Kundenseite
- Geringes Prozessrisiko
- Option zur Verwendung von Marktdaten (z.B. Wertpapierratings)
- Geringer Wartungsaufwand
- Umfangreiche Reporting- und Analysedienstleistungen
- Zugang zu Experten-Know-how in der Anwendung und Interpretation der Berechnungen

## Funktionalitäten

**Verwendung von marktüblichen Berechnungsansätzen**  
IDS verwendet die gängigen Berechnungsansätze „Kreditrisiko-Standardansatz“ und den „auf internen Ratings basierenden Ansatz“ in der Version der vereinfachten Durchschau sowie der Auslegungsentscheidung T038 der BaFin.

**Umfangreiche Reporting- und Analysedienstleistungen**  
Aufgrund der jahrelangen Erfahrungen im Bereich der Solvabilitätskennzahl-Berechnung bietet IDS ein kundenspezifisches Reporting sowie eine fundierte Interpretation der berechneten Ergebnisse an.

### Beratungsleistung

Die Beratung des Kunden im Rahmen der Solvabilitätskennzahl-Berechnung gehört zum Umfang der angebotenen Dienstleistungen.



## **Kontakt**

### **Stefan Zinn**

Produktmanager

Head of Retail Fund Reporting Services

Tel. +49.69.2443 14475

stefan.zinn@idsffm.com

IDS GmbH – Analysis and Reporting Services  
Königinstraße 28, 80802 München, Deutschland

Weitere Informationen über IDS und  
alle unsere Produkte finden Sie auf  
[www.InvestmentDataServices.com](http://www.InvestmentDataServices.com)

© IDS GmbH – Analysis and Reporting Services  
Alle Rechte vorbehalten. Alle Angaben ohne Gewähr.  
Mai 2013