

Beratung für Risikomethoden, -controlling und -management - Los 2: „Marktpreis- und Liquiditätsrisiko“ und „Quantitative Analyse im Handelsumfeld“

I.D.: 89571117

Data publicarii	20.11.23	Coduri CPV	79410000
-----------------	----------	------------	----------

Descriere: Die KfW befindet sich in einem umfangreichen und anhaltenden Modernisierungsprozess im Rahmen der strategischen Ausrichtung nach KfWplus. Nach außen soll eine stärkere Fokussierung des Förderangebots auf gesellschaftlich relevante Entwicklungen und Nachhaltigkeitskriterien sowie eine stärkere Orientierung an den Erwartungen und Bedürfnissen der Kunden erreicht werden. Nach innen setzt die KfW die Weiterentwicklung ihrer Prozesse und Organisation fort. Hierzu zählen die Optimierung von Geschäftsprozessen unter Nutzung der Chancen weitergehender Digitalisierung, die Erneuerung und Vereinheitlichung der IT-Systeme, die Anwendung der verschärften Regulierungsvorschriften für Banken (u.a. CRR, MaRisk, EBA-Leitlinien) sowie die auf die besondere Rolle der KfW bezogene Anwendung des Kreditwesengesetzes (KWG). Zudem wurde der Bereich Risikocontrolling einer Reorganisation unterzogen, die langfristig auf diese Ziele einzahlen soll. Das Risikocontrolling der KfW strukturiert sich nunmehr in die zentralen Disziplinen Konzernrisiko, Kredit- und Beteiligungsrisiko sowie Markt- und Liquiditätsrisiko, die von den interdisziplinären Verantwortlichkeiten Daten, Systeme und Projekte sowie Modellrisikomanagement unterstützt werden. Im Rahmen dieser Modernisierungsprozesse werden auch die Methoden, Prozesse und IT des Risikocontrollings überarbeitet und kontinuierlich verbessert mit dem Ziel, aktuelle und künftige regulatorische Anforderungen adäquat zu erfüllen und die interne Risikosteuerung im KfW Konzern dauerhaft angemessen auszugestalten. Die KfW benötigt hierbei fachliche Unterstützung bei der Entwicklung von Lösungen in den Bereichen Ratingsysteme und Risikomethodik sowie übergreifender Risikokennzahlen, Risikotragfähigkeitsrechnung, Stresstesting und Risikoreporting und auch im Themengebiet Quantitative Analyse im Handelsumfeld sowie der fachlichen Prozesse im Umfeld Markt- und Liquiditätsrisikosteuerung. Für die KfW bzw. deren Töchter relevante aufsichtsrechtliche Anforderungen sind dabei ebenso zu berücksichtigen wie deren effektive und aufwandssensitive Umsetzung. Die fachliche Unterstützung erstreckt sich auch auf die Umsetzung der Methoden in Risikomess-, Steuerungs- und Reportingsystemen. Die allgemeinen wie auch spezifischen Aufgabenstellungen unterteilen sich in die vier Kategorien fachliche, methodische, prozessuale und technische Lösungen, die in den für die KfW relevanten Themenschwerpunkte „Risikomethodik“, „Quantitative Analyse im Handelsumfeld“, „Marktpreis- und Liquiditätsrisiko“ sowie „Operationelle Risiken und Reputationsrisiken“ zu erarbeiten sind. Dementsprechend ergeben sich je nach spezifischem Auftrag unterschiedliche Aufgabenschwerpunkte und Anforderungen an die zu erbringenden Leistungen. Diese werden zur Ermöglichung einer gebündelten Ausschreibung in zwei disjunkte Lose aufgeteilt. Das Los 2 umfasst die Themenfelder „Marktpreis- und Liquiditätsrisiko“ und „Quantitative Analyse im Handelsumfeld“. Der Auftragnehmer hat insbesondere Projekt-, Weiterentwicklungs- und Unterstützungsleistungen in den nachstehend beschriebenen fachlichen und technischen Umfeldern zu erbringen. Die Aufgabenstellungen können sowohl in der konzeptionellen Beratung als auch in der Unterstützung bei regelmäßigen Aktivitäten liegen. Die einzelvertraglichen Leistungen können Tätigkeiten mit kleineren Aufgabenpaketen wie auch projekthafte Tätigkeiten in unterschiedlich großen Teams umfassen. Die KfW schätzt das maximale Auftragsvolumen dieser Rahmenvereinbarung im Los 2 auf 9289 Tage während der Laufzeit des Vertrages.