



Anhang 2: Prüfungsgebiete

Prüfungsgebiete als strukturelle Grundlage für die Wissensdatenbank, gruppiert zu den Begriffen der Richtlinie zum Schweizer Solvenztest.

1. Portfolioanalyse	2. Methodik + Parameter	3. Qualitative + organisatorische Anforderungen, besondere Ereignisse	4. Daten
<p>1.1 Geschäftsstrategie</p> <p>1.2 Zum Prüfungszeitpunkt vorhandenes Geschäft / vorhandene Positionen</p>	<p>2.1 Vollständigkeit / Adäquanz der Risikofaktoren (inkl. Angemessenheit der Stripping- und Mapping-Verfahren)</p> <p>2.2 Angemessenheit und formale Korrektheit des funktionalen Zusammenhangs zwischen Risikofaktoren und RTK</p> <p>2.3 Angemessenheit der stochastischen Modellierung</p> <p>2.4 Angemessenheit der verwendeten Modellparameter</p> <p>2.5 Validierung des Risikomodells</p> <p>2.6 Szenarien</p>	<p>3.1 Erstellung der marktnahen Bilanz und des RTK</p> <p>3.2 ZK-Ermittlung</p> <p>3.3 Use Test (Berichtswesen, Risikobegrenzungssystem)</p> <p>3.4 Regelmässige Überprüfung der Angemessenheit des Modells</p> <p>3.5 Organisation des Risikomanagements in Bezug auf den SST</p> <p>3.6 Beobachtung und Meldung hoher Verluste</p> <p>3.7 Beobachtung und Meldung erheblicher Änderungen der Risikosituation</p>	<p>4.1 Geschäfts- + Positionserfassung</p> <p>4.2 Qualität der Daten zur Bewertung + Risikoeermittlung</p> <p>4.3 Datenhaushalt, Datenfluss</p>