

CENARYX

Dokumentationsübersicht

Marktrisiko-, Validierungs- und Reporting-Workflows auf einen Blick.

Risikoanalytik

- VaR und Expected Shortfall
- Sensitivitäten und Aggregation
- Stress Testing und Makroszenarien
- Interaktive Dashboards und PDF-Packs

Validierungsevidenz

- Instrumentenvalidierungspakete
- Modellvalidierungsabdeckung
- Benchmark-Vergleich
- Pass/Fail-Evidenz für Review

Datenqualität

- Regelbasierte Prüfungen
- Coverage-Analyse
- Findings Management
- Pre-Report-Kontrollen

Betriebsmodell

- API-first Integration
- Transparente Workflow-Zustände
- Auditierbare Outputs
- Für Risiko- und Validierungsteams konzipiert

Typische Nutzung von CENARYX

1

Marktdaten und Positionen vorbereiten

2

Analytik und Stressszenarien ausführen

3

Instrumente, Modelle und Inputs validieren

4

Dashboards prüfen und Reports veröffentlichen