



## CENARYX PLATFORM OVERVIEW

# Marktrisiko. Validierung. Transparenz.

Prüfungssichere Analytik für VaR, Expected Shortfall, Sensitivitäten, Stress Testing, Validierungsevidenz und Management-Reporting.

Warum CENARYX

**Für Institute, die transparente Risikozahlen, nachvollziehbare Kontrollen und entscheidungsreife Evidenz benötigen.**

### DAILY RISK PACK

VaR · ES · Sensitivities · Stress · Validation

**49+**

VALIDATED INSTRUMENTS

**9**

INSTRUMENT VALIDATION PACKS

**12+**

VALIDATED MODELS

**114+**

DATA QUALITY RULES

**3,500+**

AUTOMATED TESTS

## 01 KERNFUNKTIONEN DER PLATTFORM

### Marktrisiko

- VaR
- Expected Shortfall
- Sensitivitäten
- Risikoaggregation

### Stress Testing

- Makroszenarien
- Multi-Set Stress Testing
- EBA-Szenarien
- Proxy Shock Handling

### Validierung

- Instrumentenvalidierung
- Modellvalidierung
- Evidence Packs
- Benchmark-Vergleiche

### Datenqualität

- Regelwerk
- Coverage-Analyse
- Validierungsregeln
- Findings Management

## 02 WAS CENARYX UNTERSCHIEDET

Risikoteams verlieren häufig Zeit durch getrennte Engines, Tabellen, Validierungspakete, DQ-Prüfungen und manuelle Reporterstellung.

### CENARYX verbindet den täglichen Risikoprozess von der Berechnung bis zur Evidenz:

- Nachvollziehbare VaR-, ES-, Sensitivitäts- und Aggregationsergebnisse
- Evidence-basierte Instrumenten- und Modellvalidierung
- Integrierte Datenqualitätskontrollen vor dem Reporting
- Makro- und regulatorisch orientierte Stress Tests
- Interaktive Dashboards plus professionelle PDF-Reports



## 03 Täglicher Risikoprozess

### 1. Daten

Marktdaten, Positionen, Szenarien

### 2. Berechnen

VaR, ES, Sensis, Stress

### 3. Kontrollieren

DQ Checks, Coverage, Validierung

### 4. Report

Dashboards, Evidenz, PDFs

## Von der Berechnung zum Management-Pack

### MARKTDATEN

VAR 99

**12.9m**

250T historisch

### RISK ENGINE

ES 97.5

**18.4m**

Basel-Set

### VALIDIERUNG

KONTROLLE

ERGEBNIS

STATUS

Instrumentenabdeckung

49 validierte Instrumente

Bereit

Modellvalidierung

12 validierte Modelle

Bereit

Stress Pack

Makro- + EBA-Szenarien

Bereit

Report Output

Dashboard + PDF-Evidenz

Bereit

DQ-REGELN

**114+**

Pre-Report Checks

TESTS

**3,500+**

automatisierte Evidenz

## 04 Validierungsevidenz

- Instrumentenvalidierung mit Benchmark-Vergleichen
- Modellvalidierungszentrum für Annahmen, Tests und Ergebnisse
- Nachvollziehbare Pass/Fail-Evidenz für Audit und Review
- Coverage-Sichten für Instrumente, Modelle und Marktdaten

## 05 Datenqualitätskontrollen

- Regelbasierte Qualitätsprüfungen vor der Berichtsnutzung
- Findings Management für fehlende, veraltete oder inkonsistente Inputs
- Coverage-Analytik für SBA-Metadaten, Laufzeiten und Mappings
- Transparenter Regelbestand statt versteckter Spreadsheet-Kontrollen

## 06 Professionelles Reporting

- Management-Reportseiten mit konsistenter Risiko-Narrative
- Interaktive Dashboards für Drill-down und Erklärung
- PDF-Packs für Governance, Komitees und Audit Trails
- Wiederverwendbare Designsprache für Validierung und Marktrisiko

## 07 Für Einführung konzipiert

- Unabhängige Module für Risiko, Validierung, DQ und Reporting
- API-first Integration in bestehende Daten- und Workflow-Services
- Transparente Berechnungen und Kontrollen für Model-Risk-Review
- Für Risikoteams, Treasury, Validierung und Entscheider gebaut