Backtesting

in der Geldwäscheprävention

Optimieren Sie Ihre Compliance-Risikostrategie mit einer Lösung, die Ihren Backtesting-Prozess automatisiert

Als Finanzinstitut sind Sie verpflichtet, die Funktionsfähigkeit und Wirksamkeit Ihrer internen Maßnahmen zur Verhinderung von Geldwäsche zu kontrollieren. In den Überwachungssystemen verwendete Indizien, Regeln, Schwellenwerte, Scores und Risikoklassifizierungen sind regelmäßig und anlassbezogen auf ihre Angemessenheit und Aktualität zu überprüfen.

Gut justierte Systeme erzeugen hochwertige Treffer. Um die fachliche Konfiguration zu optimieren, reicht Erfahrungswissen allein aber nicht mehr aus. Das Backtesting simuliert Auswirkungen von Parameteränderungen und hilft, das Überwachungssystem richtig zu kalibrieren.

Wir unterstützen Sie beim Backtesting und automatisieren den Prozess weitestgehend für Sie – von der Datenselektion über den Datenqualitätscheck bis hin zur Ausführung des Backtestings.

Ihre Vorteile:

Sicherstellung der Compliance

Vermeiden Sie Feststellungen im Rahmen von Prüfungen durch nachvollziehbare und dokumentierte Analysen der zu prüfenden Schwellenwerte und sonstigen Risikoparameter.

Bessere Trefferqualität

Senken Sie mit einem optimal eingestellten Überwachungssystem Falsch-Positiv-Raten und identifizieren Sie neue, zuvor unentdeckte Fälle.

Zeitgewinn durch Backtesting-Experten

Profitieren Sie von der langjährigen Erfahrung unserer Experten, die nicht nur über fundiertes Compliance-Know-how verfügen, sondern auch mit Ihren Überwachungssystemen bestens vertraut sind – technisch wie fachlich.

Erfahrungswissen validieren durch Analyse großer Datenkolonnen

In Zusammenarbeit mit Ihnen erstellen wir einen Testplan, konkretisieren die Testfälle und leiten die erforderlichen Testdaten ab. Dazu gehört auch eine Analyse Ihrer Datenqualität, denn hochwertige Daten sind Grundvoraussetzung für das reibungslose Funktionieren des Transaktionsmonitorings. Nach Durchlauf des Backtestings erhalten Sie von uns einen umfassenden Abschlussbericht mit den Trefferstatistiken der Risikoparameter und den berechneten Abhängigkeiten der Regeln – inklusive einer detaillierten fachlichen Bewertung aller Ergebnisse durch unsere Experten. Alle Schritte des Backtesting-Prozesses werden protokolliert und der Status dokumentiert. In Absprache mit Ihnen passen wir dann die Risikoparameter basierend auf den Ergebnissen des Backtestings an. Ihr Überwachungssystem ist damit bezogen auf Ihr spezifisches Geschäftsmodell und Ihre Risikoanalyse optimiert. Die Angemessenheit des Regelwerks ist für einen sachkundigen Dritten nachvollziehbar abgeleitet, die Historisierung von Änderungen ist gewährleistet.

Sachgerechtes Backtesting – Leistungen im Überblick

Zudem können Sie weitere Reports ad hoc und unkompliziert auf der Grundlage von benutzerdefinierten Parametern erzeugen. Drop-down-Menüs, Felder für Zahlen- und Texteingaben oder Datumsbereiche helfen Ihnen bei der Erstellung der gewünschten Auswertung. Sie legen hierfür vorab mit uns Pflichteingaben, Standard-, Min- und Max-Werte fest.

1 | Analyse der Risikoparameter

2 | Datenselektion und Datenqualitätsprüfung

3 | Vorbereitung des Backtestings

4 | Durchführung des Backtesting-Prozesses

5 | Anpassung und Optimierung der Risikoparameter

Optimieren Sie Ihre Compliance-Risikostrategie mit einer Lösung, die Ihren Backtesting-Prozess automatisiert.
Kontaktieren Sie uns für einen Termin mit einem unserer Experten oder um mehr zu erfahren:

+49 69 580045 6003 | sales@msg-compliance.com

msg Rethink Compliance GmbH
Amelia-Mary-Earhart-Str. 14 | 60549 Frankfurt/Main | +49 69 580045-0
info@msg-compliance.com | www.msg-compliance.com