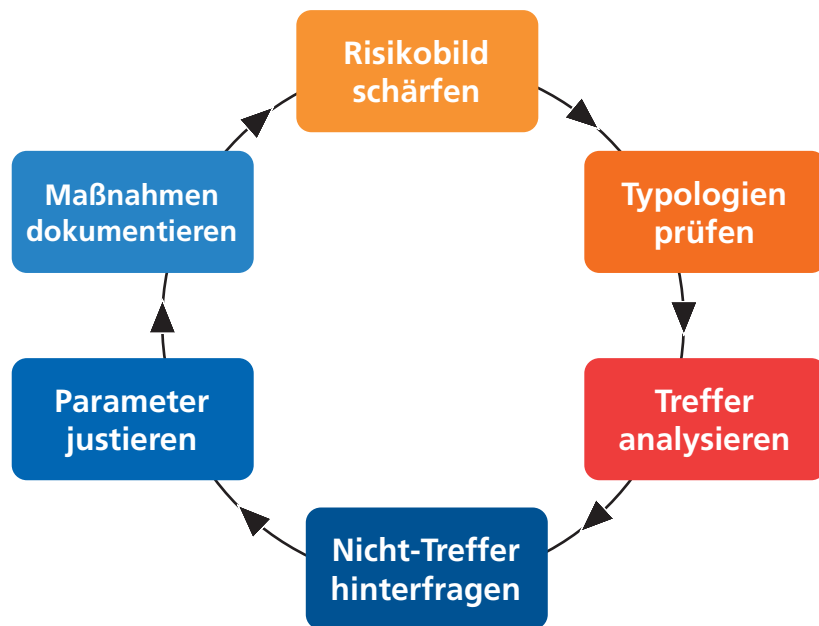


Der Backtesting-Prozess auf einen Blick

#freiraumsichern durch wirksames Monitoring

Mustervorlage: Backtesting als kontinuierlicher Steuerungsprozess



	Risikobild schärfen	Typologien prüfen	Treffer analysieren
Frage	Welche Risiken sind für unser Haus tatsächlich relevant?	Decken unsere Szenarien diese Risiken wirklich ab?	Welche Treffer sind wirklich relevant?
Typische Schwächen	▶ generische Annahmen ▶ keine klare Ableitung aus Risikoanalyse	▶ Übernahme von Standard-Setups ▶ fehlende Aktualisierung	▶ keine systematische Auswertung ▶ Fokus nur auf Bearbeitung
Ergebnis	klare Priorisierung relevanter Risiken	relevante, aktuelle Szenarien	Reduktion von False Positives

	Nicht-Treffer hinterfragen	Parameter justieren	Maßnahmen dokumentieren
Frage	Was erkennt unser System nicht?	Welche Anpassungen sind notwendig?	Können wir unsere Entscheidungen erklären?
Typische Schwächen	▶ keine Analyse von False Negatives ▶ blindes Vertrauen ins System	▶ punktuelle Änderungen ▶ keine Systematik	▶ fehlende oder unklare Dokumentation
Ergebnis	Schließen von „blinden Flecken“	gezielte Kalibrierung des Systems	prüfungssichere Nachvollziehbarkeit

Der entscheidende Unterschied

Viele Institute arbeiten an einzelnen Punkten –
aber nicht entlang eines durchgängigen Prozesses.

Ohne Struktur	Mit Backtesting Geno-SONAR®
punktueller Anpassung	systematische Steuerung
reaktiv	proaktiv
schwer erklärbar	prüfungssicher

Wie strukturiert ist Ihr Backtesting?

Wir unterstützen Sie mit nachfolgender Mustervorlage dabei,

- ▶ Ihren aktuellen Ansatz zu überprüfen,
- ▶ evtl. Ansatzpunkte zur Optimierung zu identifizieren und
- ▶ Ihr Backtesting als Steuerungsinstrument zu etablieren.

Ihr nächster Schritt:

Lassen Sie uns gemeinsam Ihr Backtesting einordnen.

Sprechen Sie mit uns.

Scannen Sie dazu einfach den QR-Code und füllen Sie das Kontaktformular aus.

**Einfach scannen und
Kontaktformular aus-
füllen. Ich melde mich
umgehend!**



[https://www.dz-cp.de/
kontaktformular_backtesting](https://www.dz-cp.de/kontaktformular_backtesting)

IHR ANSPRECHPARTNER



Thomas Wagener
Bereichsleiter
Compliance-Spezialisten
069 580024-241
thomas.wagener@dz-cp.de