



LIST REFERENCYJNY

Firma Polskie Technologie wspierała prace Deutsche Bank Polska S.A. w latach 2018-2020 w obszarze walidacji modeli. W czasie projektu konsultanci firmy Polskie Technologie mieli okazję uczestniczyć w pracach nad walidacją m.in.:

- Modelu Expected Credit Losses, który podlega wymogom MSSF9 oraz modeli zasilających PD, LGD oraz EAD,
- Modeli scoringowych PD dla segmentu klientów indywidualnych oraz małych i średnich przedsiębiorstw,
- Modelu EC Market Risk wykorzystywanego do wyznaczenia wewnętrznych potrzeb kapitałowych na pokrycie ryzyka rynkowego,
- Modeli : (1) Net Interest Income, oraz (2) Economic Value of Equity, które podlegają wytycznym EBA IRRBB,
- Modelu VaR wykorzystywanego w procesie zarządzania ryzykiem rynkowym, oraz
- Modeli wykorzystywanych w procesie zarządzania ryzykiem płynności.

Realizowane przez konsultantów firmy Polskie Technologie zadania wykonywane były z należytą starannością oraz dużym zaangażowaniem. Przydzieleni do realizacji projektu konsultanci wykazywali się znajomością technik modelowania, które są wykorzystywane w bankowości, oraz wyróżniali się wysoką sprawnością w zakresie posługiwania się narzędziami statystycznymi SAS i R. Współpracę z konsultantami dodatkowo ułatwiała ich umiejętność komunikowania skomplikowanych zagadnień statystycznych w zrozumiały dla strony biznesowej, obrazowy sposób, jak również otwartość na sugestie i potrzeby zgłaszane przez zespół Deutsche Bank Polska S.A.

A handwritten signature in blue ink, appearing to read 'P. Gemra', with a long horizontal flourish extending to the right.

Piotr Gemra

Członek Zarządu Deutsche Bank Polska S.A.