

Beraterprofil

Dr. Thomas Hudetz, M.Sc.

Thomas Hudetz	Lebenslauf - ausgewählte Erfahrungsschwerpunkte		
	Jahrgang	1965	
	1983 – 1992	Universität Wien Mathematische Physik/angewandte Mathematik, Vertragsassistent	Wien
	1995 - 1996	TU Wien & Oakland University, MI/USA Engineering- & Project Management (M.Sc.)	Wien
	1999 – 2005	OeNB Bankprüfer (1999-2002) – FMA Prüfung IRB-Modelle Basel II, u.a. (2003-'05)	Wien
	2002 – 2003	Finance Trainer Int. Financial Engineer VaR-Modelle, Consultant Marktrisiko/Treasury	Wien
	2008 (1 Jahr)	1 PLUS i GmbH Berater (Gesamtbank-Risiko, Treasury,...), fallw. Bank-Inhouse-Trainer	Frankfurt/M.
	2009 – 2012	Bausparkasse Wüstenrot Leiter Gesamtbank-Risikomanagement (auch f. KI-Gruppe)	Salzburg
	2012 – 2016	SKS Österreich (zuletzt:) Managing Expert Consultant, Schwerpkt. Basel III & ICAAP	Wien / FFM
	2016 – 2018	Vakifbank International Abt.-Leiter ‚Strategic Risk Management & Risk Controlling‘	Wien
Ab Mai 2018	Freelance Consultant Risk Management, Regulatory Requirements, Meldewesen u.a.	von Wien	
Kontakt Daten als EPU	Themenschwerpunkte Software-Kenntnisse Sprachen		
<p data-bbox="131 951 388 973">Advisory@Hudetz e.U.</p> <p data-bbox="131 1013 320 1068">Sternngasse 3/2/6 A - 1010 Wien</p> <p data-bbox="131 1108 388 1162">Mobiltel. Österreich: + 43-(0)660-7240509</p> <p data-bbox="131 1173 388 1228">Mobiltel. Deutschland: +49-(0)151-12208584</p> <p data-bbox="131 1239 388 1262">Advisory@Hudetz.info</p> <p data-bbox="131 1273 388 1296">Web: www.hudetz.info</p>	<ul data-bbox="498 959 1812 1262" style="list-style-type: none">▪ Kredit- / Marktrisikomanagement, insbes. Zinsrisiko im Bankbuch▪ ICAAP/SREP, insbesondere: SREP für LSI's▪ Stress Testing und Szenarioanalysen▪ Basel III bzw. Basel IV – Regulatory-Requirements-Projekte▪ ILAAP und operatives Liquiditätsrisikomanagement / Treasury▪ Regulatorisches Meldewesen, u.a. Erfahrung m. GMP-Cubemeldungen▪ Entwicklung von praxistauglichen u. aufsichtskonformen Risikomodellen▪ Zahlreiche High-Level-Fortbildungen & Trainings, aus fast 20 Jahren Erfahrung▪ MS Office inkl. VBA, Mathematica u.a.▪ FO-/MO-Systemerfahrung (diverse)▪ Hohe Projektmanagement-Kompet.▪ Deutsch, Englisch (verhandlungsf.) <p data-bbox="498 1308 1789 1330">20 Jahre Erfahrung im österreichischen und deutschen Bank- & Finanzsektor, inkl. eigener Aufsichts- u. Prüfertätigkeit</p>		

Beraterprofil

Dr. Thomas Hudetz, M.Sc.

Unternehmen / Ber.-Kunde	Linienaufgabe, bzw. Projektauftrag	Tätigkeitsschwerpunkte, bzw. Detail-Projektinhalte – <i>nur bis Mitte 2018 (bevor Freelancer)</i>
VakifBank International AG (10/2016-04/18)	Senior Experte sowie Leitung des Gesamtbank-Risikomanagement einer österr. Auslands-Vollbank	<ul style="list-style-type: none">▪ Abteilungsleiter (2. Ebene) der Abt. ‚Strategic Risk Management & Risk Controlling‘ einschließlich Führungsverantwortung, zuletzt 3 Mitarbeiter - enge Kooperation mit dem / Unterstützung des CRO▪ Inhaltliche Verantwortung für sämtliche Gesamtbank-Risikomanagement-Themen (ICAAP, ILAAP...)▪ Strategische Sonderprojekte im direkten Vorstandsauftrag, insbes.: Abarbeitung v. Aufsichtsanford.▪ Unterstützung einiger anderer Abteilungen bei Gesamtbankthemen, insbes. zu Meldewesen u.a.
Aquila Gruppe, Hamburg - v.a. WP-Handelsbank Beratungsprojekt	Datenanalyse, Konzept, Spreadsheet-Aufbau für ges. COREP- Meldewesen (als 1-Mann-Projekt 2014)	<ul style="list-style-type: none">▪ Entwicklung einer Spreadsheet-Vorverarbeitung auf Basis einer vollständigen Bilanzdatenanalyse▪ Überleitung zu den COREP-Meldewesenbelegen – unter hohem Zeitdruck für Basel-III-Erstmeldung▪ Spezialthemen für die damalige Wertpapier-Handelsbank (DE-Konzession) samt Aufsichtsstrategien
Degussa Bank, Frankfurt/Main – Beratungsprojekt (2014)	Validierung des Konzepts der Risikotragfähigkeits-Berechnung. / MaRisk-Check	<ul style="list-style-type: none">▪ Analyse Risikomessmethoden sowie Risikodeckungsmassen-Konzepte für die Risikotragfähigkeit▪ MaRisk-Check vor einer angekündigten MaRisk-Routineprüfung der BaFin/Bundesbank▪ Aufbereitung der Projektergebnisse in Präsentationsform für interne und externe Stakeholder
BAWAG-PSK AG - Beratungsprojekt (2013)	Anforderungsdefinition und Schnittstellenkonz. für LCR-Berechnung und -Meldung	<ul style="list-style-type: none">▪ Mitarbeit bzw. Unterstützung bei der Entwicklung des LCR-Fachkonzeptes und zugeh. IT-Konzeptes▪ Schnittstellenanpassung Solo- und Gruppen-LCR-Berechnungsprozesse (in Abst. mit Rechenzentrum)▪ Abstimmung und enge Verzahnung mit IT-seitig projektführender deutscher Spezialberatung, sowie mit intern vom LCR-Datenpool-Projektinhalt mitbetroffenen Fachabteilungen und Tochterinstituten
Raiffeisen-Landesbank OÖ., Linz - Consulting	3 jeweils länger laufende Beratungsprojekte (2012, Sommer 2014, sowie 21 Monate 2015-2016)	<ul style="list-style-type: none">▪ RWA-Optimierung im Rahmen des Kreditrisiko-Standardansatzes (Basel III), Maßnahmen RWA-Red.▪ Vorstudie zu FRTB-Handelsbuch-Rahmenwerk aus Basel IV, auf Basis der Basler Konsultationspapiere▪ Fachexperte und Projektorganisation-Mitarbeiter im Raiffeisen-AT-Gesamtprojekt „GMP“, inklusive Excel-VBA-Programmierung einer übergangsmäßigen Behelfslösung für WP-Cube (in Anfangsphase)

Beraterprofil

Dr. Thomas Hudetz, M.Sc.

Unternehmen / Ber.-Kunde	Linienaufgabe, bzw. Projektauftrag	Tätigkeitsschwerpunkte, bzw. Detail-Projektinhalte
Bausparkasse Wüstenrot (als Consulting-Kde. nach Wechsel zu SKS Mitte 2012), Consultingproj.e	4 jeweils länger laufende Beratungsprojekte nach eigenem Ausscheiden als interner Mitarbeiter, s.u. - in Folgejahren 2012-2014	<ul style="list-style-type: none">APM-Steuerung mit Berechnung einer Durationsbilanz, im Rahmen eines Pilotprojekts für bereits etabliertes Front-to-Back-System; Überleitung in die IRRBB-Meldung aus dem OeNB-Meldewesen u. für die Slowakei-Tochter (so genannte „Zinsrisikostatistik“-Meldung, inhaltlich noch aus Basel II)Credit-Spread-Risikomodelle auf Basis CDS-Spread-Historien sowie CS01-KeyRate-SensitivitätenStresstest-Neukonzeption und Implementierung im Gesamtbank-Steuerungssystem (Reverse Stress)ICAAP – Risikotragfähigkeitsrechnung: Neukonzeption vor allem betr. Risikodeckungsmassen inkl. Quantitative Kalibrierung des Risikoappetits, Methodenkonz. Marktrisiken, Beteiligungsrisiken (u.a.)
Bausparkasse Wüstenrot, inkl. KI-Gruppe (2009-Mitte 2012)	Senior Experte und Leitung des Gesamtbank-Risikomanagement einer großen österreichischen Bausparkassengruppe	<ul style="list-style-type: none">Implementierung eines Front-/Mid-/Backoffice-Systems, nachfolgende Pilotkunden-Entwicklung einer Customised-Systemerweiterung für Aktiv-Passiv-Management & Treasury-FunktionalitätenICAAP: Risikotragfähigkeitsrechnung, quantitative Risikomessung: Zinsrisiko-VaR, Credit-Spread-VaROffenlegung nach Basel II / III, Basel-III-Projektarbeit zu ILAAP-Themen und Kreditrisiko, EigenmittelVorbereitungs- und Begleitungsverantwortung zu FMA-/OeNB-Prüfungen, u.a. zu ICAAP-ThemenAbteilungsleiter (2. Ebene), Abt. „Risikomanagement Bausparkasse“, mit Führungsverantwortung zuletzt für 4 Mitarbeiter – enge Kooperation mit bzw. Unterstützung von ‚Group Risk Management‘
DekaBank FFM, Frankfurt School, Akademie des dt. Sparkassenverb., Bundesbank, u.a.	Inhouse-Trainings zu div., zum damaligen Zeitpunkt aktuellen Themenkreisen (2008)	<ul style="list-style-type: none">Eigenständige Erarbeitung der Präsentationsunterlagen auf Basis früherer PräsentationsinhalteInteraktive Inhouse-Trainings, natürlich in intensivem Dialog mit den bankinternen TeilnehmernIn vielen Teilen komplexe Themeninhalte, z.B.: „Mathematik und Statistik für Investmentbanker“Schriftliche Beantwortung von aufwändigen Teilnehmer-Inputs im Nachgang zu jew. Seminartagen
West-LB (2008) - Beratungsprojekt	Implementierung von Kondor+ als Front- und MidOffice-System	<ul style="list-style-type: none">Hauptschwerpunkt: P&L-Controlling im Treasury und Eigenhandel – Fachspezifikation für Kondor+Finanzmathematische Fragestellungen aus diesem Zusammenhang, tw. DokumentationserstellungEnge Projektzusammenarbeit mit Spezialisten der internationalen Tochter- bzw. Zweigstellenbanken

Beraterprofil

Dr. Thomas Hudetz, M.Sc.

Unternehmen / Ber.-Kunde	Linienaufgabe, bzw. Projektauftrag	Tätigkeitsschwerpunkte, bzw. Detail-Projektinhalte
Bayerische Landesbank (2008) - Projekt	IKS- und Op-Risk-Status-Erhebung für Eigenhandel → Ziel: Verhinderung von „Rogue Trader“-Aktivität	<ul style="list-style-type: none"> Strukturierte Interviews mit Hauptfunktionen für den Eigen- und Kundenhandel in der Bayern-LB-Gruppe, daraus Erfassung von möglichen Risikopotenzialen für unautorisierte Händleraktivitäten Bedrohungsszenario, auf Basis des Milliarden-Verlustes der Societé Generale durch Trader Kerviel Ableitung v. IKS-Ergänzungen bzw. Op-Risk-Vermeidungsstrategien u. konkreten Einzelmaßnahmen
Deutsche Postbank (2016) – Beratungsproj.	Tageweise Unterstützung im Analyse-Vorprojekt zu FRTB-Handelsbuchregeln	<ul style="list-style-type: none"> Analyse des Basler FRTB-Finalstandards von Anfang 2016, Versionsvergleich zu Konsultationspapier Anforderungsdefinition für eine Systemumstellung zur Implementierung der FRTB-Berechnung Unterstützung deutscher Beratungskollegen (der SKS-Gruppe) bei Excel-VBA-Toolkonzeption f. FRTB
Raiffeisen Zentralbank (2007) - Projekt	Internes Marktrisiko-Modell: Anforderungsdefinition / -spezifikation f. versch. Systemanbieter	<ul style="list-style-type: none"> Anforderungsdefinition für die Eigenmittelberechnung des Handelsbuches mittels eines VaR-basierten internen Modells, für die gesamte international agierende Bank bzw. Bankengruppe Test und Abgleich der Anforderungen mit zwei, damals in die engere Wahl kommenden externen Systemanbietern – Projektkoordination in Calls mit den Anbieter-Vertretern sowie Referenzkunden
Verbund Austrian Power Trading & Sales	Financial Engineer und Projektleiter MiFiD / CAD (2006/07)	<ul style="list-style-type: none"> Weiterentwicklung von Modellen für die Commodity-Handelsprodukt-Bepreisung (inkl. Marktdaten) Laufende Bepreisung strukturierter Sales-Produkte und komplexer Commodity-Finanzkontrakte Projektleitung f. Projekt ‚MiFiD / CADII‘, Umsetzungscoordination für das Commodity-Handelshaus
Finance Trainer International / österreichische Banken-Kunden	Financial Engineer und Consultant (2002/03)	<ul style="list-style-type: none"> Aufbau und Weiterentwicklung eines integrierten ‚Value-at-Risk-Rechners‘ für typische Investment-Portfolien (Aufbau der erf. Marktdatenbank, Risikomodellierung von relevanten Bankprodukten,...) Consulting, vor allem im Bereich Marktrisiko / APM (Zinsrisiko im Bankbuch), Treasury, und zu div. Aufsichtsrechts-Themen, bei zus. 9 mittelgroßen österreichischen Banken (laufende Reisetätigkeit)
Ergänzende Information – v.a. zu strategischer Leitungserfahrung, aus mittlerweile 5 Jahren (aktuell und weiterhin)		
Relativ kleine u. spezialisierte, österreichische Privatbank	Mitglied des Aufsichtsrats (Mai 2013 – Juni 2019, Mandat nach 6 Jahren auf eigen. Wunsch zurückgel.)	<ul style="list-style-type: none"> Aufsichtsratsmitglied, mit dem Alleinstellungsmerkmal der hohen Kompetenz im Risikomanagement Interner Berater des Aufsichtsrates (und indirekt, auch des Vorstandes) zu Aufsichtsrechts-Fragen Mitsprache bei sämtlichen strategischen Geschäftsentscheidungen im Rahmen des AR-Mandates