

Carolin Solvency-II-Pries

Senior Credit Risk Manager / FRM / PRM / CFA L3

✉ carolin.pries@example.de

☎ +49 89 5566 7788

📍 Muenchen, Deutschland

🌐 [linkedin.com/in/carolinpries](https://www.linkedin.com/in/carolinpries)

Profil

Credit Risk Manager mit M.Sc. Quantitative Finance (Frankfurt School) und 8 Jahren Erfahrung im Kreditrisiko bei BayernLB und Helaba Risk. FRM-Vollmitglied, PRM, CFA Level III. Verantwortet IFRS 9 ECL-Modelle fuer 64 Mrd. EUR Kreditportfolio. Deutsch C1, Englisch C1.

Berufserfahrung

Senior Credit Risk Manager 10/2021 - heute

BayernLB Risk Muenchen Muenchen, Deutschland

Senior Credit Risk Manager im Bereich Corporate + Mittelstand

- IFRS 9 ECL-Modelle fuer ein Portfolio mit 64 Mrd. EUR Kreditvolumen und 8.400 Mittelstandskunden verantwortet
- IRB Re-Approval Mittelstandsportfolio mit BaFin-Freigabe Q3 2024, RWA-Reduktion EUR 1,2 Mrd. erzielt
- Quartalsweises Backtesting fuer 8 PD-LGD-Modelle, 4 Re-Kalibrierungen erfolgreich an MaRisk-Kontrolle
- Stresstest EBA 2024 fuer das gesamte Bankbuch implementiert, Capital-Impact EUR 980 Mio. quantifiziert
- Mitarbeit am Credit Risk Committee 1x pro Monat, 24 Risk-Memos in 12 Monaten verfasst

Credit Risk Analyst 10/2017 - 09/2021

Helaba Risk Frankfurt Frankfurt, Deutschland

Credit Risk Analyst im Bereich Sparkassen-Verbund

- IFRS 9 ECL-Modellierung fuer das Verbund-Sparkassen-Portfolio mit 28 Mrd. EUR RWA
- Counterparty Credit Risk Berechnungen mit Moody's CreditEdge fuer 240 Counterparties
- Sektor-Exposure-Analysen fuer 6 systemrelevante Branchen, 3 Limits-Anpassungen umgesetzt

Fähigkeiten

IFRS 9 ECL + PD-LGD-EAD-Modellierung

Basel III/IV IRB + Standardansatz

Python + R + SAS Risk Stratum

Moody's Analytics
CreditEdge + RiskCalc

MaRisk + BCBS-239 + EBA Guidelines

Counterparty Credit Risk + CVA + xVA

Power BI + Tableau Credit-Dashboards

Stresstest EBA + BaFin + ECB

Sprachen

Deutsch Muttersprache

Englisch C1

Italienisch B2

Stärken

Kreditmodell-Tiefe

Verantworte 12 IRB- und IFRS-9-Modelle ueber Spezifikation, Implementierung, Backtesting und jaehrliche Validierung gemaess MaRisk

Ausbildung

M.Sc. Quantitative Finance 10/2014 - 09/2016
Frankfurt School of Finance & Management Frankfurt, Deutschland
Quantitative Finance 1,2

B.Sc. BWL + Wirtschaftsmathematik 10/2011 - 09/2014
Universitaet Mannheim Mannheim, Deutschland
BWL + Wirtschaftsmathematik GPA: 1,4

Projekte

IRB Re-Approval BayernLB Mittelstand 01/2024 - 09/2024
Re-Approval der IRB-Modelle fuer das Mittelstandsportfolio, BaFin-Freigabe Q3 2024, RWA-Reduktion EUR 1,2 Mrd.

Zertifikate

CFA Level III 11/2023

PRM Professional Risk Manager (PRMIA) 06/2021

FRM (GARP) - Vollmitglied 03/2019

Moody's Analytics CreditEdge Certified 10/2022

SAS Risk Stratum Practitioner 02/2020

Portfolio-Analyse- Faehigkeit

Pruefe Konzentrationsrisiken, Sektor-Exposure und Vintage-Effekte mit Python-Toolkit und SAS-Reports auf Monatsbasis

Aufsichtsdialog

Direkter Ansprechpartner fuer BaFin in 2 IRB-Sonderpruefungen, beide ohne aufsichtliche Auflagen