

Provinzial NordWest erweitert Nutzung von Aquantec Ocean für den ORSA-Prozess

München, November 2014

Die Provinzial NordWest Holding AG (PNW) und die Münchner Firma Aquantec AG geben den erfolgreichen Abschluss des Projekts „Erweiterungen für Solvency II und Own Risk Assessment inklusive Detailabbildung des Aktien-Dividendenkonzepts“ bekannt. Die PNW mit Sitz in Münster ist die Muttergesellschaft der Provinzial NordWest Gruppe und ist mit 3 Milliarden Euro an jährlichen Beitragseinnahmen und Kapitalanlagen von 21 Milliarden Euro die zweitgrößte öffentliche Versicherung in Deutschland.

Die PNW setzt die Software *Aquantec Ocean* seit dem ersten Quartal 2012 in der Kapitalanlageplanung für folgende Zwecke ein:

- ökonomische und bilanzielle Bewertung und Abbildung aller Kapitalanlagen samt indirekter Anlagen und illiquider Positionen,
- umfangreiche Risikoanalysen des Anlageportfolios,
- Prognosen der Liquidität und der Gewinn- und Verlustrechnung.

Die dynamische Portfoliosimulation von *Aquantec Ocean* gestattet detaillierte Berechnungen der Portfolioentwicklung und verbundener Risiken und unterstützt die PNW somit bei der Strategischen Asset Allokation und der Geschäftsplanung.

Aquantec Ocean wurde dieses Jahr in einem gemeinsamen Projekt erweitert, um Solvency II-Anforderungen zu erfüllen. Hierbei standen unternehmens-eigene Risiko- und Solvabilitätsbeurteilungen (ORSA – Own Risk and Solvency Assessment) im Mittelpunkt. Folgende Aspekte wurden realisiert:

- Ermittlung von Portfoliobewertungen nach Solvency II,
- Implementierung der Solvency II-Szenarien gemäß Standardformel und gemäß interner Stressfaktoren und ihre Anwendung auf das Gesamtportfolio,
- Anwendung von Solvency II-Szenarien auf Zukunftsprojektionen und in vielfältigen Simulationen und Stresstests,
- Realisierung der Kundenstrategie „Aktien-Dividendenkonzept“.

„Mit Aquantec haben wir seit 2011 durchgängig positive Erfahrungen in gemeinsamen Projekten gemacht. Seit 2012 sind wir intensiver Nutzer der Software *Aquantec Ocean*. Sie ermöglicht uns, die aktuellen Anforderungen von ORSA für unsere Kapitalanlagen zu erfüllen, und bietet die Flexibilität, uns auch an zukünftige regulatorische Herausforderungen leicht anzupassen. Die PNW ergänzt damit ihr Lösungsspektrum für die Berechnung von ökonomischen, bilanziellen und regulatorischen Bewertungen nach Solvency II und für die Ermittlung von Risiken für die Kapitalanlage“, sagt Dr. Christoph Heidelberg, Hauptabteilungsleiter Investment Management und Geschäfts-



fürer der PNW Asset Management GmbH.

Dr. Georg Meyer, Vorstand der Aquantec AG, kommentiert: „*Aquantec Ocean* wurde entwickelt, um die Komplexität und die dynamischen Herausforderungen des Portfoliomanagements zu bewältigen. Die moderne Architektur unserer Software gestattet es unseren Kunden, auch die anspruchsvollsten Anforderungen schnell abzubilden. Der Einsatz von *Aquantec Ocean* bei der PNW für ORSA demonstriert den hohen Nutzen von regulatorischen und bilanziellen Berechnungen in Kombination mit dem traditionell ökonomisch getriebenen Portfoliomanagement.“

Über die **Aquantec AG**

Die Aquantec AG ist Hersteller des Produkts *Aquantec Ocean*, einer Lösung für Pricing und Trading, Portfolio- und Risk-Management. Hinter *Aquantec Ocean* steht ein interdisziplinäres Team von Softwarearchitekten und -entwicklern, Businessanalysten und Finanzmathematikern. *Aquantec Ocean* ermöglicht es, flexibel und effizient an den extrem dynamischen und komplexen Finanzmärkten von heute zu agieren. Weitere Informationen finden sich unter www.aquantec.com.

Über die **Provinzial NordWest Holding AG**

Der 2005 gegründete Provinzial NordWest Konzern gehört zu den größten öffentlichen Versicherern in Deutschland. Sein Geschäftsgebiet erstreckt sich über Westfalen, Schleswig-Holstein, Hamburg und Mecklenburg-Vorpommern.

Unter dem Dach der Provinzial NordWest Holding AG agieren die Schaden- und Unfallversicherer Westfälische Provinzial Versicherung AG in Münster, Provinzial Nord Brandkasse AG in Kiel und die Hamburger Feuerkasse Versicherungs-AG.

Hinzu kommt als gemeinsamer Lebensversicherer die Provinzial NordWest Lebensversicherung AG. Als Asset Manager innerhalb des Provinzial NordWest Konzerns richtet die Provinzial NordWest Asset Management GmbH ihren Investmentprozess eng an der Investmentphilosophie und -strategie des Konzerns aus. Weitere Informationen finden sich unter www.provinzial.de.