

BVV erhält zwei bedeutende Auszeichnungen unter Einsatz von Aquantec Ocean für Risikomanagement und ALM

München, Dezember 2022

Der BVV Versicherungsverein des Bankgewerbes a.G. mit Sitz in Berlin bietet Leistungen rund um die betriebliche Altersversorgung für die Finanzwirtschaft in Deutschland. Nach Anlagevermögen ist der BVV mit Kapitalanlagen von rund 33 Milliarden Euro die größte Pensionskasse Deutschlands.

Nach erstmaliger Bewerbung hat der BVV in diesem Jahr zwei bedeutende Auszeichnungen erhalten:

- **Portfolio Institutionell Award** als „Beste Pensionskasse / Zusatzversorgungskasse“ und
- **dpn-Award** „Risikomanagement und Asset-Liability-Management“.

Mit diesen Auszeichnungen wurden insbesondere die Prozesse im Kapitalanlage- und Risikomanagement gewürdigt. Überzeugen konnte der BVV durch seinen Investmentprozess, seine Risikomanagementstrategien und seine ALM-Modelle.

Seit 2013 setzt der BVV die Software *Aquantec Ocean* der Münchner Firma Aquantec AG ein. Während die Software zunächst vorrangig zur Unterstützung und Optimierung des Kapitalanlagecontrollings und der Strategischen Asset Allokation eingesetzt wurde, wird sie seit 2016 auch als Kernanwendung für ALM genutzt. Zu diesem Zweck wurde sie in gemeinsamer Zusammenarbeit um ein ALM-Modul ergänzt.

Aquantec Ocean verwaltet alle Kapitalanlagen des BVV und ermöglicht die Bewertung und Analyse aller Anlageprodukte. Auf dieser Basis kann der BVV schnell und bequem Risikoanalysen, multideterministische und stochastische Projektionsrechnungen, Stresstests und Simulationen durchführen.

Der BVV setzt auch weiterhin auf *Aquantec Ocean*, dessen Einsatz die Effizienz im Risiko- und Anlagemanagement unterstützt und durch hochgradige Automatisierung mit einer Reduktion des operativen Risikos und einer deutlichen Skalierbarkeit der vorhandenen Ressourcen einhergeht. Entsprechend wurde die Softwarelizenzierung von *Aquantec Ocean* beim BVV erst kürzlich für mindestens weitere fünf Jahre verlängert.

Der Funktionsumfang der Installation beinhaltet:

- Verwaltung von Cross-Asset Anlageprodukten und Portfolien,
- Management und Kalibrierung von Markt- und Modelldaten,
- Bewertung, Risiko- und Szenarioanalysen, Value-at-Risk,
- Ertrags- und Bilanzprojektion (deterministisch oder stochastisch) unter Berücksichtigung von dynamischen Portfoliumschichtungen und
- Integration des BVV-Unternehmensmodells in der Simulation.



„*Aquantec Ocean* erfüllt die hohen Ansprüche, die wir an ein modernes Risiko- und Asset-Liability-Management stellen. *Aquantec Ocean* ist eine sehr umfassende und leistungsfähige Bewertungs- und Analysesoftware. Wir sind dank *Aquantec Ocean* in der Lage, den gesamten Kapitalanlagebestand über alle Anlageklassen hinweg zu bewerten, hinsichtlich der enthaltenen Risiken zu analysieren und für beliebige Szenarien zu simulieren. Optimierte Schnittstellen und automatisierte Datenpflegeroutinen ermöglichen es uns, tägliche Bewertungs- und Szenariorechnungen für wesentliche Teile der Kapitalanlagen durchzuführen und die jährlichen Asset-Liability-Studien mit deterministischen und stochastischen Szenarien parallel zu den Jahresabschlussarbeiten zu erstellen. Über die Jahre haben wir in gemeinsamen Weiterentwicklungsprojekten die vertrauensvolle und verlässliche Zusammenarbeit mit dem Aquantec-Team sehr zu schätzen gelernt.“, sagt Christian Wolf, Leiter Risikomanagement & Controlling.

Dr. Georg Meyer, Vorstand der Aquantec AG, ergänzt: „Die gute und langjährige Zusammenarbeit mit dem BVV bestätigt, dass wir mit *Aquantec Ocean* eine leistungsfähige Software für das Anlagemanagement im Versicherungsbereich zur Verfügung stellen. Wir werden auch in Zukunft die umfangreichen Funktionalitäten beständig weiter ausbauen.“

Über die **Aquantec AG**

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

Über den **BVV Versicherungsverein des Bankgewerbes a.G.**

Der BVV bietet betriebliche Altersversorgung für die Finanzwirtschaft. Seit seiner Gründung im Jahre 1909 leistet das Unternehmen einen wesentlichen Beitrag zur Alters-, Invaliditäts- und Hinterbliebenenversorgung der Angestellten im Finanzbereich. Gemessen am verwalteten Vermögen ist der BVV Deutschlands größte Pensionskasse. Er stellt seine Leistungen allen deutschen Banken und Finanzdienstleistungsinstituten sowie ihren verbundenen Dienstleistungsunternehmen zur Verfügung. Weitere Informationen finden sich unter www.bvv.de.

Weitere Informationen über den **Portfolio Institutionell Award** unter:

www.portfolio-institutionell.de/bvv-ueberzeugt-mit-authentizitaet-und-stringenz

Weitere Informationen über den **dpn-Award** unter:

www.dpn-online.com/institutionelle-investoren/ausgezeichnetes-nachhaltiges-management-105479