



Validierung der Risk Engine Pricing Module für die Raiffeisen Bank International AG mit Aquantec Ocean

21 Pricing-Module
unabhängig
validiert

3 Prioritätsstufen
in 2 Validierungsphasen
systematisch geprüft

Beratungsauftrag

Für die Raiffeisen Bank International AG führte Aquantec AG in Zusammenarbeit mit der Ithuba Capital AG eine externe Validierung der Risk Engine Pricing Module durch. Beide Unternehmen bringen dabei ausgewiesene quantitative Expertise und langjährige Erfahrung aus der Tätigkeit in Quant-Teams des Bankensektors ein. Insgesamt wurden 21 von der Bank ausgewählte und für Risikomanagement-Zwecke genutzte Pricing-Module geprüft, die in drei Prioritätsstufen (1 = höchste bis 3 = niedrigste Priorität) eingeteilt waren. Die Validierung erfolgte in zwei Phasen: In Phase 1 wurden die Module mit höchster Priorität (Priorität 1) validiert, in Phase 2 die verbleibenden Module der Prioritätsstufen 2 und 3. Grundlage der jeweiligen theoretischen Analyse bildeten die Informationen der aktuellen Risk Engine Documentation der Bank. Im Anschluss an den theoretischen Teil wurden in weiteren Berichtsteilen die praktischen Aspekte validiert, indem die mit den Risk Engine Pricing Modulen erzielten Ergebnisse mit Referenzwerten verglichen wurden, die unter anderem mit dem Portfolio- und Risikomanagementsystem Aquantec Ocean berechnet wurden. Aquantec Ocean stellt hierfür eine breite Palette etablierter Bewertungsmodelle bereit, darunter beispielsweise das Extended Displaced-Diffusion Libor Market Model.

Aquantec Ocean

Aquantec Ocean ist eine modulare Front-to-Back-Software für Cross-Asset-Portfolien mit Produkten aus allen Assetklassen. State-of-the-art-Bewertungsmodelle sind in eine hochperformante Risiko-Engine integriert und liefern präzise Bewertungen ebenso wie fundierte Risikokennzahlen.

Aquantec Ocean bietet im Bereich Risikomanagement umfassende Funktionalitäten zur Analyse und Simulation von Portfolio- und Marktrisiken. Im Modul Risk Analysis stellt das System eine Umgebung zur Verfügung, in der ein breites Spektrum an Risikosensitivitäten für kombinierte Marktdatenszenarien definiert und berechnet werden kann – inklusive der Abdeckung anspruchsvoller regulatorischer Anforderungen. Ergänzend ermöglicht die Portfolio Simulation die Abbildung der zeitlichen Entwicklung von Portfolio- und Marktdaten samt den zugehörigen Markt- und Buchwerten, wobei das Portfolio regelbasiert und in Abhängigkeit antizipierter Marktentwicklungen dynamisch umgeschichtet wird.

Technologie

Aquantec Ocean läuft auf einer modernen .NET-Architektur mit modularem, skalierbarem Aufbau – On-Premise oder in der Cloud einsetzbar. Für unterschiedliche Nutzungsszenarien stehen Smart Client, Batch Client, Web-Anwendungen und ein Calculation Service für verteilte Berechnungen bereit. Rechenintensive Prozesse werden durch Multithreading, SIMD, GPU-Unterstützung (CUDA) und ein eigenes C#-basiertes AD-Framework für algorithmische Differentiation beschleunigt. Single Sign-on (Microsoft Entra ID oder Active Directory), ein rollenbasiertes Sicherheitsmodell sowie eine REST-API-Architektur mit reibungsloser Excel-Integration sorgen für sichere Anbindung und einfache Integration in bestehende Systemlandschaften.



Jochen Lohmann

Senior Sales Manager

jochen.lohmann@aquantec.de | +49 172 254 50 51

Aquantec AG

Bülówstr. 27 | 81679 München | Germany | www.aquantec.com