aquantec

BayernLB

# Aquantec hat die Bayerische Landesbank bei der Software-Architektur einer Bewertungsplattform beraten

**3 Lösungsbausteine**
Datenmodell · Bewertung · Schnittstellen

**1 durchgängige Datenarchitektur**
für Bewertung und Risikomanagement

## Wie die BayernLB mit Aquantec die Bewertungsplattform und Bewertungsalgorithmen für ihr Zinsderivateportfolio auf eine eigenentwickelte, zukunftsfähige technische Basis gestellt hat.

### Ausgangssituation

Die BayernLB mit Sitz in München ist eine Anstalt öffentlichen Rechts und zählt mit einer Bilanzsumme von rund 285 Mrd. Euro zu den größten Banken Deutschlands. Als Mitglied der Sparkassen-Finanzgruppe – im Eigentum des Freistaats Bayern (75 %) und des Sparkassenverbands Bayern (25 %) – ist sie ein führender Unternehmens- und Immobilienfinanzierer und übernimmt die Zentralbankfunktion für die bayerischen Sparkassen.

Für die Steuerung eines Zinsderivateportfolios signifikanter Größenordnung braucht es eine Systemlösung, die sowohl die laufende Bewertung und das Risikomanagement als auch regulatorische Anforderungen abdeckt.

### Beratung

Aquantec hat die BayernLB im Rahmen einer Fachberatung bei der Eigenentwicklung einer Bewertungsplattform für ihr Zinsderivateportfolio unterstützt. Aquantec bringt dabei ausgewiesene fachliche und technische Expertise und langjährige Erfahrung aus der Tätigkeit in Quant- und IT-Teams des Bankensektors ein und verfügt mit **Aquantec Ocean** über eine Plattform, die auch für Bewertung und Risikomanagement im Bankenbereich genutzt wird.

Die Beratungsleistungen umfassten zunächst den Entwurf und die Weiterentwicklung der Anwendungsarchitektur, wobei absehbare künftige Anforderungen an Funktionsumfang, Performance, Anwenderfreundlichkeit, Test- und Wartbarkeit sowie weitere IT-Anforderungen der BayernLB von Anfang an berücksichtigt wurden. Darüber hinaus gehörten Design und Implementierung serviceorientierter, performanter und anpassungsfähiger Workflows zum Leistungsumfang. Ein zentraler Baustein war die Verwaltung und Verarbeitung der Daten, wofür ein effizientes und flexibles Datenmodell samt zugehöriger Datenzugriffsschicht konzipiert wurde. Fachlich im Zentrum stand die Entwicklung der Bewertungsalgorithmen für das Zinsderivateportfolio sowie Export- und Import-Schnittstellen zum Front-Office-System.

Auf Basis eines Prototyps entstand schließlich die Bewertungsplattform, deren Weiterentwicklung Aquantec im Rahmen einer Fachberatung zur Funktionserweiterung begleitete. Im Mittelpunkt stand dabei die Weiterentwicklung der Architektur sowie die Entwicklung einer performanten Risikoanalyse. Ergänzend wurde ein agiles Entwicklungsmodell mit Build-Prozessen, kontinuierlicher Integration (CI) und Sprint-Planung eingeführt. Zusätzlich erstreckte sich die Beratung auf Themen wie Advanced Analytics, die Modellierung von Volatilitätsflächen, die Bewertung von Zins- und FX-Optionsprodukten und die Konzeption eines Sales Clients.

## Aquantec Ocean als Referenzplattform

Aquantec Ocean ist eine modulare Front-to-Back-Software für Cross-Asset-Portfolien, die alle Assetklassen abdeckt und State-of-the-Art-Bewertungsmodelle mit einer hoch performanten Risiko-Engine kombiniert. Die Plattform bildet den gesamten Wertschöpfungsprozess vom Front Office bis zum Back Office, Risk Controlling und Accounting ab – und lässt sich dabei flexibel an die spezifischen Anforderungen jedes Kunden anpassen. Die Funktionalitäten reichen von Portfolio- und Marktdatenmanagement über Pricing und Risikoanalyse bis zu Portfoliosimulation und Reporting und können nahtlos zu einer durchgängigen Gesamtlösung kombiniert werden. Aquantec Ocean unterstützt dabei sowohl die laufende Bewertung und Steuerung des Bestands als auch mehrjährige Projektionen, strategische Asset-Allokationen und Investmentstrategien. Besonderes Gewicht liegt auf der Erfüllung regulatorischer Anforderungen, etwa durch Solvency-II-Auswertungen, ein BaFin-konformes stochastisches Kapitalmarktmodell sowie DORA-konforme, revisionssichere Prozesse.



**Jochen Lohmann**
Senior Sales Manager
jochen.lohmann@aquantec.de | +49 172 2545051

**Aquantec AG**
Bülowstr. 27 | 81679 München | Germany | www.aquantec.com