aquantec

ithuba CAPITAL immigon

Integriertes Portfoliomanagementsystem für eine Abbaubank mit einem großvolumigen, komplexen Portfolio

1 Plattform
für sämtliche Bankgeschäfte
statt paralleler Altsysteme

2 Standards
IFRS + Local GAAP
in einem Hedge-Accounting-Framework

Wie Ithuba Capital AG auf Basis von Aquantec Ocean für die immigon portfolioabbau ag i.A. eine einheitliche Datengrundlage geschaffen hat – und damit Entscheidungen in Risiko, Bewertung und Hedge Accounting schneller, konsistenter und belastbarer macht.

Ausgangslage

Die immigon portfolioabbau ag i.A. ist die Abbaueinheit der ehemaligen Österreichischen Volksbanken AG. Ihre Aufgabe: ein großvolumiges, komplexes Portfolio aus Krediten, Wertpapieren und Derivaten geordnet und regelkonform abzuwickeln – unter den strengen Anforderungen von Aufsicht, Wirtschaftsprüfern und Eigentümern.

Vor der Umstellung stützte sich die Steuerung auf mehrere parallele Alt-Systeme für Marktdaten, Handel, Bewertung, Risiko, Positionsführung und Abwicklung. Diese historisch gewachsene Systemlandschaft erschwerte eine einheitliche, jederzeit konsistente Sicht auf Bestände, Bewertungen und Risiken – eine tägliche Herausforderung gerade bei einem signifikanten Derivatevolumen, das nach IFRS und lokalem GAAP im Hedge Accounting abgebildet werden musste. Jede zusätzliche Schnittstelle bedeutete zusätzlichen Abstimmungsaufwand und ein höheres Risiko widersprüchlicher Datenstände zum Zeitpunkt einer Entscheidung.

Lösung: Ithuba Service auf Basis von Aquantec Ocean

- Ablösung der bisherigen Einzelsysteme durch Aquantec Ocean als einheitliche Cloud-Lösung; Migration des gesamten Portfolios auf die gemeinsame Plattform.
- Neugestaltung des Hedge-Accounting-Framework und Übernahme der laufenden Hedge-Accounting-Berechnungen für die gesamte Bank.
- Outsourcing der operativen Aufgaben an Ithuba Capital: Treasury, Risikomanagement, Back Office, Collateral Management sowie Datenaufbereitung für die Rechnungslegung.
- Ithuba Capital wurde vom Aufsichtsrat zusätzlich als Liquidator bestellt – Fachberatung und operative Umsetzung liegen damit in einer Hand, auf Basis derselben Aquantec-Ocean-Datenbasis.

Mehrwert: bessere Entscheidungsqualität

Der eigentliche Nutzen der Umstellung liegt nicht allein in der Ablösung alter Systeme, sondern in der Qualität der Entscheidungen, die auf der neuen Datenbasis getroffen werden können:

- Eine konsistente Bewertung über alle Produkte hinweg – inklusive strukturierter und illiquider Positionen – auf einer einzigen Plattform ersetzt die bisherige Abstimmung zwischen mehreren Alt-Systemen und reduziert widersprüchliche Datenstände.
- Die integrierte Betrachtung von Markt-, Kredit- und Liquiditätsrisiko schafft eine belastbare Grundlage für Steuerungsentscheidungen im laufenden Abbauprozess – statt isolierter Einzelsichten je Risikoart.
- Ein einheitliches Hedge-Accounting-Framework für Good Bank und Bad Bank nach lokalem GAAP und IFRS sorgt für nachvollziehbare, geprüfte Bewertungsergebnisse – wichtig für Wirtschaftsprüfer, Aufsicht und Gläubiger gleichermaßen.
- Weil Fachberatung (Ithuba) und Systembetrieb (Aquantec Ocean) aus einer Hand kommen, stehen Steuerungsinformationen zeitnah zur Verfügung – Entscheidungen zum weiteren Abbau können auf aktuellen statt nachträglich abgestimmten Daten basieren.

Ergebnisse

- Ithuba Capital als umfassender Outsourcing-Partner für den gesamten technischen Betrieb der Abbaueinheit.
- Aquantec Ocean als Kernsystem für sämtliche Bankgeschäfte der immigon portfolioabbau ag i.A.
- Hedge-Accounting-Services für Good Bank und Bad Bank nach lokalem IFRS und lokalem GAAP – durchgängig, nachvollziehbar und prüfungssicher.

Aquantec Ocean

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 – 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