aquantec

ithuba CAPITAL

Voller One-Stop-Shop-Service für eine Abbaubank mit komplexem Kredit-, Wertpapier- und CDS-Portfolio

50 %
Kostenreduktion

100 % **Bilanzsicht**
Assets + Liabilities + allgemeine Derivate
integriert bewertet

Wie Ithuba Capital AG auf Basis von Aquantec Ocean für die KA Finanz AG eine einheitliche Datengrundlage geschaffen hat – und damit Entscheidungen im Risikomanagement, Portfolioabbau und in der Bilanzsteuerung schneller, konsistenter und belastbarer macht.

Ausgangssituation

Die KA Finanz AG ist aus der Spaltung der ehemaligen Kommunalkredit Austria AG hervorgegangen und war als staatliche Abbaugesellschaft mit dem geordneten Abbau eines umfangreichen Kredit-, Wertpapier- und CDS-Portfolios (Credit Default Swaps) betraut – unter den strengen Anforderungen von Eigentümer, Aufsicht und Wirtschaftsprüfern.

Ein Portfolio dieser Größe und Komplexität – inklusive Kreditausfallversicherungen, laufender Top-up-Positionen und mehrerer tausend Einzelpositionen – verlangt eine durchgängige, jederzeit konsistente Sicht auf Bestände, Bewertungen und Risiken. Fragmentierte Systeme und Schnittstellen erhöhen dabei nicht nur den Abstimmungsaufwand, sondern auch das Risiko, dass Entscheidungen auf uneinheitlichen oder veralteten Datenständen beruhen.

Lösung:

- Bereitstellung von Aquantec Ocean als Kernbankensystem und Migration sämtlicher verbleibender Positionen; Einrichtung aller notwendigen Schnittstellen zu unterstützenden internen und externen Systemen.
- Umfassendes Outsourcing des laufenden Bankbetriebs an Ithuba Capital: Treasury- und Portfoliomanagement, Loan Management und Risikomanagement, weitere Services unter Einbindung von Servicing-Partnern (Back Office & Collateral Management, Accounting, IT).
- Abbauplanung, Portfolioanalyse und Reporting – inklusive Executive Reporting und detaillierten Ergebnissen auf Einzelpositionsebene – sowie Stresstests und Ad-hoc-Simulationen.

Mehrwert: schnellere Handlungsbereitschaft, bessere Entscheidungsqualität

Der eigentliche Nutzen der Umstellung liegt nicht allein in der Ablösung alter Systeme, sondern in der schnellen Verfügbarkeit relevanter Informationen und der Qualität der Entscheidungen, die

auf der neuen Datenbasis getroffen werden können:

- Eine vollständige, konsistente Bewertung der gesamten Bilanz – inklusive aller Assets und Liabilities sowie des komplexen CDS-Portfolios – ersetzt fragmentierte Einzelsichten und reduziert widersprüchliche Datenstände.
- Reporting vom Executive-Level bis zur einzelnen Position gibt Vorstand, Aufsichtsrat und Eigentümer eine gemeinsame, nachvollziehbare und konsistente Entscheidungsgrundlage – von der strategischen Steuerung bis ins operative Detail.
- Stresstests und Ad-hoc-Simulationen erlauben es, die Auswirkungen von Marktentwicklungen und Steuerungsmaßnahmen vorab durchzuspielen – Entscheidungen können vorausschauend statt reaktiv getroffen werden.
- 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

- Neugestaltung der gesamten IT-Infrastruktur passend zu den reduzierten Anforderungen des Abbaugeschäfts und -portfolios.
- Standardisierung und Straffung der Geschäftsprozesse mit spürbarer operativer Kostenreduktion.
- Umfassende Bewertung der gesamten Bilanz inklusive sämtlicher Assets und Liabilities.

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 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