aquantec

PROVINZIAL

Zweitgrößter öffentlicher Versicherer Deutschlands steuert Kapitalanlage mit Aquantec Ocean

€ 44 Mrd.
Kapitalanlage
auf gemeinsamer Steuerungsbasis

10+ Jahre
im produktiven Einsatz
und kontinuierlich weiterentwickelt

Wie die Provinzial Holding AG mit Aquantec Ocean ökonomische und bilanzielle Bewertung, Risiko- und Investitionscontrolling sowie die Solvency-II-ORSA-Berichterstattung auf eine gemeinsame Basis stellt.

Ausgangssituation

Die Provinzial Holding AG mit Sitz in Münster ist der zweitgrößte öffentliche Versicherer Deutschlands und verwaltet eine Kapitalanlage von rund 44 Mrd. Euro. Der Konzern ist 2020 aus der Fusion der Provinzial NordWest und der Provinzial Rheinland hervorgegangen und gehört zur Sparkassen-Finanzgruppe.

Für die Steuerung eines Kapitalanlageportfolios dieser Größenordnung braucht es eine Systemlösung, die sowohl die ökonomische als auch die bilanzielle Perspektive abdeckt – von der laufenden Bewertung über Risiko- und Investitionscontrolling bis zu den wachsenden regulatorischen Anforderungen aus Solvency II, insbesondere dem Own Risk and Solvency Assessment (ORSA). Mit der Fusion zur neuen Provinzial Holding kam zudem die Anforderung hinzu, die bestehende Systemlandschaft flexibel in eine neue, komplexere Konzernstruktur einzubinden.

Lösung - Aquantec Ocean für Kapitalanlagesteuerung und Solvency-II-Reporting

Die Provinzial verwendet Aquantec Ocean bereits seit 2012 und hat die Zusammenarbeit seither zu einer laufenden Entwicklungspartnerschaft ausgebaut – getrieben von steigenden regulatorischen Anforderungen sowie der fortlaufenden Anpassung interner Prozesse und Automatisierungen in den Investmentstrategien. Die zentralen Einsatzgebiete bei der Provinzial umfassen:

- Ökonomische und bilanzielle Bewertung sowie Risiko- und Investitionscontrolling für die Aktivseite
- Portfolio-Simulationen für GuV-Schätzungen und Kapitalplanung
- Solvency II – Own Risk and Solvency Assessment (ORSA)
- Buchhaltungsroutinen für Fondsstrukturen
- Umsetzung von Regeln für kundenspezifische Handelsstrategien
- Spezialisierte Berichte für die versicherungsaufsichtsrechtliche Berichterstattung
- Beantwortung von Ad-hoc-BaFin-Anfragen

Umsetzung

Die Provinzial ist seit 2012 Lizenzkunde von Aquantec Ocean mit rund 10 Anwendern und hat die Zusammenarbeit im Rahmen einer laufenden Entwicklungspartnerschaft kontinuierlich weiterentwickelt. Eine besondere Bewährungsprobe bestand darin, Aquantec Ocean in eine komplexe, gewachsene Systemlandschaft einzubinden – darunter SimCorp Dimension, die FIS Insurance Risk Suite und Igloo. Auch die Fusion zur neuen Provinzial Holding stellte die Anpassungsfähigkeit der Software auf die Probe.

Mehrwert: bessere Entscheidungsqualität

Der eigentliche Nutzen liegt nicht allein in der Bereitstellung einer weiteren Systemkomponente, sondern in der Qualität der Entscheidungen, die auf einer gemeinsamen Datenbasis getroffen werden können. Mit Aquantec Ocean verfügt die Provinzial über eine zentrale Informationsquelle für den Vorstand, die ökonomische und bilanzielle Steuerung gleichzeitig abbildet – ein Wettbewerbsvorteil gerade in einem Umfeld wachsender regulatorischer Anforderungen. Die Integration in eine komplexe Systemlandschaft sowie die Bewährung vor und nach der Fusion mit der Provinzial Rheinland haben zugleich die analytische Flexibilität und Anpassungsfähigkeit der Software unter Beweis gestellt.

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 hoch performante 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 von antizipierten Marktentwicklungen dynamisch umgeschichtet wird.



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

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