

Unternehmenspräsentation

finius.

IHR PROFESSIONELLER PARTNER
FÜR DIE FINANZINDUSTRIE



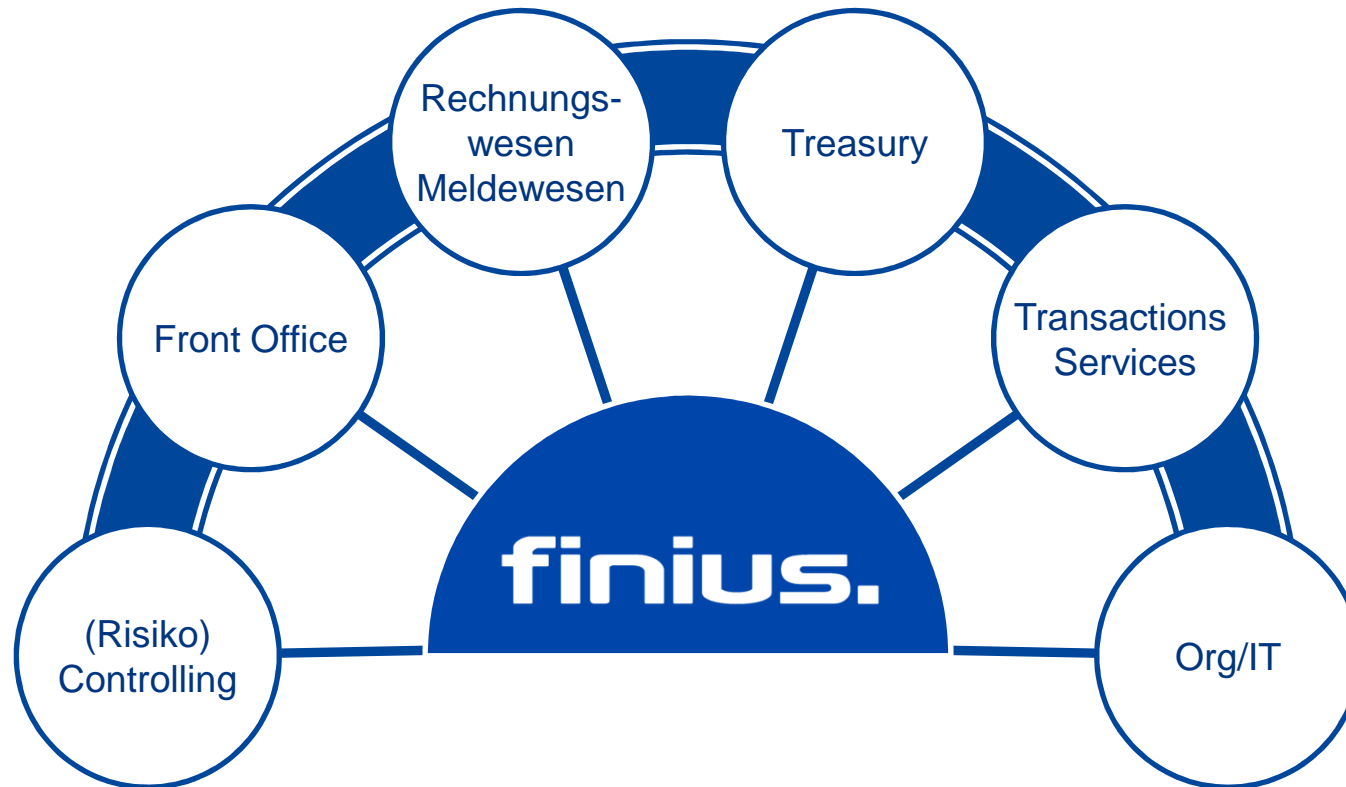
finius GmbH gehört zum Verbund der finius-Gruppe

Zusammengesetzt aus unabhängigen Gesellschaften mit unterschiedlichen Spezialisierungen, bietet diese einen Beraterpool mit insgesamt über 300 Experten

	 human resources unlimited		 INNOVECS :TIME :BUDGET :QUALITY
Fachliche Schwerpunkte <ul style="list-style-type: none"> • Risikomanagement • Investment Banking • Projektrealisierungen 	Fachliche Schwerpunkte <ul style="list-style-type: none"> • Betreuung von Handelssystemen • Rekrutierung hoch qualifizierter IT-Fachkräfte 	Fachliche Schwerpunkte <ul style="list-style-type: none"> • Risiko- und Treasurymanagement • Aufsichtsrecht und Bilanzierung 	Fachliche Schwerpunkte <ul style="list-style-type: none"> • Wertpapier, • Zahlungsverkehr • Kredit
Geschäftsführung Erwin Kaliski Corinna Stellfeldt Jürgen Lindner	Geschäftsführung Christian Culver John King Andrew French	Geschäftsführung Dr. Peter Bartetzky	Geschäftsführung Thomas Reinecke Jörg Tietjen
Gründung 2000	Gründung 2002	Gründung 2004	Gründung 2006
Umsatz 2010: 16,5 Mio. € 2011: 15,7 Mio. €	Umsatz 2010: 5,5 Mio. € 2011: 6,0 Mio. €	Umsatz 2010: 3,7 Mio. € 2011: 4,0 Mio. €	Umsatz 2010: 3,0 Mio. € 2011: 3,0 Mio. €

Optimale Know-how-Bündelung & erprobte Zusammenarbeit

finius bietet Lösungskompetenz mit thematischer Spezialisierung



» Wir konzentrieren uns auf
unsere Kernkompetenz «

Unique Selling Proposition der finius: Senior Banker für Konzeption bis Umsetzung

- Fast alle Berater mit Bankhintergrund
- Konsequente Kundenorientierung
- Reibungslose Kommunikation

Wir sind Banker



- Sehr viele Berater mit langjähriger Berufserfahrung
- Überwiegend leitende Positionen bei Kreditinstituten
- Schnelle Einarbeitung in alle Projekte

Wir sind Seniors



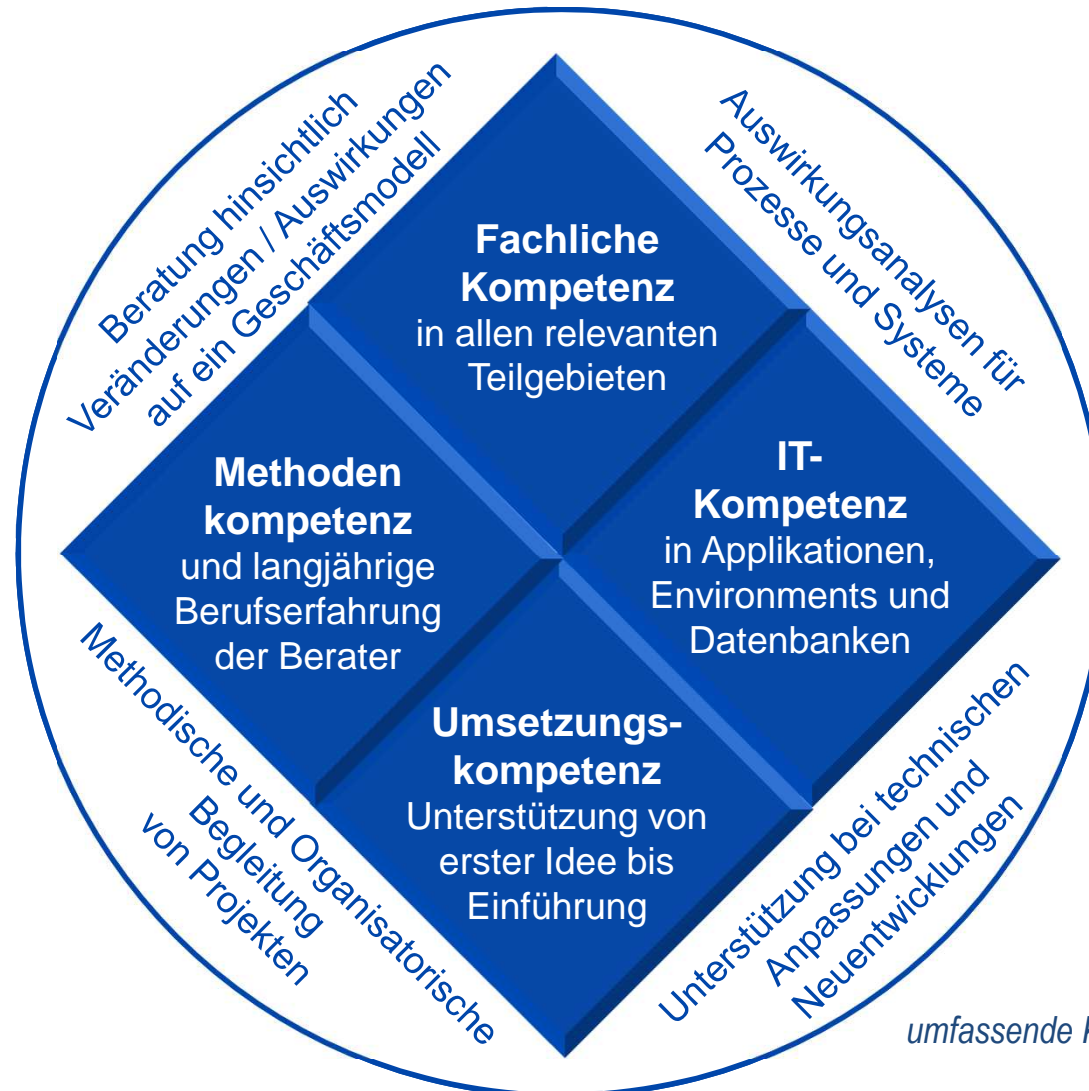
- Mehrfachspezialisierung vieler Mitarbeiter
- Konzeptionelles, bankfachliches und IT-spezifisches Know-how
- Profunde Erfahrung im Projektmanagement

Wir realisieren Projekte
von Fachkonzeption
bis IT-Umsetzung



» Einzigartiger Hintergrund macht uns stark
und Ihre Projekte erfolgreich «

finius verbindet umfassende Lösungskompetenz mit fundiertem Fach-, IT und Methoden-Know-how



» Unsere Erfahrung und umfassende Kompetenz sprechen für sich «

Auszug aus unserer Referenzliste

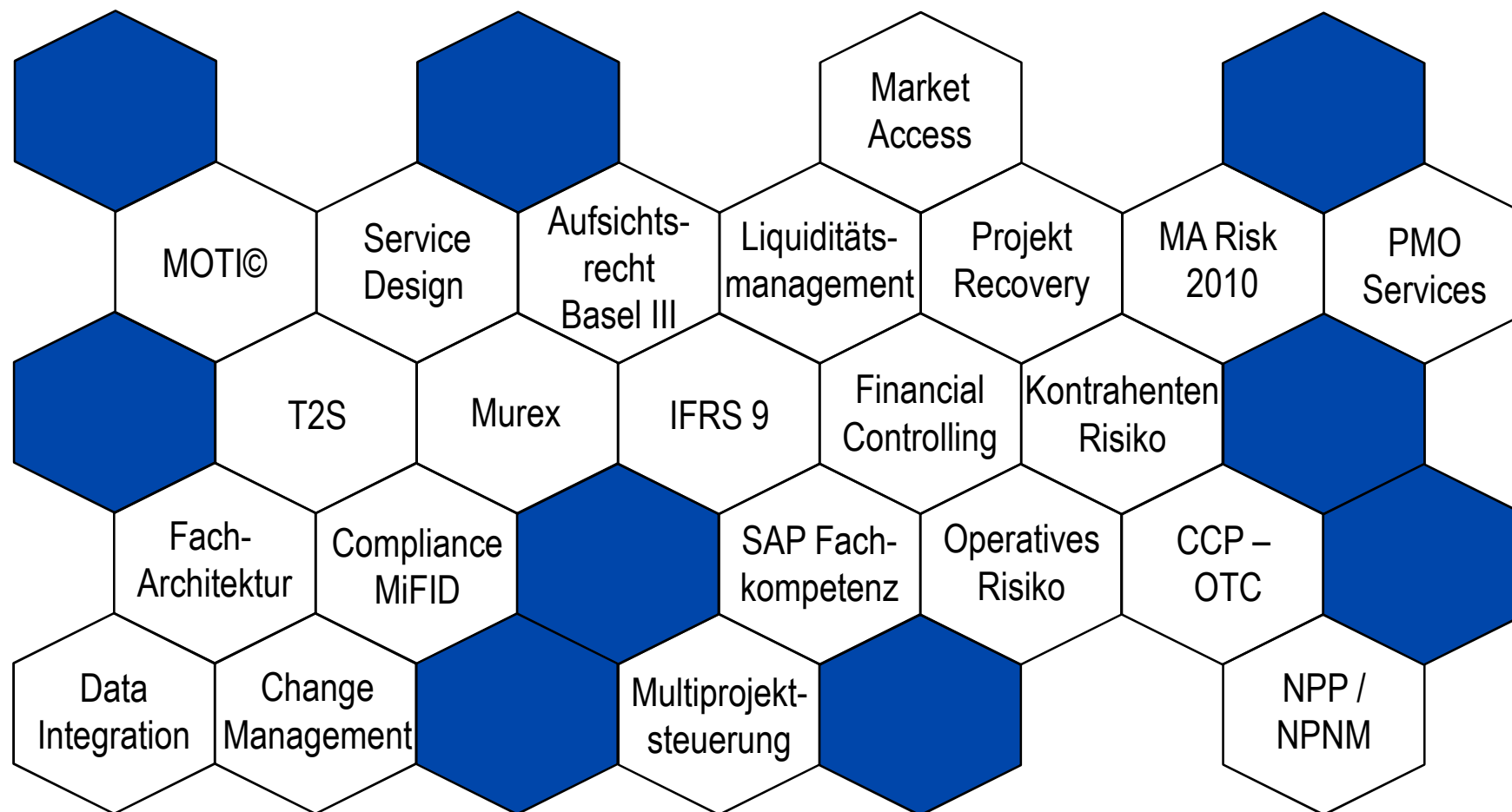


die besondere Kompetenz

Leistungsportfolio / Themenschwerpunkte (Auszug)

finius.

Ausgewählte Themenkompetenz: Kompetenter Ansprechpartner rund um den Lifecycle



Basel III – mehr als nur Erfüllung regulatorischer Anforderungen

Kerninhalte

- Erfüllung der neuen aufsichtsrechtlichen Anforderungen „Basel III: A global regulatory framework for more resilient banks and banking systems“ und „International framework for liquidity risk measurement, standards and monitoring“
 - Überarbeitete Eigenkapitaldefinition
 - Erhöhung der Mindesteigenkapitalquoten
 - Behandlung von systemrelevanten Banken
 - Verschärfung der Regelungen für das Handelsbuch
 - Einbezug Liquiditätsrisiko
 - Erhöhung der qualitativen Anforderungen an das Risikomanagement
- Nutzung der Umsetzung zur:
 - strategischen Stärkung/Neuausrichtung
 - Senkung der Kosten der Refinanzierung, Liquiditätsvorsorge
 - Synergien zur Rechnungslegung, Risikomanagement, NPNM

Ziel- und Leitbild

- Auf die jeweiligen Kundenbedürfnisse zugeschnittene Best-Practice-Lösungen
- Kostengünstige Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen zum individuell bestmöglichen Zeitpunkt
- Nutzung der Lösungen zur Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen als Basis für Projekte zur
 - Senkung der Refinanzierungs- und Liquiditätskosten
 - Erzielung von Zusatzerträgen
 - Hebung von Synergien im Rahmen der Gesamtbanksteuerung und der Rechnungslegung

Hauptprobleme in der Praxis

- Datenhaushalte lückenhaft im Hinblick auf die Anforderungen
- Ungleiche Umsetzungsstände der bisherigen regulatorischen Anforderungen in den einzelnen Konzernteilen
- Zahlreiche bestehende Workarounds erhöhen die Aufwände in der Umsetzung
- In Konkurrenz zu anderen Projektvorhaben bei knappen Budgets

Liquiditätsrisikomanagement – Neue Sicht auf ein ureigenes Bankrisiko

Kerninhalte

- Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen aus den MaRisk und den Sound Practices for Managing Liquidity in Banking Organisations
- Nutzung der methodischen Fortschritte zur Senkung der Kosten für Liquiditätsvorsorge und Refinanzierung sowie Erzielung von Zusatzerträgen aus Liquiditätsfristentransformation

Ziel- und Leitbild

- Auf die jeweiligen Kundenbedürfnisse zugeschnittene State-of-the-Art-Lösungen
- Kostengünstige Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen
- Nutzung der Lösungen zur Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Anforderungen als Basis für Projekte zur Senkung der Liquiditätskosten und zur Erzielung von Zusatzerträgen

Hauptprobleme in der Praxis

- Noch keine Standards für Methoden des Liquiditätsrisikomanagements und -controllings
- Aufbau- und Ablauforganisation nicht auf das Liquiditätsrisikomanagement ausgelegt
- Zur Zeit keine leistungsfähigen Systeme am Markt verfügbar
- Datenhaushalte lückenhaft im Hinblick auf Anforderungen des Liquiditätsrisikomanagements

Market Access – high performance to all markets for all traders

Kerninhalte

- Anbindung von Kreditinstituten an Börsen, ATS, ECN und andere Handelsplätze
- Anbindung von Informationsdiensten
- Entwicklung und Konnektierung von Applikationen für spezielle Handelsaktivitäten
- Implementierung von Handelssystemen mit direktem Marktzugang
- Implementierung von Orderrountingsystemen

Ziel- und Leitbild

- Bei der Anbindung an einen Handelsplatz geht es um:
 - Sicherstellung des Gesamtprozesses von der Ordereingabe bis zur Lieferung
 - Schnelligkeit der Orderübertragung an den jeweiligen Markt (Highest Performance)
 - Handelsstrategien effizient zu ermöglichen (z.B. Algorithm Trading, Arbitrage Trading)
 - Gewährleistung aller Vorgaben des Handelsplatzbetreibers / des Gesetzgebers

Hauptprobleme in der Praxis

- Gesamtprozess Front- to Backoffice oft nicht im Fokus bei der Anbindung neuer Märkte
- Orderrouting: Umsetzung der Anforderungen aktueller gesetzlicher Regelungen (z.B. MiFID)
- Informationsbereitstellung für Mid- und Backofficeprozesse
- Sicherstellung der Performanceanforderungen bei Erweiterung der Marktanbindungen
- Sicherstellung der Vorgaben der Märkte (z.B. Autorisierungsvorgaben für Händler)

Murex – Vollversorgung rund um den Handelssystemmarktführer

Kerninhalte

- Einführung von Murex
- Implementation von neuen Funktionalitäten / Produkten in das System Murex
- Entwicklung von Auswertungen für das „regulatorische Reporting“
- Projektleitung / Management Support
- Produktions- / Betriebsführung vom Handelssystem (Unix, Sybase, Applikation)

Ziel- und Leitbild

- Langjährige und enge Zusammenarbeit mit dem Hersteller
- Verlässlicher Partner für die Banken
- Aufgrund unserer Marktkenntnisse sind wir in der Lage, den Banken Mitarbeiter mit dem richtigen Skillset zur Verfügung zu stellen
- Europaweite Abdeckung unserer Services

Hauptprobleme in der Praxis

- Hersteller liefert nicht zuverlässige Releases
- Freie Mitarbeiter sind nicht immer in der gewünschten Qualität vorhanden
- System ist hochkomplex und hat eine Fülle von Funktionalitäten
- Herstellersupport verläuft zuweilen schleppend
- Software ist nicht immer auf den neuesten Stand der Technik

DQM – „If you can't measure it, you can't manage it“

Kerninhalte

- Aufbau einer funktionierenden Data Governance Organisation
- Datenqualität messbar machen durch Entwicklung einer Data Quality Scorecard
- Geschäftsbezogener Ansatz mit Betrachtung des business impact schlechter Datenqualität
- Einführung eines DQ management framework
- Ausrichtung der IT Infrastruktur auf unternehmensweite Datenqualität

Ziel- und Leitbild

- Schaffung einer soliden Entscheidungsbasis für die Unternehmensstrategie
- Erfüllung von Compliance Standards und regulatorischer Anforderungen
- Stärkung des Vertrauens in Analysesysteme
- Drastische Reduktion von Reconciliation und Korrekturaufwänden
- Verbesserung des time to market von IT Systemen

Hauptprobleme in der Praxis

- Keine zentrale Definition und Verwaltung von Metadaten
- Datenverantwortlichkeit nicht klar definiert
- Prozesse und Rollen unklar
- Fehlende Beschreibung von Businessregeln
- Daten und Informationen werden oft fälschlicherweise als ein reines IT Thema angesehen

Data Integration – Reinvent the datawarehouse

Kerninhalte

- Entwicklung einer Integrationsarchitektur
- Modellierung fachlicher building blocks
- Einführung eines Master Data Management
- Isolierung und Zentralisierung von Integrationslogik aus Reports und Interfaces
- Aufbau von Integration Competence Centers

Ziel- und Leitbild

- Trennung von Data Integration und Datawarehouse
- Single version of truth
- Near-time Datenbereitstellung
- Think big, start small – Projektierung einzelner fachlicher building blocks
- Decoupling durch Kommunikation über non-proprietäre Strukturen

Hauptprobleme in der Praxis

- Vielfach redundante Integrationslogik unterschiedlich implementiert
- Redundante und inkonsistente Erfassung von Masterdaten
- Großer Zeitverzug in der Informationsbereitstellung
- Enorme Reconciliation Aufwände
- Rapide steigende Integrationskosten

Compliance / MiFID – Chancen wahrnehmen

Kerninhalte

- MiFID bietet die Gelegenheit sich intensiv mit den Kunden auseinanderzusetzen und neue Ertragspotenziale zu erschließen
- Customer Due Dilligence setzt intelligente Lösungen voraus, die effizient arbeiten

Ziel- und Leitbild

- Compliance-Anforderungen chancenorientiert umsetzen
- Synergien mit anderen Anforderungen und internen Verfahren identifizieren und heben
- Compliance systemgestützt mit Hilfe von geeigneten Verfahren effizient implementieren

Hauptprobleme in der Praxis

- Regulatorische Anforderungen sind nicht immer genau kompatibel
- Überschneidungen mit anderen Themen werden meistens negiert und dies führt zu Ineffizienzen
- Regelbasierte Compliance Systeme identifizieren zu viel Items, die keine Verdachtsfälle sind

SAP Competence – der kritische Punkt Ihrer SAP-Einführung

Kerninhalte

- Strategic SAP Consulting
Unterstützung bei Analyse von Anforderungen und Entwicklung eines fachlichen Modells bzw. einer IT-Zielarchitektur
- SAP Solution Architecture & Delivery Consulting
Unterstützung bei Erstellung des Solution Blueprints und der Umsetzung von SAP-Lösungen bei der Erweiterung und Integration von Geschäftsprozessen, Anwendungen und Technologie

Ziel- und Leitbild

- Bewertung von Business-Anforderungen und Evaluierung unterschiedlicher Szenarien
- Konzeption von Architekturen und Lösungsszenarien in heterogenen IT- und Prozessumgebungen
- Gestaltung von SAP-spezifischen Roadmaps über den gesamten Projektlebenszyklus

Hauptprobleme in der Praxis

- SAP Banking® ist wesentlicher Bestandteil in vielen Bank-Infrastrukturen bzw. Architekturen:
- Kosten- und Wettbewerbsdruck durch digitale Vernetzung, sinkende Margen sowie zunehmende Globalisierung der Märkte
- Handlungsdruck durch aufsichtsrechtliche Vorgaben wie IAS und Basel II
- Ein Schlüssel zum Erfolg: Konsistente Daten, durchgängiger Informationsfluss

Operationelles Risiko – mehr als nur Erfüllung regulatorischer Anforderungen

Kerninhalte

- Optimierung der G&V-Ergebnisse durch die effektive Reduzierung von operationellen Risiken und Verlusten
- Identifizieren von institutsinternen Potenzialen durch Synergie mit anderen Funktionen
- Erfüllung regulatorischer Anforderungen (Solvabilitätsverordnung, MaRisk)

Ziel- und Leitbild

- Auf die Kultur eines Institutes maßgeschneiderte best practice Lösungen
- Umsetzung aus der Managementsicht: Die Instrumente sollen alle das Management der operationellen Risiken unterstützen
- Die Implementierung eines OR-Managements trägt zum Schutz des Ratings bei, reduziert Kundenbeschwerden und steigert die Mitarbeiterzufriedenheit

Hauptprobleme in der Praxis

- Die bestehenden Systemlösungen haben meistens den Anschluss an die heutigen Anforderungen verloren
- Das Management operationeller Risiken ist oftmals nicht in bestehende Prozesse integriert
- Die Umsetzung des OR-Managements stößt an die Grenzen der Unternehmenskultur
- Die Abnahme durch die Aufsicht ist noch nicht standardisiert

Financial Controlling – Performance-Orientierung im Geschäftsbereich

Kerninhalte

- Planung und Berichterstattung konzentrieren sich auf das Wesentliche
- Notwendige Konflikte im Unternehmen werden thematisiert
- Neben der strukturierten Information wird der Austausch von Erklärungen und Erläuterungen gefördert
- Persönliche Verantwortung für die Berichterstattung wird gestärkt

Ziel- und Leitbild

- Planung setzt an der Unternehmensstrategie auf
- Die laufende Berichterstattung ist daran ausgerichtet, das Unternehmen auf Kurs zu halten
- Planung und Berichte sind verständlich, handlungsorientiert und schnell verfügbar
- Die Dienstleistung bei der Steuerung des Unternehmens steht im Vordergrund

Hauptprobleme in der Praxis

- Mangelnde Akzeptanz, wegen unverständlicher und zu abstrakter Systeme
- Durch anonyme Berichtssysteme wird das Verantwortungsbewusstsein nicht gefördert
- Planungen und Berichte sind zu wenig zielorientiert

MOTI©: Das Tool, das komplexe Sachverhalte durch Simulation greifbar macht. Und besser entscheidbar.

Kerninhalte

- Simulationsbasierte Risikoanalysen auf Basis von Verteilungen, bei denen ungünstige Ereignisse und Steuerungsmaßnahmen berücksichtigt werden
- Breites Einsatzgebiet durch durchgehende Methodik: Cases reichen von Ertragsprognosen bei Veränderung der Zinsstrukturkurve über operationelle Risiken bis hin zu Potenzialanalysen, Investitionen und Steuerung von komplexen Projekten

Ziel- und Leitbild

- Die Wahrscheinlichkeit, mit der bestimmte Vorgaben, Ziele oder Verluste erreicht werden, ist Entscheidern und Projektleitern bekannt und transparent
- Aussagekräftige Risikoanalysen werden standardmäßig zur Vorbereitung wesentlicher Entscheidungen durchgeführt
- Vollständige Dokumentation der relevanten Annahmen und Bewertungen liegt vor

Hauptprobleme in der Praxis

- Planungen und Kalkulationen sind nicht fundiert/ verlässlich, da unsichere Einflussfaktoren/ Risiken nicht adäquat berücksichtigt werden (nur Durchschnittswerte, wenige Szenarien...)
- Nur unzureichende Transparenz und Nachvollziehbarkeit bei wichtigen Annahmen
- Keine Ansätze und Tools für aussagekräftige, flexible Risikoanalysen, die zudem auch praktikabel sind (z.B. durch Mitarbeiter ohne Spezialkenntnisse schnell einsetzbar)



Erfolg in verschiedensten Aufgabenstellungen

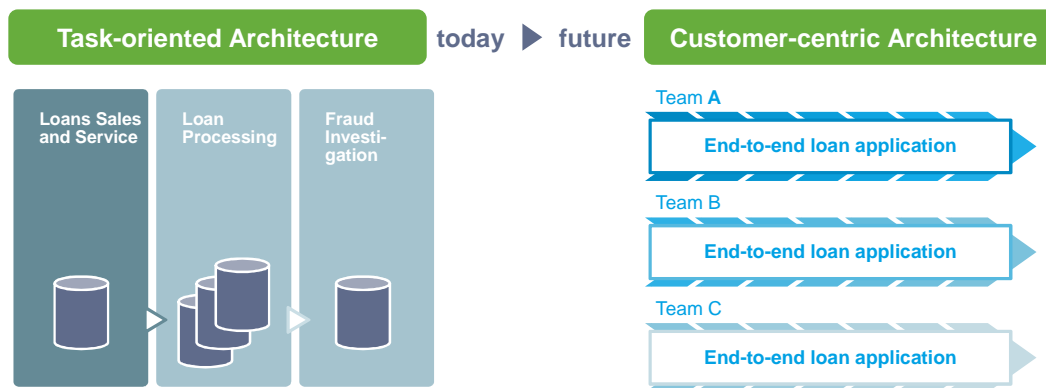
Referenzprojekte (Auszug)

finius.

Optimierung Kreditantragsprozess und Reorganisation Kreditbereich

Fachliche Beschreibung

- Ziel: Verbesserung der Buchungsquote bei genehmigten Krediten durch verkürzte Durchlaufzeiten und verbesserte Kundenbetreuung
- Erhebung der Ist-Prozesse und Identifikation der Erfolgstreiber
- Ermittlung der Verbesserungspotentiale hinsichtlich Aufbau- und Ablauforganisation sowie der Systemlandschaft
- Entwicklung der Business-Cases, der notwendigen Veränderungsanforderungen sowie der Erfolgsmessungsinstrumente
- Anpassung des Reportings für Arbeitssteuerung und Management
- Design der neuen Prozesse & Aufbauorganisation
- Begleitung der Reorganisation inkl. Umzug in neue Büroflächen



Technische Beschreibung

- Kreditbasissystem mit
 - webbasierter Kundenschnittstelle,
 - Unterstützungssystemen zur Dokumentenverwaltung und Betrugsprävention sowie
 - Schnittstellen zu externen Systemen (u.a. SCHUFA)
- SAS & MS Excel
- AMADEE 3.0®

Rahmendaten

Dauer	5 Monate
Umfang	250 Personentage
Rolle	fachliche Konzeption, Servicedesign & ext. Programm Management
Kunde	Direktbank
Status	Erfolgreich abgeschlossen

Project Recovery – Einführung F-IRB

Fachliche Beschreibung

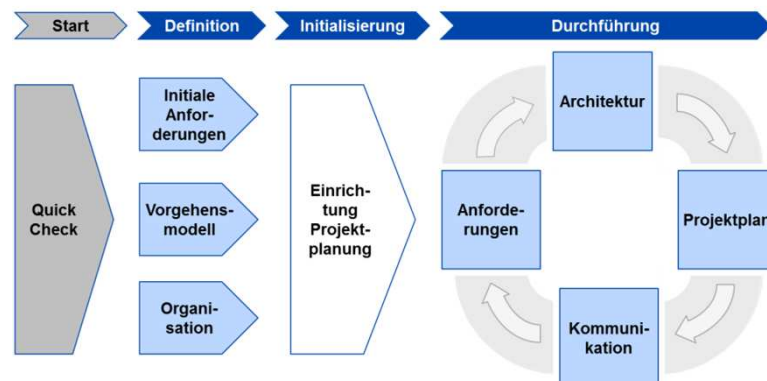
- Durchführung Quick Check für Bestandsaufnahme und Entscheidungsvorlage für das weitere Vorgehen
- Erarbeitung der inhaltlichen Anforderungen (in scope / out of scope) unter Berücksichtigung der Machbarkeit innerhalb der zeitlichen Rahmenbedingungen
- Erarbeitung Vorgehensmodell
- Erarbeitung tragfähige Projektorganisation
- Erarbeitung Projektplanung
- Aufsatz kontinuierliche Projektarbeit

Technische Beschreibung

- Legacy Systeme auf AIX
- SAP Module FI, CO, LM, GM
- SAS Detail Data Store for Banking
- SAS Enterprise Guide
- SAS Enterprise Miner
- SAS RMfB, CRM, CSS
- SAS Dataflux

Rahmendaten

Dauer	6 Wochen
Umfang	84 Personentage
Rolle	Business Analyse fachlicher Coach Projektleiter Spezialist Projektplanung und –management Coach Projektteam
Kunde	Finanzdienstleiter
Status	Erfolgreich abgeschlossen



Bestandsmigration zweier Banken

Fachliche Beschreibung

- Aufnahme und Abgleich der Arbeitsablaufprozesse im Front Office beider Banken
- Unterstützung bei der Auswahl der Zielsysteme für die Investment Bank
- Konzeption, Abstimmung und Einführung der zukünftigen Prozesse im Handelsbereich
- Zusammenführung und Bereinigung der (bilateralen) Wertpapierhandelspositionen
- Unterstützung der technischen Migration von Handelspositionen
- Konzeption und Durchführung manueller Migrationen von sensiblen Handelspositionen

Technische Beschreibung

- Testkonzepte für manuelle Migration in den Front Office Systemen

Rahmendaten

Dauer 12 Monate
Umfang 400 Personentage
Rolle Unterstützung von Capital Markets während der gesamten Migrationsphase
Kunde Großbank
Status Erfolgreich abgeschlossen

Vorstudie zum Handeln von Commodities

Fachliche Beschreibung

- Research bzgl. des potentiellen Hedgingbedarfs von Preisänderungsrisiken bei Rohwaren
- Analyse der spezifischen Marktusancen im Commodityhandel (physische Lieferung etc.)
- Produktspezifikation für OTC und Listed Derivatives mit dem Underlying Gas, Öl und Frachtraten
- Identifikation von aussagefähigen, belastbaren Marktdaten und deren Anbietern
- Entwurf, Abstimmung und Einführung eines Interimsprozesses für den Handel mit dezidierten Commodityderivaten
- Konzeption & Einführung eines teilmanuellen Prozesses für die Abwicklung dieser Geschäfte und die Integration der Daten im Meldewesen, Accounting und Reporting (inkl. § 9 WPHG)
- Einführungsseminare über Commodities und Commodityderivate für die administrativen Fachbereiche

Technische Beschreibung

- Prüfung der Abbildbarkeit von Commodities in den vorhandenen Systemen der Bank
- Auswahlverfahren eines qualifizierten STP Systems im Rahmen bankinterner Vorgaben
- Systemunterstützung des Meldewesens nach § 9 WpHG aus Kiodex, SX n. SAMBA

Rahmendaten

Dauer 8 Monate
Umfang 140 Personentage
Rolle fachliche Konzeption & Koordination
Kunde Landesbank
Status Erfolgreich abgeschlossen

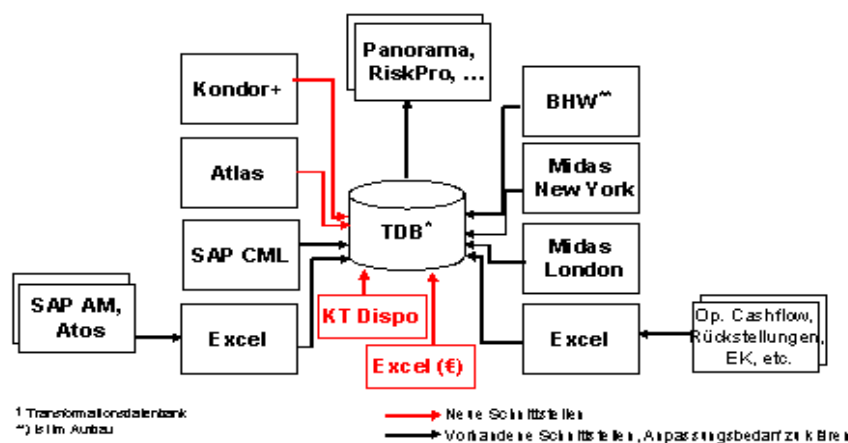
Zügige Fachkonzeption Steuerung/ Risikocontrolling Liquiditätsrisiko/ MaRisk

Fachliche Beschreibung

- Ist-Aufnahme der Prozesse und Verfahren zur Liquiditätssteuerung
- Erstellung eines Fachkonzeptes / Erfüllung der gesetzlichen und regulatorischen Anforderungen (MaRisk)
- Durchführung fachlicher Workshops
- Grobkonzeption einer Reportinglinie für Liquiditätsrisiken und eines technischen Umsetzungsplans
- Erstellung einer Management Summary zur Abstimmung der Ergebnisse der Vorstudie

Technische Beschreibung

- System
Panorama
RiskPro
Kondor+
- Datenbank
Oracle (Server)



* Transaktionsdatenbank
** in Aufbau

Rahmendaten

Dauer 2,5 Monate
 Umfang 76 Personentage
 Rolle Projektleitung
 Konzepterstellung
 Durchführung der Workshops
 Kunde Große Retailbank
 Status Erfolgreich abgeschlossen

Einführung einer Produktdatenbank mit integriertem Workflow-Tool

Fachliche Beschreibung

- Konzeption, Abstimmung, Aufsetzen und der zukünftigen Produktdatenbank für
 - Financial Markets-,
 - Kredit-,
 - Einlagen und
 - Dienstleistungsprodukte
- Migration der Daten inkl. Konsolidierungsrunden
- Aufnahme und Abgleich der vorhandenen Genehmigungsprozesse im „Neue Produkte Prozess“
- Definition, Optimierung und Abstimmung des zukünftigen Genehmigungsprozesses auf
 - die Bedürfnisse der Bank
 - die Kompatibilität mit dem System
- Definition von Verantwortlichkeiten und Prüfalgorithmen im zukünftigen Prozess
- Harmonisierung und Zusammenführung der unterschiedlichen Systeme auf ein Zielsystem

Technische Beschreibung

- Erstellung von Fachkonzepten
- Erstellung der Zielprozesse
- Systemeinführung von Interexa FPC
- Erstellung Testkonzept
- Abnahmetest
- Administration des Systems

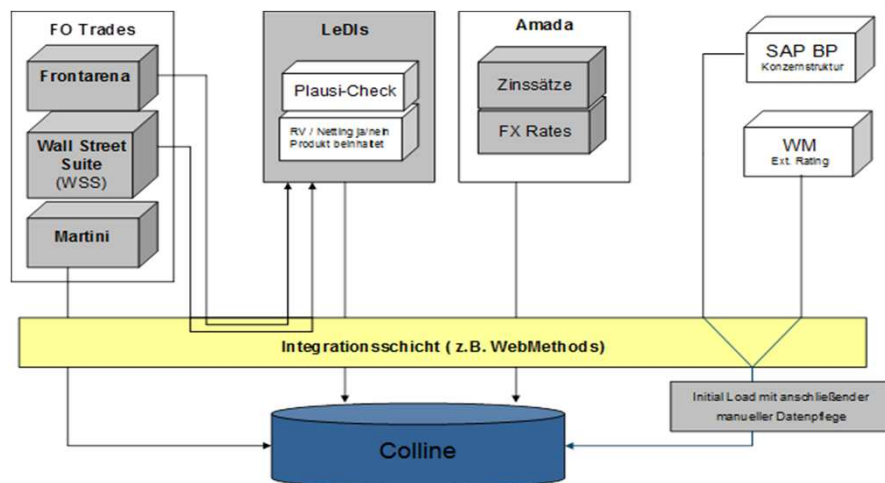
Rahmendaten

Dauer	1,5 Jahre Projekt und 3 Monate Support
Umfang	1000 Personentage
Rolle	Umsetzungsprojekt
Kunde	Landesbank
Status	Erfolgreich abgeschlossen

Optimierung der Collateral Management Prozesse / Einführung von Colline

Fachliche Beschreibung

- Erhebung der banktypischen Anforderungen an ein bilaterales Collateral Management (CM) für Repos, Wertpapierdarlehen und OTC Derivate
- Aufbereitung der bilateralen vertraglichen Grundlagen im CM differenziert nach dt. Rahmenvertrag (DRV) oder GMSLA, GMRA nach internationalem Recht
- Identifikation der bestandsführenden Front Office Systeme, Spezifikation der benötigten Geschäftsdaten, Aufbau der Aggregation zu Kreditnehmereinheiten
- Aggregation der Einzeltrades pro Gattung, Parametrierung und Initialbefüllung des Collateral Managementsystems Colline von LombardRisk London
- Aufsetzen des Dashboards für Margin Calls & die Workflowfunctions in Colline



Technische Beschreibung

Colline:

- JAVA J2EE
- Oracle 11g
- Microsoft SQL Server 2005/2008
- Windows 2003
- Web-Frontend

Rahmendaten

Dauer	5 Monate
Umfang	100 Personentage
Rolle	fachliche Konzeption & Projektleitung für die IT/Org
Kunde	Großbank
Status	Erfolgreich abgeschlossen

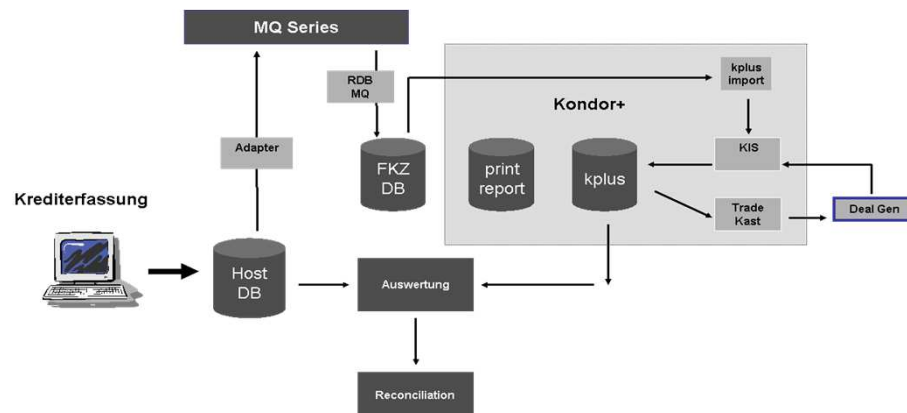
Erfolgreiche Einführung Funds Transfer Pricing System („Risikodrehscheibe“)

Fachliche Beschreibung

- Aufbau integrierter Datenbestand zur Nutzung durch Handel, Risikocontrolling, Controlling
- Zerlegung der Geschäfte nach den Bedürfnissen von Handel, Treasury, und ggf. Credit-Treasury
- Trennung in Risikoelemente Zins und Liquidität: Positionsdarstellung, Ergebnis-, Risikobeitrag
- Die Risikodrehscheibe spaltet die Positionen auf Einzelgeschäftsebene auf
- Für Inventarisierung und Risikomanagement von embedded Derivatives werden zusätzliche Prozesse aufgebaut

Technische Beschreibung

- Adapter
MQSeries, C++
- FZK Server
C, Shell, SQL, Sybase ASE 12.x
- Fremdsoftware
Kondor+ 2.0, 2.5, 2.6
- Operating Systems
Unix



Rahmendaten

Dauer	10 Monate
Umfang	ca. 1.200 Personentage
Rolle	Projektleitung Fachkonzeption Umsetzung
Kunde	Landesbank
Status	Erfolgreich abgeschlossen

Einführung Exchange Traded Derivatives für Privatkunden

Fachliche Beschreibung

- Herausstellung der Haftungskette gegenüber den Kunden und dem General Clearer beim Handel von Derivaten an geregelten Börsen im In- und Ausland
- Unterstützung bei der Definition der notwendigen Regeln & Prozesse, die für den Kundenhandel mit Derivaten zwingend notwendig sind
- Identifikation der prozessualen Schnittstellen zwischen Kundenmanager, Order Aufgabe, PreOrder Check, Order Routing, Order Execution und Confirmation,
- Inhouse Abwicklung der Börsengeschäfte, tägl. Reconciliation mit dem GCM, Buchung im Kundendepot u. Kernbanksystem, Belieferung des Meldewesens
- Anbindung der Bank an einen General Clearer (GCM), der den Kunden der Bank den Handel an der EUREX, der CME und der OCC ermöglicht
- Konfiguration der Kontenstruktur (Omnibus Account & Segregated Accounts)
- Unterstützung beim Aufbau der Datenstrecke - Übermittlung der Order via Fix Protocol, automatische Durchleitung an die Börse und Rücklauf der Execution
- Testkonzeption, Testplanung und Testdurchführung für die gesamte neu aufgesetzte Prozesskette
- Schulung der neuen Prozesse für Front- und Back-Office Mitarbeiter

Technische Beschreibung

- Kernbanksystem OLYMPIC von eRI Bancaire
- Erweiterung eines Inhouse Kundenverwaltungssystems um Order Routing Funktionen
- Bi – direktionale Datenübertragung zw. GCM und Bank via Fix Protocol
- Anpassungen in Abacus
- Anpassungen in Flex Finance von Fernbach

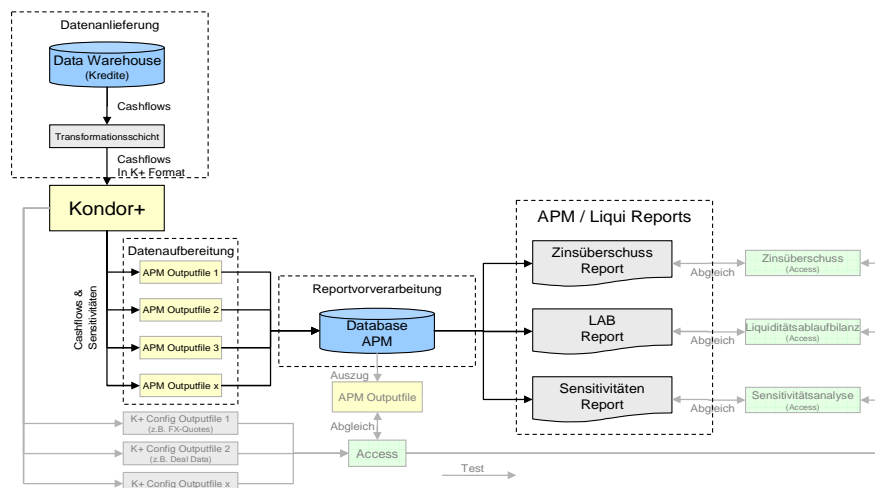
Rahmendaten

Dauer	6 Monate
Umfang	160 Personentage
Rolle	fachliche Konzeption & Koordination
Kunde	Luxemburger Tochter einer dt. Großbank
Status	Erfolgreich abgeschlossen

Erfolgreiche Einführung Reporting Zins- und Liquiditätsrisikomanagement

Fachliche Beschreibung

- Definition der fachlichen Anforderungen an das Zins- und Liquiditätsrisiko-Reporting in Zusammenarbeit mit Treasury
- Erstellung des Fachkonzeptes inkl. Umsetzung und Test
- Entwicklung der Reports für
 - Zinsüberschussprognose
 - Liquiditätsablaufbilanz
- Konzeptionierung der Datenanlieferung, -aufbereitung und Reportvorverarbeitung



Technische Beschreibung

- Systeme
 - Kondor+
 - Kreditsystem
 - Data Warehouse
 - NumeriX
- Anwendungen
 - Excel, Access, Sybase

Rahmendaten

Dauer 12 Monate
 Umfang 600 Personentage
 Rolle Projektleitung
 Konzepterstellung
 Umsetzung und Test
 Kunde Spezialbank
 Status Erfolgreich abgeschlossen

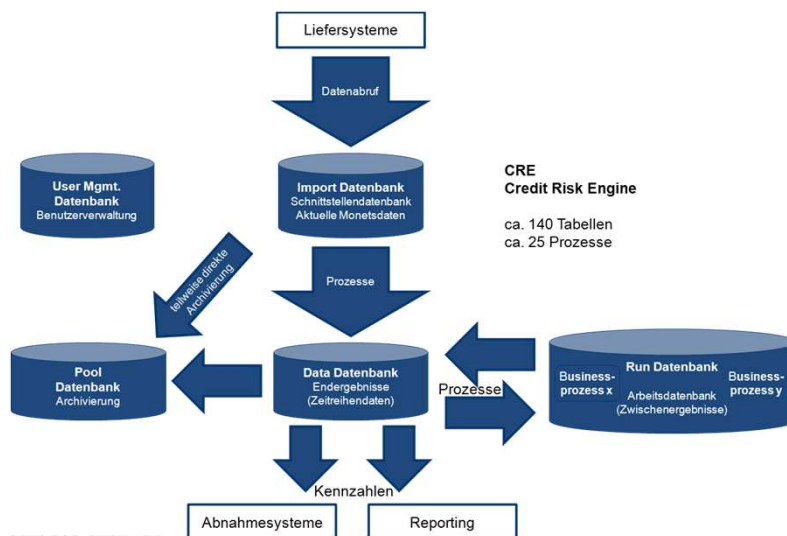
Reibungsloser Aufbau der Credit Risk Engine in einer Großbank

Fachliche Beschreibung

- Die Credit Risk Engine (CRE) dient zur Erstellung
 - des monatlichen Reportings des Kreditrisikos (Credit Value at Risk)
 - von Kennzahlen für Kreditrisikosteuerung (für Messung + Vertrieb)
- Weitere Funktionen der CRE ist die Sammlung und Aufbereitung der bestehenden Kreditrisikodaten (Kunden, Geschäfte, PDs, etc.)
- Fachliche Steuerung der CRE erfolgt über GUI
- Für eine What-if-Analyse wird ein Szenariorechner zur Verfügung gestellt

Technische Beschreibung

- Programmiersprache SQL (Datenbank) und C++ (Rechenkern)
- GUI Java Server Pages
- Application Server Websphere
- Datenbank Sybase (Server), MS Access (Client)
- Plattform Sun Solaris



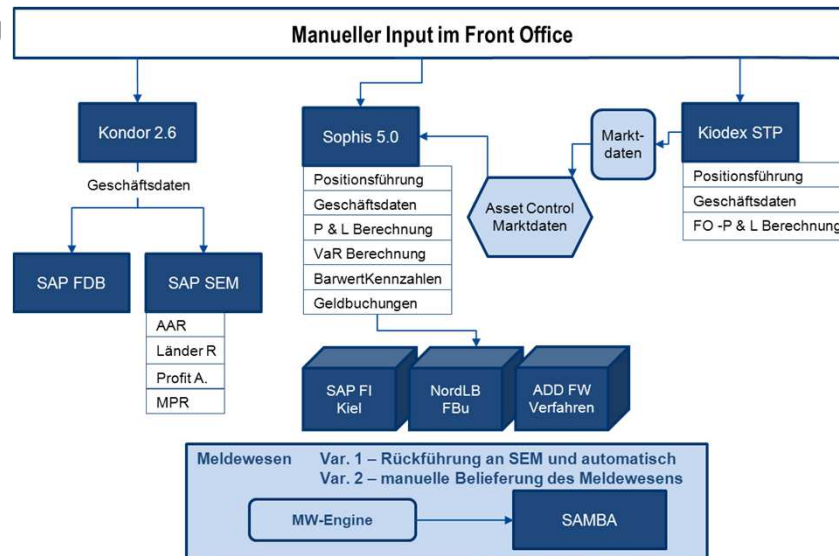
Rahmendaten

Umfang	4.000 Personentage
Rolle	Projektleitung Technische Umsetzung
Kunde	Großbank
Status	produktiv (und in Weiterentwicklung)

Einführung Commodity-System

Fachliche Beschreibung

- Fachkonzeptionen für den Commodityhandel für
 - Front Office
 - Back Office
 - Marktpreisrisiko (VaR)
 - System- & Modellvalidierung
- Administrative Unterstützung des internen Projektleiters
- Fachliche Konzeption und technische Umsetzung der Schnittstellen
- Testkoordination für alle Instrumente von Front-Office bis Meldewesen / Accounting



Technische Beschreibung

- Systemeinführung von Sophis Risque 5.0
- Systemparameterisierung für Commodity- Derivate auf Öl, Gas und FFA's
- Anbindung an die Marktdatenversorgung
- Datenübertrag an SAP, Ledis, Sentry, Kondor etc.

Rahmendaten

- Dauer 6 Monate
- Umfang 360 Personentage
- Rolle fachliche u. technische Umsetzung
- Kunde Landesbank
- Status Erfolgreich abgeschlossen

Einführung eines Aktienderivatesystems

Fachliche Beschreibung

- Fachkonzeptionen für den Aktienderivatehandel für
 - Front Office
 - Back Office
 - Marktpreisrisiko (VaR)
 - System- & Modellvalidierung
 - Adress- und Kontrahentenrisiko
- Technische Projektleitung
- Fachliche Konzeption und technische Umsetzung der Schnittstellen

Technische Beschreibung

- Systemeinführung von Sophis Risque 4.5.1
- Systemparameterisierung für Aktienderivate
- Marktdatenanbindung an Realtime und AssetControl
- Preisversorgung von Kondor, SAP-SEM,
- Parametrisierung des Sophis-VaR-Moduls

Rahmendaten

Dauer 7 Monate Einführung und 5 Monate Support
Umfang 1000 Personentage
Rolle Umsetzung Gesamtprojekt
Kunde Landesbank
Status Erfolgreich abgeschlossen

Vielen Dank für Ihre Aufmerksamkeit!

finius.

Kontakt – Ihre Ansprechpartner der finius GmbH



finius GmbH
Limburger Straße 22
61462 Königstein
<http://www.finius.de>
Telefon (+49) 6174 20390-0
Telefax (+49) 6174 20390-29

Erwin Kaliski
Geschäftsführung

Mobil (+49) 170 422 39 45
Erwin.Kaliski@finius.de

Jürgen Lindner
Geschäftsführung

Mobil (+49) 151 151 35 036
Juergen.Lindner@finius.de

Corinna Stellfeldt
Geschäftsführung

Mobil (+49) 151 151 35 039
Corinna.Stellfeldt@finius.de