

Referenzen

Tailor Made Software

München, Oktober 2015

Referenz – Energieversorger

Hintergrund

- DEVnet wurde beauftragt die Marktdaten-Infrastruktur des Handelsbereichs eines Energieversorgers aufzubauen und die bestehenden Systeme zu konsolidieren

Herausforderungen

- Entwicklung und Implementierung einer Marktdatenbank-Infrastruktur für Marktdaten und abgeleitete Daten für Commodities, FX, Zinsen und Energie
- Datenerfassung und -speicherung von ca. 200 externen und zusätzlichen internen Datenfeeds
- Gewährleistung von Data Compliance bei Datenanbietern und Usern

Strategie

- Implementierung einer 3-schichtigen Infrastruktur: ein Datenprovider-Hub, eine zentrale Datenhaltung und eine Datenzugriffsschicht
- Design und Entwicklung einer Feed-Factory, die nahtlos in das Job-Control System integriert werden kann
- Entwicklung von effizienten und wiederverwendbaren Datenvalidierungstechniken bieten ein hohes Maß an Anpassungsmöglichkeiten für individuelle Nutzer

Ergebnisse

- Signifikante Reduktion von Support-Kosten
- Kürzere Time-to-Market Intervalle für die Integration von zusätzlichen Funktionen durch den Einsatz der Mehrweg-Architektur



Data Value Chains



Business Analytics



Application Ecosystems



Managed Services

Referenz - Assetmanager

Hintergrund

- DEVnet agierte als exklusiver IT-Partner für alle Fragen im Bereich Softwareentwicklung und -infrastruktur für den Assetmanager

Herausforderungen

- Neuentwicklung einer Risikomanagement-Plattform parallel zu der Integration der bereits existierenden Systeme im Portfolio-Management und Accounting
- Erstellung einer quantitativen Entwicklungsumgebung zur flexiblen Integration neuer Bewertungsmodelle und Quant-Analytics

Strategie

- Design, Entwicklung und Betrieb eines Risikomanagementsystems inkl. UCITS IV Anlagegrenzprüfungen und einer Value-at-Risk Engine auf Basis von .NET, MatLab, RabbitMQ und MongoDB
- Aufbau einer zentralen, versionierten und historisierten Datenbank für Stamm-, Instrument-, Markt-, Emittenten- und Kontrahentendaten. Umsetzung der notwendigen Adapter zu den Marktdatenanbietern Bloomberg, MarkIT und Morningstar
- Bereitstellung einer flexiblen Konfigurationsmöglichkeit für die Value-at-Risk Engine und deren Backtesting- und Stresstesting-Module

Ergebnisse

- Abdeckung kombinierter Portfolio- und Risikomanagement-Anforderungen, die nicht durch ein standardisiertes off-the-shelf Produkt unterstützt werden
- Optimale Time-to-Market von Quant-Modellen durch unmittelbare Auslieferung in das System
- Die Plattform unterstützt einen Quant-Entwicklungsprozess zum Erstellen von MatLab Pricing Modellen, die direkt im Live-System verwendet werden können und über Excel/VBA integriert sind



Data Value Chains



Business Analytics



Application Ecosystems



Managed Services

Universalbank -
Täglicher Ausweis der
P&L aller weltweiten
Handelstätigkeiten einer
Universalbank

Referenz – Universalbank

Hintergrund

- DEVnet wurde für die Entwicklung einer Reporting-Softwareplattform beauftragt, die täglich die konsolidierte und qualitätsgesicherte P&L Analyse ausweist.

Herausforderungen

- Reporting der offiziellen P&L für alle weltweit getätigten Handelstätigkeiten
- Tägliche Erstellung einer P&L Explanation auf Basis von Griechen, Marktdaten und zusätzlichen Positionsbewertungen sowie taggleiche Abschätzung der P&L zum Handelsschluss
- Unterstützung verteilter Korrektur- und Sign-Off Prozesse über die weltweiten Lokationen hinweg

Strategie

- Entwicklung einer Reportinglösung und eines auf Microsoft Business Intelligence basierenden Datawarehouse, auf die u.a. über eine Excel/Access API zugegriffen werden kann
- Einbau der Identifikation und eines detaillierten Reportings der hauptsächlichen Risikofaktoren in das P&L Explanation Modul. Risikofaktoren waren u.a. Wechselkurse, Zinsraten/-kurven, Volatilitäten, Kreditrisiken, Aktienkurse sowie Dividendenvorhersagen

Ergebnisse

- Das System ist flexibel um Kennzahlen für neue Analysezwecke erweiterbar
- Einfache und schnelle Einbindung zusätzlicher Systeme bezüglich Schnittstellen und Abbildung von Datenfeldern



Data Value Chains



Business Analytics



Application Ecosystems



Managed Services

Clearinghaus -
Implementierung einer
zentralen Architektur für
das Risikomanagement

Referenz - Clearinghaus

Hintergrund

- DEVnet wurde durch das Tier 1 Clearinghouse aus Deutschland mit der Gestaltung und Implementierung einer zentralen Risikomanagement-Architektur für die Integration von Preisbildungs- und Risikoanalysen beauftragt

Herausforderungen

- Reduzierung operativer Risiken
- Verringerung von Kosten und Time-to-Market
- Ausarbeitung einer zukunftsfähigen Lösung

Strategie

- Für diese Aufgabe wurde ein umfassender agiler Softwareentwicklungsprozess unter Verwendung der „Turnkey Solution“ von DEVnet angewandt
- Automatisierung der Geschäftsprozesse auf Basis einer eigenständig entwickelten Software-Architektur basierend auf den Technologien: MatLab, JEE, Oracle DB und Google Protocol Buffer/AMQP
- Neugestaltung und Optimierung funktionaler Prototypen für Preisbildungs- und Risikoanalysen mit Hilfe von MatLab-basiertem DSL

Ergebnisse

- Tägliche Bereinigung der Marktdaten für das zentrale Risiko- und Portfoliomanagementsystem
- Skalierung der Risikomanagementstruktur und Reduzierung operativer Risiken
- Einführung eines neuen Produktverfahrens für die Bearbeitung von mehr als 200 Prozessschritten in einer wizard-basierten Workflow-Struktur



Data Value Chains



Business Analytics



Application Ecosystems



Managed Services