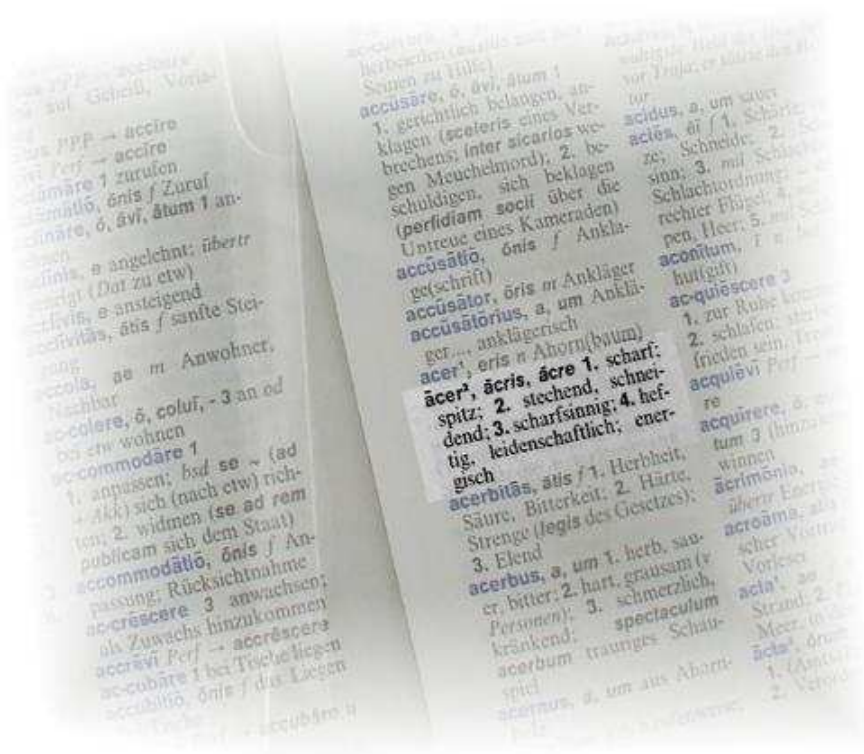


Marktdatensysteme

ACRYS CONSULT



Inhalt

Überblick	3
Referenzen.....	4
Unser Leistungsangebot.....	5
Kontakt.....	6

Überblick

Marktdaten sind integraler Bestandteil des Datenhaushaltes der Kreditinstitute, die in vielen Bereichen – wie z.B. Handel, Risikocontrolling, statistischen Abteilungen – von eminenter Wichtigkeit sind. Durch die Einführung von umfassenden Risikocontrolling-Systemen ist der Bedarf an einer konsistenten Marktdatenversorgung in den letzten Jahren noch größer geworden, was auch in der Erfüllung externen Bestimmungen begründet ist.

So fordern die „Verlautbarungen über Mindestanforderungen an das Betreiben von Handelsgeschäften der Kreditinstitute“ des Bundesaufsichtsamtes für das Kreditwesen vom 23.10.1995 bezüglich der Marktgerechtigkeit: „Die internen Kontrollstellen haben zu überwachen, dass die Geschäftsabschlüsse den zum Abschlusszeitpunkt der Geschäfte üblichen Marktbedingungen entsprechen.“

Des weiteren heißt es im Kontext Marktpreisrisikoerfassung: „Die Handelspositionen sollen täglich zu Marktpreisen bewertet werden.“

Diesen Aspekten kann in effizienter Weise durch die Implementierung eines zentralen Marktdatensystems Rechnung getragen werden.

Zudem sind die strategischen Vorteile ein wichtiger Entscheidungsgrund:

- Verminderung der Schnittstellen von informationsliefernden und -abnehmenden Systemen
- Vereinfachung und Standardisierung der Arbeitsabläufe für die Pflege, Verwaltung und Überwachung der Marktdaten
- Durch einen zentralen Marktdatenpool ist eine einheitliche Sichtweise der Positionen der Bank möglich.

Grundlage eines Marktdatensystems ist die Datensammlung. Bereits hier wird die Bandbreite des Themas deutlich. Die Selektion der Datengruppen (Preise, Zinsen, Kurse, volkswirtschaftliche Daten, etc.) und ihre Spezifika (Frequenz, Aktualität, etc.) rückt die fachlichen Anforderungen in den Fokus der Vorüberlegungen zu einem Marktdatensystem.

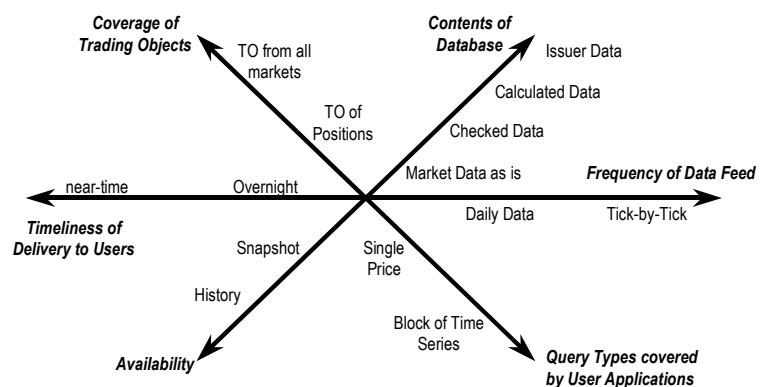


Abbildung 1: Übersicht über die für ein Marktdatensystem relevanten Strukturierungskategorien

Nur durch eine ganzheitliche Betrachtung von fachlichen und technischen Anforderungen kann eine sinnvolle Systemauswahl getroffen werden.

So erfordert die Bereitstellung statistischer Daten für eine zentrale Research-Abteilung andere IT-Strukturen als eine Online-Marktdatenversorgung für mehrere Handelssysteme.

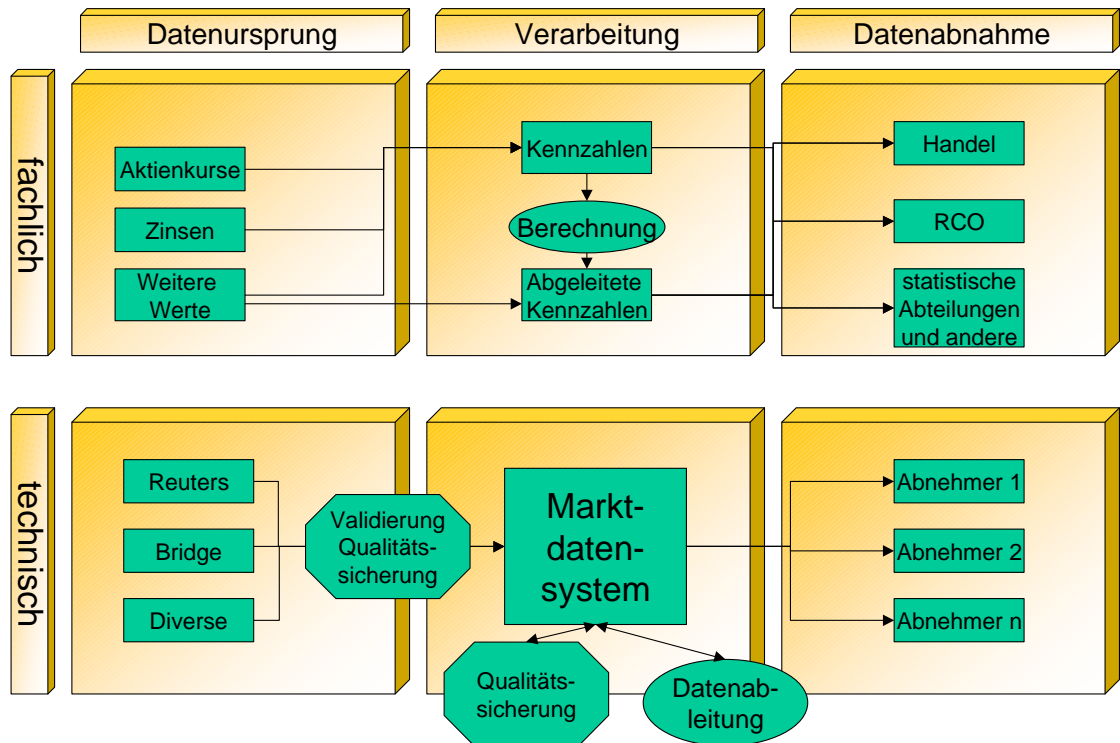


Abbildung 2: Selektion, Verarbeitung, Verteilung aus fachlicher und technischer Sicht

Referenzen

Acrys Consult greift auf weitreichende Erfahrungen aus der Konzeptionierung und dem Betrieb von Marktdatensystemen mit unterschiedlichem Fokus zurück.

Zudem begleiteten wir Kunden sowohl beim Aufbau selbstentwickelter Systeme, als auch bei der Software-Einführung von am Markt etablierten Standards (z.B. AssetControl, Fame).

Die HypoVereinsbank AG und die Dresdner Bank AG haben wir umfassend bei Konzeption und Implementierung ihrer Marktdatensysteme begleitet.

Unser Leistungsangebot

Unsere inhaltlichen Beratungsschwerpunkte und Kompetenzen zu Marktdatensystemen bzw. Marktdatenversorgung umfassen:

- Projektmanagement (Planung, Steuerung, Monitoring, Reporting) für die „Implementierung eines Marktdaten-Systems“, Koordination mit betroffenen Einheiten
- Fachliche Anforderungsanalyse
- Definition von Anforderungen für Fremdsoftware auf Grundlage der fachlichen und technischen Anforderungen
- Analyse der aktuellen und historischen Datenquellen (z.B. XETRA, EUREX, Reuters)
- Technische Konzeption der Datenversorgung
- Aufbau der notwendigen IT-Struktur:
 - Tool-Selektion / Technische Installation (Support)
 - Systemarchitektur bei Eigenentwicklung
 - Schnittstellen / Sicherstellung Datenanbindung
 - Historisierungskonzepte
 - Ausfallsicherheit
- Erstellung von Filter- und Validierungsfunktionen im Rahmen der Qualitätssicherung
- Unterstützung bei der Implementierung von Algorithmen zur Gewinnung von abgeleiteten Daten
- Konzeption der Abbildung von komplexen Produkten (Volatilitätsflächen, Zinskurven)

Kontakt

Management

Acrys Consult GmbH & Co. KG

Barbara Dilges-Maruska

+49 69 24 45 06 16

Barbara.Dilges-Maruska@acrys.com

www.acrys.com