



sparkassen.bip

Rollout Banksteuerung
und wie geht es weiter
Thomas Becker, Marilen Jahnke

Wie es begann, ...

Sprinter Gesamtbanksimulation

Flächenumstieg GBS

26.09/2023

Kick-off
Sprinter



12/2023

13 First
movers



11./12.03/2024

Lessons
Learned Sprinter



03/2024¹

Umstiegs-
tranche



04/2024¹

Umstiegs-
tranche



05/2024¹

Umstiegs-
tranche



06/2024¹

Umstiegs-
tranche



09/2024

Vorbereitung
IRRBB

11/2024

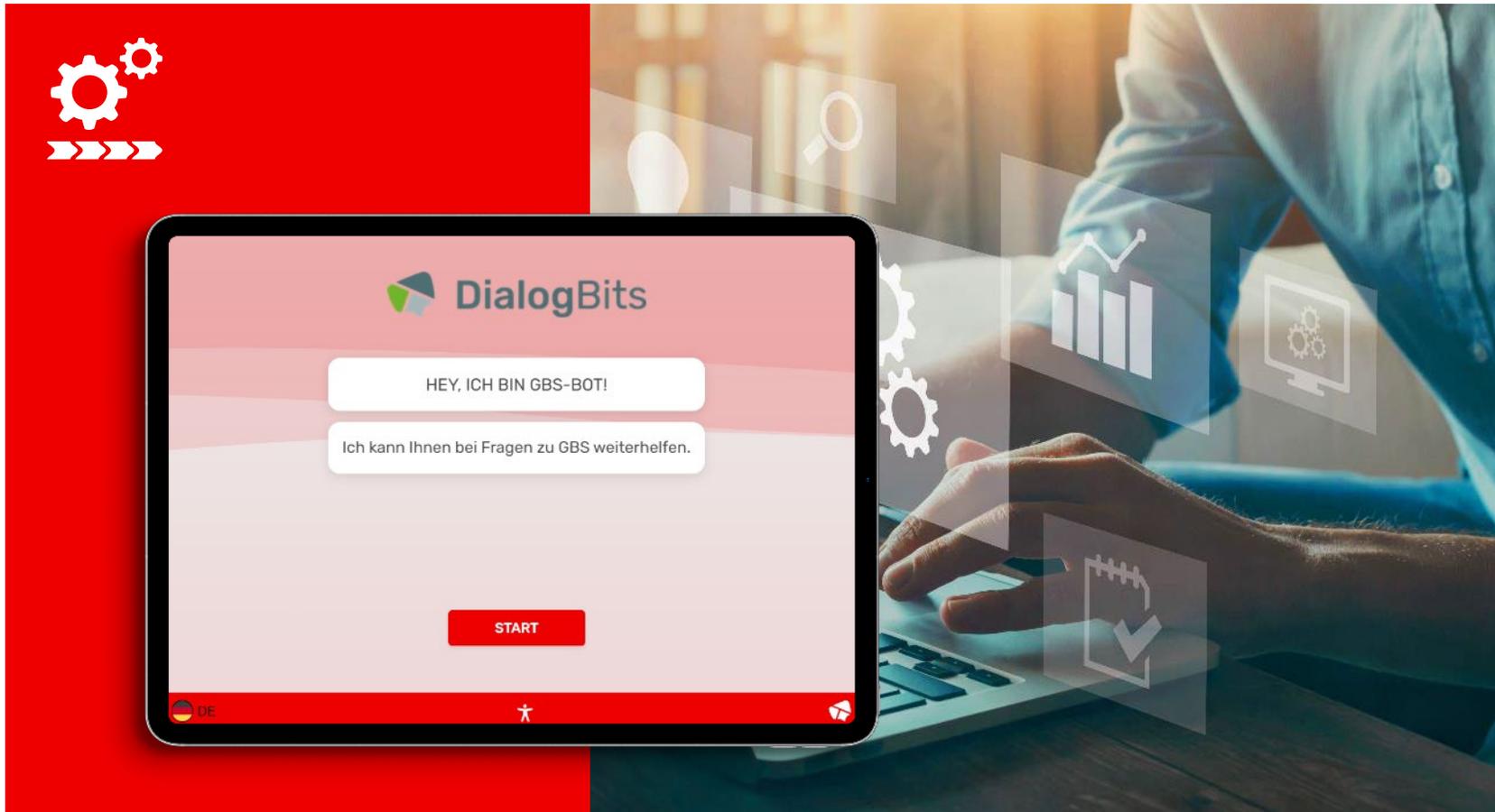
Meldung
IRRBB

Rollout Neue
SCD-Module

Als Zinsänderungsrisiko
(Interest Rate Risk in the
Banking Book/**IRRBB**),
bezeichnet man das Risiko
aus der Veränderung von
Zinsen am Geld- und
Kapitalmarkt.

¹ Auswertungsmonat

... und dann kam der GBS-BOT der Vorläufer des S-K/Pilot

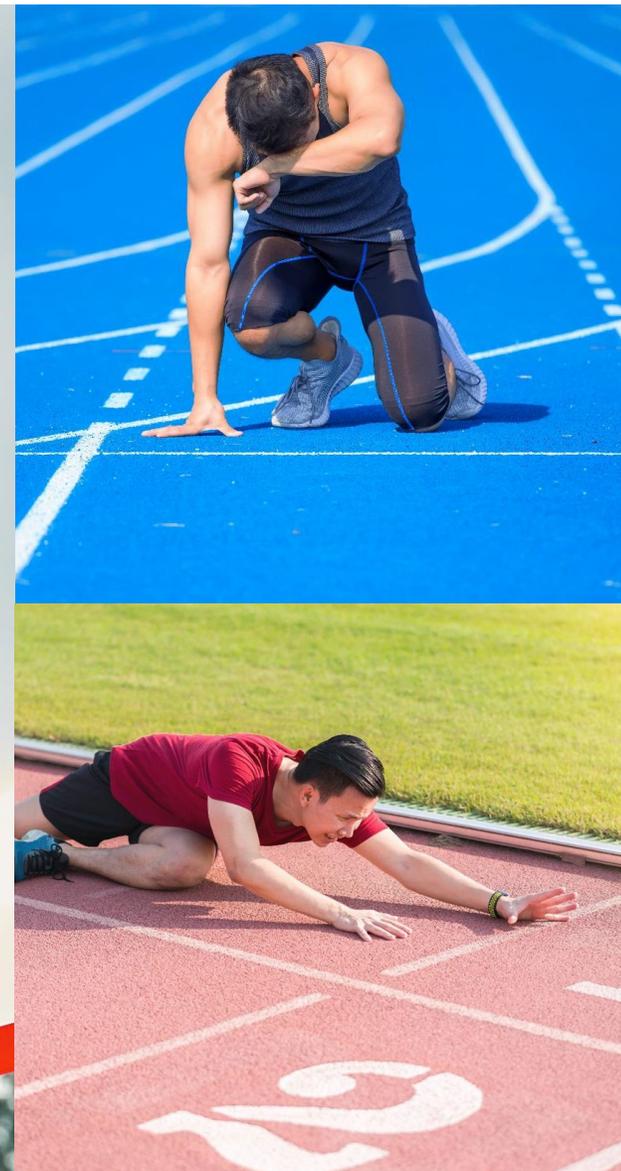
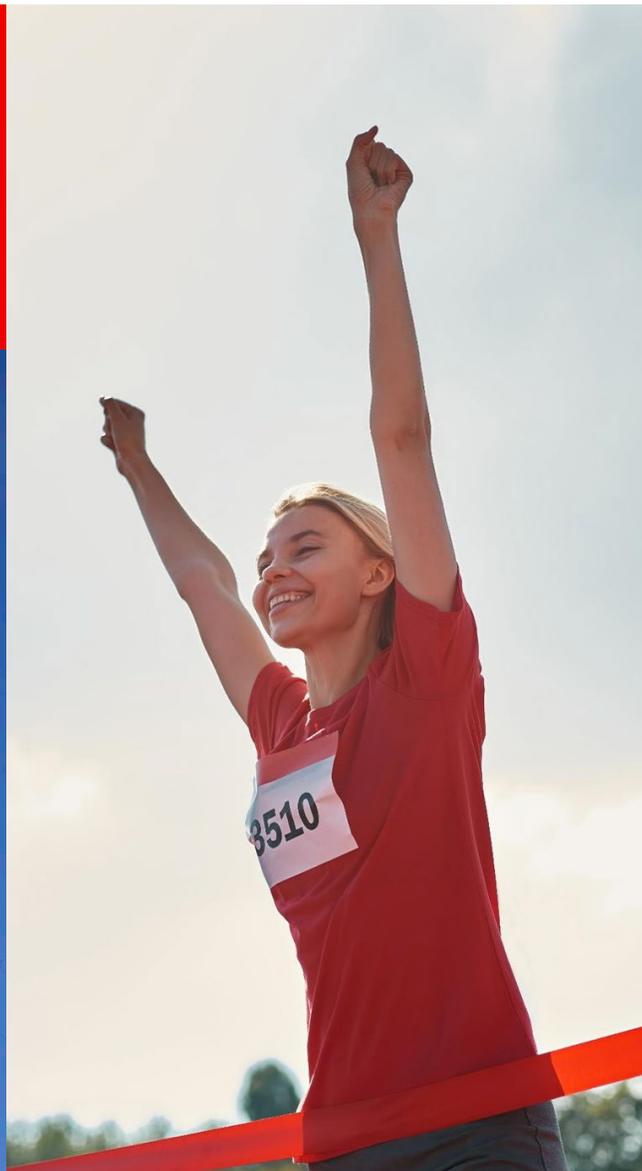
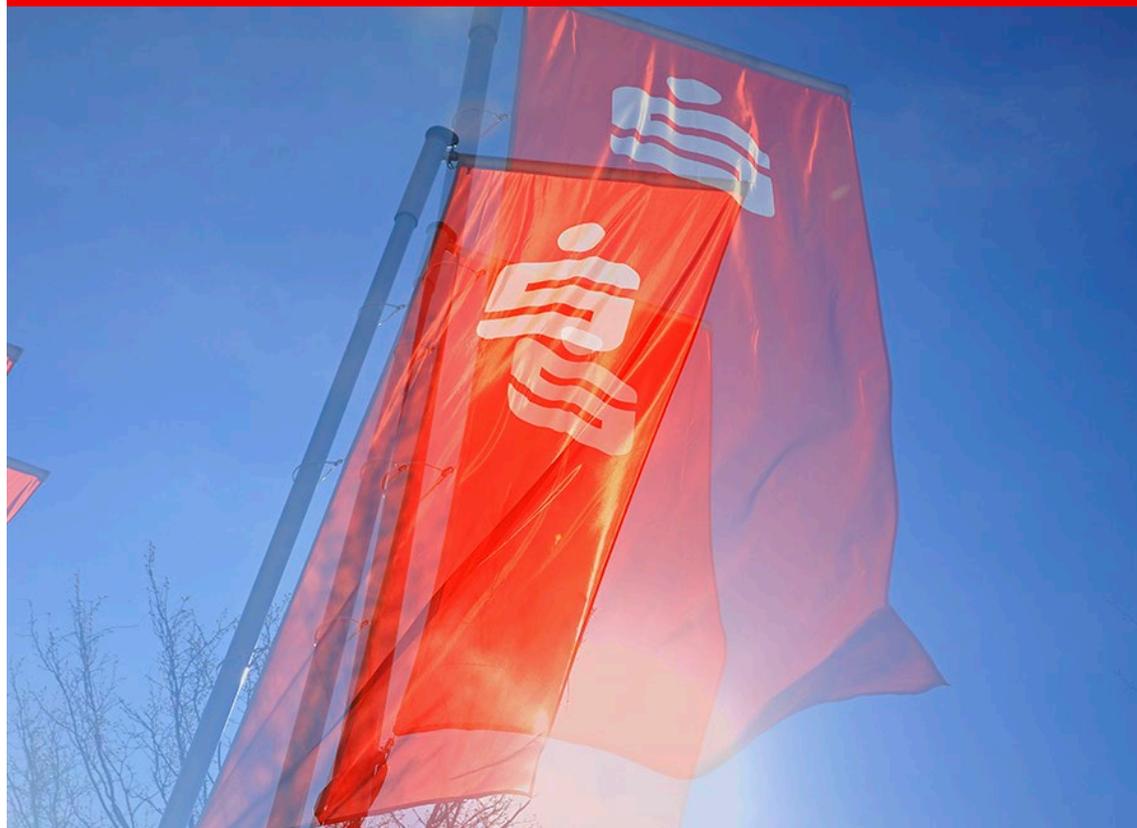


> Hintergrund:

- > Hilfe zur Selbsthilfe
- > Quellensuche
- > Unterstützung neuer Mitarbeiter
- > Ticketvermeider



Gesamtbanksimulation alle sind nach einem anstrengenden Marathon im Ziel angekommen



Gesamtbanksimulation alle sind nach einem anstrengenden Marathon im Ziel angekommen

Standardisierte Einführungsprozesse für komplexe Themen – Lessons Learned



Zentrale Informationen

Teamroom Banksteuerung und SiteTracker als zentrale Informationsplattform für Aktivitätensteuerung, Dokumente, FAQ.



Transparenz und Zusammenarbeit

Transparente und zielgruppengerechte Statusinformationen mit Erfahrungsaustauschen.



Bewährte Abläufe

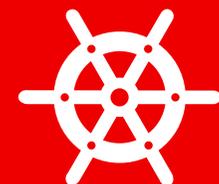
Zentrale Planung und Steuerung.

Akademieschulungen, Mustervorgehen, Chatbot.



Last Verteilen zur QS

Testdatenautomatisierung auch mit Echtdateien, Praxissprints und Pilotierung zur QS der Anwendungen und Rolloutformate.





Rollout #IRRBB- Reporting

Von den Daten bis zur Meldung



IRRBB- Reporting- den Weg und das Ziel kennen



Harmonisierung im Europäischen Meldewesen

EU Durchführungsverordnung 2024/855



Unterschiedliche Meldebögen

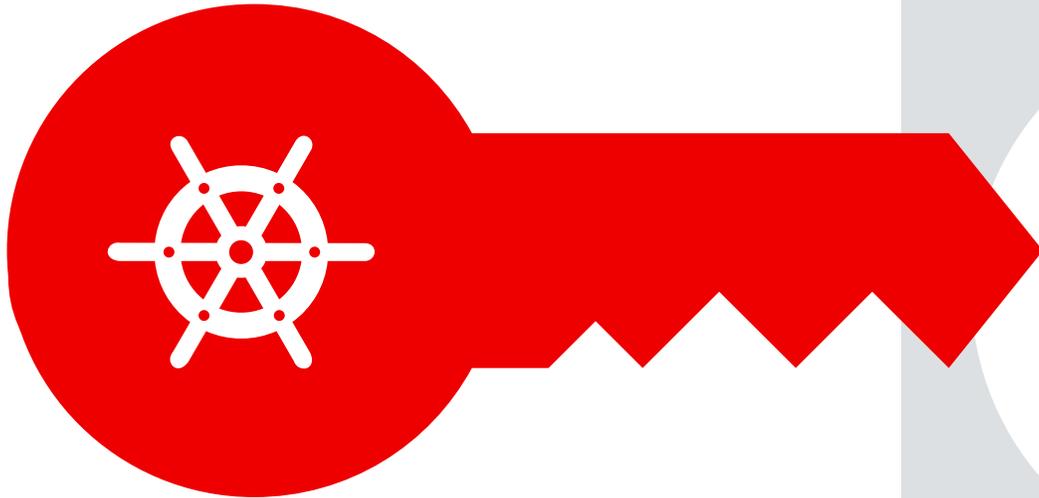
Der Meldeumfang variiert auf Basis der Einordnung des Institutes bei der Bundesbank (SNCIs, Large and Others).



Abgabe Erste Meldung 11.11.2024

Die erweiterte IRRBB Meldung wird erstmals auf den Stichtag 30.09.2024 abgegeben.

IRRBB-Reporting Rollout



**Standardisierung als
Schlüssel zum Erfolg!**



Praxis Sprints

Erste Erkenntnisse in 2 Phasen
mit insgesamt 4 Sparkassen



Pilotierung

Frühzeitige Erkenntnisse mit
Echtdatenportfolien

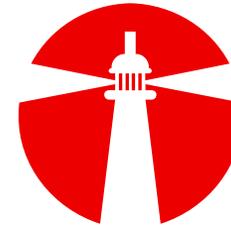


Flächeneinsatz

Big Bang vor Erstmeldung

1

Praxissprints



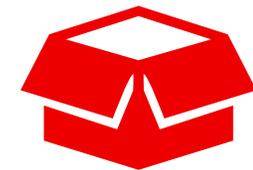
2

Pilotierung



3

Flächeneinsatz





Ziel:

Abhängigkeiten testen und Kennzahlen überprüfen

Praxissprint 1:

Praxissprint 2:

Sparkasse

Sparkasse

Sparkasse

Fokus:
IRRBB- GBS

Sparkasse

Sparkasse

Sparkasse

Sparkasse

Gesamtlauf bis zur Meldung



Erprobung der IRRBB Meldung auf den Stichtag 30.06.



Ziel: Erkenntnisse in der Breite bekommen durch heterogene Piloten auf Basis von Produktionsgruppen



Über 40 SPK auf definierten Produktionsgruppen



Erkenntnisse sammeln für der Kunden Support während der ersten Meldung



Kick-Off startete am 16.08.



**Start der
Vorbereitung für
die Erstmeldung
für alle Kunden.**



**Zur Vorbereitung stehen
ihnen die zentralen
Rolloutschulungen zur
Verfügung, die Sie über Ihre
Akademie buchen können**



**Schulungstermine:
09./19./27.09.**



**Aktivitäten via SiteTracker
nutzen für Transparenz und
Status Reports**

Meine persönlichen Learnings



Sparkassen sind **heterogen**

Mut für volatile Themen

Kundenzentrierung für komplexe Themen **neu denken**



Rollout Neue SCD-Module



Ziel Rollout SCD neue Module



Compliance Manager

Wechsel vom Limitmodul auf den Compliance Manager für Umstellung Limitmodul auf „read-only“ ab OSPlus-Release 25.1 bis zur finalen Abschaltung des Limitmoduls



Asset Manager

Nutzung neuer Funktionen im Asset Manager ergänzend zur Echtbestandsanzeige inklusive neuer Layouts mit neuen grafischen Darstellungsmöglichkeiten

Abschluss

Praxisverprobung im 1. Halbjahr 2024 mit Ziel APA-Beschluss September 2024.

Start Rollout¹ mit Kickoff in Großserien gefolgt von Tutorials und Akademie-schulungen in Kleinserien.

Nach OSPlus-Release 25.1 erfolgen Weiterentwicklungen nur noch in den neuen SCD Modulen²



¹ Start des technischen Rollouts auf Basis der neuen Funktionalitäten der Module | ² Umsetzung der Einzelanforderung „41208“ – (Aufsichtliche Handhabung von Anlagen in Spezialfonds nach den MaRisk) Ende 2024 im Compliance Manager vorgesehen.

Vom Limit Modul zum Compliance Manager

Limit Modul

- ⊖ Mehrfachverwendung von Limiten nur durch erneute Eingabe möglich
- ⊖ Fehleranfällig durch manuelle Mehrfacheingabe
- ⊖ Eingeschränkte Warnhinweise bei Limitüberschreitungen



Compliance Manager

- ⊕ Alert-Funktionen bei Limitüberschreitung per Nachtverarbeitung und E-Mail Benachrichtigung
- ⊕ Überblick aller Limite in einer Maske
- ⊕ Aufbau der Benutzeroberfläche ähnlich Windows-Explorer
- ⊕ Limitzuweisung per „drag and drop“ Funktion
- ⊕ Pre-Deal Limitcheck auf Simulationsebene (ad hoc Aktualisierung)
- ⊕ Grafische Darstellung der Limitauslastung



Von der Echtbestandsanzeige zum Asset Manager

Echtbestandsanzeige

- ⊖ Tabellarische Darstellung
- ⊖ Grafische Darstellungen über Zusatzfunktion abrufbar
- ⊖ Eingeschränkter Funktionsumfang
- ⊖ Weiterentwicklungen in zukünftigen SimCorp Releases nicht gewährleistet
- ⊖ Bei Weiterverwendung höhere Kosten und exklusive Neuentwicklungslösungen



Asset Manager

- ⊕ Übersichtliche Datenauswahl nach Instrumenten- und Gattungsarten
- ⊕ Grafische und tabellarische Darstellung von Beständen in übersichtlichen Layouts
- ⊕ Exportfunktionen nach Excel
- ⊕ Möglichkeit für „ad hoc“ Reporting Auswertungen (grafisch)
- ⊕ Flexibler Gestaltungsspielraum in Ansichten und Integration von Informationen
- ⊕ Integrierte Funktionen zum Compliance Manager und Fondsdurchschau-komponenten

Neue SCD-Module – Ergebnisse Praxisverprobung

> Anpassungsbedarfe Schulungsvorgehen



Tutorial

Korrektur von Darstellungen und Sprechtexten und Erweiterung um ein übergeordnetes Einführungsvideo



Webinar

Anpassung der Webinarstruktur für den Compliance Manager mit Clusterung der Lernbausteine für Regelerstellung und Limitkontrolle/-überwachung sowie Zielgruppen-gerechte Ansprache

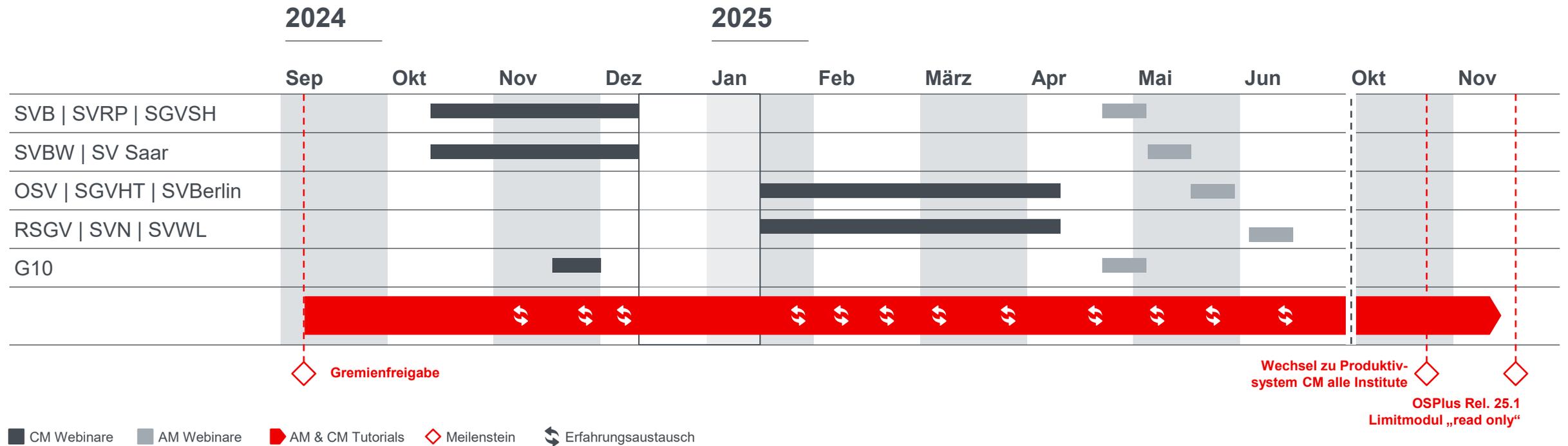
> Systemseitige Anpassungsbedarfe

Aufnahme der hoch priorisierten Anforderung für den Compliance Manager zur Abbildung der Limite für Gruppe verbundener Kunden (GVK) und Kreditnehmereinheit (KNE) in der Listenfunktion zur Umsetzung in einem Einzeleinsatz 2024

Aufnahme weiterer wichtiger Anforderungen im FI Kunden-Anforderungsmanagement zur Entscheidung in den FI-Gremien für Umsetzung



Schulungsvorgehen – Zeitplan für den Flächenrollout



> Detailplanung und die Aufteilung auf Groß- und Kleinserien wurden mit Ihren RV-Vertretenden abgestimmt und werden über den Teamroom bereitgestellt

> Die Anmeldung zu den Webinaren erfolgt wie gewohnt über Ihre Akademie

> Der SCD-Rollout ist weitestgehend mit der Produkteinführung IRRBB abgestimmt, lediglich 2 Kleinserien starten abgestimmt mit den Instituten im Oktober

Ausblick auf 2025

Praxissprint und Rollout **IRRBB¹**

Praxissprint und Rollout **Daten Monitoring**

Praxisverprobung und Rollout **SCD neue Module**

Praxissprint und Rollout **LQR Plan-Liquiditätsablaufbilanz**

Abrundung Zielbild Banksteuerung 1.0 (Abbau von Workarounds)

Technische Umsetzung von Feststellungen aus der 44er-Prüfung bei der SR



30.06/2024
Einführung
GBS-VMU



APA 09/24
Praxisverprobung
SCD neue Module

11.11/2024
Abgabe
IRRBB-Meldung

OSPlus-Release 25.1
Abschaltung
SCD_Limitmodul

2. HJ 2024

1. HJ 2025

2. HJ 2025

**Umsetzung
Zielbild
Banksteuerung 2.0**

Nach-
haltigkeit



RWA²-
Reduktion



Betriebsw.
Steuerung



Produkt-
abbildung



Melde-
wesen



¹ Interest Rate Risk in the Banking Book/Zinsänderungsrisiko im Anlagebuch | ² Risk Weighted Assets/Risikogewichtete Aktiva



Marilen Jahnke

Banksteuerung

marilen.jahnke@f-i.de



Thomas Becker

Bereichsleiter Produktmanagement Banksteuerung

thomas.becker@f-i.de