

Financial Data Management



Innovatives Daten-Management - Realisierung eines normierten, strukturierten Datenfeeds

Mit dem Ziel einer ganzheitlichen Datenversorgung im Rahmen einer neuen, strukturierten Lieferarchitektur zur effizienten Abbildung aller bankfachlichen Informationen, ist das Projekt mit seinem erfolgreichen Abschluss nicht weniger als der Beweis dafür, dass sich initiale Investitionen in eine langfristige Datenstrategie gegenüber taktischen Lösungen durch Hebung von Synergien, Komplexitätsreduktion und Zentralisierung bereits kurzfristig auszahlen können.

Ausgangslage

Zur Behebung eines EZB-Monitums muss die konzernweite Liquiditätssteuerung einer Universalbank um Daten auf Einzelgeschäftsebene aus einer kürzlich integrierten Tochtergesellschaft ergänzt werden.

Die Datenlieferung soll erstmalig unter Einhaltung einer neuen konzernweiten Guideline zur zentralen Datenversorgung erfolgen. Neue Datenfeeds sind zur Vermeidung von Sunk-Cost gemäß der Guideline in einem strategischen Format an eine zentrale Datendrehscheibe zu liefern. Hier gelten folgende Rahmenbedingungen:

- Lieferung in einem strukturierten Format im Rahmen des gesamtbankfachlichen Datenmodells (technisch JSON).
- Erstmalige produktive Umsetzung des Lieferformats innerhalb des Konzerns (Pilotprojekt).
- Prozesse, Methoden und Datenmodelle der Ziellösung noch nicht final spezifiziert.

Projektziel

Vorrangiges Projektziel ist die Sicherstellung der Datenversorgung für die Treasury & Liquiditätssteuerung. Hierfür soll das komplette Produktportfolio einer Tochtergesellschaft (inkl. Einlagen, Darlehen, Factoring, Anleihen, Derivate, Emissionen, Geldmarkt, Sicherheiten, Partnerdaten)

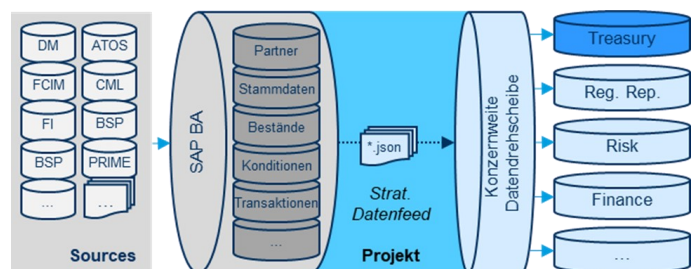


Abbildung 1: Datenfluss der neuen Schnittstelle

geliefert werden (s. Abbildung 1).

Ein wesentliches Kernziel ist die erfolgreiche Erprobung der neuen Datendrehscheibe und Belieferung im strukturierten Datenformat. Hiervon abhängig ist die konzernweite Umstellung auf die neue Datenversorgung.

Innerhalb eines Jahres sollen zur Erfüllung der EZB-Auflagen mind. 85% des Produktvolumens durch diesen Feed in die Liquiditätssteuerung einfließen.

Im Datenfeed sind hierzu ca. 330 strukturierte Geschäftsinformationen, sowie weitere 140 strukturierte Partnerinformationen täglich bis 6 Uhr zu liefern. Als Ausgangsbasis für den Datenfeed muss der SAP Bank Analyzer als zentrale Datenplattform der Tochtergesellschaft um liquiditätsrelevante Informationen (insb. Konditionen & Transaktionen) erweitert werden.

Projektansatz

Die Umsetzung des Projekts erfolgt in der Tochtergesellschaft anhand eines Stream-Vorgehens (modifiziertes Wasserfallmodell). Im Konzern jedoch wird weitestgehend ein agiles Vorgehen angewendet, wodurch sich wesentliche

KEY FACTS	4 MA. { 1Pa, 1MC, 1SC, 1C	129 Files
	20 Monate	470 Attribute
		320 GB tägl.

Schwierigkeiten ergeben:

- Anforderungen der Liquiditätssteuerung sind nicht vollständig / final.
- Struktur des strat. Datenfeeds durch monatliche Modellierungs-Updates stark volatil.

Durch Baselines, sowohl für die Anforderungen als auch die Datenmodelle (des. Datenfeeds), wird der agile Fortschritt für einen Release-Zeitraum eingefroren und für das Stream-Vorgehen zugänglich gemacht.

Die Datenlieferung erfolgt dabei nach Absprache innerhalb von 1.5 Jahren in zwei Phasen:

1. Phase: Massendaten (Einlagen, Darlehen, Partner)
2. Phase: restl. (komplexe) Produkte & Erweiterung der Anlieferung aus Phase 1

Die 1. Phase dient so neben der Erfüllung des 85%-Ziels auch der Finalisierung von Anforderungen und Datenmodellen.

Projektlösung

Die Lieferung des Datenfeeds erfolgt zur Einhaltung nicht-funktionaler Anforderungen und zur Komplexitätsreduktion quellsystemabhängig, d.h. der Datenfeed wird in „Bündel“ geschnitten, so dass Lieferzeiten eingehalten, Abhängigkeiten reduziert und Risiken minimiert werden. Dies führt zu einer zeitoptimierten Lastverteilung.

Hieraus ergibt sich ein Datenfeed, der aus 11 Bündeln mit jeweils maximal 25 Lieferdateien zusammensetzt ist, woraus sich die Gesamtzahl zu liefernder Dateien ableiten lässt. Der Zugriff auf die Hadoop basierte Datendrehzscheibe erfolgt dabei mit Standardtools wie Hive.

Technisch erfolgt die Lieferung im maschinen-optimierten JSON-Format, welches im SAP Power Designer direkt aus den Datenmodellen generiert wird. Zur Erzeugung der Lieferdateien wird der integrierte SAP JSON-Converter genutzt.

Durch das Onboarding weiterer Konsumenten (Abb. 1) und die konsistente, konzernweite Datenversorgung ergibt sich

ein Leverage-Effekt, wodurch bereits kurzfristig parallele Legacy-Feeds zurückgebaut und redundante Aufwände in Fachabteilungen reduziert werden können.

Projektbeitrag

Die Berater der movisco AG haben wesentliche Teile des Projekts begleitet und zum Erfolg geführt:

- Übernahme der Projektleitung
- Aufnahme Anforderung & Analyse
- Fachl. Konzeption, Dokumentation und Test
- Prozessuale und inhaltliche Schnittstelle zur IT
- Mit- und Weiterentwicklung des konzernweiten, strategischen Datenfeeds mittels SAP Power Designer von der Theorie in die Praxis
- Inbetriebnahme und Wissenstransfer zum Kunden
- Verfeinerung der Vorgehensmodelle und Prozesse
- Linienübergabe und Konsumentensupport

Fazit

Die Herausforderung, innerhalb kürzester Zeit die Datenversorgung in einem neuen und bisher nur theoretisch erdachten, strukturierten Datenformat für alle Produkte einer Universalbank zu etablieren, obgleich sich die Anforderungen, Prozesse, Vorgehensmodelle und Struktur des Datenfeeds selbst noch im agilen Aufbau befanden, hat der Kunde zusammen mit der movisco AG mit der Produktivsetzung der 2. Phase des Projekts erfolgreich gemeistert. Das Onboarding zusätzlicher Konsumenten zeigt den Erfolg des Projekts und unterstreicht die Entscheidung, eine langfristige, strategische Lösung zu etablieren, welche bereits kurzfristig Synergien heben und Kosten senken kann. Diesen Weg auch gerade dann zu gehen, wenn das Risiko aufgrund externer Anforderungen hoch ist, bedarf Entschlossenheit, Vertrauen in seine Lösung und Erfahrung.

Autoren

Dr.-Ing. Torsten Lorenzen ist Senior Consultant der movisco AG. Seine Beratungsschwerpunkte sind Data Management, Datenmodellierung (SAP PD), Dokumentation (inkl. Data-Dictionary) sowie Migrationsprojekte im Bereich Data Management. Darüber hinaus versteht er sich in der Begleitung aller Projektschritte von der Anforderungsanalyse bis zur Umsetzung und fungiert durch sein bankfachliches und technisches Verständnis als Schnittstelle zwischen Fach und IT.



Robert Meinel ist Partner der movisco AG. Seine Beratungsschwerpunkte sind SAP Implementierungsprojekte im Bereich Gesamtbanksteuerung, ERP & S/4HANA, SL-Accounting, ETL und Datenbereitstellung, Datenmanagement sowie fachlich Accounting und Regulatorik. Dabei begleitete er

eine Vielzahl von Projekten in unterschiedlichen Finanzunternehmen durch seine Expertise sowohl operativ als auch in der Projektleitung.

movisco AG

Die movisco AG ist eine spezialisierte Business- und IT-Beratung für Finanzdienstleister. Wir entwickeln Business Intelligence (BI) sowie Data-Warehouse-Lösungen und beraten unsere Kunden in den Bereichen Risikomanagement, Regulatorik, Unternehmenssteuerung und Finanzen.

Stellen Sie Ihre Fragen

movisco AG

E-Mail: info@movisco.com
Internet: www.movisco.com
Fax: +49 40 767 53 377

movisco Hamburg

Osterbekstraße 90a
22083 Hamburg
Tel.: +49 40 767 53 777

movisco Bonn

Fritz-Schäffer-Straße 1
53113 Bonn
Tel.: +49 228 9293 9145

movisco Frankfurt

Taunusanlage 8
60329 Frankfurt am Main
Tel.: +49 69 174 98 590