



SAS in der Finanzindustrie

Einsatzmöglichkeiten und Use-Cases

Financial
Industry
Consulting



Übersicht

- Nagler & Company hat diverse Kundenprojekte erfolgreich umgesetzt und dadurch wertvolle Erfahrungen für den Einsatz von SAS in der Finanzindustrie gesammelt
- Unsere Mitarbeitenden generieren durch ihre holistische Sichtweise auf Markt, Handel, Regulatorik und Prozesse direkten Mehrwert bei unseren Kunden

Expertise: SAS Analytics

- **SAS Silver Partner** seit 2013
- Zugang zu aktuellsten Versionen und Release Notes
- Offiziell **SAS-zertifizierte Mitarbeitende** durch Schulungsangebote/Workshops
- Regelmäßiger **direkter Austausch** mit SAS

Expertise: Erfahrung Finanzindustrie

- Durch **langjährige Projekterfahrung** im Finanzsektor kennen wir die branchenspezifische Anforderungen genau
- Versiert im **regulatorischen Umfeld**
- Positionierung an der Schnittstelle zwischen Fachbereich und IT stützt unsere Expertise in **industrierelevanten Systemen**
- **Fachliche Kompetenz** gestützt auf unterschiedlichen akademischen Hintergründen der Mitarbeitenden

Qualifizierte Mitarbeiter

Durch die pragmatische Umsetzungsstärke, Methodenkompetenz und Expertenwissen unserer Mitarbeitenden helfen wir unseren Kunden, ihre Projekte zu realisieren



Michael Brinkmann – Business Lead

+49 160 71 33 86 1 mobile

Michael.brinkmann@nagler-company.com



Florian Seidl – Technical Lead

+49 151 25 26 26 07 mobile

florian.seidl@nagler-company.com



Mit unserem Expertise-Team und unserer tiefen Vernetzung in der Finanzindustrie können wir Finanzinstitute entlang der gesamten Wertschöpfungskette unterstützen

Nagler & Company im Profil

Das Unternehmen

- **Spezialisierung:** Nagler & Company ist spezialisiert auf die Finanzindustrie. Zu unseren Kunden zählen hauptsächlich Banken, Versicherungsunternehmen, Clearing-Häuser und Asset-Manager*innen
- **Erfahrung:** Wir kennen das Bankgeschäft, die Herausforderungen der Märkte, die aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen und Technologien in der Finanzwirtschaft
- **Historie:** Das Unternehmen wurde im Jahr 2000 von Dr. Martin Nagler gegründet und zählt inzwischen ca. 95 Mitarbeiter
- **Standorte:** Unsere Bürostandorte befinden sich in Frankfurt am Main, München, Schnaittenbach (Hauptsitz) sowie Graz, Wien und Zürich

Fachliche und technische Expertise

- Risk & Analytics
- Front Office / Capital Markets
- Regulatory Reporting
- Market and Reference Data
- Asset Management & Buy-Side
- Projektmanagement

Technologiepartnerschaften

-  Celonis Process Mining
-  Tableau Self-Service BI-Lösungen
-  FIS FrontArena
-  SAS Business-Analytics-Software
-  Marktdatenbanksysteme
-  Automatisierte Test-Systeme

SAS im Profil



Softfacts

- **Marktführer für Business-Analytics-Software** und weltweit größter unabhängiger Anbieter im Business-Intelligence-Markt
- Unternehmensgründung im Jahr 1976 in North Carolina
- **91 der Top-100 der 2020 Fortune-500-Unternehmen** vertrauen auf SAS
- Konzentriert auf die Anwendungsfelder **künstliche Intelligenz (KI), Machine Learning und Analytics**
- Umfassendes **Partner-Programm** mit **weltweiter Vernetzung**

N&C Expertise beim Projekteinsatz

Produkt Know-How



Wir kennen die Produktpalette und können unsere Kunden bei Auswahl und Anwendung der SAS Produkte gezielt beraten

Schulungskompetenz



Exzellente Consultants durch gezielte Schulungen und Zugang zu aktuellster Dokumentation

Maßgeschneiderte Lösungen



Unsere umfassende Erfahrung ermöglicht die Implementierung kundenindividueller Lösungen

Marktdurchdringung



Beratung aus einer Hand durch unser bestehendes Partner-Netzwerk

SAS Highlights



82.000+ Unternehmen als Kunden



40+ Jahre Erfahrung



145 Länder



3.27 Milliarden US\$ Umsatz 2018



12.500+ Mitarbeiter



Als langjähriger offizieller Partner von SAS sind wir bzgl. des Produktangebots jederzeit auf dem aktuellen Wissenstand und über neue Entwicklungen informiert

Referenzprojekte

Referenzprojekt 1: Anti-Fraud-Initiative

Leistung: Spezifikation, Implementierung

Projektauftrag

- Untersuchung gefährdeter Kontenbereiche im Privatkundengeschäft
- Konzeption und Umsetzung eines Regelprozesses, der dem Operational Risk Management ermöglicht, automatisierte Analysen durchzuführen

Aufgabe Nagler & Company:

- Entwicklung und Implementierung von statistischen Analyseverfahren
- Schulung der Bankmitarbeitenden und Präsentation der Projektergebnisse auf Bereichsleitungs- und Vorstandsebene

Lösungskonzept:

- Entwicklung von Analyseverfahren mit R und MySQL
- Umsetzung der statistischen Analyse in einem SAS-Tool
- Upload der Rohdaten in SAS-Tool, regelmäßiges Durchführen der Analyse durch OpRisk Mitarbeitende

Mehrwert für den Kunden:

- Effektive Überwachung gefährdeter Konten
 - Wirksame Verhinderung von Betrug
 - Bank erfüllt Anforderungen von Aufsicht und Wirtschaftsprüfer, Verhinderung finanzieller Schäden
-

Referenzprojekt 2: Datenzugriff und Prüfbarkeit digitaler Unterlagen

Leistung:

- Unterstützung der Projektleitung
- Begleitung der Spezifikation und Implementierung

Projektauftrag

Alle steuerrelevanten Daten und Dokumente werden in eigens für diesen Zweck konzipiertes Softwaresystem auf SAS Basis ausgelagert und dort für die elektronische Steuerprüfung vorgehalten

Aufgabe Nagler & Company:

- Unterstützung in den Bereichen Planung, Entscheidungsmanagement und Dokumentation
- Durchführung der Tests (mit Hilfe von SAS EG) und Testmanagement

Lösungskonzept:

- Entwicklung von Analyseverfahren mit R und MySQL
- Entwicklung eines Datenarchivs auf SAS Basis
- Zugriffsmöglichkeit über SAS Web Report Studio für den Endnutzenden

Mehrwert für den Kunden:

- Zentrale Sammelstelle für alle steuerrelevanten Daten der Bank
 - Zugriff bzw. Berechtigung des Steuerprüfenden nur noch auf ein System notwendig
-

Referenzprojekt 3: Tests bei Einführung eines neues FO-Kreditsystems

Leistung:

Unterstützung Testzyklen im Data Warehouse

Projektauftrag

- Sicherstellung einer weitestgehenden Neutralisierung der bereitzustellenden Daten unter der Neuansbindung eines Kreditsystems für diverse Abnehmersysteme
- Validierung der Testlieferungen (technisch und fachlich)

Aufgabe Nagler & Company:

- Begleitung der Tests und Analyse der Testergebnisse
- Aufgaben im übergreifenden Test- und Defectmanagement

Lösungskonzept:

Unter Einsatz vorhandener SAS-Technologie, Entwicklung von Skripten zur Testunterstützung (Produktion vs. Test Abgleiche). Durchführung von Tests und Datenanalysen mit Hilfe von SAS 9.1

Mehrwert für den Kunden:

- Effiziente Prüfung von Testlieferungen durch Plausibilisierungsroutinen, Erstellung von wiederholbaren Abweichungsanalysen
 - Reduktion von Testaufwand & effiziente Ressourcenallokationen
-

Referenzprojekt 4: Validierung und Migration PD-Ratingtool (Kreditrisiko)

Leistung:

Validierung der Ratingmodelle (SAS), Spezifikation des neuen Ratingtools, Datenaufbereitung und Datenmigration (SAS)

Projektauftrag

Das PD-Ratingtool mit internen Modellen und historischen Kreditdaten der Bank wird auf eine neue Plattform migriert. Historischen Daten werden in SAS bereinigt und standardisiert. Modelle werden mit SAS validiert und an neue Anforderungen angepasst

Aufgabe Nagler & Company:

- Erstellung der Rohdatensätze zur Validierung und Migration
- Spezifikation des Ratingtools
- Testmanagement
- Koordination der Umsetzung und Projektmanagement

Lösungskonzept:

- Einsatz von SAS zur Datennormalisierung
- SAS Projekte zur Automatisierung der Datenaufbereitung
- Dokumentation Migrationsprozesse
- Berechnung der Ratings in SAS als Benchmark für das Ratingtool

Mehrwert für den Kunden:

Ablösung des alten Ratingtools mit langfristig nutzbarer Datenhistorie, erhöhtem Nutzerkomfort, gesteigerter Datensicherheit und erweiterten Analysemöglichkeiten

Referenzprojekt 5: Unterstützung bei Anbindung an neuen Datenhaushalt

Leistung:

- Umbau der Datenverarbeitung und Testunterstützung
- Klärung fachlicher Zusammenhänge

Projektauftrag

- Anbindung der Kreditrisiko- und Engagement Plattform an ein neues Data Warehouse
- Bereinigung des Datenmodells und Umstellung sämtlicher Verarbeitungen auf neue Schnittstelle

Aufgabe Nagler & Company:

- Abweichungsanalysen
- Bereitstellen synthetischer Testdaten
- Testunterstützung

Lösungskonzept:

SAS Projekte zur Automatisierung von Testvorgängen und zur Erstellung synthetischer Testdaten

Mehrwert für den Kunden:

- Anbindung des Systems an ein zentrales Data Warehouse
 - Konsolidierung des Datenhaushalts
 - Sicherstellung einer nachvollziehbaren Data Lineage
-

Ihre Ansprechpartner



Michael Brinkmann

+49 160 71 33 86 1 mobile

michael.brinkmann@nagler-company.com



Florian Seidl

+49 151 25 26 26 07 mobile

florian.seidl@nagler-company.com

Frankfurt am Main

Dr. Nagler & Company GmbH
Fellnerstraße 7–9
D-60322 Frankfurt am Main
T +49 69 90 55 38 0
F +49 69 90 55 38 20

Graz

Dr. Nagler & Company Austria GmbH
Joanneumring 18/5
A-8010 Graz
T +43 316 26 97 71

München

Dr. Nagler & Company GmbH
Maximilianstrasse 47
D-80538 München
T +49 89 21 11 36 70
F +49 89 21 11 36 74

Schnaittenbach

Dr. Nagler & Company GmbH
Hauptstraße 9
D-92253 Schnaittenbach
T +49 9622 71 97 30
F +49 9622 71 97 50

Wien

Dr. Nagler & Company Austria GmbH
Euro Plaza 4, Am Euro Platz 2
A-1120 Wien
T +43 316 26 97 71

Zürich

Dr. Nagler & Company AG
Kämbelgasse 4
CH-8001 Zürich
T +41 43 50 81 65 7

Disclaimer

Diese Präsentation wurde mit größtmöglicher Sorgfalt erstellt; dennoch bleiben Änderungen, Irrtümer und Auslassungen vorbehalten. Die enthaltenen Bewertungen, Stellungnahmen oder Erklärungen geben ausschließlich die persönliche Meinung der Autor*innen wieder. Nagler & Company gibt keine Gewährleistungen oder Zusicherungen hinsichtlich der Vollständigkeit oder Richtigkeit der hierin enthaltenen Informationen oder Meinungen ab. Durch die Überlassung der Präsentation wird weder eine vertragliche Bindung noch eine sonstige Haftung gegenüber dem Empfangenden oder Dritten begründet.