



BMF

**BUNDESMINISTERIUM
FÜR FINANZEN**

Oliver Hofer:

Vollintegration des Liquiditäts- und Risikomanagements der Österreichischen Bundesfinanzierungsagentur in das Rechnungswesen der Bundesverwaltung

Inhalt

- Projektauftrag
- Realisierung
- Nutzen

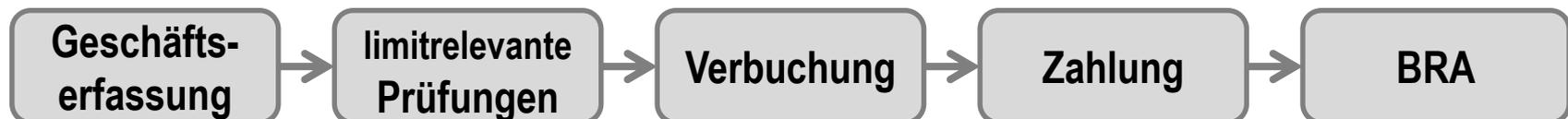
Österreichische Bundesfinanzierungsagentur (ÖBFA)

- ... handelt im Namen und auf Rechnung der Republik Österreich,
- ... ist für die Aufnahme von Schulden, für das Schuldenportfoliomanagement und für das Liquiditätsmanagement des Bundes zuständig.

Ziel ist die jederzeitige Sicherstellung der Zahlungsfähigkeit der Republik Österreich zu mittel- bis langfristig optimalen Konditionen bei gleichzeitig risikoaverser Ausrichtung.

Projektauftrag

- Ablöse des IT-Systems zum Schuldenportfolio- und Liquiditätsmanagement der ÖBFA um Synergien mit den IT-Verfahren des BMF zu nutzen
- Ziel: Unternehmensübergreifende Geschäftsprozesse zur Gänze in einem Verfahren:



Integration in IT-Verfahren 'Treasury'

Haftungen des Bundes

Fokus: Bundesrechnungsabschluss (BRA)

Volumen: rund 100 Mrd. EUR

Zuständigkeit: BMF

Beteiligungen des Bundes

Fokus: Verrechnung, BRA

Volumen: rund 25 Mrd. EUR

Zuständigkeit: Ressorts bzw. BMF

Treasury

Finanzierungen d. Bundes

Fokus: Zahlungsverkehr, Verrechnung, BRA

Volumen: rund 200 Mrd. EUR

Zuständigkeit: BMF

Schuldenportfolio- und Liquiditätsmanagement

Fokus: Liquiditätssteuerung

Volumen: rund 650 Mrd. EUR

Zuständigkeit: ÖBFA

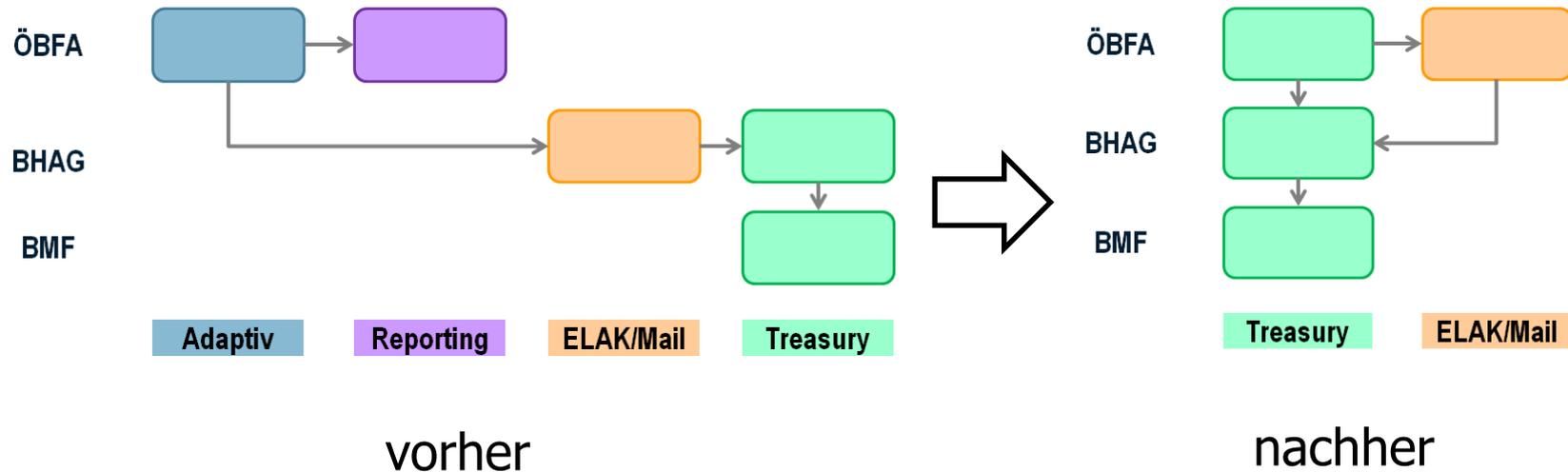
Projektumfang

- Pflichtenheft: 580 Seiten, 210 funktionale Anforderungen
- Projektstrukturplan mit über 100 Arbeitspaketen
- Projektteam
 - ÖBFA: 10 Personen
 - BMF (IT-Sektion): 3 Personen
 - BRZ (inkl. Subunternehmer): 8 Personen
- Abwicklung in 2 Teilprojekten
 1. Teilprojekt: Prozesse + Funktionalitäten (06/2014 – 07/2015)
 2. Teilprojekt: Berichtswesen (06/2015 – 02/2016)

Inhalt

- Projektauftrag
- **Realisierung**
- Nutzen

Prozesse / Workflows



- Organisationsübergreifende Prozesse in einem System
- Aufgabentrennung über SAP Workflows gesteuert
- Workflows sind durch Aufgabentrennung teilweise 3-stufig und unternehmensübergreifend

- Über 100 Berichte für unterschiedliche Interessensgruppen implementiert (*ÖBFA, BMF, Buchhaltungsagentur, Rechnungshof, Parlament, ...*)
- Je nach Bericht stehen die Daten in Echtzeit oder zumindest tagesaktuell zur Verfügung.
- Einheitliche Datenquelle für sämtliche Berichte
- Zugriffsmöglichkeit über Sicherheits- und Berechtigungskonzept gesteuert

Limitberechnung

- Richtlinien zur Begrenzung der von der ÖBFA im Namen der Republik eingegangenen Kreditrisiken
- Die Berechnung der Höhe der Limite erfolgt durch das Treasury System auf Basis diverser Daten (z.B. Rating der Business Partner)
- Zur Berechnung der Limitauslastung wurden verschiedene Methoden zur Berücksichtigung des maximalen Ausfallsrisikos umgesetzt (z.B. „Monte Carlo Simulation“).
- Vor Geschäftsabschluss erfolgt eine automatische Prüfung der Limitauslastung.
- Bei Überschreitung der Limite wird ein definierter Personenkreis automatisch per E-Mail verständigt.

Marktgerechtigkeitsprüfung

- Aktuelle Marktdaten (z.B. Zinskurven, Währungskurse, ...) werden über eine Schnittstelle von Reuters bereitgestellt.
- ÖBFA legt im System die maximal zulässige Abweichung zum Benchmark fest.
- Alle neu abgeschlossenen Transaktionen werden vom System auf Marktkonformität geprüft.

Inhalt

- Projektauftrag
- Realisierung
- **Nutzen**

Nutzen (1/2)

- Reduktion von IT-Verfahren in der Geschäftsabwicklung
→ ein IT-Verfahren für gesamten, unternehmensübergreifenden Prozess
- Verbesserung der Nachvollziehbarkeit der Geschäftsfallbearbeitung
- Steigerung von Transparenz und Compliance
- Reduktion des Risikos von technischen Ausfällen und unverhältnismäßigen Wartezeiten
→ System ist in zwei großen Rechenzentren gespiegelt

Nutzen (2/2)

- Reduktion des Aufwands bei der Benutzung des IT-Verfahrens
- Verbesserung der Aktualität der dargestellten Informationen
- Verbesserung der Datenflüsse und Reduktion unnötiger Schnittstellen
- Reduktion von redundanter Informationsverwaltung (Datenspeicherung)

**Im Namen des Treasury-Projektteams
vielen Dank für Ihre Aufmerksamkeit!**

Mag. Oliver Hofer

Applikationsleiter im Bundesministerium für Finanzen

E-Mail: oliver.hofer@bmf.gv.at