

Erkundung des Marktes iSd § 24 BVergG

„Risikomesssystem“

Akt. Nr. 057H/2019/0087

Inhalt

I	Vorbemerkungen	3
1.1	Gegenstand der Markterkundung	3
1.2	Rechtliche Grundlagen und Auftraggeberin	3
1.3	Kommunikation, Fragen	3
1.4	Gegenstand der Markterkundung	3
1.5	Ablauf der Markterkundung	4
1.6	Einzureichende Unterlagen, Teilnahmefrist	5
1.7	Aufwendungen der Teilnehmer	5
1.8	Zusätzliche Angaben.....	5
2	Anhang I	6
	Teilnahmeantrag	6
3	Anhang II	7
	Geheimhaltungserklärung	7

I Vorbemerkungen

I.1 Gegenstand der Markterkundung

Die Oesterreichische Nationalbank plant voraussichtlich im Herbst 2019 im Rahmen eines Vergabeverfahrens gemäß BVergG 2018 die Beschaffung einer IT-Applikation zur Marktrisikomessung.

Um sich vorab unverbindlich über die am Markt vorhandenen Produkte und deren Funktionalitäten zu informieren, wird vorab eine EU-weite Markterkundung durchgeführt.

I.2 Rechtliche Grundlagen und Auftraggeberin

Auftraggeberin: Oesterreichische Nationalbank
 Otto-Wagner-Platz 3
 1090 Wien
 (im Folgenden „AG“ oder „OeNB“)

Kontaktperson: Mag. Bianca Schaidler
bianca.schaidler@oenb.at

Die Auftraggeberin führt eine Erkundung des Marktes gemäß § 24 BVergG 2018 durch.

Der Ablauf und die Regeln dieser Markterkundung werden in den folgenden Kapiteln festgelegt.

I.3 Kommunikation, Fragen

Die rechtsgültige Übermittlung von Informationen zwischen Unternehmen und der AG erfolgt während des gesamten Vergabeverfahrens per E-Mail mit der oben genannten Kontaktperson. Auskünfte von anderen Personen bzw. mündliche Auskünfte sind nicht rechtsverbindlich.

Zu dem Zweck der direkten Kommunikation per E-Mail, hat das interessierte Unternehmen auf dem einzureichenden Teilnahmeantrag eine E-Mail-Adresse bekanntzugeben.

Das gesamte Verfahren wird in deutscher Sprache abgewickelt, somit hat die Kommunikation zwischen Unternehmen und der AG in deutscher Sprache zu erfolgen. Beilagen technischer Natur können in deutscher oder englischer Sprache vorgelegt werden.

Fragen zur Markterkundung und den Unterlagen können per E-Mail an die oben genannte Kontaktperson gestellt werden.

I.4 Gegenstand der Markterkundung

Die OeNB sucht zur Marktrisikomessung eine IT-Applikation, welche in erster Linie Value-at-Risk (VaR) und Expected Shortfall (ES) Berechnungen nach den drei marktüblichen Methoden (parametrische Methode, historische Simulation, Monte-Carlo-Simulation) beherrscht. Die notwendigen Korrelationsmatrizen sollen im System automatisch im Rahmen der VaR- und ES-Berechnung kalkuliert werden. Es sind sowohl ein Risikohorizont von 1 Jahr sowie kürzere Zeiträume notwendig. Weitere Risikokennzahlen (wie Sensitivitätskennzahlen und Risikobeiträge) sollen standardmäßig verfügbar sein.

Die Finanzinstrumente, deren Marktrisiko berechnet werden sollen, sind größtenteils Fixed Income Instrumente, wie Anleihen unterschiedlicher Ausprägungen bzgl. Verzinsung, Emittenten, Währung, Collateral, Geldmarktinstrumente wie Repos, Time Deposits als auch Wechselkursinstrumente, wie FX-Forwards, FX-Swaps sowie FX- und Zinsderivate. Zusätzlich sind Aktien, Convertibles, Fonds, ETFs sowie dazugehörige Derivate in verschiedenen Währungen zu berücksichtigen.

Die Finanzinstrumente sollen bereits in der IT-Applikation auf ihre Marktrisikofaktoren (insb. Zinskurven, Laufzeiten-Stützstellen, Währungen, Spreadkurven) granular gemapped sein, um diese mark-to-model und mark-to-market zu bewerten und deren Marktrisiko zu berechnen.

Das Marktrisiko soll auf Risikoarten wie FX, Interest, Spread, Equity aufgeteilt werden können. Faktormodelle können optionaler Bestandteil sein, ebenso Zusatzfunktionen wie Kreditrisikokennzahlen und Liquiditätsrisikokennzahlen.

Die IT-Applikation soll (sowohl historische als auch predictive) Stresstests mit eigenen frei skalierbaren sowie mit vordefinierten Annahmen durchführen können. Szenario Analysen sind optional. Möglichkeiten zum Backtesting und zur Validierung der Risikoberechnungen sollten zur Verfügung stehen.

Die von der IT-Applikation zu erstellenden Risikoreports sollen vom Softwaresystem täglich automatisiert erstellt werden. Weiters sollen die zur Risikomessung notwendigen täglichen Marktdaten der Marktrisikofaktoren historisch gecleaned in der IT-Applikation bereits zur Verfügung stehen und mindestens täglich automatisch aktualisiert werden. Die Einbettung in die vorhandene IT-Umgebung über Schnittstellen soll grundsätzlich möglich sein, eine Erweiterung mit dem Portfoliomanagementsystem und den Trading-Tools ist optional.

1.5 Ablauf der Markterkundung

Interessierte Unternehmen, welche über eine entsprechende IT-Applikation, welche die oben beschriebenen Anforderungen erfüllt, verfügen, werden eingeladen bis zum Ende der Teilnahmefrist einen ausgefüllten Teilnahmeantrag (siehe Anhang I) sowie die unterfertigte Geheimhaltungserklärung (siehe Anhang II) per Email an bianca.schaider@oenb.at einzureichen.

Den interessierten Unternehmen wird sodann ein Fragenkatalog mit der Aufforderung diesen ausgefüllt an die AG zu retournieren, zugesendet.

Weitergehende Informationen oder Unterlagen, welche für das Ausfüllen des Fragenkatalogs erforderlich sind, hat das interessierte Unternehmen zeitgerecht einzufordern. Die AG wird den interessierten Unternehmen alle erforderlichen Informationen zur Verfügung stellen, behält sich allerdings vor einzelne Fragen, deren Beantwortung internen Geheimhaltungsvorschriften widersprechen würde, nicht zu beantworten.

Ziel der Markterkundung ist es, sich einen möglichst großen Überblick über die am Markt vorhandenen IT-Applikationen für die Messung des Marktrisikos zu verschaffen und diese Applikationen und deren Funktionalitäten kennenzulernen.

Aus diesem Grund behält sich die AG vor, nach Auswertung der von den Unternehmen ausgefüllten Fragenkataloge weitergehende Fragen an die Unternehmen zu richten. Weiters behält sich die AG vor, ausgewählte Unternehmen in die Räumlichkeiten der OeNB in Wien einzuladen um die IT-Applikationen im Zuge von Produktdemonstrationen näher kennenzulernen und weitergehende Aufklärungsgespräche zu führen.

I.6 Einzureichende Unterlagen, Teilnahmefrist

Die interessierten Unternehmen, welche an der Markterkundung teilnehmen möchten, haben folgende Unterlagen bis zum Ende der Teilnahmefrist per Email an die oben genannte Kontaktperson einzureichen:

- Teilnahmeantrag
- Geheimhaltungserklärung
- Informationsmaterial zu der IT-Applikation (wenn vorhanden)

Ende der Teilnahmefrist: 30.08.2019, 18.00 Uhr

I.7 Aufwendungen der Teilnehmer

Seitens der AG wird kein Ersatz etwaiger Kosten oder eine sonstige Vergütung für die Teilnahme an dieser Markterkundung, insbesondere für die Ausarbeitung des Fragenkataloges oder für die Teilnahme an Präsentationsterminen oder Aufklärungsgesprächen, geleistet.

I.8 Zusätzliche Angaben

Es wird darauf hingewiesen, dass es im freien Ermessen der AG liegt, ob im Anschluss an diese Markterkundung ein Vergabeverfahren für die Beschaffung einer IT-Applikation zur Marktrisikomessung durchgeführt bzw. bekanntgemacht oder von einer Ausschreibung ganz abgesehen wird.

Weiters wird darauf hingewiesen, dass alle Informationen, die im Zuge der Markterkundung zur Verfügung gestellt wurden, rein vorläufigen und unverbindlichen Charakter und daher keine präjudizielle Wirkung auf eine mögliche künftige Vergabe haben.

2 Anhang I

Jedes interessierte Unternehmen hat den vollständig ausgefüllten Teilnahmeantrag abzugeben.

Teilnahmeantrag

Das interessierte Unternehmen erklärt,

- an der Markterkundung „Risikomesssystem“, Akt Nr. 057H/2019/0087 der Oesterreichischen Nationalbank teilnehmen zu wollen;
- die Bestimmungen der Markterkundung vollständig gelesen und verstanden zu haben;
- alle Angaben im Rahmen der Markterkundung nach bestem Wissen und Gewissen gemacht zu haben;
- zur Ausführung der nachgefragten Leistungen nach den in seinem Herkunftsland geltenden Bestimmungen berechtigt zu sein;
- sich nicht in Liquidation zu befinden oder seine gewerbliche Tätigkeit eingestellt zu haben;
- sich zu verpflichten, die mit den vorliegenden Unterlagen erlangten Informationen sowie Informationen über seinen Teilnahmeantrag vor und nach der Markterkundung vertraulich zu behandeln und nicht an Dritte weiterzugeben.

Name, Adresse und Firmenbuchnummer:

Firmenwortlaut:	
Firmenbuchnummer:	
Adresse:	
Postleitzahl/Ort:	
Staat:	
Ansprechpartner:	
Telefonnummer:	
Fax-Nummer:	
E-Mail:	

Ort, Datum

Rechtsgültige Zeichnung des interessierten Unternehmens mit Firmenstempel und Namen des/der Unterfertigen in Klartext

3 Anhang II

Geheimhaltungserklärung

Ich garantiere hiermit alle gesetzlichen Geheimhaltungs- bzw. Verschwiegenheitspflichten einzuhalten (insbesondere § 6 DSG sowie § 45 NBG) sowie alle Informationen, Daten und Unterlagen, die mir von der OeNB im Zusammenhang mit der Markterkundung "Risikomesssystem" übergeben oder in diesem Zusammenhang sonst bekannt geworden sind, geheim zu halten und sicher zu stellen, dass diese Personen, die diesen Geheimhaltungspflichten nicht unterliegen, nicht zur Kenntnis gelangen.

Ich verpflichte alle Personen und allfällige von mir beauftragte Subunternehmer, die allenfalls Zugang zu diesen Informationen erhalten, die mir hiermit auferlegten Geheimhaltungspflichten gleichfalls einzuhalten – und zwar auch nach Beendigung ihrer Tätigkeit.

Sämtliche Geheimhaltungs- bzw. Verschwiegenheitspflichten gelten auch nach Beendigung der Zusammenarbeit mit der OeNB bzw. nach Beendigung der Tätigkeit von mir eingesetzter Personen oder Subunternehmer.

Aufgrund der gegenständlichen vertraglichen Vereinbarung hafte ich der OeNB für Schäden, die der OeNB aufgrund der Nichteinhaltung der mir in dieser Geheimhaltungserklärung auferlegten Pflichten entstehen gemäß den gesetzlichen Bestimmungen.

Diese Geheimhaltungs- und Verschwiegenheitspflichten gelten nicht für Unterlagen und Informationen,

die nachweislich allgemein bekannt sind oder rechtmäßig allgemein bekannt werden, ohne dass dies vom mir zu vertreten ist oder

die mir durch einen Dritten zur Kenntnis gelangt sind, ohne dass der Dritte dadurch seine Geheimhaltungspflicht gegenüber der OeNB verletzt hat und mir dieser Umstand bekannt war oder sein musste.

Auf diese Vereinbarung ist österreichisches Recht anzuwenden. Für Rechtsstreitigkeiten in diesem Zusammenhang ist das sachlich zuständige Gericht in Wien zuständig.

Ort, Datum

Rechtsgültige Zeichnung des interessierten Unternehmens mit Firmenstempel und Namen des/der Unterfertigen in Klartext