

# Java-Portierung Marktrisikosteuerung: Verbesserungen im Prozess

Köln, 19. Mai 2022

Marvin Klaar

Nico Schooß

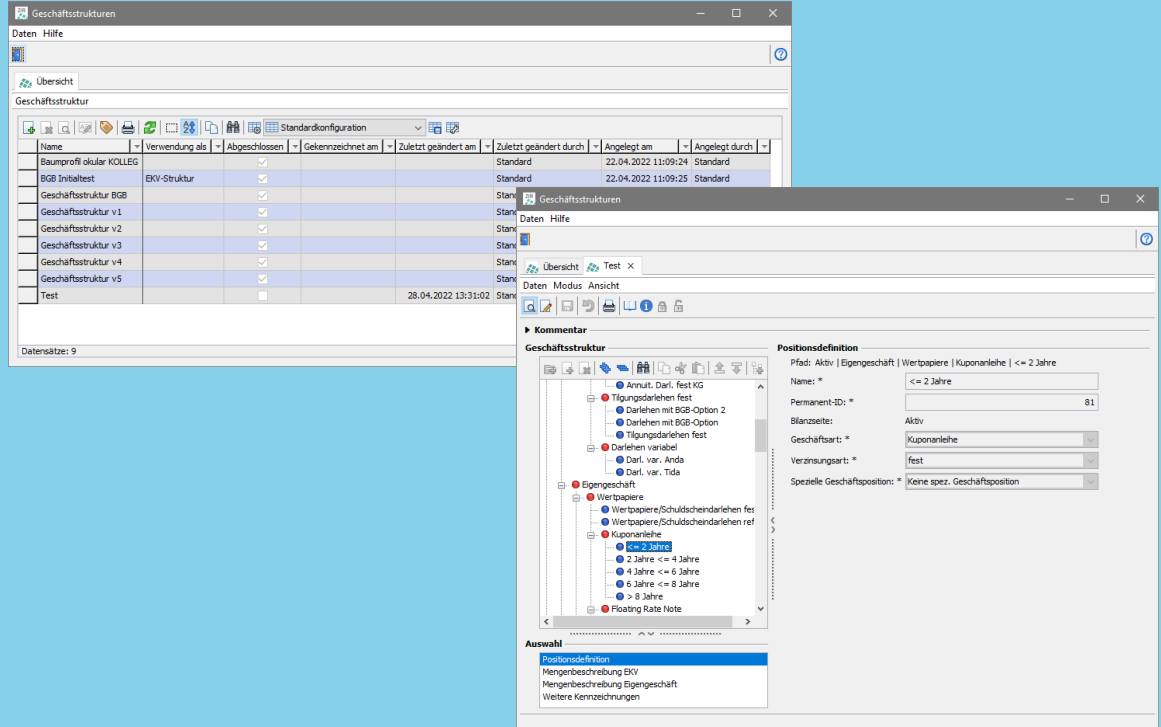
# Geschäftsstrukturen

## Übersicht

- ✓ Tabellarische Darstellung aller Geschäftsstrukturen mit Zusatzinformationen

## Einzelansicht

- ✓ **Auswahlbereiche** zur fachlichen Trennung
- ✓ Übersicht der **speziellen Geschäftspositionen**
- ✓ **Währungseinstellung** an Eigengeschäftsposition und im Einfüge-Dialog
- ✓ **Auf- und Abschließen** der Geschäftsstruktur



## Eigengeschäfte und Ergebnisse überführen

Eigengeschäfte und Ergebnisse überführen

Bereich	Auswahl	Geschäfte (gesamt)	Geschäfte (vollständig überführt)	Geschäfte (teilweise überführt)	Geschäfte (nicht überführt)	Gespeichert am	Gespeichert von	Version
Zins-/Kapitalbindungsbilanz	<input checked="" type="checkbox"/>	303	302	0	1	2021-12-22 11:16:26.903	Admin	Entwicklung/Development
Zinsergebnisbilanz (Status)	<input type="checkbox"/>	507	463	38	6	2021-12-21 14:24:15.358	Admin	Entwicklung/Development
Realisierte Ergebnisse	<input type="checkbox"/>	607	607	0	0	2021-12-21 14:24:15.358	Admin	Entwicklung/Development
KOS-Werte	<input type="checkbox"/>					2021-12-21 14:24:15.358	Admin	Entwicklung/Development

Datensätze: 4

Zins-/Kapitalbindungsbilanz   Zinsergebnisbilanz (Status)   Realisierte Ergebnisse   Nicht zugeordnete Eigengeschäfte

Produktart	ISIN/WKN	Konto Nr.	Bezeichnung	Portfolio	Skontro-ID	Permanent-ID	Status (überführt/nicht überführt)	Hinweis
Aktie	AKT09	61005	AKT A HW keine Diff 009	Überführung Z88 EG	323	153	überführt	
Aktienanleihe	AA01	90105	AAAN A HW negDiff kein PD 01	Überführung Z88 EG	324	50	überführt	
Aktienanleihe	AA03	90107	AAAN A HW negDiff kein PD 03	Überführung Z88 EG	327	50	überführt	
Aktienanleihe	AA02	90106	AAAN A HW negDiff mit PD 2	Überführung Z88 EG	326	50	überführt	
Aktienanleihe	AA04	90108	AAAN A HW negDiff mit PD 4	Überführung Z88 EG	328	50	überführt	
Aktienanleihe	AA05	4005	AA05	KPM-EG Initialtest	680	191	überführt	
Aktienanleihe	AA0001	40001	AAAN_A_HW_Bes_posDiff	Bestandsgeschäft	24	50	überführt	
Aktienanleihe	AKT001	90101	AKT A HW posDiff 01	Überführung Z88 EG	206	50	überführt	
Aktienanleihe	AKT002	90102	AKT A HW posDiff 02	Überführung Z88 EG	235	191	überführt	
Aktienanleihe	AKT003	90103	AKT A HW posDiff03	Überführung Z88 EG	236	50	überführt	
Aktienanleihe	ZAR_AA03	4013	mit Spread, Rendite berücksichtigen	ZAR_CF	633	191	überführt	
Aktienanleihe	ZAR_AA04	4014	Offener Umsatz Verkauf	ZAR_CF	634	191	überführt	
Aktienanleihe	ZAR_AA01	4011	Standard, Strike-Preis lässt Put-Option ausüben	ZAR_CF	631	191	überführt	
Aktienanleihe	ZAR_AA02	4012	Standard, Strike-Preis lässt Put-Option nicht ausüben	ZAR_CF	632	191	überführt	
Floating Rate Note	FRN07_PB	9007	CLN	Produktkatalog Basis	572	171	überführt	
Floating Rate Note	FRN09_PB	9009	CLN, Collar	Produktkatalog Basis	573	199	überführt	
Floating Rate Note	FRN03_PB	9003	CMS-Referenzierung, Anpassungstermin	Produktkatalog Basis	569	182	überführt	

Datensätze: 303

Hilfe   Drucken   Schließen

- ✓ Ausgabe eines Status bzgl. Überführung je Bereich
- ✓ Information zu Zeitpunkt, Benutzer und Version
- ✓ Detailansicht je Einzelgeschäft inkl. Status und Hinweismeldung
- ✓ Reiter „Nicht zugeordnete Eigengeschäfte“ listet Eigengeschäfte ohne Geschäftsposition auf

# Position

## Aufbau

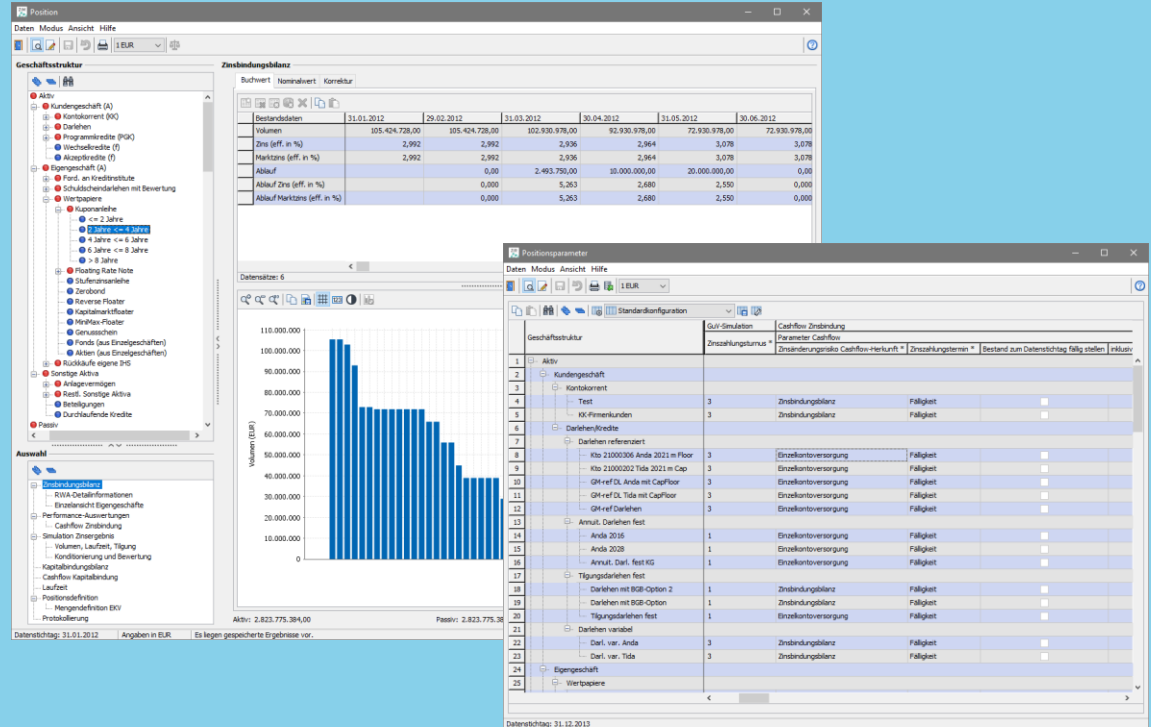
- ✓ Navigation durch Auswahlbereiche
- ✓ Statuszeile mit zusätzlichen Informationen

## Auswahlbereiche

- ✓ Integration der Untermenüpunkte
- ✓ Positionsspezifische Parametrisierung

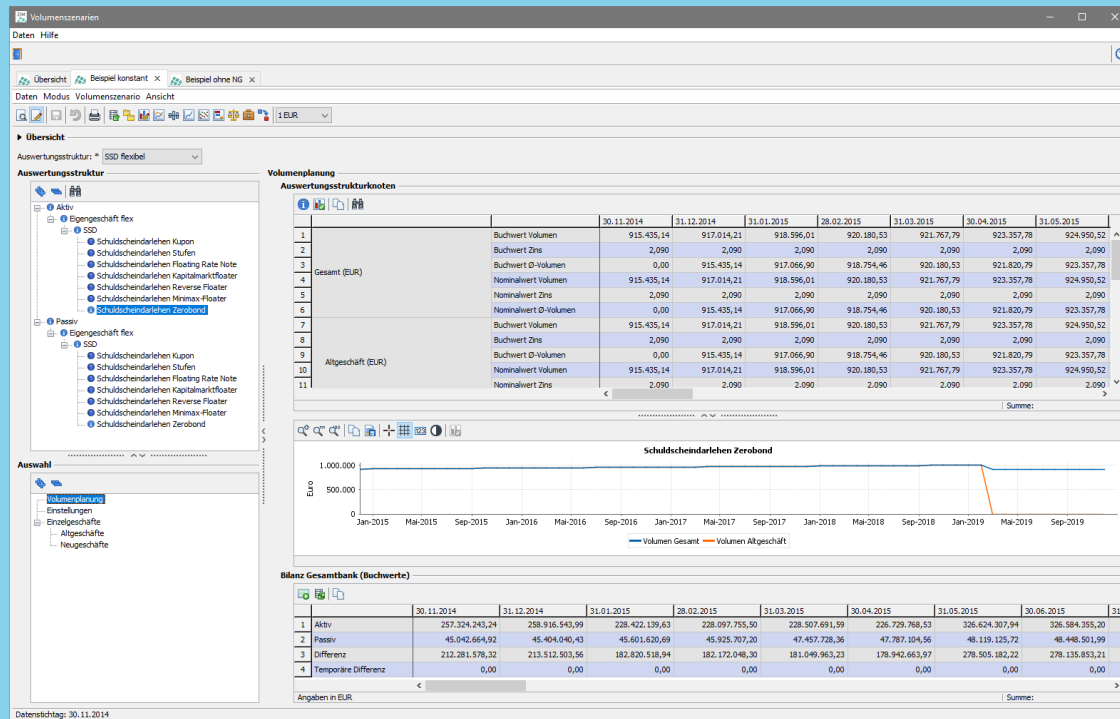
## Positionsparameter

- ✓ Tabellarische Übersicht aller Parameter
- ✓ Exportieren und Bearbeiten der Parameter



# Volumenszenario / Geschäftsstrukturszenario

- ✓ Planung auf Basis einer Auswertungsstruktur
- ✓ Detailliertere Untergliederung des Volumens in u.a. Altgeschäft, Neugeschäft aus Vormonaten, Neugeschäft aus aktuellem Monat
- ✓ Grafische Aufbereitung der Volumina
- ✓ Neue Funktionalitäten



# Übergreifende Punkte

## Zusammenfassung

### Assistenten

- ✓ Tabellarische Übersicht über alle Strukturen/Szenarien
- ✓ Ausgabe einer Reihe von Zusatzinformationen
- ✓ Klassische Tabellenfunktionalitäten

### Oberflächengestaltung

- ✓ Anpassung der Oberflächengestaltung
  - Geschäfts-/Auswertungsstruktur
  - Auswahlbereiche
  - Ergebnisfeld auf Basis des Auswahlbereichs

### Neue Funktionalitäten

- ✓ Copy/Paste aus Excel
- ✓ Konstant fortschreiben
- ✓ Paralleles Öffnen gleicher Strukturen/Szenarien
- ✓ Mehrbenutzerfähigkeit

# Ihre Ansprechpartner

Nico Schooß  
Methoden- und Produktmanagement  
[Nico.Schooss@parclT.de](mailto:Nico.Schooss@parclT.de)

Marvin Klar  
Methoden- und Produktmanagement  
[Marvin.Klaar@parclT.de](mailto:Marvin.Klaar@parclT.de)

