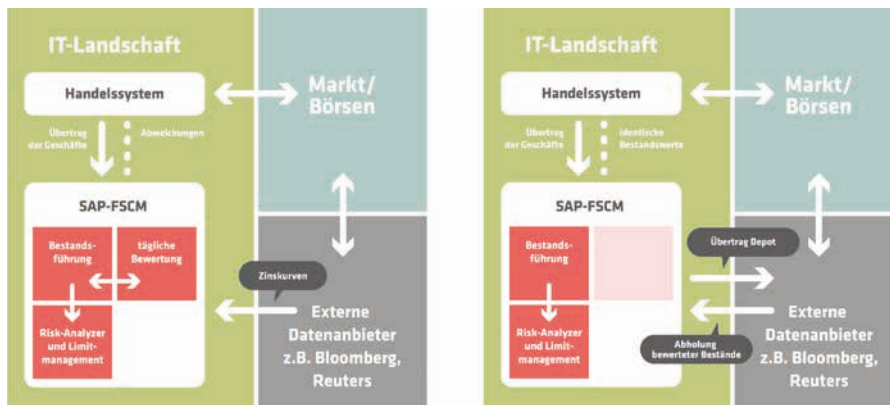


Anbindung an Bloomberg

# SAP-basiertes Derivategeschäft

Banken, die ihre Derivategeschäfte zur Bestandsführung in SAP-FSCM abbilden, stehen häufig vor der Schwierigkeit, dass die dort ermittelten Werte von jenen im jeweiligen Handelssystem abweichen. Eine neue Anbindung soll Abhilfe schaffen.



Interne versus externe Bewertung des Derivateportfolios.

Das Integrationsangebot ermöglicht Banken, externe Bewertungen ihres Derivateportfolios in ihre SAP-Systeme zu übernehmen. Innobis, ein IT- und SAP-Dienstleister für Banken und Finanzdienstleister, realisiert dazu den Datenaustausch zwischen dem Wertpapierdatenanbieter Bloomberg und der SAP-Landschaft. Die Bestandswerte, mit denen die Banken arbeiten, sind so mit jenen des jeweiligen Handelssystems deckungsgleich. Es gibt keine Abweichungen mehr. Das Angebot richtet sich an kleine und mittelständische Banken, im Speziellen an Förder- und Hypothekenbanken, die SAP-FSCM (Financial Supply Chain Management) zur Verwaltung von Derivaten im Einsatz haben.

## Derivatebewertung in zwei Schritten

Entscheidet sich die Bank für die Anbindung an Bloomberg, so werden die Derivate täglich automatisiert über eine Software-Schnittstelle aus dem SAP-FSCM zum Wertpapierdatenanbieter Bloomberg zur externen Bewertung überstellt. In einem zweiten Schritt werden die Ergebnisse „abgeholt“, in SAP-FSCM übernommen und laufen schließlich in den SAP Bank Analyzer bzw. den Credit Risk Analyzer (SAP-CRA) und das Limit-Management ein. Durch die Übernahme der externen Bewertungen gibt es keine Abweichungen mehr zur Marktbewertung der Derivate. Die Standardfunktionen in SAP-FSCM

können einwandfrei und unverändert weiterlaufen und mit den importierten Werten arbeiten. Auch bei einer (vorzeitigen) Auflösung lassen sich die vom Kontrahenten ermittelten Werte gegen die Marktwerte aus Bloomberg abgleichen. Wenn Banken ihre Derivategeschäfte zur Bestandsführung in SAP-FSCM abbilden, ergibt sich oft die Herausforderung, dass die dort ermittelten Werte von jenen im jeweiligen Handelssystem bzw. von den durch die Kontrahenten ermittelten Geschäftswerten abweichen. Eine weitere Auswirkung könnte auch sein, dass die im Handelssystem berücksichtigten Limits eingehalten, im bestandsführenden SAP-System aber überschritten werden. Die Ursachen für die divergierenden Bewertungsergebnisse zu externen Datenanbietern wie Bloomberg oder auch Reuters liegen in der Zinskurve, die der Bewertung in SAP-FSCM zugrunde liegt. Hier können der Zeitpunkt der Ausgabe, die Anzahl der Stützstellen (Granularität) oder das verwendete Interpolationsverfahren abweichen.



Bitte beachten Sie auch den  
Community-Info-Eintrag ab Seite 99

[www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com)

## Beste und umfassendste EDI/B2B/EAI- Lösung für SAP

- ✓ E-Invoicing mit ZUGFeRD
- ✓ Belegflut beherrschen mit Lösungen für SAP für E-Invoicing und E-Ordering
- ✓ eMobility – auch als Offline Client für SAP-Anwender »SAP to Non-SAP«

ON-PREMISE

HYBRID

CLOUD SERVICE