

INVESTRO Newsletter

Nr. 6

Handel und Abrechnung in Fremdwährung

## INHALT

1	Zusammenfassung .....	3
2	Teilnahme .....	4
3	Stammdatenfeld: Abrechnungswährung-INVESTRO .....	4
4	Abwicklungsfähige Währungen .....	5
5	Verarbeitung.....	6
5.1	Aufträge .....	6
5.1.1	Auftragserfassung .....	6
5.1.2	Anzeige: Preisausgezeichnete Aufträge BRAF SP .....	6
5.1.3	Auftragshistorie .....	7
5.1.4	Terminaldruck.....	8
5.1.5	Ausführungsbestätigung MT519 .....	8
5.2	Geschäfte .....	9
5.2.1	Geschäftserfassung .....	9
5.2.2	Transaktion BRAG .....	12
5.2.3	Währung im Schlussnotendatenträger .....	12
5.3	Transaktion WSAI .....	13
6	Schnittstelle Clearstream Banking Frankfurt .....	13

## 1 Zusammenfassung

INVESTRO bietet bisher nicht die Möglichkeit, auch Fonds abzuwickeln, deren Preis in einer anderen Währung als Euro festgestellt wird.

Sowohl bei den deutschen Kapitalanlagegesellschaften, als auch bei ausländischen Kapitalanlagegesellschaften werden Fonds vertrieben, deren Preise in anderen Währungen festgestellt werden.

Um auch diese Fonds über INVESTRO abwickeln zu können, wurden die Plausibilitäten der Auftragserfassung in INVESTRO entsprechend angepasst und eine neue Geschäftserfassungs-Funktion implementiert, die es ermöglicht, Geschäfte in Gattungen einzustellen, die nicht in Euro notiert sind.

Das Stücke-Settlement erfolgt über das CBF Abwicklungs-System (CASCADE) und die Zahlung erfolgt über das CBL Abwicklungs-System (CREATION) in Commercial Bank Money.

### **Der Einsatz von INVESTRO-Fremdwährung erfolgt in 2 Stufen:**

**In der 1. Stufe**, ab Mitte September, wird INVESTRO fremdwährungsfähig sein, d.h. es können Aufträge und Geschäfte in Gattungen, deren Preis in Fremdwährung festgestellt wird, in INVESTRO erfasst werden. Die Aufträge werden in INVESTRO ausgeführt und die dazugehörigen Schlussnoten werden erstellt, aber die daraus entstandenen Geschäfte werden nicht an LION weiter übermittelt, sondern ausgesteuert, da LION zu diesem Zeitpunkt noch nicht fremdwährungsfähig ist.

Die Abwicklung dieser Geschäfte muss dann durch die Eingabe eines OTC-Fremdwährungs-Geschäftes in das CBF Abwicklungs-System (CASCADE) durch die beiden Kontrahenten angestoßen werden.

**In der 2. Stufe**, geplant im Dezember 2003, wird die Schnittstelle zu LION implementiert sein, so dass alle eingestellten Geschäfte über die Standardschnittstelle für Börsengeschäfte abgewickelt werden.

Die neue Transaktion BRGB-Geschäftserfassung wird in der 1. Stufe eingeführt.

## 2 Teilnahme

Vorraussetzung für die Teilnahme an der Abwicklung in Fremdwährung sind das Vorhandensein eines

- CBF Auslandskontos (CREATION) und die Kennzeichnung als
- CBF-Teilnehmer-Ausland.

Nur wer diese Voraussetzungen erfüllt, kann in INVESTRO Fremdwährungsaufträge über die Transaktion **BREF** oder den Systemanschluss einstellen bzw. empfangen und Fremdwährungsgeschäfte über die neue Transaktion **BRGB** erfassen.

Die Voraussetzungen werden bei der Auftragserfassung und bei der Geschäftserfassung für beide Kontrahenten geprüft.

## 3 Stammdatenfeld: Abrechnungswährung-INVESTRO

In die INVESTRO-Stammdaten wurde das Feld

- Abrechnungswährung-INVESTRO

aufgenommen.

Die Pflege des Feldes erfolgt analog dem bisherigen Verfahren der INVESTRO-Stammdatenpflege. Der Fondsstammdaten-Meldebogen an WM wurde entsprechend erweitert.

Über dieses Feld wird die Währung ermittelt, die auf der Schlussnote angezeigt und im Schlussnotendatenträger mitgeliefert wird. Es ist auch die Währung, über die das Cash-Settlement in Creation erfolgt. In dieser Währung muss auch der Preis festgestellt werden.

Alle bisher gehandelten Gattungen erhalten durch WM die INVESTRO-Abrechnungswährung Euro.

## **4 Abwicklungsfähige Währungen**

Die nachfolgend genannten Währungen sind für INVESTRO freigegeben:

- USD, US-Dollar
- CAD, Kanadische Dollar
- CHF, Schweizer Franken
- CZK, Tschechische Kronen
- DKK, Dänische Kronen
- GBP, Pfund Sterling
- MXN, Mexikanische Pesos
- NOK, Norwegische Kronen
- SEK, Schwedische Kronen
- ZAR, Südafrikanische Rand

## 5 Verarbeitung

### 5.1 Aufträge

#### 5.1.1 Auftragserfassung

Aufträge für Gattungen, deren Preis in Fremdwährung festgestellt wird, können über die Systemschnittstelle und im Dialog eingegeben werden. Die Währung muss bei der Dialogeingabe nicht eingegeben werden. Bei Kauf-/Verkaufsaufträgen, die über den Systemanschluss eingestellt werden, ist das Währungsfeld (32L) zu füllen.

Die Abrechnungswährung wird vom System zugesteuert.

#### 5.1.2 Anzeige: Preisausgezeichnete Aufträge BRAF SP

In der Anzeige ‚Preisausgezeichnete Aufträge‘ wird zum Kurswert die Währung angezeigt.

TRAN: BRAF FC: SP SB: ##		XONTRO INVESTRO / PREISAUSGEZEICHNETE AUFTRAEGE		7002/99 DRESDNER BAN		SEITE: 1	
SCHLUSSTAG	GATTUNG	WRG	KONTR	+----- K A U F -----+ +---- V E R K A U F ----+			
				KURSWERT	ANZ.	KURSWERT	ANZ.
30. 07. 01	DE0008475013	USD	7002	111. 000, 00	2		0
01. 08. 01	DE0008475013	USD	7002	8. 500, 00	1		0
02. 08. 01	DE0008475013	USD	7001	144. 000, 00	9		0
03. 08. 01	DE0008475013	USD	4001	78. 200. 000, 00	80	20. 000. 000, 00	20
	DE0008475013		4001	108. 000, 00	6		0
			7001	216. 000, 00	12	32. 000, 00	2
	DE0008475062	EUR	4001	79. 000, 00	5		0
			7001	118. 500, 00	6	35. 500, 00	1
06. 08. 01	DE0008475067	USD	4001	102. 000, 00	3	8. 500, 00	1
			7001	9. 000, 00	1		0
			7002	9. 000, 00	1		0
			7003	9. 000, 00	1		0

-- ID-KZ: 7002192799 - PW: ----- B9998071 - 08/07/03 - 13: 18: 07 -  
 F3 END F4 ABBR F6 MENU F11 ABMELD  
 BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN

INVESTRO

Newsletter Nr. 6

### 5.1.3 Auftragshistorie

In der Maske Auftragshistorie wird die Abrechnungswährung unter dem Preis angezeigt werden:

TRAN: BRHF FC: AH SB: #021113740001

XONTRO INVESTRO / HISTORIE VOLLANZEIGE-1

3029/99 VEREINS- UND

KAUF

DE0008476607 DVG-FDS EURO-RENT 1

DWZ-AUFTR.: 021113740001 GESCH. TAG: 13. 11. 02 EMPF: 7003 AUSGEFUEHRT

PREIS: 100,00 WRG: USD

TAG	ZEIT	STUECK	VERTRIEBSPART.	HINWEIS
14. 11.	10: 15	1		AUSFUEHRUNG PREISDATUM 13. 11. 02
13. 11.	16: 29	1		EINSTELLUNG

DRUCK: .

-- ID-KZ: 3029192799 -- PW: ----- B999813S -- 06/12/02 -- 13: 46: 20 --

F3 END F4 ABBR F6 MENU F10 RECHTS F11 ABMELD

BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN

### 5.1.4 Terminaldruck

Bei Terminaldruck in der Auftragshistorie (BRHF AH) wird bei ausgeführten Aufträgen die INVESTRO Abrechnungswährung neben dem Preis ausgegeben:

XONTR0-INVESTRO PROTOKOLL HISTORIE		4001/99 DEUTSCHE BANK AG		DATUM 12. 04. 01	
				UHRZEIT: 08: 12: 45	
GATTUNG: DE0008475013 THESAURUS		EMPF: 7002			
DWZ-AUFTRAGSNR. : 0104127400000		GUELTIG AB: 07. 04. 01			
VERTRIEBSPARTNER : 1234567890		PREIS: 220, 55		WRG: USD AUSGEFUEHRT	
KAUF ZUR WIEDERANLAGE		STUECK TEXT/HINWEIS			
BI-AUFTRAGSNR.					
-----					
07. 04.	13: 55	D-NUMMER-002	100, 001	TEXT-ALT	
		4001199999		AUSFUEHRUNG	PREISDATUM 07. 04. 01
06. 04.	13: 54	D-NUMMER-002	100, 001	TEXT-ALT	
		4001199999		AENDERUNG	
06. 04.	13: 52	D-NUMMER-001	100, 001	TEXT-ALT	
		4001199999		EINSTELLUNG	NACH ANNAHMESCHLUSS

### 5.1.5 Ausführungsbestätigung MT519

Im **Feld 33T** wird künftig nicht die Währung der Notierung, sondern die ‚Abrechnungswährung-INVESTRO‘ übertragen.

Der akkumulierte Ertrag wird nur übertragen, wenn die Währung des akkumulierten Ertrages gleich der ‚INVESTRO- Abrechnungswährung‘ ist.

Ansonsten sind keine Änderungen im MT519.

## 5.2 Geschäfte

### 5.2.1 Geschäftserfassung

In INVESTRO gibt es derzeit keine Möglichkeit der Geschäftserfassung. Bisher wurde die Geschäftserfassung BCEG EW/EK mitbenutzt.

Im Zuge der Einführung von Fremdwährungsaufträgen wurde für INVESTRO eine eigene Geschäftserfassung ermöglicht. Es wurde eine neue Transaktion Geschäftsbearbeitung ‚GB‘ mit zwei neuen Funktionen ‚GE‘ Geschäftserfassung und ‚SG‘ Storno Geschäft implementiert.

Damit einhergehend sind Schlussnoten aus INVESTRO-Geschäftseingaben dann auch in der Schlussnotenanzeige über die Abrufgruppe ‚V‘ aufzurufen und nicht wie bisher bei den normalen ‚Bank-Direktgeschäften‘.

Die Transaktion steht nur den Abwicklungsstellen zur Verfügung. Die Berechtigung, diese Transaktion durchzuführen, wird über die Security gesteuert.

#### Maske: Menü

TRAN: MENU FC: SB:

XONTRO / KREDITINSTITUTE

XONTRO T R A D E

EG EINGABE GESCHAEFTE

AG ABRUF GESCHAEFTE

EHS O R D E R S

EH BEARBEITEN ORDERS SME

EX BEARBEITEN ORDERS MAX-ONE

SERVICE - FUNKTIONEN

IN INFORMATIONS- U. TECHN. DIENSTE

XONTRO O R D E R S

EB ERFASSUNG/BEARBEITUNG ORDERS

IO INFORMATIONSDIENST ORDERS

HI ORDERHISTORIE

XONTRO I N V E S T R O

EF ERFASSUNG/LOESCHUNG FONDAUFTRAEGE

HF AUFTRAGSHISTORIE

AF ANZEIGE FONDSHANDEL

FK VERWALTUNG FONDSKONDITIONEN

FT FEIERTAGSBEHANDLUNG

GB GESCHAEFTSBEARBEITUNG

-- ID-KZ: 7030192799 -- PW:

----- B999813S -- 03/02/03 -- 16:07:43 --

BC0080I BITTE DATEN EINGEBEN

Mit Aufruf der Funktion ,GB' erfolgt die Anzeige der Auswahlmaske:

**Maske: Transaktion BRGB – Auswahlmaske Geschäftsbearbeitung**

```
TRAN: BRGB FC: SB:

XONTRO INVESTRO / GESCHAFTSBEARBEITUNG .....

GE GESCHAFTSERFASSUNG

SG STORNO GESCHAFT

-- ID-KZ: 7030192799 -- PW ----- B999813S -- 23/01/03 -- 13: 32: 03 --

SY0043A BITTE DATEN EINGEBEN
```

Über die Auswahlmaske können die Funktionen

- GE Geschäftserfassung oder
- SG Storno Geschäft

selektiert werden.

Über die Funktion ,GE' können nur INVESTRO-fähige Gattungen erfasst werden.

Die Funktion Storno wird aus der Transaktion BRAF herausgenommen und der Transaktion BRGB zugeordnet.

Bei der Auswahl der Funktion ,GE' Geschäftserfassung wird in die nachfolgende Eingabemaske verzweigt:



### **5.2.2 Transaktion BRAG**

Auf der Schlussnote wird beim abzurechnenden Betrag die Abrechnungswährung-  
INVESTRO angezeigt.

Die Schlussnoten sind unter der Abrufgruppe ‚V‘ aufzurufen.

### **5.2.3 Währung im Schlussnotendatenträger**

Für Fremdwährungsgeschäfte (aus Auftrageinstellung und der neuen Geschäftseingabe) gilt:

die Währungskennzeichen in den Etiketten:

- 33T Abschlusskurs
- 32M Kurswert
- 71C Bonifikationsbetrag und
- 34B Abrechnungsbetrag

sind mit der ‚Abrechnungswährung-INVESTRO‘ gefüllt.

Die Felder

- Zwischengewinn (Etikett 72, 5.Zeile)
- Ausgabepreis (Etikett 72, 6.Zeile)
- Akkumulierter Ertrag (Etikett 72, 6.Zeile)

haben kein eigenes Währungskennzeichen. Die Währung ist immer die  
Abrechnungswährung-INVESTRO. Gefüllt werden die Felder entweder aus WSS oder der  
neuen Geschäftseingabe.

### **5.3 Transaktion WSAI**

In den Funktionen EP/AP und EW wird das Feld Vorgabe-Währung nicht mehr angezeigt. Stattdessen wird das Feld Währung immer mit der Abrechnungswährung-INVESTRO vorbelegt. Das Feld kann nicht überschrieben werden.

**Hinweis:** Aus dem WM-Band werden nur die Preise übernommen, die in der Abrechnungswährung-INVESTRO festgestellt wurden.

Bei händischer Eingabe des Preises muss der Eingabe sicherstellen, dass es sich um den in der Abrechnungswährung-INVESTRO festgestellten Preis handelt.

## **6 Schnittstelle Clearstream Banking Frankfurt**

Das Settlement der Fremdwährungsaufträge wird künftig über die Standardschnittstelle LION/CASCADE ermöglicht. Dazu sind einige Anpassungen in den Systemen notwendig, die bis Dezember dieses Jahres realisiert sein sollen. Bis dahin kann die Interimslösung, wie unter Punkt 1 beschrieben, genutzt werden.

Das Procedere der Abwicklung in Fremdwährung unterscheidet sich vom Procedere der Abwicklung in Euro.

Nach Freigabe der Geschäfte in LION erfolgt die Stückereservierung auf dem Unterkonto 995. Hier bleiben die Stücke, bis die Geldseite gebucht ist; danach erfolgt die Freigabe der Stücke. Solange Geldbuchung und Lieferung noch offen sind, werden die Geschäfte in LION als offene Geschäfte angezeigt. Sind Geldbuchung und Lieferung durchgeführt, erfolgt eine Meldung an LION und die Geschäfte werden nicht mehr angezeigt.

**Hinweis:** CBF-Konten, die sich eines abweichenden Depotkontos bedienen, sind aus abwicklungstechnischen Gründen von der Fremdwährungsverarbeitung ausgeschlossen. Ein "Abweichendes Depotkonto" ist ein nicht bestandsführendes Hauptkonto, das sich eines dritten CBF-Hauptkontos für seine Wertpapierabwicklung bedient.