

Auf einen Blick

1	Einleitung	21
2	Stammdaten	51
3	Geschäftsverwaltung	85
4	Korrespondenz	179
5	Bestandsverwaltung	259
6	Integration mit anderen Modulen	417
7	Marktdaten	475
8	Exposure Management	535
9	Hedge Accounting für Exposures	571
10	Hedge Accounting für Bestände	645
11	Reporting mit dem Informationssystem	705
12	Portfolio-Controlling mit den Analyzern	779
13	Schnittstellen und Erweiterungen	999
14	Gesetzliche Vorschriften	1037
15	Integrations- und Systemwerkzeuge	1049

Inhalt

1	Einleitung	21
1.1	Liebe Leserin, lieber Leser!	21
1.1.1	An wen richtet sich das Buch?	22
1.1.2	Die Arbeit mit diesem Buch	24
1.2	Inhalt und Aufbau des Buches	24
1.3	Übersicht über die Finanzinstrumente	31
1.3.1	OTC-Finanzinstrumente	31
1.3.2	Handelbare Finanzinstrumente	33
1.4	Geschichte von SAP Treasury and Risk Management	34
1.4.1	Neuerungen zu Release SAP R/3 Enterprise 2.0	36
1.4.2	Neuerungen zu Release SAP ERP 2004	36
1.4.3	Neuerungen zu Release SAP ERP 6.0	37
1.5	Erweiterungspakete zu SAP ERP 6.0	38
1.5.1	Erweiterungspakete und Business Functions	38
1.5.2	Business Functions in SAP Treasury and Risk Management – Überblick	40
1.5.3	Business Functions zu EHP 3	41
1.5.4	Business Functions zu EHP 4	42
1.5.5	Business Functions zu EHP 5	43
1.5.6	Business Functions zu EHP 6	47
1.6	Rapid Deployment Solution und SAP Treasury and Risk Management	47
1.6.1	Rapid Deployment Solution – Überblick	47
1.6.2	RDS für SAP Treasury and Risk Management	49
2	Stammdaten	51
2.1	Zentrale Customizing-Einstellungen	52
2.1.1	Arten und Typen	52
2.1.2	Produktart	53
2.1.3	Geschäftsart	54
2.1.4	Commodity-Art	56
2.1.5	Buchungskreis	57

2.2	Commodity-Stammdaten	58
2.3	Gattungsstammdaten	60
2.3.1	Gattungsstammdaten erfassen	60
2.3.2	Customizing der Gattungsstammdaten	68
2.3.3	Börsennotierte Commodity-Derivate	71
2.3.4	Zusätzliche Registerkarten für die Gattungsstammdaten	71
2.3.5	Klassifizierung	74
2.4	Geschäftspartner	74
2.4.1	Hausbanken	74
2.4.2	Geschäftspartnerrollen	75
2.4.3	Standing Instructions	77
2.5	Organisationselemente	80
2.5.1	Depot	80
2.5.2	Positionskonto	82
2.5.3	Portfolio	83
2.5.4	Andere Organisationselemente	84

3	Geschäftsverwaltung	85
----------	----------------------------------	-----------

3.1	Geschäft	86
3.1.1	Bedienungskonventionen	87
3.1.2	Einstieg in die Geschäftsverwaltung	91
3.1.3	Datenbild	96
3.1.4	Bewegungen	102
3.1.5	Konditionen	108
3.1.6	Underlying	117
3.1.7	Handelbare Finanzinstrumente	118
3.1.8	Feldauswahl	119
3.1.9	Vorgänge	120
3.2	Handel	122
3.2.1	Vorbereitung	123
3.2.2	Entscheidungsunterstützende Werkzeuge	125
3.2.3	Handelsfunktionen	127
3.3	Abwicklung	131
3.3.1	Zinsanpassung	131
3.3.2	Preisanpassung	136
3.3.3	Devisenkurs	137
3.3.4	Referenzen	138

3.3.5	Abrechnung	140
3.3.6	Statusverwaltung	140
3.3.7	Workflow	142
3.3.8	Änderungsbelege	143
3.4	Operatives Reporting	144
3.4.1	Kontrolle	145
3.4.2	Übersicht	146
3.5	Produkttypen	148
3.5.1	Wertpapier	149
3.5.2	Festgeld	150
3.5.3	Kündigungsgeld	151
3.5.4	Commercial Paper	151
3.5.5	Finanzstromgeschäft	151
3.5.6	Zinsgeschäft	152
3.5.7	Fazilität	152
3.5.8	Treuhandanlage	153
3.5.9	Devisengeschäft	154
3.5.10	Cap/Floor	154
3.5.11	Zinsswap	154
3.5.12	Forward Rate Agreement (FRA)	155
3.5.13	Total Return Swap	155
3.5.14	Future	156
3.5.15	Repo	157
3.5.16	Wertpapiertermingeschäft	157
3.5.17	Handelbare Option	158
3.5.18	OTC-Option	158
3.5.19	Wertpapierleihe	159
3.5.20	Forward	160
3.5.21	Darlehensvorkauf	160
3.5.22	Commodity Forward	160
3.5.23	Commodity Swap	161
3.6	Architektur	161
3.6.1	Datenbank	162
3.6.2	Application Framework	163
3.6.3	Kundenspezifische Registerkarte	168
3.7	Spezialthemen	171
3.7.1	Rollen	171
3.7.2	Spiegelgeschäfte	173
3.7.3	Interner Devisenhandel	175

4	Korrespondenz	179
4.1	Alte Korrespondenz	181
4.2	Migration	184
4.3	Grundlagen	186
4.3.1	Historie	186
4.3.2	Begriffe	186
4.3.3	Korrespondenz-Framework	187
4.3.4	Korrespondenzobjekt	189
4.4	Customizing und Stammdaten	192
4.4.1	Technisches Kommunikationsprofil	192
4.4.2	Korrespondenzpartner	200
4.4.3	Zuordnungen für den Eingangsprozess	207
4.4.4	Zuordnungen für den Ausgangsprozess	208
4.4.5	Weitere Einstellungen	210
4.4.6	Dokumentenverwaltung	215
4.4.7	SAPscript-Formulare	215
4.4.8	PDF-Formulare	216
4.5	Ausgangsprozess	217
4.5.1	Korrespondenzobjekt zu einem Geschäft	217
4.5.2	Korrespondenzobjekt zu einer Depotumbuchung	220
4.5.3	Manuelles Anlegen von Korrespondenzobjekten	221
4.5.4	Freigabeprozess des Korrespondenzobjekts	222
4.5.5	Senden	223
4.6	Eingangsprozess	226
4.6.1	Starten des Eingangsprozesses	227
4.6.2	Verwendete BAdIs	228
4.6.3	Aufteilen und Zusammenführen (Split/Merge)	229
4.6.4	Mapping	230
4.6.5	Normale Nachricht	231
4.6.6	Stornonachricht und Änderungsnachricht (CANC/AMND)	231
4.6.7	Anerkennungsnachricht (ACK/NACK)	231
4.6.8	Eingangsprozess der Beispiele	232
4.7	Mapping	233
4.7.1	Prinzipien von Mapping-Regeln	234
4.7.2	View Cluster	236
4.7.3	Grafisches Mapping-Tool	237

4.8	Verknüpfen	238
4.8.1	Customizing	239
4.8.2	Automatisches Verknüpfen	240
4.8.3	Erzwungene Verknüpfungen	241
4.9	Alert	242
4.9.1	Customizing	242
4.9.2	Alert-Arten	244
4.9.3	Alert überwachen und auslösen	245
4.10	Anzeige	245
4.10.1	Anzeige im Geschäft	246
4.10.2	Anzeige bei Depotumbuchung	246
4.11	Korrespondenzmonitor	246
4.11.1	Selektionsbild	247
4.11.2	Datenbild	249
4.12	Erweiterungen (BADl)	253
4.12.1	Erweiterungsspot ES_TCOR_MONITOR	253
4.12.2	Erweiterungsspot ES_TCORF_CONFIG	255
4.12.3	Erweiterungsspot ES_TCORF_MSG_INT	255
4.12.4	Erweiterungsspot FTR_TR_ALERT	257

5 Bestandsverwaltung 259

5.1	Grundlegende Begriffe	260
5.1.1	Externe und interne Bestände	260
5.1.2	Fortschreibungsart	262
5.1.3	Geschäftsvorfall	265
5.1.4	Parallele Rechnungslegung	267
5.2	Externe Bestandsverwaltung	267
5.2.1	Depotverwaltung	269
5.2.2	Kapitalmaßnahmen	287
5.2.3	Rechte	294
5.2.4	Positionskontoverwaltung	301
5.3	Grundlagen der internen Bestandsverwaltung	311
5.3.1	Architektur der internen Bestandsverwaltung	312
5.3.2	Bewertungsbereiche definieren	320
5.3.3	Bewertungsklassen	322
5.3.4	Differenzierung	325
5.3.5	Bestandskennzeichen	332
5.3.6	Bestandsführungsverfahren	338
5.3.7	Abgeleitete Geschäftsvorfälle	345

5.4	Prozesse der internen Bestandsverwaltung	352
5.4.1	Stichtagsbewertung durchführen	352
5.4.2	Impairments und außerplanmäßige Bewertungen	355
5.4.3	Customizing der Bewertung	358
5.4.4	Abgrenzung	386
5.4.5	Umbuchung	393
5.4.6	Intrakonzerngeschäfte	403
5.5	Beispielszenarien	408
5.5.1	Anleihe in der Haltekategorie »Available for Sale«	408
5.5.2	Darlehen mit einer Annuitäten- oder Ratentilgung	412

6 Integration mit anderen Modulen 417

6.1	Zahlender Bewertungsbereich	418
6.2	Finanzbuchhaltung	420
6.2.1	Buchungsprozesse	420
6.2.2	Kontenfindung	431
6.2.3	Parallele Rechnungslegung in der Finanzbuchhaltung	441
6.2.4	Customizing der Kontenlösung	446
6.2.5	Customizing der Ledgerlösung im neuen Hauptbuch	448
6.2.6	Customizing der Ledgerlösung mit Speziellen Ledgern	450
6.3	Abwicklung von Zahlungen	452
6.3.1	Debitorenebenebuch	453
6.3.2	Zahlungsanordnungen	455
6.3.3	SAP In-House Cash	460
6.4	SAP Cash and Liquidity Management	463
6.5	Public Sector Management	466
6.5.1	Kontierungsobjekte erfassen	466
6.5.2	Fondsumbuchung	468
6.5.3	Investitionspools	469
6.5.4	Integration mit Public Sector Management aktivieren und einstellen	471
6.6	Meldewesen	472

7	Marktdaten	475
7.1	Devisenkurse und Devisenswapsätze	475
7.2	Wertpapierkurse	477
7.2.1	Pflege der Wertpapierkurse	477
7.2.2	Kursberechnung für Anleihen	479
7.2.3	Wertpapierkurse lesen	481
7.3	Referenzzinsen und Zinskurven	482
7.3.1	Referenzzinsen	483
7.3.2	Zinskurven	485
7.3.3	Marktdatenpflege für Zinsen	491
7.4	Commodity-Preise und Commodity-Forward-Kurven	495
7.4.1	Commodity-Preise aus der Logistik	495
7.4.2	Future-Style-Commodity-Forward- Kurven	497
7.4.3	Forward-Style-Commodity-Forward- Kurven	500
7.5	Indizes	502
7.5.1	Aktienindizes	502
7.5.2	Preisindizes	503
7.6	Credit-Spreads	503
7.7	Volatilitäten	504
7.7.1	Erste Volatilitätsdatenbank	506
7.7.2	Zentrale Volatilitätsdatenbank	508
7.7.3	Zugriffsregel auf Volatilitäten	510
7.8	Korrelationen	512
7.9	Ablage von Barwerten	513
7.9.1	Barwertablage	514
7.9.2	Pflege von Barwerten	515
7.9.3	Berechnung von Barwerten	515
7.10	Szenarien und Marktdatenshifts	517
7.10.1	Szenarien	517
7.10.2	Marktdatenshifts	519
7.10.3	Szenarienverläufe	520
7.11	Marktdatenschnittstelle	521
7.11.1	Marktdatenübernahme über die Dateischnittstelle	521
7.11.2	Datafeed	525
7.11.3	Marktdatenübernahme über eine Tabellenkalkulation	531

8 Exposure Management 535

8.1	Grundlagen	536
8.1.1	Verwendung	536
8.1.2	Begriffe	537
8.2	Rohexposure	539
8.2.1	Rohexposure-Pflege	539
8.2.2	Überblick über die Rohexposures	544
8.2.3	Commodity-Split definieren	546
8.3	Rohexposure-Customizing	548
8.3.1	Globale Einstellungen	548
8.3.2	Exposure-Aktivitätsart	549
8.3.3	Freie Attribute	551
8.4	Rohexposure-Freigabe	552
8.4.1	Manuelles und automatisches Freigeben	552
8.4.2	Anschluss an SAP Business Workflow	553
8.4.3	Ableitungsstrategie für Exposure-Felder	554
8.4.4	Produktart	554
8.4.5	Exposure-Positionstyp	555
8.4.6	Nicht abgeleitete Exposure- Transaktionen	558
8.5	Exposure-Position	560
8.5.1	Bestandswerte von Exposure-Positionen	560
8.5.2	Exposure-Positionsbewegungen	562
8.5.3	Commodity-Exposure-Report	564
8.6	Treasury-Logistik-Integration	567
8.6.1	Logistik-Ausgangsverarbeitung	568
8.6.2	Treasury-Eingangsverarbeitung	569

9 Hedge Accounting für Exposures 571

9.1	Prozesse im Hedge Accounting für Exposures	572
9.1.1	Sicherungsplan	573
9.1.2	Exposures	576
9.1.3	Sicherungsobjekt	578
9.1.4	Sicherungsbeziehung	579
9.1.5	Barwerte ermitteln	582
9.1.6	Prospektiver und retrospektiver Effektivitätstest	583
9.1.7	Hedge Accounting in der Stichtagsbewertung	588

9.1.8	Ende der Sicherungsbeziehung	591
9.1.9	Nach dem Ende der Sicherungs- beziehung	596
9.1.10	Reporting im Hedge Accounting	598
9.2	Customizing	601
9.2.1	Zentrales Customizing: Hedge Accounting für Exposures als internes Add-on	601
9.2.2	Einstellungen für die Effektivitätsprüfung ...	603
9.2.3	Einstellungen im Market Risk Analyzer	613
9.2.4	Einstellungen in der Bestands- verwaltung	615
9.3	Arten der Exposure-Erfassung	620
9.3.1	Direkte Eingabe	620
9.3.2	Exposure in der Geschäftserfassung des Sicherungsgeschäfts	621
9.3.3	Übergabe aus dem Exposure Management	625
9.3.4	Upload	626
9.3.5	Eingabe über generisches Geschäft	628
9.4	Implementation Guide	629
9.4.1	Full-Fair-Value-Sicherung	630
9.4.2	Sicherung der Wechselkursrisiken	633
9.4.3	Sicherung der Zinsrisiken	639

10 Hedge Accounting für Bestände 645

10.1	Prozesse im Hedge Accounting für Bestände	647
10.1.1	Hedge Accounting als integraler Bestandteil der Bestandsverwaltung	647
10.1.2	Sicherungsbeziehung	648
10.2	Bestandsverwaltung in Sicherungsbeziehungen	667
10.2.1	Designation in der Bestandsverwaltung – Phänomenologie	667
10.2.2	Konzept des Unterbestands	669
10.2.3	Bewertung und Hedge Accounting	670
10.2.4	Dedesignation	674
10.2.5	Customizing	676
10.3	Effektivitätstest	682
10.3.1	Effektivitätstest mit und ohne Wertermittlung	682
10.3.2	Effektivitätstestmethode	683

10.3.3	Einstellungen zu Marktdatenberei- stellungen im PET	691
10.3.4	Testdurchführung	696
10.3.5	Effektivitätstestergebnisse	698
10.3.6	Effektivitätstestframework	702

11 Reporting mit dem Informationssystem 705

11.1	Logische Datenbanken	706
11.1.1	Logische Datenbank FTI_TR_DEALS	709
11.1.2	Logische Datenbank FTI_TR_POSITIONS	719
11.1.3	Logische Datenbank FTI_TR_PERIODS	734
11.1.4	Logische Datenbank FTI_TR_PL_CF	743
11.1.5	Logische Datenbank FTI_TR_CASH_FLOWS	744
11.1.6	Logische Datenbank FTI_TR_THX_HEDGE	745
11.1.7	Logische Datenbank FTI_TR_COMM_DEAL_EXP	747
11.1.8	Logische Datenbank FTI_TR_HEDGE	749
11.1.9	Logische Datenbank FTLM_DB01	751
11.1.10	Performance und Parallelisierung der logischen Datenbanken	752
11.1.11	Einstellungen zur Berechtigungsprüfung	753
11.2	SAP Query	753
11.2.1	SAP Queries für Standardberichte	754
11.2.2	Fälligkeitsliste	755
11.2.3	Berichts-Berichts-Schnittstelle	756
11.3	Logische Datenbank LDB_PROCESS und RAPIs	759
11.3.1	Funktionsbaustein LDB_PROCESS	760
11.3.2	RAPIs	763
11.4	SAP NetWeaver BW	768
11.4.1	Extraktion von Bestandsdaten	771
11.4.2	Extraktion von Marktdaten	777

12 Portfolio-Controlling mit den Analyzern 779

12.1	Die Analyser-Familie	780
12.1.1	Market Risk Analyzer	781
12.1.2	Portfolio Analyzer	781

12.1.3	Accounting Analyzer	782
12.1.4	Credit Risk Analyzer	783
12.2	Grundlagen, Architektur, Datenhaltung	784
12.2.1	Grundlegende Begriffe	784
12.2.2	Finanzobjektbestandteile und -pflege	787
12.2.3	Analysemerkmale und Analysestruktur	795
12.2.4	Merkmale im Credit Risk Analyzer	815
12.2.5	Finanzobjektintegration	815
12.2.6	Risikoträger und generisches Geschäft	830
12.3	Übergreifende Steuerungs- und Strukturierungsentitäten	832
12.3.1	Cashflow-Kennzeichen	832
12.3.2	Auswertungsart und Bewertungsregel	834
12.3.3	Filter	845
12.3.4	Portfoliohierarchie	851
12.4	Value at Risk	856
12.4.1	Grundlagen	856
12.4.2	Risikohierarchie	858
12.4.3	Statistikrechner	862
12.4.4	Kalkulation des Value at Risks	872
12.4.5	Backtesting	883
12.4.6	Weitere Kennzahlen	884
12.5	Online-Analysen des Market Risk Analyzers	886
12.5.1	Barwertanalyse	886
12.5.2	Kennzahlenanalyse	889
12.5.3	Value-at-Risk-Einzelanalyse	894
12.5.4	Übersicht über andere Online-Analysen	898
12.6	Ergebnisdatenbank des Market Risk Analyzers, des Portfolio Analyzers und des Accounting Analyzers	900
12.6.1	Einführung in die Ergebnisdatenbank	900
12.6.2	Kennzahlen und Kennzahltypen	905
12.6.3	Auswertungsverfahren	913
12.6.4	Pflege der Kennzahlen und Auswertungsverfahren	917
12.6.5	Ermittlung der Einzelsätze und Endergebnisse	929
12.6.6	Portfolio Analyzer: Renditemethoden und -ermittlung	937
12.6.7	Portfolio Analyzer: Benchmarking	945

12.6.8	Portfolio Analyzer: risikoadjustierte Kennzahlen	953
12.6.9	Analyzer-Informationssystem	959
12.7	Credit Risk Analyzer	968
12.7.1	Globale Einstellungen	970
12.7.2	Anrechnungsbetragsermittlung	971
12.7.3	Limitmanagement	983
12.7.4	Automatische Finanzobjektintegration	989
12.7.5	Integrierte Einzelgeschäftsprüfung und Tagesendverarbeitung	989
12.7.6	Reporting	994
12.7.7	Weitere Funktionen und Werkzeuge	996
12.8	Werkzeuge – Parallelisierung	996

13 Schnittstellen und Erweiterungen 999

13.1	BAPIs	1000
13.1.1	Einführung in BAPIs	1000
13.1.2	Finanzinstrumentspezifische BAPIs	1006
13.1.3	Finanzinstrumentübergreifende BAPIs	1007
13.1.4	BAPIs für das Gesamtgeschäft	1009
13.1.5	BAPIs für Stammdaten	1011
13.1.6	BAPIs für das Exposure Management und das Hedge Accounting für Exposures ...	1012
13.2	PI-Message	1013
13.2.1	PI-Schnittstelle TreasuryDealNotification ...	1014
13.2.2	Beispiel zum Routing und Mapping in PI ...	1016
13.2.3	Mapping im Zielsystem	1020
13.3	Erweiterungen	1024
13.3.1	Customer-Exit	1025
13.3.2	BAdI	1026
13.3.3	Erweiterungspot	1031

14 Gesetzliche Vorschriften 1037

14.1	Sarbanes-Oxley Act	1038
14.1.1	SAP-Lösungen für Governance, Risk und Compliance	1038
14.1.2	Management des internen Kontrollsystems	1039

14.1.3	Kontrollen im Treasury	1039
14.2	Anforderungen von Finanzbehörden	1041
14.2.1	Der Steuerprüfer im System	1041
14.2.2	Überlassung steuerrelevanter Daten	1043
15	Integrations- und Systemwerkzeuge	1049
15.1	Merkmalsableitungstool	1049
15.1.1	Schrittarten	1050
15.1.2	Verwendung und Beispiele	1051
15.2	Altdatenübernahme	1054
15.2.1	Altdatenübernahme für OTC-Geschäfte	1055
15.2.2	Altdatenübernahme für Wertpapiere	1058
15.2.3	Altdatenübernahme für Futures und handelbare Optionen	1061
15.2.4	Customizing der Altdatenübernahme	1061
15.3	Initialisierung	1063
15.3.1	Initialisierung für OTC-Geschäfte	1065
15.3.2	Initialisierung für Wertpapiere	1066
15.3.3	Initialisierung für Futures, handelbare Optionen und Darlehen	1067
15.4	Migration	1067
15.5	Archivierung	1070
15.5.1	Geschäftsverwaltung	1071
15.5.2	Korrespondenz	1072
15.5.3	Bestandsverwaltung	1073
15.5.4	Exposure Management	1073
15.5.5	Hedge Accounting	1074
15.5.6	Analyzer	1074
Anhang	1075
A	Literatur	1077
B	Die Autoren	1079
C	Danksagung	1083
Index	1085

Index

A

- Abfragemodus 530
abgeleitete Bewegung 80, 107
abgeleiteter Geschäftsvorfall
345, 1029
gleicher Status 430
offline 430
online 429
Status Plan 429
Abgrenzung 386, 1033
antizipative 386
Differenzenverfahren 386
Methode 391
Rücknahmeverfahren 386,
1029
transitorische 386
Verfahren 391
Abgrenzungsbewegung 103
Abgrenzungsposten Kaufwert
316
Ableitungsregel 821
Ableitungstool 433, 1020,
1049
Ablösungswährung 492
Abrechnung 140
ABS 34
Abschlussdatum 717
Abschreibungsregel 362
Abstimmkonto 440
abstrakter Risikofaktor 861
abstraktes Commodity 58
Abwicklungstyp 122, 140
Accounting-Kreis 57, 312,
320
Add-on-Faktor 975, 980
Adressausfallwahrscheinlich-
keit 972, 981
Adressrisiko 30, 783, 969
Aggregationstyp 860, 861
Agio 315, 370, 376
AIS 962, 1040
Aktie 34, 118
Aktienindex 502
Aktiensplit 288
Aktientausch 288, 294
Aktivbestand 272
Aktivdepot 81, 272
aktive Definition 920, 921,
923
aktivierte Dividende 282
aktivierte Kosten 315
Alert 189, 242, 257
Arten 244
Kategorie 242
senden 245
Wartezeit 244
Alertmonitor 145, 245
Altdatenübernahme 1054
amortisierter Anschaffungswert
317
Amortisierung 315, 341, 358,
370, 1029, 1032
Bruttoverfahren 376
inkrementelle Methode 372
LAC 373
Negotiation Spread 315
SAC 373
Analyse(RM) 790
Analysemerkmal 785, 793
Analysemerkmal, Auslieferungs-
Customizing 814
Analysestruktur 793, 799,
802, 803, 805
aktivieren 803, 804
Auslieferungs-Customizing
814
Transport 805
Analyzer 30
Analyzer-Informationssystem
904, 962
Formeln 960
Layout 959
Änderungsbeleg 143
Änderungsparameter 1003,
1011, 1012
Anforderungsprofil 526
Angebotsübersicht 146
Anleihe 33
ABS, MBS 34
amortisierende 33
Auslosungsanleihe 34
Emission 34
mit Kündigungsrechten 34
mit Ratentilgung 34
Optionsanleihe 34
stücknotierte 33
Stufenzinsanleihe 33
Wandelanleihe 34
Annualisierungsfaktor 954
annuitätische Tilgung 116
Anrechnungsbetrag 783, 976
Anrechnungsbetragsermitt-
lung 794, 968, 971
Anschaffungswert 317
antizipative Abgrenzung 386
Anwendungslog → Exposure
Anzeigewährung 722, 731
Application Framework 163
Application Link Enabling
(ALE) 1004
Arbeitsbereich 649
Arbeitsvorrat 142
Archivierung 1070
Archivierungsobjekt
TRTM_CO 1072
TRTM_EXPOS 1073
TRTM_FTR 1071
TRTM_HMLOG 1074
TRTM_LM 1074
TRTM_REXP 1073
TRTM_TPM 1073
Assessment → Effektivitäts-
nachweis
Asset Backed Securities 34
asynchroner Datafeed 525
Audit Information System
(AIS) 962, 1040
Auflösung der Sicherungsbe-
ziehung 580, 593, 594,
595, 596
Ausfallrisikolimit 790, 815,
968
Ausfallrisikolimit, Merkmale
815
Ausfallrisikoregel 970, 974,
978, 981, 989

- Ausfallrisikoregel, Ableitung 970
 Ausfallwahrscheinlichkeit 974, 980, 981
 Ausstattungsbewegung 103
 Auswertungsart 603, 608, 609, 613, 730, 792, 836, 970
 Auswertungsdatum 834
 Auswertungsverfahren 918
 Monitor 928
 Version 919
 Auswertungswährung 722, 731
 automatische Fixingbearbeitung 137
 Average Rate Fixing 138
- B**
-
- Backtesting 883, 930
 BAdI 432, 461
 BAdI JBA_SFGDT 844
 Bankbuchung 434
 Bankverrechnungskonto 439
 Barrier-Option 32
 Double Barrier-Option 32
 Knock-in 32
 Knock-out 32
 Barwert 126, 355, 513, 582, 608, 783, 834
 Barwertablage 514
 Barwertanalyse 886
 Barwertart 362
 Barwert-Ast 907
 Barwertrechner 834
 Basiskennzahl 910
 Basiskennzahl, abstrakte 915
 Basisportfolio 811, 853
 Basispunkt 687
 Basispunkt Dollar-Offset 687
 BBAS → Berechnungsbasis
 bebuchbarer Knoten 808
 Behandlung Erfolge 360, 615
 Belegart 436
 Belegnummer 425
 Benchmark 908, 945
 Composite-Benchmark 946
 Devisen-Benchmark 946
 feste Zinsrate 946
 Index-Benchmark 946
 Benchmark-Lauf 952
 Benchmark-Stammdaten 946
 Benutzermenü 171
 Berechnungsart 574, 588, 604, 607, 630
 Berechnungsbasis 977, 979, 980
 Berechnungstyp 271, 607, 630
 Barwert 631, 637, 638
 Cashflow-Differenzen Forwardkurs diskontiert 644
 Cashflow-Differenzen gemäß Kassakurs 634
 Clean-Price hypothetisches Derivat 612, 642
 hypothetisches Derivat 612, 642
 innerer Wert hypothetisches Derivat 612, 637, 644
 Korrelation 613
 Option, innerer Wert Forwardkurs 637
 Option, innerer Wert Forwardkurs diskontiert 637, 644
 Option, innerer Wert Kassakurs 619, 637
 Berechtigung
 Standing Instructions 80
 Steuerprüfer 1042
 Berechtigungsprofil 172
 Berechtigungsprüfung für logische Datenbanken 753
 Berichts-Berichts-Schnittstelle 756
 Bestand
 Aktivbestand 272
 Buchbestand 262
 Einzelbestand 304, 328
 externer 26, 261
 interner 27, 261
 Lot-Bestand 268
 Passivbestand 272
 Short-Bestand 273
 Bestandsänderungstyp 263, 317, 679
 Bestandsbewegungsliste 318, 467, 705
 Bestandsbuchung 434
 Bestandscube 772
 Bestandsführung 27
 Bestandsführungstyp 338
 Bestandsführungsverfahren 338, 615, 630, 670
 Bestandskennzeichen 332, 670, 1028, 1058
 Bestandsliste 705
 bestandsrelevante Kennzahl 723
 Bestandsverwaltung 27
 externe 267
 interne 311
 Bestandswährung 334, 436, 439, 481, 722
 Betafaktor 502
 Betafaktorart 503
 Beteiligung 34
 Betrag
 der Bewegung 738
 periodengerecht abgegrenzter 737
 Bewegung 102
 abgeleitete 80, 107, 737, 1028
 verarbeiten 736, 738
 Bewegungsart 103, 263, 458
 finanzdispolelevante 465
 Zahlungsanordnung zulassen 458
 Bewegungstyp 103
 Bewertung 352, 679
 Devisen 315
 einstufige Kursbewertung 358, 615
 erfolgsneutrale 723
 erfolgswirksame 723
 Futures 367
 Index 315
 Indexbewertung 369
 manuelle 355
 Margin-Abgrenzung 382
 simulierte 723
 Swapabgrenzung 382
 Swapbewertung 383
 Titel 315
 Titelbewertung 362
 Bewertung Hedge Accounting
 effektiver Anteil 590

- freistehender Anteil* 589, 669
ineffektiver Anteil 590
Zeitwert 590, 619
 Bewertungsbasis 369
 Bewertungsbereich 313, 320, 437, 438, 575, 602, 713, 725, 782, 826, 886
führender 575, 602
zahlender 418, 419, 449
 Bewertungsbewegung 103
 Bewertungsdatum 835
 Bewertungsfaktor 973
 Bewertungsfaktorfindung 972, 981
 Bewertungsklasse 314, 393
allgemeine 323
spezielle 323
 Bewertungsklassenumbuchung 393, 395
 Bewertungsprotokoll 673
 Bewertungsregel 613, 792, 836
 Bewertungsschritt 340, 358, 588, 615
 Bewertungswährung 322, 347, 451, 481, 722
 Bezugsrecht 288, 294
 Bilanzkennzeichen 334
 Binomialbaum 844
 Black-Scholes 844
 Bondemission 34
 Bootstrapping 484
 Branche 712, 732
 Branchensystem 712, 718, 732
 Bruttoverfahren 376
 Buchbestand 27
 buchhalterische Bewertung 352, 356, 615, 634, 677, 1029
 Buchindex 369
 Buchswapwert 383
 Buchung
 debitorische 434, 440, 447, 450, 1030
 manuelle 280, 283, 430, 1030
 Buchungsfreigabe 420
 Buchungsjournal 425, 460, 462, 705
 Buchungskreis 57, 312, 320
 Buchungskreislösung 443
 Buchungsprotokoll 424, 590, 592
 Buchungsschema 435
 Buchungsschema, Fortschreibungsart 437
 Buchungsschlüssel 437
 Buchungsstatus 736
 Buchungsstatus TRL 736
 CFM 736
 Ledger-Buchungsstatus 736
 zu fixieren 423, 429
 zu stornieren 426
 Buchungstyp 434
 Buchwert 317
 Business Add-in (BAdI) 1002, 1020, 1026, 1031
 Business Application Programming Interface (BAPI)
 Architektur 1010
 finanzinstrumentspezifisches 1006
 finanzinstrumentübergreifendes 1007
 Gesamtgeschäft 1009
 Hedge Accounting für Exposures 1013
 Stammdaten 1011
 testen 1007
 Verbuchung 1009
 Business Content 769
 Business Function 38
 Business Object Repository (BOR) 1003, 1004
 Business-Objekt 1001
 Business-Objekttyp 1001
- C**

 Callable Bond 294
 Cap 32, 115, 154, 644
 Cashflow am Horizont 613, 843
 Cashflow-Hedge 578, 585, 588, 596, 597, 626, 629, 639, 642, 650
 Cashflow-Kennzeichen 613, 615, 832
- CFM 35
 Clearing Account 28
 Close 302, 320
 Close-Margin 309
 CML → SAP Loans Management
 Collar 581, 638, 644
 Commercial Paper 31, 126, 134, 151
 Commercial Paper, Schnellerfassung 95
 Commodity 58
 abstraktes 58
 Floating 550
 Marktdaten 495
 Preise 495
 Preiskurve 495
 Commodity Forward 160
 Commodity Price Engine (CPE) 496
 Commodity Swap 161
 Commodity-Art 56
 Commodity-Bestandsreport 705
 Commodity-Exposure-Report 564
 Commodity-Future 71
 Commodity-Kurvenart 497
 Commodity-Preise 1034
 Commodity-Risiko 574
 Commodity-Split 546
 COMPLETE_INDICATOR 1011
 Compound-Option 32
 Continuous-Compounding 490
 Corporate Finance Management (CFM) 35
 Credit Risk Analyzer 968
 Critical Terms Match 583, 685
 Cross-Rate-Rechner 125
 current Value 683, 700
 Customer-Exit 1025
 Customizing-Prüfung 446
- D**

 Darlehen 419, 1067
 Darlehensnummer 332

- Darlehensverwaltung 76, 412
 Darlehensvorkauf 160
 DART 1043
 DARWIN 35
 Data Retention Tool (DART) 1043
 Datafeed 521, 525
 DataSource
 OCFM_DELTA_POSITIONS 771
 OCFM_INIT_POSITIONS 771
 OCFM_MARKET_VALUES 777
 Dateschnittstelle 521
 Datenbank 162
 Datenbild Geschäftsverwaltung 96
 Datenquelle 528
 Datenquelle für Datenfeed definieren 528
 Datumsformat 89
 Debitor 76
 Debitorenebenbuch 453
 debitorische Zahlung →
 Buchung, debitorische
 Decay-Faktor 865, 866
 Dedesignation → Entkopplung der Sicherungsbeziehung
 Depot 80, 268, 326
 Aktivdepot 272
 Passivdepot 272
 Depotbank 76
 Depotbestandskennzeichen 333
 Depotfinanzstrom 269, 276, 1029
 Depotgattungsbestand 970
 Depotgattungsfinanzstrom 705
 Depotgruppe 82, 326
 Depotliste 148
 Depotumbuchung 285, 1029
 Depotverwaltung 27, 269, 270, 278
 Designation 572, 657
 Marktdaten 658
 Marktdatencontainer 658
 Devisengeschäft 91, 123, 124, 154, 173, 1008, 1011
 Devisengeschäft, Intercompany-Funktion 32
 Devisenkassageschäft 32
 Devisenkurs 475, 476, 714
 Devisenoption 32, 117, 621, 637
 amerikanische 32
 Barrier-Option 32
 Compound-Option 32
 Correlation-Option 32
 europäische 32
 FX Average Rate Option 32
 FX Basket Option 32
 FX Forward Rate Volatility Agreement 32
 Non-deliverable Forward 32
 Devisenspoteffekt 574, 634
 Devisenswap 32
 Devisenswapsätze 475, 476
 Devisentermingeschäft 32, 379, 574, 608, 621, 623, 624, 633
 Differenzenverfahren 386
 Differenzierung 325, 466, 471
 Differenzierung, Bestandsposition 721
 DIG G7 Methode 1 605
 digitale Devisenoption 32
 Hit-at-End-Binary-Option 32
 One-Touch-Binary-Option 32
 Disagio 315, 370, 376
 Dispositionsebene 464
 Dividende, aktivierte 282
 DMS-Dokument 664
 Document Management System (DMS) 188, 215, 662
 Dokumentation 653, 661
 Dokumentation, Sicherungsbeziehung 1036
 Dokumentenmanagementsystem 188, 215, 662
 Dollar-Offset-Methode 606, 685
 Downside-Risiko 955
 Drawable Bond 294
- E**
-
- Early Repayment 105
 EEV 915
 EEV1 916
 EEV2 916, 926, 935
 Effective Portion 590
 effektiver Anteil → Bewertung Hedge Accounting
 Effektivitätsbewertung 581, 584, 585, 588, 604, 616
 Effektivitätsnachweis 581, 584, 585, 588, 594, 604, 616
 Effektivitätsnachweisart 604, 605
 Effektivitätsprognose 593
 Effektivitätsprüfung 583, 584, 593, 600
 Effektivitätsrate 606, 608, 686
 Effektivitätstest 660, 672, 682, 699
 Detailprotokoll 581, 586, 587, 591, 610, 643
 manuell effektiver 698, 702
 prospektiver 583, 593, 651
 retrospektiver 583, 588, 594, 651
 Effektivitätstestmethode (ET-Methode) 651, 683, 684
 Effektivzinsberechnung 271
 Eigenkapital-Reklassifikation
 automatische 597, 636
 manuelle 596, 636
 Einbuchen
 Bezugsrechte 288
 junge Aktien 288
 Einstiegsbild Geschäftsverwaltung 91
 Einzelbestand 268, 304, 328, 330, 1060
 Einzelgeschäftsprüfung, integrierte 783, 969, 971, 989, 990
 Einzelregulierung 456, 458
 Einzelsatzergebnisdatenbank 915
 Einzelsatzverfahren 913
 Einzelsatzverfahren, Filter 851

- einziges Sicherungsobjekt →
 Sicherungsobjekt
 Elementargeschäft 830
 Elementtyp 863, 866, 874
 Emissionswährung 478
 Emissionswährungsumstel-
 lung 288, 290
 Emittent 62, 76
 Emittentenrisiko 969
 Endergebnisverfahren 915
 Filter 851
 für additive Kennzahlen 916
 *für nicht-additive Kennzah-
 len* 916
 Endergebnisverfahren 1 916
 Endergebnisverfahren 2 916,
 926, 935
 endfällige Tilgung 116
 Enhancement Package 38
 Entkopplung der Sicherungs-
 beziehung 581, 593, 595,
 596, 624, 636, 674
 Ereignistypkopplung 143
 Erfolgsart 737
 Erfolgsbuchung 434, 435, 441
 erfolgsneutrale Bewertung
 723
 Devis 316
 Index 316
 Titel 316
 Ergebnis verdichten 733, 742
 Ergebnisanalyse 790
 Ergebnisdatenbank 514, 851
 Ermittlung von Einzelsätzen
 930
 Prozessübersicht 902
 Ermittlungsverfahren 972,
 978, 984
 Ertragsklassifikation 743
 Erweiterung 30, 168, 999,
 1024
 Erweiterungsparameter 1003
 Erweiterungsspot 1026, 1031
 ESV 913
 exklusive Plandaten 727
 exogener Cashflow 937, 941,
 942
 Exposure 576, 767, 976
 Ableitungsstrategie 554
 Aktivitätsart 539
 Anwendungslog 570
 *automatischen Positionsab-
 gleich erlauben* 548
 *BADI_TEX_DERIVE_EXP_
 FIELDS* 554
 brutto 973
 *Commodity-Exposure-Bewe-
 gungsart* 549
 Devisen-Exposure-Typ 549
 Differenzierungskriterien
 556
 differenzierende Merkmale
 556
 Differenzierung 556
 Exposure-Ansatztyp 550
 Feldauswahl 549
 fix 550
 fix und variabel 550
 freies Attribut 551
 Freigabe simulieren 546
 globale Einstellungen 548
 Herkunft 540
 Integration 568, 569, 570
 Lieferdatum 542
 netto 973
 ohne Preise 550
 Position 560
 Positionsbewegung 562
 Positionstyp 555
 Produktart 554
 Rohexposure 539
 SAP Business Workflow 553
 Transaktion 558
 Transaktion FTREX7 546
 *Treasury Exposure Notifica-
 tion* 567
 *Treasury-Logistik-Integra-
 tion* 567
 variabel 550
 variable Preise 542
 Version 540
 Vorgangstyp 548
 *Vorgangstypänderung erlau-
 ben* 548
 Zahltermin 542
 Exposure Management 28
 Commodity-Preisrisiko 536
 Customizing-Pfade 536
 Fremdwährungsrisiko 536
 Version 535
 Exposure-Analyse 1034
 Exposure-Transaktion 576
 externe Kennzahlen 790
 externes Konto 27, 1033
 Extraktor 768
- ## F
-
- Fair Value 834
 Fair-Value-Hedge 578, 616,
 618, 626, 629, 639, 641,
 650
 Fälligkeit 110
 Fälligkeitsliste 145
 FAS 133 571, 583, 604
 Fazilität 148, 152
 bilaterale 31
 Funktionen 1027
 syndizierte 31, 718
 Fehlerprotokoll 733
 Feldauswahl 119
 Festgeld 31, 104, 106, 123,
 124, 134, 150
 Festgeld, Schnellerfassung 95
 FIFO 330
 Filter 100, 845, 913
 mit freien Abgrenzungen
 845
 zu Portfoliohierarchien 845,
 854
 Filtertyp 845
 *Filter zu Portfoliohierar-
 chien* 850
 Filtergruppe 849
 mit freien Abgrenzungen
 849
 FIN_TRM_CORR_FW 186
 Financial Supply Chain
 Management (FSCM) 31,
 32, 33, 34, 35
 Finanzbuchhaltung 420
 Finanzobjekt 784, 787, 788,
 989
 Finanzobjekt, Ausfallrisiko-
 limit 984
 Finanzobjektintegration 785,
 815, 989
 Finanzobjektintegration, auto-
 matische 989

- Finanzobjektkomponente
 791, 817, 818, 824
 Analyse(RM) 824, 825
 Ausfallrisikolimit 825
 Finanzobjekttyp 816
 Finanzstrom 99, 1033
 Finanzstrom, Neuberechnung 134
 Finanzstromgeschäft 31, 151
 Firma 57
 Fixieren 423, 429
 Fixing 137
 Floater 33
 Floor 32, 154, 644
 FO-Integration 816
 Folgekondition 108, 109
 Fonds 34, 418, 466
 Fondsumbuchung 468
 Fördermittelmanagement
 (PSM-GM) 466
 Förderung 418, 466
 Formel-ID 976, 979
 Fortschreibungsart 262, 676
 abgeleiteter Geschäftsvorfall
 347, 406
 Abgrenzung 390
 Bestandskomponente 317
 buchungsrelevante 440
 Buchungsschema zuordnen
 437, 447
 Depotverwaltung 270
 Ersetzung von 680
 finanzdispolevante 465
 Kapitalmaßnahme 293
 Positionskontoverwaltung
 310
 Rechtstyp 295
 Fortschreibungsmethode 110
 adjusted 110
 rhythmisch 110
 unadjusted 110
 Forward 160
 Forward Rate Agreement
 (FRA) 32, 155, 644
 Discount Style 32
 Normal Style 32
 Forward-Kurvenart 484
 Forward-Style-Kurven 500
 Forward-Zinssatz 484
 Free-Standing Portion 589
 Freigabebedingung 142
 Freigabeverfahren 142
 Freigabeworkflow 666
 freistehender Anteil → Bewertung Hedge Accounting
 Fremdwährungsbewertung
 358, 615
 Fremdwährungsrisiko → Wechselkursrisiko
 Frühwarnsteuerung 985, 987
 FSCM → Financial Supply Chain Management (FSCM)
 FS-CML → SAP Loans Management
 Full-Fair-Value-Sicherung
 574, 630
 Funktionsbaustein LDB_PROCESS 759, 763
 Future 34, 118, 156, 301, 367
 Future-Stammdaten 60
 Future-Style-Kurven 497
- G**
-
- Gattung 60, 148
 Gattungsdaten 60, 479, 722, 1033
 Gattungsstammdaten 61, 1032
 GDPdU 1041
 Geldhandelsgeschäft 426
 generisches Geschäft 628, 831
 Geschäft
 ändern 127
 anlegen 86, 127
 anpassen 130
 anzeigen 127
 ausführen 129
 ausüben 130
 bearbeiten 86
 Definition 85, 86
 Dividende anpassen 130
 erfüllen 130
 fixieren 130
 Freigabe 131
 Historie 128
 Knock-in 129
 Knock-out 129
 Kontrolle 131, 145
 korrigieren 130
 kündigen 128
 prolongieren 128
 seitendupliziertes 717
 stornieren 127
 Übersicht 146
 Überwachung 131
 verfallen 130
 Vorbelegung 89
 vorzeitige Abwicklung 129
 Geschäfte mit Finanzströmen 147
 Geschäftsart 54, 420
 Geschäftsbearbeitung 92
 Geschäftsbereich 82
 Geschäftserfassung 92
 Geschäftsfreigabe 147
 Geschäftsjahr 649
 Geschäftsnummer 332
 Geschäftspartner 74, 712, 722, 726
 Geschäftsverwaltung 26, 85
 Bewegungen buchen 421
 Datenbild 96
 Einstiegsbild 91
 Sammelbearbeitung 94
 Geschäftsvorfall 265
 Geschäftsvorfall, abgeleiteter
 317, 319, 342, 345, 428, 429, 677, 1029
 Geschäftsvorfallstyp 265
 gesicherte Stände 884, 890, 914
 Gewinn- und Verlustrechnung (GuV) 434
 Gitteranalyse 899
 Governance, Risk und Compliance (GRC) 1038
 Process Control 1039
 Repository 1038
 Risk Management 1039
 Griechen 889
 Grundgeschäft 654
 Grundlauf 931
 Grundsätze zur Durchsicht und Prüfbarkeit digitaler Unterlagen (GDPdU) 1041
 Gruppfindung 456
 Gültig-ab-Datum 108
 Gültigkeit 792, 913
 GuV 876

H

HACC-Rule 671
 Haltedauer 857, 863, 867
 Haltekategorie 314, 398
 Handel 122
 handelbare Option 34, 118, 158, 301
 handelbares Finanzinstrument 118
 Handelsentscheidung 122
 Handelsfunktion 123, 127
 Handelsplatz 62, 478, 481
 Händlerberechtigung 126
 Hauptbewegung 103
 Hauptbuch
 klassisches 441
 neues 441
 Hauptdarlehensnehmer 76
 Hausbank 74, 78
 Hausbankkonto 75, 439
 Haushaltsmanagement (PSM-FM) 418, 466
 Hauswährung 451, 722
 Hedge Accounting für Bestände 571
 Hedge Accounting für Exposures 571, 572
 Hedge Accounting für Exposures aktivieren 593, 601
 Hedge Adjustment 671, 674
 Hedge Management 29
 Hedge Ratio 606, 686
 Hedge-Accounting-Regel 671, 681
 Heimatbörse 481
 FIFO 330
 Höchstalter Kurs 842
 Horizont 835
 HTML-Datei 525, 526
 Hull-White 844
 hypothetisches Derivat 612

I

IAS 39 571, 583
 Impairment 316, 356, 358
 Incoterm 57
 Index 502

Indexanleihe 33, 369
 Indexart 503
 Indexbewertung 358, 369
 Index-Linked Bond 33, 369, 502
 Ineffective Portion 590
 ineffektiver Anteil → Bewertung Hedge Accounting
 Information Ratio 955
 InfoSource
 OCFM_MARKET_RATES 777
 OCFM_POSITIONS 771
 Initialisierung 1063
 Initial-Margin 301
 Inklusivkennzeichen 89
 inkrementelle Methode 371
 Interest Rate Garantie 32
 Interface 999
 Interimslimit 987
 Intermediate Document (IDoc) 1005
 interner Devisenhandel 175, 1028
 Internes Kontrollsystem (IKS) 1039
 Interpolation 488, 1031
 Interpolationsverfahren 488
 Interpretation Depotgruppe 728
 Interpretation Leitwährung 728
 Intrakonzerngeschäfte 404
 Investitionspool 418, 469
 Investmentanteil 34
 IRG 32

J

Jensen_fs Alpha 956
 Journal der Finanzgeschäfte 146
 junge Aktie 288

K

Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln 288

Kapitalherabsetzung 288
 Kapitalmaßnahme 34, 287, 430, 1029
 manuelle 289, 292
 Sortierung 293
 Kapitalmaßnahmetyp 288
 Kapitalveränderung 103
 Kaufindex 370
 Kaufwert 315
 Kennzahlen 314
 Monitor 928
 nicht-additive 812
 Version 919
 Kennzahltyp 905
 Kennzahltyp, Attributvererbung 910
 Kennzahltyphierarchie 905
 Market Risk Analyzer 906
 Portfolio Analyzer 907
 Kennzeichen Analyse aktiv 791
 Klammerung 799
 Klassensystem 74
 Klassifizierung → Value at Risk
 klassisches Hauptbuch 441
 Knoten
 CONDITIONS 714
 CONDITONDS_UL 716
 FLOWS 714
 FLOWS_UL 715
 FORMULA 714
 INTEREST_ADJ 714
 LDB 851
 MAIN_DATA 712
 PAY_INFO 714
 UNDERLYING 715
 Kompensation 457
 Kompensationsgeschäft 380, 843
 Komponente 314
 abgeleitete 314
 originäre 314
 Komponenten-Commodity 546
 Kondition 63, 108, 714
 Konditionsart 63, 68, 109, 271
 Konditionstyp 108
 Konfidenzniveau 857
 Konsolidierungsstufe 860

- Kontenfindung 431, 433, 447, 449, 451
 Altdatenübernahme 1063
 Überblick 440
 Kontenlösung 442, 443, 446
 Kontenplan 438
 Kontierung 441
 Kontierungsreferenz 334, 400, 432, 439, 670, 721
 Kontierungsreferenz, historische 733
 Kontierungsreferenzmittlung 433
 Kontierungsreferenzumbuchung 400, 434
 Kontoauszug 452
 Kontosymbol 402, 433, 438
 Kontosymbol, Initialisierung 1065
 Kontrahent 76
 Kontrahentenrisiko 969
 Konvexität 898
 Korrekturlauf 931
 generischer 933
 manueller 934
 Korrelation 512, 862
 Korrelationsart 513
 Korrelationskoeffizient
 exponentiell gewichteter 865
 klassischer 864
 Korrelationsmatrix justieren 868
 Korrespondenz 28, 79, 179, 186
 Abrechnung Geschäft 206
 ACK-Nachricht 231
 AMND-Nachricht 231
 Änderungsnachricht 231
 Anerkennungsnachricht 190, 231
 Anlage 254
 anzeigen 245
 Attribute 202
 Ausgangsprozess 208, 217
 BAfI 228, 253
 Berechtigung 247
 BIC-Code 214
 CANC-Nachricht 231
 Eingangsnachricht 231
 Eingangsprozess 206, 207, 226
 Ereignis 254
 Erweiterungsspot 253
 Format 195, 256
 Format-Metatype 193, 256
 Formatzuordnung 200
 Fragment 229
 Freigabe 190, 222, 253
 Genehmigerliste 223
 Geschäftspartnergruppe 201, 208, 209, 210
 Geschäftsstatus 189
 Historie 186
 interner Empfänger 201, 209
 Kommunikationskanal 192, 257
 Kommunikationsprofil 196, 209, 210
 Korrespondenzempfängerart 196
 Korrespondenzklasse 194, 207
 Korrespondenzpartner 200
 Korrespondenzvorfall 211
 logische Nachricht 229
 Mapping 188, 213, 230, 233
 Mapping-Regeln 234
 Mapping-Tool 233, 237
 Merge 230
 Migration 185
 Nachricht 187
 NACK-Nachricht 231
 negative Anerkennungsnachricht 231
 Nummernkreis 215, 239
 senden 223
 Split 229
 Stornonachricht 231
 SWIFT-Code 214
 SWIFT-Format 212
 Verknüpfung 231, 238, 249
 Zuordnung 249
 Korrespondenz alt 181
 Ableich 184
 Bestätigung 184
 Gegenbestätigung 183, 184
 Istsatz 181
 Korrespondenzart 183
 Korrespondenzmedium 181
 Korrespondenzmonitor 182, 184
 Korrespondenzvorfall 183
 Plansatz 181
 Korrespondenzabgleich 1026
 Korrespondenzausgabe 1028
 Korrespondenz-Framework 187
 Korrespondenzmonitor 187, 246, 1026
 Korrespondenzobjekt 187, 189, 251
 abgleichen 189
 Anlage 187, 250
 anzeigen 188
 Depotumbuchung 220
 Ereignis 189
 Freigabe 188
 Geschäft 217
 kundeneigene Felder 218, 220, 253
 manuelle Anlage 221
 Status 190
 zuordnen 189
 Kostenstelle 434
 Kreditlinie 152
 Kreditrisiko 969, 973
 Kündigungsgeld 31, 134, 151
 Kündigungsgeld, Schnellerfassung 95
 Kursart 362, 477, 731
 Kursberechnung 731
 Kursbewertung
 einstufige 481
 für Devisentermingeschäfte 358, 615
 Kursgewinn 346
 Kurstyp 322, 476
 Kursverlust 346

L

- Länderrisiko 969
 Lauf 930
 Laufzeit 62
 Ledger 445
 Ledger, führendes 449
 Ledgergruppe 445
 Ledgerlösung 443, 444, 448

- Leihedepot 81
 Leitwahrung, Interpretation 717
 LIFO 330
 Limitart 984
 Limitbetrag 987
 Limitanspruchnahme 994
 Limitleihe 987
 Limitmanagement 783, 969
 Limitmerkmal 794, 983, 985, 986
 Limitproduktgruppe 984
 Limitprufung 126, 980, 991
 Limitvorgabe 980, 983, 986, 994
 Linear Amortized Cost (LAC) 373
 lineare Regression 605, 606, 687, 689
 Liquiditatsvorschau 463
 LOFO 330
 Logical Database Builder 709
 logische Datenbank 600, 706
 FTI_TR_CASH_FLOWS 708, 744
 FTI_TR_COMM_DEAL_EXP 747
 FTI_TR_DEALS 709
 FTI_TR_HEDGE 601, 749
 FTI_TR_PERIODS 734
 FTI_TR_PL_CF 708, 743
 FTI_TR_POSITIONS 599, 719
 Logistik-Ausgangsverarbeitung → Exposure
 Logistik-Integration 1035
 Long-Short-Kennzeichen 268
 Lot 268, 326, 328, 331, 332
 Lot-Bestand 268, 304, 326, 328
 Loterzeugungstyp 330
- M**
-
- Management of Internal Controls (MIC) 1039
 manuell effektiver Effektivitatestest 698, 702
 manuelle Buchung → Buchung, manuelle
 manuelle Sollstellung → Buchung, manuelle
 manuelle Zinsanpassung 135
 manuelles Fixing 137
 Mapping 1016, 1020
 Margin
 Close-Margin 309
 eines Repos 383
 Variation-Margin 307
 Margin-Abgrenzung 316, 358, 383
 Margin-Buchung 430
 Margin-Konto 27
 Market Risk Analyzer 29, 723
 Marktdaten 26
 Marktdatenanderungsratenset (MDCR) 695
 Marktdatenanderungsratenset (MDRC) 694
 Marktdatencontainer 658
 Marktdatenpuffer 528, 530
 Marktdatenschnittstelle 521
 Marktdatenschnittstelle, Dateiformat 524
 Marktdatenset (MDS) 692, 693
 Marktdatenshift 519
 Marktdatenubernahme
 Dateischnittstelle 521
 Tabellenkalkulation 531, 533
 Marktkurse 724
 Marktwertanderungsfrist 975, 981
 maschinelle Sollstellung 280, 430, 1030
 maschinelle Zinsanpassung 135
 Maskierung 439
 Maskierung des Bankverrechnungskontos 439
 MBS 34
 Measurement → Effektivitatsbewertung
 Mehrwahrungsanleihe 33
 Meldewesen 472, 1034
 Menge 261
 Mengebuch 262, 329
 Merkmalsableitung 821
 Merkmalsableitungstool 1049
 Merkmalsauspragung 805
 Merkmalshierarchie 806, 854
 Merkmalshierarchieknoten
 bebuchbarer 808
 nicht bebuchbarer 809
 Merkmalsklammerung 799
 Merkmalsverwendung 810, 813
 Migration 1067
 Moneyiness 505, 509
 Moneyiness-Berechnungsmethode 509
 Monitor fur Kennzahlen und Auswertungsverfahren 928
 Monte Carlo 872
 Mortgage Backed Securities (MBS) 34
- N**
-
- Nachbarschaftssuche 511
 Nachricht 187
 empfangen 188
 senden 188
 Nachweisart 604, 605
 Nebenbuchbestandskennzeichen 333
 negative Zinsen 1032
 Negotiation Spread 376
 Net-Present-Value 834
 Net-Investment-Hedge 578, 629
 Netting 452, 456, 462
 Netting-Gruppen 970
 Nettoverfahren 376
 neues Hauptbuch 441
 nicht bebuchbarer Knoten 809
 nicht-additive Kennzahlen 812
 Noise-Schwellenwert 611
 Nominalanpassung 285
 Nominalveranderung 104
 Nominalzins 109
 Notierung 476
 Notierungsart 477
 bruchnotierte 478
 preisnotierte 478

prozentnotierte 477
punktnotierte 478
stücknotierte 477
 Notierungswährung 478, 481
 Notiz 101, 664
 NPV 834
 Nullsätze ausblenden 733

O

Open 302, 320
 Open TRIM 165
 operatives Geschäft 535
 operatives Reporting 144
 Option 574, 590, 619
 handelbare 34, 118, 301
 OTC-Option 32, 117
 Option auf Commodity-Future 71
 Optionsanleihe 34, 294
 Optionspreis 834
 Optionspreisrechner 126, 834
 Optionsschein 34
 auf Aktie 294
 auf Anleihe 294
 auf Index 294
 auf Währung 294
 Overnight-Variation-Margin 308

P

PA-Bewegung 942
 PA-Bewegungsart 1031
 parallele Rechnungslegung 267, 442
 Parallelisierung 752, 776
 Parametertransaktion 144
 Parkupon 871
 Parsatz 484
 Partner (Engagement) 726
 Passivbestand 272
 Passivdepot 81, 272
 PDF 663
 PDF-Formular 216
 Performance Presentation Standards 941

Period-Begin-to-Date-Rendite 940
 Personenbuchung 434, 454
 PET → prospektiver Effektivitätstest
 PH-Blatt 851
 PH-Knoten 851
 PI-Message 1036
 PI-Schnittstelle TreasuryDeal-Notification 1014
 Plansatz Zins 131
 Plansatzaktualisierung 133
 Plansatzfortschreibung 132
 Plansatzfortschreibungsmethode 132
 Poolteilnehmer 469, 470
 Poolzertifikat 469
 Portfolio 326, 722
 Portfolio Analyzer 30
 Portfoliohierarchie 811, 851
 anzeigen 853
 deaktivieren 855
 definieren 851
 löschen 855
 Positionskonto 82, 268, 301, 332
 Positionskontobestand 304
 Positionskontofinanzstrom 305
 Positionskontoführung 27
 Positionskontoverwaltung 301
 Positionsmonitor 147, 1028
 PPS 941
 Prämienkondition 115
 Preisanpassung 136
 Preisanpassungsplan 146
 Preisindex 502
 Preiskompensierung 116
 Preisrechner 834
 Primärrisikoreduktion 972
 Produktart 53
 Produkttyp 148
 Profil → Sicherungsprofil
 Programm RSAQCOPY 754
 Prolongation 623
 prospektiver Effektivitätstest (PET) 651, 660, 672, 675
 Public Sector 1034
 Public Sector Management 418, 466, 473

Purchase GAAP 350
 Puttable Bond 294

Q

Query → SAP Query

R

Ratentilgung 63, 116
 Rating 981
 Readjustierung 948
 Rebonato-Verfahren 868, 880
 Recherche 899
 Rechnungslegungsvorschrift 445
 Recht 294, 430
 Rechtstyp 294
 Recovery Rate 972, 975, 980, 982
 Recovery-Rate-Klasse 982
 Referenz 138, 713, 718
 Referenzgeschäftsvorfall 345
 Referenznummer 425
 Referenztyp 138
 Referenzzins 482, 483
 Registerkarte im Geschäft 87, 96
 Analyse 102
 Ausfallrisiko-Limit 102
 Ausstattung 97
 Commoditypreisanpassung 101
 Finanzobjekt 102
 Finanzstrom 99
 Hedge Management 98, 1031
 kundenspezifische 98, 168
 Notizen 101
 Partnerzuordnung 101
 Status 101
 Verwaltung 98
 Wertpapierkursanpassung 101
 Zahlungsverbindungen 99
 Zinsanpassung 100
 Zusatzbewegung 98
 zusätzliche 71

- Regulierer 76
 Reklassifikation 595, 619
 Reklassifikationsperiode 597
 Rekonstruktion 710
 Relevanz → Exposure
 Rendite
 Dietz-Methode 939
 mit festem Startdatum 940
 mit fester Periodenlänge 940
 modifizierte Dietz-Methode 938
 Money-Weighted Rate of Return 938
 MWRR 938
 Time-Weighted Rate of Return 937
 TWRR 937
 wertgewichtete 938
 zeitgewichtete 937
 Renditeintervalle 921, 948
 Renditeperioden 919, 935, 939
 Renditetyp 484
 Repo 33, 118, 157, 383
 Repo, Vorbelegung 1027
 Reporting 29
 Reporting Application Programming Interfaces (RAPi)
 601, 759, 763
 FTI_LDB_GET_HM_DATA_BY_HEDGE 767
 FTI_LDB_GET_HM_DATA_GENERAL 767
 FTI_LDB_GET_OTC_DEAL1_DATA 765
 FTI_LDB_GET_OTC_DEAL2_DATA 765
 FTI_LDB_GET_POS_DATA 765
 FTI_LDB_GET_SECURITY_DEAL1 765
 FTI_LDB_GET_SWAP_DETAILS 765
 Restlaufzeit 712, 732, 741
 Restnominal 68
 retrospektiver Effektivitätstest (RET) 651, 672, 675
 Returntabelle 1003
 Reverse Repo 33
 Reversionsrate 509
 Risikobindungsdauer 973, 975, 981, 987
 Risikofaktor 858, 859, 873
 Risikohierarchie 859
 Risikosensitivität 972, 981
 Risikoträger 829
 Risikotyp 574, 973
 RM-(Barwert)Puffer 730
 Rohexposure 537
 allgemeine Einstellung 540
 automatisch freigeben 552
 Benutzerdaten 543
 Einzelatz 541
 freies Attribut 540
 Freigabe 552
 Freigabeart 550
 Herkunft 540
 Kontrollattribut 541
 Menge 542
 Position 541
 Preisfindung 550
 Unterrohexposure 543
 Rolle 171, 1040
 Routing 1016
 Rückkaufvereinbarung → Repo
 Rücknahmeverfahren 386
 Rundungsregel 275
- S**
- Sachkontenbuchung 434
 Saldenliste 598
 Sammelbearbeitung 93, 146
 Sammelbearbeitung, Geschäftsverwaltung 94
 Sammelbestand 329
 SAP Cash and Liquidity Management 463
 SAP In-House Cash 460, 1030
 SAP List Viewer (ALV) 756
 SAP Loans Management 412, 419, 720
 SAP NetWeaver BW 706, 768
 SAP NetWeaver PI 1013
 SAP Query 754
 SAPscript-Formular 215
 Sarbanes-Oxley Act (SOX) 1038
 Schleifer-Noise-Methode 686
 Schnellbearbeitung 96
 Schnellerfassung 95
 Commercial Paper 95
 Festgeld 95
 Kündigungsgeld 95
 Schnittstelle 30, 999
 Schwellenwert 611
 Scientifically Amortized Cost (SAC) 373
 Segment 811, 853
 Sekundärrisikoausweis 972
 Selektionsvariante 728
 Sensitivitäten 898
 Settlementrisiko 969, 973, 975, 980
 Sharpe Ratio 954
 Short-Bestand 273
 Shortcut 90, 583, 604
 Short-Rate-Modell 844
 Sicherheitenbewertungsregel 972, 973
 Sicherheitenstellung 970, 972
 Sicherungsbeziehung 579
 Sicherungsbeziehung, Dokumentation 653, 661
 Sicherungsgeschäft 767
 Sicherungsinstrument 654
 Sicherungsobjekt 578, 767
 einziges 575, 640, 644
 ID 930
 Sicherungsplan 573
 Sicherungsprofil 649
 Sicherungsstrategie 580, 588, 603, 622, 632, 639
 Sicherungsszenario 649
 Sicherungstyp 577, 578, 622, 630
 Sicht 813
 Simulation 124
 Simulationsverfahren 861, 872
 Smile 505
 Sollstellung 271, 277
 manuelle 280, 430, 1030
 maschinelle 280, 430, 1030
 sonstige Sachkontenbuchung 434
 Sortino Ratio 955
 Spezielle Ledger 444, 450
 Spiegelgeschäft 173
 Spotbewertung 316

- Stamm-Commodity 546
 Stammdaten 26
 Future 60
 Wertpapier 60
 Standardabweichung
 exponentiell gewichtete 864
 klassische 864
 Standardbericht 754
 Standardbranche 713
 Standardbranchensystem
 719, 733
 Standardnotierung 476
 Standing Instructions 454
 Statistikart 865
 Status 101
 Status, Korrektur 142
 Statusschema 141
 Statusverwaltung 102, 140
 Steuern 274
 Steuern auf Wertpapierbe-
 stände 271, 274
 Steuerungsparameter 718,
 729
 Stichtag 717, 726
 Stichtagsbewertung 352, 356,
 1029
 stichtagsbezogener Bericht
 720
 Stichtagsreferenz 727, 738
 Bestandsvaluta 727
 Buchungsdatum 727, 736
 Storno 425, 427
 Bewegung stornieren 426
 Vorgang stornieren 425
 Stornobeleg 427
 Stornoprotokoll 426
 Struktur FTI_LDB_TR_POSITI-
 ONS 721
 Stückzins 316
 Subposition 670
 Swap 32
 Cancelable Swap 32
 Compound Swap 32
 Constant Maturity Swap 32
 Discount Swap 32
 EONIA-Swap 32, 113
 OTC-Zinsswap 120
 Payerswap 32
 Receiverswap 32
 Währungsswap 32
 Zinsswap 32, 120
 Zinswährungsswap 32
 Swapabgrenzung 316, 358,
 382, 635
 Swapbewertung 316, 358,
 382, 635
 Swaption 32
 SWIFT 1026
 Switch 39
 synchroner Datafeed 525
 Syndikat splitten 718
 Szenarienvorlauf 520
 Szenario 517, 692, 835
- T**
-
- Tabellenkalkulation 521
 Tagesendverarbeitung 783,
 969, 992
 Tagesfinanzstatus 463
 Tagesgeld 31
 Tageswertberechnungstyp
 704
 Tageswertermittlungstyp 683
 Tauschgeschäfte 728
 Termingeld 31
 Terminprüfung 126
 Terminvorschau 110
 Testausführungshistorie 661
 Testplan 650, 692, 697
 Testplantyp 650
 TestRun 1002
 Testselektionen 848, 931
 thesaurierender Fonds 282
 Tilgung 316
 Tilgung, endfällige 116
 Tilgungskondition 116
 Tilgungsplan 63, 66
 Tilgungsplanset 66
 Time Value → Bewertung
 Hedge Accounting
 Titelbewertung 358, 362,
 481, 615, 632, 634, 679
 Tochterkennzahl 910
 Total Return Swap 155
 Tracking Error 955
 TRACV_POST_REL 441
 Transaction Manager 30
 Transaktion 576
 AAEP1 930
 AAEP2 934
- AFHBMPH 949
 AFO_AP_LOAN_MMIG
 823, 825
 AFO_AP_LOAN_MUPD 825
 AFO_AP_POS1_MMIG 822,
 825
 AFO_AP_POS1_MUPD 825
 AFO_AP_POS2_MMIG 822,
 825
 AFO_AP_POS2_MUPD 825
 AFO_AP_TRTM_MUPD 825
 AFO_FOI_PP 823
 AFW_ACT1 814
 AFW_ACT2 814
 AFWA 799, 806
 AFWBM 946
 AFWFL 845
 AFWKF_AA 927
 AFWKF_MD 928
 AFWKF_PA 918, 951, 956
 AFWKF_RA 927
 AFWO1 936
 AFWO2 936
 AFWOBM 953
 AFWPH 851
 AFWs 810
 AIS_FORMULA_DEF 960
 AIS_LAY_DEF 959
 AIS_STDREP 962
 AISGENKF 889
 AISS 898
 BAPI 1004, 1007, 1008
 BDBG 1005
 BP 76, 713
 CMOD 1025
 F110 455
 F111 455, 458, 459
 FC17 496
 FCZZ 496, 501
 FF70 463
 FI12 74
 FNV_CSPRD 504
 FNVS 757
 FTR_00 94
 FTR_ALERT 145, 245
 FTR_ALRT_BTCH 245
 FTR_BAPI 1007, 1008
 FTR_BP_BIC 214
 FTR_COCREATE 221
 FTR_COMATCH 241

FTR_COMONI 221, 245, 246
FTR_COSEND 223
FTR_CREATE 92
FTR_CSPRD 504
FTR_DEALPOS 147
FTR_EDIT 92, 425, 757
FTR_EXT_ASSIGN 209
FTR_IMPORT 227
FTR_INB_ASSIGN 208
FTR_INB_FUNC 207
FTR_INT_ASSIGN 209, 210
FTR_MASS_EXEC 129
FTR_MASS_ORDR_EXPIRY 130
FTR_MASS_SETTLE 140
FTR_MASSAPPROVAL 223
FTR_OPEN_TRTM_INIT 822, 825
FTR_SAT_ACTVT 212, 220
FTR_SAT_ALRT 243
FTR_SEND_APPRVL 223
FTR_SWIFT_IMPORT 227
FTREX12 1035
FTREX31 1074
FTREX32 1074
FTREX7 546
FTW1A 1045
FTWCS 1044
FTWP 1046
FW_CSPRD 504
FW18 478
FWBS 283, 430, 1030
FWDG 148
FWDP 148
FWDU 246, 286, 1029
FWER 297
FWK0 291
FWSO 280, 430, 1030
FWUP 274
FWZE 280, 430, 1030
FWZZ 61, 479, 481, 724
JBAI 884
JBAS 884
JBDO 787, 823, 978
JBDO1 788
JBIRM 491
JBNPV 514, 582
JBR4E 855
JBR5 855
JBR8 855
JBRBPC 479
JBRCT 806
JBRCU 805
JBRCV 806
JBREVAL 836
JBRFO 792
JBRI 899
JBRJ 899
JBRK 853
JBRP0 855
JBRR 859
JBRW 855
JBRX 886
JBVIR 506, 507
JBVIRC 506, 507
JBWH 806
JBYC 491
KLMAXLIMIT 980
KLNACHT 993, 994
PA_FILLUTYPEMATCH 944
PAEP1 930
PAEP2 934
PAEPBM 952
PAEPBM_RATIO 958
PARSPDEL 931
PFCG 171
PMSV 308, 309
PMVM 307, 309, 430
RAEP1 930
RAEP2 934
RASRPDEL 931
RCA00 832
RECON4 203
RECON5 181, 189, 203
RM_98 824, 825
RMCM 832
RMV0 894
S_ALR_87008531 514, 515
S_KK4_13000287 981
S_KK4_13000289 983
S_KK4_13000302 983
SARA 1071
SBIW 777
SCPE_PQ1 496
SCPE_PQ3 496
SE18 1026, 1031
SE19 73, 170, 1026, 1031
SE71 216
SE80 764
SFP 216, 666
SLG1 227, 733, 1043
SM30 744
SM34 236
SMOD 1025
SO10 215
SPROXY 1016
SQ01 754, 755, 756
SQ02 754, 755, 777
SWETYPV 143
SWO1 1001
SXMB_IFR 1016, 1018
TAN_MDS 693
TANCC_COMPARE 501
TANCC11 501
TANCCMASTER 497
TANMDCR 695
TAV1 138
TAV2 138
TBB1 421, 423, 424, 452, 466, 591
TBB1_LC 1055
TBB4 389
TBCD 143
TBCS 137
TBD3 530
TBD4 528, 529
TBD5 524, 530
TBDA 530
TBDM 522, 524, 531
TBDN 524
TBEX 531
TBEXN 533
TBR1 457
TBR4 458
TBR5 457
TBR6 139, 638, 644
TBR7 139
TBR8 139
TBR9 139
TBRL 139
TBT1 126
TBZ1 184
TBZ11 182, 1026
TBZ12 183
TCL1 153
TCOM 146
TEM15 1035
TEM20 1034
TF00 94

- THM10* 595
THM11 595
THM12 595
THM14 595, 596
THM15 595
THM30 582
THM35 628
THM50 593
THM51 593
THM52 594
THM53 595
THM54 596, 636
THM58 597, 636
THM59 598
THM80 583, 584, 593, 600
THM81 596, 598
THM82 599
THM83 599
THM84 600
THMEX 573, 595, 602, 750, 1013
THMMM 626, 640, 642, 643
THMRO 628
THMST 599
TI00 94
TI10 135, 136, 748
TI11 135, 136
TI12 135, 136
TI37 135, 136
TI4B 638
TI90 421
TI91 94
TI92 94
TI93 421
TI94 146
TISCERN 705, 749
TJ01 146
TJ04 147, 744
TJ05 135, 136
TJ05_REV 136
TJ06 145
TJ07 146
TJ08 147
TJ09 133, 136
TJ12 147
TJ13 136
TM_60 148
TM_60A 148
TM00 93
TM0F 95
TM1F 95
TM20 96
TM21 134
TM22 126
TM30 126
TM3F 95
TMA5 795
TMCA 123
TMFM 134
TMSA 124
TPC2 1042
TPC4 1042
TPC6 1042
TPM_CTY_MASTER 57, 58, 71, 501
TPM_CTY11 60
TPM_INITIALIZE 1064
TPM_LOCATION 59
TPM_MIGRATION 185, 471, 1068
TPM_TRCO_FUTMD 499, 501
TPM_TRCO_FWDMD 501
TPM1 352, 356, 476, 588, 670, 674, 697
TPM10 423, 424, 426, 427
TPM100 648, 662, 667, 720, 735, 745
TPM110 696
TPM112 698
TPM12 401, 599, 669, 705
TPM13 318, 401, 467, 599, 667, 705, 757
TPM15M 395
TPM18 351, 429, 592, 593, 641
TPM20 401, 425, 460, 462, 705
TPM22 285
TPM25 309
TPM26 262
TPM27 351, 430
TPM28 401
TPM3 433
TPM35 309, 430
TPM4 82
TPM40 204, 269, 705
TPM44 387, 724
TPM56A 473
TPM57A 333
TPM59 481, 724
TPM60 355, 514, 515, 582
TPM61 1059
TPM61A 1058
TPM63 1057
TPM63A 1060
TPM63C 1056
TPM63D 1061
TPM64 1058
TPM70 357
TPM73 357
TPM74 355
TPM75 357
TPM8 305
TPM80 468
TPM81 468
TPM82 399
TPM83 400
TPM85 470
TPM86 471
TPM87 471
TPM88 471
TPM89 470
TPM9 83, 304
TPM90 471
TRIG_IGT 404
TRMP_PERFORMANCE_MV 730
TRMP_PERFORMANCE_ST 730
TRMW 731
TRS_SEC_ACC 80, 212, 233
TS00 94
TSL00 94
TSL10 147
TSW2 184
TV21 517, 519
TV28 520
TVMD 524
TVS1 866
TX06 93, 623, 624
TX30 176
TX31 177
TXAK 126
TXV5 137
 Transaktionstyp 577
 Transaktionsvorgang 577
 transitorische Abgrenzung 386

Translation 346
 TreasuryDealNotification
 1014
 Treasury-Eingangsverarbei-
 tung → Exposure
 Treuhandanlage 153
 Treynor Ratio 955
 Trinomialbaum 844

U

Überfälligkeit 732
 Übersetzungstabelle 526, 528
 Ultimokennzeichen 89
 Umbuchung 393
 Umbuchung, Kontierungsrefe-
 renz 400
 Umbuchungsbewegung 103
 Umbuchungstyp 341, 393,
 394
 Umrechnungstyp 322
 Umschlüsselungstabelle 521
 Underlying 117, 715
 Unterbestand 669, 670, 678
 User-Exit 979

V

Value at Risk 588, 592, 602,
 616, 617, 630, 856, 897
*Approximation der Barwert-
 funktion* 872
Delta-Gamma-Verfahren
 873
Delta-Position 873, 897
Delta-Verfahren 872
Gamma-Position 873, 897
GuV-Verteilung 897
historische Simulation 874
Kombinationsverfahren 877,
 881
Konsolidierungsstufe 875
Marginal Value at Risk 885
Mean Excess Loss 884, 897
Monte Carlo 877
Monte-Carlo-Simulation 877
Structured Monte Carlo
 878

Value at Risk Contribution
 885
Value-at-Risk-Art 879, 895
Varianz-Kovarianz-Ansatz
 878
Vollauswertung 881
 VaR-Ast 907
 Variablenbelegungs-ID 977,
 980
 Variante 100
 Variante Selektionsoptionen
 und Steuerungsparameter
 728
 Varianz-Kovarianz 861, 872
 Variation-Margin 307, 316,
 368
 Verbrauchsfolgeverfahren
 329
 Verfall/Barrier-Check 146
 Vergleichsberechnungstyp
 688
 Vergleichsmethode 608
 Versicherungsaufsicht 472
 Version 919
 Version 1 990
 Version 2 990
 Versionsdatum 920
 Verteilung der Erfolge 588
 Vertragsabschlussdatum 717,
 1027
 Verwendung 264
 Verwendungszustand 667, 699
 Volatilität 504, 862, 1030
historische 505
implizite 505
Zugriffsregeln 510
 Volatilitätsart 506, 511
 Volatilitätsdatenbank
erste 505, 506
zentrale 505, 508
zweite 505
 Volatilitätskurve 505, 508
 Volatilitätsname 508, 510
 Volatilitätsprofil 508
 Volatilitätsstruktur 505
 Vollansatz 314
 Vorgang 120, 420
 Vorgängerkondition 109
 Vorgangshistorie 122
 Vorgangsübergang 120
 Vorzeichen Zahlbetrag 745

vorzeitige Abwicklung 624

W

Währungstausch 435, 436
 Währungstyp 446, 449, 451
Buchungskreiswährung 446,
 449
Hartwährung 449, 451
Konzernwährung 449, 451
 Währungsumrechnungsart
 731
 Wandelanleihe 34, 294
 Wechselkursrisiko 574, 633
 Wert 261
 Wertpapier 149
Stammdaten 60
Vorbelegung 1027
 Wertpapierberechnung 1033
 Wertpapierkennnummer
 1032
 Wertpapierleihe 147, 159
 Wertpapierleihgeschäft 33
 Wertpapiertermingeschäft
 157
 Workflow 131, 142, 971,
 1027

X

XI → siehe SAP NetWeaver PI

Z

Z1-Zugriff 1041
 Z3-Zugriff 1043
 Zahldaten 714
 Zahlung 1034
 zahlender Bewertungsbereich
 → Bewertungsbereich
 Zahlprogramm 452, 455,
 1030
für offene Posten 455
für Zahlungsanordnungen
 455
 Zahlung kapitalisierter Zin-
 sen 113

- Zahlungsabwicklung 452
- Zahlungsanordnung 455, 458, 461, 1030
- Zahlungsauftrag 461
- Zahlungsdatum 745
- Zahlungseingang 278
- Zahlungsplan 147
- Zahlungsreferenz 462
- Zahlungsverbindung 78, 82, 99, 453, 455
- Zahlungsverkehr 77
- Zahlungsvorgang 437, 454
- Zahlwahrung 436, 439
- Zeitmerkmale 712
- Zeitwert → Bewertung Hedge Accounting
- Zerobond 33
- Zerobondabzinsungsfaktor (ZBAF) 482, 484, 493
- Zerobondrendite 484
- Zerokupon 871
- Ziehung 152
- Zinsanpassung 100, 131
- Zinsanpassung aktualisieren 136
- Zinsanpassungsdaten 714
- Zinsanpassungskondition 112
- Zinsanpassungsplan 146
- Zinsderivat 426
- Zinseffekt 574
- Zinsen, variable 273
- Zinsfixierung 274
- Zinsgeschaft 31, 110, 113, 116, 152, 1027
- Zinskapitalisierung 109, 113, 1027
- Zinskondition 109
- Zinskurve 482, 485, 486
- Zinskurvenart 485
- Zinsoption 644
- Zinsperiode 110, 117
- Zinsrisiko 574
- Zinssplit 678
- Zinsstruktur 485
- Zinsstrukturkurve 485
- Zinsswap 604, 612, 630, 641, 642
- Zuordnungsvariante 949, 952, 958
- Zusatzbewegung 98, 106
- Zusatzkontierung → Kontierung
- zusatztliche Registerkarten 71
- Zuschreibungsregel 362