|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
| Testskript  SAP S/4HANA - 22-09-20 | public |
| Fremdwährungs-Risikomanagement (1X1\_DE) |

Inhaltsverzeichnis

[1 Verwendungszweck 8](#_Toc52218868)

[2 Voraussetzungen 9](#_Toc52218869)

[2.1 Systemzugriff 9](#_Toc52218870)

[2.2 Rollen 9](#_Toc52218871)

[2.3 Stammdaten, Organisationsdaten und sonstige Daten 10](#_Toc52218872)

[2.4 Voraussetzungen/Situation 11](#_Toc52218873)

[2.5 Vorbereitende Schritte 11](#_Toc52218874)

[2.5.1 Geschäftspartner anlegen 11](#_Toc52218875)

[2.5.1.1 Allgemeine Daten für Geschäftspartner pflegen 11](#_Toc52218876)

[2.5.1.2 Zahlungsverbindungen für Geschäftspartner pflegen 14](#_Toc52218877)

[2.5.1.3 Berechtigungen für Geschäftspartner pflegen 18](#_Toc52218878)

[2.5.1.4 Meldedaten im Buchungskreis für Geschäftspartner pflegen 20](#_Toc52218879)

[2.5.2 Korrespondenz 21](#_Toc52218880)

[2.5.2.1 Zuordnung von Profilen und Geschäftspartnergruppen zu externen Empfängern pflegen 22](#_Toc52218881)

[2.5.2.2 Zuordnung von Profilen und Geschäftspartnergruppen zu internen Empfängern pflegen 25](#_Toc52218882)

[2.5.3 Pflegen des Kreditlimits 28](#_Toc52218883)

[2.5.3.1 Limit mit Limitart Y01 pflegen 28](#_Toc52218884)

[2.5.3.2 Limit mit Limitart Y07 pflegen 30](#_Toc52218885)

[2.5.4 Händler und Händlerberechtigungen pflegen 31](#_Toc52218886)

[2.5.4.1 Händler definieren 31](#_Toc52218887)

[2.5.4.2 Benutzerdaten definieren 33](#_Toc52218888)

[2.5.4.3 Händlerberechtigungen pflegen 34](#_Toc52218889)

[2.5.5 Exposure Management und Hedge Management 36](#_Toc52218890)

[2.5.5.1 Zeitraster definieren 36](#_Toc52218891)

[2.5.5.2 Sicherungsbereich definieren 37](#_Toc52218892)

[2.5.5.3 Kennzahlen für Bilanzdevisenrisiko definieren 42](#_Toc52218893)

[2.5.5.4 Anforderungsparameter für Bilanzdevisenrisiko definieren 44](#_Toc52218894)

[2.5.6 Fixingreferenzen definieren 47](#_Toc52218895)

[2.5.7 Werte für die Verfallszeit definieren 50](#_Toc52218896)

[3 Übersichtstabelle 52](#_Toc52218897)

[4 Testverfahren 62](#_Toc52218898)

[4.1 Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Ohne Optionen 62](#_Toc52218899)

[4.1.1 (1XN) Market Rates Management – manuell per Upload 62](#_Toc52218900)

[4.1.2 Limitinanspruchnahmen aufbauen 63](#_Toc52218901)

[4.1.3 Tagesfinanzstatus analysieren 64](#_Toc52218902)

[4.1.4 Liquiditätsvorschau analysieren 65](#_Toc52218903)

[4.1.5 Bilanz-Exposure-Management 65](#_Toc52218904)

[4.1.5.1 Bilanzdevisenrisiko prüfen 65](#_Toc52218905)

[4.1.5.2 Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen 67](#_Toc52218906)

[4.1.5.3 Snapshot-Position prüfen und verarbeiten 69](#_Toc52218907)

[4.1.5.4 Snapshot freigeben 70](#_Toc52218908)

[4.1.6 Cashflow-Exposure-Management 71](#_Toc52218909)

[4.1.6.1 Exposure-Daten sammeln 72](#_Toc52218910)

[4.1.6.2 Rohexposure anlegen 72](#_Toc52218911)

[4.1.6.3 Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen 76](#_Toc52218912)

[4.1.6.4 Cashflow-Netto-Exposure überprüfen 77](#_Toc52218913)

[4.1.7 Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren 79](#_Toc52218914)

[4.1.8 Handelsanforderung anlegen 79](#_Toc52218915)

[4.1.8.1 Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen 80](#_Toc52218916)

[4.1.8.1.1 Sicherungsanforderung generieren 80](#_Toc52218917)

[4.1.8.1.2 Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten 82](#_Toc52218918)

[4.1.8.1.3 Sicherungsanforderung freigeben 84](#_Toc52218919)

[4.1.8.2 Handelsanforderung über Cashflow-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen 85](#_Toc52218920)

[4.1.8.2.1 Sicherungsanforderung generieren 85](#_Toc52218921)

[4.1.8.2.2 Sicherungsanforderung freigeben 88](#_Toc52218922)

[4.1.8.3 Handelsanforderung manuell anlegen 90](#_Toc52218923)

[4.1.9 Status der Handelsanforderungen prüfen 92](#_Toc52218924)

[4.1.10 Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen 93](#_Toc52218925)

[4.1.11 Devisenkontrakt anlegen 95](#_Toc52218926)

[4.1.11.1 Kassa-/Termingeschäft anlegen 95](#_Toc52218927)

[4.1.11.2 Devisenswap anlegen 97](#_Toc52218928)

[4.1.11.3 Non-Deliverable Forward anlegen 99](#_Toc52218929)

[4.1.12 (BFB) Grundlegende Kassenvorgänge 101](#_Toc52218930)

[4.1.13 (J78) Erweiterte Kassenvorgänge 102](#_Toc52218931)

[4.1.14 Korrespondenz 103](#_Toc52218932)

[4.1.14.1 Abrechnungsstatus setzen (manuell) 103](#_Toc52218933)

[4.1.14.2 Korrespondenz über PDF-Formular 105](#_Toc52218934)

[4.1.14.2.1 Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden 106](#_Toc52218935)

[4.1.14.2.2 Korrespondenzstatus prüfen 106](#_Toc52218936)

[4.1.14.2.3 Eingehende Bestätigung erhalten 108](#_Toc52218937)

[4.1.14.2.4 Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen 109](#_Toc52218938)

[4.1.14.2.5 Abrechnungsstatus setzen 111](#_Toc52218939)

[4.1.15 Periodenende wurde erreicht 113](#_Toc52218940)

[4.1.15.1 Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen 113](#_Toc52218941)

[4.1.15.2 Stichtagsbewertung durchführen 117](#_Toc52218942)

[4.1.16 Geschäft ist fällig 120](#_Toc52218943)

[4.1.16.1 Für NDF 120](#_Toc52218944)

[4.1.16.1.1 Kurs für NDF festlegen 120](#_Toc52218945)

[4.1.16.1.2 Korrespondenz 121](#_Toc52218946)

[4.1.16.2 Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen 131](#_Toc52218947)

[4.1.16.3 Zahlungsanordnung verarbeiten 133](#_Toc52218948)

[4.1.16.4 Von Bank initiierte Zahlung 137](#_Toc52218949)

[4.1.16.5 Im Hauptbuch buchen 137](#_Toc52218950)

[4.1.16.6 Realisierten Gewinn und Verlust buchen 141](#_Toc52218951)

[4.2 Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Mit Optionen 143](#_Toc52218952)

[4.2.1 (1XN) Market Rates Management – manuell per Upload 144](#_Toc52218953)

[4.2.2 Limitinanspruchnahmen aufbauen 144](#_Toc52218954)

[4.2.3 Liquiditätsvorschau analysieren 146](#_Toc52218955)

[4.2.4 Bilanz-Exposure-Management 146](#_Toc52218956)

[4.2.4.1 Bilanzdevisenrisiko prüfen 146](#_Toc52218957)

[4.2.4.2 Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen 148](#_Toc52218958)

[4.2.4.3 Snapshot-Position prüfen und verarbeiten 150](#_Toc52218959)

[4.2.4.4 Snapshot freigeben 151](#_Toc52218960)

[4.2.5 Cashflow-Exposure-Management 152](#_Toc52218961)

[4.2.5.1 Exposure-Daten sammeln 153](#_Toc52218962)

[4.2.5.2 Rohexposure anlegen 153](#_Toc52218963)

[4.2.5.3 Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen 156](#_Toc52218964)

[4.2.5.4 Cashflow-Netto-Exposure überprüfen 158](#_Toc52218965)

[4.2.6 Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren 159](#_Toc52218966)

[4.2.7 Handelsanforderung anlegen 160](#_Toc52218967)

[4.2.7.1 Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen 160](#_Toc52218968)

[4.2.7.1.1 Sicherungsanforderung generieren 160](#_Toc52218969)

[4.2.7.1.2 Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten 163](#_Toc52218970)

[4.2.7.1.3 Sicherungsanforderung freigeben 164](#_Toc52218971)

[4.2.7.2 Handelsanforderung über Cashflow-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen 166](#_Toc52218972)

[4.2.7.2.1 Sicherungsanforderung generieren 166](#_Toc52218973)

[4.2.7.2.2 Sicherungsanforderung freigeben 169](#_Toc52218974)

[4.2.7.3 Handelsanforderung manuell anlegen 171](#_Toc52218975)

[4.2.8 Status der Handelsanforderungen prüfen 172](#_Toc52218976)

[4.2.9 Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen 174](#_Toc52218977)

[4.2.10 Devisenoptionsgeschäft anlegen 175](#_Toc52218978)

[4.2.10.1 Devisenoption Plain Vanilla anlegen 176](#_Toc52218979)

[4.2.10.2 Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) anlegen 178](#_Toc52218980)

[4.2.10.2.1 Option 1: Beide Optionen separat und Optionsreferenz anlegen 179](#_Toc52218981)

[4.2.10.2.2 Option 2: Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption in einem Schritt anlegen 184](#_Toc52218982)

[4.2.11 (BFB) Grundlegende Kassenvorgänge 188](#_Toc52218983)

[4.2.12 (J78) Erweiterte Kassenvorgänge 189](#_Toc52218984)

[4.2.13 Korrespondenz 190](#_Toc52218985)

[4.2.13.1 Abrechnungsstatus setzen (manuell) 190](#_Toc52218986)

[4.2.13.2 Korrespondenz über PDF-Formular 192](#_Toc52218987)

[4.2.13.2.1 Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden 193](#_Toc52218988)

[4.2.13.2.2 Korrespondenzstatus prüfen 193](#_Toc52218989)

[4.2.13.2.3 Eingehende Bestätigung erhalten 195](#_Toc52218990)

[4.2.13.2.4 Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen 196](#_Toc52218991)

[4.2.13.2.5 Abrechnungsstatus setzen 198](#_Toc52218992)

[4.2.14 Prämienzahlung 200](#_Toc52218993)

[4.2.14.1 Zahlungsanforderung für Prämie erzeugen 200](#_Toc52218994)

[4.2.14.2 Zahlungsanordnung verarbeiten 201](#_Toc52218995)

[4.2.14.3 Von Bank initiierte Zahlung 205](#_Toc52218996)

[4.2.14.4 Im Hauptbuch buchen 205](#_Toc52218997)

[4.2.15 Periodenende wurde erreicht 209](#_Toc52218998)

[4.2.15.1 Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen 209](#_Toc52218999)

[4.2.15.2 Stichtagsbewertung durchführen 213](#_Toc52219000)

[4.2.16 Geschäft ist fällig 216](#_Toc52219001)

[4.2.16.1 Bericht zur Sammelbearbeitung von Devisenoptionen überprüfen 216](#_Toc52219002)

[4.2.16.1.1 Entscheidung für "Ausübung" 217](#_Toc52219003)

[4.2.16.1.2 Kassakontrakt anlegen 219](#_Toc52219004)

[4.2.16.1.3 Entscheidung für "Verfall" 221](#_Toc52219005)

[4.2.16.2 Realisierten Gewinn und Verlust buchen 223](#_Toc52219006)

[4.3 Reporting 225](#_Toc52219007)

[4.3.1 Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen 225](#_Toc52219008)

[4.3.2 Treasury-Alerts anzeigen – Buchung 226](#_Toc52219009)

[4.3.3 Treasury-Alerts anzeigen – Abrechnung, Freigabe, Zahlung und Korrespondenz 228](#_Toc52219010)

[4.3.4 Zahlungsplan anzeigen 229](#_Toc52219011)

[4.3.5 Treasury-Buchungsjournal anzeigen 230](#_Toc52219012)

[4.3.6 Treasury-Bestandsanalyse 232](#_Toc52219013)

[4.3.7 Treasury-Bestandswerte anzeigen 233](#_Toc52219014)

[4.3.8 Finanzpositionen definieren 234](#_Toc52219015)

[4.3.9 Finanzstatus (Buchwert) 238](#_Toc52219016)

[4.3.10 Finanzstatus (Nominalbetrag) 239](#_Toc52219017)

[4.3.11 Treasury-Zahlungen anzeigen 240](#_Toc52219018)

[4.3.12 Barwert analysieren 242](#_Toc52219019)

[4.3.13 Marktrisikokennzahlen berechnen 243](#_Toc52219020)

[4.3.14 Sensitivitätskennzahlen 245](#_Toc52219021)

[4.3.15 Bericht "Limitinanspruchnahmen prüfen" 246](#_Toc52219022)

[4.3.16 Schwellenwertberechnung ausführen 248](#_Toc52219023)

[4.3.17 Schwellen-Report prüfen 249](#_Toc52219024)

[5 Anhang 251](#_Toc52219025)

[5.1 Exposure Management 251](#_Toc52219026)

[5.1.1 Übersicht über Rohexposures 251](#_Toc52219027)

[5.1.2 Exposure-Positionen bearbeiten 252](#_Toc52219028)

[5.1.3 Bewegungen der Exposure-Bestände anzeigen 253](#_Toc52219029)

[5.1.4 Beschreibung der Vorlage für den Import von Rohexposures 254](#_Toc52219030)

[5.1.5 Beispieldaten für den Import von Rohexposures 259](#_Toc52219031)

[5.2 Buchhaltung 262](#_Toc52219032)

[5.2.1 Bewertung stornieren 262](#_Toc52219033)

[5.2.2 Kontierungsreferenzumbuchung 265](#_Toc52219034)

[5.2.3 Kontierungsreferenzumbuchung stornieren 267](#_Toc52219035)

[5.3 Zinsanpassung 269](#_Toc52219036)

[5.3.1 Anpassung ändern (Zinssätze/Preise) 269](#_Toc52219037)

[5.3.2 Anpassung anzeigen (Zinssätze/Preise) 271](#_Toc52219038)

[5.3.3 Automatische Anpassungen stornieren (Zinssätze/Preise) 272](#_Toc52219039)

[5.3.4 Anpassung stornieren (Zinssätze/Preise) 273](#_Toc52219040)

[5.4 Market Risk Analyzer 275](#_Toc52219041)

[5.4.1 Marktdaten-Shift verwalten 275](#_Toc52219042)

[5.4.2 Szenarien pflegen 276](#_Toc52219043)

[5.4.3 Definieren des Berichtslayouts für "Marktrisikokennzahlen berechnen" 278](#_Toc52219044)

[5.4.4 Marktrisikokennzahlensätze verwalten 282](#_Toc52219045)

[5.4.5 Marktrisikokennzahlen berechnen 285](#_Toc52219046)

[5.5 Credit Risk Analyzer 287](#_Toc52219047)

[5.5.1 Übersicht der Limitvorgaben anzeigen 287](#_Toc52219048)

[5.6 Kontrahent ändern 289](#_Toc52219049)

[5.6.1 Kontrahenten von Finanzgeschäften ändern 289](#_Toc52219050)

[5.6.2 Finanzgeschäfte mit geändertem Kontrahenten anzeigen 290](#_Toc52219051)

[5.7 Analytische Apps 292](#_Toc52219052)

[5.7.1 Anzeigereihenfolge festlegen 292](#_Toc52219053)

[5.7.2 Analytische Apps 293](#_Toc52219054)

[5.8 FX-Netting 294](#_Toc52219055)

[5.8.1 Devisentermingeschäft anlegen 294](#_Toc52219056)

[5.8.2 Manuelle Abrechnung 295](#_Toc52219057)

[5.8.3 Devisengeschäft prolongieren 295](#_Toc52219058)

[5.8.4 Zahlungsverbindungen der Devisengeschäfte bearbeiten 297](#_Toc52219059)

[5.8.5 Netting-Liste vorschlagen 300](#_Toc52219060)

[5.8.6 Kompensation anzeigen 301](#_Toc52219061)

[5.8.7 Zahlungsanordnungen für kompensierte Geschäfte erzeugen 303](#_Toc52219062)

[5.8.8 Zahlungsanordnung verarbeiten 304](#_Toc52219063)

[5.9 Vorhandenes Geschäft kopieren 308](#_Toc52219064)

[5.9.1 Devisenkassa-/Devisentermingeschäft kopieren 308](#_Toc52219065)

[5.9.2 Non-Deliverable Forwards anlegen 310](#_Toc52219066)

[5.10 Kündigung des Devisengeschäfts 312](#_Toc52219067)

[5.10.1 Kündigungsanforderung für ein Termingeschäft anlegen, einreichen und freigeben 312](#_Toc52219068)

[5.10.2 Devisentermingeschäft kündigen 314](#_Toc52219069)

[5.10.3 Kündigungsabrechnungsstatus für Devisentermingeschäft setzen 316](#_Toc52219070)

[5.10.4 Bewegungen zur Kündigung buchen 317](#_Toc52219071)

[5.10.5 Kündigungsanforderung für eine Option anlegen, einreichen und freigeben 319](#_Toc52219072)

[5.10.6 Devisenoption kündigen 321](#_Toc52219073)

[5.10.7 Kündigungsabrechnungsstatus für Devisenoption setzen 323](#_Toc52219074)

[5.10.8 Bewegungen zur Kündigung buchen 325](#_Toc52219075)

# Verwendungszweck

Mit Fremdwährungs-Risikomanagement erhalten Sie einen Überblick über das Devisenrisiko, dem Ihr Unternehmen ausgesetzt ist, sowie über die Absicherungsinstrumente, mit denen Sie dieses Risiko gemindert haben. Sie können Ihr Bilanzdevisenrisiko überprüfen und die offenen Nettoexposures (Devisenrisiko) bestimmen.

Mit den für diesen Prozess vorgesehenen Finanzgeschäften können Sie die Devisenrisiken mindern.

Diese Funktion hilft Ihnen dabei, arbeitsintensive Prozesse zu automatisieren, z.B. die Bestätigung von Finanzgeschäften und FI-Buchungen, sodass Sie mehr Zeit haben, sich auf wertschöpfende Tätigkeiten zu konzentrieren. Sie können Betrieb und Rechnungswesen verwalten. Der Prozess umfasst Kassageschäfte, Termingeschäfte, Swaps, Non-Deliverable Forwards und Devisenoptionen.

Dieses Dokument enthält eine detaillierte Ablaufbeschreibung, anhand deren der Umfangsbestandteil nach der Lösungsaktivierung getestet werden kann; außerdem bildet es den vordefinierten Umfang der Lösung ab. Jeder Prozessschritt, Report oder Bestandteil wird in einem eigenen Abschnitt beschrieben, in dem die Interaktionen im System (Testschritte) tabellarisch dargestellt sind. Schritte, die nicht im Prozessumfang enthalten sind, aber zu Testzwecken benötigt werden, sind entsprechend gekennzeichnet. Projektspezifische Schritte sind zu ergänzen.

# Voraussetzungen

In diesem Abschnitt sind alle Voraussetzungen für den Test hinsichtlich System, Benutzer, Stammdaten, Organisationsdaten, sonstige Testdaten und Voraussetzungen zusammengefasst.

## Systemzugriff

Der Test wird in den folgenden Systemen durchgeführt:

|  |  |
| --- | --- |
| System | Details |
| SAP-S/4HANA-System | Erreichbar über SAP Fiori Launchpad. Ihr Systemadministrator stellt Ihnen die URL für den Zugriff auf die verschiedenen Apps zur Verfügung, die Ihrer Rolle zugeordnet sind. |

## Rollen

Weisen Sie Ihren einzelnen Testbenutzern folgende Benutzerrollen zu. Alternativ können Sie, falls verfügbar, Benutzerrollen unter Verwendung der folgenden Bereiche mit Seiten und vordefinierten Apps für das SAP Fiori Launchpad anlegen und die Benutzerrollen zu Ihren individuellen Testbenutzern zuordnen.

Hinweis Diese Rollen oder Bereiche sind Beispiele, die von SAP bereitgestellt werden. Sie können sie als Vorlagen zum Anlegen Ihrer eigenen Rollen und Bereiche verwenden.

Weitere Informationen zu Benutzerrollen finden Sie unter Benutzern Benutzerrollen zuordnen im [Administrationsleitfaden für die Implementierung von SAP S/4HANA mit SAP Best Practices](https://help.sap.com/viewer/S4HANA2020_AdminGuide).

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Name (Rolle) | Beschreibung | ID (Rolle) | Beschreibung (Bereich) | ID (Bereich) | Anmeldung |
| Treasury-Spezialist – Backoffice |  | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_BOE | Treasury-Backoffice | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_BOE |  |
| Treasury-Spezialist – Frontoffice |  | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_FOE | Treasury-Frontoffice | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_FOE |  |
| Treasury-Spezialist – Middle-Office |  | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_MOE | Treasury-Middle-Office | SAP\_BR\_TREASURY\_SPECIALIST\_MOE |  |
| Treasury-Buchhalter |  | SAP\_BR\_TREASURY\_ACCOUNTANT | Treasury Buchhaltung | SAP\_BR\_TREASURY\_ACCOUNTANT |  |
| Treasury Risk Manager |  | SAP\_BR\_TREASURY\_RISK\_MANAGER | Treasury | SAP\_BR\_TREASURY\_RISK\_MANAGER |  |
| Cash-Manager |  | SAP\_BR\_CASH\_MANAGER | Cash Management | SAP\_BR\_CASH\_MANAGER |  |
| Administrator |  | SAP\_BR\_ADMINISTRATOR | Verwaltung | SAP\_BR\_ADMINISTRATOR |  |
| Stammdatenexperte – Geschäftspartnerdaten |  | SAP\_BR\_BUPA\_MASTER\_SPECIALIST | Geschäftspartner | SAP\_BR\_BUPA\_MASTER\_SPECIALIST |  |

## Stammdaten, Organisationsdaten und sonstige Daten

Die Organisationsstruktur und die Stammdaten Ihres Unternehmens werden bei der Aktivierung in Ihrem System angelegt. Die Organisationsstruktur gibt den Aufbau Ihres Unternehmens wieder. Die Stammdaten stehen beispielsweise für Materialien, Kunden und Lieferanten, je nach betrieblichem Schwerpunkt Ihres Unternehmens.

Verwenden Sie beim Durchführen des Tests eigene Stammdaten. Wenn Sie ein SAP Best Practices Baseline Package installiert haben, können Sie die folgenden Baseline-Package-Beispieldaten verwenden:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Daten | Beispielwert | Details | Kommentare |
| Buchungskreis | 1010 |  |  |
| Währung | EUR, USD und BRL |  |  |
| Geschäftspartner | 10537001 und 10537002 |  |  |
| Bewertungsbereich | DE0 |  |  |

Weitere Informationen zum Anlegen dieser Stammdatenobjekte finden Sie unter [Stammdatenskripte (MDS)](https://support.sap.com/content/dam/SAAP/Sol_Pack/BP_OP_ENTPR/BP_OP_ENTPR_S4HANA2020_7_Master_Data_EN_XX.htm).

Tabelle 1: Verweis auf Stammdatenskripte

|  |  |
| --- | --- |
| MDS | Beschreibung |
| 22G | Geschäftspartner für Treasury and Risk Management anlegen |

## Voraussetzungen/Situation

Um diesen Umfangsbestandteil testen zu können, müssen die folgenden Voraussetzungen erfüllt sein.

|  |  |
| --- | --- |
| Umfangsbestandteil | Voraussetzungen/Situation |
| 1XN - Market Rates Management – manuell per Upload | Muss vor diesem Testskript ausgeführt werden; Marktdaten müssen erstellt werden. |
| J60 – Kreditorenbuchhaltung | Führen Sie die Voraussetzungen in J60 aus, um die Zahlungsträger-Formatvarianten (ZTF) zu definieren. Voraussetzungen > Vorbereitende Schritte > Zahlungsträger-Formatvarianten definieren |

## Vorbereitende Schritte

### Geschäftspartner anlegen

#### Allgemeine Daten für Geschäftspartner pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Abschnitt werden die Schritte zum Pflegen der allgemeinen Daten für einen Geschäftspartner beschrieben.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Stammdatenexperte – Geschäftspartnerdaten an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Geschäftspartner pflegen(BP). | Das Bild Geschäftspartner pflegen wird angezeigt. |  |
| 3 | Datenerfassung auf dem Einstiegsbild | Wählen Sie Organisation. | Das Bild Organisation anlegen wird angezeigt. |  |
| 4 | Adressdaten eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Geschäftspartner: z.B. 10537001  Gruppierung: <Wählen Sie TR02 Treasury-Partner (extern)>.  Anlegen in GP-Rolle: <Wählen Sie 000000 Geschäftspartner (allg.)>.  Titel: <Wählen Sie 0003 Unternehmen>.  Name: z.B. <Bank 1 – BEISPIELBANK>  Anrede: z.B. <Bank 1>  Suchbegriff 1/2: z.B. <Bank 1>  Straße/Hausnummer: z.B. <Theodor-Heuss-Allee 70>  Postleitzahl/Ort: z.B. 60486 Frankfurt  Land: Wählen Sie DE aus.  Sprache: Wählen Sie EN aus.  E-Mail: z.B. <E-Mail>  Adresse gültig ab: z.B. <aktuelles Datum im vorherigen Jahr>  Adresse gültig bis: z.B. <31. Dez. des Jahres 9999>  Hinweis Bleiben Sie für die nachfolgenden Schritte auf dem Bild. | Der Geschäftspartner wurde erfolgreich angelegt.  Die Sicht Organisation anzeigen: 10537001 wird angezeigt. |  |
| 5 | Änderungsmodus aufrufen | Wählen Sie Umschalten zwischen Anzeigen und Ändern.  Geben Sie folgende Daten ein:  Ändern in GP-Rolle: Wählen Sie TR0151 Kontrahent. | Es werden zusätzliche Registerkarten speziell für Kontrahenten angezeigt, z.B. "Juristische Daten" oder "Bewertung".  Das Bild Organisation ändern:10537001, neue Rolle Kontrahent wird angezeigt. |  |
| 6 | Juristische Daten eingeben | Wählen Sie … > Juristische Daten.  Hinweis Die drei Punkte (...) stehen für das Navigationsmenü.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Land: Wählen Sie DE  Hinweis Bleiben Sie für die nachfolgenden Schritte auf dem Bild. | Die juristischen Daten werden erfasst und gesichert.  Die Sicht Organisation ändern: 10537001, neue Rolle Kontrahent wird angezeigt. |  |
| 7 | Daten zum Zahlungsverkehr eingeben | Wählen Sie ... > Zahlungsverkehr.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Zeile 1:  ID: z.B. EUR1  Lnd: z.B. DE  Bankschlüssel, z.B. 50070010  Bankkonto: z.B. <Bankkonto>  IBAN: Wählen Sie die Drucktaste IBAN, und wählen Sie Weiter in der Sicht IBAN.  Zeile 2:  ID: z.B. USD1  Land: z.B. DE  Bankschlüssel, z.B. 50070010  Bankkonto: z.B. <Bankkonto>  IBAN: Wählen Sie die Drucktaste IBAN, und wählen Sie Weiter im Dialogfenster IBAN.  Hinweis Wenn beim Auswählen der IBAN das Dialogfenster Informationen angezeigt wird, wählen Sie Weiter. | Die Daten zum Zahlungsverkehr sind erfasst, und der Geschäftspartner wird gesichert. |  |

#### Zahlungsverbindungen für Geschäftspartner pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Abschnitt werden die genauen Schritte zum Pflegen der Zahlungsverbindungsdaten für einen Geschäftspartner beschrieben.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Stammdatenexperte – Geschäftspartnerdaten an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Geschäftspartner pflegen(BP). | Das Bild Geschäftspartner pflegen wird angezeigt. |  |
| 3 | Änderungsmodus aufrufen | Wählen Sie im Popup-Dialogfeld die Option BP öffnen, und geben Sie folgende Daten ein:  Geschäftspartner: 10537001  Wählen Sie zunächst Enter und anschließend Zwischen Anzeigen und Ändern wechseln.  Geben Sie folgende Daten ein:  Ändern in GP-Rolle: <Wählen Sie TR0151 Kontrahent (definiert) aus.> | Die Sicht Organisation ändern: 1010, Rolle Kontrahent wird angezeigt. |  |
| 4 | SI: Zahlungsverbindungen eingeben | Wählen Sie Buchungskreis.  Geben Sie folgende Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  Wählen Sie Enter.  Wählen Sie SI: Zahlungsverbindungen.  Geben Sie folgende Daten ein:  Zeile 1:  Währung: z.B. EUR  Zahlver-ID: z.B. EURI  Hausbank: z.B. DEBK1  Konto-ID: z.B. DEAC1  Regulierer: <leer>  Partnerbank: <leer>  Zahlungsanforderung: <entmarkieren>  Zahlwege: <leer>  Zeile 2:  Währung: z.B. EUR  Zahlver-ID: z.B. EURO  Hausbank: z.B. DEBK1  Konto-ID: z.B. DEAC1  Zahlungsregulierer: z.B. 10537001  Partnerbank: z.B. EUR1  Zahlungsanforderung: <markieren>  Zahlwege: z.B. <Wählen Sie einen oder mehrere Zahlwege aus der Wertehilfe aus.>  Zeile 3:  Währung: z.B. USD  Zahlver-ID: z.B. USDI  Hausbank: z.B. DEBK1  Konto-ID: z.B. USDAC  Regulierer: <leer>  Partnerbank: <leer>  Zahlungsanforderung: <entmarkieren>  Zahlwege: <leer>  Zeile 4:  Währung: z.B. USD  Zahlver-ID: z.B. USDO  Hausbank: z.B. DEBK1  Konto-ID: z.B. USDAC  Zahlungsregulierer: z.B. 10537001  Partnerbank: z.B. USD1  Zahlungsanforderung: <markieren>  Zahlwege: z.B. <Wählen Sie einen oder mehrere Zahlwege aus der Wertehilfe aus>  Hinweis Bleiben Sie für die nachfolgenden Schritte auf dem Bild.  Hinweis Wenn ein Fenster mit der folgenden Meldung angezeigt wird, wählen Sie Nein.  Geschäftspartner als Regulierer vorgeschlagen (bitte Langtext beachten!).  Diese Meldung für diesen Geschäftspartner noch einmal anzeigen? | Die SI-Zahlungsverbindungsdaten werden erfasst. |  |
| 5 | Zahlungsverbindungen zuordnen | Auf dem letzten Bild des vorherigen Schritts:  Markieren Sie für EUR das Ankreuzfeld für EUREURI, und wählen Sie Zuordnen.  Im Dialogfenster Kontrahentenänderung: Zuordnung Zahlungsverbindungen wählen Sie Alle eingehenden markieren.  Jetzt wird EURI unter Z-ID eing.angezeigt.  Wählen Sie Weiter.  Markieren Sie das Ankreuzfeld für EUREURO, und wählen Sie Zuordnen.  Im Dialogfenster Kontrahentenänderung: Zuordnung Zahlungsverbindungen wählen Sie Alle ausgehenden markieren.  Nun wird EURO unter Z-ID ausg. angezeigt.  Wählen Sie Weiter.  Verfahren Sie ebenso bei USD:  USDI: Z-ID eing.  USDO: Z-ID ausg.  Auf dem Bild Organisation ändern: 10537001, Rolle Kontrahent wählen Sie Sichern. | Die Zahlungsverbindungen und Zuordnungen werden gesichert. |  |

#### Berechtigungen für Geschäftspartner pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Dieser Abschnitt beschreibt die detaillierten Schritte zur Pflege der Berechtigungsdaten für einen Geschäftspartner für SAP TRM.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Stammdatenexperte – Geschäftspartnerdaten an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Geschäftspartner pflegen(BP). | Das Bild Geschäftspartner pflegen wird angezeigt. |  |
| 3 | Änderungsmodus aufrufen | Wählen Sie im Popup-Dialogfeld die Option BP öffnen, und geben Sie folgende Daten ein:  Geschäftspartner: 10537001  Wählen Sie zunächst Enter und anschließend Zwischen Anzeigen und Ändern wechseln.  Geben Sie folgende Daten ein:  Ändern in GP-Rolle: <Wählen Sie TR0151 Kontrahent (definiert) aus.> | Die Sicht Organisation ändern: 10537001, Rolle Kontrahent wird angezeigt. |  |
| 4 | SI-Berechtigungsdaten eingeben | Wählen Sie Buchungskreis.  Wählen Sie SI: Berechtigungen.  Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Devisen: Berecht.: markiert  Derivate: Berecht.: markiert  Hinweis Sie können die Ordner aufklappen, um die Berechtigung für eine bestimmte Produkt- oder Geschäftsart zu erteilen. Zu Testzwecken werden alle Berechtigungen allen Produkt- und Geschäftsarten zugeordnet. | Die Berechtigungsdaten werden gesichert. |  |

#### Meldedaten im Buchungskreis für Geschäftspartner pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Abschnitt werden die genauen Schritte zum Pflegen der Unternehmensbeziehungen für einen Geschäftspartner beschrieben.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Stammdatenexperte – Geschäftspartnerdaten an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Geschäftspartner pflegen(BP). | Das Bild Geschäftspartner pflegen wird angezeigt. |  |
| 3 | Änderungsmodus aufrufen | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Enter.  Geschäftspartner: 10537001  Wählen Sie Umschalten zwischen Anzeigen und Ändern.  Geben Sie folgende Daten ein:  Ändern in GP-Rolle: TR0151 Kontrahent (definiert) | Die Sicht Organisation ändern: 10537001, Rolle Kontrahent wird angezeigt. |  |
| 4 | Meldedaten im Buchungskreis erfassen | Wählen Sie Buchungskreis.  Wählen Sie Meldedaten im Buchungskreis.  Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern.  UBeziehung: 3 Sonstige  Hinweis Wenn Sie Meldedaten im Buchungskreis nicht finden können, wählen Sie ... (Navigationsmenü), und wählen Sie im Dropdown-Menü die entsprechende Option aus.  Hinweis "UBeziehung" (Unternehmensbeziehung) steht für Ihre Beziehung zum Kontrahenten.   * 1 Verbunden und konsolidiert * 2 Verbunden, aber nicht konsolidiert * 3 Nicht verbunden * 4 Nicht verwenden   Diese Werte werden zur Ableitung der korrekten Sachkonten verwendet. | Die Meldedaten werden erfasst und gesichert. |  |

### Korrespondenz

Zweck

SAP TRM umfasst eine Standardkorrespondenzfunktion. Damit können Sie festlegen, dass bei jedem Sichern eines TRM-Geschäfts entweder eine E-Mail an den Geschäftspartner gesendet oder automatisch ein Formular ausgedruckt wird.

Um diese Korrespondenzfunktion zu verwenden, müssen dem Geschäftspartner die folgenden Daten zugeordnet sein:

* Geschäftspartnerprofil
* Geschäftspartnergruppe
* Swift/BIC-Code

#### Zuordnung von Profilen und Geschäftspartnergruppen zu externen Empfängern pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Geschäftspartnerprofile und Geschäftspartnergruppen steuern die Korrespondenzaktivitäten in SAP Treasury and Risk Management.

SAP stellt die folgenden vordefinierten Geschäftspartnerprofile bereit:

* PR\_EMAIL
* PR\_PRINT

Sie können diese vordefinierten Geschäftspartnerprofile Ihrem Geschäftspartner zuweisen. Wenn die Kommunikation mit Ihrem Geschäftspartner per E-Mail erfolgt, können Sie Ihrem Geschäftspartner das Profil PR\_EMAIL zuweisen. Wenn die Kommunikation über gedruckte Dokumente erfolgt, können Sie PR\_PRINT zuweisen.

SAP stellt die folgende vordefinierte Geschäftspartnergruppe bereit:

* BPG\_DEFAULT

Sie können diese vordefinierte Geschäftspartnergruppe Ihrem Geschäftspartner zuweisen. Sie können über die IMGs Geschäftspartnergruppe definieren und Geschäftspartnergruppen Attribute zuordnen auch Ihre eigene Geschäftspartnergruppe hinzufügen und geeignete Attribute Ihren Anforderungen entsprechend zuordnen: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Korrespondenz > Allgemeine Einstellungen:

Dieser Schritt beschreibt die Zuordnung von Geschäftspartnerprofilen und Geschäftspartnergruppen zu einem externen Geschäftspartner.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Profil und GP-Gruppe zuordnen - Externe Empfänger(FTR\_EXT\_ASSIGN). | Die Sicht Zuordnung von Profilen und GP-Gruppen zu externen Empfängern wird angezeigt. |  |
| 3 | Geschäftspartnerdaten auf dem Bild erfassen | Im linken Bildbereich wählen Sie Zeile einfügen.  Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Enter:  GeschPartner: z.B. 10537001  Bukr: z.B. 1010  Empf./Senderart: z.B. COUNTERPARTY  Markieren Sie das Ankreuzfeld. | Die Geschäftspartnerinformationen sind erfasst. |  |
| 4 | Geschäftsprofil und GP-Gruppe zu Geschäftspartner zuordnen | Rechts oben auf dem Bild:  Wählen Sie Knoten expandieren.  Expandieren Sie GP:XXXXXXXX/Buchungskreis:YYYY/Empfänger/Senderart: KONTRAHENT > Devisen > FX-Transaktion > 60A Devisen > 101 Kassageschäft > 20 Vertrag.  Wählen Sie rechts unten auf dem Bild die Option Zeile einfügen, und geben Sie folgende Daten ein:  Profil: z.B. PR\_EMAIL  GP-Gruppe: z.B. BPG\_DEFAULT  Wählen Sie erneut Zeile einfügen. Fügen Sie einen weiteren Eintrag hinzu, und wählen Sie Sichern:  Profil: z.B. PR\_PRINT  GP-Gruppe: z.B. BPG\_DEFAULT  Hinweis In der Regel ordnen Sie einer Produktart, einer Geschäftsart und einem Aktivitätstyp nur ein Profil zu. | Der Kombination aus Produktart, Geschäftsart und Aktivitätstyp wurden GP-Profile und GP-Gruppen zugeordnet. |  |
| 5 | Vorherigen Schritt wiederholen | Wiederholen Sie den vorherigen Schritt mit den Werten in der folgenden Datentabelle. | Die GP-Profile und GP-Gruppen werden allen aufgelisteten Produktarten, Geschäftsarten und Aktivitätstypen zugeordnet. |  |

Tabelle 2: Tabelle "Geschäftspartnerzuordnung"

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Produktart | Geschäftsart | Aktivitäts- typ |
| 60A | 101 | 20 |
| 60A | 102 | 20 |
| 60A | 103 | 20 |
| 60A | 104 | 20 |
| 60A | 105 | 20 |
| 60A | 107 | 20 |
| 60B | 103 | 20 |
| 60B | 103 | 55 |
| 60B | 104 | 20 |
| 60B | 104 | 55 |
| 60B | 105 | 20 |
| 60B | 105 | 55 |
| 60B | 110 | 20 |
| 60B | 110 | 55 |
| 76A | 100 | 20 |
| 76A | 200 | 20 |

#### Zuordnung von Profilen und Geschäftspartnergruppen zu internen Empfängern pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Die interne Empfänger-ID ist von SAP vordefiniert und kann mit SAP-Benutzer-IDs verknüpft werden. Wenn eine Verknüpfung zu einer SAP-Benutzer-ID besteht, versucht SAP Treasury and Risk Management jedes Mal, wenn ein internes Korrespondenzobjekt generiert wird, Korrespondenzinformationen an die Adresse der SAP-Benutzer-ID zu senden. In Abhängigkeit von den verschiedenen Profilen (PR\_EMAIL oder PR\_PRINT) kann entweder eine E-Mail an die E-Mail-Adresse des Benutzers gesendet oder ein Formular ausgedruckt werden.

Dieser Schritt beschreibt die Zuordnung von Geschäftspartnerprofilen und Geschäftspartnergruppen zu einem internen Geschäftspartner.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | Auf die SAP-Fiori-App zugreifen | Öffnen Sie Profil und GP-Gruppe zuordnen - Interne Empfänger(FTR\_INT\_ASSIGN). | Das Bild Zuordnung von Profilen und GP-Gruppen zu internen Empfängern wird angezeigt. |  |
| 3 | Geschäftspartnerdaten auf dem Bild erfassen | Im linken Bildbereich wählen Sie Zeile einfügen.  Nehmen Sie folgende Einträge vor, und drücken Sie Enter:  Int. Empf.: z.B. INT.EMPF.  BuKr: z.B. 1010  Empf./Senderart:: z.B. INTERN  Ankreuzfeld: markiert | Die Geschäftspartnerinformationen sind erfasst. |  |
| 4 | Geschäftsprofil und GP-Gruppe zu Geschäftspartner zuordnen | Expandieren Sie rechts oben auf dem Bild den Geschäftspartner: INT.EMPF/Buchungskreis XXXX > Empfänger-/Senderart: INTERN > Devisen > 60A Devisen > 101 Kassageschäft > 20 Vertrag.  Wählen Sie rechts unten auf dem Bild Zeile einfügen.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Profil: z.B. PR\_EMAIL  GP-Gruppe: z.B. BPG\_DEFAULT  Benutzername: <Wählen Sie eine Benutzer-ID>.  Wählen Sie erneut Zeile einfügen.  Fügen Sie einen weiteren Eintrag hinzu, und wählen Sie Sichern:  Profil: z.B. PR\_PRINT  GP-Gruppe: z.B. BPG\_DEFAULT  Benutzername: Wählen Sie eine <Benutzer-ID>.  Hinweis Bei der Benutzer-ID handelt es sich um eine Backend-Benutzer-ID. | GP-Profil, GP-Gruppe und Benutzer-ID werden der Produktart, der Geschäftsart und dem Aktivitätstyp zugeordnet. |  |
| 5 | Vorherigen Schritt wiederholen | Wiederholen Sie den obigen Schritt mit den Daten aus der folgenden Tabelle. | Die GP-Profile, GP-Gruppen und Benutzer-IDs werden allen aufgelisteten Produkttypen, Geschäftsarten und Aktivitätstypen zugeordnet. |  |

Tabelle 3: Tabelle "Geschäftspartnerzuordnung"

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Produktart | Geschäftsart | Aktivitätstyp |
| 60A | 101 | 20 |
| 60A | 102 | 20 |
| 60A | 103 | 20 |
| 60A | 104 | 20 |
| 60A | 105 | 20 |
| 60A | 107 | 20 |
| 60B | 103 | 20 |
| 60B | 103 | 55 |
| 60B | 104 | 20 |
| 60B | 104 | 55 |
| 60B | 105 | 20 |
| 60B | 105 | 55 |
| 60B | 110 | 20 |
| 60B | 110 | 55 |
| 76A | 100 | 20 |
| 76A | 200 | 20 |

### Pflegen des Kreditlimits

Einsatzmöglichkeiten

Im System wurde eine Reihe von Limitarten angelegt. Sie können die Kreditlimits dem Geschäft entsprechend auf der Grundlage der angegebenen Limitart pflegen. In diesem Testskript werden die Limitarten Y01 und Y07 gepflegt.

#### Limit mit Limitart Y01 pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Sie können für jede Kombination von Limitmerkmalen, die in einem Limittyp definiert sind, Merkmalswerte erstellen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Limits verwalten(TBL1). |  |  |
| 3 | Limitart auswählen | Markieren Sie die Zeile Limitart Y01, und wählen Sie Limitvorgaben anlegen. |  |  |
| 4 | Buchungskreis | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Das Bild Limitvorgaben zu Limitart Y01 bearbeiten: Neue Vorgabe anlegen wird angezeigt. |  |
| 4 | Internen und externen Limitbetrag anlegen | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Gültig-ab-Datum: z.B. <aktuelles Datum>  Gültigkeitsende intern: z.B. 12/31/9999  Gültigkeitsende extern: z.B. <aktuelles Datum + 1 Jahr>  Limitwährung: z.B. EUR  Interner Limitbetrag: z.B. 250.000.000  Externer Limitbetrag: z.B. 200.000.000  kritische Limitauslastung: z.B. 90%  max. Risikobind. in Mon.: z.B. 999  Limit: z.B. Scheck |  |  |

#### Limit mit Limitart Y07 pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Sie können für jede Kombination von Limitmerkmalen, die in einem Limittyp definiert sind, Merkmalswerte erstellen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Limits verwalten(TBL1). | Die Sicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Limitart auswählen | Markieren Sie die Zeile Limitart Y07, und wählen Sie Limitvorgaben anlegen. |  |  |
| 4 | Limitvorgaben bearbeiten | Geben Sie folgende Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  GeschPartner: z.B. 10537001  Wählen Sie anschließend Weiter. | Die Sicht Limitvorgaben zu Limitart Y07 bearbeiten: Neue Vorgabe anlegen wird angezeigt. |  |
| 5 | Internen und externen Limitbetrag anlegen | Geben Sie folgende Daten ein:  Gültig-ab-Datum: z.B. <aktuelles Datum>  Gültigkeitsende intern: z.B. 12/31/9999  Gültigkeitsende extern: z.B. <aktuelles Datum + 1 Jahr>  Limitwährung: z.B. EUR  Interner Limitbetrag: z.B. 250.000.000  Externer Limitbetrag: z.B. 200.000.000  kritische Limitauslastung: z.B. 90%  max. Risikobind. in Mon.: z.B. 999  Limit: z.B. Scheck  Wählen Sie Sichern. |  |  |

### Händler und Händlerberechtigungen pflegen

#### Händler definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität definieren Sie Händler.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieHändler definieren(S\_ALR\_87009302). | Das Dialogfenster Arbeitsbereich festlegen: Eingabe wird angezeigt. |  |
| 3 | Arbeitsbereich eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Das Bild Sicht „Treasury: Händler“ ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Neue Einträge | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 5 | Neuen Datensatz anlegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Händler: z.B. HÄNDLER02.  Wenn das Dialogfenster Eingabeaufforderung für Customizing-Auftrag angezeigt wird, geben Sie eine Transportauftragsnummer ein, und wählen Sie Weiter oder drücken Sie Enter. | Die Daten werden gesichert. |  |

#### Benutzerdaten definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität ordnen Sie Benutzern einen Händler zu. Dieser Händler wird dann beim Anlegen eines neuen Geschäfts als Voreinstellung verwendet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Benutzerdaten definieren(S\_ALR\_87007933). | Das Bild Sicht "Treasury: Benutzerstamm Ergänzungen" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Datensatz anlegen | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 4 | Daten eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Benutzername: z.B. <Ihr Benutzername>  Händler: z.B. TRADER02  Wenn das Dialogfenster Eingabeaufforderung für Customizing-Auftrag angezeigt wird, geben Sie eine Transportauftragsnummer ein, und wählen Sie Weiter oder drücken Sie Enter. | Die Daten werden gesichert. |  |

#### Händlerberechtigungen pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie Berechtigungen für Händler fest.

Voraussetzungen

Vor diesem Schritt muss ein Händler definiert werden. Weitere Informationen erhalten Sie im Schritt Händler definieren.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Händlerberechtigungen verwalten(TBT1). | Das Bild Geschäftsberechtigung für Händler anlegen/ändern: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Enter.  Händler: z.B. TRADER02  Buchungskreis: z.B. 1010 | Das Bild Geschäftsberechtigung für Händler anlegen/ändern wird angezeigt. |  |
| 4 | Berechtigung eingeben und sichern | Markieren oder entmarkieren Sie die Spalte Berechtigung, und wählen Sie Sichern.  Hinweis Erteilen Sie TRADER02 die Berechtigung für Geschäfte mit Devisen und Derivaten. | Die Daten werden gesichert. Die Meldung Geschäftsberechtigungen für Händler TRADER02 werden gesichert wird angezeigt. |  |

### Exposure Management und Hedge Management

#### Zeitraster definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität definieren Sie ein Zeitraster, das für Zielquoten innerhalb eines Sicherungsbereichs verwendet wird.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Zeitraster definieren(TOE\_TIME\_PATTERN). | Das Bild Zeitraster anzeigen wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Sicherungsbereich anlegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Zeitraster: z.B. M12 | Das Dialogfenster Zeitraster anlegen wird angezeigt. |  |
| 4 | Details für den neuen Sicherungsbereich eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Zeitraster: z.B. Klicken Sie auf "Kalenderbezogen"  Anzahl der Perioden: z.B. 12  Periodenlänge: z.B. Monat  Absolutes Zeitraster: <Nicht markieren> | Die Daten werden gesichert. |  |

#### Sicherungsbereich definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität definieren Sie einen Sicherungsbereich, um die offenen Nettoexposures im Hedge-Management-Cockpit(TOENE) zu berechnen und anzuzeigen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsbereich definieren(TOE\_HEDGING\_AREA). | Das Bild Sicherungsbereich anzeigen wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Sicherungsbereich anlegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001 | Das Dialogfenster Sicherungsbereich anlegen wird angezeigt. |  |
| 4 | Details für den neuen Sicherungsbereich eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Beschreibung: z.B. FX-Sicherungsbereich  Berechtigungsgruppe: z.B. HAG01  Gültig ab: z.B. <1. Januar des aktuellen Jahres> | Die Daten werden gesichert. Das Bild Sicherungsbereich ändern wird angezeigt. |  |
| 5 | Hauptdaten für Sicherungsbereich definieren | Geben Sie auf der Registerkarte Hauptdaten folgende Daten ein:  Handelsplattformintegration aktivieren: z.B. <das Ankreuzfeld markieren>  Exposure-Aggregationsebene: z.B. Netto und Brutto  Risikofreie Währung: z.B. Hauswährung  Hinweis Wenn Sie die Extraktion von währungsübergreifenden Exposures aktivieren möchten, wählen Sie Von der Quelle definierte Währung. Dadurch wird die risikolose Währung aus dem Währungspaar des Exposure-Postens abgeleitet. Wenn die Quelle Exposure Managementist, ist die risikofreie Währung die Zielwährung. Wenn die Quelle Cash Managementist, ist die risikolose Währung die Buchungskreiswährung.  Meldezeitraster: z.B. kalenderbezogen  Anzahl der Perioden: z.B. 12  Periodenlänge: z.B. Monat  Zielquote: z.B. Zielquote auswählen  Wählen Sie Zielquotenart hinzufügen  ZQ-Art: z.B. YLQ  Zeitraster-ID: z.B. M12 | Die Daten werden gesichert. |  |
| 6 | Allgemeine Einstellungen | Wählen Sie die Registerkarte Allgemeine Einstellungen. |  |  |
| 7 | Allgemeine Einstellungen für den Sicherungsbereich definieren | Geben Sie folgende Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  Differenzierungskriterium: z.B. Währung/Währungsgruppe und Buchungskreis auswählen  Für Zielquote relevant: z.B. Währung / Währungsgruppe auswählen  Wählen Sie Sicherungsklassifizierung hinzufügen.  Fügen Sie Y0 hinzu. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 8 | Währung | Wählen Sie die Registerkarte Währungen. |  |  |
| 9 | Währung | Wählen Sie Währung hinzufügen. |  |  |
| 10 | Währungen definieren | Geben Sie in der Spalte Währung den Wert USD ein.  Geben Sie in der Spalte Währungsgruppe Amerika ein.  Wiederholen Sie den Schritt, um BRL hinzuzufügen, und geben Sie Amerika in der Währungsgruppe ein. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 11 | Filter für Exposures | Wählen Sie die Registerkarte Filter für Exposures. |  |  |
| 12 | Filter für Exposures anlegen | Wählen Sie Filter anlegen. | Das Dialogfenster Neuer Filter für Exposures wird angezeigt. |  |
| 13 | Daten für Filter für Exposures definieren | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Filter anlegen:  Filter: z.B. EXP\_FILTER  Filterbeschreibung: z.B. Exposure-Filter  Quelle: E\_EM2  Hinweis Sie können auch die Quelle E\_1EXP auswählen, d.h. One Exposure. | In der Filterliste für Exposures wird ein Datensatz angelegt. |  |
| 14 | Andere filterspezifische Selektionen definieren | Blättern Sie zum Abschnitt Andere filterspezifische Selektionen.  Geben Sie folgende Daten ein:  Exposure-Positionstyp: YFX | Die Daten werden gesichert. |  |
| 15 | Filter für Sicherungen | Wählen Sie die Registerkarte Filter für Sicherungen. |  |  |
| 16 | Filter für Sicherungen anlegen | Wählen Sie Filter anlegen. | Das Dialogfenster Neuer Filter für Sicherungen wird angezeigt. |  |
| 17 | Daten für Filter für Sicherungen definieren | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Filter anlegen:  Filter: z.B. HDG\_FILTER  Filterbeschreibung: z.B. Sicherungsfilter  Datenquelle: H\_TM | In der Filterliste für Sicherungen wird ein Datensatz angelegt. |  |
| 18 | Andere filterspezifische Selektionen definieren | Blättern Sie zum Abschnitt Andere filterspezifische Selektionen. Geben Sie folgende Daten ein:  Produktart: 60A und 76A |  |  |
| 19 | Zielquoten | Wählen Sie Zielquoten. |  |  |
| 20 | Zielquote definieren | Fügen Sie eine Quote ein, und geben Sie die folgenden Daten im Bild Zielquote eingeben ein. Wählen Sie anschließend Weiter:  Netto/Brutto: z.B. Netto  Währungsgruppe: z.B. Amerika  Zielquote: z.B. <80 für Zeitraum 1,2,3,4,5,6 und 70 für Zeitraum 7,8,9,10,11,12>  Hinweis Bestätigen Sie das Dialogfenster, indem Sie "Weiter" wählen, und geben Sie dann für jede Zeile die Zielquote ein. | Die Zielquoten werden angelegt. |  |
| 21 | Devisensicherungsanforderung | Wählen Sie die Registerkarte Devisensicherungsanforderung. |  |  |
| 22 | Automatisierung der Sicherungsanforderungseinstellungen definieren | Geben Sie folgende Daten ein:  Zielstatus für Automatisierung: z.B. angelegt  Valutadefinition: z.B. <letzter Tag der Periode>  Blättern Sie zum Abschnitt Sicherungsanforderungseinstellungen. Fügen Sie folgende Einträge ein:  Unternehmen: z.B. 1010  Währung: z.B. USD  Standardinstrumenttyp: z.B. FXFW  Sicherungsklassifizierung: z.B. Y0  Mindestbetrag: z.B. 10.000  Wiederholen Sie diesen Schritt, um einen weiteren Eintrag für die Währung BRL einzufügen. | Die Automatisierung der Sicherungsanforderung ist festgelegt. |  |
| 23 | Daten sichern | Wählen Sie Sichern. | Die neue Sicherungsbereichsversion wird gesichert. |  |

#### Kennzahlen für Bilanzdevisenrisiko definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität definieren Sie eine Reihe von Kennzahlen, die auf dem Bild Bilanzdevisenrisiko prüfen angezeigt werden sollen.

Hinweis Die folgende Vorgehensweise veranschaulicht das Anlegen von Kennzahlen. Definieren Sie die Kennzahlengruppen und Kennzahlen entsprechend den Anforderungen ihres Unternehmens.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kennzahlen definieren - Bilanzdevisenrisiko(FXM\_KF\_DEF). | Das Bild Sicht „Kennzahlengruppen pflegen“ anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neue Einträge | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 4 | Kennzahlengruppen pflegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Kennzahlgruppe: z.B. EXP\_GRP1  Beschreibung Kennzahlgruppe: z.B. alle Kreditoren  Exposure / Sicherung: z.B. Exposure  Kennzahlgruppe: z.B. HED\_GRP1  Beschreibung Kennzahlgruppe: z.B. alle Währungstransaktionen  Exposure / Sicherung: z.B. Sicherung | Die Daten werden gesichert. |  |
| 5 | Kennzahlen pflegen | Doppelklicken Sie im Bereich Dialogstruktur auf Kennzahlen pflegen. |  |  |
| 6 | Kennzahlen pflegen | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 7 | Kennzahlen pflegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Kennzahl: z.B. EG1K1  Kennzahlbeschreibung: z.B. alle Kreditoren  Kennzahlgruppe: z.B. EXP\_GRP1  Datenquelle: z.B. One Exposure  Kennzahl: z.B. HG1K1  Kennzahlbeschreibung: z.B. alle Währungstransaktionen  Kennzahlgruppe: z.B. HED\_GRP1  Datenquelle: z.B. Finanzgeschäfte | Die Daten werden gesichert. |  |
| 8 | Auswahl pflegen | Selektieren Sie eine Kennzahl, und wählen Sie Auswahl pflegen.  Hinweis Wenn die Drucktaste "Auswahl pflegen" nicht angezeigt wird, müssen Sie evtl. die Taste "Zurück" wählen. |  |  |
| 9 | Auswahl pflegen | Wählen Sie Kennzahl: EG1K1 aus, geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Enter:  Wahrscheinlichkeitsstufe: z.B. PAY\_N  Wählen Sie Kennzahl: HG1K1 aus, geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Enter:  Produktart: z.B. 60A bis: z.B. 60B |  |  |
| 10 | Sichern | Wählen Sie Zurück.  Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |

#### Anforderungsparameter für Bilanzdevisenrisiko definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt definieren Sie eine Reihe von Anforderungsparametern, um die Generierung der Sicherungsanforderungen zu filtern.

Hinweis Die folgende Prozedur veranschaulicht die Erstellung von Anforderungsparametern. Definieren Sie die Anforderungsparametergruppe und die Anforderungsparameter gemäß den Anforderungen Ihres Unternehmens.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kennzahlen definieren - Bilanzdevisenrisiko(FXM\_KF\_DEF). | Das Bild Sicht „Kennzahlengruppen pflegen“ ändern: Übersicht" wird angezeigt. |  |
| 3 | Anforderungsparametergruppen pflegen | Doppelklicken Sie im Bereich Dialogstruktur auf Anforderungsparametergruppen pflegen, um den Ordner zu öffnen. | Der Ordner Anforderungsparametergruppen pflegen wird geöffnet. |  |
| 4 | Neue Einträge | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 5 | Anforderungsparametergruppen pflegen | Geben Sie Folgendes ein, und wählen Sie Sichern:  Anforderungsparametergruppe: z.B. RP\_GRP1  Beschreibung Kennzahlengruppe: z.B. Standardparametergruppe für 1010  Standard: z.B. Ja | Die Daten werden gesichert. |  |
| 6 | Anforderungsparameter pflegen | Doppelklicken Sie im Bereich Dialogstruktur auf Anforderungsparameter pflegen. |  |  |
| 7 | Anforderungsparameter pflegen | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 8 | Anforderungsparameter pflegen | Geben Sie Folgendes ein, und wählen Sie Sichern:  Kennzahl: z.B. RP1  Beschreibung Kennzahl: z.B. USD  Kennzahlengruppe: z.B. RP\_GRP1  Kennzahl: z.B. RP2  Beschreibung Kennzahl: z.B. BRL  Kennzahlengruppe: z.B.  RP\_GRP1 | Die Daten werden gesichert. |  |
| 9 | Auswahl pflegen | Selektieren Sie einen Anforderungsparameter, und wählen Sie Auswahl pflegen.  Hinweis Wenn die Drucktaste Auswahl pflegen nicht angezeigt wird, müssen Sie evtl. die Taste Zurück wählen. |  |  |
| 10 | Auswahl pflegen | Wählen Sie Kennzahl: RP1, geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Zurück:  Buchungskreis: z.B. 1010  Währung: z.B. USD  Zeitraum: z.B. <markieren>  Valutadefinition: z.B. <erster Tag der Periode>  Instrumenttyp: z.B. Devisentermingeschäft  Zielstatus: z.B. angelegt  Wählen Sie Kennzahl: RP2, geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Zurück.  Buchungskreis: z.B. 1010  Währung: z.B. BRL  Zeitraum: z.B. <markieren>  Valutadefinition: z.B. <erster Tag der Periode>  Instrumenttyp: z.B. Devisentermingeschäft  Zielstatus: z.B. angelegt |  |  |
| 11 | Sichern | Wählen Sie Zurück.  Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |

### Fixingreferenzen definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Für das Swift-Format MT300 gibt es ein neues obligatorisches Feld mit der Bezeichnung "14S: Abrechnungskursquelle". Der Eintrag in diesem Feld beschreibt, ob der Fixingkurs:

* über eine EMTA-Vorlage verwaltet wird (z.B. :14S:EMT00) ODER
* mit dem Kontrahenten ausgehandelt und explizit beschrieben beschrieben wird (z.B. :14S:EUR2/1600/GBLO)

Zur Ableitung dieses Feldes müssen Sie Fixingreferenzen festlegen. Geben Sie die Fixingreferenzen in jedem NDF-Geschäft ein. SAP liefert drei Fixingreferenztypen:

* 1: Allgemeine Fixingreferenz
* 2: EMTA-Fixingreferenz
* 3: Kombinierte Fixingreferenz

Die ersten beiden Fixingreferenztypen sind die grundlegenden Fixingreferenztypen, mit denen die Fixingreferenz-IDs für den dritten Typ festgelegt werden können. Die Fixingreferenz-IDs für Typ 1 und Typ 2 können Sie direkt definieren. Um die Fixingreferenz-ID für Typ 3 zu definieren, müssen Sie zuerst die grundlegenden Fixingreferenz-IDs definieren. Dann können Sie mit diesen grundlegenden Fixingreferenz-IDs die kombinierte Fixingreferenz-ID definieren.

Vorgehensweise

Tabelle 4: Allgemeine Fixingreferenz und EMTA-Fixingreferenz festlegen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Fixingreferenzen definieren(FTR\_FIX\_DEF). | Das Bild Sicht "Fixingreferenz definieren" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Wählen Sie Neue Einträge. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht Hinzugefügte wird angezeigt. |  |
| 4 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Legen Sie die in der folgenden Tabelle definierten Fixingreferenz-IDs an, und wählen Sie Sichern. | Auf dem Bild Neue Einträge: Übersicht über hinzugefügte Einträge wird die Meldung Daten wurden gesichert angezeigt. |  |

Tabelle 5: Tabelle "Fixingreferenz-IDs"

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Fixingreferenz-ID | Fixingreferenzbeschreibung | Leitwährung | Folgewährung | Fixingreferenztyp | Quelle | Ort | Zeit |
| ECB37 EUR/USD | ECB37 EUR/USD | EUR | USD | 1 Allgemeine Fixingreferenz | EUR1 | DECB | 14:15 |
| WM/REUTERS EUR/USD 4 PM | WM/REUTERS EUR/USD 4 PM | EUR | USD | 1 Allgemeine Fixingreferenz | EUR2 | GBLO | 16:00 |
| KFTC18 (KRW02) | KFTC18 (KRW02) | USD | KRW | 2 EMTA-Fixingreferenz | leer lassen | leer lassen | leer lassen |
| PTAX (BRL09) | BRL PTAX (BRL09) | USD | BRL | 2 EMTA-Fixingreferenz | leer lassen | leer lassen | leer lassen |

Tabelle 6: Kombinierte Fixingreferenz festlegen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Fixingreferenzen definieren(FTR\_FIX\_DEF). | Das Bild Sicht "Fixingreferenz definieren" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Wählen Sie Neue Einträge. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht Hinzugefügte wird angezeigt. |  |
| 4 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Geben Sie folgende Daten ein:  Erste Zeile:  Fixingreferenz-ID:PTAX(BRL09) -WM/REUTERS EUR/USD  Fixingreferenzbeschreibung: BRL PTAX (BRL09) - WM/REUTERS EUR/USD 4 PM  Leitwährung: EUR  Folgewährung: BRL  Fixingreferenztyp: 3 Kombinierte Fixingreferenz  Quelle: leer lassen  Ort: leer lassen  Zeit: leer lassen |  |  |
| 5 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang dieser Zeile, und wählen Sie Details der kombinierten Fixingreferenz angeben. |  |  |
| 6 | Fixingreferenz-IDs anlegen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Zeile 1:  Fixingreferenz-ID:PTAX (BRL09)  Laufende Nummer:1  Zeile 2:  Fixingreferenz-ID:WM/REUTERS EUR/USD 4 PM  Laufende Nummer:2 | Auf dem Bild Neue Einträge: Übersicht über hinzugefügte Einträge wird die Meldung Daten wurden gesichert angezeigt.  Sie haben die erforderlichen Fixingreferenz-ID definiert. |  |

### Werte für die Verfallszeit definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Für das Swift-Format MT305 gibt es ein neues Mussfeld mit der Bezeichnung 31G, in das Verfallseinzelheiten eingegeben werden. Hier werden Datum, Zeit und Ort für den Optionsverfall festgelegt. In dieser Aktivität ordnen Sie Zeiten zu Orten zu.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Werte für Verfallszeit definieren - Devisenoption(FTR\_EXPIRY\_TIME\_DEF). | Das Bild Sicht "Zeiten zu Orten zuordnen" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Verfallszeiten zu Orten zuordnen | Wählen Sie Neue Einträge. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht Hinzugefügte wird angezeigt. |  |
| 4 | Verfallszeiten zu Orten zuordnen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Lokation: z.B. DEFR  Zeit: z.B. 15:00 | Auf dem Bild Neue Einträge: Übersicht über hinzugefügte Einträge wird die Meldung Daten wurden gesichert angezeigt. |  |

# Übersichtstabelle

Der Umfangsbestandteil Fremdwährungs-Risikomanagement (1X1) umfasst die verschiedenen Prozessschritte in der folgenden Tabelle.

Hinweis Wenn Ihr Systemadministrator Bereiche und Seiten auf dem SAP Fiori Launchpad aktiviert hat, enthält die Startseite nur die wesentlichen Apps, mit denen die typischen Aufgaben einer Benutzerrolle ausgeführt werden können.

Alle anderen Apps, die nicht auf der Startseite enthalten sind, finden Sie über die Suchleiste.

Wenn Sie die Startseite personalisieren und versteckte Apps hinzufügen möchten, wechseln Sie in Ihre Benutzerprofil und wählen Sie Einstellungen > App Finder.

Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Ohne Optionen

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Prozessschritt | Benutzerrolle | Transaction/APP | Erwartete Ergebnisse |
| [(1XN) Market Rates Management – manuell per Upload](#unique_27) [Seite ] 62 | - | - | Die Marktdaten werden vorbereitet. |
| [Limitinanspruchnahmen aufbauen](#unique_28) [Seite ] 63 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Tagesendeverarbeitung(KLNACHT) | Der Prozess wird erfolgreich abgeschlossen. |
| [Tagesfinanzstatus analysieren](#unique_29) [Seite ] 64 | Cash-Manager | - | Den beiden Testskripts zu Vorgängen für Barmittel wird gefolgt. |
| [Liquiditätsvorschau analysieren](#unique_30) [Seite ] 65 | Cash-Manager | - | Den beiden Testskripts zu Vorgängen für Barmittel wird gefolgt. |
| [Bilanzdevisenrisiko prüfen](#unique_31) [Seite ] 65 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Bilanzdevisenrisiko prüfen(F1588) | Bild "Bilanzdevisenrisiko prüfen" wird mit korrekten Daten angezeigt. |
| [Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen](#unique_32) [Seite ] 67 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Treasury-Middle-Office-Jobs einplanen(F2772) | Es wird ein Snapshot für "Bilanzdevisenrisiko" erstellt. |
| [Snapshot-Position prüfen und verarbeiten](#unique_33) [Seite ] 69 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763) | Ihre Änderungen werden gesichert. |
| [Snapshot freigeben](#unique_34) [Seite ] 70 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763) | Der Snapshot wird freigegeben. |
| [Exposure-Daten sammeln](#unique_35) [Seite ] 153 | - | - | Übersicht über die Rohexposures.  Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Rohexposure anlegen](#unique_36) [Seite ] 72 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Rohexposure verarbeiten(FTREX1)Rohexposures importieren - Tabellenkalkulation(FTREX\_EXCEL\_UPLOAD) | Die Exposures werden angelegt. |
| [Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen](#unique_37) [Seite ] 76 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshot erstellen(TOESNAP) | Es wird ein Snapshot für "Cashflow-Exposure" erstellt. |
| [Cashflow-Netto-Exposure überprüfen](#unique_38) [Seite ] 77 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Hedge-Management-Cockpit(TOENE) | Das Hedge-Management-Cockpit wird mit den Exposure-Daten angezeigt. |
| [Sicherungsanforderung generieren](#unique_39) [Seite ] 80 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Treasury-Middle-Office-Jobs einplanen(F2772) | Durch den Hintergrundjob wird eine Handelsanforderung über die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung angelegt. |
| [Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten](#unique_40) [Seite ] 82 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko | Ihre Änderungen werden gesichert. |
|  | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764) | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wurde erfolgreich freigegeben. |
| [Sicherungsanforderung generieren](#unique_41) [Seite ] 85 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Hedge-Management-Cockpit(TOENE) | Sicherungsanforderung wird generiert. |
| [Sicherungsanforderung freigeben](#unique_42) [Seite ] 88 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO) | Sicherungsanforderung wird synchronisiert. |
| [Status der Handelsanforderungen prüfen](#unique_43) [Seite ] 92 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO) |  |
| [Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren](#unique_44) [Seite ] 79 | - | - | Vereinbarung über die Sicherungsmaßnahmen.  Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen](#unique_45) [Seite ] 93 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB) | Das System zeigt anhand Ihrer Selektionskriterien eine Übersicht der Limitinanspruchnahmen an. |
| [Kassa-/Termingeschäft anlegen](#unique_46) [Seite ] 95 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | Kassa-/Termingeschäft anlegen(TX01) | Geschäft wird gesichert, und Geschäftsnummer wird generiert. |
| [Devisenswap anlegen](#unique_47) [Seite ] 97 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | Devisenswap anlegen(TX10) | Geschäft wird gesichert, und Geschäftsnummer wird generiert. |
| [Non-Deliverable Forward anlegen](#unique_48) [Seite ] 99 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | Kassa-/Termingeschäft anlegen(TX01) | Geschäft wird gesichert, und Geschäftsnummer wird generiert. |
| [(BFB) Grundlegende Kassenvorgänge](#unique_49) [Seite ] 101 | Cash-Manager | - | Dem angegebenen Testskript folgen |
| [(J78) Erweiterte Kassenvorgänge](#unique_50) [Seite ] 102 | Cash-Manager | - | Dem angegebenen Testskript folgen |
| [Abrechnungsstatus setzen (manuell)](#unique_51) [Seite ] 103 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06) | Der Transaktionsstatus ändert sich zu "Vertragsabrechnung". |
| [Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden](#unique_52) [Seite ] 106 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Korrespondenzstatus prüfen](#unique_53) [Seite ] 106 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |
| [Eingehende Bestätigung erhalten](#unique_54) [Seite ] 195 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen](#unique_55) [Seite ] 109 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Die relevanten ausgehenden KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Abgeschlossen".  Die relevanten INTERNEN ausgehenden Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Gesendet". |
| [Abrechnungsstatus setzen](#unique_56) [Seite ] 130 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Geschäft wurde auf Vorgang 2 "Vertragsabrechnung" aktualisiert. |
| [Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen](#unique_57) [Seite ] 113 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA) | Auf dem Bild "Market Risk Analyzer" werden die Barwerte einschließlich CVA/DVA angezeigt. Sie sehen auf dem Bild zu jedem Geschäft den Barwert, risikofreien Barwert, CVA und DVA. |
| [Stichtagsbewertung durchführen](#unique_58) [Seite ] 117 | Treasury-Buchhalter | Bewertung ausführen(TPM1) | Das Bild "Bewertungsprotokoll" wird angezeigt. Sie können die Buchungsinformation für nationale Rechnungslegungsvorschriften prüfen (Bewertungsbereich DE0), indem Sie "Protokolle + Nachrichten" wählen.  Der Buchhaltungsbeleg wurde in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften angelegt (Bewertungsbereich DE0). |
| [Kurs für NDF festlegen](#unique_59) [Seite ] 120 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Feste Umrechnungskurse(TXV5) | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |
| [Abrechnungsstatus setzen (manuell)](#unique_51) [Seite ] 103 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06) | Der Transaktionsstatus ändert sich zu "Vertragsabrechnung". |
| [Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden](#unique_60) [Seite ] 124 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Korrespondenzstatus prüfen](#unique_53) [Seite ] 106 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |
| [Eingehende Bestätigung erhalten](#unique_54) [Seite ] 195 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen](#unique_55) [Seite ] 109 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Die relevanten ausgehenden KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Abgeschlossen".  Die relevanten INTERNEN ausgehenden Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Gesendet". |
| [Abrechnungsstatus setzen](#unique_56) [Seite ] 130 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Geschäft wurde auf Vorgang 2 "Vertragsabrechnung" aktualisiert. |
| [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Bewegungen buchen(TBB1) | Das Bild „Protok.Zahlung“ wird angezeigt, und eine Zahlungsanforderung wurde generiert. Notieren Sie die Schlüsselnummer, die auf diesem Bild angezeigt wird. |
| [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) | Der Zahlungsbeleg wurde angelegt.  Der BCM-Batch wurde angelegt.  Für einen Batch sind ggf. weitere Genehmigungen erforderlich, bevor schließlich der Zahlungsträger angelegt wird. Details finden Sie im Testskript "Vorgänge für Barmittel – Standard (BFB)". |
| [Von Bank initiierte Zahlung](#unique_63) [Seite ] 137 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Im Hauptbuch buchen](#unique_64) [Seite ] 137 | Treasury-Buchhalter | Bewegungen buchen(TBB1)Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10) | Das Bild "Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle" wird anzeigt, und für Ausgangszahlungen in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) wurde ein Buchhaltungsbeleg angelegt. |
| [Realisierten Gewinn und Verlust buchen](#unique_65) [Seite ] 141 | Treasury-Buchhalter | Abgeleitete Geschäftsvorfälle buchen(TPM18) | Das neue Bild "Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle" wird angezeigt. Sie sehen die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Der Buchhaltungsbeleg wurde in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften angelegt (Bewertungsbereich DE0). |

Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Mit Optionen

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Prozessschritt | Benutzerrolle | Transaction/APP | Erwartete Ergebnisse |
| [(1XN) Market Rates Management – manuell per Upload](#unique_27) [Seite ] 62 | - | - | Die Marktdaten werden vorbereitet. |
| [Limitinanspruchnahmen aufbauen](#unique_66) [Seite ] 144 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Tagesendeverarbeitung(KLNACHT) | Der Prozess wird erfolgreich abgeschlossen. |
| [Liquiditätsvorschau analysieren](#unique_30) [Seite ] 65 | Cash-Manager | - | Den beiden Testskripts zu Vorgängen für Barmittel folgen |
| [Bilanzdevisenrisiko prüfen](#unique_31) [Seite ] 65 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Bilanzdevisenrisiko prüfen(F1588) | Bild "Bilanzdevisenrisiko prüfen" wird mit korrekten Daten angezeigt. |
| [Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen](#unique_32) [Seite ] 67 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Treasury-Middle-Office-Jobs einplanen(F2772) | Es wird ein Snapshot für "Bilanzdevisenrisiko" erstellt. |
| [Snapshot-Position prüfen und verarbeiten](#unique_33) [Seite ] 69 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763) | Der Snapshot-Status lautet Freigegeben. |
| [Snapshot freigeben](#unique_34) [Seite ] 70 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763) | Ihre Änderungen werden gesichert. |
| [Exposure-Daten sammeln](#unique_35) [Seite ] 153 | - | - | Übersicht über die Rohexposures  Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Rohexposure anlegen](#unique_67) [Seite ] 153 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Rohexposure verarbeiten(FTREX1)Rohexposures importieren - Tabellenkalkulation(FTREX\_EXCEL\_UPLOAD) | Die Exposures werden angelegt. |
| [Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen](#unique_37) [Seite ] 76 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Snapshot erstellen(TOESNAP) | Es wird ein Snapshot für "Cashflow-Exposure" erstellt. |
| [Cashflow-Netto-Exposure überprüfen](#unique_38) [Seite ] 77 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Hedge-Management-Cockpit(TOENE) | Das Hedge-Management-Cockpit wird mit den Exposure-Daten angezeigt. |
| [Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren](#unique_44) [Seite ] 79 | - | - | Vereinbarung über die Sicherungsmaßnahmen  Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Sicherungsanforderung generieren](#unique_68) [Seite ] 160 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Treasury-Middle-Office-Jobs einplanen(F2772) | Durch den Hintergrundjob wird eine Handelsanforderung über die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung angelegt. |
| [Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten](#unique_40) [Seite ] 82 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko | Ihre Änderungen werden gesichert. |
| [Sicherungsanforderung freigeben](#unique_69) [Seite ] 84 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764) | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wurde erfolgreich freigegeben. |
| [Sicherungsanforderung generieren](#unique_70) [Seite ] 166 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Hedge-Management-Cockpit(TOENE) | Eine Sicherungsanforderung wird angelegt. |
| [Sicherungsanforderung freigeben](#unique_71) [Seite ] 169 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO) | Die Sicherungsanforderung wird freigegeben. |
| [Handelsanforderung manuell anlegen](#unique_72) [Seite ] 171 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO) | Eine Handelsanforderung wird manuell angelegt. |
| [Status der Handelsanforderungen prüfen](#unique_73) [Seite ] 172 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO) |  |
| [Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen](#unique_45) [Seite ] 93 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB) | Das System zeigt anhand Ihrer Selektionskriterien eine Übersicht der Limitinanspruchnahmen an. |
| [Devisenoption Plain Vanilla anlegen](#unique_74) [Seite ] 176 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | OTC-Option anlegen(TI71) | Geschäft wird gesichert, und Geschäftsnummer wird generiert. |
| [Option 1: Beide Optionen separat und Optionsreferenz anlegen](#unique_75) [Seite ] 179 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | OTC-Option anlegen(TI71) |  |
| [Option 2: Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption in einem Schritt anlegen](#unique_76) [Seite ] 184 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | Collar-Devisenoption anlegen(TI4B) |  |
| [(BFB) Grundlegende Kassenvorgänge](#unique_49) [Seite ] 101 | Cash-Manager | - | Dem angegebenen Testskript folgen |
| [(J78) Erweiterte Kassenvorgänge](#unique_50) [Seite ] 102 | Cash-Manager | - | Dem angegebenen Testskript folgen |
| [Abrechnungsstatus setzen (manuell)](#unique_77) [Seite ] 190 | Treasury-Spezialist – Backoffice | OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91) | Der Transaktionsstatus ändert sich zu "Vertragsabrechnung". |
| [Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden](#unique_52) [Seite ] 106 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Korrespondenzstatus prüfen](#unique_53) [Seite ] 106 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |
| [Eingehende Bestätigung erhalten](#unique_54) [Seite ] 195 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen](#unique_55) [Seite ] 109 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Die relevanten ausgehenden KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Abgeschlossen".  Die relevanten INTERNEN ausgehenden Korrespondenzobjekte der Geschäfte haben den Status "Gesendet". |
| [Abrechnungsstatus setzen](#unique_56) [Seite ] 130 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) | Das Geschäft wurde auf Vorgang 2 "Vertragsabrechnung" aktualisiert. |
| [Zahlungsanforderung für Prämie erzeugen](#unique_78) [Seite ] 200 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Bewegungen buchen(TBB1) | Das Bild „Protok.Zahlung“ wird angezeigt, und eine Zahlungsanforderung wurde generiert. Notieren Sie die Schlüsselnummer, die auf diesem Bild angezeigt wird. |
| [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) | Der Zahlungsbeleg wurde angelegt.  Der BCM-Batch wurde angelegt.  Für einen Batch sind ggf. weitere Genehmigungen erforderlich, bevor schließlich der Zahlungsträger angelegt wird. Details finden Sie im Testskript "Vorgänge für Barmittel – Standard (BFB)". |
| [Von Bank initiierte Zahlung](#unique_63) [Seite ] 137 | Treasury-Spezialist – Backoffice | - | Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems. |
| [Im Hauptbuch buchen](#unique_64) [Seite ] 137 | Treasury-Buchhalter | Bewegungen buchen(TBB1)Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10) | Das Bild "Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle" wird anzeigt, und für Ausgangszahlungen in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) wurde ein Buchhaltungsbeleg angelegt. |
| [Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen](#unique_57) [Seite ] 113 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA) | Auf dem Bild "Market Risk Analyzer" werden die Barwerte einschließlich CVA/DVA angezeigt. Sie sehen auf dem Bild zu jedem Geschäft den Barwert, risikofreien Barwert, CVA und DVA. |
| [Stichtagsbewertung durchführen](#unique_58) [Seite ] 117 | Treasury-Buchhalter | Bewertung ausführen(TPM1) | Das Bild "Bewertungsprotokoll" wird angezeigt. Sie können die Buchungsinformation für nationale Rechnungslegungsvorschriften prüfen (Bewertungsbereich DE0), indem Sie "Protokolle + Nachrichten" wählen.  Der Buchhaltungsbeleg wurde in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften angelegt (Bewertungsbereich DE0). |
| [Entscheidung für "Ausübung"](#unique_79) [Seite ] 217 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91) | Das Geschäft wird auf "Ausüben" aktualisiert und ohne Fehlermeldung gesichert. |
| [Kassakontrakt anlegen](#unique_80) [Seite ] 219 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91) | Die Daten werden gesichert, und eine neue Geschäftsnummer wird generiert. |
| [Entscheidung für "Verfall"](#unique_81) [Seite ] 221 | Treasury-Spezialist – Frontoffice | OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91) | Das Geschäft wird auf "Verfall" aktualisiert und ohne Fehlermeldung gesichert. |
| [Realisierten Gewinn und Verlust buchen](#unique_65) [Seite ] 141 | Treasury-Buchhalter | Abgeleitete Geschäftsvorfälle buchen(TPM18) | Das neue Bild "Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle" wird angezeigt. Sie sehen die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Der Buchhaltungsbeleg wurde in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften angelegt (Bewertungsbereich DE0). |

Reporting

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Prozessschritt | Benutzerrolle | Transaction/APP | Erwartete Ergebnisse |
| [Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen](#unique_82) [Seite ] 225 | Treasury-Buchhalter | Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen(F1754) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Alerts anzeigen – Buchung](#unique_83) [Seite ] 226 | Treasury-Buchhalter | Treasury-Alerts anzeigen(F4984) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Alerts anzeigen – Abrechnung, Freigabe, Zahlung und Korrespondenz](#unique_84) [Seite ] 228 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Treasury-Alerts anzeigen(F2025) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Zahlungsplan anzeigen](#unique_85) [Seite ] 229 | Treasury-Buchhalter | Zahlungspläne anzeigen(TJ04) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Buchungsjournal anzeigen](#unique_86) [Seite ] 230 | Treasury-Buchhalter | Treasury-Buchungsjournal anzeigen(F1755) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Bestandsanalyse](#unique_87) [Seite ] 232 | Treasury-Buchhalter | Treasury-Bestandsanalyse (barrierefrei)(W0049) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Bestandswerte anzeigen](#unique_88) [Seite ] 233 | Treasury-Buchhalter | Treasury-Bestandswerte anzeigen(F1867) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Finanzpositionen definieren](#unique_89) [Seite ] 234 | Treasury Risk Manager | Finanzbestände definieren(FTR\_FP\_DEF) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Finanzstatus (Buchwert)](#unique_90) [Seite ] 238 | Treasury Risk Manager | Finanzstatus - Buchwert(F2136) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Finanzstatus (Nominalbetrag)](#unique_91) [Seite ] 239 | Treasury Risk Manager | Finanzstatus (Nominalbetrag) (barrierefrei)(W0122) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Treasury-Zahlungen anzeigen](#unique_92) [Seite ] 240 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Treasury-Zahlungen anzeigen(TPM20A) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Barwert analysieren](#unique_93) [Seite ] 242 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Barwert analysieren(JBRX) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Marktrisikokennzahlen berechnen](#unique_94) [Seite ] 243 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Marktrisikokennzahlen berechnen(AISGENKF) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Sensitivitätskennzahlen](#unique_95) [Seite ] 245 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Sensitivitätskennzahlen - Einzelanalyse(AISS) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Bericht "Limitinanspruchnahmen prüfen"](#unique_96) [Seite ] 246 | Treasury-Spezialist – Middle-Office | Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Schwellenwertberechnung ausführen](#unique_97) [Seite ] 248 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Kennzahlen für Clearing-Schwelle berechnen(FTR\_THRESHOLD\_CALC) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |
| [Schwellen-Report prüfen](#unique_98) [Seite ] 249 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Clearing-Schwellen-Report(FTR\_THRESHOLD\_DISP) | Der Report wird mit gefilterten Daten angezeigt. |

# Testverfahren

In diesem Abschnitt werden die Testverfahren für den jeweiligen Prozessschritt beschrieben, der zum betreffenden Umfangsbestandteil gehört.

Der Test sollte ungefähr <Dauer eingeben, z.B. 60 Minuten> dauern.

## Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Ohne Optionen

Zweck

In diesem Abschnitt legen Sie Devisengeschäfte für die Absicherung oder für andere Zwecke an. Zusätzlich bearbeiten Sie die nachfolgenden Schritte zur Abrechnung, Fixierung und Ausführung des Kontrakts bis zum Abschluss durch Eingang bzw. Senden der Zahlung. Die Devisengeschäfte sind fest und automatisch in Vorgänge für Barmittel, Hauptbuch und Korrespondenz integriert. Für die an den Devisenprozessen beteiligten Rollen werden Funktionen für tägliches Reporting bereitgestellt.

### (1XN) Market Rates Management – manuell per Upload

Verwendungszweck

In diesem Schritt erfahren Sie, wie Sie Marktdaten wie Fremdwährungstausch-Kassakurse, Swap-Sätze, Referenzzinssätze usw. erfassen.

Diese Daten liefern Standardwerte, wenn Sie neue Geschäfte anlegen oder den Marktwert bestehender Geschäfte berechnen.

Vorgehensweise

Weitere Informationen finden Sie im Testskript Market Rates Management – manuell per Upload (1XN).

### Limitinanspruchnahmen aufbauen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Am Ende des Geschäftstages kann der "Treasury-Spezialist – Middle-Office" die Tagesendeverarbeitung ausführen. Das System ermittelt und aktualisiert die Limitinanspruchnahme auf der Grundlage der im Datenpool enthaltenen Geschäfte und Bestände sowie der erfassten externen Geschäfte.

Voraussetzung

Die Marktdaten wurden importiert.

Wenn ein Wertpapier besteht, muss der Spot-Preis für das aktuelle Datum eingegeben werden. Ausführliche Vorgehensweisen finden Sie im Abschnitt Wertpapierkurs aktualisieren von Market Rates Management – manuell per Upload(1XN).

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Tagesendeverarbeitung(KLNACHT). | Das Bild Tagesendeverarbeitung(KLNACHT) wird angezeigt. |  |
| 3 | Kriterien für die Tagesendeverarbeitung eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Bewertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Ermittlungsverfahren: z.B. <10 bis 20>  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Meldung Tagesendeverarbeitung erfolgreich durchgeführt wird angezeigt. |  |

### Tagesfinanzstatus analysieren

Einsatzmöglichkeiten

Zu Beginn des Geschäftstages prüft der Cashmanager den Tagesfinanzstatus und entscheidet dann anhand dieser Analyse über die richtigen Finanzinstrumente für kurzfristige Zwecke.

Vorgehensweise

Wenn in Ihrem System Cash Management implementiert ist, können Sie den Tagesfinanzstatus mit der App Cashflow-Analyse(F2332) analysieren. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Grundlegende Kassenvorgänge(BFB).

### Liquiditätsvorschau analysieren

Einsatzmöglichkeiten

Der Cash-Manager prüft die Liquiditätsvorschau regelmäßig und trifft Entscheidungen zu mittelfristigen oder langfristigen Finanzinstrumenten, z.B. Investitionen, Darlehen oder Devisen.

Vorgehensweise

Wenn in Ihrem System Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) analysieren. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Grundlegende Kassenvorgänge(BFB).

### Bilanz-Exposure-Management

Zweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie Bilanz-Exposures überprüft werden.

#### Bilanzdevisenrisiko prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen Sie das Bilanzdevisenrisiko, um eine Übersicht über den Status der Bilanzdevisenrisiken zu erhalten.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieBilanzdevisenrisiko prüfen(F1588). | Das Bild Bilanzdevisenrisiko prüfen(F1588)wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Folgendes ein, und wählen Sie Starten:  Anzeigewährung: z.B. EUR  Wechselkurstyp: z.B. M  Stichtag: <aktuelles Datum> | Die Standard-Bereiche zeigen die Daten für alle Buchungskreise an. |  |
| 4 | Drilldown auf einen Buchungskreis | In der Spalte Buchungskreis wählen Sie 1010. | Die Liste Bilanz-Devisen-Nettoexposures enthält die Elemente, die unter Kennzahlen für Bilanzdevisenrisiko definieren festgelegt wurden. |  |

#### Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität erstellen Sie ein Snapshot für das Bilanzdevisenrisiko zum Stichtag.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshot erstellen - Bilanzdivisenrisiko(FXM\_SNAP). | Das Bild Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeinen Informationen für die Erstellung eines Snapshots eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Im Bereich Allgemein  Snapshot-Beschreibung: z.B.: Snapshot-Bilanzdevisenrisiko verwenden  Status: Angelegt  Stichtagsdefinition: Festgelegtes Datum  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Berichtswährung: EUR  Kurstyp: M  Im Bereich Filter:  Buchungskreis: 1010  Währung: <Risikowährung, z.B. USD für DE>  Im Bereich Zeitraster:  Periodendefinition: z.B. <markieren>  Startdatum: z.B. <erster Tag des aktuellen Jahres>  Enddatum: z.B. <letzter Tag des aktuellen Jahres>  Schrittweite: z.B. 1  Einheit: z.B. Monat  Testlauf: <entmarkieren> | Das Bild Snapshot-Details wird angezeigt.  Notieren Sie sich die Snapshot-ID für die Folgeschritte. |  |

#### Snapshot-Position prüfen und verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen und bearbeiten Sie die Snapshot-Position für das Bilanzdevisenrisiko.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763). | Das Bild Snapshot des Bilanzdevisenrisikos verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Snapshot-Position prüfen | Geben Sie die Snapshot-ID ein, die Sie im Feld Snapshot-ID notiert haben, und wählen Sie Starten.  Wählen Sie > am Ende der Zeile für den soeben eingeplanten Job.  Wählen Sie im Bild Snapshot am Ende der Zeile für die Snapshot-Position das Pfeilsymbol >, um die Details zu überprüfen.  Prüfen Sie die Snapshot-Position. | Das Bild Snapshot-Position wird angezeigt. |  |
| 4 | Neue Snapshot-Position anlegen (optional) | Wählen Sie "Zurück", um zum Bild Snapshot zurückzukehren.  Wählen Sie Anlegen.  Geben Sie im Bild Neue Snapshot-Position folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Buchungskreis: 1010  Betrag: z.B. 1.000.000 <Risikowährung, z.B. USD für DE>  Periodenbeginn: z.B. <erster Tag des aktuellen Monats>  Periodenende: z.B. <letzter Tag des aktuellen Monats> | Eine Snapshot-Position wird mit dem Kennzeichen Manuell angelegt. |  |
| 5 | Snapshot-Position bearbeiten (optional) | Wählen Sie Bearbeiten, ändern Sie die Daten, ändern Sie z.B. den Betrag auf 2.000.000 und wählen Sie Sichern. | Ihre Änderungen wurden gesichert. |  |

#### Snapshot freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität geben Sie den aktualisierten Snapshot für das Bilanzdevisenrisiko frei.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763). | Das Bild Snapshot des Bilanzdevisenrisikos verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Snapshot freigeben | Wählen Sie den Snapshot, den Sie gerade bearbeitet haben, und wählen Sie Freigeben.  Wählen Sie im Dialogfenster OK. | Der Snapshot wird freigegeben. |  |

### Cashflow-Exposure-Management

Zweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie die Cashflow-Exposure auf der Grundlage von Exposure-Daten aus einem externen System eingegeben wird.

#### Exposure-Daten sammeln

Zweck

Benutzer sammeln Exposure-Daten von verschiedenen Teams und Abteilungen, um eine Exposure-Sammlung zu generieren und in das SAP-System einzugeben.

Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

#### Rohexposure anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Sie legen im SAP-System mit Daten aus einer externen Datenquelle ein Rohexposure an.

Voraussetzungen

Für Option 2: Rohexposures aus Tabelle importieren ist ein bestimmtes Datenformat erforderlich. Weitere Informationen zum Generieren einer Vorlagendatei finden Sie im Anhang unter Beschreibung der Vorlage für den Import von Rohexposures und unter Beispieldaten für den Import von Rohexposures.

Vorgehensweise

Option 1: Rohexposure manuell anlegen.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Rohexposure verarbeiten(FTREX1). | Das Bild Rohexposure: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Exposure-Aktivitätsart: z.B. YFXO | Das Bild Rohexposurepflege: Erstellen wird angezeigt. |  |
| 4 | Kopfdaten eingeben | Geben Sie auf der Registerkarte Kopfdaten folgende Daten ein:  Ext. Beleg- Nr.: z.B. <aktuelles Datum>001>  Standard-Exposure-Typ: z.B. 01  Buchungskreis: 1010  Crit4ExpPosType: FX  Richtung: z.B. AUS | Das Bild wechselt zur Registerkarte Positionsdaten. |  |
| 5 | Belegzeilendaten | Wählen Sie die Registerkarte Belegzeilendaten. |  |  |
| 6 | Neue Belegzeile | Wählen Sie Neue Belegzeile erstellen. |  |  |
| 7 | Positionsdaten eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Ext. PosNr.: z.B. 1001  Fälligkeitsdatum: z.B. <aktuelles Datum + 3 Monate>  Exposure- Betrag: z.B. 100.000.000,00  Währung Exposure-Betrag: USD  Zielwährung: EUR | Im Dialogfenster Meldungen werden Meldungen zur erfolgreichen Freigabe, Erstellung und Sicherung angezeigt. |  |

Option 2: Rohexposures aus Tabelle importieren

Hinweis Wenn Sie den Browser im Datenschutzmodus ausführen, können Probleme auftreten. Wechseln Sie daher für die folgenden Schritte in den normalen Modus.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad mit der Rolle Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Rohexposures importieren - Tabellenkalkulation(FTREX\_EXCEL\_UPLOAD). | Das Bild Excel-Upload für Rohexposures wird angezeigt. |  |
| 3 | Lokale Datei zum Gerät hochladen | Wählen Sie Lokale Datei für Upload/Download.  Hinweis Wenn Ihr Browser eine Meldung mit der Frage anzeigt, ob die Dateien auf diesem Gerät gespeichert werden sollen, wählen Sie Zulassen, um fortzufahren. | Das Bild Exposure-Datei auswählen wird angezeigt. |  |
| 4 | Aus nativem Dateisystem importieren | Wählen Sie Aus nativem Dateisystem importieren. Wählen Sie die Vorlagendatei aus dem lokalen Dateisystem, und wählen Sie Öffnen.  Hinweis Die Vorlage muss in einem bestimmten Format vorliegen. Weitere Informationen über das Dateiformat finden Sie im Anhang im Abschnitt Beschreibung der Vorlage für den Import von Rohexposures.  Hinweis Die Datei muss die Erweiterung.xlsx aufweisen.  Hinweis Einige Beispieldaten finden Sie im Anhang unter Beispieldaten für den Import von Rohexposures.  Für die folgenden Schritte wird vorausgesetzt, dass Sie die Beispieldaten im Anhang verwenden. | Nach dem Import wird ein Informationspopup mit der Meldung Import beendet. Anzahl importierter Dateien: 1 angezeigt. |  |
| 5 | OK | Wählen Sie OK. | Im Dialogfenster Exposure-Datei auswählen wird die Exposure-Datei angezeigt. |  |
| 6 | Exposure-Datei zum Importieren und Ausführen auswählen | Selektieren Sie die Exposure-Datei, und wählen Sie Auswählen. | Der Dateipfad im Feld Dateiname wird auf dem Bild Excel-Upload für Rohexposures angezeigt. |  |
| 7 | Testlauf des Imports | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Daten vor Verarbeit. anzeigen: markiert  Testlauf: markiert | Das Bild Exposure-Uploaddaten - Simulation wird angezeigt. |  |
| 8 | Testlaufergebnis prüfen | Prüfen Sie die Exposure-Daten. Wählen Sie zur Bestätigung der Daten  Ausführen. | Links wird die Spalte Status angezeigt. Die erfolgreichen Datensätze sind durch ein Ampelsymbol gekennzeichnet. |  |
| 9 | Echtlauf des Imports | Wählen Sie Beenden. | Das Bild Exposure-Datei auswählen wird angezeigt. |  |
| 10 |  | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Exposure-Uploaddaten zeigt die importierten Daten an. |  |
| 11 | Echtlauf und Überprüfung der Importergebnisse | Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Exposure-Upload wird mit den Importergebnissen angezeigt.  Die erfolgreich importierten Datensätze sind mit einem grünen Ampelsymbol gekennzeichnet und verfügen über eine generierte Rohexposure-ID. |  |

#### Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Snapshot für Cashflow-Exposure am Stichtag erstellen.

Voraussetzungen

Es ist ein Sicherungsbereich vorhanden. Informationen zum Anlegen eines Sicherungsbereichs finden Sie im vorhergehenden Verfahren "Sicherungsbereich definieren".

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | Snapshot erstellen | Öffnen Sie Snapshot erstellen(TOESNAP). | Das Bild Snapshot erstellen wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeine Abgrenzungen erfassen | Nehmen Sie auf dem Bild Allgemeine Abgrenzungen folgende Einträge vor, und wählen Sie Ausführen.  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Beschreibung: z.B. <Aktuelles Datum> Snapshot  Extraktionsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Hinweis Sie können auch einen Snapshot mit einem Extraktionsdatum in der Vergangenheit erstellen, wenn kein Snapshot für den Sicherungsbereich erstellt wird. Beachten Sie, dass Sie einen Snapshot mit einem Extraktionsdatum in der Vergangenheit nur einmal erstellen können.  Tagesreferenz: <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Hinweis Das Ankreuzfeld Tagesreferenz muss markiert sein, wenn Sie den Vorgang Sicherungsanforderung generieren durchführen möchten.  Wenn Sie das Kennzeichen Zielquote zurücksetzen setzen, werden manuell überschriebene Zielquoten im Hedge Management Cockpit auf die ursprünglich in Ihrem Sicherungsbereich definierten Zielquoten zurückgesetzt, die mit dem neuen Snapshot-Datum verwendet werden. | Ein Protokoll mit einer Meldung, dass der Snapshot erfolgreich erstellt wurde, wird angezeigt. |  |

#### Cashflow-Netto-Exposure überprüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt überprüfen Sie das Cashflow-Netto-Exposure im Hedge Management Cockpit.

Voraussetzungen

Es ist ein Sicherungsbereich vorhanden. Informationen zum Anlegen eines Sicherungsbereichs finden Sie im vorhergehenden Verfahren Sicherungsbereich definieren.

Es ist ein Snapshot zum Stichtag vorhanden.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). | Die Sicht Hedge-Management-Cockpit wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Nehmen Sie folgende Einträge vor, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID： 1R\_ALL\_CH | Das Hedge-Management-Cockpit für SicherungsbereichDE 0001 wird mit den Exposure-Daten angezeigt.  Hinweis Wenn Sie Von Quelle definierte Währung wählen und Exposure-Posten während des Snapshots basierend auf den währungsübergreifenden Exposures angelegt werden, zeigt das Hedge-Management-Cockpit die Zielwährung, die Risikowährung und die Buchungskreiswährung an. |  |

### Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren

Zweck

Sie analysieren die Exposure-Daten mit den entsprechenden Teams und Organisationen und vereinbaren Sicherungsmaßnahmen. Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

### Handelsanforderung anlegen

Verwendungszweck

Sie haben drei Möglichkeiten, eine Handelsanforderung anzulegen:

* Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen
* Handelsanforderung über Cashflow-Sicherungsanforderung anlegen
* [Handelsanforderung manuell anlegen](#unique_105) [Seite ] 90

#### Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen

##### Sicherungsanforderung generieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt erzeugen Sie eine Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Sie haben einen Snapshot wie im Abschnitt [Bilanz-Exposure-Management](#unique_101) [Seite ] 65 beschrieben erstellt und freigegeben.

Vorgehensweise

Option 1: Sicherungsanforderung ohne vordefinierte Parameter generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderung generieren - Bilanzdevisenrisiko(FXM\_REQUEST). | Sie gelangen auf das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren. |  |
| 3 | Allgemeine Informationen für "Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren" eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Im Bereich Snapshot  Selektion über Snapshot-ID: z.B. <markieren>  Snapshot-ID: z.B. <die ID, die Sie sich im Schritt "Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen" notiert haben>  Hinweis Stellen Sie sicher, dass Sie beim Erstellen des Snapshots dieselbe Snapshot-ID verwenden.  Im Bereich Filter für Snapshots  Buchungskreis: 1010  Währung: <die Risikowährung, z.B. USD>  Im Bereich Valutadatum:  Festes Datum: <Markieren>  Valutaselektion: Ende aktueller Monat  Im Bereich Hauptparameter:  Instrumenttyp: Devisentermingeschäft  Zielstatus: Angelegt  Testlauf: <entmarkieren> | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungsliste wird angezeigt. |  |

Option 2: Sicherungsanforderung mit vordefinierten Parametern generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeine Informationen für "Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren" eingeben | Wählen Sie Anlegen.  Geben Sie im Dialogfenster folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Snapshot-ID: z.B. <die von Ihnen notierte Snapshot-ID>  Hinweis Stellen Sie sicher, dass Sie beim Erstellen des Snapshots dieselbe Snapshot-ID verwenden.  Anforderungsparametergruppe: z.B. RP\_GRP1 | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungsliste wird mit den neu angelegten Sicherungsanforderungen angezeigt. |  |

##### Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt prüfen und verarbeiten Sie eine Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Es wurde eine Devisensicherungsanforderung angelegt und zur Verfügung gestellt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Start:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 4 | Anfrage prüfen | Markieren Sie die Zeile der zuvor angelegten Sicherungsanforderung, und wählen Sie am Ende der Zeile, das Pfeilsymbol >. | Das Bild Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 5 | Die Anforderung bearbeiten (optional) | Wählen Sie Bearbeiten, ändern Sie die Daten, ändern Sie z.B. den Betrag auf 80% des Originalbetrags, und wählen Sie Sichern. | Ihre Änderungen werden gesichert. |  |

##### Sicherungsanforderung freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt geben Sie eine Devisensicherungsanforderung frei.

Voraussetzungen

Es wurde eine Devisensicherungsanforderung angelegt und zur Verfügung gestellt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Start:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 4 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile der gerade bearbeiteten Sicherungsanforderung, und wählen Sie Freigeben.  Wählen Sie im Dialogfenster OK. | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wurde erfolgreich freigegeben. |  |

#### Handelsanforderung über Cashflow-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen

##### Sicherungsanforderung generieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt erzeugen Sie eine Cashflow-Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Sie haben einen Snapshot mit Tagesreferenz wie im Schritt [Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen](#unique_37) [Seite ] 76 beschrieben erstellt.

Vorgehensweise

Tabelle 7: Sicherungsanforderung manuell generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). |  |  |
| 3 | Layouts verwalten | Wählen Sie Layouts verwalten. | Das Bild Layoutübersicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Eigenes Layout anlegen | Wählen Sie eine Zeile der Vorgabe-Layout-ID, z.B. Layout 1R\_ALL\_CH, und wählen Sie Anlegen mit Vorlage | Das Bild Neue Layout-ID wird angezeigt. |  |
| 5 | Layout-ID eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Enter.  Layout-ID: z.B. 2R\_TQ\_CH | Das Bild Layout wird angezeigt. |  |
| 6 | Kennzahlen für neues Layout wählen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Beschreibung: z.B. Mit Zielquote (Kennzahlen in Zeilen)  Zielquotenart: z.B. YLQ  Geben Sie auf der Registerkarte Kennzahl die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Abzusichernder Betrag: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 8  Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 9  Obere Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 10  Untere Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 11 |  |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID: 2R\_TQ\_CH  Wählen Sie Starten. | Das Hedge-Management-Cockpit für SicherungsbereichDE 0001 wird mit den Exposure-Daten und der Zielquote angezeigt.  Hinweis Sie können eine Zielquote überschreiben, indem Sie eine Zielquotenzelle auswählen und auf Zielquote überschreiben klicken.  Die überschriebene Zielquote kann auf berechnete Kennzahlen angewendet werden, die von der Zielquote abhängen, z.B. Zielsicherungsbetrag und Abzusichernder Betrag. |  |
| 8 | Sicherungsanforderung generieren | Wählen Sie ein Feld mit dem Wert Nettoexposure aus, z.B. ein Feld mit dem Wert Nettoexposure in den nächsten 3 Monaten, und wählen Sie Sicherungsanforderung > Devisensicherungsanforderung, um eine Sicherungsanforderung anzlegen.  Hinweis Wählen Sie das Feld für die Erstellung einer Sicherungsanforderung korrekt aus, da anderenfalls die Fehlermeldung Anforderungen für Navigation zu einer Sicherungsanforderung nicht erfüllt angezeigt wird. | Das Bild Sicherungsanforderung anlegen wird angezeigt. |  |
| 9 | Sicherungsanforderung sichern | Geben Sie folgende Daten ein:  Sicherungsanforderungs-ID: z.B. Devisensicherungsanforderung  Instrumententyp.: z.B. Devisentermingeschäft  Sicherungsklassifizierung: z.B. Y0  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 3 Monate>  Sicherungsanforderungsbetrag: z.B. + 1.000.000  Wählen Sie Sichern. |  |  |

Tabelle 8: Sicherungsanforderung automatisch generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Sicherungsanforderung automatisch generieren | Wählen Sie Autom. Anforderungsanlage.  Prüfen Sie die Zeile Sicherungsanforderung kann angelegt werden, ändern Sie die folgenden Standardeinträge nach Bedarf und wählen Sie Sichern:   * Betrag * Sicherungsanforderungsvaluta * Instrumenttyp.   Hinweis Sie müssen die Kennzahl Abzusichernder Betrag in Ihrem gewählten Layout zur Verfügung stellen. | Die Meldung Sicherungsanforderung wurde mit Gruppen-ID gesichert wird angezeigt. |  |

##### Sicherungsanforderung freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diese Aktivität wird beschrieben, wie Sie eine Devisensicherungsanforderung freigeben.

Voraussetzungen

Ein Devisengeschäftsanforderung wurde angelegt und steht zur Verfügung.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieVerarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Die Sicht Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  Wählen Sie Starten. | Das System zeigt die den Filterkriterien entsprechenden Sicherungsanforderungen an. |  |
| 4 | Anforderung absenden | Markieren Sie die Zeile mit der Sicherungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Absenden aus der Dropdown-Liste aus. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung gesendet wurde. |  |
| 5 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile mit der Sicherungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste aus. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung freigegeben wurde. |  |

#### Handelsanforderung manuell anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt legen Sie manuell eine Handelsanforderung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO). | Die Sicht Handelsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Handelsanforderung manuell anlegen | Wählen Sie Manuelle Handelsanforderung anlegen.  Geben Sie auf der Registerkarte Allgemein die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Buchungskreis: z.B. 1010  Instrumenttyp: z.B. Devisentermingeschäft  Kauf/Verkauf: z.B. Kaufen  Angeforderter Betrag: z.B. 10.000USD  Gegenläufige Währung: z.B. EUR  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 3 Monat> | Die Handelsanforderung wird angezeigt. |  |
| 4 | Zurück zum vorherigen Bild | Wählen Sie Zurück. |  |  |
| 5 | Anforderung filtern | Geben Sie die Handelsanforderungs-ID ein, und wählen Sie Ausführen. |  |  |
| 6 | Anforderung absenden | Markieren Sie die Zeile mit der Handelsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Absenden aus der Dropdown-Liste aus. |  |  |
| 7 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile mit der Handelsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste aus. | Der Status der Handelsanforderung ändert sich in Freigegeben. |  |
| 8 | Abrufvorgang in SAP-S/4HANA-Cloud-Platform-App ausführen | Führen Sie den Vorgang Abrufen entsprechend den Anweisungen im Testskript Treasury-Handel über Handelsplattformen (2F5) aus. | Der Abrufvorgang wurde erfolgreich abgeschlossen. |  |
| 9 | Aktualisierungsstatus bestätigen | Überprüfen Sie den Status der Handelsanforderung. | Der Status der Handelsanforderung ändert sich in Übertragen. |  |

### Status der Handelsanforderungen prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt prüfen Sie den Status aller Handelsanforderungen.

Voraussetzungen

Es werden Devisensicherungsanforderungen angelegt und freigegeben, um die Handelsanforderungen bereit zu stellen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO). | Die Sicht Handelsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Handelsanforderungstyp: z.B. Sicherung  Hinweis Um Handelsanforderungen zu überprüfen, die über Bilanz-Exposure-Sicherheitsanforderung angelegt wurden, wählen Sie Bilanz-Hedge. | Das System zeigt die den Filterkriterien entsprechenden Handelsanforderungen an.  Sicherungsanforderungen aus dem vorherigen Schritt werden mit dem entsprechenden Status angezeigt. |  |
| 4 | Ursprüngliche Anforderung prüfen | Markieren Sie die Zeile einer Handelsanforderung, und wählen Sie Ursprüngliche Anforderung. | Die Sicht "Sicherungsanforderung" wird angezeigt. |  |
| 5 | Anfrage prüfen | Wählen Sie Prüfen. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung konsistent ist. |  |

### Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie Sie den Bericht "Limitinanspruchnahmen" prüfen.

Voraussetzungen

Die Limitstammsätze Ihres Unternehmens sind im System gepflegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB). | Das Bild Übersicht Limitinanspruchnahmen - Auswahl über alle Merkmale wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Limitart: z.B. Y01 oder Y07  Inanspruchnahmebasis: z.B. 1  Ermittlungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Vorgaben gültig ab: z.B. <aktuelles Datum> | Es wird eine Übersicht der Limitinanspruchnahmen anhand Ihrer Selektionskriterien angezeigt. |  |

### Devisenkontrakt anlegen

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Abschnitt können Sie Devisenkontrakte für die Absicherung oder für andere Zwecke anlegen.

#### Kassa-/Termingeschäft anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität legen Sie ein Devisenkassa- oder -termingeschäft für die Absicherung oder für andere Zwecke an.

Sie können auch ein Devisenkassa- oder -termingeschäft anlegen, indem Sie ein vorhandenes Devisenkassa- oder -termingeschäft kopieren. Weitere Informationen hierzu finden Sie im Schritt [Vorhandenes Geschäft kopieren](#unique_107) [Seite ] 308 des Anhangs.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmeldung | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäft anlegen(TX01). | Das Bild Kassa-/Termingeschäftserfassung: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Enter.  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 60A  Geschäftsart: z.B. 101  Partner: z.B. 10537001  Hinweis Verwenden Sie für ein Termingeschäft die Geschäftsart 102. | Das Bild Kassa-/Termingeschäftserfassung: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten eingeben | Pflegen Sie die folgenden Felder, und wählen Sie dann die Registerkarte Verwaltung :  Kurs: Beispiel: EUR/USD <Geben Sie einen geeigneten Kurs ein.>  Kauf/Verkauf: z.B. K Kaufen  Geh.Betrag: z.B. 1M  Valutadatum: +2  Hinweis Für Termingeschäfte können Sie ein Valutadatum von mehr als +2 Tagen eingeben.  Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. | Die Registerkarte Verwaltung wird angezeigt. |  |
| 5 | Daten auf der Registerkarte "Verwaltung" eingeben | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  SichKlassifiz.: Z.B.: Y0  Risikominderung: <markieren>  Hinweis Markieren Sie das Ankreuzfeld Risikominderung, wenn dieses Geschäft für die Risikominderung vorgesehen ist. In diesem Fall geht das Geschäft nicht in die Berechnung des Clearing-Schwellen-Reports ein. | Das Geschäft wird gesichert, und eine Geschäftsnummer wird generiert. |  |

#### Devisenswap anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie einen Devisenswap für die Absicherung oder für andere Zwecke an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Devisenswap anlegen(TX10). | Das Bild Devisenswap anlegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Enter.  Buchungskreis: z.B. 1010  Partner: z.B. 10537001  Erstes Geschäft  Produktart: 60A  Geschäftsart: z.B. 101  Zweites Geschäft  Produktart: 60A  Geschäftsart: z.B. 102 | Das Bild Devisenswap anlegen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten eingeben | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Erstes Geschäft  Währungen: z.B. EUR/USD  Kurs: Beispiel: <Geben Sie einen geeigneten Kurs ein.>  Kauf/Verkauf: z.B. K Kaufen  Geh.Betrag: z.B. USD1M  Valutadatum: z.B. +2  2. Transaktion  Kurs: Beispiel: <Geben Sie einen geeigneten Kurs ein.>  Valutadatum: z.B. ++6  Hinweis Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. | Zwei Geschäfte werden gesichert und zwei Geschäftsnummern generiert. |  |

#### Non-Deliverable Forward anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie ein Non-Deliverable-Forward-Devisengeschäft zur Absicherung oder zu anderen Zwecken an.

Sie können ein Non-Deliverable-Forward-Devisengeschäft anlegen, indem Sie ein vorhandenes NDF kopieren. Weitere Informationen hierzu finden Sie im Schritt [Vorhandenes Geschäft kopieren](#unique_107) [Seite ] 308 des Anhangs.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieKassa-/Termingeschäft anlegen(TX01). | Das Bild Kassa-/Termingeschäftserfassung: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Enter.  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 60B  Geschäftsart: z.B. 110  Partner: z.B. 10537001 | Das Bild Kassa-/Termingeschäftserfassung: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Vewaltung:  Kurs: Beispiel: EUR/BRL <Geben Sie einen geeigneten Kurs ein>  Kauf/Verkauf: z.B. K Kaufen  Geh.Betrag: z.B. BRL 50M  Valutadatum: ++6+2  Fixing-Datum: ++6  Abrechnungswährung:  Hinweis Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. | Die Registerkarte Verwaltung wird angezeigt. |  |
| 5 | Daten auf der Registerkarte „Verwaltung“ eingeben | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  SichKlassifiz.: z.B. Y0  Risikominderung <markieren>  Hinweis Markieren Sie das Ankreuzfeld Risikominderung, wenn dieses Geschäft für die Risikominderung vorgesehen ist. In diesem Fall geht das Geschäft nicht in die Berechnung für den Clearing-Schwellen-Report ein. | Das Geschäft wird gesichert, und eine Geschäftsnummer wird generiert.  Hinweis Wenn die Fehlermeldung Kein Währungspaar für die Währungen definiert angezeigt wird, pflegen Sie das Währungspaar in der SSCUI-App Leitwährung definieren finden Sie unter Treasury and Risk Management > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. |  |

### (BFB) Grundlegende Kassenvorgänge

Einsatzmöglichkeiten

Nachdem das Geschäft (im Status Vertrag) angelegt wurde und bevor die Zahlung ausgeführt wird, werden die künftigen Cashflows in den Liquiditätsvorschauberichten abgebildet. Wenn in Ihrem System das elementare Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) analysieren.

Hinweis Dieser Schritt kann während des gesamten Lebenszyklus des Treasury-Geschäfts ausgeführt werden. Die Ergebnisse in den Liquiditätsvorschauberichten variieren je nach der Bearbeitungsphase des Geschäfts (z.B. vor dem Anlegen, nach dem Anlegen, nach Buchung der Zahlung).

Vorgehensweise

Wenn in Ihrem System das elementare Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) auf Änderungen analysieren. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Grundlegende Kassenvorgänge (BFB).

Die finanzrelevanten Cashflows werden auf den finanzspezifischen Planungsebenen abgebildet. Beispiel:

* MM – Geldhandelgeschäfte
* NM – Geldhandelgeschäfte (Bank unbekannt)
* FX – Devisengeschäfte
* FO – Devisenoptionen
* NF – Devisengeschäfte (Bank unbekannt)
* DR – Derivatgeschäfte
* ND – Derivatgeschäfte (Bank unbekannt)

### (J78) Erweiterte Kassenvorgänge

Einsatzmöglichkeiten

Nachdem das Geschäft (im Status Vertrag) angelegt wurde und bevor die Zahlung ausgeführt wird, werden die künftigen Cashflows in den Liquiditätsvorschauberichten abgebildet. Wenn in Ihrem System Basic Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) oder Finanzstrompositionen prüfen(F0735) analysieren.

Hinweis Dieser Schritt kann während des gesamten Lebenszyklus des Treasury-Geschäfts ausgeführt werden. Die Ergebnisse in den Liquiditätsvorschauberichten variieren je nach der Bearbeitungsphase des Geschäfts (z.B. vor dem Anlegen, nach dem Anlegen, nach Buchung der Zahlung).

Vorgehensweise

Ist das vollständige Cash Management in Ihrem System implementiert, können Sie die Liquiditätsvorschau mit den Apps Cashflow-Analyse oder Finanzstrompositionen prüfen(F0735)auf Änderungen prüfen. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Erweiterte Kassenvorgänge (J78).

Die finanzrelevanten Cashflows werden auf den finanzspezifischen Planungsebenen abgebildet. Beispiel:

* MM – Geldhandelgeschäfte
* NM – Geldhandelgeschäfte (Bank unbekannt)
* FX – Devisengeschäfte
* FO – Devisenoptionen
* NF – Devisengeschäfte (Bank unbekannt)
* DR – Derivatgeschäfte
* ND – Derivatgeschäfte (Bank unbekannt)

Außerdem können Sie bei Apps für das vollständige Cash Management auch finanzspezifische Cash Flows auswählen, indem Sie nach Wahrscheinlichkeitsstufen filtern:

* TRM\_D – Finanzinstrument
* TRM\_O – Optionales Finanzinstrument

### Korrespondenz

Einsatzmöglichkeiten

Sie können die Transaktionsinformationen mit Ihrem Partner über die Korrespondenzfunktion kommunizieren, z.B. mit einem Druckformular per E-Mail.

#### Abrechnungsstatus setzen (manuell)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Nachdem Sie ein TRM-Geschäft in SAP erfasst und gesichert haben, müssen Sie das Geschäft abrechnen, bevor Sie weitere Aktivitäten ausführen können. Es gibt zwei Möglichkeiten, das Geschäft abzurechnen, nachdem Sie die Kontrahentenbestätigung erhalten haben:

* Manuelle Abrechnung

Beispiel: Sie erhalten die Kontrahentenbestätigung per E-Mail und rechnen dann das Geschäft mit einer der folgenden Apps manuell ab:

* + Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06)
  + OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91)
* Automatische Abrechnung über Korrespondenzprozess

Beispiel: Wenn für ein Geschäft alle ausgehenden und eingehenden Korrespondenzobjekte abgeglichen wurden und den Status "Abgeschlossen" erhalten haben, wird für die Finanzgeschäfte automatisch der Abrechnungsstatus gesetzt.

In dieser Aktivität rechnen Sie das TRM-Geschäft manuell ab.

Voraussetzungen

Im vorherigen Schritt wurde erfolgreich ein TRM-Geschäft angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummer> | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 4 | TRM-Geschäft abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang der Geschäftszeile, und wählen Sie Abrechnen. | Das Bild Devisengeschäft abrechnen: Struktur wird mit den Geschäftsdaten angezeigt. |  |
| 5 | Änderung sichern | Wählen Sie Sichern. | Das Geschäft wird abgerechnet und gesichert. Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 6 | Status des TRM-Geschäft | Markieren Sie das Ankreuzfeld, und wählen Sie Anzeigen. | Das Bild Devisengeschäft anzeigen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 7 | Status prüfen | Wählen Sie ... > Status.  Das Feld Vorgangstyp sollte den Status Vertragsabrechnung aufweisen. | Das Geschäft hat den Status Vertragsabrechnung. |  |

#### Korrespondenz über PDF-Formular

Einsatzmöglichkeiten

E-Mails/Ausdrucke werden als PDF-Formular ausgegeben. Standardmäßig stellt SAP mehrere Geschäftsprofile für PDF-Formulare bereit, z.B. PR\_PRINT und PR\_EMAIL.

* Bei Geschäftspartnern mit der Zuordnung PR\_PRINT wird bei Anlegen eines Finanzgeschäfts ein PDF-Formular an die vorher festgelegte Druckwarteschlagen gesendet. Sie können die PDF-Datei über die App Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) prüfen und drucken. Nachdem Sie geprüft und bestätigt haben, dass die Transaktionsinformationen auf dem Formular korrekt sind, senden Sie die Papierversion des Formulars an den Geschäftspartner.
* Bei Geschäftspartnern mit der Profilzuordnung PR\_EMAIL sendet SAP nach dem Anlegen eines Finanzgeschäfts automatisch E-Mails an den Geschäftspartner.

Nachdem Sie die Bestätigung zum Geschäft von Ihrem Geschäftspartner erhalten haben, können Sie alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts abrechnen. Sobald alle Korrespondenzobjekte abgerechnet wurden, ändert sich der Status des Geschäfts in Vertragsabrechnung.

In diesem Schritt rechnen Sie das TRM-Geschäft automatisch über die Korrespondenzverarbeitung ab.

Voraussetzungen

Sie haben ein TRM-Geschäft angelegt, das noch nicht abgerechnet wurde.

##### Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden

Zweck

SAP stellt die Geschäftspartnergruppe BPG\_DEFAULT bereit. Wenn ein Geschäftspartner dieser Gruppe zugeordnet ist, werden die Korrespondenzobjekte standardmäßig automatisch gesendet, wenn ein Finanzgeschäft gesichert wird. Wie in den vorbereitenden Schritten beschrieben, ist der Geschäftspartner 10537001 der Gruppe BPG\_DEFAULT zugeordnet, sodass die Korrespondenzobjekte automatisch gesendet werden. Wenn Sie eine neue Geschäftspartnergruppe jedoch über das Customizing der anlegen, und nicht das Attribut für automatisches Senden zuweisen, müssen Sie die entsprechenden Korrespondenzobjekte ggf. mit der App Korrespondenz senden(FTR\_COSEND) manuell senden.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

##### Korrespondenzstatus prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt prüfen Sie den Status der Korrespondenzobjekte eines Geschäfts.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Korrespondenzstatus prüfen | Alle Korrespondenzobjekte werden angezeigt. In der Spalte Status:  Hinweis Ein Finanzgeschäft kann in Abhängigkeit von der Zuordnung der GP-Profile und GP-Gruppen ein oder mehrere Korrespondenzobjekte haben.   * Wenn der Kanal "E-Mail" lautet, bedeutet der Status Gesendet, dass das System versucht hat, eine E-Mail an die in den Geschäftspartner-Stammdaten gepflegte E-Mail-Adresse zu senden. Allerdings können Sie diese E-Mail-Adresse auch überschreiben, indem Sie in der App Ausgabeparameterfindung eine E-Mail-Empfänger-Regel pflegen. Mit der App E-Mail-Versand anzeigen(F1259) können Sie den tatsächlichen E-Mail-Status prüfen. * Wenn der Kanal "Druck" lautet, wird das Formular an die Druckwarteschlange gesendet. Sie können das Formular mit der App Druckwarteschlangen pflegen(F1260) ausdrucken. * Sie können mit der App E-Mail-Vorlagen pflegen Ihre eigenen E-Mail-Vorlagen pflegen. * Sie können mit der App Formularvorlagen pflegen Ihre eigenen Formularvorlagen pflegen. | Die Korrespondenzobjekte haben den Status Gesendet. |  |
| 5 | Geschäftsdetails anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Underlying anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal E-MAIL  Wählen Sie Zurück. | Die Geschäftsdetails werden angezeigt.  Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 6 | Formular zum Korrespondenzobjekt anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Meldung anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal: E-MAIL  In einem Dialogfenster wird ein Formular angezeigt. Wählen Sie Weiter. | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |  |

Prüfen Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Status für beide Legs.

##### Eingehende Bestätigung erhalten

Zweck

Im vorherigen Schritt wurde für den E-Mail-Kanal eine ausgehende E-Mail an den Geschäftspartner gesendet. Normalerweise erhalten Sie eine Kontrahentenbestätigung vom Geschäftspartner per E-Mail, Telefon oder über andere Kanäle. Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

##### Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Sie haben im vorherigen Verfahren die Kontrahentenbestätigung erhalten. In diesem Verfahren legen Sie ein Eingangskorrespondenzobjekt an und gleichen es mit allen ausgehenden Korrespondenzobjekten ab.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Die Sicht Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien in der Einstiegssicht eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Gruppe Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Gruppe Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer>  Hinweis Notieren Sie den Korrespondenzschlüssel für ein KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekt. | Notieren Sie sich die Nummern der Korrespondenzschlüssel für KONTRAHENT DRUCKEN und KONTRAHENT E-MAIL. |  |
| 4 | Anlegen | Wählen Sie Anlegen. | Die Sicht Optionen beim Anlegen von Korrespondenzobjekten wird angezeigt. |  |
| 5 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit Verweis auf ausgehendes Korrespondenzobjekt anlegen | Geben Sie folgende Daten in die Gruppen ein, und wählen Sie Enter:  Gruppe Anzeigeoptionen:  Korrespondenztyp Kategorie: 01 Geschäftsaktivitäten  Gruppe Geschäftsdetails:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. <die im Geschäft angegebene Produktart>  Ein-/Ausgehend: I (Eingehende)  Erfassungsoptionen: 05 Korrespondenzobjekt als Vorlage  Gruppe Vorlage für Korrespondenzobjektdaten:  Korrespondenzschlüssel: z.B <Geben Sie die Nummer des Korrespondenzschlüssels für "KONTRAHENT DRUCKEN" aus dem vorherigen Schritt ein.> |  |  |
| 6 | Sichern | Wählen Sie Sichern.  Hinweis Wenn die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag angezeigt wird, wählen Sie Abbrechen. | Das eingehende Korrespondenzobjekt wird erfolgreich angelegt und in der Sicht Korrespondenzmonitor - Standardsicht angezeigt. |  |
| 7 | Eingehendes Korrespondenzobjekte mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal DRUCKEN abgleichen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Statusfunktionen > Automatischer Abgleich. | Die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag wird angezeigt. |  |
| 8 | Ausgehende Korrespondenz | Expandieren Sie links in der Sicht den eingehenden Korrespondenzschlüssel. Es werden alle ausgehenden Korrespondenzobjekte des Geschäfts angezeigt.  Markieren Sie alle Ankreuzfelder der ausgehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Enter. | Alle ausgehenden "KONTRAHENT DRUCKEN"-Korrespondenzobjekte des Geschäfts haben nun den Status Abgeschlossen.  Alle ausgehenden INTERNEN Korrespondenzobjekte verbleiben im Status Gesendet. |  |
| 9 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal E-MAIL abgleichen | Wiederholen Sie die oben genannten Schritte, um ein eingehendes Korrespondenzobjekt für KONTRAHENT E-MAIL anzulegen und mit der ausgehenden Korrespondenz für den Kanal E-MAIL abzugleichen. |  |  |

##### Abrechnungsstatus setzen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Im vorherigen Schritt wurden alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts erfolgreich abgeglichen. Im Rahmen der Standardfunktion wird das Geschäft automatisch abgerechnet.

In diesem Schritt prüfen Sie, ob das Geschäft automatisch abgerechnet wurde.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Vorgangshistorie anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Underlying anzeigen. | Das Bild Devisengeschäft anzeigen: Struktur wird angezeigt. In der zweiten Zeile wird Aktivität 2 Vertragsabrechnung angezeigt. |  |

### Periodenende wurde erreicht

#### Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt ermitteln Sie die Marktwerte (Barwerte) von Finanzgeschäften.

Der Barwert kann automatisch mit dem Market Risk Analyzer (MRA) berechnet werden. Er wird in der Tabelle VTVBAR gesichert. Diese Werte können dann für die buchhalterische Bewertung verwendet werden. Zusätzlich können Sie den relevanten Barwert manuell pflegen.

Die in der Komponente Market Risk Analyzer (MRA) vorab ausgelieferte Konfiguration bietet drei Möglichkeiten zur automatischen Barwertberechnung mit der App Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA)):

* Risikofreier Barwert: Mit der Auswertungsart ohne Basis-Spread-Kurve oder Credit-Spread-Kurve berechnet das System nur den risikofreien Barwert.
* Risikoberücksichtigender Barwert mit Credit-Spread-Kurve: Mit der Auswertungsart mit Credit-Spread-Kurve berechnet das System den risikofreien Barwert unter Verwendung der risikofreien Zinskurve sowie den (risikobasierten) Barwert unter Berücksichtigung der Credit Spreads.
* Risikoberücksichtigender Barwert mit Basis-Spread-Kurve und Credit-Spread-Kurve: Mit der Auswertungsart mit Basis-Spread-Kurve und Credit-Spread-Kurve berechnet das System den risikofreien Barwert unter Verwendung der risikofreien Zinskurve und der Basis-Spread-Kurve sowie den (risikobasierten) Barwert unter Berücksichtigung der Credit Spreads.

Es gibt zwei Berechnungsmethoden für CVA und DVA:

* Basierend auf erwarteten Exposures
* Differenzmethode

Die Formel für den Barwert lautet: Barwert = risikofreier Barwert - CVA - DVA.

Voraussetzungen

Stellen Sie vor der Barwertberechnung mit der App Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA) sicher, dass die relevanten Marktdaten (Zinssätze, Umrechnungskurse, Credit Spreads usw.) für das Auswertungsdatum gepflegt wurden. Weitere Informationen zur Pflege von Marktdaten finden Sie im Testskript Market Rates Management – manuell per Upload (1XN).

Wenn Sie die Parmethode zur Barwertberechnung für Ihre Devisentermingeschäfte verwenden möchten, aktualisieren Sie vorab die relevante Auswertungsart über die die Devisenbewertungsmethode auf Währungsumrechnung vor Abzinsung. Die finden Sie unter SPRO > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Grundeinstellungen für Analyzer > Bewertung im Voraus.

Vorgehensweise

Option 1: Barwert automatisch berechnen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA). | Das Bild Barwerte inklusive Credit und Debit Value Adjustments ermitteln wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben und ausführen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Auswertungsparameterableitung: entmarkiert  OTC-Geschäft auswählen: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer aus den vorherigen Schritten>  Auswertungsdatum: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  CVD/DVA-Art: Lassen Sie zur Berechnung des risikofreien Barwerts dieses Feld leer. Geben Sie zur Berechnung von risikobasiertem Barwert und CVA/DVA den Wert Y01 ein.  Auswertungsart: Geben Sie zur Berechnung des risikofreien Barwerts den Wert Y001 ein. Geben Sie zur Berechnung von risikobasiertem Barwert und CVA/DVA den Wert Y002 ein.  Testlauf: entmarkiert  Kurs-/Barwertart: 001  Werte mit Warnungen sichern: markiert  Detailprotokoll (and. BerSchritte):markiert | Das Bild Barwerte inkl. CVA/DVA aus dem Market Risk Analyzer wird angezeigt. Sie sehen dort zu jedem Geschäft den Barwert, risikofreien Barwert, CVA und DVA.  Über die folgenden Drucktasten können Sie weitere Informationen prüfen:   * Einzelgeschäft: * CVA/DVA-Kennzahlen * Detailprotokoll * Berechnungsgrundlagen * Fehlerprotokoll |  |

Option 2: Barwert manuell pflegen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad mit der Rolle Treasury-Spezialist - Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Barwerte eingeben(JBNPV). | Das Bild Barwerte eingeben(JBNPV)wird angezeigt. Das Dialogfenster Feldauswahl wird angezeigt. |  |
| 3 | Feldauswahl | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: markiert  Geschäft: markiert | Das Dialogfenster Arbeitsbereich festlegen: Eingabe wird angezeigt. |  |
| 4 | Feldauswahl | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummern> | Das Bild Sicht "Barwerte von OTC-Geschäften" anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
|  |  | Wählen Sie Bearbeiten | Die Sicht Sicht "Barwerte von OTC-Geschäften" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 5 | Barwert eingeben | Wählen Sie Neue Einträge.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Inhalts- art: z.B. Geldhandel  BuKr: z.B. 1010  Geschäft: <im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummern>  Kurs-/Barwertart: 001  Gültig ab: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  Barwert: <Wert des (risikobasierten) Barwerts>  Währung: z.B. EUR  Risikofreier Barwert: <Wert des risikofreien Barwerts>  CVA: <Wert des CVA>  DVA: <Wert des DVA>  Hinweis Um den Credit Spread für die buchhalterische Bewertung abzubilden, pflegen Sie den risikobasierten Barwert im Feld Barwert, und geben Sie dann das CVA/DVA ein, das die Differenz zwischen risikofreiem Barwert und risikobasiertem Barwert ist. Barwert = risikofreier Barwert – CVA – DVA. Geben Sie ansonsten den Wert des risikofreien Barwerts im Feld Barwert ein, und lassen Sie die Felder CVA und DVA leer. | Der manuell gepflegte Barwert wird gesichert. |  |

#### Stichtagsbewertung durchführen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit der Bewertungsfunktion bewerten Sie die Positionen der Finanzinstrumente, die auf den historischen Kosten oder dem Marktwert zu einem bestimmten Stichtag basieren, und die Ergebnisse werden in die Finanzbuchhaltung übertragen.

Voraussetzungen

Es wurden Marktwerte (NPV) für Finanzgeschäfte berechnet oder gepflegt, deren Bewertung als Marktwerte (NPV) gemäß den Rechnungslegungsvorschriften erfolgt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Buchhalter am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewertung ausführen(TPM1). | Das Bild Bewertung durchführen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Im Bereich Produktgruppen  OTC-Geschäfte: <markieren Sie dieses Ankreuzfeld>  Im Bereich Allgemeine Abgrenzungen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  Geschäft: <In vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  Im Bereich Bewertungsparameter:  Stichtag der Bewertung: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  Bewertungstyp: z.B. unterjährige Bewertung mit Rücknahme  Hinweis Wenn das Periodenende dem Jahresende entspricht, verwenden Sie den Bewertungstyp Jahresabschlussbewertung.  Testlauf: <markiert> | Das Bild Für Bewertung ausgewählte Treasury-Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 4 | Bewertung für Testlauf durchführen | Wählen Sie Bewertung durchführen.  Wenn ein Dialogfenster mit einer Meldung angezeigt wird, wählen Sie Weiter. | Das Bild Bewertungsprotokoll wird angezeigt. Sollte eine rote Ampel angezeigt werden, klicken Sie darauf, um die Fehlermeldung zu prüfen. Beheben Sie den Fehler, und führen Sie einen weiteren Testlauf aus, bis kein Fehler mehr auftritt.  Sie können die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) prüfen, indem Sie Protokolle + Nachrichten wählen. Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt.  Hinweis Es kann vorkommen, dass keine simulierte Buchung vorhanden ist, da für das von Ihnen ausgewählte Geschäft keine Bewertung erforderlich ist. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis das Bild Bewertung durchführen angezeigt wird.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: <entmarkieren> | Das Bild Für Bewertung ausgewählte Treasury-Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 6 | Bewertung für Echtlauf durchführen | Wählen Sie Bewertung durchführen. | Das Bild Bewertungsprotokoll wird angezeigt. Prüfen Sie die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0), indem Sie Protokolle + Nachrichten wählen. Der Buchhaltungsbeleg wird in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |

### Geschäft ist fällig

Zweck

Dieser Abschnitt beschreibt die bei Fälligkeit eines Geschäfts erforderlichen Vorgänge (z.B. Fixing eines NDF-Geschäfts oder Zahlung).

#### Für NDF

Zweck

Für Non-Deliverable Forwards (NDFs) ist ein Fixing-Kurs erforderlich.

##### Kurs für NDF festlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie den Kurs für ein NDF-Geschäft fest.

Voraussetzungen

Es ist ein NDF-Geschäft mit baldiger Fälligkeit vorhanden.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Feste Umrechnungskurse(TXV5). | Das Bild Fixinggeschäft ausführen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Enter.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des fälligen Geschäfts> | Das Bild Fixinggeschäft ausführen: Struktur wird angezeigt.  Der Abrechnungskurs wird automatisch aus der Währungstabelle vorgeschlagen. |  |
| 4 | Daten prüfen und sichern | Überprüfen Sie den Abschnitt Abrechnung. Wählen Sie anschließend Sichern. | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

##### Korrespondenz

Einsatzmöglichkeiten

Sie können Ihrem Partner die Transaktionsinformationen über die Korrespondenzfunktion mitteilen, z.B. mit einem Druckformular per E-Mail.

###### Abrechnungsstatus setzen (manuell)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Verwendungszweck

Nachdem Sie ein TRM-Geschäft in SAP erfasst und gesichert haben, müssen Sie das Geschäft abrechnen, bevor Sie weitere Aktivitäten ausführen können. Es gibt zwei Möglichkeiten, das Geschäft abzurechnen, nachdem Sie die Kontrahentenbestätigung erhalten haben:

* Manuelle Abrechnung

Beispiel: Sie erhalten die Kontrahentenbestätigung per E-Mail und rechnen dann das Geschäft mit einer der folgenden Apps manuell ab:

* + Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten (Untertitel: Sammelbearbeitung)
  + Devisenoptionen bearbeiten (Untertitel: Sammelbearbeitung)
* Automatische Abrechnung über Korrespondenzprozess

Beispiel: Wenn für ein Geschäft alle ausgehenden und eingehenden Korrespondenzobjekte abgeglichen wurden und den Status "Abgeschlossen" erhalten haben, wird für die Finanzgeschäfte automatisch der Abrechnungsstatus gesetzt.

In dieser Aktivität rechnen Sie das TRM-Geschäft manuell ab.

Voraussetzungen

Im vorherigen Schritt wurde erfolgreich ein TRM-Geschäft angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummer> | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 4 | TRM-Geschäft abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang der Geschäftszeile, und wählen Sie Abrechnen. | Die Sicht Devisengeschäft abrechnen: Struktur wird mit den Geschäftsdaten angezeigt. |  |
| 5 | Änderung sichern | Wählen Sie Sichern. | Das Geschäft wird abgerechnet und gesichert. Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 6 | Status des TRM-Geschäft | Markieren Sie das Ankreuzfeld, und wählen Sie Anzeigen. | Das Bild Devisengeschäft anzeigen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 7 | Status | Wählen Sie ... > Status.  Das Feld Vorgangstyp sollte den Status Fixing-Abrechnung aufweisen. | Das Geschäft hat den Status Fixing-Abrechnung. |  |

###### Korrespondenz über PDF-Formular

Einsatzmöglichkeiten

E-Mails/Ausdrucke werden als PDF-Formular ausgegeben. Standardmäßig stellt SAP mehrere Geschäftsprofile für PDF-Formulare bereit, z.B. PR\_PRINT und PR\_EMAIL.

* Bei Geschäftspartnern mit der Zuordnung PR\_PRINT wird bei Anlegen eines Finanzgeschäfts ein PDF-Formular an die vorher festgelegte Druckwarteschlagen gesendet. Sie können die PDF-Datei über die App Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) prüfen und drucken. Nachdem Sie geprüft und bestätigt haben, dass die Transaktionsinformationen auf dem Formular korrekt sind, senden Sie die Papierversion des Formulars an den Geschäftspartner.
* Bei Geschäftspartnern mit der Profilzuordnung PR\_EMAIL sendet SAP nach dem Anlegen eines Finanzgeschäfts automatisch E-Mails an den Geschäftspartner.

Nachdem Sie die Bestätigung zum Geschäft von Ihrem Geschäftspartner erhalten haben, können Sie alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts abrechnen. Sobald alle Korrespondenzobjekte abgerechnet wurden, ändert sich der Status des Geschäfts in Vertragsabrechnung.

In diesem Schritt rechnen Sie das TRM-Geschäft automatisch über die Korrespondenzverarbeitung ab.

Voraussetzungen

Sie haben ein TRM-Geschäft angelegt, das noch nicht abgerechnet wurde.

###### Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden

Zweck

SAP stellt die Geschäftspartnergruppe BPG\_DEFAULT bereit. Wenn ein Geschäftspartner dieser Gruppe zugeordnet ist, werden die Korrespondenzobjekte standardmäßig automatisch gesendet, wenn ein Finanzgeschäft gesichert wird. Wie im Abschnitt Vorbereitende Schritte dieses Dokuments beschrieben, ist der Geschäftspartner 10537001 der Gruppe BPG\_DEFAULT zugeordnet, sodass die Korrespondenzobjekte automatisch gesendet werden. Wenn Sie eine neue Geschäftspartnergruppe jedoch per IMG anlegen, und nicht das Attribut für automatisches Senden zuweisen, müssen Sie die entsprechenden Korrespondenzobjekte ggf. mit der App Korrespondenz senden manuell senden.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

###### Korrespondenzstatus prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt prüfen Sie den Status der Korrespondenzobjekte eines Geschäfts.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Korrespondenzstatus prüfen | Alle Korrespondenzobjekte werden angezeigt. In der Spalte Status:  Hinweis Ein Finanzgeschäft kann in Abhängigkeit von der Zuordnung der GP-Profile und GP-Gruppen ein oder mehrere Korrespondenzobjekte haben.   * Wenn der Kanal "E-Mail" lautet, bedeutet der Status Gesendet, dass das System versucht hat, eine E-Mail an die in den Geschäftspartner-Stammdaten gepflegte E-Mail-Adresse zu senden. Allerdings können Sie diese E-Mail-Adresse auch überschreiben, indem Sie in der App Ausgabeparameterfindung eine E-Mail-Empfänger-Regel pflegen. Mit der App E-Mail-Versand anzeigen(F1259) können Sie den tatsächlichen E-Mail-Status prüfen. * Wenn der Kanal "Druck" lautet, wird das Formular an die Druckwarteschlange gesendet. Sie können das Formular mit der App Druckwarteschlangen pflegen(F1260) ausdrucken. * Sie können mit der App E-Mail-Vorlagen pflegen Ihre eigenen E-Mail-Vorlagen pflegen. * Sie können mit der App Formularvorlagen pflegen Ihre eigenen Formularvorlagen pflegen. | Die Korrespondenzobjekte haben den Status Gesendet. |  |
| 5 | Geschäftsdetails anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Underlying anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal E-MAIL  Wählen Sie Zurück. | Die Geschäftsdetails werden angezeigt.  Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 6 | Formular zum Korrespondenzobjekt anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Meldung anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal: E-MAIL  In einem Dialogfenster wird ein Formular angezeigt. Wählen Sie Weiter. | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |  |

Prüfen Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Status für beide Legs.

###### Eingehende Bestätigung erhalten

Zweck

Im vorherigen Schritt wurde für den E-Mail-Kanal eine ausgehende E-Mail an den Geschäftspartner gesendet. Normalerweise erhalten Sie eine Kontrahentenbestätigung vom Geschäftspartner per E-Mail, Telefon oder über andere Kanäle. Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

###### Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Sie haben im vorherigen Verfahren die Kontrahentenbestätigung erhalten. In diesem Verfahren legen Sie ein Eingangskorrespondenzobjekt an und gleichen es mit allen ausgehenden Korrespondenzobjekten ab.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Die Sicht Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien in der Einstiegssicht eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Gruppe Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Gruppe Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer>  Hinweis Notieren Sie den Korrespondenzschlüssel für ein KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekt. | Notieren Sie sich die Nummern der Korrespondenzschlüssel für KONTRAHENT DRUCKEN und KONTRAHENT E-MAIL. |  |
| 4 | Anlegen | Wählen Sie Anlegen. | Die Sicht Optionen beim Anlegen von Korrespondenzobjekten wird angezeigt. |  |
| 5 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit Verweis auf ausgehendes Korrespondenzobjekt anlegen | Geben Sie folgende Daten in die Gruppen ein, und wählen Sie Enter:  Gruppe Anzeigeoptionen:  Korrespondenztyp Kategorie: 01 Geschäftsaktivitäten  Gruppe Geschäftsdetails:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. <die im Geschäft angegebene Produktart>  Ein-/Ausgehend: I (Eingehende)  Erfassungsoptionen: 05 Korrespondenzobjekt als Vorlage  Gruppe Vorlage für Korrespondenzobjektdaten:  Korrespondenzschlüssel: z.B <Geben Sie die Nummer des Korrespondenzschlüssels für "KONTRAHENT DRUCKEN" aus dem vorherigen Schritt ein.> |  |  |
| 6 | Sichern | Wählen Sie Sichern.  Hinweis Wenn die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag angezeigt wird, wählen Sie Abbrechen. | Das eingehende Korrespondenzobjekt wird erfolgreich angelegt und in der Sicht Korrespondenzmonitor - Standardsicht angezeigt. |  |
| 7 | Eingehendes Korrespondenzobjekte mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal DRUCKEN abgleichen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Statusfunktionen > Automatischer Abgleich. | Die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag wird angezeigt. |  |
| 8 | Ausgehende Korrespondenz | Expandieren Sie links in der Sicht den eingehenden Korrespondenzschlüssel. Es werden alle ausgehenden Korrespondenzobjekte des Geschäfts angezeigt.  Markieren Sie alle Ankreuzfelder der ausgehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Enter. | Alle ausgehenden "KONTRAHENT DRUCKEN"-Korrespondenzobjekte des Geschäfts haben nun den Status Abgeschlossen.  Alle ausgehenden INTERNEN Korrespondenzobjekte verbleiben im Status Gesendet. |  |
| 9 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal E-MAIL abgleichen | Wiederholen Sie die oben genannten Schritte, um ein eingehendes Korrespondenzobjekt für KONTRAHENT E-MAIL anzulegen und mit der ausgehenden Korrespondenz für den Kanal E-MAIL abzugleichen. |  |  |

###### Abrechnungsstatus setzen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Im vorherigen Schritt wurden alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts erfolgreich abgeglichen. Im Rahmen der Standardfunktion wird das Geschäft automatisch abgerechnet.

In diesem Schritt prüfen Sie nur, ob das Geschäft automatisch abgerechnet wurde.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Vorgangshistorie anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Underlying anzeigen. | Das Bild OTC-Option anzeigen: Ausstattung wird angezeigt. In der zweiten Zeile wird Aktivität 2 Vertragsabrechnung angezeigt. |  |

Überprüfen Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Abrechnungsstatus für beide Legs.

#### Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Jedes Finanzgeschäft enthält Bewegungen, die bezahlt werden müssen. Beim Erstellen des Geschäfts kann die Zahlungsanordnung nach Wunsch ausgewählt werden (in der Praxis üblicherweise nur für Zahlungsausgänge möglich). Das Treasury-Backoffice verwendet die Funktion Nur zhl. in der App Bewegungen buchen(TBB1), um eine Zahlungsanordnung für Abgänge zu erstellen, die eine Zahlungsanordnung erfordern. Eine Buchung in der Finanzbuchhaltung wird nicht angelegt.

Wenn der Finanzpartner die Zahlung initiiert, überspringen Sie dieses Verfahren und das folgende Verfahren Zahlungsanforderung verarbeiten, und fahren Sie mit dem Verfahren Von Bank initiierte Zahlung fort.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Devisen: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer mit Abgängen, die Sie in den vorherigen Schritten angelegt haben>  Bis einschließlich Fälligkeit: Geben Sie das Datum ein, an dem die Bewegung des Finanzgeschäfts gebucht werden soll, z.B. <Tagesdatum>.  Testlauf: markiert  Nur zhl.: markiert | Die Sicht Zahlungsprotokoll - Testlauf wird angezeigt. Überprüfen Sie die Zahlungsinformationen in dieser Sicht.  Wenn die Meldung Es sind keine Bewegungen zur Bearbeitung vorhanden angezeigt wird, ist keine Zahlung mit Zahlungsanordnung für Ihre Selektionskriterien erforderlich. Fahren Sie mit dem nachfolgenden Verfahren In Hauptbuch buchen fort. |  |
| 4 | Zurück | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 5 | Echtlauf | Nehmen Sie die folgende Änderung vor:  Testlauf: entmarkiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Zahlungsprotokoll wird angezeigt. Eine Zahlungsanforderung wird erzeugt.  Notieren Sie die Schlüsselnummer: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

#### Zahlungsanordnung verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit dieser App starten Sie das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen. Das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen stellt eine zusätzliche Möglichkeit für die maschinelle Zahlung im SAP-System dar. Im Gegensatz zum Standardzahlprogramm basieren die Zahlungen nicht auf offenen Posten (Kreditoren- bzw. Debitorenposten), sondern auf Zahlungsanordnungen.

Voraussetzungen

Im vorherigen Schritt wurde eine Zahlungsanordnung erzeugt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111). | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111)wird angezeigt. |  |
| 3 | Datum der Ausführung und Identifikation eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Parameter:  Datum der Ausführung: z.B. <Tagesdatum>  Identifikation: z.B. TRM01 | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 4 | Parameter eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Freie Abgrenzungen:  Buchungsdatum: z.B. <Tagesdatum>  Nächster Zahllauf am: z.B. <aktuelles Datum + 3 Tage>  Buchungskreis: z.B. 1010  Zahlwege: z.B. TF | Das Dialogfenster Freie Selektion für Zahllauf wird angezeigt. |  |
| 5 | Schlüsselnummer | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Schlüsselnummer: <Schlüsselnummer, die Sie im vorherigen Schritt notiert haben> | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 6 | Zusatzprotokoll | Wählen Sie Zusatzprotokoll. | Das Dialogfenster Zusatzprotokoll wird angezeigt. |  |
| 7 | Parameter eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Zahlwegauswahl in allen Fällen: markiert  Positionen der Zahlungsbelege: markiert  Prüfung der Fälligkeit: markiert  Wenn die Meldung Das Protokoll wird für alle Konten erstellt angezeigt wird, wählen Sie Weiter.  Wählen Sie Sichern auf dem Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter. | Auf dem Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen wird die Meldung Parameter wurden erfasst angezeigt. |  |
| 8 | Vorschlag einplanen | Wählen Sie Vorschlag. | Das Dialogfenster Vorschlag einplanen wird angezeigt. |  |
| 9 | Job einplanen | Wählen Sie Start sofort und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Vorschlag läuft mit einem gelben Ampelsymbol wird angezeigt. |  |
| 10 | Status aktualisieren | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungsvorschlag wurde erstellt mit einem grünen Ampelsymbol in der Statusleiste angezeigt wird. | Der Zahlungsvorschlag wird erzeugt. |  |
| 11 | Zahlung einplanen | Wählen Sie Zahllauf. | Das Dialogfenster Zahlung einplanen wird angezeigt. |  |
| 12 | Job einplanen | Wählen Sie Start sofort, Zahlungsträger erstellen und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Zahlungslauf läuft mit einem gelben Ampelsymbol wird in der Statusleiste angezeigt. |  |
| 13 | Status aktualisieren | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungslauf wurde ausgeführt mit einem grünen Ampelsymbol angezeigt wird. | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) wird angezeigt.  Der Zahlungsbeleg wird angelegt.  Wenn Bank Communication Management (BCM) nicht in Ihrem System implementiert ist, wird der Zahlungsträger angelegt, sofern dieser das PMW-Format verwendet. Sie können das Protokoll überprüfen, indem Sie auf Zahlungsprotokoll anzeigen doppelklicken.  Wenn BCM in Ihrem System implementiert ist, wird in Zahlungsprotokoll anzeigen die Meldung Zahllauf XX/XX/20XX TRM01R ist für zahllaufübergreifende Zahlungsträger vorgesehen angezeigt. Nach dem Zahllauf wird ein BCM-Batch angelegt. Weitere Informationen erhalten Sie im nächsten Testschritt. |  |
| 14 | Zahllaufübergreifender Zahlungsträger (BCM-Batch anlegen) | Wählen Sie Mehr > Umfeld > Zahlungsträger > Zahllaufübergreifende Zahlungsträger > Zahlungsträger erstellen. | Das Bild Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird angezeigt. |  |
| 15 | Daten eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Datum der Ausführung: z.B. <Tagesdatum>  Identifikation: z.B. TRM01R | Im Dialogfenster Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird die Meldung Sammler XX/XX/20XX XXXXXX wurde angelegt oder aktualisiert angezeigt. Der BCM-Batch wurde angelegt.  Für einen Batch sind ggf. weitere Genehmigungen erforderlich, bevor schließlich der Zahlungsträger angelegt wird. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Erweiterte Kassenvorgänge(J78). |  |

#### Von Bank initiierte Zahlung

Zweck

Wenn die Ausgangszahlung von der Bank initiiert wird, ist es nicht notwendig, die vorherigen Schritte [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 und [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133 durchzuführen.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Schritte im SAP-System.

#### Im Hauptbuch buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit den Buchungsfunktionen werden die buchungsbezogenen Cashflows an die FI-Schnittstelle übertragen, die die relevanten Buchungen in der Finanzbuchhaltung erzeugt. Für die Buchung von Bewegungen stehen zwei SAP-Fiori-Apps zur Verfügung:

* Bewegungen buchen(TBB1): Diese SAP-Fiori-App unterstützt das Erzeugen von Buchungen für Eingangszahlung und Ausgangszahlung ohne Zahlungsanforderung. Sie können diese App nicht verwenden, um Buchungen für Ausgangszahlungen zu erzeugen, die Sie im vorherigen Schritt [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 über die Option Nur zahlen bearbeitet haben.
* Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10): Verwenden Sie diese SAP-Fiori-App, um Buchungen für Ausgangszahlungen zu erzeugen, die Sie im vorherigen Schritt [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 über die Option Nur zahlen bearbeitet haben.

Voraussetzungen

Mittels Zahlungsanforderung vorgenommene Ausgangszahlungen wurden im vorherigen Verfahren Zahlungsanforderung für fällige Transaktion erstellen mit der Option Nur Zahlen verarbeitet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein:  Devisen: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer mit dem Zugang, die in den vorherigen Schritten angelegt wurde, für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) ist es das kurze Leg>  Bis einschl. Fälligkeitsdatum: Geben Sie das Datum ein, an dem die Bewegung des Finanzgeschäfts gebucht werden soll, z.B. <Tagesdatum>.  Testlauf: markiert  Nur operativ buchen: markiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Überprüfen Sie auf dieser Sicht die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Hinweis Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt.  Wenn die Meldung Es sind keine Bewegungen zur Bearbeitung vorhanden angezeigt wird, ist keine Buchung für Ihre Selektionskriterien erforderlich.  Sie können die nächsten Schritte überspringen und mithilfe der App Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10) mit Schritt 6 fortfahren. |  |
| 4 | Zurück | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 5 | Echtlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Der Buchhaltungsbeleg wird für die Eingangszahlung in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |
| 6 | Andere SAP-Fiori-App aufrufen | Kehren Sie zum SAP Fiori Launchpad zurück, und öffnen Sie Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10). | Die Sicht Geschäfte fixieren, buchen oder stornieren wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  Abgrenzung über Geschäftsnummer: Entmarkieren Sie dieses Ankreuzfeld.  Abgrenzung über Nebenbuchbestände: markiert  Geschäft: <Geschäftsnummer mit Abgang und zugehöriger Zahlungsanordnung, die Sie in vorherigen Verfahren „Zahlungsanordnung erzeugen“ generiert haben, für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) ist es das lange Leg>  Testlauf: markiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Testlauf: Geschäftsvorfälle buchen/stornieren wird angezeigt.  Wenn die Meldung Es wurden keine Geschäftsvorfälle selektiert angezeigt wird, sind für Ihre Selektionskriterien keine Buchungen erforderlich. In diesem Fall können Sie diesen Schritt überspringen. |  |
| 8 | Testlaufergebnis prüfen | Wählen Sie Alle markieren.  Wählen Sie Zu buchende auswählen.  Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Testlauf: Anzeige gebuchte/stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. |  |
| 9 | Protokoll und Nachrichten | Wählen Sie Protokolle und Nachrichten. | Das Bild Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Überprüfen Sie auf dieser Sicht die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Hinweis Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 10 | Zurück | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Geschäfte fixieren, buchen oder stornieren wird angezeigt. |  |
| 11 | "Testlauf" entmarkieren | Nehmen Sie die folgende Änderung vor:  Testlauf: entmarkiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Echtlauf: Geschäftsvorfälle buchen/stornieren wird angezeigt. |  |
| 12 | Echtlauf | Wählen Sie Alle markieren.  Wählen Sie Zu buchende auswählen.  Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Echtlauf: Anzeige gebuchte/stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. |  |
| 13 | Protokoll und Nachrichten | Wählen Sie Protokolle und Nachrichten. | Das Bild Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Der Buchhaltungsbeleg wird für die Ausgangszahlung in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |

#### Realisierten Gewinn und Verlust buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Bereich fixieren und buchen Sie abgeleitete Geschäftsvorfälle (in der Regel realisierter Gewinn und Verlust bei fälligen Geschäften).

Voraussetzungen

Das Fälligkeitsdatum des Geschäfts ist erreicht.

Das Finanzgeschäft wurde angelegt, abgerechnet und gebucht.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Abgeleitete Geschäftsvorfälle buchen(TPM18). | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  OTC-Geschäfte: <Nummern der fälligen Geschäfte; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  TRL-Datum: <Fälligkeitsdatum des Geschäfts>  Testlauf: markiert  Bestätigen Sie die Meldung Sind Sie sicher, dass Sie zukünftige Geschäftsvorfälle auswählen möchten?, indem Sie Enter wählen. | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt.  Falls die Meldung Zur Selektion wurden keine geplanten abg. Geschäftsvorfälle gefunden angezeigt wird, ist für Ihre Selektion kein abgeleitetes Geschäft verfügbar. In diesem Fall können Sie diesen Schritt überspringen. |  |
| 4 | Für Testlauf fixieren und buchen | Wählen Sie Fixieren. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Sie sehen die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0). Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis Sie zum Einstiegsbild der App gelangen.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: Entmarkieren  Bestätigen Sie die Meldung Sind Sie sicher, dass Sie zukünftige Geschäftsvorfälle auswählen möchten?, indem Sie Enter wählen. | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt. |  |
| 6 | Für Echtlauf fixieren und buchen | Wählen Sie Fixieren. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Sie sehen die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0). In den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) wird ein Buchhaltungsbeleg angelegt. |  |

## Fremdwährungs-Risikomanagement und -Buchhaltung – Mit Optionen

Zweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie Sie Devisengeschäfte für Zwecke der Absicherung und für andere Zwecke anlegen. Weiterhin sind die nachfolgenden Schritte zur Abrechnung, Fixierung und Ausführung des Vertrages bis zum vollständigen Eingang oder Senden der Zahlung beschrieben. Die Devisengeschäfte sind fest und automatisch in Vorgänge für Barmittel, Hauptbuch und Korrespondenz integriert. Für die an den Devisenprozessen beteiligten Rollen werden Funktionen für tägliches Reporting bereitgestellt.

### (1XN) Market Rates Management – manuell per Upload

Verwendungszweck

In diesem Schritt erfahren Sie, wie Sie Marktdaten wie Fremdwährungstausch-Kassakurse, Swap-Sätze, Referenzzinssätze usw. erfassen.

Diese Daten liefern Standardwerte, wenn Sie neue Geschäfte anlegen oder den Marktwert bestehender Geschäfte berechnen.

Vorgehensweise

Weitere Informationen finden Sie im Testskript Market Rates Management – manuell per Upload (1XN).

### Limitinanspruchnahmen aufbauen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Am Ende des Geschäftstages kann der "Treasury-Spezialist - Middle-Office" die Tagesendeverarbeitung ausführen. Das System ermittelt und aktualisiert die Limitinanspruchnahmen auf der Grundlage der im Datenpool enthaltenen Geschäfte und Bestände sowie der erfassten externen Geschäfte.

Voraussetzung

Die Marktdaten wurden importiert.

Wenn ein Wertpapier besteht, muss der Spot-Preis für das aktuelle Datum eingegeben werden. Ausführliche Vorgehensweisen finden Sie im Abschnitt Wertpapierkurs aktualisieren von Market Rates Management – manuell per Upload(1XN).

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Tagesendeverarbeitung(KLNACHT). | Das Bild Tagesendeverarbeitung(KLNACHT) wird angezeigt. |  |
| 3 | Kriterien für die Tagesendeverarbeitung eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Bewertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Ermittlungsverfahren: z.B. <10 bis 20>  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Meldung Tagesendeverarbeitung erfolgreich durchgeführt wird angezeigt. |  |

### Liquiditätsvorschau analysieren

Einsatzmöglichkeiten

Der Cash-Manager prüft die Liquiditätsvorschau regelmäßig und trifft Entscheidungen zu mittelfristigen oder langfristigen Finanzinstrumenten, z.B. Investitionen, Darlehen oder Devisen.

Vorgehensweise

Wenn in Ihrem System Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) analysieren. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Grundlegende Kassenvorgänge(BFB).

### Bilanz-Exposure-Management

Zweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie Bilanz-Exposures überprüft werden.

#### Bilanzdevisenrisiko prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen Sie das Bilanzdevisenrisiko, um eine Übersicht über den Status der Bilanzdevisenrisiken zu erhalten.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieBilanzdevisenrisiko prüfen(F1588). | Das Bild Bilanzdevisenrisiko prüfen(F1588)wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Folgendes ein, und wählen Sie Starten:  Anzeigewährung: z.B. EUR  Wechselkurstyp: z.B. M  Stichtag: <aktuelles Datum> | Die Standard-Bereiche zeigen die Daten für alle Buchungskreise an. |  |
| 4 | Drilldown auf einen Buchungskreis | In der Spalte Buchungskreis wählen Sie 1010. | Die Liste Bilanz-Devisen-Nettoexposures enthält die Elemente, die unter Kennzahlen für Bilanzdevisenrisiko definieren festgelegt wurden. |  |

#### Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität erstellen Sie ein Snapshot für das Bilanzdevisenrisiko zum Stichtag.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshot erstellen - Bilanzdivisenrisiko(FXM\_SNAP). | Das Bild Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeinen Informationen für die Erstellung eines Snapshots eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Im Bereich Allgemein  Snapshot-Beschreibung: z.B.: Snapshot-Bilanzdevisenrisiko verwenden  Status: Angelegt  Stichtagsdefinition: Festgelegtes Datum  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Berichtswährung: EUR  Kurstyp: M  Im Bereich Filter:  Buchungskreis: 1010  Währung: <Risikowährung, z.B. USD für DE>  Im Bereich Zeitraster:  Periodendefinition: z.B. <markieren>  Startdatum: z.B. <erster Tag des aktuellen Jahres>  Enddatum: z.B. <letzter Tag des aktuellen Jahres>  Schrittweite: z.B. 1  Einheit: z.B. Monat  Testlauf: <entmarkieren> | Das Bild Snapshot-Details wird angezeigt.  Notieren Sie sich die Snapshot-ID für die Folgeschritte. |  |

#### Snapshot-Position prüfen und verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen und bearbeiten Sie die Snapshot-Position für das Bilanzdevisenrisiko.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763). | Das Bild Snapshot des Bilanzdevisenrisikos verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Snapshot-Position prüfen | Geben Sie die Snapshot-ID ein, die Sie im Feld Snapshot-ID notiert haben, und wählen Sie Starten.  Wählen Sie > am Ende der Zeile für den soeben eingeplanten Job.  Wählen Sie im Bild Snapshot am Ende der Zeile für die Snapshot-Position das Pfeilsymbol >, um die Details zu überprüfen.  Prüfen Sie die Snapshot-Position. | Das Bild Snapshot-Position wird angezeigt. |  |
| 4 | Neue Snapshot-Position anlegen (optional) | Wählen Sie "Zurück", um zum Bild Snapshot zurückzukehren.  Wählen Sie Anlegen.  Geben Sie im Bild Neue Snapshot-Position folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Buchungskreis: 1010  Betrag: z.B. 1.000.000 <Risikowährung, z.B. USD für DE>  Periodenbeginn: z.B. <erster Tag des aktuellen Monats>  Periodenende: z.B. <letzter Tag des aktuellen Monats> | Eine Snapshot-Position wird mit dem Kennzeichen Manuell angelegt. |  |
| 5 | Snapshot-Position bearbeiten (optional) | Wählen Sie Bearbeiten, ändern Sie die Daten, ändern Sie z.B. den Betrag auf 2.000.000 und wählen Sie Sichern. | Ihre Änderungen wurden gesichert. |  |

#### Snapshot freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität geben Sie den aktualisierten Snapshot für das Bilanzdevisenrisiko frei.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Snapshots verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4763). | Das Bild Snapshot des Bilanzdevisenrisikos verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Snapshot freigeben | Wählen Sie den Snapshot, den Sie gerade bearbeitet haben, und wählen Sie Freigeben.  Wählen Sie im Dialogfenster OK. | Der Snapshot wird freigegeben. |  |

### Cashflow-Exposure-Management

Zweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie die Cashflow-Exposure auf der Grundlage von Exposure-Daten aus einem externen System eingegeben wird.

#### Exposure-Daten sammeln

Zweck

Benutzer sammeln Exposure-Daten von verschiedenen Teams und Abteilungen, um eine Exposure-Sammlung zu generieren und in das SAP-System einzugeben.

Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

#### Rohexposure anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie im SAP-System mit Daten aus einer externen Datenquelle ein Rohexposure an.

Vorgehensweise

Option 1: Rohexposure manuell anlegen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieRohexposure verarbeiten(FTREX1). | Das Bild Rohexposure: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Anlegen:  Exposure-Aktivitätsart: z.B. YFXO | Das Bild Rohexposurepflege: Erstellen wird angezeigt. |  |
| 4 | Kopfdaten eingeben | Geben Sie Kopfdaten ein, und wählen Sie die Registerkarte Positionsdaten.  Geben Sie folgende Daten ein:  Ext. Belegnummer: z.B. <aktuelles Datum 001>  Standard-Exposure-Typ: z.B. 01  Buchungskreis: 1010  Krit. für ExpPosTyp: FX  Richtung: z.B. AUS | Das Bild wechselt zur Registerkarte Positionsdaten. |  |
| 5 | Positionsdaten eingeben | Wählen Sie Neue Belegzeile erstellen.  Geben Sie die Positionsdaten ein, und wählen Sie Sichern.  Externe Positionsnummer: z.B. 1001  Fälligkeitsdatum: z.B. <aktuelles Datum + 6 Monate>  Exposure-Betrag: z.B. 100.000.000,00  Währung Exposure-Betrag: USD  Zielwährung: EUR | Die Daten werden gesichert. |  |

Option 2: Rohexposures aus Tabelle importieren

Wenn Sie den Browser im Datenschutzmodus ausführen, können Probleme auftreten. Wechseln Sie in diesem Fall für die folgenden Schritte in den normalen Modus Ihres Browsers.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad mit der Rolle Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieRohexposures importieren - Tabellenkalkulation(FTREX\_EXCEL\_UPLOAD). | Das Bild Excel-Upload für Rohexposures wird angezeigt. |  |
| 3 | Lokale Datei zum Gerät hochladen | Wählen Sie Lokale Datei für Upload/Download.  Hinweis Wenn Ihr Browser eine Meldung mit der Frage anzeigt, ob die Dateien auf diesem Gerät gespeichert werden sollen, wählen Sie Zulassen. | Das Bild Exposure-Datei auswählen wird angezeigt. |  |
| 4 | Aus nativem Dateisystem importieren | Wählen Sie Aus nativem Dateisystem importieren. Wählen Sie die Vorlagendatei aus dem lokalen Dateisystem, und wählen Sie Öffnen.  Hinweis Die Vorlage muss in einem bestimmten Format vorliegen. Weitere Informationen über das Dateiformat finden Sie im Anhang im Abschnitt Beschreibung der Vorlage für den Import von Rohexposures.  Hinweis Importieren Sie eine Datei mit der Erweiterung.xlsx.  Hinweis Einige Beispieldaten finden Sie im Anhang im Abschnitt Beispieldaten für den Import von Rohexposures.  Für die folgenden Schritte wird vorausgesetzt, dass Sie die Beispieldaten im Anhang verwenden. | Nach dem Import wird ein Informationspopup mit der Meldung Import beendet. Anzahl importierter Dateien: 1 angezeigt. |  |
| 5 | Exposure-Datei zum Importieren und Ausführen auswählen | Wählen Sie OK.  Selektieren Sie die Exposure-Datei, und wählen Sie Auswählen. | Die Exposure-Datei wird im Dialogfenster Exposure-Datei auswählen angezeigt.  Der in das Feld Dateiname eingegebene Dateipfad wird im Dialogfenster Excel-Upload für Rohexposures angezeigt. |  |
| 6 | Testlauf des Imports | Legen Sie die Verarbeitungsoptionen fest, und wählen Sie Ausführen.  Daten vor Verarbeit. anzeigen: markiert  Testlauf: markiert | Das Bild Exposure-Uploaddaten - Simulation wird angezeigt. |  |
| 7 | Testlaufergebnis prüfen | Überprüfen und bestätigen Sie die Exposure-Daten, und wählen Sie Ausführen. | Die erfolgreichen Datensätze sind an der grünen Ampel in der Spalte Status zu erkennen. |  |
| 8 | Echtlauf des Imports | Wählen Sie Beenden. Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Exposure-Uploaddaten wird angezeigt. |  |
| 9 | Echtlauf und Überprüfung der Importergebnisse | Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Exposure-Upload wird angezeigt.  Die erfolgreich importierten Datensätze sind mit einem grünen Ampelsymbol gekennzeichnet und verfügen über eine generierte Rohexposure-ID. |  |

#### Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Snapshot für Cashflow-Exposure am Stichtag erstellen.

Voraussetzungen

Es ist ein Sicherungsbereich vorhanden. Informationen zum Anlegen eines Sicherungsbereichs finden Sie im vorhergehenden Verfahren "Sicherungsbereich definieren".

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | Snapshot erstellen | Öffnen Sie Snapshot erstellen(TOESNAP). | Das Bild Snapshot erstellen wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeine Abgrenzungen erfassen | Nehmen Sie auf dem Bild Allgemeine Abgrenzungen folgende Einträge vor, und wählen Sie Ausführen.  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Beschreibung: z.B. <Aktuelles Datum> Snapshot  Extraktionsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Hinweis Sie können auch einen Snapshot mit einem Extraktionsdatum in der Vergangenheit erstellen, wenn kein Snapshot für den Sicherungsbereich erstellt wird. Beachten Sie, dass Sie einen Snapshot mit einem Extraktionsdatum in der Vergangenheit nur einmal erstellen können.  Tagesreferenz: <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Hinweis Das Ankreuzfeld Tagesreferenz muss markiert sein, wenn Sie den Vorgang Sicherungsanforderung generieren durchführen möchten.  Wenn Sie das Kennzeichen Zielquote zurücksetzen setzen, werden manuell überschriebene Zielquoten im Hedge Management Cockpit auf die ursprünglich in Ihrem Sicherungsbereich definierten Zielquoten zurückgesetzt, die mit dem neuen Snapshot-Datum verwendet werden. | Ein Protokoll mit einer Meldung, dass der Snapshot erfolgreich erstellt wurde, wird angezeigt. |  |

#### Cashflow-Netto-Exposure überprüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt überprüfen Sie das Cashflow-Netto-Exposure im Hedge Management Cockpit.

Voraussetzungen

Es ist ein Sicherungsbereich vorhanden. Informationen zum Anlegen eines Sicherungsbereichs finden Sie im vorhergehenden Verfahren Sicherungsbereich definieren.

Es ist ein Snapshot zum Stichtag vorhanden.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). | Die Sicht Hedge-Management-Cockpit wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Nehmen Sie folgende Einträge vor, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID： 1R\_ALL\_CH | Das Hedge-Management-Cockpit für SicherungsbereichDE 0001 wird mit den Exposure-Daten angezeigt.  Hinweis Wenn Sie Von Quelle definierte Währung wählen und Exposure-Posten während des Snapshots basierend auf den währungsübergreifenden Exposures angelegt werden, zeigt das Hedge-Management-Cockpit die Zielwährung, die Risikowährung und die Buchungskreiswährung an. |  |

### Exposure analysieren und Sicherungsmaßnahmen vereinbaren

Zweck

Sie analysieren die Exposure-Daten mit den entsprechenden Teams und Organisationen und vereinbaren Sicherungsmaßnahmen. Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

### Handelsanforderung anlegen

Verwendungszweck

Sie haben drei Möglichkeiten, eine Handelsanforderung anzulegen:

* Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen
* Handelsanforderung über Cashflow-Sicherungsanforderung anlegen
* [Handelsanforderung manuell anlegen](#unique_72) [Seite ] 171

#### Handelsanforderung über Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen

##### Sicherungsanforderung generieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt erzeugen Sie eine Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Sie haben einen Snapshot wie im Abschnitt [Bilanz-Exposure-Management](#unique_123) [Seite ] 146 beschrieben erstellt und freigegeben.

Vorgehensweise

Option 1: Sicherungsanforderung ohne vordefinierte Parameter generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderung generieren - Bilanzdevisenrisiko(FXM\_REQUEST). | Sie gelangen auf das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren. |  |
| 3 | Allgemeine Informationen für "Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren" eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Im Bereich Snapshot  Selektion über Snapshot-ID: z.B. <markieren>  Snapshot-ID: z.B. <die ID, die Sie sich im Schritt "Snapshot für Bilanzdevisenrisiko erstellen" notiert haben>  Hinweis Stellen Sie sicher, dass Sie beim Erstellen des Snapshots dieselbe Snapshot-ID verwenden.  Im Bereich Filter für Snapshots  Buchungskreis: 1010  Währung: <die Risikowährung, z.B. USD>  Im Bereich Valutadatum:  Festes Datum: <Markieren>  Valutaselektion: Ende aktueller Monat  Im Bereich Hauptparameter:  Instrumenttyp: Devisenoption  Zielstatus: Angelegt  Testlauf: <entmarkieren> | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungsliste wird angezeigt. |  |

Option 2: Sicherungsanforderung mit vordefinierten Parametern generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeine Informationen für "Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen generieren" eingeben | Wählen Sie Anlegen.  Geben Sie im Dialogfenster folgende Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Snapshot-ID: z.B. <die von Ihnen notierte Snapshot-ID>  Hinweis Stellen Sie sicher, dass Sie beim Erstellen des Snapshots dieselbe Snapshot-ID verwenden.  Anforderungsparametergruppe: z.B. RP\_GRP1 | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungsliste wird mit den neu angelegten Sicherungsanforderungen angezeigt. |  |

##### Sicherungsanforderung prüfen und verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt prüfen und verarbeiten Sie eine Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Es wurde eine Devisensicherungsanforderung angelegt und zur Verfügung gestellt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Start:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 4 | Anfrage prüfen | Markieren Sie die Zeile der zuvor angelegten Sicherungsanforderung, und wählen Sie am Ende der Zeile, das Pfeilsymbol >. | Das Bild Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 5 | Die Anforderung bearbeiten (optional) | Wählen Sie Bearbeiten, ändern Sie die Daten, ändern Sie z.B. den Betrag auf 80% des Originalbetrags, und wählen Sie Sichern. | Ihre Änderungen werden gesichert. |  |

##### Sicherungsanforderung freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt geben Sie eine Devisensicherungsanforderung frei.

Voraussetzungen

Es wurde eine Devisensicherungsanforderung angelegt und zur Verfügung gestellt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sicherungsanforderungen verarbeiten - Bilanzdevisenrisiko(F4764). | Das Bild Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Start:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 4 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile der gerade bearbeiteten Sicherungsanforderung, und wählen Sie Freigeben.  Wählen Sie im Dialogfenster OK. | Die Bilanz-Exposure-Sicherungsanforderung wurde erfolgreich freigegeben. |  |

#### Handelsanforderung über Cashflow-Exposure-Sicherungsanforderung anlegen

##### Sicherungsanforderung generieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Verwendungszweck

In diesem Schritt erzeugen Sie eine Cashflow-Devisensicherungsanforderung.

Voraussetzungen

Sie haben einen Snapshot mit Tagesreferenz wie im Schritt [Snapshot für Cashflow-Exposure erstellen](#unique_37) [Seite ] 76 beschrieben erstellt.

Vorgehensweise

Tabelle 9: Sicherungsanforderung manuell generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). |  |  |
| 3 | Layouts verwalten | Wählen Sie Layouts verwalten. | Das Bild Layoutübersicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Eigenes Layout anlegen | Wählen Sie eine Zeile der Vorgabe-Layout-ID, z.B. Layout 1R\_ALL\_CH, und wählen Sie Anlegen mit Vorlage | Das Bild Neue Layout-ID wird angezeigt. |  |
| 5 | Layout-ID eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Enter:  Layout-ID: z.B. 2R\_TQ\_CH | Das Bild Layout wird angezeigt. |  |
| 6 | Kennzahlen für neues Layout wählen | Nehmen Sie die folgende Einträge vor, und wählen Sie Sichern:  Beschreibung: z.B. Mit Zielquote (Kennzahlen in Zeilen)  Zielquotenart: z.B. YLQ  Geben Sie auf der Registerkarte Kennzahl die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Abzusichernder Betrag: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 8  Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 9  Obere Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 10  Untere Zielquote [%]: Anzeigeebene, z.B. 1; Auftrag, z.B. 11 |  |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID： 2R\_TQ\_CH  Wählen Sie Starten. | Das Hedge-Management-Cockpit für SicherungsbereichDE 0001 wird mit den Exposure-Daten und der Zielquote angezeigt.  Hinweis Sie können eine Zielquote überschreiben, indem Sie eine Zielquotenzelle auswählen und auf Zielquote überschreiben klicken.  Die überschriebene Zielquote kann auf berechnete Kennzahlen angewendet werden, die von der Zielquote abhängen, z.B. Zielsicherungsbetrag und Abzusichernder Betrag. |  |
| 8 | Sicherungsanforderung generieren | Markieren Sie eine Zeile.  Markieren Sie beispielsweise eine Zeile, die in der Spalte Kennzahlname die Option Nettosicherungen mit einem aktuellen Datumswert + 3 Monate enthält.  Wählen Sie Sicherungsanforderung und dann Devisensicherungsanforderung. | Die Sicht Sicherungsanforderung wird angezeigt. |  |
| 9 | Sicherungsanforderung sichern | Geben Sie folgende Daten ein:  Sicherungsanforderungs-ID: z.B. Devisensicherungsanforderung  Instrumententyp.: z.B. Devisenoption  Sicherungsklassifizierung: z.B. Y0  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 3 Monate>  Sicherungsanforderungsbetrag: z.B. + 1.000.000  Wählen Sie Sichern. |  |  |

Tabelle 10: Sicherungsanforderung automatisch generieren

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Sicherungsanforderung automatisch generieren | Wählen Sie Autom. Anforderungsanlage.  Prüfen Sie die Zeile Sicherungsanforderung kann angelegt werden, ändern Sie die folgenden Standardeinträge nach Bedarf und wählen Sie Sichern:   * Betrag * Sicherungsanforderungsvaluta * Instrumenttyp.   Hinweis Sie müssen die Kennzahl Abzusichernder Betrag in Ihrem gewählten Layout zur Verfügung stellen. | Die Meldung Sicherungsanforderung wurde mit Gruppen-ID gesichert wird angezeigt. |  |

##### Sicherungsanforderung freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Verwendungszweck

In diese Aktivität wird beschrieben, wie Sie eine Devisensicherungsanforderung freigeben.

Voraussetzungen

Ein Devisengeschäftsanforderung wurde angelegt und steht zur Verfügung.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Die Sicht Sicherungsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  Wählen Sie Starten. | Das System zeigt die den Filterkriterien entsprechenden Sicherungsanforderungen an. |  |
| 4 | Anforderung absenden | Markieren Sie die Zeile mit der Sicherungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Absenden aus der Dropdown-Liste aus. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung gesendet wurde. |  |
| 5 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile mit der Sicherungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste aus. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung freigegeben wurde. |  |
| 7 | Aktualisierungsstatus bestätigen | Wählen Sie die Sicherungsanforderung per Doppelklick aus.  Wählen Sie die Drucktaste Handelsanforderung.  Bestätigen Sie dann den HandelsanfordStatus im Dialogfenster Zugeordnete Handelsanforderung. | Der Status der Handelsanforderung ändert sich nach dem Abrufen in Übertragen. |  |

#### Handelsanforderung manuell anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt legen Sie manuell eine Handelsanforderung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO). | Die Sicht Handelsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Handelsanforderung manuell anlegen | Wählen Sie Manuelle Handelsanforderung anlegen.  Geben Sie auf der Registerkarte Allgemein die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Buchungskreis: z.B. 1010  Instrumenttyp: z.B. Devisenoption  Kauf/Verkauf: z.B. K Kaufen  Angeforderter Betrag: z.B. 10.000USD  Gegenläufige Währung: z.B. EUR  Valutadatum: z.B. <Aktuelles Datum> | Die Handelsanforderung wird angezeigt. |  |
| 4 | Zurück zum vorherigen Bild | Wählen Sie Zurück. |  |  |
| 5 | Anforderung filtern | Geben Sie die Handelsanforderungs-ID ein, und wählen Sie Ausführen. |  |  |
| 6 | Anforderung absenden | Markieren Sie die Zeile mit der Handelsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Absenden aus der Dropdown-Liste aus. |  |  |
| 7 | Anforderung freigeben | Markieren Sie die Zeile mit der Handelsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste aus. | Der Status der Handelsanforderung ändert sich in Freigegeben. |  |

### Status der Handelsanforderungen prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt prüfen Sie den Status aller Handelsanforderungen.

Voraussetzungen

Es werden Devisensicherungsanforderungen angelegt und freigegeben, um die Handelsanforderungen bereit zu stellen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Handelsanforderungen verarbeiten(TPITRO). | Die Sicht Handelsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Handelsanforderungstyp: z.B. Sicherung  Hinweis Um Handelsanforderungen zu überprüfen, die über Bilanz-Exposure-Sicherheitsanforderung angelegt wurden, wählen Sie Bilanz-Hedge. | Das System zeigt die den Filterkriterien entsprechenden Handelsanforderungen an.  Sicherungsanforderungen aus dem vorherigen Schritt werden mit dem entsprechenden Status angezeigt. |  |
| 4 | Ursprüngliche Anforderung prüfen | Markieren Sie die Zeile einer Handelsanforderung, und wählen Sie Ursprüngliche Anforderung. | Die Sicht "Sicherungsanforderung" wird angezeigt. |  |
| 5 | Anfrage prüfen | Wählen Sie Prüfen. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Sicherungsanforderung konsistent ist. |  |

### Bericht "Limitinanspruchnahme" prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie Sie den Bericht "Limitinanspruchnahmen" prüfen.

Voraussetzungen

Die Limitstammsätze Ihres Unternehmens sind im System gepflegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB). | Das Bild Übersicht Limitinanspruchnahmen - Auswahl über alle Merkmale wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Limitart: z.B. Y01 oder Y07  Inanspruchnahmebasis: z.B. 1  Ermittlungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Vorgaben gültig ab: z.B. <aktuelles Datum> | Es wird eine Übersicht der Limitinanspruchnahmen anhand Ihrer Selektionskriterien angezeigt. |  |

### Devisenoptionsgeschäft anlegen

Zweck

In diesem Schritt legen Sie einen Devisenoptionsvertrag (Plain-Vanilla-Devisenoption oder Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption) als Sicherungsinstrument an.

#### Devisenoption Plain Vanilla anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie die Devisenoptionsgeschäfte für die Devisenabsicherung an. Darüber hinaus können Devisenoptionsgeschäfte auch für andere Zwecke als zur Absicherung angelegt werden.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Option anlegen(TI71). | Das Bild OTC-Option anlegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Enter.  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 76A  Geschäftsart: z.B. 100  Partner: z.B. 10537001 | Das Bild OTC-Option: Vertrag anlegen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Ausstattung eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie die Registerkarte Verwaltung:  Ablaufdatum: z.B. ++6 (6 Monate später)  Ablaufzeit: z.B. Frankfurt 15:00  Ausübungsart: z.B. europäisch  Abrechnung: z.B. Physische Ausübung  Strike: z.B. EUR/USD<Geben Sie einen geeigneten Kurs ein.>  Put/Call: z.B. Call  Geh.Betrag: z.B. USD 5M  Geben Sie folgende Daten im Abschnitt Agio ein:  Notierung: z.B. Prozentsatz  Prozentsatz: z.B. 8  Bewegungsart: z.B. 1300 Optionsprämie – Gewinn/Verlust  Währung: z.B. EUR  Hinweis Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. |  |  |
| 5 | Verwaltungsdaten eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Risikominderung: z.B. <entmarkieren>  Hinweis Markieren Sie das Ankreuzfeld "Risikominderung", wenn diese Transaktion für die Risikominderung vorgesehen ist. In diesem Fall geht das Geschäft nicht in die Berechnung des Clearing-Schwellen-Reports ein.  Sicherungsklassifizierung: z.B. Y0 | Die Daten werden gesichert, und die Transaktionsnummer wird generiert. |  |

#### Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt legen Sie eine Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) an.

Es bestehen zwei Möglichkeiten zur manuellen Erstellung einer Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption:

* Option 1: Beide Optionen separat und Optionsreferenz anlegen. Sie können eine Devisenoption (langer Leg) und eine weitere Devisenoption anlegen (kurzer Leg), und anschließend einen Verweis für diese beiden Legs erstellen, wodurch die Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption entsteht.
* Option 2: Legen Sie eine Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption in einem Schritt an. Die zwei Legs und der Bezug werden gleichzeitig gesichert.

Egal, welche Option Sie wählen, müssen die folgenden Attribute in beiden Währungsoptionsvorgängen (zwei Legs) identisch sein:

* Buchungskreis
* Produktart
* Geschäftspartner
* Verfalldatum
* Verfallszeit
* Risikowährung, Risikobetrag
* Prämienzahlung, Prämienwährung
* Vertragsdaten
* Sicherungsklassifizierung

##### Option 1: Beide Optionen separat und Optionsreferenz anlegen

Vorgehensweise

Kauf einer Call/Put-Devisenoption (langes Leg):

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Option anlegen(TI71). | Das Bild OTC-Option anlegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Datenerfassung auf dem Einstiegsbild | Im Bild OTC-Option anlegen: Einstieg geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Enter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 76A  Geschäftsart: 100  Partner: z.B. 10537001 | Das Bild OTC-Option: Vertrag anlegen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten in Registerkarte Struktur eingeben | Geben Sie auf der Registerkarte Struktur die folgenden Daten ein:  Teilbereich Option:  Ablaufdatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate>  Ablaufzeit: z.B. Frankfurt 15:00  Ausübungsart: z.B. europäisch  Abrechnung: z.B. Physische Ausübung  Strike:Risikowährung/Hauswährungskurs, z.B. USD/EUR<Strike-Kurs eingeben>  Put/Call: z.B Call  Geh.Betrag: <Risikowährung><Betrag>, z.B. USD500000  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate + 2 Tage>  Teilbereich Prämie:  Bewegungsart: z.B. 1300 Optionsprämie – Gewinn/Verlust  Zahlungstermin: <aktuelles Datum + 2 Tage>  Betrag: <lokale Währung> <Ihr Optionsprämienbetrag>, z.B. EUR500  Teilbereich Vertragsabschluss:  Vertragsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Hinweis Das Ablaufdatum der Devisenoption sollte im gleichen Zeitraum liegen, wie das Fälligkeitsdatum des Exposure.  Sie verlängern die Call-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein ausgehendes Exposure handelt.  Sie verlängern die Put-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein eingehendes Exposure handelt,  Die Währung unter Geh.Betrag sollte der Risikowährung entsprechen. Der Geh.Betrag sollte weniger oder gleich dem Betrag der offenen Nettoexposure sein.  Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. | Die Daten auf der Registerkarte Struktur wurden eingegeben. |  |
| 5 | Daten auf der Registerkarte "Verwaltung" eingeben | Wählen Sie die Registerkarte Verwaltung, und geben Sie die folgenden Daten ein:  Allg. BewKlasse: z.B. 43 Derivate  SichKlassifiz.: z.B. Y0 | Die Daten auf der Registerkarte Verwaltung wurden eingegeben. |  |
| 6 | OTC-Devisenoption (langes Leg) sichern | Wählen Sie Sichern. | Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen auswählen angezeigt wird, stellen Sie sicher, dass keine Fehlermeldungen vorliegen (anderenfalls korrigieren Sie die Daten, und sichern Sie sie erneut), und wählen Sie Weiter (Enter).  Die Meldung Finanzgeschäft unter der Nummer ... gesichert wird angezeigt.  Notieren Sie die Geschäftsnummer dieses langen Legs. |  |

Verkauf einer Put/Call-Devisenoption (kurzes Leg):

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Option anlegen(TI71). | Das Bild OTC-Option anlegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Datenerfassung auf dem Einstiegsbild | Im Bild OTC-Option anlegen: Einstieg geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Enter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 76A  Geschäftsart: 200  Partner: z.B. 10537001 | Das Bild OTC-Option: Vertrag anlegen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten in Registerkarte Struktur eingeben | Geben Sie auf der Registerkarte Struktur die folgenden Daten ein:  Teilbereich Option:  Ablaufdatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate>  Ablaufzeit: z.B. Frankfurt 15:00  Ausübungsart: z.B. europäisch  Abrechnung: z.B. Physische Ausübung  Strike:Risikowährung/Hauswährungskurs, z.B. USD/EUR<Strike-Kurs eingeben>  Put/Call: z.B. Put  Geh.Betrag: <Risikowährung> <Betrag>, z.B. USD500000  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate + 2 Tage>  Teilbereich Prämie:  Bewegungsart: z.B. 1300 Optionsprämie – Gewinn/Verlust  Zahlungstermin: <aktuelles Datum + 2 Tage>  Betrag: <lokale Währung> <Ihr Optionsprämienbetrag>, z.B. EUR500  Teilbereich Vertragsabschluss:  Vertragsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Hinweis Das Ablaufdatum der Devisenoption sollte im gleichen Zeitraum liegen, wie das Fälligkeitsdatum des Exposure.  Hinweis Sie verkürzen die Call-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein eingehendes Exposure handelt,  Sie verkürzen die Put-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein ausgehendes Exposure handelt.  Hinweis Die Währung unter Geh.Betrag sollte der Risikowährung entsprechen. Der Geh.Betrag sollte weniger oder gleich dem Betrag der offenen Nettoexposure sein. | Die Daten auf der Registerkarte Struktur wurden eingegeben. |  |
| 5 | Daten auf der Registerkarte "Verwaltung" eingeben | Wählen Sie die Registerkarte Verwaltung, und geben Sie die folgenden Daten ein:  Allg. BewKlasse: z.B. 43 Derivate  SichKlassifiz.: z.B. Y0 | Die Daten auf der Registerkarte Verwaltung wurden eingegeben. |  |
| 6 | OTC-Devisenoption (kurzes Leg) sichern | Wählen Sie Sichern. | Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen auswählen angezeigt wird, stellen Sie sicher, dass keine Fehlermeldungen vorliegen (anderenfalls korrigieren Sie die Daten, und sichern Sie sie erneut), und wählen Sie Weiter (Enter).  Die Meldung Finanzgeschäft unter der Nummer ... gesichert wird angezeigt.  Notieren Sie die Geschäftsnummer dieses kurzen Legs. |  |

Optionsreferenz anlegen:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Referenz anlegen(TBR6). | Die Sicht Referenz anlegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Datenerfassung auf dem Einstiegsbild | Geben Sie auf dem Bild Referenz anlegen: Einstieg die folgenden Daten ein:  Referenzkategorie: OPT  Teilbereich Zu verknüpfendes Objekt 1:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer des langen Legs>  Teilbereich Zu verknüpfendes Objekt 2:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer des kurzen Legs>  Wählen Sie Enter. | Die Sicht Referenz anlegen: Daten wird angezeigt. |  |
| 4 | Referenz sichern | Wählen Sie auf dem Bild Referenz anlegen: Daten die Option Sichern. | Die Meldung Referenznummer angelegt wird angezeigt. |  |

##### Option 2: Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption in einem Schritt anlegen

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Collar-Devisenoption anlegen(TI4B). | Das Bild Devisenoptionserfassung – Spread: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Datenerfassung auf dem Einstiegsbild | Geben Sie auf dem Bild Devisionoptionserfassung – Spread: Einstieg die folgenden Daten ein:  Buchungskreis: z.B. 1010  Partner: z.B. 10537001  Teilbereich Erstes Geschäft:  Produktart: 76A  Bewegungsart: 100  Teilbereich Zweites Geschäft:  Produktart: 76A  Bewegungsart: 200  Wählen Sie Enter. | Das Bild Devisenoptionserfassung – Spread: Struktur wird angezeigt. |  |
| 4 | Daten für 1. Geschäft eingeben (langes Leg) | Geben Sie auf dem Bild Devisenoptionseintrag – Spread: Struktur die folgenden Daten im Bereich 1. Geschäft ein:  Teilbereich Option:  Ausübungsart: z.B. europäisch  Abrechnung: z.B. Physische Ausübung  Ablaufdatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate>  Ablaufzeit: z.B. Frankfurt 15:00  Strike:Risikowährung/Hauswährungskurs, z.B. USD/EUR<Strike-Kurs eingeben>  Put/Call: z.B Call  Geh.Betrag: <Risikowährung> <Betrag>, z.B. USD500000  Valutadatum: z.B. <aktuelles Datum + 2 Monate + 2 Tage>  Teilbereich Prämie:  Bewegungsart: z.B. 1300 Optionsprämie – Gewinn/Verlust  Zahlungsdatum: <aktuelles Datum + 2 Tage>  Betrag: <lokale Währung> <Ihr Optionsprämienbetrag>, z.B. EUR500  Allg. BewKlasse: z.B. 43 Derivate  SichKlassifiz.: z.B. Y0  Wählen Sie Enter.  Hinweis Das Ablaufdatum der Devisenoption sollte im gleichen Zeitraum liegen, wie das Fälligkeitsdatum des Exposure.  Sie verlängern die Put-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein eingehendes Exposure handelt,  Sie verlängern die Call-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein ausgehendes Exposure handelt.  Die Währung unter Geh.Betrag sollte der Risikowährung entsprechen. Der Geh.Betrag sollte weniger oder gleich dem Betrag der offenen Nettoexposure sein.  Wenn das Währungspaar nicht definiert ist, können Sie das Währungspaar über den IMG Leitwährung definieren unter folgendem IMG-Pfad definieren: SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Transaction Manager > Allgemeine Einstellungen > Geschäftsverwaltung > Währungen. | Die Daten für das 1. Geschäft (langes Leg) wurden eingegeben. |  |
| 5 | Die Daten für das 2. Geschäft (kurzes Leg) wurden eingeben. | Geben Sie die folgenden Daten in den Bereich 2. Geschäft ein:  Teilbereich Option:  Ausübungsart: <wird automatisch vom 1. Geschäft kopiert>  Abrechnung: <wird automatisch vom 1. Geschäft kopiert>  Verfallstag: <wird automatisch vom 1. Geschäft kopiert>  Verfallszeit: <wird automatisch vom 1. Geschäft kopiert>  Strike: Währungspaar wird automatisch aus dem ersten Geschäft kopiert. Sie müssen nur einen korrekten Wechselkurs eingeben.  Put/Call: Dies leitet sich automatisch vom 1. Geschäft ab; wenn sich der Call auf das erste 1. Geschäft bezieht, sollte beim 2. Geschäft Put eingegeben werden.  Geh.Betrag: Währung und Betrag werden automatisch aus dem 1. Geschäft übernommen.  Valutadatum: <wird automatisch vom 1. Geschäft kopiert>  Teilbereich Prämie:  Bewegungsart: z.B. 1300 Optionsprämie – Gewinn/Verlust  Zahlungsdatum: aktuelles Datum + 2 Tage  Betrag: <lokale Währung> <Ihr Optionsprämienbetrag>, z.B. EUR500  Allg. BewKlasse: z.B. 43 Derivate  SichKlassifiz.: z.B. Y0  Wählen Sie Enter.  Hinweis Sie verkürzen die Call-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein eingehendes Exposure handelt,  Sie verkürzen die Put-Option in der Zylinderoption, wenn es sich um ein ausgehendes Exposure handelt. | Die Daten für das 2. Geschäft (kurzes Leg) wurden eingegeben. |  |
| 6 | Vertragsabschlussdaten eingeben | Geben Sie im Teilbereich Vertragsabschluss die folgenden Daten ein:  Vertragsdatum: z.B. <aktuelles Datum> | Das Vertragsdatum wurde eingegeben. |  |
| 7 | Zylinder-Option sichern (beide Legs) | Wählen Sie Sichern. | Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen anzeigen Nachdem die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption gesichert wurde, können Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle Office anmelden und die App öffnen. Vergewissern Sie sich, dass keine Fehlermeldung vorhanden ist (korrigieren Sie anderenfalls die Daten, und sichern Sie sie erneut), und wählen Sie Weiter (Enter).  Die Meldung Optionen Nummer 1 und Nummer 2 in Buchungskreis (Buchungskreis) gesichert wird angezeigt.  Zwei Zylinderoptions-Legs wurden gesichert, für die ein Bezug angelegt wurde.  Notieren Sie die Geschäftsnummern dieser zwei Legs. |  |

Nachdem die Null-/Niederstwert-Collar Devisenoption gesichert wurde, können Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office anmelden und die App Hedge-Management-Cockpit(TOENE) öffnen, um das offene Nettoexposure erneut zu prüfen.

In der App Hedge-Management-Cockpit(TOENE) werden die Beträge des langen Legs in den entsprechenden Zellen für den Kennzahlnamen Nettosicherungen und den relevanten Buchungskreis, die Risikowährung und den Zeitraum abgebildet. Offenes Netto-Exposure sollte entsprechend verringert werden.

### (BFB) Grundlegende Kassenvorgänge

Einsatzmöglichkeiten

Nachdem das Geschäft (im Status Vertrag) angelegt wurde und bevor die Zahlung ausgeführt wird, werden die künftigen Cashflows in den Liquiditätsvorschauberichten abgebildet. Wenn in Ihrem System das elementare Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) analysieren.

Hinweis Dieser Schritt kann während des gesamten Lebenszyklus des Treasury-Geschäfts ausgeführt werden. Die Ergebnisse in den Liquiditätsvorschauberichten variieren je nach der Bearbeitungsphase des Geschäfts (z.B. vor dem Anlegen, nach dem Anlegen, nach Buchung der Zahlung).

Vorgehensweise

Wenn in Ihrem System das elementare Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) auf Änderungen analysieren. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Grundlegende Kassenvorgänge (BFB).

Die finanzrelevanten Cashflows werden auf den finanzspezifischen Planungsebenen abgebildet. Beispiel:

* MM – Geldhandelgeschäfte
* NM – Geldhandelgeschäfte (Bank unbekannt)
* FX – Devisengeschäfte
* FO – Devisenoptionen
* NF – Devisengeschäfte (Bank unbekannt)
* DR – Derivatgeschäfte
* ND – Derivatgeschäfte (Bank unbekannt)

### (J78) Erweiterte Kassenvorgänge

Einsatzmöglichkeiten

Nachdem das Geschäft (im Status Vertrag) angelegt wurde und bevor die Zahlung ausgeführt wird, werden die künftigen Cashflows in den Liquiditätsvorschauberichten abgebildet. Wenn in Ihrem System Basic Cash Management implementiert ist, können Sie die Liquiditätsvorschau mit der App Cashflow-Analyse(F2332) oder Finanzstrompositionen prüfen(F0735) analysieren.

Hinweis Dieser Schritt kann während des gesamten Lebenszyklus des Treasury-Geschäfts ausgeführt werden. Die Ergebnisse in den Liquiditätsvorschauberichten variieren je nach der Bearbeitungsphase des Geschäfts (z.B. vor dem Anlegen, nach dem Anlegen, nach Buchung der Zahlung).

Vorgehensweise

Ist das vollständige Cash Management in Ihrem System implementiert, können Sie die Liquiditätsvorschau mit den Apps Cashflow-Analyse oder Finanzstrompositionen prüfen(F0735)auf Änderungen prüfen. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Erweiterte Kassenvorgänge (J78).

Die finanzrelevanten Cashflows werden auf den finanzspezifischen Planungsebenen abgebildet. Beispiel:

* MM – Geldhandelgeschäfte
* NM – Geldhandelgeschäfte (Bank unbekannt)
* FX – Devisengeschäfte
* FO – Devisenoptionen
* NF – Devisengeschäfte (Bank unbekannt)
* DR – Derivatgeschäfte
* ND – Derivatgeschäfte (Bank unbekannt)

Außerdem können Sie bei Apps für das vollständige Cash Management auch finanzspezifische Cash Flows auswählen, indem Sie nach Wahrscheinlichkeitsstufen filtern:

* TRM\_D – Finanzinstrument
* TRM\_O – Optionales Finanzinstrument

### Korrespondenz

Einsatzmöglichkeiten

Sie können die Transaktionsinformationen mit Ihrem Partner über die Korrespondenzfunktion kommunizieren, z.B. mit einem Druckformular per E-Mail.

#### Abrechnungsstatus setzen (manuell)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Nachdem Sie ein TRM-Geschäft im SAP-System erfasst und gesichert haben, müssen Sie das Geschäft abrechnen, bevor Sie weitere Aktivitäten ausführen können. Es gibt zwei Möglichkeiten, das Geschäft abzurechnen, nachdem Sie die Kontrahentenbestätigung erhalten haben:

* Manuelle Abrechnung

Beispiel: Sie erhalten die Kontrahentenbestätigung per E-Mail und rechnen dann das Geschäft mit einer der folgenden Apps manuell ab:

* + Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06)
  + OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91)
* Automatische Abrechnung über Korrespondenzprozess

Beispiel: Wenn für ein Geschäft alle ausgehenden und eingehenden Korrespondenzobjekte abgeglichen wurden und den Status "Abgeschlossen" erhalten haben, wird für die Finanzgeschäfte automatisch der Abrechnungsstatus gesetzt.

In diesem Schritt rechnen Sie das TRM-Geschäft manuell ab.

Voraussetzung

Im vorherigen Schritt wurde erfolgreich ein TRM-Geschäft angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben und ausführen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Die im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummer> | Das Geschäft wird auf dem nächsten Bild angezeigt. |  |
| 4 | TRM-Geschäft abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang der Geschäftszeile, und wählen Sie Abrechnen. | Das Bild OTC-Option Vorgang hinzufügen: Ausstattung wird mit den Geschäftsdaten angezeigt. |  |
| 5 | Änderungen sichern | Wählen Sie Sichern. | Das Geschäft wird abgerechnet und gesichert. Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird geöffnet. |  |
| 6 | Status des TRM-Geschäfts prüfen | Markieren Sie das Ankreuzfeld, und wählen Sie Anzeigen. | Das Bild OTC-Option anzeigen: Ausstattung wird angezeigt. |  |
| 7 | Status prüfen | Wählen Sie ... > Status.  Das Feld Vorgangstyp weist den Status Vertragsabrechnung auf. | Das Geschäft hat den Status Vertragsabrechnung. |  |

Hinweis Geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Status der Vertragsabrechnung für beide Legs ein.

#### Korrespondenz über PDF-Formular

Einsatzmöglichkeiten

E-Mails/Ausdrucke werden als PDF-Formular ausgegeben. Standardmäßig stellt SAP mehrere Geschäftsprofile für PDF-Formulare bereit, z.B. PR\_PRINT und PR\_EMAIL.

* Bei Geschäftspartnern mit der Zuordnung PR\_PRINT wird bei Anlegen eines Finanzgeschäfts ein PDF-Formular an die vorher festgelegte Druckwarteschlagen gesendet. Sie können die PDF-Datei über die App Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI) prüfen und drucken. Nachdem Sie geprüft und bestätigt haben, dass die Transaktionsinformationen auf dem Formular korrekt sind, senden Sie die Papierversion des Formulars an den Geschäftspartner.
* Bei Geschäftspartnern mit der Profilzuordnung PR\_EMAIL sendet SAP nach dem Anlegen eines Finanzgeschäfts automatisch E-Mails an den Geschäftspartner.

Nachdem Sie die Bestätigung zum Geschäft von Ihrem Geschäftspartner erhalten haben, können Sie alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts abrechnen. Sobald alle Korrespondenzobjekte abgerechnet wurden, ändert sich der Status des Geschäfts in Vertragsabrechnung.

In diesem Schritt rechnen Sie das TRM-Geschäft automatisch über die Korrespondenzverarbeitung ab.

Voraussetzungen

Sie haben ein TRM-Geschäft angelegt, das noch nicht abgerechnet wurde.

##### Bestätigungs-E-Mail/Ausdruck senden

Zweck

SAP stellt die Geschäftspartnergruppe BPG\_DEFAULT bereit. Wenn ein Geschäftspartner dieser Gruppe zugeordnet ist, werden die Korrespondenzobjekte standardmäßig automatisch gesendet, wenn ein Finanzgeschäft gesichert wird. Wie in den vorbereitenden Schritten beschrieben, ist der Geschäftspartner 10537001 der Gruppe BPG\_DEFAULT zugeordnet, sodass die Korrespondenzobjekte automatisch gesendet werden. Wenn Sie eine neue Geschäftspartnergruppe jedoch über das Customizing der anlegen, und nicht das Attribut für automatisches Senden zuweisen, müssen Sie die entsprechenden Korrespondenzobjekte ggf. mit der App Korrespondenz senden(FTR\_COSEND) manuell senden.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

##### Korrespondenzstatus prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt prüfen Sie den Status der Korrespondenzobjekte eines Geschäfts.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Korrespondenzstatus prüfen | Alle Korrespondenzobjekte werden angezeigt. In der Spalte Status:  Hinweis Ein Finanzgeschäft kann in Abhängigkeit von der Zuordnung der GP-Profile und GP-Gruppen ein oder mehrere Korrespondenzobjekte haben.   * Wenn der Kanal "E-Mail" lautet, bedeutet der Status Gesendet, dass das System versucht hat, eine E-Mail an die in den Geschäftspartner-Stammdaten gepflegte E-Mail-Adresse zu senden. Allerdings können Sie diese E-Mail-Adresse auch überschreiben, indem Sie in der App Ausgabeparameterfindung eine E-Mail-Empfänger-Regel pflegen. Mit der App E-Mail-Versand anzeigen(F1259) können Sie den tatsächlichen E-Mail-Status prüfen. * Wenn der Kanal "Druck" lautet, wird das Formular an die Druckwarteschlange gesendet. Sie können das Formular mit der App Druckwarteschlangen pflegen(F1260) ausdrucken. * Sie können mit der App E-Mail-Vorlagen pflegen Ihre eigenen E-Mail-Vorlagen pflegen. * Sie können mit der App Formularvorlagen pflegen Ihre eigenen Formularvorlagen pflegen. | Die Korrespondenzobjekte haben den Status Gesendet. |  |
| 5 | Geschäftsdetails anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Underlying anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal E-MAIL  Wählen Sie Zurück. | Die Geschäftsdetails werden angezeigt.  Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 6 | Formular zum Korrespondenzobjekt anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit den folgenden Daten, und wählen Sie Meldung anzeigen:  Empf./Senderart KONTRAHENT  Kanal: E-MAIL  In einem Dialogfenster wird ein Formular angezeigt. Wählen Sie Weiter. | Das Formular für das Korrespondenzobjekt wird angezeigt. |  |

Prüfen Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Status für beide Legs.

##### Eingehende Bestätigung erhalten

Zweck

Im vorherigen Schritt wurde für den E-Mail-Kanal eine ausgehende E-Mail an den Geschäftspartner gesendet. Normalerweise erhalten Sie eine Kontrahentenbestätigung vom Geschäftspartner per E-Mail, Telefon oder über andere Kanäle. Dieser Schritt erfolgt außerhalb des SAP-Systems.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Aktivitäten im System.

##### Geschäft suchen und Geschäftsdetails abgleichen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Sie haben im vorherigen Verfahren die Kontrahentenbestätigung erhalten. In diesem Verfahren legen Sie ein Eingangskorrespondenzobjekt an und gleichen es mit allen ausgehenden Korrespondenzobjekten ab.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Die Sicht Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien in der Einstiegssicht eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Gruppe Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Gruppe Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer>  Hinweis Notieren Sie den Korrespondenzschlüssel für ein KONTRAHENTEN-Korrespondenzobjekt. | Notieren Sie sich die Nummern der Korrespondenzschlüssel für KONTRAHENT DRUCKEN und KONTRAHENT E-MAIL. |  |
| 4 | Anlegen | Wählen Sie Anlegen. | Die Sicht Optionen beim Anlegen von Korrespondenzobjekten wird angezeigt. |  |
| 5 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit Verweis auf ausgehendes Korrespondenzobjekt anlegen | Geben Sie folgende Daten in die Gruppen ein, und wählen Sie Enter:  Gruppe Anzeigeoptionen:  Korrespondenztyp Kategorie: 01 Geschäftsaktivitäten  Gruppe Geschäftsdetails:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. <die im Geschäft angegebene Produktart>  Ein-/Ausgehend: I (Eingehende)  Erfassungsoptionen: 05 Korrespondenzobjekt als Vorlage  Gruppe Vorlage für Korrespondenzobjektdaten:  Korrespondenzschlüssel: z.B <Geben Sie die Nummer des Korrespondenzschlüssels für "KONTRAHENT DRUCKEN" aus dem vorherigen Schritt ein.> |  |  |
| 6 | Sichern | Wählen Sie Sichern.  Hinweis Wenn die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag angezeigt wird, wählen Sie Abbrechen. | Das eingehende Korrespondenzobjekt wird erfolgreich angelegt und in der Sicht Korrespondenzmonitor - Standardsicht angezeigt. |  |
| 7 | Eingehendes Korrespondenzobjekte mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal DRUCKEN abgleichen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Statusfunktionen > Automatischer Abgleich. | Die Sicht Automatischer Abgleichvorschlag wird angezeigt. |  |
| 8 | Ausgehende Korrespondenz | Expandieren Sie links in der Sicht den eingehenden Korrespondenzschlüssel. Es werden alle ausgehenden Korrespondenzobjekte des Geschäfts angezeigt.  Markieren Sie alle Ankreuzfelder der ausgehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Enter. | Alle ausgehenden "KONTRAHENT DRUCKEN"-Korrespondenzobjekte des Geschäfts haben nun den Status Abgeschlossen.  Alle ausgehenden INTERNEN Korrespondenzobjekte verbleiben im Status Gesendet. |  |
| 9 | Eingehendes Korrespondenzobjekt mit den ausgehenden Korrespondenzobjekten für Kanal E-MAIL abgleichen | Wiederholen Sie die oben genannten Schritte, um ein eingehendes Korrespondenzobjekt für KONTRAHENT E-MAIL anzulegen und mit der ausgehenden Korrespondenz für den Kanal E-MAIL abzugleichen. |  |  |

##### Abrechnungsstatus setzen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Im vorherigen Schritt wurden alle Korrespondenzobjekte des Geschäfts erfolgreich abgeglichen. Im Rahmen der Standardfunktion wird das Geschäft automatisch abgerechnet.

In diesem Schritt prüfen Sie nur, ob das Geschäft automatisch abgerechnet wurde.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Korrespondenz bearbeiten - Monitor(FTR\_COMONI). | Das Bild Korrespondenzmonitor wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien auf dem Einstiegsbild eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Registerkarte Korrespondenz:  Buchungskreis: z.B. 1010  Registerkarte Geschäft:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäftsnummer: z.B. <Geschäftsnummer> | Das Bild Korrespondenzmonitor - Standardsicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Vorgangshistorie anzeigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld der eingehenden Korrespondenzobjekte, und wählen Sie Underlying anzeigen. | Das Bild OTC-Option anzeigen: Ausstattung wird angezeigt. In der zweiten Zeile wird Aktivität 2 Vertragsabrechnung angezeigt. |  |

Überprüfen Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) den Abrechnungsstatus für beide Legs.

### Prämienzahlung

#### Zahlungsanforderung für Prämie erzeugen

Zweck

Jedes Finanzgeschäft enthält Bewegungen, die bezahlt werden müssen. Beim Erstellen des Geschäfts kann die Zahlungsanordnung nach Wunsch ausgewählt werden (in der Praxis üblicherweise nur für Zahlungsausgänge möglich). Das Treasury-Backoffice verwendet die Funktion Nur zhl. in der App Bewegungen buchen(TBB1), um eine Zahlungsanordnung für Abgänge zu erstellen, die eine Zahlungsanordnung erfordern. Eine Buchung in der Finanzbuchhaltung wird nicht angelegt.

Wenn der Finanzpartner die Zahlung initiiert, überspringen Sie diesen und den folgenden Schritt, [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133, und fahren Sie mit Schritt [Von Bank initiierte Zahlung](#unique_63) [Seite ] 137 fort.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Das Bild Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Derivate: <markieren>  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer mit Abgängen, die in den vorherigen Schritten angelegt wurde, für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) ist es das lange Leg>  Bis einschl. Fälligkeitsdatum: Geben Sie das Datum ein, an dem die Bewegung des Finanzgeschäfts gebucht werden soll, z.B. <aktuelles Datum + 2 Arbeitstage>.  Testlauf: <Markieren>  Nur zhl.: <markieren> | Das Bild Zahlungsprotokoll – Testlauf wird angezeigt. Überprüfen Sie die Zahlungsinformationen auf diesem Bild.  Wenn die Meldung Es sind keine Bewegungen zur Bearbeitung vorhanden angezeigt wird, sind keine Zahlungen mit Zahlungsanordnung für Ihre Selektionskriterien erforderlich. Fahren Sie direkt mit Schritt [Im Hauptbuch buchen](#unique_64) [Seite ] 137 fort. |  |
| 4 | Echtlauf | Wählen Sie Zurück.  Ändern Sie auf dem Bild Treasury: Bewegungen buchen die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: <entmarkieren> | Das Bild Zahlungsprotokoll wird angezeigt. Die Zahlungsanordnung wird erzeugt. Notieren Sie die auf diesem Bild angezeigte Schlüsselnummer: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

#### Zahlungsanordnung verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit dieser App starten Sie das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen. Das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen stellt eine zusätzliche Möglichkeit für die maschinelle Zahlung im SAP-System dar. Im Gegensatz zum Standardzahlprogramm basieren die Zahlungen nicht auf offenen Posten (Kreditoren- bzw. Debitorenposten), sondern auf Zahlungsanordnungen.

Voraussetzungen

Im vorherigen Schritt wurde eine Zahlungsanordnung erzeugt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111). | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111)wird angezeigt. |  |
| 3 | Datum der Ausführung und Identifikation eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Parameter:  Datum der Ausführung: z.B. <Tagesdatum>  Identifikation: z.B. TRM01 | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 4 | Parameter eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Freie Abgrenzungen:  Buchungsdatum: z.B. <Tagesdatum>  Nächster Zahllauf am: z.B. <aktuelles Datum + 3 Tage>  Buchungskreis: z.B. 1010  Zahlwege: z.B. TF | Das Dialogfenster Freie Selektion für Zahllauf wird angezeigt. |  |
| 5 | Schlüsselnummer | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Schlüsselnummer: <Schlüsselnummer, die Sie im vorherigen Schritt notiert haben> | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 6 | Zusatzprotokoll | Wählen Sie Zusatzprotokoll. | Das Dialogfenster Zusatzprotokoll wird angezeigt. |  |
| 7 | Parameter eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Zahlwegauswahl in allen Fällen: markiert  Positionen der Zahlungsbelege: markiert  Prüfung der Fälligkeit: markiert  Wenn die Meldung Das Protokoll wird für alle Konten erstellt angezeigt wird, wählen Sie Weiter.  Wählen Sie Sichern auf dem Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter. | Auf dem Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen wird die Meldung Parameter wurden erfasst angezeigt. |  |
| 8 | Vorschlag einplanen | Wählen Sie Vorschlag. | Das Dialogfenster Vorschlag einplanen wird angezeigt. |  |
| 9 | Job einplanen | Wählen Sie Start sofort und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Vorschlag läuft mit einem gelben Ampelsymbol wird angezeigt. |  |
| 10 | Status aktualisieren | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungsvorschlag wurde erstellt mit einem grünen Ampelsymbol in der Statusleiste angezeigt wird. | Der Zahlungsvorschlag wird erzeugt. |  |
| 11 | Zahlung einplanen | Wählen Sie Zahllauf. | Das Dialogfenster Zahlung einplanen wird angezeigt. |  |
| 12 | Job einplanen | Wählen Sie Start sofort, Zahlungsträger erstellen und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Zahlungslauf läuft mit einem gelben Ampelsymbol wird in der Statusleiste angezeigt. |  |
| 13 | Status aktualisieren | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungslauf wurde ausgeführt mit einem grünen Ampelsymbol angezeigt wird. | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) wird angezeigt.  Der Zahlungsbeleg wird angelegt.  Wenn Bank Communication Management (BCM) nicht in Ihrem System implementiert ist, wird der Zahlungsträger angelegt, sofern dieser das PMW-Format verwendet. Sie können das Protokoll überprüfen, indem Sie auf Zahlungsprotokoll anzeigen doppelklicken.  Wenn BCM in Ihrem System implementiert ist, wird in Zahlungsprotokoll anzeigen die Meldung Zahllauf XX/XX/20XX TRM01R ist für zahllaufübergreifende Zahlungsträger vorgesehen angezeigt. Nach dem Zahllauf wird ein BCM-Batch angelegt. Weitere Informationen erhalten Sie im nächsten Testschritt. |  |
| 14 | Zahllaufübergreifender Zahlungsträger (BCM-Batch anlegen) | Wählen Sie Mehr > Umfeld > Zahlungsträger > Zahllaufübergreifende Zahlungsträger > Zahlungsträger erstellen. | Das Bild Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird angezeigt. |  |
| 15 | Daten eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Datum der Ausführung: z.B. <Tagesdatum>  Identifikation: z.B. TRM01R | Im Dialogfenster Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird die Meldung Sammler XX/XX/20XX XXXXXX wurde angelegt oder aktualisiert angezeigt. Der BCM-Batch wurde angelegt.  Für einen Batch sind ggf. weitere Genehmigungen erforderlich, bevor schließlich der Zahlungsträger angelegt wird. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Erweiterte Kassenvorgänge(J78). |  |

#### Von Bank initiierte Zahlung

Zweck

Wenn die Ausgangszahlung von der Bank initiiert wird, ist es nicht notwendig, die vorherigen Schritte [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 und [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133 durchzuführen.

Vorgehensweise

Dieser Schritt erfordert keine Schritte im SAP-System.

#### Im Hauptbuch buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit den Buchungsfunktionen werden die buchungsbezogenen Cashflows an die FI-Schnittstelle übertragen, die die relevanten Buchungen in der Finanzbuchhaltung erzeugt. Für die Buchung von Bewegungen stehen zwei SAP-Fiori-Apps zur Verfügung:

* Bewegungen buchen(TBB1): Diese SAP-Fiori-App unterstützt das Erzeugen von Buchungen für Eingangszahlung und Ausgangszahlung ohne Zahlungsanforderung. Sie können diese App nicht verwenden, um Buchungen für Ausgangszahlungen zu erzeugen, die Sie im vorherigen Schritt [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 über die Option Nur zahlen bearbeitet haben.
* Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10): Verwenden Sie diese SAP-Fiori-App, um Buchungen für Ausgangszahlungen zu erzeugen, die Sie im vorherigen Schritt [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 über die Option Nur zahlen bearbeitet haben.

Voraussetzungen

Mittels Zahlungsanforderung vorgenommene Ausgangszahlungen wurden im vorherigen Verfahren Zahlungsanforderung für fällige Transaktion erstellen mit der Option Nur Zahlen verarbeitet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein:  Devisen: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummer mit dem Zugang, die in den vorherigen Schritten angelegt wurde, für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) ist es das kurze Leg>  Bis einschl. Fälligkeitsdatum: Geben Sie das Datum ein, an dem die Bewegung des Finanzgeschäfts gebucht werden soll, z.B. <Tagesdatum>.  Testlauf: markiert  Nur operativ buchen: markiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Überprüfen Sie auf dieser Sicht die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Hinweis Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt.  Wenn die Meldung Es sind keine Bewegungen zur Bearbeitung vorhanden angezeigt wird, ist keine Buchung für Ihre Selektionskriterien erforderlich.  Sie können die nächsten Schritte überspringen und mithilfe der App Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10) mit Schritt 6 fortfahren. |  |
| 4 | Zurück | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 5 | Echtlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Der Buchhaltungsbeleg wird für die Eingangszahlung in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |
| 6 | Andere SAP-Fiori-App aufrufen | Kehren Sie zum SAP Fiori Launchpad zurück, und öffnen Sie Geschäftsvorfälle verarbeiten(TPM10). | Die Sicht Geschäfte fixieren, buchen oder stornieren wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  Abgrenzung über Geschäftsnummer: Entmarkieren Sie dieses Ankreuzfeld.  Abgrenzung über Nebenbuchbestände: markiert  Geschäft: <Geschäftsnummer mit Abgang und zugehöriger Zahlungsanordnung, die Sie in vorherigen Verfahren „Zahlungsanordnung erzeugen“ generiert haben, für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) ist es das lange Leg>  Testlauf: markiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Testlauf: Geschäftsvorfälle buchen/stornieren wird angezeigt.  Wenn die Meldung Es wurden keine Geschäftsvorfälle selektiert angezeigt wird, sind für Ihre Selektionskriterien keine Buchungen erforderlich. In diesem Fall können Sie diesen Schritt überspringen. |  |
| 8 | Testlaufergebnis prüfen | Wählen Sie Alle markieren.  Wählen Sie Zu buchende auswählen.  Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Testlauf: Anzeige gebuchte/stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. |  |
| 9 | Protokoll und Nachrichten | Wählen Sie Protokolle und Nachrichten. | Das Bild Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Überprüfen Sie auf dieser Sicht die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0).  Hinweis Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 10 | Zurück | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Geschäfte fixieren, buchen oder stornieren wird angezeigt. |  |
| 11 | "Testlauf" entmarkieren | Nehmen Sie die folgende Änderung vor:  Testlauf: entmarkiert  Wählen Sie Ausführen. | Die Sicht Echtlauf: Geschäftsvorfälle buchen/stornieren wird angezeigt. |  |
| 12 | Echtlauf | Wählen Sie Alle markieren.  Wählen Sie Zu buchende auswählen.  Wählen Sie Ausführen. | Das Bild Echtlauf: Anzeige gebuchte/stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. |  |
| 13 | Protokoll und Nachrichten | Wählen Sie Protokolle und Nachrichten. | Das Bild Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Der Buchhaltungsbeleg wird für die Ausgangszahlung in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |

### Periodenende wurde erreicht

#### Marktwert der Geschäfte berechnen oder pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt ermitteln Sie die Marktwerte (Barwerte) von Finanzgeschäften.

Der Barwert kann automatisch mit dem Market Risk Analyzer (MRA) berechnet werden. Er wird in der Tabelle VTVBAR gesichert. Diese Werte können dann für die buchhalterische Bewertung verwendet werden. Zusätzlich können Sie den relevanten Barwert manuell pflegen.

Die in der Komponente Market Risk Analyzer (MRA) vorab ausgelieferte Konfiguration bietet drei Möglichkeiten zur automatischen Barwertberechnung mit der App Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA):

* Risikofreier Barwert: Mit der Auswertungsart ohne Basis-Spread-Kurve oder Credit-Spread-Kurve berechnet das System nur den risikofreien Barwert.
* Risikoberücksichtigender Barwert mit Credit-Spread-Kurve: Mit der Auswertungsart mit Credit-Spread-Kurve berechnet das System den risikofreien Barwert unter Verwendung der risikofreien Zinskurve sowie den (risikobasierten) Barwert unter Berücksichtigung der Credit Spreads.
* Risikoberücksichtigender Barwert mit Basis-Spread-Kurve und Credit-Spread-Kurve: Mit der Auswertungsart mit Basis-Spread-Kurve und Credit-Spread-Kurve berechnet das System den risikofreien Barwert unter Verwendung der risikofreien Zinskurve und der Basis-Spread-Kurve sowie den (risikobasierten) Barwert unter Berücksichtigung der Credit Spreads.

Es gibt zwei Berechnungsmethoden für CVA und DVA:

* Basierend auf erwarteten Exposures
* Differenzmethode

Die Formel für den Barwert lautet: Barwert = risikofreier Barwert - CVA - DVA.

Voraussetzungen

Stellen Sie vor der Barwertberechnung mit der App Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA) sicher, dass die relevanten Marktdaten (Zinssätze, Umrechnungskurse, Credit Spreads usw.) für das Auswertungsdatum gepflegt wurden. Weitere Informationen zur Pflege von Marktdaten finden Sie im Testskript Market Rates Management – manuell per Upload (1XN).

Wenn Sie den Barwert für Ihre Option mit impliziten Volatilitäten berechnen möchten, weisen Sie Währungspaare für Volatilitäten mit Moneyness zu, und geben Sie Werte für Volatilitäten mit Moneyness ein. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Market Rates Management – manuell per Upload (1XN). Wenn Sie keine Währungspaare für Volatilitäten mit Moneyness zuordnen oder Werte für Volatilitäten mit Moneyness eingeben, berechnet das System die Option mit historischen Volatilitäten.

Vorgehensweise

Option 1: Barwert automatisch berechnen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Barwerte berechnen - Mit CVA und DVA(TPM60CVA). | Das Bild Barwerte inklusive Credit und Debit Value Adjustments ermitteln wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben und ausführen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Auswertungsparameterableitung: <entmarkieren>  OTC-Geschäft auswählen: <markieren>  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Geschäftsnummern aus vorherigen Schritten; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  Auswertungsdatum: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  CVD/DVA-Art: Lassen Sie zur Berechnung des risikofreien Barwerts dieses Feld leer. Geben Sie zur Berechnung von risikobasiertem Barwert und CVA/DVA den Wert Y01 ein.  Auswertungsart: Geben Sie zur Berechnung des risikofreien Barwerts den Wert Y001 ein. Geben Sie zur Berechnung von risikobasiertem Barwert und CVA/DVA den Wert Y002 ein.  Testlauf: <entmarkieren>  Kurs-/Barwertart: 001  Werte mit Warnungen sichern: <Markieren>  Detailprotokoll (and. BerSchritte):<markieren> | Das Bild Barwerte inkl. CVA/DVA aus dem Market Risk Analyzer wird angezeigt. Sie sehen dort zu jedem Geschäft den Barwert, risikofreien Barwert, CVA und DVA.  Über die folgenden Drucktasten können Sie weitere Informationen prüfen:   * Einzelgeschäft: * CVA/DVA-Kennzahlen * Detailprotokoll * Berechnungsgrundlagen * Fehlerprotokoll |  |

Option 2: Barwert manuell pflegen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad mit der Rolle Treasury-Spezialist - Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Barwerte eingeben(JBNPV). | Das Bild Barwerte eingeben(JBNPV)wird angezeigt. Das Dialogfenster Feldauswahl wird angezeigt. |  |
| 3 | Feldauswahl | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: <markieren>  Geschäft: <markieren> | Das Dialogfenster Arbeitsbereich festlegen: Eingabe wird angezeigt. |  |
| 4 | Feldauswahl | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <in vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.> | Die Sicht Sicht "Barwerte von OTC-Geschäften" anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
|  |  | Wählen Sie Bearbeiten | Die Sicht Sicht "Barwerte von OTC-Geschäften" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 5 | Barwert eingeben | Wählen Sie Neue Einträge.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Vertr Art: z.B. Geldhandel  Bukr: z.B. 1010  Vorgang: <in vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  Kurs-/Barwertart: 001  Gültig ab: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  Barwert: <Wert des (risikobasierten) Barwerts>  Währung: z.B. EUR  Risikofreier Barwert: <Wert des risikofreien Barwerts>  CVA: <Wert des CVA>  DVA: <Wert des DVA>  Hinweis Um den Credit Spread für die buchhalterische Bewertung abzubilden, pflegen Sie den risikobasierten Barwert im Feld Barwert, und geben Sie dann das CVA/DVA ein, das die Differenz zwischen risikofreiem Barwert und risikobasiertem Barwert ist. Barwert = risikofreier Barwert – CVA – DVA. Geben Sie ansonsten den Wert des risikofreien Barwerts im Feld Barwert ein, und lassen Sie die Felder CVA und DVA leer. | Der manuell gepflegte Barwert wird gesichert. |  |

#### Stichtagsbewertung durchführen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Mit der Bewertungsfunktion bewerten Sie die Positionen der Finanzinstrumente, die auf den historischen Kosten oder dem Marktwert zu einem bestimmten Stichtag basieren, und die Ergebnisse werden in die Finanzbuchhaltung übertragen.

Voraussetzungen

Es wurden Marktwerte (NPV) für Finanzgeschäfte berechnet oder gepflegt, deren Bewertung als Marktwerte (NPV) gemäß den Rechnungslegungsvorschriften erfolgt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Buchhalter am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewertung ausführen(TPM1). | Das Bild Bewertung durchführen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Im Bereich Produktgruppen  OTC-Geschäfte: <markieren Sie dieses Ankreuzfeld>  Im Bereich Allgemeine Abgrenzungen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  Geschäft: <In vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  Im Bereich Bewertungsparameter:  Stichtag der Bewertung: z.B. <letztes Datum des aktuellen Monats>  Bewertungstyp: z.B. unterjährige Bewertung mit Rücknahme  Hinweis Wenn das Periodenende dem Jahresende entspricht, verwenden Sie den Bewertungstyp Jahresabschlussbewertung.  Testlauf: <markiert> | Das Bild Für Bewertung ausgewählte Treasury-Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 4 | Bewertung für Testlauf durchführen | Wählen Sie Bewertung durchführen.  Wenn ein Dialogfenster mit einer Meldung angezeigt wird, wählen Sie Weiter. | Das Bild Bewertungsprotokoll wird angezeigt. Sollte eine rote Ampel angezeigt werden, klicken Sie darauf, um die Fehlermeldung zu prüfen. Beheben Sie den Fehler, und führen Sie einen weiteren Testlauf aus, bis kein Fehler mehr auftritt.  Sie können die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) prüfen, indem Sie Protokolle + Nachrichten wählen. Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt.  Hinweis Es kann vorkommen, dass keine simulierte Buchung vorhanden ist, da für das von Ihnen ausgewählte Geschäft keine Bewertung erforderlich ist. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis das Bild Bewertung durchführen angezeigt wird.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: <entmarkieren> | Das Bild Für Bewertung ausgewählte Treasury-Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 6 | Bewertung für Echtlauf durchführen | Wählen Sie Bewertung durchführen. | Das Bild Bewertungsprotokoll wird angezeigt. Prüfen Sie die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0), indem Sie Protokolle + Nachrichten wählen. Der Buchhaltungsbeleg wird in den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) angelegt. |  |

### Geschäft ist fällig

Zweck

In diesem Abschnitt werden die bei Fälligkeit eines Optionsgeschäfts erforderlichen Vorgänge beschrieben. Der Benutzer muss entscheiden, ob er die Option ausübt oder verfallen lässt und die folgenden Vorgänge ausführt.

#### Bericht zur Sammelbearbeitung von Devisenoptionen überprüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen Sie den Status der Geschäfte und führen entsprechende Vorgänge aus.

Wenn es sich um eine Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption handelt, führen Sie die folgenden Schritte (Ausübung oder Nichtinanspruchnahme) für das lange Leg durch.

Wenn sich das lange Leg beim Ablauf im Geld befindet, führt das Unternehmen in der Regel das lange Leg aus und der Vertragspartner lässt das kurze Leg ablaufen.

Wenn sich das lange Leg beim Ablauf nicht im Geld befindet, lässt das Unternehmen in der Regel das lange Leg ablaufe und der Vertragspartner führt das kurze Leg aus.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des fälligen Geschäfts; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern des langen Legs ein.> | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird mit den Optionsgeschäften angezeigt. |  |

##### Entscheidung für "Ausübung"

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität führen Sie den Vorgang für die Ausübung einer fälligen Devisenoption aus.

Voraussetzungen

* Ein Devisenoptionsgeschäft ist vorhanden, wurde auf den Status "Vertragsabrechnung" aktualisiert und erreicht seine Fälligkeit.
* Rufen Sie das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wie in [Bericht zur Sammelbearbeitung von Devisenoptionen überprüfen](#unique_152) [Seite ] 216 beschrieben auf.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des fälligen Geschäfts; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern des langen Legs ein.> | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird mit den Optionsgeschäften angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft auswählen und ausüben | Wählen Sie ein Geschäft aus, das den folgenden Kriterien entspricht, und wählen Sie Ausüben:  Aktivitätstyp Name: Vertragsabrechnung | Das Bild OTC-Option: Vorgang hinzufügen wird mit Buchungskreis und Geschäft angezeigt. |  |
| 5 | Ausführen | Wählen Sie Enter. | Das Bild OTC-Option Vorgang hinzufügen: Ausstattung wird angezeigt. |  |
| 6 | Daten eingeben und sichern | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Ausübungsdatum überprüfen:  Bei Europäisch als Ausübungsart muss das Ausübungsdatum der Ausübungsfrist entsprechen.  Bei Amerikanisch als Ausübungsart muss das Ausübungsdatum vor der Ausübungsfrist liegen oder ihr entsprechen.  Hinweis Vergewissern Sie sich, dass das Abschlussdatum vor der Ausübungsfrist liegt. | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

##### Kassakontrakt anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität führen Sie die Vorgänge nach der Ausübung einer Währungsoption aus, um ein Devisenkassageschäft anzulegen.

Voraussetzungen

Ein Devisenoptionsgeschäft wurde ausgeübt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des fälligen Geschäfts; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern des langen Legs ein.> | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird mit den Optionsgeschäften angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft auswählen und abrechnnen | Wählen Sie ein Geschäft aus, das den folgenden Kriterien entspricht, und wählen Sie Abrechnen.  Aktivitätstyp Name: Übung | Das Bild OTC-Option: Vorgang hinzufügen: Ausstattung wird mit Buchungskreis und Geschäft angezeigt. |  |
| 5 | Ausführen | Wählen Sie Enter. | Das Bild OTC-Option Vorgang hinzufügen: Ausstattung wird angezeigt. |  |
| 6 | Daten eingeben und sichern | Wählen Sie Sichern. | Das Bild Kassa-/Termingeschäft Anlegen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 7 | Daten überprüfen und sichern | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Geschäftsart: 107 Kassageschäft von Option  Die bearbeitbaren Felder werden mit den Werten des ausgeübten Optionsgeschäfts vorbelegt. Bestätigen Sie sie, und wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert, und eine neue Geschäftsnummer wird generiert. |  |

Beachten Sie die vorherigen Schritte für die nachfolgenden Vorgänge (wie Cash Operations, Korrespondenz, Periodenende wurde erreicht).

Alle Schritte ab einschließlich Grundlegende Kassenvorgänge (BFB) unter dem Abschnitt Risikomanagement für Fremdwährungen und Rechnungswesen – Ohne Optionen

##### Entscheidung für "Verfall"

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität führen Sie den Vorgang für den Verfall einer fälligen Devisenoption aus.

Voraussetzungen

* Ein Devisenoptionsgeschäft ist vorhanden, wurde auf den Status "Vertragsabrechnung" aktualisiert und erreicht seine Fälligkeit.
* Rufen Sie das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung entsprechend der Beschreibung unter Bericht zur Sammelbearbeitung von Devisenoptionen überprüfen auf.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des fälligen Geschäfts; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Nummern der fälligen Geschäfte des kurzen Legs ein.> | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird mit den Optionsgeschäften angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft auswählen und ausüben | Wählen Sie ein Geschäft aus, das den folgenden Kriterien entspricht, und wählen Sie Verfall:  Aktivitätstyp Name: Vertragsabrechnung | Das Bild OTC-Option: Vorgang hinzufügen wird mit Buchungskreis und Geschäft angezeigt. |  |
| 5 | Ausführen | Wählen Sie Enter. | Das Bild OTC-Option Vorgang hinzufügen: Ausstattung wird angezeigt. |  |
| 6 | Daten eingeben und sichern | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Hinweis Vergewissern Sie sich, dass das Abschlussdatum vor der Ausübungsfrist liegt. | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

#### Realisierten Gewinn und Verlust buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Bereich fixieren und buchen Sie abgeleitete Geschäftsvorfälle (in der Regel realisierter Gewinn und Verlust bei fälligen Geschäften).

Voraussetzungen

Das Fälligkeitsdatum des Geschäfts ist erreicht.

Das Finanzgeschäft wurde angelegt, abgerechnet und gebucht.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Abgeleitete Geschäftsvorfälle buchen(TPM18). | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: z.B. DE0  OTC-Geschäfte: <Nummern der fälligen Geschäfte; geben Sie für die Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption (Zylinderoption) die Geschäftsnummern beider Legs ein.>  TRL-Datum: <Fälligkeitsdatum des Geschäfts>  Testlauf: markiert  Bestätigen Sie die Meldung Sind Sie sicher, dass Sie zukünftige Geschäftsvorfälle auswählen möchten?, indem Sie Enter wählen. | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt.  Falls die Meldung Zur Selektion wurden keine geplanten abg. Geschäftsvorfälle gefunden angezeigt wird, ist für Ihre Selektion kein abgeleitetes Geschäft verfügbar. In diesem Fall können Sie diesen Schritt überspringen. |  |
| 4 | Für Testlauf fixieren und buchen | Wählen Sie Fixieren. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Sie sehen die simulierten Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0). Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis Sie zum Einstiegsbild der App gelangen.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: Entmarkieren  Bestätigen Sie die Meldung Sind Sie sicher, dass Sie zukünftige Geschäftsvorfälle auswählen möchten?, indem Sie Enter wählen. | Das Bild Abgeleitete Geschäftsvorfälle fixieren und buchen wird angezeigt. |  |
| 6 | Für Echtlauf fixieren und buchen | Wählen Sie Fixieren. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Sie sehen die Buchungsinformationen für die nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0). In den nationalen Rechnungslegungsvorschriften (Bewertungsbereich DE0) wird ein Buchhaltungsbeleg angelegt. |  |

## Reporting

### Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Bestandsbewegungen an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Buchhalter am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen(F1754). | Das Bild Treasury-Bestandsbewegungen anzeigen(F1754) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Produktgruppe: z.B. OTC-Geschäfte  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Bestandsbewegungsdaten werden den Filterwerten entsprechend angezeigt. |  |

### Treasury-Alerts anzeigen – Buchung

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Treasury-Alerts für die Buchung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Alerts anzeigen - Buchung(F4984). | Das Bild Treasury-Alerts anzeigen - Buchung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Meldung ausgeben für: Buchung  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Alert-Daten werden den Filterwerten entsprechend angezeigt. |  |

### Treasury-Alerts anzeigen – Abrechnung, Freigabe, Zahlung und Korrespondenz

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Treasury-Alerts für verschiedene Arten von Transaktionen an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Alerts anzeigen - Abrechnung(F4979). | Das Bild Treasury-Alerts anzeigen - Abrechnung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Folgendes ein, und wählen Sie Starten:  Meldung ausgeben für: Abrechnung  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Alert-Daten werden entsprechend der Filterwerte angezeigt. |  |
| 4 | Alerts für andere Transaktionen bestätigen | Wählen Sie andere Werte im Feld Meldung ausgeben für. |  |  |
| 5 | Treasury-Alerts anzeigen mit Freigabe | Öffnen Sie die App Treasury-Alerts anzeigen - Freigabe(F4980). | Das Bild Treasury-Alerts anzeigen - Freigabe wird mit "Meldung ausgeben für: Freigabe" angezeigt. Freigabe" angezeigt. |  |
| 6 | Treasury-Alerts anzeigen mit Zahlung | Öffnen Sie Treasury-Alerts anzeigen - Zahlung(F4981). | Das Bild Treasury-Alerts anzeigen - Zahlung wird mit "Meldung ausgeben für: Zahlung" angezeigt. |  |
| 7 | Treasury-Alerts anzeigen mit Korrespondenz | Öffnen Sie Treasury-Alerts anzeigen - Korrespondenz(F4983). | Das Bild Treasury-Alerts anzeigen - Korrespondenz wird mit "Meldung ausgeben für: Korrespondenz" angezeigt. |  |

### Zahlungsplan anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie den Zahlungsplan für fällige ausgehende Finanzströme an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Buchhalter am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Zahlungspläne anzeigen(TJ04). | Das Bild Treasury: Zahlungspläne wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Laufzeitende in der Zukunft: markiert  Laufzeitende abgelaufen: markiert  Zahlungszeitraum: z.B. <aktuelles Datum> bis <aktuelles Datum + 5 Tage>  Zahlungsstatus: z.B. 1  Fehlerprotokoll ausgeben: markiert | Sie können den Zahlungsplanbericht prüfen. |  |

### Treasury-Buchungsjournal anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Buchungsjournale zur Prüfung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen SieTreasury-Buchungsjournal anzeigen(F1755). | Das Bild Treasury-Buchungsjournal anzeigen(F1755)wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Starten:  Produktgruppe: z.B. OTC-Geschäfte  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Buchungsjournale werden den Filterwerten entsprechend angezeigt. |  |

### Treasury-Bestandsanalyse

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität zeigen Sie die Treasury-Bestandsanalyse zur Prüfung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Bestandsanalyse (barrierefrei)(W0049). | Das Bild Treasury-Bestandsanalyse(F3167) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die Selektionskriterien ein, und wählen Sie Starten.  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Plandaten einbeziehen: z.B. 1  Bewertungsbereich: z.B. DE0  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. 60A, 60B und 76A  Sie können die Enter-Taste verwenden, wenn Sie mehrere Produktarten eingeben. Beispiel: Geben Sie 60A ein, und drücken Sie die Enter-Taste. Geben Sie dann 60B ein, und drücken Sie Enter. | Die Bestandsanalysedaten werden den Filterwerten entsprechend angezeigt. |  |

### Treasury-Bestandswerte anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Treasury-Bestandswerte an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Bestandswerte anzeigen(F1867). | Das Bild Listen-Report wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Starten:  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Produktgruppe: z.B. OTC-Geschäfte  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Daten der Bestandswerte werden den Filterwerten entsprechend angezeigt. |  |

### Finanzpositionen definieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität definieren Sie eine Reihe von Kennzahlen zur Anzeige auf den Bildern Finanzstatus - Buchwert und Finanzstatus - Nominalbetrag.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Finanzbestände definieren(FTR\_FP\_DEF). | Das Bild Sicht "Finanzpositionsgruppen pflegen" anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Kennzahlengruppen pflegen | Wählen Sie Bearbeiten  Wählen Sie Neue Einträge.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Finanzpositionsgruppe: z.B. FPG\_A0001  Finanzpositionsgruppenbeschreibung: z.B. Bankkonten und kurzfristige Kapitalanlage  Aktiv/Passiv: z.B. Aktiva | Die Daten werden gesichert. |  |
| 4 | Kennzahlen pflegen | Wählen Sie die Registerkarte Finanzpositionen pflegen.  Wählen Sie Neue Einträge.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern.  Finanzposition: z.B. FP\_A0001  Finanzpositionsbeschreibung: z.B. Bankkonten  Finanzpositionsgruppe: z.B. FPG\_A0001  Datenquelle: z.B. One Exposure | Die Daten werden gesichert. |  |
| 5 | Auswahl pflegen | Markieren Sie die obige Finanzposition, wählen Sie Zurück und dann Auswahl pflegen.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie anschließend Zurück:  Hausbank: z.B. DEBK1  Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 6 | Weitere Daten erfassen | Wiederholen Sie die obigen Schritte mit den Daten aus der folgenden Tabelle. |  |  |

Finanzpositionsgruppen

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Finanzpositionsgruppe | Finanzpositionsgruppenbeschreibung | Aktiv/Passiv |
| FPG\_A0001 | Bankkonten und kurzfristige Kapitalanlage | Aktiva |
| FPG\_A0002 | Langfristige Kapitalanlage und sonstige Vermögens-Gegenstände | Aktiva |
| FPG\_L0001 | Kurzfristige Schulden | Passiva |
| FPG\_L0002 | Langfristige Schulden und sonstige Verbindlichkeiten | Passiva |

Finanzpositionen

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Finanzposition | Finanzpositionsbeschreibung | Finanzpositionsgruppe | Datenquelle | Auswahl pflegen |
| FP\_A0001 | Bankkonten | FPG\_A0001 | One Exposure | Hausbank |
| FP\_A0002 | Kurzfristige Beteiligungen | FPG\_A0001 | Treasury-Bestandsführung | Produktart = 51A bis 55A Geschäftsart = 100 bis 199  Bewertungsklasse = 20 bis 29  Bewertungsbereich = DE0  Buchungsstatus = 2 |
| FP\_A0003 | Langfristige Beteiligungen | FPG\_A0002 | Treasury-Bestandsführung | Produktart = 51A bis 55A  Vorgangsart = 100 bis 199  Bewertungsklasse = 10 bis 19  Bewertungsbereich = DE0  Buchungsstatus = 2 |
| FP\_A0004 | Sonstige Vermögens-Gegenstände | FPG\_A0002 | Belegsalden | Kontonummer = 12041000 bis 12041999  12042000 bis 12042999  12701000 bis 12701999 Kontenplan = YCOA Ledger = 0L |
| FP\_L0001 | Kurzfristige Schulden | FPG\_L0001 | Treasury-Bestandsführung | Produktart = 51A bis 55A Geschäftsart = 200 bis 299  Bewertungsklasse = 20 bis 29  Bewertungsbereich = DE0  Buchungsstatus = 2 |
| FP\_L0002 | Langfristige Schulden | FPG\_L0002 | Treasury-Bestandsführung | Produktart = 51A bis 55A Geschäftsart = 200 bis 299  Bewertungsklasse = 10 bis 19  Bewertungsbereich = DE0  Buchungsstatus = 2 |
| FP\_L0003 | Sonstige Verbindlichkeiten | FPG\_L0002 | Belegsalden | Kontonummer = 22541000 bis 22541999  22542000 bis 22542999  Kontenplan = YCOA Ledger = 0L |

### Finanzstatus (Buchwert)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie den Finanzstatus für Buchwerte an.

Voraussetzungen

Finanzbestände wurden bereits definiert. Weitere Informationen finden Sie unter [Finanzpositionen definieren](#unique_89) [Seite ] 234.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Finanzstatus - Buchwert(F2136). | Das Bild Finanzstatus – Buchwert wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Starten:  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Anzeigewährung: z.B. EUR  Kurstyp, z.B M  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Daten werden entsprechend der Filterwerte angezeigt. |  |

### Finanzstatus (Nominalbetrag)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie den Finanzstatus eines Nominalbetrages an.

Voraussetzungen

Finanzbestände wurden bereits definiert.

Weitere Informationen finden Sie unter [Finanzpositionen definieren](#unique_89) [Seite ] 234.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Finanzstatus - Nominalbetrag(F3168). | Das Bild Finanzstatus – Nominalbetrag wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Starten:  Stichtag: z.B. <aktuelles Datum>  Anzeigewährung: z.B. EUR  Wechselkurstyp: z.B. M  Buchungskreis: z.B. 1010 | Die Daten werden entsprechend der Filterwerte angezeigt. |  |

### Treasury-Zahlungen anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Arbeitsschritt zeigen Sie alle Zahlungsjournale zur Prüfung an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Treasury-Zahlungen anzeigen(TPM20A). | Das Bild Zahlungsjournal wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: 60A | Die Zahlungsjournale werden angezeigt. |  |
| 4 | Daten prüfen | Prüfen Sie die Daten, die auf dem Bild angezeigt werden. Sie können auch Ursprungs-Geschäftsvorfall oder Details wählen, um einen Drilldown auf weitere Details auszuführen. |  |  |

### Barwert analysieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität berechnen Sie das Barwertergebnis und zeigen dieses an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Barwert analysieren(JBRX). | Das Bild Barwertanalyse: Anzeige von Einzelwerten wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien der generischen Selektion eingeben | Geben Sie folgende Daten ein:  Auswertungswährung: z.B. EUR  Auswertungsart: z.B. Y001  Auswertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Horizont: z.B. <Enddatum des aktuellen Monats>  Portfoliohierarchie: z.B. 100 | Das System berechnet den Barwert zum Horizontdatum, wählt aber die Bewegungsdaten und Marktdaten für das Auswertungsdatum aus. |  |
| 4 | Selektionskriterien der Merkmale eingeben | Wählen Sie die Registerkarte Merkmale. |  |  |
| 5 | Selektionskriterien der Merkmale eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. 60A | Das Barwertergebnis wird auf der Grundlage der Portfoliohierarchie angezeigt. |  |

### Marktrisikokennzahlen berechnen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Mit dieser Funktion können Sie die Kennzahlen für die Barwertanalyse und die Sensitivitätskennzahlen für eine Auswahl von Transaktionen online berechnen und anzeigen. Sie können auch berechnete Kennzahlen als Grundlage für die Definition formelbasierter Kennzahlen verwenden und diese mit den Barwert- und Sensitivitätskennzahlen anzeigen.

Voraussetzung

Das Berichtslayout für Kennzahlen wurde gepflegt. Folgen Sie dem Verfahren <#unique_154> im Anhang .

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Marktrisikokennzahlen berechnen(AISGENKF). | Das Bild Einzelwertanalyse für generische Kennzahlen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien der generischen Selektion eingeben | Geben Sie folgende Daten ein:  Auswertungswährung: z.B. EUR  Auswertungsart: z.B. Y001  Auswertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Horizont: z.B. <aktuelles Datum>  Berichtslayout z.B. <Y01 oder anderes Berichtslayout, das Sie angelegt haben>  Portfoliohierarchie: z.B . 100 | Das System berechnet den Barwert zum Horizontdatum, wählt aber die Bewegungsdaten und Marktdaten für das Auswertungsdatum aus. |  |
| 4 | Selektionskriterien eingeben | Wählen Sie die Registerkarte Merkmale. |  |  |
| 5 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. 60A bis: z.B. 60B | Die Einzelwertanalyse des zugeordneten Berichtslayouts wird angezeigt. |  |

### Sensitivitätskennzahlen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität verarbeiten Sie die Sensitivitätskennzahlen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Sensitivitätskennzahlen - Einzelanalyse(AISS). | Das Bild Sensitivitätskennzahlen - Einzelanalyse(AISS) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien der generischen Selektion eingeben | Geben Sie folgende Daten ein:  Anzeigewährung: z.B. EUR  Auswertungsart: z.B. Y001  Auswertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Horizont: z.B. <Enddatum des aktuellen Monats>  Portfoliohierarchie: z.B. 100 | Das System berechnet den Barwert zum Horizontdatum, wählt aber die Bewegungsdaten und Marktdaten für das Auswertungsdatum aus. |  |
| 4 | Merkmale | Wählen Sie die Registerkarte Merkmale. |  |  |
| 5 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Produktart: z.B. 60A | Die Sensitivitätskennzahlen werden auf der Grundlage der Portfoliohierarchie angezeigt. |  |

### Bericht "Limitinanspruchnahmen prüfen"

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen Sie die Limitinanspruchnahmen mithilfe des entsprechenden Berichts.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Limitinanspruchnahmen prüfen(TBLB). | Das Bild Übersicht Limitinanspruchnahmen - Auswahl über alle Merkmale wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Limitart: z.B. Y01  Status der Inanspruchnahme: z.B. 1  Ermittlungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Vorgaben gültig ab: z.B. <aktuelles Datum> | Das System zeigt anhand Ihrer Selektionskriterien eine Übersicht der Limitinanspruchnahmen an. |  |

### Schwellenwertberechnung ausführen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität bereiten Sie die Daten für das Clearing-Schwellen-Reporting vor.

Voraussetzung

In diesem Schritt werden nur bestehende Bewegungsdaten wie Devisengeschäfte, Zinsswapgeschäfte usw. verarbeitet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kennzahlen für Clearing-Schwelle berechnen(FTR\_THRESHOLD\_CALC). | Das Bild Kennzahlen für Clearing-Schwellen-Report berechnen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Rechtsgrundlage: 01  CSR Entität: z.B. 1000  Stichtag: Geben Sie die Datumsangaben für den Zeitraum an, für den die Daten vorbereitet werden sollen. Beispiel: Tagesdatum – 7 bis Tagesdatum  Testlauf: markiert  Ergebnisse anzeigen: markiert | Das Bild Kennzahlen für Clearing-Schwellen-Report berechnen wird mit dem Ergebnis der Clearing-Schwellenauslastung für den angegebenen Zeitraum auf täglicher Basis angezeigt.  Hinweis Wenn der angegebene Zeitraum einen arbeitsfreien Tag enthält, wird eine Meldung angezeigt. |  |
| 4 | Echtlauf | Wählen Sie Zurück. | Das Bild Kennzahlen für Clearing-Schwellen-Report berechnen wird angezeigt. |  |
| 5 | Echtlauf | Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Kennzahlen für Clearing-Schwellen-Report berechnen wird mit dem Ergebnis der Clearing-Schwellenauslastung für den angegebenen Zeitraum auf täglicher Basis angezeigt. |  |

### Schwellen-Report prüfen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen Sie die Daten für das Clearing-Schwellen-Reporting.

Voraussetzung

Der Schritt "Schwellenwertberechnung ausführen" für den Echtlauf muss abgeschlossen sein, bevor Daten für dieses Verfahren verfügbar sind.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Clearing-Schwellen-Report(FTR\_THRESHOLD\_DISP). | Das Bild Clearing-Schwellen-Report(FTR\_THRESHOLD\_DISP) wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Rechtsgrundlage: 01  CSR Entität: z.B. 1000  Stichtag: <Geben Sie die Datumsangaben für den Zeitraum an, für den die Daten geprüft werden sollen.> Beispiel: Tagesdatum – 7 bis Tagesdatum | Das Bild Clearing-Schwellen-Report(FTR\_THRESHOLD\_DISP) wird mit Daten auf Tagesbasis angezeigt. |  |

# Anhang

## Exposure Management

### Übersicht über Rohexposures

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität können Sie Rohexposures überprüfen und zusammen bearbeiten.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Rohexposures verarbeiten - Sammelbearbeitung(FTREX2). | Das Bild Rohexposures: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Wählen Sie Ausführen.  Hinweis Sie können bei Bedarf auch Kriterien eingeben, um die Rohexposures zu filtern. | Das Bild Rohexposures: Übersicht wird mit den Rohexposure-Datensätzen angezeigt. |  |

### Exposure-Positionen bearbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen und bearbeiten Sie die Exposure-Positionen zu einem bestimmten Stichtag.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Exposure-Positionen bearbeiten(FTREX12). | Das Bild Rohexposure-Positionen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Stichtag: z.B. <Tagesdatum> | Das Bild Exposure-Positionen vom wird mit den Exposure-Positionen des angegebenen Datums angezeigt. |  |

### Bewegungen der Exposure-Bestände anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität prüfen und bearbeiten Sie die Bewegungen der Exposure-Bestände.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen der Exposure-Bestände anzeigen(FTREX13). | Das Bild Exposurebestandsbewegungen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Exposure-Positionstyp: z.B. YFX | Das Bild Exposure-Positionen vom wird angezeigt. |  |

### Beschreibung der Vorlage für den Import von Rohexposures

|  |  |
| --- | --- |
| Feldname | Beschreibung |
| Externe Belegnummer | Ein Parameter zur Übergabe der externen Belegnummer für die BAPI-Methoden des Business-Objekts "Rohexposure" im neuen Exposure Management (BUS5990). Dieser Parameter stellt die Referenzbelegnummer dar, auf die sich das Rohexposure bezieht, und bildet zusammen mit der Exposure-Herkunft und dem logischen System den Schlüssel zur eindeutigen Identifizierung eines Rohexposures. |
| Exposure-Herkunft | Ein Parameter zur Übergabe der Exposure-Herkunft für die BAPI-Methoden des Business-Objekts "Rohexposure" im neuen Exposure Management (BUS5990). Dieser Parameter steht für die Herkunft des Rohexposures (MM, SD usw.) und bildet zusammen mit der externen Belegnummer und dem logischen System den Schlüssel zur eindeutigen Identifizierung eines Rohexposures. |
| Logisches System | Im SAP-System entspricht der Mandant einem logischen System. Für den Austausch von Daten zwischen Systemen wird vorausgesetzt, dass jedes System im Netzwerk eine eindeutige ID hat. Das logische System dient zu diesem Zweck. |
| Exposure-Aktivitätsart | Die Exposure-Aktivitätsart beinhaltet einen Exposure-Typ für Devisen und einen Exposure-Typ für ein Commodity. Darüber hinaus legt sie fest, ob das Commodity-Risiko Klassisch (Nur Preisfindungsrisiko) oder ein Preisfindungs- und Lieferungsrisiko ist.  Die Exposure-Aktivitätsart gibt einem Exposure eine semantische Bedeutung. Darüber hinaus liegt sie der Funktionalität der dynamischen Feldselektion zugrunde. Ein Rohexposure wird immer mit einer Exposure-Aktivitätsart angelegt. |
| Exposure-Typ des Rohexposures | Ein Rohexposure kann in Exposure-Typen wie Geplantes Geschäft, Obligo-Geschäft oder Asset/Liability-Geschäft kategorisiert werden.  Der Exposure-Typ dient der Differenzierung der Exposure-Positionen, da die Hedge-Accounting-Regeln für die verschiedenen Exposure-Typen unterschiedlich sind. |
| Länderschlüssel | Der Länderschlüssel enthält Informationen, die zur Prüfung von Eingaben verwendet werden, wie z.B. Länge der Postleitzahl oder Länge der Bankkontonummer. Üblicherweise wird der zweistellige ISO-Code nach ISO 3166 verwendet, der standardmäßig von SAP ausgeliefert wird. Es kann auch das Kfz-Nationalitätszeichen oder ein typischer Länderschlüssel verwendet werden, z.B. in Deutschland das Länderkennzeichen des Statistischen Bundesamtes. Die Länderschlüssel werden bei der Systeminstallation in den Grundeinstellungen festgelegt. Die Definition des Länderschlüssels im SAP System muss nicht mit politischen oder staatlichen Einheiten übereinstimmen. Da der Länderschlüssel nicht in allen Installationen mit dem ISO-Code übereinstimmen muss, dürfen Programme, die nach bestimmten Werten des Länderschlüssels unterscheiden, nicht den Länderschlüssel T005-LAND1 abfragen, sondern müssen auf den ISO-Code T005-INTCA programmieren. |
| ISO-Code | Internationaler standardisierter Länderschlüssel nach ISO 3166.  Der Eintrag wird in den Ländern der Europäischen Gemeinschaft zur Überprüfung der Umsatzsteuer-Identifikationsnummer (USt-IdNr.) verwendet. Sie können die Umsatzsteuer-Identifikationsnummer im Stammsatz eines Debitors oder Kreditors oder für den Buchungskreis hinterlegen. Der ISO-Code wird als Länderschlüssel beim Austausch von Informationen über EDI verwendet. Sie müssen daher den ISO-Code für jedes Land in diesem Feld angeben, wenn Sie EDI verwenden. Über den ISO-Code wird auch gesteuert, welche zusätzlichen Angaben für einen Buchungskreis relevant sind. Sie können immer nur die zusätzlichen Angaben eingeben, die für das Buchungskreisland oder für alle Länder relevant sind. Die Zuordnung zum Land erfolgt über den ISO-Code.  Vorgehensweise: Geben Sie den ISO-Code für jedes Land ein. Dies ist von besonderer Bedeutung ...   * wenn das Land der Europäischen Gemeinschaft angehört * wenn Sie Informationen über EDI austauschen * wenn buchungskreisspezifische zusätzliche Angaben nach Ländern begrenzt werden sollen. |
| Buchungskreis | Der Buchungskreis ist eine in der Finanzbuchhaltung verwendete Organisationseinheit. |
| Wert eines freien Attributs (Char4) |  |
| Wert eines freien Attributs (Char4) |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |
| Freies Attribut (Datum) |  |
| Gültig ab | Gültigkeitsbeginn des Rohexposures  Legt die Gültigkeit des Rohexposures und der bei der Freigabe eines Rohexposures angelegten Exposure-Positionsbewegungen fest. |
| Inventur-Kennzeichen | Dieses Kennzeichen bestimmt, ob eine Commodity-Exposure-Menge eine aus einem Plan/Kundenauftrag resultierende normale Bewegung oder ein Bestandssaldo am Ende des Tages ist. Handelt es sich um eine normale Bewegung, wird die gesamte Menge als Exposure-Positionsbewegung hinzugefügt. Bei einem Bestandssaldo am Ende des Tages ermittelt das System die Differenz zwischen der angegebenen Menge und der verfügbaren Menge in der Exposure-Position und fügt die Differenz anschließend der Exposure-Positionsbewegung hinzu. Wurde das Kennzeichen für Bestandssaldo am Ende des Tages gesetzt, können in diesem Rohexposure nur Commodity-Einzelposten definiert werden.  Im Commodity-Exposure-Ansatztyp "Preisfindungs- und erfüllungsbasiert" kann der Commodity-Bestand präzise im Exposure Management gepflegt werden.  Abhängigkeiten: Dieses Kennzeichen funktioniert nur, wenn der Commodity-Exposure-Ansatztyp auf "Preisfindungs- und erfüllungsbasiert" gesetzt ist. |
| Freigabestatus | Freigabestatus eines Rohexposures  Mögliche Werte sind:   * Bearbeitbar – Das Rohexposure kann bearbeitet werden. * Initiiert – Der Freigabe-Workflow für ein Rohexposure wurde initiiert. * Freigegeben – Das Rohexposure wurde für Exposure-Positionen freigegeben. |
| Externe Positionsnummer | Dieses Feld kann verwendet werden, um Positionen in Rohexposures mit Positionen in operativen Belegen wie Kundenaufträgen oder Bestellungen zu verknüpfen. |
| Profitcenter | Schlüssel, der zusammen mit dem Kostenrechnungskreis ein Profitcenter eindeutig identifiziert. |
| Material (veraltet) - Validierung nach Laden(F2615) | Alphanumerischer Schlüssel, der das Material eindeutig kennzeichnet |
| Commodity | Schlüssel oder Kurzname eines Commodity. |
| Menge | Gibt an, wie viele Einheiten des jeweiligen Commodity gehandelt werden. Die Menge kann nur in Zusammenhang mit der Mengeneinheit richtig interpretiert werden. |
| Mengeneinheit | Gibt die Mengeneinheit zu der unter "Menge" genannten Commodity-Menge an. |
| ISO-Code für Mengeneinheiten | Der für Mengeneinheiten verwendete ISO-Code. Ein ISO-Code kann mehreren internen Maßeinheiten einer Dimension zugeordnet sein.  Verwendung: Der ISO-Code ist für EDI wichtig. Er wird verwendet, um die internen SAP-Mengeneinheiten in Standardmengeneinheiten umzuwandeln. Der Datenaustausch über EDI erfordert die Umwandlung von internen Mengeneinheiten in Standardmengeneinheiten.  Eine Liste der aktuellen international vereinbarten ISO-Codes kann bei der zuständigen UN-Kommission bestellt werden (WP.4 Trade Facilitation Recommendations, Recommendation 20):  UN Economic Commission for Europe  Information Office  Palais des Nations  1211 Genf, Schweiz  E-Mail: info.ece@unece.org oder direkt auf dieser Internetseite: [Hier](http://www.unece.org/cefact/codesfortrade/codes_index.htm)  Weitere Informationen finden Sie im SAP-Hinweis [69063](https://launchpad.support.sap.com/#/notes/69063). |
| Exposure-Betrag | Exposure-Betrag |
| Währung des Exposure-Betrags | Währung für den Exposure-Betrag |
| ISO-Code (Währ.Exp.Betr.) | Währungsschlüssel (weltweiter Standard).  Vorgehensweise: Geben Sie den ISO-Code ein, sofern Sie nicht bereits den globalen Standardwährungsschlüssel verwenden.  Wenn Sie mit der EDI-Anwendung arbeiten, wird der ISO-Code für den Austausch von Informationen verwendet. |
| Zielwährung Rohexposure | Zielwährung einer Rohexposure-Position  Verwendung: In einer Devisenposition ist die Zielwährung die Risikowährung. |
| ISO-Code (Zielwährung) | Währungsschlüssel (weltweiter Standard).  Vorgehensweise: Geben Sie den ISO-Code ein, sofern Sie nicht bereits den globalen Standardwährungsschlüssel verwenden. Wenn Sie mit der EDI-Anwendung arbeiten, wird der ISO-Code für den Austausch von Informationen verwendet. |
| Periode | Beispiel: Planungsperioden   * Januar * Februar * März * April |
| Planungsjahr | Die Planungsperiode und das Planungsjahr legen den Zeitraum fest, wenn das Rohexposure abläuft.  Verwendung: Geben Sie das Jahr ein, in dem das Rohexposure abläuft. |
| Exposure-Fälligkeitsdatum | Datum, an dem das Rohexposure fällig ist oder abläuft.  Verwendung: Dieses Datum wird als Enddatum oder Ablaufdatum des Exposures an das Hedge Accounting für Exposures gesendet. Dieses Feld kann nicht geändert werden, wenn das Fälligkeitsdatum dem Exposure-Positionstyp als Differenzierunsgparameter hinzugefügt wird. |
| Freies Attribut (Char20) |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |
| Wert eines freien Attributs (Char10) |  |
| Wert eines freien Attributs (Char10) |  |
| Wert eines freien Attributs (Char4) |  |
| Freies Attribut (Datum) |  |
| Zahlungsdatum | Datum, an dem die Zahlung erfolgt |
| Fix/Variabel-Kennzeichen |  |
| Werk | Schlüssel zur eindeutigen Identifizierung eines Werks |
| Lagerort | Nummer des Lagerorts, an dem das Material gelagert wird. Ein Werk kann einen oder mehrere Lagerorte enthalten. |
| Charge | Ordnet ein Material, das in Chargen oder Produktionslosen gefertigt wird, einer bestimmten Charge zu. |
| Exposure-Regel für Marktpreis |  |
| Konditionsart |  |
| Variabler Preistyp |  |
| Status Preisfixierung |  |
| Frühestes Ausübungsdatum |  |
| Spätestes Ausübungsdatum |  |
| Liefertermin |  |
| Externe Positions-ID | Externe Positions-ID  Verwendung: Dieses Feld kann verwendet werden, um Positionen in Rohexposures mit Positionen in operativen Belegen wie Kundenaufträgen oder Bestellungen zu verknüpfen. |
| Material (veraltet) - Validierung nach Laden(F2615) | Alphanumerischer Schlüssel, der das Material eindeutig kennzeichnet |
| Portfolio | Ein Portfolio ist ein organisatorisches Element, mit dem verschiedene Treasury-Geschäftsvorfälle für Berichtszwecke zusammengefasst werden. |
| Kostenstelle | Schlüssel, der die Kostenstelle eindeutig identifiziert |
| Geschäftsbereich | Schlüssel, der den Geschäftsbereich eindeutig identifiziert |
| PSP-Element | Schlüssel, der das PSP-Element eindeutig identifiziert |
| Segment | Segment für Segmentberichterstattung |
| Im Auftrag von Buchungskreis | Wenn Sie ein Finanzgeschäft für einen anderen Buchungskreis anlegen, können Sie den Buchungskreis in den Finanzgeschäftsdaten auf der Registerkarte "Verwaltung" eingeben. Dieses Attribut kann in Exposure Management 2.0 auch für Rohexposure-Einzelsätze gefüllt und als Differenzierungskriterium für Exposure-Positionen verwendet werden. In einem Sicherungsbereich können Sie dieses Attribut als Differenzierungskriterium für die Analysepositionen verwenden.  Beispiel: In einer Gruppe von Gesellschaften haben die Zentrale und verbundene Unternehmen unterschiedliche Buchungskreise. Wenn die Zentrale eine Absicherung für eines der verbundenen Unternehmen durchführt, kann dies durch die Eingabe des Buchungskreises des verbundenen Unternehmens auf der Registerkarte "Verwaltung" in den Finanzgeschäftsdaten des Sicherungsinstruments visualisiert werden. Des Weiteren können Sie den entsprechenden Buchungskreis den Rohexposure-Einzelsätzen hinzufügen und ihn als Differenzierungskriterium für Exposure-Positionen und im Sicherungsbereich verwenden. |

### Beispieldaten für den Import von Rohexposures

Je nach Dokumentformat besteht die Möglichkeit, eine Excel-Vorlage mit vier Beispieldatensätzen herunterzuladen.

Wenn die Excel-Vorlage verfügbar ist, wird ein entsprechender Download-Link angezeigt.

Fehlt dieser Link, wird der Download der Excel-Vorlage für das von Ihnen verwendete Dokument nicht unterstützt. In diesem Fall erstellen Sie selbst eine Excel-Vorlage unter Verwendung der unten angegebenen Anweisungen und Beispieldaten.

Die folgende Tabelle wurde für die Darstellung in diesem Dokument transponiert. Kopieren Sie die Daten (außer den Zeilen "Feld", "Satz 1" und "Satz 2") nach Excel, und transponieren Sie die Spalten und Zeilen, um eine importierbare Vorlagendatei zu erstellen. Stellen Sie sicher, dass Sie das Tabellenblatt in Main umbenannt haben.

Beachten Sie beim Anlegen der Vorlage die Nummerntyp- und Texttypspalten.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Feld | Satz 1 | Satz 2 | Satz 3 | Satz 4 |
| Externe Belegnummer | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 |
| Exposure-Herkunft | ABR | ABR | ABR | ABR |
| Logisches System | 099TTUG | 099TTUG | 099TTUG | 099TTUG |
| Exposure-Aktivitätsart | YFXO | YFXO | YFXO | YFXO |
| Exposure-Typ des Rohexposures | 01 | 01 | 01 | 01 |
| Länderschlüssel |  |  |  |  |
| ISO-Code |  |  |  |  |
| Buchungskreis | 1310 | 1310 | 1310 | 1310 |
| Wert eines freien Attributs (Char4) | FX | FX | FX | FX |
| Wert eines freien Attributs (Char4) | OUT | OUT | OUT | OUT |
| Freies Attribut (Char20) |  |  |  |  |
| Freies Attribut (Datum) |  |  |  |  |
| Gültig ab | 30.08.2016 | 30.08.2016 | 30.08.2016 | 30.08.2016 |
| Inventur-Kennzeichen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Freigabestatus |  |  |  |  |
| Externe Positionsnummer | 1 | 2 | 1 | 2 |
| Profitcenter |  |  |  |  |
| Material (veraltet) - Validierung nach Laden(F2615) |  |  |  |  |
| Commodity |  |  |  |  |
| Menge | 0,000 | 0,000 | 0,000 | 0,000 |
| Mengeneinheit |  |  |  |  |
| ISO-Code für Mengeneinheiten |  |  |  |  |
| Exposure-Betrag | 5.000.000,00 | 5.000.000,00 | 10.000,00 | 10.000,00 |
| Währung des Exposure-Betrags | USD | USD | USD | USD |
| ISO-Code (Währ.Exp.Betr.) |  |  |  |  |
| Zielwährung Rohexposure | EUR | EUR | EUR | EUR |
| ISO-Code (Zielwährung) |  |  |  |  |
| Periode | M08 | M08 | M08 | M08 |
| Planungsjahr | 2017 | 2017 | 2017 | 2017 |
| Exposure-Fälligkeitsdatum | 30.08.2017 | 30.08.2017 | 30.08.2017 | 30.08.2017 |
| Freies Attribut (Char20) |  |  |  |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |  |  |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |  |  |  |
| Freies Attribut (Char20) |  |  |  |  |
| Wert eines freien Attributs (Char10) |  |  |  |  |
| Wert eines freien Attributs (Char10) |  |  |  |  |
| Wert eines freien Attributs (Char4) |  |  |  |  |
| Freies Attribut (Datum) |  |  |  |  |
| Zahlungsdatum |  |  |  |  |
| Fix/Variabel-Kennzeichen |  |  |  |  |
| Werk |  |  |  |  |
| Lagerort |  |  |  |  |
| Batch |  |  |  |  |
| Exposure-Regel für Marktpreis |  |  |  |  |
| Konditionsart |  |  |  |  |
| Variabler Preistyp |  |  |  |  |
| Status Preisfixierung |  |  |  |  |
| Frühestes Ausübungsdatum |  |  |  |  |
| Spätestes Ausübungsdatum |  |  |  |  |
| Liefertermin |  |  |  |  |
| Externe Positions-ID | 1 | 2 | 1 | 2 |
| Material (veraltet) - Validierung nach Laden(F2615) |  |  |  |  |
| Portfolio | Y000 | Y000 | Y000 | Y000 |
| Kostenstelle |  |  |  |  |
| Geschäftsbereich |  |  |  |  |
| PSP-Element |  |  |  |  |
| Segment |  |  |  |  |
| Im Auftrag von Buchungskreis |  |  |  |  |

## Buchhaltung

Zweck

In diesem Abschnitt werden weitere buchhaltungsrelevante Aktivitäten beschrieben.

### Bewertung stornieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In dieser Aktivität stornieren Sie die gebuchte Periodenendbewertung für das Geschäft. Dies ist beispielsweise notwendig, wenn Sie die Periodenendbewertung mit falschen Währungskursen oder einer falschen Auswertungsart durchgeführt haben, denn daraus resultieren falsche Buchhaltungsergebnisse.

Voraussetzungen

Die Periodenendbewertung des Geschäfts wurde gebucht.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewertung stornieren(TPM2). | Das Bild Bewertung stornieren(TPM2) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: Lassen Sie das Feld leer, oder geben Sie einen bestimmten Bewertungsbereich ein, z.B. DE0.  Geschäft: <Geschäftsnummern, für die die Bewertung storniert werden soll>  Stichtag der Bewertung: z.B. <Datum, zu dem die Stornierung erfolgen soll>  Stornogründe: z.B. 04 Sonstige Gründe  Testlauf: markiert | Das Bild Anzeige zu stornierender Bestände wird angezeigt. |  |
| 4 | Bewertung für Testlauf stornieren | Wählen Sie Bewertung stornieren(TPM2). | Das Bild Stornoprotokoll: Stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Storno (Testlauf) der Bewertung erfolgreich durchgeführt wird angezeigt.  Auf dem Bild werden die Daten der simulierten Stornobuchung angezeigt. Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis Sie zum Einstiegsbild der App gelangen.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Anzeige zu stornierender Bestände wird angezeigt. |  |
| 6 | Bewertung für Echtlauf stornieren | Wählen Sie Bewertung stornieren(TPM2). | Das Bild Stornoprotokoll: Stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Storno der Bewertung erfolgreich durchgeführt wird angezeigt.  Auf diesem Bild können Sie die Buchung überprüfen. Der Buchhaltungsbeleg für die Stornierung wird angelegt. |  |

### Kontierungsreferenzumbuchung

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

Jeder Position wird eine Kontierungsreferenz zugeordnet. In dieser Aktivität übertragen Sie Positionen mit ihrem Buchwert von einer Kontierungsreferenz auf eine andere (die Finanzpositionen werden auf die Sachkonten umgebucht).

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kontierungsreferenz umbuchen(TPM28). | Das Bild Kontierungsreferenzumbuchung durchführen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: Geldhandel, Devisen, OTC-Derivate: markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: Lassen Sie das Feld leer, oder geben Sie einen bestimmten Bewertungsbereich ein, z.B. DE0.  Geschäft: <Geschäftsnummern, die auf eine andere Kontierungsreferenz umgebucht werden sollen>  Buchungsdatum: <Termin, an dem die Kontierungsreferenzumbuchung erfolgen soll>  Neue Kontierungsreferenz: <Wählen Sie eine neue Kontierungsreferenz>  Testlauf: markiert | Das Bild Umzubuchende Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 4 | Umbuchung für Testlauf durchführen | Wählen Sie Umbuchung durchführen. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Umbuchung (im Testlauf) erfolgreich durchgeführt wird angezeigt.  Die simulierten Buchungen für die Kontierungsreferenzumbuchung werden angezeigt. Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis Sie zum Einstiegsbild der App gelangen.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Umzubuchende Bestände anzeigen wird angezeigt. |  |
| 6 | Umbuchung für Echtlauf durchführen | Wählen Sie Umbuchung durchführen. | Die Sicht Buchungsprotokoll: Gebuchte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Umbuchung erfolgreich durchgeführt wird angezeigt.  Die Buchungen für die Kontierungsreferenzumbuchung werden angezeigt. Es werden Buchhaltungsbelege angelegt. |  |

### Kontierungsreferenzumbuchung stornieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Um eine Kontierungsreferenzumbuchung zu stornieren, nachdem diese aktualisiert wurde, können Sie die App Kontierungsreferenzumbuchung stornieren(TPM29) verwenden.

Voraussetzungen

Die Kontierungsreferenzumbuchung wurde gebucht.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Buchhalter am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kontierungsreferenzumbuchung stornieren. | Das Bild Kontierungsreferenzumbuchung stornieren(TPM29) wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien für Testlauf eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  OTC-Geschäfte: Geldhandel, Devisen, Derivate:markiert  Buchungskreis: z.B. 1010  Bewertungsbereich: leer lassen  Geschäft: <Geschäftsnummer der Kontierungsreferenzumbuchung, die storniert werden soll>  Stornogründe: z.B. 04 Sonstige Gründe  Testlauf: markiert | Das Bild Anzeige zu stornierender Bestände wird angezeigt. |  |
| 4 | Umbuchung für Testlauf stornieren | Markieren Sie die zu stornierenden Positionen, und wählen Sie Umbuchung stornieren. | Das Bild Stornoprotokoll: Stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Umbuchungen erfolgreich storniert (Testlauf) wird angezeigt.  Die simulierten Buchungen für die Stornierung der Kontierungsreferenzumbuchung werden angezeigt. Es wird keine Buchung angelegt, da es sich um einen Testlauf handelt. |  |
| 5 | Selektionskriterien für Echtlauf eingeben | Wählen Sie Zurück, bis Sie zum Einstiegsbild der App gelangen.  Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Anzeige zu stornierender Bestände wird angezeigt. |  |
| 6 | Umbuchung für Echtlauf stornieren | Markieren Sie die zu stornierenden Positionen, und wählen Sie Umbuchung stornieren. | Das Bild Stornoprotokoll: Stornierte Geschäftsvorfälle wird angezeigt. Die Meldung Umbuchungen erfolgreich storniert wird angezeigt.  Die Buchungen für die Stornierung der Kontierungsreferenzumbuchung werden angezeigt. Es werden Buchhaltungsbelege angelegt. |  |

## Zinsanpassung

### Anpassung ändern (Zinssätze/Preise)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität ändern Sie die Zinsanpassung.

Voraussetzungen

Die Zinsanpassung wurde angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Anpassung ändern - Zinssätze/Preise(TI11) | Das Bild Letzte Zins-/Preisanpassung ändern wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein und drücken Sie Enter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <die in "Zinssatz anpassen" in den vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummer> | Das Bild Zins-/Preisanpassung ändern wird angezeigt. |  |
| 4 | Neuen Zinssatz eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Zinssatz: z.B. 3 | Die manuelle Zins-/Preisanpassung wird geändert. |  |

### Anpassung anzeigen (Zinssätze/Preise)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Zinsanpassung an.

Voraussetzungen

Die Zinsanpassung wurde angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Anpassung anzeigen - Zinssätze/Preise(TI12) | Das Bild Zins-/Preisanpassung anzeigen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein und drücken Sie Enter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <die in "Zinssatz anpassen" in den vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummer> | Das Bild Zins-/Preisanpassung anzeigen wird angezeigt. |  |

### Automatische Anpassungen stornieren (Zinssätze/Preise)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität stornieren Sie die automatische Zinsanpassung.

Voraussetzungen

Die automatische Zinsanpassung wurde angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Automatische Anpassungen stornieren - Zinssätze/Preise(TJ05\_REV). | Das Bild Automatische Zins-/Preisanpassung stornieren wird angezeigt. |  |
| 3 | Stornokriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Fixing-Datum: z.B. <Termin der letzten automatischen Anpassung>  Testlauf: entmarkiert | Das Ergebnis der Stornierung wird angezeigt. |  |

### Anpassung stornieren (Zinssätze/Preise)

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität stornieren Sie die manuelle Zinsanpassung.

Voraussetzungen

Die manuelle Anpassung eines Zinssatzes wurde angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Backoffice am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Anpassung stornieren - Zinssätze/Preise(TI37) | Das Bild Zins-/Preisanpassung stornieren wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein und drücken Sie Enter:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Die in „Zinssatz anpassen“ in den vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummer> | Das Bild Zins-/Preisanpassung stornieren wird angezeigt. |  |
| 4 | Zinsanpassung stornieren | Wählen Sie Sichern. | Die manuelle Zins-/Preisanpassung wird storniert. |  |

## Market Risk Analyzer

### Marktdaten-Shift verwalten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie Marktdatenshifts an, um Kennzahlen mit geänderten Marktdaten zu analysieren. Diese werden im Schritt Definieren des Berichtslayouts zur Berechnung von Marktrisikokennzahlen verwendet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Marktdaten-Shift verwalten(JBR0). | Das Bild Marktdatenshifts bearbeiten wird angezeigt. |  |
| 3 | Name der Marktdatenshifts eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Marktdatenshift: z.B. 1 | Das Bild Marktdaten-Shifts definieren wird angezeigt. |  |
| 4 | Marktdatenshift definieren | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie die Registerkarte Zinskurve:  Kurzbezeichnung: z.B. Marktdatenshift 0001 |  |  |
| 5 | Zinskurven des Marktdatenshifts pflegen | Wählen Sie Zeile einfügen.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Kurzbezeichnung: z.B. Shift Euro-Depot  Währung: z.B. EUR  Zinskurvenart: z.B. 0001  Zinsreferenz: z.B. EURM01EUR  Prozentsatz: z.B. 2 | Der Marktdatenshift wird gesichert. |  |

### Szenarien pflegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt legen Sie ein Szenario an. Ein Szenario ist ein Marktdatensatz, der z.B. aktuelle Marktdaten, Devisenkurse, Devisenkursvolatilitäten, Zinskurven oder Zinsvolatilitäten enthält. Sie können Szenarien für Marktsituationen anlegen, die Sie für möglich oder wahrscheinlich halten (z.B. Hochzinsszenario mit invertierter Zinskurve).

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Offen Szenarios verwalten(TV21) | Die Sicht Szenarienverwaltung: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Szenarionamen eingeben | Geben Sie auf dem Bild Szenarienverwaltung: Einstieg die folgenden Daten ein, und wählen Sie Anlegen:  Szenario: z.B. 1 | Das Bild Szenario 1 anlegen wird angezeigt. |  |
| 4 | Szenario pflegen | Geben Sie auf dem Bild Szenario 1 anlegen folgende Daten ein:  Szenario: Vollständiger Name: z.B. Szenario 1  Szenario: Kurztext: z.B. Szenario 1 |  |  |
| 5 | Devisenkurse für das Szenario pflegen | Wählen Sie auf dem Bild Szenario 1 anlegen die Registerkarte Umrechnungskurse, und geben Sie die folgenden Daten ein:  Bezugswährung: z.B. EUR  Wählen Sie im Formular Weitere Währungen die Option Zeile einfügen, und geben Sie die folgenden Daten ein:  Währung: z.B. USD  Geldkurs: z.B. 1,2  Briefkurs: z.B. 1,2  Wählen Sie anschließend Sichern.  Hinweis Ein Marktdaten-Shift besteht aus Parameter-Shifts, die auf importierten Marktdaten basieren. Für das Szenario können Sie Parameter ohne Bezug pflegen. | Das Szenario wird gesichert. |  |

### Definieren des Berichtslayouts für "Marktrisikokennzahlen berechnen"

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt definieren Sie das Layout für den Marktrisikokennzahlenbericht.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Marktrisikokennzahlen berechnen(AISGENKF). | Das Bild Marktrisikokennzahlen berechnen wird angezeigt. |  |
| 3 | Bild zum Definieren von Berichtslayouts aufrufen | Geben Sie auf dem Bild Marktrisikokennzahlen berechnen die Auswertungswährung und die Auswertungsart ein, und wählen Sie Berichtslayout definieren. | Die Sicht Sicht "Kennzahlen-Layout" ändern: Übersicht wird angezeigt. | . |
| 4 | Layout-ID-Einträge anlegen | Wählen Sie im Bild Sicht "Kennzahlen-Layout" ändern: Übersicht die Option Neue Einträge. Fügen Sie dann in das Formular Kennzahlen-Layout die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  ZEILE 1  Layout-ID: z.B. Y01  Kurztext: z.B. Barwert/BPV/Dauer  Langtext: z.B. Barwert/BPV/Dauer  ZEILE 2  Layout-ID: z.B. Y02  Kurztext: z.B. Barwert + Marktdatenshifts  Langtext: z.B. Barwert + Marktdatenshifts | Zwei neue Einträge wurden angelegt. |  |
| 5 | Bild zur Pflege von Kennzahlen aufrufen | Wählen Sie im Bild Sicht "Kennzahlen" ändern: Übersicht das Ankreuzfeld für die Layout-ID Y01. Doppelklicken Sie anschließend im Bildbereich Dialogstruktur auf den Ordner Kennzahlen. | Das Bild Sicht "Kennzahlen" ändern: Übersicht wird im Hauptbereich angezeigt. |  |
| 6 | Kennzahlen des Layouts pflegen | Wählen Sie im Bild Sicht "Kennzahlen" ändern: Übersicht die Option Neue Einträge, und fügen Sie dann im Formular Kennzahlen die folgenden Daten ein:  ZEILE 1  Kennzahlname: z.B. BARWERT  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. Barwert  Kurztext: z.B. Barwert  Shift-Regel: z.B. 1 oder Marktdatenshift-Regel, die Sie angelegt haben  Dezimalst.: z.B. 0  ZEILE 2  Kennzahlname: z.B. BPV  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. SKF\_BASE\_POINT  Kurztext: z.B. BPV  Shift-Regel: z.B. 0.  Dezimalst.: z.B. 0  ZEILE 3  Kennzahlname: z.B. CRFNPV  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. RISK\_FREE\_NPV  Kurztext: z.B. Aktueller risikofreier Barwert  Shift-Regel: z.B. 0.  Dezimalst.: z.B. 0  ZEILE 4  Kennzahlname: z.B. DURATION1  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. SKF\_FWDURATION  Kurztext: z.B. Modified Duration  Shift-Regel: z.B. 0.  Dezimalst.: z.B. 0  ZEILE 5  Kennzahlname: z.B. DURATION2  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. SKF\_MACAULAY  Kurztext: z.B. Macaulay-Duration  Shift-Regel: z.B. 0.  Dezimalst.: z.B. 0  Wählen Sie Sichern. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht Hinzugefügte zeigt die Einträge für Kennzahlnamen und die Konfigurationseinstellungen an. |  |
| 7 | Bild zur Pflege von Kennzahlen aufrufen | Wechseln Sie zurück zur Sicht Sicht "Kennzahlen-Layout" ändern: Übersicht, und markieren Sie das Ankreuzfeld für die Layout-ID Y02. Doppelklicken Sie auf den Ordner Kennzahlen im Bildbereich Dialogstruktur. |  |  |
| 8 | Kennzahlen des Layouts pflegen | Wählen Sie in der Sicht Sicht "Kennzahlen-Layout" ändern: Übersicht die Option Neue Einträge. Geben Sie dann im Formular Kennzahlen die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Kennzahlname: z.B. Barwert  PosBereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  PH-Bereich: z.B. <Markieren Sie dieses Ankreuzfeld.>  Kennzahltyp: z.B. Barwert  Kurztext: z.B. Barwert  Shift-Regel: z.B. 1 oder Marktdatenshift-Regel, die Sie angelegt haben  Nachkommastellen: z.B. 0 |  |  |

### Marktrisikokennzahlensätze verwalten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Einsatzmöglichkeiten

In diesem Schritt definieren Sie die Parameter für die Berechnung der Marktrisikokennzahlen, einschließlich Auswertungswährung, Auswertungsart, Szenario und Marktdaten-Shift-Regel.

Die Berechnung der Marktrisikokennzahlen wird als eingeplanter Hintergrundjob verarbeitet, dessen Ergebnis in der Datenbank für die Analyse eingetragen wird.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Marktrisikokennzahlensätze verwalten(AFWKF\_SET). | Das Bild Sicht „Marktrisikokennzahlensatz“ ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Risikofaktorensatz definieren | Führen Sie im Bild Sicht „Marktrisikokennzahlensatz“ ändern: Übersicht auf der linken Seite im Bereich Dialogstruktur auf den Ordner Risikofaktorensatz einen Doppelklick aus. Wählen Sie Neue Einträge, und fügen Sie die folgenden Daten in das Formular Risikofaktorensatz ein:  RF- Satz: z.B R01  Beschreibung , z.B Risikofaktorsatz mit Umrechnungskurs und Zinskurven  Devisenrisiko: <Markieren Sie das Ankreuzfeld.>  Zinsrisiko: <Markieren Sie das Ankreuzfeld.>  Markieren Sie dann den angelegten Eintrag, und doppelklicken Sie auf der linken Seite im Bereich Dialogstruktur auf den Ordner Risikowährung. Wählen Sie Neue Einträge und fügen Sie die folgenden Daten in das Formular Risikowährung ein:  Row 1  Währung: z.B. USD  Zinsrisiko: <Markieren Sie das Ankreuzfeld>  Doppelklicken Sie anschließend im Bereich Dialogstruktur auf der linken Seite auf den Ordner Zinssatzlaufzeit. Wählen Sie Neue Einträge, fügen Sie die folgenden Daten in das Formular Zinslaufzeit ein, und wählen Sie Sichern:  Row 1  Laufzeit: z.B. 1  Zeiteinheit: z.B. Monat  Row 2  Laufzeit: z.B. 3  Zeiteinheit: z.B. Monat  Row 3  Laufzeit: z.B. 6  Zeiteinheit: z.B. Monat  Row 4  Laufzeit: z.B. 1  Zeiteinheit: z.B. Jahr | Es wird ein neuer Risikofaktorensatz angelegt. |  |
| 4 | pflegen | Doppelklicken Sie im Bereich Dialogstruktur auf der linken Seite auf den Ordner Marktrisikokennzahlensatz. Wählen Sie Neue Einträge, geben Sie die folgenden Daten in das Formular Marktrisikokennzahlensatz ein, und wählen Sie Sichern:  row 1  MR-Kennzahlensatz: z.B MRK01  Beschreibung: z.B MR-Kennzahlensatz ohne VaR  Auswertungswährung: z.B. EUR  Ausw. Art: z.B. Y001  VaR ber.: <entmarkieren>  Akt.b.Änd.: <markieren>  Hinweis Wenn das Ankreuzfeld "Akt.b.Änd." markiert ist, wird nach dem Anlegen oder Ändern eines neuen Finanzobjekts eine automatische Berechnung des Marktrisikokennzahlensatzes ausgelöst. Die Berechnung deckt nur das aktualisierte Objekt ab. Der Anpassungslauf basiert auf dem Grundlauf desselben Datums, der von einem eingeplanten Job verarbeitet wird.  Row 2  MR-Kennzahlensatz: z.B MRK02  Beschreibung: z.B MR-Kennzahlensatz (VaR hist. Sim.)  Auswertungswährung: z.B. EUR  Ausw. Art: z.B. Y001  VaR ber.: <Markieren>  VaRArt: z.B. SV1  RF- Satz: z.B. R01  Row 3  MR-Kennzahlensatz: z.B. MRK03  Beschreibung: z.B MR-Kennzahlensatz (VaR Monte-Carlo-Sim.)  Auswertungswährung: z.B. EUR  Bew. Art: z.B. Y001  VaR ber.: <Markieren>  VaRArt: z.B. SV2  RF- Satz: z.B. R01  Row 4  MR-Kennzahlensatz: z.B. MRK04  Beschreibung: z.B MR-Kennzahlensatz (VaR Varianz/Kovarianz)  Auswertungswährung: z.B. EUR  Bew. Art: z.B. Y001  VaR ber.: <Markieren>  VaRArt: z.B SV3  RF- Satz: z.B R01  Hinweis Wenn das Ankreuzfeld für VaR ber. ausgewählt ist, müssen die Parameter der VaR-Art und des Risikofaktorensatzes zugeordnet sein. Das Marktdatenszenario oder der Marktdaten-Shift muss leer sein. | Das Marktrisikokennzahlensatz wird gesichert.  Die VaR-Art SV1 für die VaR-Berechnungsmethode ist eine historische Simulation.  Die VaR-Art SV2 für die VaR-Berechnungsmethode ist eine Monte-Carlo-Simulation.  Die VaR-Art SV3 für die VaR-Berechnungsmethode ist der Varianz-Kovarianz-Ansatz. |  |

### Marktrisikokennzahlen berechnen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt planen Sie einen Hintergrundjob zur Berechnung von Marktrisikokennzahlen einschließlich der Kennzahl Value at Risk ein. Das Berechnungsergebnis wird zur Analyse in der Datenbank gespeichert. Die Berechnungsrisikokennzahlen werden im Marktrisikokennzahlsatz definiert.

Für die Kennzahl Value at Riskstehen drei Berechnungsmethoden zur Verfügung: die historische Simulation, die Monte-Carlo-Simulation und eine parametrische Methode (Varianz-Kovarianz-Ansatz).

Bei der historischen Simulation müssen die täglichen Marktdaten der letzten 250 Tage für die Simulation gepflegt werden.

Für die Monte-Carlo-Simulation und den Varianz-Kovarianz-Ansatz sind die Statistikdaten der Volatilität oder Korrelation erforderlich, und die Berechnung basiert auf den täglichen historischen Marktdaten, in denen tägliche Marktdaten der vergangenen 113 Tage gepflegt werden müssen.

Voraussetzungen

Sie müssen zuerst den Marktrisikokennzahlsatz pflegen. Weitere Informationen hierzu finden Sie im vorherigen Schritt "Marktrisikokennzahlensätze verwalten" im Abschnitt Anhang.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich über SAP Logon am GUI-System mit der erforderlichen Benutzerberechtigung an. | Das Bild "SAP Easy Access" wird angezeigt. |  |
| 2 | Transaktion für eine neue Jobdefinition aufrufen | Geben Sie den Transaktionscode RAEP1\_KFSET im Befehlsfeld ein, und wählen Sie Enter. | Das Bild Marktrisikokennzahlen berechnen wird angezeigt. |  |
| 3 | Allgemeine Informationen zum neuen Job eingeben | Geben Sie in den Bereichen Modus und Auswertungsparameter die folgenden Daten ein:  Grundlauf: <markieren>  Testlauf für Grundlauf: <entmarkieren>  Marktrisikokennzahlensatz: der von Ihnen gepflegte Kennzahlensatz, z.B MRK01 und MRK02  Auswertungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>  Ermittlung statistischer Daten: <markieren> | Der Anpassungslauf verarbeitet neue Finanzobjekte und Finanzobjekte, bei denen im Grundlauf Fehler aufgetreten sind. |  |
| 4 | Einplanungsoptionen für neuen Job eingeben | Wählen Sie in der oberen Leiste Programm , und wählen Sie dann im Dropdown-Menü Im Hintergrund ausführen.  Wählen Sie Weiter im Dialogfenster, wählen Sie im nächsten Bild Sofort, und wählen Sie dann Sichern, um den Job einzuplanen. |  |  |
| 5 | Transaktion für Jobmonitor aufrufen | Geben Sie den Transaktionscode SM36 im Befehlsfeld ein, und wählen Sie dann Enter. | Das Bild Hintergrundjob definierenwird angezeigt. |  |
| 6 | Status des Jobs überwachen | Wählen Sie Eigene Jobs. | Der Job, den Sie eben eingeplant haben, wird im Bild Jobübersicht angezeigt. |  |

## Credit Risk Analyzer

### Übersicht der Limitvorgaben anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität zeigen Sie die Limitvorgaben an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury-Spezialist – Middle-Office am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Übersicht der Limitvorgaben anzeigen(TBL3) | Das Bild Übersicht Limitvorgaben wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Limitart: z.B. Y01 bis Y09  Buchungskreis: z.B. 1010 | Das Bild Limitvorgaben für Limitarten anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |

## Kontrahent ändern

### Kontrahenten von Finanzgeschäften ändern

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität ändern Sie den Kontrahenten von Finanzgeschäften.

Voraussetzungen

Im Vorfeld wurde ein Partner 10537002 unter Bezugnahme auf das Stammdatenskript Geschäftspartner für Treasury and Risk Management anlegen (22G) angelegt.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kontrahent ändern - Finanzgeschäft(TRTM\_CHG\_PARTNER). | Das Bild Kontrahent eines Finanzgeschäfts ändern wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Neuer Partner: z.B. 10537002  Änderung gültig ab: Geben Sie das Datum ein, ab dem die Änderung gültig sein soll, z.B. <Aktuelles Datum>.  Testlauf: markiert | Das Bild Kontrahent eines Finanzgeschäfts ändern wird mit Testlauf: Liste der erfolgreich geänderten Finanzgeschäfte angezeigt.  Hinweis Wenn der angegebene Zeitraum einen arbeitsfreien Tag enthält, wird eine Meldung angezeigt. |  |
| 4 | Echtlauf | Wählen Sie Beenden.  Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Das Bild Kontrahent eines Finanzgeschäfts ändern wird mit der Liste der erfolgreich geänderten Finanzgeschäfte angezeigt. |  |

### Finanzgeschäfte mit geändertem Kontrahenten anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität rufen Sie die Liste der Finanzgeschäfte mit geändertem Kontrahenten auf.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Vorgänge anzeigen - Geänderter Kontrahent(TRTM\_CHG\_PARTNER\_DIS). | Das Bild Finanzgeschäfte mit geändertem Kontrahenten anzeigen wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010 | Das Bild Finanzgeschäfte mit geändertem Kontrahenten anzeigen wird mit der Liste der Finanzgeschäfte mit geändertem Partner angezeigt. |  |

## Analytische Apps

### Anzeigereihenfolge festlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt erfahren Sie, wie Sie die Anzeigereihenfolge für Währungspaare ändern.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury Risk Manager an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Anzeigereihenfolge definieren - Währungspaare(FXM\_CURR\_DISP). | Das Bild Sicht "Anzeigereihenfolge für Währungspaare definieren" anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Kennzahlengruppen pflegen | Wählen Sie Bearbeiten. |  |  |
| 4 | Kennzahlengruppen pflegen | Suchen Sie die Einträge, die geändert werden sollen. Nehmen Sie die Änderungen vor, und wählen Sie Sichern.  Hinweis Suchen Sie z.B. die folgenden Währungspaare, und ändern Sie dann die Spalte Anzeigereihenfolge.  Satz 1  Leitwährung:EUR  Folgewährung:USD  Anzeigereihenfolge: 10  Satz 2  Leitwährung:EUR  Folgewährung:BRL  Anzeigereihenfolge: 20 | Die Daten werden gesichert. |  |

### Analytische Apps

Zweck

Dieser Schritt enthält Anleitungen zur Verwendung von einigen analytischen SAP-Fiori-Apps für Treasury and Risk Management.

Vorgehensweise

Weitere Informationen finden Sie im Testskript Analytische SAP-Fiori-Apps für Treasury and Risk Management (1MN).

## FX-Netting

Mit der Funktion FX-Netting können Sie Geschäfte aus den Devisenhandelsbereichen zusammenfassen und gemeinsam bezahlen. Dies ermöglicht eine vereinfachte Zahlungsabwicklung. Es kommt vor, dass mehrere Finanzgeschäfte gemeinsam bezahlt werden müssen, insbesondere bei Geschäften mit Geschäftspartnern, die keine Hausbanken sind (Zahlungen müssen ausgetauscht werden).

Wenn Sie ein Devisentermingeschäft prolongieren, erstellt SAP zwei Geschäfte: das Netting-Geschäft zur Kompensation des ursprünglichen Geschäfts und das neue prolongierte Geschäft mit dem neuen Valutadatum und den neuen Bedingungen. Für das ursprüngliche Devisentermingeschäft und das Netting-Geschäft kann eine Netting-Gruppe angelegt werden.

In diesem Abschnitt legen Sie ein Devisentermingeschäft an und prolongieren das Geschäft. Dann legen Sie für das ursprüngliche Devisentermingeschäft und das Netting-Geschäft eine Netting-Gruppe an. Danach verarbeiten Sie alle ausgehenden und eingehenden Zahlungsanforderungen in der Netting-Gruppe. Die ausgehenden und eingehenden Zahlungen saldieren auf Null.

Bei der Prolongation oder vorzeitigen Abwicklung für ein Devisengeschäft haben Sie auch die Möglichkeit, den Umrechnungskurs des Netting-Geschäfts entsprechend Ihrer Geschäftsanforderung anzupassen. In diesem Fall werden die ausgehenden und eingehenden Zahlungen nicht auf Null saldieren.

### Devisentermingeschäft anlegen

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie ein Devisentermingeschäft für die Absicherung oder für andere Zwecke an.

Vorgehensweise

Führen Sie den folgenden Schritt im Skript Fremdwährungs-Risikomanagement (1X1) aus, um ein Devisentermingeschäft anzulegen.

* Kassa-/Termingeschäft anlegen(TX01)
* Sie müssen ein Devisentermingeschäft anlegen (Geschäftsart 102).
* Als Valutadatum geben Sie aktuelles Datum + 1 Monat ein.
* Notieren Sie die Geschäftsnummer: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

### Manuelle Abrechnung

Zweck

Die TRM-Geschäfte müssen vor der weiteren Verarbeitung abgerechnet werden.

Vorgehensweise

Führen Sie im Testskript Fremdwährungs-Risikomanagement (1X1) die folgenden Schritte aus:

* Abrechnungsstatus setzen (manuell)

### Devisengeschäft prolongieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Bei der Prolongation eines Devisentermingeschäfts legt das System automatisch ein Kompensationsgeschäft an, um das ursprüngliche Devisentermingeschäft zu kompensieren. In diesem Schritt prolongieren Sie das im vorherigen Schritt angelegte und abgerechnete Devisengeschäft.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Parameter eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: 1010  Geschäft: Geschäftsnummer aus dem vorherigen Schritt  . | Auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird das Geschäft angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft prolongieren | Markieren Sie das Ankreuzfeld (erste Spalte), und wählen Sie Prolongieren. | Das Bild Prolongation auf alter Basis: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Geschäft prolongieren | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Erstes Geschäft:  Kurs: z.B. 1,2  Valutadatum: aktuelles Datum + 2 Monate  Hinweis Sie können auch den Kurs des zweiten Geschäfts (Kompensation) entsprechend Ihrer Geschäftsanforderung anpassen. | Auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird die folgende Meldung angezeigt:  Devisengeschäfte 100000000XXXX und 100000000XXXX im Buchungskreis 1010 gesichert..  Hinweis   * Die Geschäftsarten dieser beiden Geschäfte sind 104 Prolongation und 103 Kompensation. * Notieren Sie sich die beiden Geschäftsnummern: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

### Zahlungsverbindungen der Devisengeschäfte bearbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Damit die Funktion FX-Netting korrekt funktioniert, müssen Sie das Ankreuzfeld Zahlungsanordnung erzeugen sowohl für ausgehende als auch für eingehende Zahlungen im Zusammenhang mit Devisengeschäften markieren.

Vorgehensweise

Tabelle 11: Zahlungsverbindung für ursprüngliches Devisentermingeschäft ändern

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Parameter auf dem Einstiegsbild erfassen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: 1010  Vorgang: <Drei in den vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern> | Auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung werden die Geschäfte angezeigt. |  |
| 4 | Zahlungsverbindungseinstellungen für ursprüngliches Devisengeschäft ändern | Blättern Sie nach rechts zur Spalte GArt.  Markieren Sie das Ankreuzfeld der Zeile mit Geschäftsart (GArt) 102, und wählen Sie Ändern. | Das Bild Devisengeschäft ändern: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Zahlungsverbindungseinstellungen für ursprüngliches Devisengeschäft ändern | Wählen Sie Zahlungsverbindungen. | Das Bild Devisengeschäft ändern: Zahlungsverbindungen wird angezeigt. |  |
| 6 | Zahlungsverbindungseinstellungen für ursprüngliches Devisengeschäft ändern | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit dem Pluszeichen (+), und wählen Sie Zahlungsverbindungen. |  |  |
| 7 | Zahlungsverbindungseinstellungen für ursprüngliches Devisengeschäft ändern | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Zahlungsanordnung: <markieren>  Zahlungsregulierer: 10537001  Zahlwege: F  Partnerbank: 1 | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung zeigt die Meldung Devisengeschäft unter der Nummer 100000000XXXX gesichert an. |  |

Tabelle 12: Zahlungsverbindung für Devisenkompensationsgeschäft ändern

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte verarbeiten – Sammelbearbeitung. | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Parameter eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: 1010  Vorgang: <drei in den vorherigen Schritten angelegte Geschäftsnummern> | Auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung werden die Geschäfte angezeigt. |  |
| 4 | Zahlungsverbindung für kompensiertes Devisengeschäft ändern | Blättern Sie nach rechts zur Spalte GArt.  Markieren Sie das Ankreuzfeld der Zeile mit Geschäftsart (GArt) 103, und wählen Sie Ändern. | Das Bild Devisengeschäft ändern: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Zahlungsverbindung für kompensiertes Devisengeschäft ändern | Wählen Sie Zahlungsverbindungen. | Das Bild Devisengeschäft ändern: Zahlungsverbindungen wird angezeigt. |  |
| 6 | Zahlungsverbindung für kompensiertes Devisengeschäft ändern | Markieren Sie das Ankreuzfeld für die Zeile mit dem Pluszeichen (+), und wählen Sie Zahlungsverbindungen. |  |  |
| 7 | Zahlungsverbindung für kompensiertes Devisengeschäft ändern | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Zahlungsanordnung: <markieren>  Zahlungsregulierer: 10537001  Zahlwege: T  Partnerbank: 1 | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung zeigt die Meldung Devisengeschäft unter der Nummer 100000000XXXX gesichert an. |  |

### Netting-Liste vorschlagen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Nachdem Sie die zu kompensierenden Devisengeschäfte angelegt haben, können Sie über die App Kompensation anlegen(TBR1) die Netting-Gruppe anlegen. SAP Treasury and Risk Management kann die Netting-Liste für Devisengeschäfte auch automatisch vorschlagen. In diesem Schritt legen Sie eine Netting-Liste an. Nach dem Anlegen können Sie die Netting-Gruppe anzeigen, auflösen oder ändern. Die folgenden Apps sind relevant für FX-Netting:

* Kompensation anlegen(TBR1)
* Kompensation ändern(TBR2)
* Clearing-Schwellen-Report(TBR3)
* Kompensation auflösen(TBR4)
* Kompensationsvorschläge anzeigen(TBR5)

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Kompensationsvorschläge anzeigen(TBR5). | Die Sicht Vorschlagsliste für Kompensationen wird angezeigt. |  |
| 3 | Parameter in der Einstiegssicht erfassen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: 1010  Vorgang: <Drei im vorherigen Schritt angelegte Geschäftsnummern> | In der Sicht Vorschlagsliste für Kompensationen werden die Geschäfte angezeigt.  Hinweis Die Geschäfte wurden in zwei Gruppen eingeteilt. |  |
| 4 | Netting-Liste anlegen | Die beiden Geschäfte mit den Geschäftsarten 102 und 103 wurden in dieselbe Gruppe eingeteilt.  Markieren Sie die beiden Ankreuzfelder vor den beiden Geschäften unter der ersten Gruppe, und wählen Sie Sichern. | Die Sicht Vorschlagsliste für Kompensationen zeigt die Meldung Kompensation X angelegt an.  Hinweis Notieren Sie sich die Kompensationsnummer. \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

### Kompensation anzeigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Sobald eine Kompensationsnummer angelegt wurde, können Sie die Kompensationsnummer bei Bedarf anzeigen, ändern oder auflösen. In diesem Schritt zeigen Sie die im vorherigen Schritt angelegte Netting-Gruppe an.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen SieClearing-Schwellen-Report(TBR3). | Das Bild Kompensation anzeigen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Parameter auf dem Einstiegsbild erfassen | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  KompensationKompensationsnummer aus dem vorherigen Schritt | Das Bild Kompensation anzeigen: Daten zeigt die Kompensationsnummer an.  Hinweis Notieren Sie sich die beiden Geschäftsnummern: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

### Zahlungsanordnungen für kompensierte Geschäfte erzeugen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt generieren Sie die Zahlungsanordnungen für kompensierte Geschäfte.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen SieBewegungen buchen(TBB1). | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Geldhandel: markiert  Buchungskreis: 1010  Vorgang: Zwei Geschäftsnummern aus dem vorherigen Schritt  Bis einschl. Fälligkeitsdatum: Datum ein, an dem die Bewegung des Finanzgeschäfts gebucht werden soll, z.B. aktuelles Datum + 1 Monat  Testlauf: markiert  Nur zhl.: markiert | Auf dem Bild Informationsübersicht werden sowohl "Zahlungsprotokoll" als auch "Nachrichten" mit einem grünen Ampelstatus angezeigt wird. |  |
| 4 | Echtlauf | Wählen Sie Zurück. | Die Sicht Treasury: Bewegungen buchen wird angezeigt. |  |
| 5 | Echtlauf | Ändern Sie die folgenden Daten, und wählen Sie Ausführen:  Testlauf: entmarkiert | Auf dem Bild Informationsübersicht werden sowohl "Zahlungsprotokoll" als auch "Nachrichten" mit einem grünen Ampelstatus angezeigt wird. |  |
| 6 | Zahlungsprotokoll | Wählen Sie Zahlungsprotokoll. | Das Bild Zahlungsprotokoll zeigt die Schlüssel an. Notieren Sie sich die Zahlungsanforderungs-Schlüsselnummern: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |

### Zahlungsanordnung verarbeiten

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Verwendungszweck

In dieser Aktivität starten Sie das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen. Das Zahlungsprogramm für Zahlungsanordnungen stellt eine zusätzliche Möglichkeit für die maschinelle Zahlung im SAP-System dar. Im Gegensatz zum Standardzahlprogramm basieren die Zahlungen nicht auf offenen Posten (Kreditoren- bzw. Debitorenposten), sondern auf Zahlungsanordnungen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | App aufrufen | Öffnen Sie Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111). | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) wird angezeigt. |  |
| 3 | Datum der Ausführung und Identifikation eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Parameter:  Laufdatum: z.B. aktuelles Datum  Identifikation: z.B. TRM01  Hinweis Falls die Meldung Parameter wurden erfasst angezeigt wird, verwenden Sie eine andere Identifikation (z.B. TRM02). | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 4 | Parameter eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Freie Abgrenzungen:  Buchungsdatum: z.B. aktuelles Datum  Nächster Zahllauf am: z.B. aktuelles Datum + 2 Monate  Buchungskreis: z.B. 1010  Zahlwege: z.B. TF | Das Dialogfenster Freie Selektion für Zahllauf wird angezeigt. |  |
| 5 | Parameter eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern:  Schlüsselnummer: alle Schlüsselnummern aus dem vorherigen Schritt  Hinweis Dadurch werden alle Zahlungsanforderungs-Schlüsselnummern in einen Zahlungslauf aufgenommen. Andernfalls saldieren die ausgehenden und eingehenden Zahlungen nicht auf Null. |  |  |
| 6 | Parameter eingeben | Wählen Sie Zusatzprotokoll. | Das Dialogfenster Zusatzprotokoll wird angezeigt. |  |
| 7 | Parameter eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Weiter:  Zahlwegauswahl in allen Fällen: markiert  Positionen der Zahlungsbelege: markiert  Prüfung der Fälligkeit: markiert  Hinweis Wenn die Meldung Das Protokoll wird für alle Konten erstellt angezeigt wird, wählen Sie Weiter. | Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr: Parameter wird angezeigt. |  |
| 8 | Parameter eingeben | Wählen Sie Sichern. | Das System zeigt die Meldung Parameter wurden erfasst an. |  |
| 9 | Vorschlag einplanen | Wählen Sie Vorschlag. | Das Dialogfenster Vorschlag einplanen wird angezeigt. |  |
| 10 | Vorschlag einplanen | Wählen Sie Start sofort und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Vorschlag läuft mit einem gelben Ampelstatus wird angezeigt. |  |
| 11 | Vorschlag einplanen | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungsvorschlag wurde erstellt mit einem grünen Ampelstatus angezeigt wird. | Der Zahlungsvorschlag wird erzeugt.  HINWEIS  Wenn Sie Vorschlagsprotokoll anzeigen wählen, wird die Meldung Folgende Zahlungsaufträge saldieren sich zu Null und werden ausgeziffert angezeigt. |  |
| 12 | Zahlung einplanen | Wählen Sie Zahllauf. | Das Dialogfenster Zahlung einplanen wird angezeigt. |  |
| 13 | Zahlung einplanen | Wählen Sie Start sofort, Zahlungsträger erstellen und anschließend Job einplanen. | Die Meldung Zahlungslauf läuft mit einem gelben Ampelstatus wird angezeigt. |  |
| 14 | Zahlung einplanen | Wählen Sie Status, bis die Meldung Zahlungslauf wurde ausgeführt mit einem grünen Ampelstatus angezeigt wird. | Der Zahlungsbeleg wird angelegt.  Wenn Bank Communication Management (BCM) nicht in Ihrem System implementiert ist, wird der Zahlungsträger angelegt, sofern dieser das PMW-Format verwendet. Sie können das Protokoll prüfen, indem Sie Zahlungsprotokoll anzeigen wählen.  Wenn BCM in Ihrem System implementiert ist und in Zahlungsprotokoll anzeigen die Meldung Zahllauf XX/XX/20XX TRM01R ist für zahllaufübergreifende Zahlungsträger vorgesehen angezeigt wird, muss nach dem Zahllauf ein BCM-Batch angelegt werden. Weitere Informationen erhalten Sie im nächsten Testschritt.  HINWEIS  Wenn Sie das Zahllaufprotokoll prüfen, sehen Sie die Meldung Beleg 10000XXXX Buchungskreis XXXX Währung XXX Zahlweg.  Das Bild Maschineller Zahlungsverkehr für Zahlungsanordnungen(F111) wird angezeigt. |  |
| 15 | Zahllaufübergreifender Zahlungsträger (BCM-Batch anlegen) | Wählen Sie Mehr > Umfeld > Zahlungsträger > Zahllaufübergreifende Zahlungsträger > Zahlungsträger erstellen. | Das Bild Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird angezeigt. |  |
| 16 | Zahllaufübergreifender Zahlungsträger (BCM-Batch anlegen) | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Laufdatum: z.B. aktuelles Datum  Identifikation: z.B. TRM01R | Im Dialogfenster Erstellung von zahllaufübergreifenden Zahlungsträgern wird die Meldung Sammler XX/XX/20XX XXXXXX wurde angelegt oder aktualisiert angezeigt. Der BCM-Batch wurde angelegt.  Für einen Batch sind ggf. weitere Genehmigungen erforderlich, bevor schließlich der Zahlungsträger angelegt wird. Weitere Informationen finden Sie im Testskript Erweiterte Kassenvorgänge(J78). |  |

## Vorhandenes Geschäft kopieren

Mit der Funktion zum Kopieren vorhandener Geschäfte können Sie ein neues Geschäft anlegen, indem Sie ein vorhandenes Geschäft kopieren und Daten in begrenztem Umfang ändern, z.B. den Devisenswapsatz, den gehandelten Betrag und das Valutadatum.

Geschäfte können nur für 600er Produkttypen kopiert werden, und Währungstausch wird nicht unterstützt.

### Devisenkassa-/Devisentermingeschäft kopieren

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie ein Devisenkassa- oder Devisentermingeschäft an, indem Sie ein vorhandenes Devisenkassa- oder Devisentermingeschäft kopieren.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird geöffnet. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Im vorherigen Schritt angelegte Nummer des Devisenkassa-/Devisentermingeschäfts> | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird geöffnet. |  |
| 4 | TRM-Geschäft abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang der Geschäftszeile, und wählen Sie Kopieren. | Das Bild Devisengeschäft kopieren: Struktur wird mit den Transaktionsdaten angezeigt. |  |
| 4 | Daten aktualisieren | Aktualisieren Sie die Daten, und wählen Sie die Registerkarte Verwaltung.  Kurs: z.B. EUR/USD 1,2  Geh.Betrag: z.B. USD0,5 Mio.  Valutadatum: +2  Hinweis Für Termingeschäfte können Sie ein Valutadatum größer als +2 unabhängig davon eingeben, ob das bestehende Geschäft ein Devisen- oder Termingeschäft ist. | Die Registerkarte Verwaltung wird angezeigt. |  |
| 5 | Daten auf der Registerkarte „Verwaltung“ eingeben | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  SichKlassifiz.: z.B.: Y0  Risikominderung <markieren>  Hinweis Markieren Sie das Ankreuzfeld „Risikominderung“, sofern dieses Geschäft zur Risikominderung vorgesehen ist. In diesem Fall geht das Geschäft nicht in die Berechnung des Clearing-Schwellen-Reports ein. | Das Geschäft wird gesichert, und eine Geschäftsnummer wird generiert. |  |

### Non-Deliverable Forwards anlegen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In dieser Aktivität legen Sie ein Non-Deliverable-Forward-Geschäft an, indem Sie ein bestehendes NDF kopieren.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird geöffnet. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Im vorherigen Schritt angelegte Nummer des Devisen-NDF-Geschäfts> | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird geöffnet. |  |
| 4 | TRM-Geschäft abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld am Anfang der Geschäftszeile, und wählen Sie Kopieren. | Das Bild Devisengeschäft kopieren: Struktur wird mit den Transaktionsdaten angezeigt. |  |
| 5 | Daten aktualisieren | Aktualisieren Sie die Daten, und wählen Sie die Registerkarte Verwaltung.  Kurs: z.B. EUR/BRL3,3  Geh.Betrag: z.B. BRL10 Mio.  Valutadatum: ++6+2  Fixing-Datum: ++6  Abrechnungswährung: EUR | Die Registerkarte Verwaltung wird angezeigt. |  |
| 6 | Daten auf der Registerkarte „Verwaltung“ eingeben | Geben Sie Daten ein, und wählen Sie Sichern.  SichKlassifiz.: z.B. Y0  Risikominderung <Markieren>  Hinweis Markieren Sie das Ankreuzfeld Risikominderung, sofern dieses Geschäft zur Risikominderung vorgesehen ist. In diesem Fall geht das Geschäft nicht in die Berechnung des Clearing-Schwellen-Reports ein. | Das Geschäft wird gesichert, und eine Geschäftsnummer wird generiert. |  |

## Kündigung des Devisengeschäfts

### Kündigungsanforderung für ein Termingeschäft anlegen, einreichen und freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In einigen Fällen, z.B. wenn ein langfristiges Devisentermingeschäft (oder Devisenkassa, Devisenswap, NDF) übergesichert ist, müssen Sie das Geschäft unter Umständen nach Abstimmung mit Ihrem Kontrahenten kündigen.

In diesem Schritt wählen Sie im Hedge-Management-Cockpit das Devisengeschäft, das beendet werden soll, und legen eine Kündigungsanforderung an. Anschließend wird die Anforderung freigegeben.

Voraussetzungen

Sie haben ein Devisentermingeschäft angelegt und abgerechnet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). |  |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Nehmen Sie folgende Einträge vor, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID: 2R\_TQ\_CH  Hinweis Weitere Details finden Sie im Schritt [Sicherungsanforderung generieren](#unique_41) [Seite ] 85. | Das Hedge Management Cockpit für Sicherungsbereich DE0001 wird mit Nettosicherungen angezeigt. |  |
| 4 | Kündigungsanfrage anlegen | Doppelklicken Sie auf die Kennzahl Nettosicherungen in der Periode des Valutadatums des Termingeschäfts, das Sie zuvor als Voraussetzung angelegt haben.  Wählen Sie die Transaktion aus, die Sie zuvor angelegt haben, klicken Sie auf Sicherungsanforderung, und wählen Sie Kündigungsanfrage in der Dropdown-Liste. | Das Bild Sicherungsanforderung anlegen wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigungsanfrage einreichen | Beschreibung für die Sicherungsanforderung eingeben: Termingeschäft terminieren  Geben Sie auf der Registerkarte Allgemein die folgenden Daten ein, und wählen Sie Einreichen:  Sicherungsanforderungsgrund: Wählen Sie S003 Übersicherungsverarbeitung - Kündigung.  Hinweis Übersteuerung nicht erlaubt | Die Kündigungsanfrage wird mit der ID der Kündigungsanfrage eingereicht.  Nicht vergessen Notieren Sie die ID. |  |
| 6 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Das Bild Sicherungsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001 | Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 8 | Kündigungsanfrage freigeben | Markieren Sie die Zeile der Kündigungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Kündigungsanforderung freigegeben wurde. |  |

### Devisentermingeschäft kündigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt kündigen Sie ein Devisentermingeschäft im System.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <die Nummer des zu kündigenden Devisengeschäfts> | Eine Liste der Währungstransaktionen wird im Bereich Devisen: Sammelbearbeitung - Ergebnisse angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft kündigen | Markieren Sie das Ankreuzfeld des zu kündigenden Geschäfts im Bereich Devisen: Sammelbearbeitung - Ergebnisse, und wählen Sie Kündigen. | Das Bild Devisengeschäft kündigen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigung sichern | Auf dem Bild Devisengeschäft kündigen: Struktur entspricht der Wert des Felds "Aktivität" im Kopfbereich 3 – Kündigung.  Geben Sie im Teilbereich Kündigung folgende Daten ein:  Datum: <das Kündigungsdatum; es sollte zwischen dem Abschlussdatum und dem Valutadatum liegen>  Hinweis Das Kündigungsdatum sollte zwischen dem Buchungsdatum und dem Valutadatum liegen, wenn die Periodenendbewertung und die Buchung erfolgt sind.  Zahlungsdatum: z. B. <Kündigungsdatum + 2 Tage>  Eintragsart: z.B. Kurs  Kurs: z.B. 1,16  Wählen Sie Sichern.  Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen anzeigen angezeigt wird, wählen Sie Weiter (Enter). | Der Zahlungsbetrag für die Kündigung wird berechnet und das Geschäft mit dem Status Kündigung gesichert. |  |
| 6 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Das Bild Sicherungsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001 | Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 8 | Status einer Kündigungsanforderung prüfen | Der Status der Kündigungsanfrage ist Abgeschlossen. |  |  |

### Kündigungsabrechnungsstatus für Devisentermingeschäft setzen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Nachdem Sie ein Devisentermingeschäft im System gekündigt haben, müssen Sie den Status in Kündigungsabrechnung ändern, bevor Sie Buchungen für die Kündigungsbewegung anlegen können. Das Setzen des Status erfolgt in der Regel nach Erhalt der Eingangsbestätigung für die Kündigung durch den Kontrahenten.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. |  |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Kassa-/Termingeschäfte bearbeiten - Sammelbearbeitung(TX06). | Das Bild Devisen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie auf dem Bild Devisen: Sammelbearbeitung die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des Devisegeschäfts im Status "Kündigung"> | Eine Liste der Währungstransaktionen wird im Bereich Devisen: Sammelbearbeitung - Ergebnisse angezeigt. |  |
| 4 | Kündigung abrechnen | Markieren Sie das Ankreuzfeld des abzurechnenden Geschäfts im Feld Devisen: Sammelbearbeitung - Ergebnisse, und wählen Sie Abrechnen. | Das Bild Devisengeschäft abrechnen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigungsabrechnung sichern | Auf dem Bild Devisengeschäft abrechnen: Struktur entspricht der Wert des Felds "Aktivität" im Kopfbereich 4 – Kündigungsabrechnung.  Wählen Sie Sichern.  Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen anzeigen angezeigt wird, wählen Sie Weiter (Enter). | Das Geschäft wird mit dem Status Kündigungsabrechnung gesichert. |  |

### Bewegungen zur Kündigung buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Buchen Sie operative und abgeleitete Bewegungen zum Zahlungsdatum der Kündigung.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Das Bild "Treasury: Bewegungen buchen" wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie in der Sicht Treasury: Bewegungen buchen die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des gekündigten Devisengeschäfts>  Bis einschließlich Fälligkeit: <Zahlungsdatum der Kündigung>  Testlauf: z.B. Entmarkieren Sie dieses Ankreuzfeld.  Alle Bewertungsbereiche buchen: z.B. <Wählen Sie diesen Auswahlknopf.> | Das Dialogfenster "Informationsübersicht" wird angezeigt. |  |
| 4 | Buchungsprotokoll prüfen | Wenn das Dialogfenster Informationsübersicht angezeigt wird, wählen Sie Buchungsprotokoll. | Das Buchungsjournal wird angezeigt. |  |

Hinweis Informationen zu dem Fall, dass die Kündigung zu einer Ausgangszahlung mit einer Zahlungsanforderung führt, finden Sie unter [Zahlungsanforderung für fälliges Geschäft erzeugen](#unique_61) [Seite ] 131 und [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133.

### Kündigungsanforderung für eine Option anlegen, einreichen und freigeben

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Verantwortungsbereich | <Geben Sie den Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In einigen Fällen, z.B. wenn eine langfristige Plain-Vanilla-Devisenoption oder eine Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption übergesichert ist, müssen Sie sie unter Umständen nach Abstimmung mit Ihrem Kontrahenten kündigen.

In diesem Schritt wählt der Risikomanager im Hedge-Management-Cockpit das Devisengeschäft aus, das gekündigt werden soll, und legt eine Kündigungsanforderung an und versendet diese. Anschließend wird die Anforderung freigegeben.

Voraussetzungen

Sie haben eine Devisenoptionsgeschäft angelegt und abgerechnet.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Middle-Office an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Hedge-Management-Cockpit(TOENE). |  |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Nehmen Sie folgende Einträge vor, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001  Layout-ID: 2R\_TQ\_CH  Hinweis Weitere Details finden Sie im Schritt [Sicherungsanforderung generieren](#unique_41) [Seite ] 85. | Das Hedge Management Cockpit für Sicherungsbereich DE0001 wird mit Nettosicherungen angezeigt. |  |
| 4 | Kündigungsanfrage anlegen | Doppelklicken Sie auf die Kennzahl Nettosicherungen in der Periode des Valutadatums des Optionsgeschäfts, das Sie zuvor als Voraussetzung angelegt haben.  Wählen Sie die Transaktion aus, die Sie zuvor angelegt haben, klicken Sie auf Sicherungsanforderung, und wählen Sie Kündigungsanfrage in der Dropdown-Liste. | Das Bild Sicherungsanforderung anlegen wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigungsanfrage einreichen | Beschreibung für die Sicherungsanforderung eingeben: Option kündigen  Geben Sie auf der Registerkarte Allgemein die folgenden Daten ein, und wählen Sie Einreichen:  Sicherungsanforderungsgrund: Wählen Sie S003 Übersicherungsverarbeitung - Kündigung.  Hinweis Übersteuerung nicht erlaubt | Die Kündigungsanfrage wird mit der ID der Kündigungsanfrage eingereicht.  Nicht vergessen Notieren Sie die ID. |  |
| 6 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Das Bild Sicherungsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001 | Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 8 | Kündigungsanfrage freigeben | Markieren Sie die Zeile der Kündigungsanforderung, und wählen Sie Verarbeiten und anschließend Freigeben aus der Dropdown-Liste. | Ein Protokoll zeigt an, dass die Kündigungsanforderung freigegeben wurde. |  |

### Devisenoption kündigen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt kündigen Sie eine Plain-Vanilla-Option oder ein Leg der Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption. Wenn beide Legs der Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption gekündigt werden sollen, kündigen Sie sie einzeln.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Frontoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie auf dem Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <die Nummer des zu kündigenden Devisenoptionsgeschäfts> | Die Liste der Devisenoptionsgeschäfte wird im Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung angezeigt. |  |
| 4 | Geschäft kündigen | Markieren Sie auf dem Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung das Ankreuzfeld des zu kündigenden Geschäfts, und wählen Sie Kündigen. | Das Bild OTC-Option kündigen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigung sichern | Auf dem Bild OTC-Option kündigen: Struktur entspricht der Wert des Felds "Aktivität" im Kopfbereich 3 – Kündigung.  Geben Sie im Teilbereich Kündigung folgende Daten ein:  Kündigungsdatum: <das Kündigungsdatum; es sollte zwischen dem Abschlussdatum und dem Ablaufdatum liegen>  Hinweis Das Kündigungsdatum sollte zwischen dem Buchungsdatum und dem Valutadatum liegen, wenn die Periodenendbewertung und die Buchung erfolgt sind.  Zahlungsdatum: z. B. <Kündigungsdatum + 2 Tage>  Betrag: z.B. -100  Wählen Sie Sichern.  Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen anzeigen angezeigt wird, wählen Sie Weiter (Enter). | Der Vorgang wird mit dem Status Kündigung gesichert. |  |
| 6 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Verarbeitung von Sicherungsanforderungen(TOEHREQO). | Das Bild Sicherungsanforderungen verarbeiten wird angezeigt. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Starten:  Sicherungsbereich: z.B. DE0001 | Sicherungsanforderungen, die den Filterkriterien entsprechen, werden angezeigt. |  |
| 8 | Status einer Kündigungsanforderung prüfen | Der Status der Kündigungsanfrage ist Abgeschlossen. |  |  |

### Kündigungsabrechnungsstatus für Devisenoption setzen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

Wenn das Devisenoptionsgeschäft im System gekündigt wurde, muss der Status des Geschäfts auf Kündigungsabrechnung gesetzt werden, bevor Sie Buchungen für die Kündigungsbewegung anlegen können. Dies erfolgt in der Regel nach Erhalt der Eingangsbestätigung für die Kündigung durch den Kontrahenten.

In diesem Schritt rechnen Sie die Kündigung für eine Plain-Vanilla-Option oder ein Leg der Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption ab. Wenn beide Legs der Null-/Niederstwert-Collar-Devisenoption gekündigt werden sollen, rechnen Sie sie Kündigungen einzeln ab.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Spezialist – Backoffice an. |  |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie OTC-Optionen verarbeiten - Sammelbearbeitung(TI91). | Das Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie auf dem Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen.  Buchungskreis: z.B. 1010  Geschäft: <Nummer des Devisenoptionsgeschäfts im Status „Kündigung“> | Die Liste der Devisenoptionsgeschäfte wird im Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung angezeigt. |  |
| 4 | Kündigung abrechnen | Markieren Sie auf dem Bild OTC-Optionen: Sammelbearbeitung das Ankreuzfeld des zu abzurechnenden Geschäfts, und wählen Sie dann Abrechnen. | Das Bild OTC-Option: Kündigung abrechnen: Struktur wird angezeigt. |  |
| 5 | Kündigungsabrechnung sichern | Auf dem Bild OTC-Optionen: Kündigung abrechnen: Struktur entspricht der Wert des Felds "Aktivität" im Kopfbereich 4 – Kündigungsabrechnung.  Wählen Sie Sichern.  Wenn das Dialogfenster Belegzeilen: Meldungen anzeigen angezeigt wird, wählen Sie Weiter (Enter). | Das Geschäft wird mit dem Status Kündigungsabrechnung gesichert. |  |

### Bewegungen zur Kündigung buchen

Testverwaltung

Kundenprojekt: Füllen Sie die projektbezogenen Teile aus.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Testfall-ID | <X.XX> | Testername |  | Testdatum | Geben Sie ein Testdatum ein. |
| Benutzerrolle(n) |  | | | | |
| Zuständigkeit | <Geben Sie einen Serviceanbieter, einen Kunden oder einen Serviceanbieter zusammen mit einem Kunden an.> | | | Dauer | Geben Sie eine Dauer ein. |

Zweck

In diesem Schritt buchen Sie operative und abgeleitete Bewegungen zum Zahlungsdatum der Kündigung.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisungen | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP Fiori Launchpad als Treasury-Buchhalter an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Bewegungen buchen(TBB1). | Das Bild "Treasury: Bewegungen buchen" wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie in der Sicht Treasury: Bewegungen buchen die folgenden Daten ein, und wählen Sie Ausführen:  Buchungskreis: z.B. 1010.  Geschäft: <Geschäftsnummer der gekündigten Devisenoption>  Bis einschließlich Fälligkeit: <Zahlungsdatum der Kündigung>  Testlauf: z.B. Entmarkieren Sie dieses Ankreuzfeld.  Alle Bewertungsbereiche buchen: z.B. <Wählen Sie diesen Auswahlknopf.> | Das Dialogfenster "Informationsübersicht" wird angezeigt. |  |
| 4 | Buchungsprotokoll prüfen | Wenn das Dialogfenster Informationsübersicht angezeigt wird, wählen Sie Buchungsprotokoll. | Das Buchungsjournal wird angezeigt. |  |

Hinweis Informationen zu dem Fall, dass die Kündigung zu einer Ausgangszahlung mit einer Zahlungsanforderung führt, finden Sie unter [Zahlungsanforderung für Prämie erzeugen](#unique_78) [Seite ] 200 und [Zahlungsanordnung verarbeiten](#unique_62) [Seite ] 133.

Typographic Conventions

|  |  |
| --- | --- |
| Type Style | Description |
| Example | Words or characters quoted from the screen. These include field names, screen titles, pushbuttons labels, menu names, menu paths, and menu options.  Textual cross-references to other documents. |
| Example | Emphasized words or expressions. |
| EXAMPLE | Technical names of system objects. These include report names, program names, transaction codes, table names, and key concepts of a programming language when they are surrounded by body text, for example, SELECT and INCLUDE. |
| Example | Output on the screen. This includes file and directory names and their paths, messages, names of variables and parameters, source text, and names of installation, upgrade and database tools. |
| Example | Exact user entry. These are words or characters that you enter in the system exactly as they appear in the documentation. |
| <Example> | Variable user entry. Angle brackets indicate that you replace these words and characters with appropriate entries to make entries in the system. |
| EXAMPLE | Keys on the keyboard, for example, F2 or ENTER. |

|  |
| --- |
|  |
| www.sap.com/contactsap |
| © 2020 SAP SE or an SAP affiliate company. All rights reserved.  No part of this publication may be reproduced or transmitted in any form or for any purpose without the express permission of SAP SE or an SAP affiliate company. The information contained herein may be changed without prior notice.  Some software products marketed by SAP SE and its distributors contain proprietary software components of other software vendors. National product specifications may vary.  These materials are provided by SAP SE or an SAP affiliate company for informational purposes only, without representation or warranty of any kind, and SAP or its affiliated companies shall not be liable for errors or omissions with respect to the materials. The only warranties for SAP or SAP affiliate company products and services are those that are set forth in the express warranty statements accompanying such products and services, if any. Nothing herein should be construed as constituting an additional warranty.  SAP and other SAP products and services mentioned herein as well as their respective logos are trademarks or registered trademarks of SAP SE (or an SAP affiliate company) in Germany and other countries. All other product and service names mentioned are the trademarks of their respective companies.  See [www.sap.com/copyright](http://www.sap.com/copyright) for additional trademark information and notices. |

