|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
| TestskriptSAP S/4HANA - 20-09-20 | public |
| Market Rates Management – manuell per Upload (1XN\_DE) |

Inhaltsverzeichnis

[1 Zweck 3](#_Toc52218781)

[2 Voraussetzungen 4](#_Toc52218782)

[2.1 Systemzugriff 4](#_Toc52218783)

[2.2 Rollen 4](#_Toc52218784)

[2.3 Stammdaten, Organisationsdaten und sonstige Daten 5](#_Toc52218785)

[2.4 Voraussetzungen/Situation 5](#_Toc52218786)

[3 Übersichtstabelle 6](#_Toc52218787)

[4 Testverfahren 8](#_Toc52218788)

[4.1 Marktdaten manuell erfassen 8](#_Toc52218789)

[4.1.1 Devisenkassakurse eingeben 8](#_Toc52218790)

[4.1.2 Devisen-Swapsätze erfassen 10](#_Toc52218791)

[4.1.3 Währungsvolatilitäten eingeben 12](#_Toc52218792)

[4.1.4 Währungspaare für Volatilitäten mit Moneyness zuordnen 13](#_Toc52218793)

[4.1.5 Werte für Volatilitäten mit Moneyness eingeben 16](#_Toc52218794)

[4.1.6 Zinssätze eingeben 19](#_Toc52218795)

[4.1.7 Zinskurven prüfen 22](#_Toc52218796)

[4.1.8 Referenzeinheiten für Geschäftspartner anlegen 23](#_Toc52218797)

[4.1.9 Attribute Auswertungsarten zuordnen 25](#_Toc52218798)

[4.1.10 Referenzeinheiten bearbeiten 26](#_Toc52218799)

[4.1.11 Credit-Spreads erfassen 28](#_Toc52218800)

[4.1.12 Erfassen von Basis-Spreads 31](#_Toc52218801)

[4.1.13 Wertpapierkurs aktualisieren 33](#_Toc52218802)

[4.1.13.1 Wertpapierkurs aktualisieren – Investmentfondsmanagement für den Geldhandel (2UN) 33](#_Toc52218803)

[4.1.13.2 Wertpapierkurs aktualisieren – Anleihenverwaltung (3WY) 35](#_Toc52218804)

[4.1.14 Faktorwerte für Wertpapiere eingeben 38](#_Toc52218805)

[4.2 Marktdaten per Datei-Upload importieren 43](#_Toc52218806)

[4.2.1 Marktdaten per Datei-Upload importieren 43](#_Toc52218807)

[4.3 Report 53](#_Toc52218808)

[4.3.1 Marktdatenübersicht 53](#_Toc52218809)

# Zweck

Mit diesem Prozess können Sie die relevanten Marktdaten manuell eingeben oder aus einer Tabelle importieren, die für die Prozesse in Treasury and Risk Management erforderlich ist.

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 und Organisationsdaten sowie 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 Risk Manager |  | SAP\_BR\_TREASURY\_RISK\_MANAGER | Treasury | SAP\_BR\_TREASURY\_RISK\_MANAGER |  |

## Stammdaten, Organisationsdaten und sonstige Daten

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

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, BRL |  |  |
| Geschäftspartner | 10537001 |  |  |

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 |
| 22G - Geschäftspartner für Treasury and Risk Management anlegen | Führen Sie Umfangsbestandteil 22G aus, um einen Geschäftspartner anzulegen. |

# Übersichtstabelle

Dieser Umfangsbestandteil 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.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Prozessschritt | Benutzerrolle | Transaktion/App | Erwartete Ergebnisse |
| [Devisenkassakurse eingeben](#unique_8) [Seite ] 8 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Devisenkassakurse erfassen(OB08) | Sie geben die Kassakurse für den Währungstausch ein. |
| [Devisen-Swapsätze erfassen](#unique_9) [Seite ] 10 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Devisen-Swapsätze erfassen(TMDFXFP) | Sie geben die Swap-Sätze für den Währungstausch ein. |
| [Währungsvolatilitäten eingeben](#unique_10) [Seite ] 12 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Währungsvolatilitäten eingeben(JBVFX) | Sie geben die Währungsvolatilität ein. |
| [Währungspaare für Volatilitäten mit Moneyness zuordnen](#unique_11) [Seite ] 13 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Volatilitäten mit Moneyness - Werte eingeben(TMDVOLANAME)Volatilitäten mit Moneyness - Währungspaare zuordnen(TMDAS\_VOLANAME2FX) | Sie ordnen den Währungspaaren einen Volatilitätsnamen zu. |
| [Werte für Volatilitäten mit Moneyness eingeben](#unique_12) [Seite ] 16 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Volatilitäten mit Moneyness - Werte eingeben(TMDVOLANAME) | Sie geben Werte für Volatilitäten mit Moneyness ein. |
| [Zinssätze eingeben](#unique_13) [Seite ] 19 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Zinssätze eingeben(JBIRMC) | Sie geben die Referenzzinssätze ein. |
| [Zinskurven prüfen](#unique_14) [Seite ] 22 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Ertragskurven verwalten(JBYCN) | Sie überprüfen die Zinskurve für eine bestimmte Währung. |
| [Referenzeinheiten für Geschäftspartner anlegen](#unique_15) [Seite ] 23 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Referenzeinheiten anlegen - Geschäftspartner (RMREBP) | Sie legen die Referenzeinheit für einen Geschäftspartner an. |
| [Attribute Auswertungsarten zuordnen](#unique_16) [Seite ] 25 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Attribute zu Auswertungsarten zuordnen(JBREVAL\_CLOUD) | Sie ordnen der Auswertungsart Attribute zu. |
| [Referenzeinheiten bearbeiten](#unique_17) [Seite ] 26 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Referenzeinheiten verwalten(RMRE) | Sie prüfen die Liste der Referenzeinheiten, und legen eine Referenzeinheit für einen Buchungskreis an. |
| [Credit-Spreads erfassen](#unique_18) [Seite ] 28 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Credit-Spreads erfassen(RMCSM) | Sie geben Credit-Spreads für einen Geschäftspartner oder einen eigenen Buchungskreis ein. |
| [Erfassen von Basis-Spreads](#unique_19) [Seite ] 31 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Basis-Spreads erfassen(RMBSM) | Sie geben die Basis-Spreads ein. |
| [Wertpapierkurs aktualisieren – Investmentfondsmanagement für den Geldhandel (2UN)](#unique_20) [Seite ] 33 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Wertpapierkurse erfassen(FW17) | Wertpapierkurse für Investmentfonds für den Geldhandel werden eingegeben. |
| [Wertpapierkurs aktualisieren – Anleihenverwaltung (3WY)](#unique_21) [Seite ] 35 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Wertpapierkurse erfassen(FW17) | Wertpapierkurse für Anleihe werden eingegeben. |
| [Faktorwerte für Wertpapiere eingeben](#unique_22) [Seite ] 38 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Wertpapierkurse erfassen(FW17) | Sie geben Faktorwerte für Wertpapiere ein. |
| [Marktdaten per Datei-Upload importieren](#unique_23) [Seite ] 43 | Treasury-Spezialist – Backoffice | Marktdaten importieren(F2610) | Die Daten wurden importiert und gesichert. |

# 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.

## Marktdaten manuell erfassen

Verwendungszweck

In diesem Abschnitt wird beschrieben, wie ein Benutzer Marktdaten manuell über Fiori-Apps erfassen kann.

### Devisenkassakurse eingeben

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 Prozessschritt geben Sie die Devisenkassakurse manuell ein.

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 Devisenkassakurse erfassen(OB08). | Das Bild Sicht "Währungsumrechnungskurse ändern": Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Datensatz hinzufügen | Finden Sie einen Datensatz, den Sie ändern möchten.Beispiel: Finden Sie den Datensatz mit folgenden Bedingungen:Ab: USDHinweis Für US, geben Sie EUR ein.Ktyp: MBis: EURGültig ab: <erster Tag des letzten Monats>Pflegen Sie eines der folgenden Notierungen gemäß der Devisennotierungskonvention (für EURO-Länder und GB, pflegen Sie z.B. Mengennotierungen), und wählen Sie Sichern:Mengennot.: <Geben Sie einen geeigneten mengennotierten Umrechnungskurs ein.>Preisnot.: <Geben Sie einen geeigneten preisnotierten Umrechnungskurs ein.> | Es wurde ein neuer Devisenkassakurs angelegt. |  |

Für NDF-Geschäfte müssen Sie möglicherweise das folgende Währungspaar hinzufügen.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| KTyp | Gültig ab | Von | Bis | Preisnot. | Mengennot. |
| M | <erster Tag des letzten Monats> | BRL | EUR |  | <Geben Sie einen geeigneten mengennotierten Umrechnungskurs ein.> |

### Devisen-Swapsätze erfassen

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 geben Sie die Devisen-Swapsätze manuell ein.

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 Devisen-Swapsätze erfassen(TMDFXFP). | Das Bild Sicht "Tabelle AT15 anzeigen – Swap-Sätze" anzeigen – Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Datensatz hinzufügen | Wählen Sie Neue Einträge. |  |  |
| 4 | Kurskriterien hinzufügen | Nehmen Sie die folgenden Einträge vor, und wählen Sie Sichern:Gültig ab: <z.B. erster Tag des Vormonats>Ktyp: MVon: USDHinweis Für US geben Sie EUR ein.Bis: EURLaufzeit (in Tagen): z.B. 360Swap-Satz: z.B. <Geben Sie einen passenden Swap-Satz ein.> | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

Hinweis Wenn Sie z.B. die Parmethode verwenden möchten, müssen Sie den Swap-Satz innerhalb von 90 Tagen eingeben (einschließlich Feiertage und Wochenendtage).

Für NDF-Geschäfte müssen Sie möglicherweise das folgende Währungspaar hinzufügen.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Gültig Ab | Umrechnungskurstyp | Ab | Bis | Laufzeit (Tage) | Swapkurs |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | M | EUR | BRL | 360 | <Geben Sie einen geeigneten Swap-Satz ein.> |

### Währungsvolatilitäten eingeben

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 Prozessschritt geben Sie die Währungsvolatilitäten manuell ein, wenn Sie historische Volatilitäten verwenden.

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 Währungsvolatilitäten eingeben(JBVFX). | Die Sicht Sicht "Devisenkursvolatilitäten" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neuen Datensatz hinzufügen | Wählen Sie Neue Einträge, und geben Sie die folgenden Daten ein:Von: z.B. EURBis: z.B. USDVolatilitätsart: 002Datum: z.B. <Tagesdatum>Hinweis Das eingegebene Datum entspricht dem Gültig-ab-Datum.Laufzeit: z.B. 360Volatilität: z.B. 28Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

### Währungspaare für Volatilitäten mit Moneyness zuordnen

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 Prozessschritt ordnen Sie den Währungspaaren Volatilitätsnamen zu, wenn Sie Volatilitäten mit Moneyness verwenden. Wenn Sie den Währungspaaren keinen Volatilitätsnamen zuordnen, verwendet der Auswertungstyp historische Volatilitäten.

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 Volatilitäten mit Moneyness - Werte eingeben(TMDVOLANAME). |  |  |
| 3 | Neuen Volatilitätsnamen hinzufügen | Wählen Sie Neue Einträge, geben Sie die folgenden Daten ein und wählen Sie Sichern:Volatilitätsname: z.B. SFX\_\_EUR\_USD |  |  |
| 4 | Parameter für die Volatilitätsstruktur eingeben | Wählen Sie den Volatilitätsnamen aus, und wählen Sie Volatilitätsprofil.Wählen Sie Neue Einträge, und geben Sie die folgenden Daten ein:Volatilitätsprofil: z.B. SEURUSD\_ATM\_2WOptionslaufzeit: z.B. 14Moneyness-Faktor: z.B. 0,5Hinweis Geben Sie weitere Volatilitätsparameter ein (siehe Liste in der Tabelle am Ende dieses Schritts), und wählen Sie Sichern. |  |  |
| 5 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Volatilitäten mit Moneyness - Währungspaare zuordnen(TMDAS\_VOLANAME2FX). | Die Sicht Sicht "Volatilitäten - Mapping von Währungspaaren": ändern Übersicht wird angezeigt. |  |
| 6 | Neuen Datensatz hinzufügen | Wählen Sie Neue Einträge, und geben Sie folgende Daten ein:Von-Währung: z.B. EURNach-Währung: z.B. USDVolatilitätsname: z.B. SFX\_\_EUR\_USDWählen Sie Sichern.Hinweis Wenn Sie den Währungspaaren keinen Volatilitätsnamen zuordnen, verwendet der Auswertungstyp historische Volatilitäten. | Die Daten werden ohne Fehlermeldung gesichert. |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Volatilitätsname | Volatilitätsprofil | Optionslaufzeit | Moneyness-Faktor |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_2W | 14 | 0,5 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_3M | 90 | 0,5 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_6M | 180 | 0,5 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_9M | 270 | 0,5 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_18M | 540 | 0,5 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_2W | 14 | -0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_3M | 90 | -0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_6M | 180 | -0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_9M | 270 | -0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_18M | 540 | -0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_2W | 14 | -0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_3M | 90 | -0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_6M | 180 | -0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_9M | 270 | -0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_18M | 540 | -0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_2W | 14 | 0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_3M | 90 | 0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_6M | 180 | 0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_9M | 270 | 0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_18M | 540 | 0,1 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_2W | 14 | 0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_3M | 90 | 0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_6M | 180 | 0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_9M | 270 | 0,25 |
| SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_18M | 540 | 0,25 |

Hinweis Passen Sie das Dezimaltrennzeichen an das Systemverhalten an, ändern Sie z.B. Kommata "," in Punkte ".".

### Werte für Volatilitäten mit Moneyness eingeben

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 Prozessschritt geben Sie Werte für Volatilitäten mit Moneyness ein. Wenn Sie keine Volatilitäten mit Moneyness eingeben, auch wenn Sie den Währungspaaren im vorherigen Schritt einen Volatilitätsnamen zugeordnet haben, verwendet die Auswertungsart historische Volatilitäten.

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 Volatilitäten mit Moneyness - Werte eingeben(TMDVOLANAME). | Die Sicht Sicht "Volatilitätsnamen" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Volatilitätsnamen wählen | Wählen Sie den Volatilitätsnamen, der im vorherigen Schritt einem Währungspaar zugeordnet wurde:Volatilitätsname: z.B. SFX\_\_EUR\_USD |  |  |
| 4 | Neuen Datensätze hinzufügen | Wählen Sie im linken Bildbereich den Ordner Volatilitäten mit Doppelklick aus, wählen Sie dann Neue Einträge, geben Sie die folgenden Daten ein und wählen Sie Sichern:Gültigkeitsdatum: z.B. <aktuelles Datum>Volatilitätsart: z.B. 002Volatilitätsprofil: z.B. SEURUSD\_ATM\_2WVolatilität: z.B. 7,310 | Das Bild Sicht "Volatitäten" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 5 | Wiederholen | Wiederholen Sie die oben genannten Schritte, um die in der folgenden Tabelle angegebenen Werte zu bearbeiten.Hinweis Die in der folgenden Tabelle angegebenen Daten dienen lediglich als Beispiel. Es wird empfohlen, die neuesten Marktdaten einzugeben.Wenn mit Moneyness keine Volatilitäten eingegeben werden, übernimmt die Auswertungsart die historischen Volatilitäten.Standardmäßig ist in den vordefinierten Auswertungsarten die Vanna-Volga-Annäherung eingestellt. Wechseln Sie zu Fixpunktiteration über die IMG Auswertungsart definieren und einstellen in SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Grundeinstellungen für Analyzer > Bewertung. Diese Methode funktioniert allerdings am besten, wenn die Marktdaten in 5%-Deltaintervallen verfügbar sind. |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Gültigkeitsdatum | Volatilitätsart | Volatilitätsprofil | Volatilität |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_ATM\_2W | 7,310 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_ATM\_3M | 6,853 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_ATM\_6M | 6,955 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_ATM\_9M | 7,243 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_ATM\_18M | 7,803 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25P\_2W | 7,289 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25P\_3M | 7,093 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25P\_6M | 7,400 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25P\_9M | 7,858 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25P\_18M | 8,445 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10P\_2W | 7,515 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10P\_3M | 7,545 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10P\_6M | 8,098 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10P\_9M | 8,730 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10P\_18M | 9,428 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10C\_2W | 8,175 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10C\_3M | 7,540 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10C\_6M | 7,498 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10C\_9M | 7,650 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_10C\_18M | 8,273 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25C\_2W | 7,707 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25C\_3M | 7,088 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25C\_6M | 7,065 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25C\_9M | 7,238 |
| <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 002 | SEURUSD\_25C\_18M | 7,800 |

Hinweis Die Volatilität für jedes Profil stellt lediglich Beispieldaten für interne Tests dar.

### Zinssätze eingeben

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 die Referenzzinssätze manuell ein.

Hinweis Sie müssen ggf. Ihren eigenen Referenzzinssatz hinzufügen oder Ihren aktuellen Referenzzinssatz Ihren Anforderungen entsprechend aktualisieren. Nehmen Sie die Einstellungen über den IMG Referenzzinssätze definieren vor. Wählen Sie dazu SPRO > Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > GrundfunktionenMarktdatenverwaltung > Stammdaten > Einstellungen zu Referenzzinsen und Zinskurven > Referenzzinssätze definieren.

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 Zinssätze eingeben(JBIRMC). | Das Dialogfenster Feldauswahl wird angezeigt. |  |
| 3 | Kriterien in "Arbeitsbereich festlegen" eingeben Eintrag | Geben Sie keine Daten ein, und wählen Sie Weiter. | Das Bild Sicht "Referenzzinswerte" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Neuen Datensatz hinzufügen | Wählen Sie Neue Einträge. | Die Sicht Neue Einträge: Übersicht Hinzugefügte wird angezeigt. |  |
| 5 | Daten eingeben und sichern | Geben Sie die folgenden neuen Daten ein, und wählen Sie Sichern:Referenz: z.B. EURM03EURHinweis Sie können auch Daten für alternative Refernzzinssätze eingeben, z.B. ESTRM03OIS für EUR.Gültig ab: z.B. <Erster Tag des letzten Monats>Zinssatz: <Geben Sie einen korrekten Zinssatz ein.> | Neue Referenzzinssätze werden gesichert. |  |

Beispiel

Die folgende Tabelle zeigt als Beispiel Referenzzinssätze für EUR.

Tabelle 2: Referenzzinsatz für EUR

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Referenz | Gültig ab | Zinssatz |
| EURD01EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | -0,4240 |
| EURD07EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | -0,2560 |
| EURD14EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | -0,1660 |
| EURM01EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,0640 |
| EURM02EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,2240 |
| EURM03EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,4040 |
| EURM04EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,6640 |
| EURM05EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,8340 |
| EURM06EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,9940 |
| EURM07EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,3540 |
| EURM08EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,4240 |
| EURM09EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,5940 |
| EURM10EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,7840 |
| EURM11EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 0,9640 |
| EURM12EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,2440 |
| EURM18EUR | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,3440 |
| EURY02S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,4340 |
| EURY03S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,7240 |
| EURY04S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,7440 |
| EURY05S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 1,9180 |
| EURY06S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 2,1100 |
| EURY07S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 2,3210 |
| EURY08S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 2,5530 |
| EURY09S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 2,8090 |
| EURY10S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 3,0900 |
| EURY11S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 3,3990 |
| EURY12S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 3,6990 |
| EURY15S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 3,9990 |
| EURY20S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 4,2990 |
| EURY25S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 4,5990 |
| EURY30S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 4,8990 |
| EURY35S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 5,1990 |
| EURY40S6E | Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein. | 5,4990 |

### Zinskurven 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 Zinskurven.

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 Ertragskurven verwalten(JBYCN). | Die Sicht Zinskurven eingeben und auswerten wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Übersicht:Zinskurvenart: 0001Währung: z.B. EURDatum: z.B. <aktuelles Datum>Hinweis Die vordefinierte Zinskurve 0001 ist mit dem Referenzzinssatz IBOR definiert. Sie können auch die vordefinierte Zinskurve 9001 prüfen. Sie ist mit den alternativen Referenzzinssätzen SOFR und ESTER definiert. | Die Sicht Zinskurvenübersicht wird angezeigt. |  |
| 4. | Zinskurvendetails prüfen | Doppelklicken Sie auf eine Zeile, um die Zinskurve für eine bestimmte Währung zu überprüfen. | Das Bild Zinskurve: Details wird angezeigt. |  |

### Referenzeinheiten für Geschäftspartner 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 dieser Aktivität wird beschrieben, wie die Referenzeinheit für einen Geschäftspartner angelegt wird

Voraussetzungen

Ein Geschäftspartner (GP) wurde als Kontrahent angelegt und bearbeitet.

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 Referenzeinheiten anlegen - Geschäftspartner (RMREBP). | Die Sicht Referenzeinheiten für Geschäftspartner anlegen wird angezeigt. |  |
| 3 | Testlauf | Geben Sie folgende Daten ein:Geschäftspartner: z.B. 10537001GP-Rolle: z.B. TR0151Präfix für Referenzeinheits-ID: z.B. BP\_In CS-Kurve verwenden: z.B. <Setzen Sie dieses Kennzeichen.>Credit-Spread-Kurve (Bid): z.B. Y001Credit-Spread-Kurve (Ask): z.B. Y001Credit-Spread-Kurve (Mid): z.B. Y001Wählen Sie Ausführen.Im Dialogfenster Information wählen Sie Weiter, um zur Sicht Referenzeinheiten für Geschäftspartner anlegen zurückzukehren. | Ein Dialogfenster Information wird mit der Meldung 1 neue Einträge wurden eingefügt, 0 vorhandene Einträge aktualisiert angezeigt.Hinweis Wenn bereits ein Referenzeintrag angelegt wurde, erfolgt kein neuer Eintrag. |  |

### Attribute Auswertungsarten zuordnen

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

Stellen Sie den Standardbuchungskreis für den Auswertungstyp bereit, um Credit Spreads abzurufen.

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich am SAP GUI an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | Auf Transaktion zugreifen | Öffnen Sie die Transaktion SPRO, und navigieren Sie zum IMG Auswertungsart definieren und einstellen unter Financial Supply Chain Management > Treasury and Risk Management > Grundeinstellungen für Analyzer > Bewertung.Oder greifen Sie direkt auf die Transaktion CFMEVAL im Befehlsfeld zu. | Das Bild Auswertungsart definieren und einstellen wird angezeigt. |  |
| 3 | Daten eingeben und sichern | Wählen Sie in der Spalte Auswertungstyp die Zeilen Y002 und Y003, geben Sie folgende Daten ein, und wählen Sie Sichern:Standardbuchungskreis: z.B. 1010 | Die Daten werden gesichert. |  |
| 4 | Wiederholen für weitere Auswertungstypen | Wiederholen Sie den vorstehenden Schritt für den Auswertungstyp Y003, AuswArt mit BasSpr. & CredSpr. |  |  |

### Referenzeinheiten bearbeiten

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 Liste der Referenzeinheiten, und legen eine Referenzeinheit für einen Buchungskreis an.

Voraussetzungen

Bevor Sie Referenzeinheiten für Buchungskreise anlegen, stellen Sie sicher, dass der relevante Standardbuchungskreis einer Auswertungsart mit Credit-Spread-Kurve zugeordnet ist.

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 Referenzeinheiten verwalten(RMRE). | Das Bild Sicht "Referenzeinheiten" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | "Neue Einträge" wählen | Wählen Sie Neue Einträge. | Das Bild Neue Einträge: Details der hinzugefügten Einträge wird angezeigt. |  |
| 4 | Parameter eingeben und sichern | Geben Sie folgende Daten ein:Referenzeinheit: z.B. CC\_1010Name: z.B. BuchungskreisBuchungskreis: z.B. 1010In Kurv. ver.: markiertCredit-Spread-Kurve (Bid): z.B. Y001Credit-Spread-Kurve (Ask): z.B. Y001Credit-Spread-Kurve (Mid): z.B. Y001Wählen Sie Sichern. | Die Referenzeinheit für den Buchungskreis wird angelegt und die Daten werden gesichert. |  |

### Credit-Spreads erfassen

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 wird beschrieben, wie Credit-Spreads für einen Geschäftspartner oder Ihren eigenen Buchungskreis erfasst 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 – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Credit-Spreads erfassen(RMCSM). | Das Bild Credit-Spreads pflegen: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Sicht wechseln | Wählen Sie Ändern. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht hinzugefügte "Credit-Spread-Werte" wird angezeigt. |  |
| 4 | Anzeigen | Wählen Sie Anzeigen. | Das Bild Sicht "Credit-Spread-Werte" anzeigen: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 5 | Bearbeiten | Wählen Sie oben rechts in der sicht die Drucktaste Bearbeiten. | Das Bild Sicht "Credit-Spread-Werte" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 6 | Neuer Eintrag | Wählen Sie Neue Einträge. | Das Bild Neue Einträge: Übersicht hinzugefügte "Credit-Spread-Werte" wird angezeigt. |  |
| 7 | Neue Credit-Spreads für Kontrahent erfassen | Geben Sie die folgenden Daten ein, und wählen Sie Sichern.Referenzeinheit: z.B. BP\_0010537001Credit-Spread-ID: z.B. YEAR\_01Notier. Typ: z.B. 1Datum: z.B. <aktuelles Datum>Credit Spread (GP): z.B. 100Hinweis Für den Credit-Spread-Wert in Basispunkten entspricht ein Basispunkt einem Hundertstel eines Prozentpunktes.Wiederholen Sie diese Schritte mit den Daten in den folgenden Tabellen für zusätzliche Credit Spreads für Kontrahenten und Credit Spreads für das eigene Unternehmen. |  |  |
| 8 | Neue Einträge für eigenen Buchungskreis eingeben | Auf dem Bild Sicht "Credit-Spread-Werte: Übersicht" ändern wählen Sie Neue Einträge, und geben Sie folgende Daten ein:Referenzeinheit: z.B. CC\_1010CreditSpread-ID: z.B. MONTH\_03Notierungsart: z.B. 1Datum: z.B. <Aktuelles Datum>Credit Spread (GP): z.B. 50Hinweis Für den Credit-Spread-Wert in Basispunkten (BP) entspricht ein Basispunkt einem Hundertstel eines Prozentpunktes.Wählen Sie dann Sichern. |  |  |

Beispieldaten

* Credit-Spreads für Kontrahent

Hinweis Ändern Sie den Wert Gültig ab auf den ersten Tag des aktuellen Monats, damit die Daten zu einem späteren Zeitpunkt wieder verwendet werden können.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Referenzeinheit | CreditSprdID | Notierungsart | Erster Tag des aktuellen Monats | CreditSprd (BP) |
| BP\_0010537001 | MONTH\_03 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 100 |
| BP\_0010537001 | MONTH\_06 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 150 |
| BP\_0010537001 | MONTH\_09 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 200 |
| BP\_0010537001 | YEAR\_02 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 400 |
| BP\_0010537001 | YEAR\_03 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 500 |

* Credit-Spreads für eigenen Buchungskreis

Hinweis Ändern Sie den Wert Gültig ab auf den ersten Tag des aktuellen Monats, damit die Daten zu einem späteren Zeitpunkt wieder verwendet werden können.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Referenzeinheit | CreditSprdID | Notierungsart | Datum | CreditSprd (BP) |
| CC\_1010 | MONTH\_06 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 200 |
| CC\_1010 | MONTH\_09 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 300 |
| CC\_1010 | YEAR\_01 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 400 |
| CC\_1010 | YEAR\_02 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 500 |
| CC\_1010 | YEAR\_03 | 1 | <erster Tag des aktuellen Monats> | 550 |

### Erfassen von Basis-Spreads

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 wird beschrieben, wie Basis-Spreads eingegeben 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 – Backoffice an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Basis-Spreads erfassen(RMBSM). | Die Sicht Basis-Spreads bearbeiten: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Basis-Spread-ID: z.B. CBRLUSD1M01YIn: z.B. TUSD6M3M05YWählen Sie Ändern. | Das Bild Sicht "Credit-Spread-Werte" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 4 | Erfassen neuer Basis-Spreads | Wählen Sie Neue Eingabezeile, und geben Sie folgende Daten ein:Basis-Spread-ID: z.B. TUSD1M3M01YNotierungsart: z.B. 1Notierungsdatum: z.B. <aktuelles Datum>Basis-Spread (GP): z.B. 8Hinweis Für den Basis-Spread-Wert in Basispunkten (BP) entspricht ein Basispunkt einem Hundertstel eines Prozentpunktes.Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 5 | Wiederholen | Wiederholen Sie die Schritte mit den Werten aus der folgenden Tabelle. | Zusätzliche Basis-Spread-ID werden eingegeben und gespeichert. |  |

Beispieldaten

* Basis-Spreads

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Basis-Spread-ID | Notier. | Notierungsdatum | BasSpread(BP) |
| CBRLUSD1M01Y | 1 | Aktuelles Datum | 12 |
| CEURUSD3M01Y | 1 | Aktuelles Datum | 15 |
| TEUR6M3M01Y | 1 | Aktuelles Datum | -10 |
| TUSD1M3M01Y | 1 | Aktuelles Datum | 8 |
| TUSD6M3M01Y | 1 | Aktuelles Datum | -18 |

### Wertpapierkurs aktualisieren

#### Wertpapierkurs aktualisieren – Investmentfondsmanagement für den Geldhandel (2UN)

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 dieser Aktivität erfassen Sie den Wertpapierkurs.

Voraussetzung

Die Wertpapiergattungen MMF\_DE1, MMF\_DE2 und MMF\_DE3 wurden gemäß den im Testskript "Investmentfondsmanagement für den Geldhandel" (2UN) beschriebenen Verfahren 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 Wertpapierkurse erfassen(FW17). | Das Bild Wertpapierkurs bearbeiten: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. MMF\_DE1Exchange: z.B. SMMFWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 4 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. <Aktuelles Datum>Preisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 1,0002Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 5 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. MMF\_DE2Exchange: z.B. SMMFWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 6 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. <Aktuelles Datum>Preisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 1,0002Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. MMF\_DE3Exchange: z.B. SMMFWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 8 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. <Aktuelles Datum>Preisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 1,0002Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |

#### Wertpapierkurs aktualisieren – Anleihenverwaltung (3WY)

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 dieser Aktivität erfassen Sie den Wertpapierkurs.

Voraussetzung

Die Wertpapiergattungen BD\_DE1, BD\_DE2, BD\_DE3, BD\_DE4 und BD\_DE5 wurden gemäß den Anweisungen im Testskript Anleihenverwaltung (3WY) 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 Wertpapierkurse erfassen(FW17). | Das Bild Wertpapierkurs bearbeiten: Einstieg wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. BD\_DE1Börse: z.B. EURONEXT PWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 4 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. letztes Datum des aktuellen MonatsPreisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 99Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 5 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. BD\_DE2Börse: z.B. EURONEXT PWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 6 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. letztes Datum des aktuellen MonatsPreisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 99Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 7 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. BD\_DE3Börse: z.B. EURONEXT PWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 8 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. letztes Datum des aktuellen MonatsPreisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 99Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 9 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. BD\_DE4Börse: z.B. EURONEXT PWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 10 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. letztes Datum des aktuellen MonatsPreisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 99Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |
| 11 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Daten ein:Kennnummer: z.B. BD\_DE5Börse: z.B. EURONEXT PWählen Sie dann Ändern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |
| 12 | Kurskriterien erfassen | Geben Sie folgende Daten ein:Preisdatum: z.B. letztes Datum des aktuellen MonatsPreisart: SpotPreis / Kurs: z.B. 99Wählen Sie Sichern. | Die Daten werden gesichert. |  |

### Faktorwerte für Wertpapiere eingeben

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 dieser Aktivität wird beschrieben, wie Sie Faktorwerte für Wertpapiere eingeben.

Voraussetzung

Die Wertpapiergattungen MMF\_DE1, MMF\_DE2 und MMF\_DE3 wurden gemäß den Anweisungen im Testskript Investmentfondsmanagement für den Geldhandel(2UN) 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 Faktorwerte eingeben(TMDFACTORVAL) | Die Sicht Sicht "Faktorwerte eingeben" ändern: Übersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Neue Faktorwerte eingeben und Änderung sichern | Geben Sie folgende Daten ein:Satz 1Wertpapiergattung: z.B. MMF\_DE1Faktorart: z.B. SD\_FACTOR:Gültig ab: <letzter Tag des laufenden Monats>Faktorwerte: z.B. 0,001226122Satz 2Wertpapiergattung: z.B. MMF\_DE2Faktorart: z.B. SD\_FACTOR:Gültig ab: z.B. <aktuelles Datum>Faktorwerte: z.B. 0,000040014Satz 3Wertpapiergattung: z.B. MMF\_DE3Faktorart: z.B. SD\_FACTOR:Gültig ab: z.B. <aktuelles Datum>Faktorwerte: z.B. 0,000040014Wählen Sie Sichern. | Die Sicht Wertpapierkurs ändern wird angezeigt. |  |

Legen Sie die Faktorwerte unter Verwendung folgender Tabelle an. Sie können die Marktdaten auch durch Hochladen einer Datei importieren.

Hinweis Der Gültigkeitstermin (JJJJMMTT) in der folgenden Form dient lediglich als Beispiel. Damit die Dividendenausschüttung aktiviert wird, muss der Gültigkeitstermin mit dem Gültigkeitstermin oder Gültig-ab-Datum des Einkaufsvorgangs für Wertpapiere identisch sein.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | ID-Nummer | Faktorart | Gültigkeitstermin (JJJJMMTT) | Dividendenfaktor |
| 41 | MMF\_DE1 | SM\_FACTOR | 20180331 | 0,001226122 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180301 | 0,000040014 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180302 | 0,000040196 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180303 | 0,000040177 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180304 | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180305 | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180306 | 0,000040187 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180307 | 0,000039978 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180308 | 0,000040168 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180309 | 0,000040137 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180310 | 0,00004009 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180311 | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180312 | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180313 | 0,000040076 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180314 | 0,000039783 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180315 | 0,000039772 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180316 | 0,000039803 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180317 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180318 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180319 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180320 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180321 | 0,000039243 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180322 | 0,000039167 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180323 | 0,000039083 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180324 | 0,000038902 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180325 | 0,000038657 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180326 | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180327 | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180328 | 0,000038539 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180329 | 0,000039237 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180330 | 0,000038784 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | 20180331 | 0,000038963 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180301 | 0,000040014 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180302 | 0,000040196 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180303 | 0,000040177 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180304 | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180305 | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180306 | 0,000040187 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180307 | 0,000039978 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180308 | 0,000040168 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180309 | 0,000040137 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180310 | 0,00004009 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180311 | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180312 | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180313 | 0,000040076 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180314 | 0,000039783 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180315 | 0,000039772 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180316 | 0,000039803 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180317 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180318 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180319 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180320 | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180321 | 0,000039243 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180322 | 0,000039167 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180323 | 0,000039083 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180324 | 0,000038902 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180325 | 0,000038657 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180326 | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180327 | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180328 | 0,000038539 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180329 | 0,000039237 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180330 | 0,000038784 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | 20180331 | 0,000038963 |

## Marktdaten per Datei-Upload importieren

### Marktdaten per Datei-Upload importieren

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 importieren Sie Marktdaten per Datei-Upload.

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 Marktdaten importieren(F2610). | Das Bild Marktdaten importieren wird angezeigt. |  |
| 3 | "Vorlage herunterladen" auswählen | Wählen Sie im unteren Bereich der Sicht die Option Vorlage herunterladen. | Das Dialogfenster Vorlagen herunterladen wird angezeigt. |  |
| 4 | Vorlage zum Herunterladen auswählen | Geben Sie Selektionskriterien ein, und wählen Sie Herunterladen:Typauswahl: UmrechnungskurseDatenauswahl: z.B. Mit StammdatenFormatauswahl: z.B. Typspezifische DateienHinweis Wiederholen Sie den Schritt für andere Marktdatentypen, z.B. Zinssätze, Credit Spreads usw., wie in der folgenden Tabelle beschrieben. | Die Vorlage wird heruntergeladen. |  |
| 5 | Vorlage ausfüllen und hochladen | Geben Sie die erforderlichen Informationen für die Vorlage ein, und laden Sie sie anschließend hoch.Hinweis In der ersten Spalte der Vorlagendateien müssen Sie den Marktdatentyp angeben. Die Werte, die Sie eingeben müssen, finden Sie unten in der Tabelle Liste der Marktdatentypen und Apps. | Der Teilbereich Validierung von Umrechnungskursen wird angezeigt. |  |
| 6 | Meldungen bestätigen und importieren | Wenn Sie keine weiteren Änderungen vornehmen möchten, bestätigen Sie die Meldungen, und wählen Sie Importieren. | Die Kurse werden ohne Fehler importiert. |  |
| 7 | Verfügbarkeit der importierten Daten bestätigen | Öffnen Sie die manuelle Eingabe-App, um zu bestätigen, dass die richtigen Daten importiert wurden.Weitere Informationen zu den entsprechenden Apps finden Sie in der Tabelle Liste der Marktdatentypen und Apps. | Die importierten Daten können gefunden werden. |  |

Liste der Marktdatentypen und Apps

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Name | Typ | Apps |
| Wechselkurse | 01 | Devisenkassakurse erfassen(OB08) |
| Wertpapierkurs aktualisieren | 02 | Wertpapierkurse erfassen(FW17) |
| Zinssätze | 03 | Zinssätze eingeben(JBIRMC) |
| Basis-Spreads | 09 | Basis-Spreads erfassen(RMBSM) |
| Credit-Spreads | 10 | Credit-Spreads erfassen(RMCSM) |
| Devisenswapsätze | 21 | Devisen-Swapsätze erfassen(TMDFXFP) |
| Implizite Volatilitäten | 30 | Volatilitäten mit Moneyness - Werte eingeben(TMDVOLANAME) |
| Währungsvolatilität | 31 | Währungsvolatilitäten eingeben(JBVFX) |
| Faktorwerte | 41 | Faktorwerte eingeben(TMDFACTORVAL) |

Beispieldaten

Sie können zum Testen die folgenden Daten verwenden: Kopieren Sie diese Testdaten in die heruntergeladene Vorlage, und passen Sie die Daten Ihren Geschäftsanforderungen entsprechend an.

Wechselkurse

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | Von-Währung | Nach-Währung | Umrechnungskurstyp | Datum (JJJJMMTT) | Umrechnungskurs | Von-Faktor | Nach-Faktor | Kursnotierung |
| 01 | USD | EUR | M | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | <Geben Sie einen geeigneten Satz ein.> | 1 | 1 | X |
| 01 | BRL | EUR | M | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | <Geben Sie einen geeigneten Satz ein.> | 1 | 1 | X |

Hinweis Geben Sie für das Feld Kursnotierung "X" ein, um die Mengennotierung anzuzeigen, und lassen Sie es leer, um die Preisnotierung anzuzeigen.

* Devisenswapsätze

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | Von-Währung | Nach-Währung | Umrechnungskurstyp | Datum gültig ab (JJJJMMTT) | Laufzeit (Tagen) | Devisenswapsatz |
| 21 | EUR | USD | M | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 360 | <Geben Sie einen geeigneten Satz ein.> |
| 21 | EUR | BRL | M | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 360 | <Geben Sie einen geeigneten Satz ein.> |

* Währungsvolatilitäten

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | Von-Währung | Nach-Währung | Volatilitätsart | Datum gültig ab (JJJJMMTT) | Laufzeit | Volatilität |
| 31 | EUR | USD | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 180 | 26 |
| 31 | EUR | USD | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 360 | 28 |

* Implizite Volatilitäten

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | Volatilitätsname | Volatilitätsprofil | VArt | Gültigkeitsdatum | Volatilität |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_2W | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,310 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_3M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 6,853 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_6M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 6,955 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_9M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,243 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_ATM\_18M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,803 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_2W | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,289 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_3M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,093 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_6M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,400 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_9M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,858 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25P\_18M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 8,445 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_2W | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,515 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_3M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,545 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_6M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 8,098 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_9M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 8,730 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10P\_18M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 9,428 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_2W | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 8,175 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_3M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,540 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_6M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,498 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_9M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,650 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_10C\_18M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 8,273 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_2W | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,707 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_3M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,088 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_6M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,065 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_9M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,238 |
| 30 | SFX\_EUR\_USD | SEURUSD\_25C\_18M | 002 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 7,800 |

Zinssätze

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | Referenzzinssatz | Datum (JJJJMMTT) | Zinssatz |
| 03 | EURD01EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | -0,4240 |
| 03 | EURD07EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | -0,2560 |
| 03 | EURD14EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | -0,1660 |
| 03 | EURM01EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,0640 |
| 03 | EURM02EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,2240 |
| 03 | EURM03EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,4040 |
| 03 | EURM04EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,6640 |
| 03 | EURM05EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,8340 |
| 03 | EURM06EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,9940 |
| 03 | EURM07EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,3540 |
| 03 | EURM08EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,4240 |
| 03 | EURM09EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,5940 |
| 03 | EURM10EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,7840 |
| 03 | EURM11EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,9640 |
| 03 | EURM12EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,2440 |
| 03 | EURM18EUR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,3440 |
| 03 | EURY02S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,4340 |
| 03 | EURY03S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,7240 |
| 03 | EURY04S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,7440 |
| 03 | EURY05S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,9180 |
| 03 | EURY06S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,1100 |
| 03 | EURY07S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,3210 |
| 03 | EURY08S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,5530 |
| 03 | EURY09S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,8090 |
| 03 | EURY10S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,0900 |
| 03 | EURY11S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,3990 |
| 03 | EURY12S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,6990 |
| 03 | EURY15S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,9990 |
| 03 | EURY20S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 4,2990 |
| 03 | EURY25S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 4,5990 |
| 03 | EURY30S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 4,8990 |
| 03 | EURY35S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 5,1990 |
| 03 | EURY40S6E | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 5,4990 |
| 03 | USDD01LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,9300 |
| 03 | USDD02DEP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,0200 |
| 03 | USDD07LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,0400 |
| 03 | USDD14LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,9800 |
| 03 | USDM01LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,1100 |
| 03 | USDM02LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,2600 |
| 03 | USDM03LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,3400 |
| 03 | USDM04LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,4100 |
| 03 | USDM05LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,4900 |
| 03 | USDM06LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,5400 |
| 03 | USDM07LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,5900 |
| 03 | USDM08LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,6500 |
| 03 | USDM09LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,7000 |
| 03 | USDM10LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,7500 |
| 03 | USDM11LIB | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,8100 |
| 03 | USDM12USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,4100 |
| 03 | USDY02USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,5000 |
| 03 | USDY03USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,6900 |
| 03 | USDY04USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,9000 |
| 03 | USDY05USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,1300 |
| 03 | USDY06USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,3200 |
| 03 | USDY07USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,4800 |
| 03 | USDY08USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,6100 |
| 03 | USDY09USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 2,7100 |
| 03 | USDY10USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,0800 |
| 03 | USDY11USA | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 3,2000 |
| 03 | BRLD01SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 9,3200 |
| 03 | BRLM01SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 9,4400 |
| 03 | BRLM02SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 9,4900 |
| 03 | BRLM03SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 9,5257 |
| 03 | BRLM04SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 10,0457 |
| 03 | BRLM06SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 10,4830 |
| 03 | BRLY01SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 10,8408 |
| 03 | BRLY02SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 11,7350 |
| 03 | BRLY03SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 12,1510 |
| 03 | BRLY04SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 12,3259 |
| 03 | BRLY05SWP | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 12,4016 |

Wertpapierkurse

Wenn Sie 2UN verwenden, können Sie Wertpapierkurse wie in der folgenden Tabelle importieren.

Als Voraussetzung sollten Sie Wertpapiergattungen anlegen, wie im Testskript Investmentfondsmanagement für den Geldhandel(2UN) beschrieben.

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | ID-Nummer | Handelsplatz | Preisart | Preisdatum (JJJJMMTT) | Preis einer Einheit | Not.-Whrg. |
| 02 | MMF\_DE1 | SMMF | 09 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1 | EUR |
| 02 | MMF\_DE2 | SMMF | 09 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,0002 | EUR |
| 02 | MMF\_DE3 | SMMF | 09 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 1,0002 | EUR |

Wenn Sie 3WY verwenden, können Sie Wertpapierkurse wie in der folgenden Tabelle importieren.

Als Voraussetzung sollten Sie Wertpapiergattungen wie im Testskript Anleihenverwaltung(3WY) beschrieben anlegen.

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | ID-Nummer | Handelsplatz | Preisart | Preisdatum (JJJJMMTT) | Preis einer Einheit | Not.-Whrg. |
| 02 | BD\_DE1 | EURONEXT P | 01 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 99 | EUR |
| 02 | BD\_DE2 | EURONEXT P | 01 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 99 | EUR |
| 02 | BD\_DE3 | EURONEXT P | 01 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 99 | EUR |
| 02 | BD\_DE4 | EURONEXT P | 01 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 99 | EUR |
| 02 | BD\_DE5 | EURONEXT P | 01 | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 99 | EUR |

Dividendenfaktoren für Wertpapiere

Wenn Sie 2UN verwenden, können Sie die Faktoren für die Wertpapierdividende wie in der folgenden Tabelle importieren.

Als Voraussetzung sollten Sie Wertpapiergattungen anlegen, wie im Testskript Investmentfondsmanagement für den Geldhandel(2UN) beschrieben.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Marktdatentyp | ID-Nummer | Faktorart | Gültigkeitstermin (JJJJMMTT) | Dividendenfaktor |
| 41 | MMF\_DE1 | SM\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,001226122 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040014 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040196 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040177 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040187 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039978 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040168 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040137 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,00004009 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040076 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039783 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039772 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039803 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039243 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039167 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039083 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038902 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038657 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038539 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039237 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038784 |
| 41 | MMF\_DE2 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038963 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040196 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040177 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040188 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040187 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039978 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040168 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040137 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,00004009 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040077 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000040076 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039783 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039772 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039803 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039331 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039243 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039167 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039083 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038902 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038657 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038656 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038539 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000039237 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038784 |
| 41 | MMF\_DE3 | SD\_FACTOR | <Geben Sie den letzten Tag des Vormonats ein.> | 0,000038963 |

## Report

### Marktdatenübersicht

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

Marktdaten zur Überprüfung anzeigen

Vorgehensweise

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Testschrittnummer | Bezeichnung des Testschritts | Anweisung | Erwartetes Ergebnis | Bestanden/Nicht bestanden/Anmerkung |
| 1 | Anmelden | Melden Sie sich als Treasury Risk Manager am SAP Fiori Launchpad an. | Das SAP Fiori Launchpad wird angezeigt. |  |
| 2 | SAP-Fiori-App aufrufen | Öffnen Sie Marktdatenübersicht(F3941). | Das Bild Marktdatenübersicht wird angezeigt. |  |
| 3 | Selektionskriterien eingeben | Geben Sie die folgenden Selektionskriterien ein.Schlüsseldaten: z.B. <aktuelles Datum>Kurstyp, z.B MPreisart: z.B. 01Währungspaar: z.B. EUR/USDReferenzzins: z.B. EURM03EUR | Die Karten Historischer Devisenkassakurs, Devisenkassakurs, Devisenswapsatz, Historischer Wertpapierkurs, Aktueller Wertpapierkurs werden gemäß den Filterwerten angezeigt. |  |

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. |

