



Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Datum: 19.03.2015

HSBC  Trinkaus

Die **Schnittstelle** oder das Interface ([['intəfeɪs](#)] oder [['ɪntəfeɪs](#)], englisch für *Grenzfläche*) ist der Teil eines [Systems](#), welcher der [Kommunikation](#) dient.



Der Begriff stammt ursprünglich aus der Naturwissenschaft und bezeichnet die physikalische [Phasengrenze](#) zweier Zustände eines Mediums.^{[\[1\]](#)}

Er beschreibt bildhaft die Eigenschaft eines Systems als [Black Box](#), von der nur die „Oberfläche“ sichtbar ist, und daher auch nur darüber eine Kommunikation möglich ist. Zwei benachbarte Black Boxes können nur miteinander kommunizieren, wenn ihre Oberflächen „zusammenpassen“.

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Standardisierung

Warum unterhalten wir uns über Datenaustausch und Schnittstellen?



(aus Computer Bild-13.03.2014, 17:35 Uhr)

Warum unterhalten wir uns über Datenaustausch und Schnittstellen?

Gesetzesvorlage verabschiedet

EU: Einheitliche Handy-Ladegeräte ab 2017 beschlossen

Ab 2017 sind einheitliche Ladegeräte für Mobiltelefone in der Europäischen Union (EU) Pflicht. Das EU-Parlament stimmte für eine entsprechende Gesetzesvorlage.

Vorteile für die Verbraucher

Verbraucher sparen Geld, wenn sie für ein neues Handy kein weiteres Ladegerät benötigen. Und auch die Umwelt freut sich, denn die Vereinheitlichung erspart Tausende Tonnen Elektromüll. Allerdings haben nach Schätzungen der EU-Kommission schon 90 Prozent aller neuen Telefone seit 2013 Netzteile, die auch Akkus anderer Geräte aufladen. Nach der Grundsatzvereinbarung 2009 hatten sich die Hersteller freiwillig dazu verpflichtet. Wie genau der neue Universal-Stecker aussieht, ist noch nicht klar. Die EU-Kommission berät mit den Herstellern in den kommenden Monaten über ein technisch optimales Format.

(aus Computer Bild-13.03.2014, 17:35 Uhr)

Einige allgemeine Gedanken

- Ein Standard für Handy Ladegeräte spart Ressourcen und ist damit umweltfreundlich
- Aber ein Standard für die Krümmung einer Gurke ist befremdlich
- Standardisierung vs. Differenzierung
- Standardisierung verhindert Innovation
- Regelt nicht der Markt, was ein Gesetzgeber nicht schaffen kann, der beste Standard setzt sich durch
- Welches ist der richtige/beste Standard

Einige spezielle Gedanken

- HSBC arbeitet mit 13 KVG'en zusammen und erhält verschiedenste Formate
- die KVG 'en setzen Simcorp, Xentis, GP3 und weitere Systeme dennoch gibt es auch innerhalb eines Systems unterschiedliche Formate
- für HSBC steht die Ressourcenfrage im Vordergrund

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Ein Unterarbeitskreis entsteht

Ein Unterarbeitskreis bildet sich:

- Am 03.06.2013 hält Herr Gruss HSBC einen Vortrag zum Thema „Automatisierung und Standardisierung – The never ending story: Optimierung von Schnittstellen zwischen Depotbank und KAG für Daten- und Preislieferungen“
- Er wird von Herrn Dr. Popp, Geschäftsführer der HELABA angesprochen, ob man dieses Thema nicht gemeinsam zwischen Verwahrstellen und KVG'en im Rahmen einer Arbeitsgruppe behandeln könne
- Es dauert bis zum Juli 2014 bis die Abstimmungen so weit sind, dass der BdB und der BVI eine Einladung an die Mitgliedsinstitute senden
- Die erste Sitzung findet am 16.09.2014 statt

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Mitglieder des Unterarbeitskreises

Der Unterarbeitskreis Schnittstellen:

- Der Unterarbeitskreis besteht aus 20 Mitgliedern und setzt sich aus Vertretern von Verwahrstellen, Kapitalverwaltungsgesellschaften und Dienstleistern zusammen

Mitglieder:	
BNY Mellon Service Kapitalanlage-Gesellschaft mbH	KAS BANK N.V. - German Branch
BVI	Landesbank Baden-Württemberg
Deka Investment GmbH	NORD/LB Norddeutsche Landesbank Girozentrale
DekaBank - Deutsche Girozentrale	State Street Bank GmbH
Deutsche WertpapierService Bank AG	The Bank of New York Mellon SA/NV
DWS Holding & Service GmbH	Union IT-Services-GmbH
Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH	Union Service-Gesellschaft mbH
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG	Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Internationale Kapitalanlagegesellschaft mbH	WGZ BANK AG
J.P. Morgan	

Was soll behandelt werden?

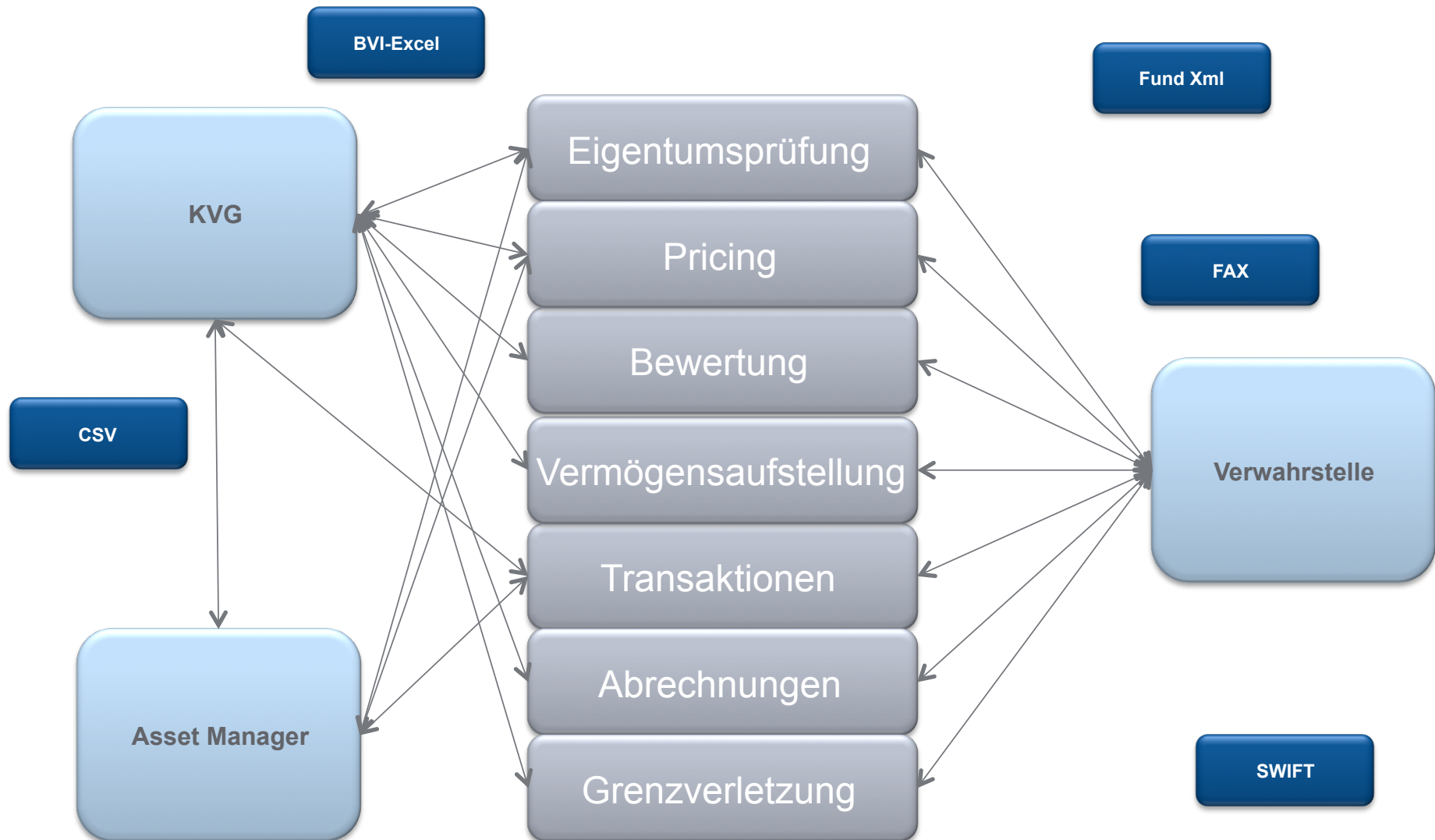
- Insgesamt sollen alle bestehenden Schnittstellen von der UAG beleuchtet werden, ggf. werden nicht für alle Schnittstellen auch Empfehlungen ausgesprochen.

Grundsätzlich sollen die folgenden Themengebiete abgedeckt/betrachtet werden:

- Transaktionen
- Abrechnungen
- Vermögensaufstellung
- Bewertungen
- Grenzverletzungen
- Eigentumsüberprüfung
- Pricing

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Datenaustausch



Was kann die Arbeitsgruppe leisten?

- Die Unterarbeitsgruppe ist sich einig, dass sie für Standards zur Kommunikation zwischen Kapitalverwaltungsgesellschaften und Verwahrstellen **nur Empfehlungen** aussprechen kann
- Die Empfehlungen der Arbeitsgruppe sollen, nach Würdigung durch die entsprechenden Gremien der Verbände, von der DK und dem BVI an die Mitgliedsinstitute weitergegeben werden
- Die Mitglieder der Arbeitsgruppe werden die Empfehlungen in den eigenen Häusern verbreiten und für eine Umsetzung werben

Womit geht es los?

- Es wurde diskutiert, mit welchem Thema begonnen werden soll. Dabei wurden 3 Themengebiete vorgeschlagen: Vermögensaufstellung (zur Kontrolle und Fondspreisbestätigung), Anlagegrenzprüfung (Interpretation und Gestaltung der Regelwerke) und Eigentumsüberprüfung (welche Dokumente sind bei welcher Asset Klasse einzureichen)
- Per Mehrheitsbeschluss wurde festgelegt, mit der Vermögensaufstellung zu beginnen
- Nach verschiedenen Diskussionen um die Vorgehensweise wurde beschlossen, eine kleine Gruppe (bestehend aus Vertretern der Verwahrstellen) mit der Vorbereitung des nächsten Termins zu beauftragen
- Auf der Grundlage der im FundsXML-Standard enthaltenen Felder sollen die Verwahrstellen eine GAP Analyse durchführen, welche Inhalte ggf. fehlen und Anforderungen an die einzelnen Felder zu formulieren

Was ist bisher gelungen / Stand der Dinge?

Die Verwahrstellen haben bisher den Datenaustausch/Standard für die Vermögensaufstellung vorbereitet:

- Vorschläge erstellt zu
 - Systemanforderungen
 - Namenskonventionen
 - Inhalte zu Identifiern (zur eindeutigen Identifikation der Fonds)
 - Inhalte zur Darstellung der Strukturen Master/Sub; Tranchen
- und eine Datenstruktur

Was ist bisher gelungen / Stand der Dinge?

■ Datenstruktur:

- Wertpapiervermögen
- Optionen
- Futures
- DTG
- Swaps
- Anlagekonto
- Auslagerungskonto
- Marginkonto
- Termingeld
- Stückzinsen
- Dividenden
- Forderungen Termingeld
- Quest
- KK Zinsen
- Sonstige Forderungen (ggf. weitere Untergliederung)
- Verbindlichkeiten
- Rückstellungen
- Verbindlichkeiten aus offenen Geschäften (ggf.)

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Unterarbeitskreis – Beispiel FundXML

Was ist bisher gelungen / Stand der Dinge?

- Erste Zuordnungen zu den FundXML Feldern – Wertpapierstammdaten

Feld	Format	Beispiel	Pflichtfeld
Wertpapierkennnummer	ISO Code	855244	Nein

Feld gem. Fund XML DataDictionary Element	Feld gem. Fund XML DataDictionary Complex Type	Berscheibung	Bemerkung
FundsXML/ AssetMasterData/ Asset/ SecurityCodes(SecurityCodesType)	SecurityCodesType/ CountrySecurityCode/ CountryCode(ISOCountryCodeType) - und - SecurityCodesType/ CountrySecurityCode/ SecurityNumber	Code for a nation with its own government. The code is checked against the list of country names obtained from the United Nations (ISO 3166, Alpha-2 code) Here: Code for the country to which the security code is related to.	Weiteres Feld für Code Type einführen

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Unterarbeitskreis – Beispiel FundXML

Was ist bisher gelungen / Stand der Dinge?

- Erste Zuordnungen zu den FundXML Feldern – Wertpapierstammdaten

Feld	Format	Beispiel	Pflichtfeld
Anlagewährung	ISO Code	USD	Ja

Feld gem. Fund XML DataDictionary Element	Feld gem. Fund XML DataDictionary Complex Type	Berscheibung	Bemerkung
FundsXML/ AssetMasterData /Asset/Security/ Equity/ Currency(ISOCurr encyCodeType)	AmountType/ AmountCurrency / Currency(ISOCur rencyCodeType)	The currency code must be a valid active currency code, not yet withdrawn on the day the message containing the currency is exchanged. Valid active currency codes are registered with the ISO 4217 Maintenance Agency, consist of three (3) contiguous letters, and are not yet withdrawn on the day the message containing the currency is exchanged.	ggf. Problematisch, je Type of Asset ein XML Feld und unklarer Zusammenhang zu dem Feld Amount Type

Was spricht für XML?

(Hinweis: Es ist weder eine Entscheidung getroffen, noch ist eine Empfehlung ausgesprochen worden. Aktuell dient FundXML als Referenz)

- Das Format ist relativ frei definierbar
- Es sind 1:N Konstellationen abbildbar (1 Fonds - N Wertpapiere)
- XML breitet sich aus (Elektronisches Meldewesen der Dt. Bundesbank, FundXML, ggf. MiFid Transaction Reporting ...)
- Warum einen weiteren Standard definieren, wenn es schon Ansätze gibt

XML Beispiel:

```
<Portfolio>
  <Assets>
    <SecurityCodes>
      <ISIN>AT0000A03FF7</ISIN>
      <UniqueID>RE820602</UniqueID>
    </SecurityCodes>
    <Currency>EUR</Currency>
    <NominalOrUnits>200000</NominalOrUnits>
    <ExchangeRate>1.0000000</ExchangeRate>
    <Price>95.0300000</Price>
  </Assets>
  <Assets>
    <SecurityCodes>
      <ISIN>AT0000A03FF7</ISIN>
      <UniqueID>RE820602</UniqueID>
    ...
  </Assets>
</Portfolio>
```

Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Unterarbeitskreis – weitere Vorgehensweise

Wie geht es weiter?

- Die Verwahrstellen werden die vorgeschlagene Datenstruktur den bestehenden FundXML Feldern soweit möglich zuordnen
- Es müssen noch diverse Fragestellungen geklärt werden
- Termine können aktuell nicht seriös genannt werden, Ziel ist es, bis Mitte des Jahres die Daten und die Zuordnungen (soweit möglich) zusammengetragen zu haben

Warum dauert dies so lange?

- Leider ist die Zuordnung nicht so eindeutig wie erhofft
- Das FundXML Schema ist komplex – 474 Elemente mit ca. 1.000 Feldern
- Ggf. müssen weitere Felder dem FundXML Standard hinzugefügt werden
- Es ist zu klären, ob Felder verwendet werden sollen, auch wenn sie nicht eindeutig sind
- Und BaFin Rundschreiben, UCITS V ...



Datenaustausch zwischen KVG und Verwahrstelle

Danke für Ihre Aufmerksamkeit

Roland Höbel

Direktor, Leiter Depotbank Services

HSBC Trinkaus & Burkhardt AG

Yorckstraße 21-23, D-40476 Düsseldorf

Tel : +49 (0)211/910-3831

E-Mail: roland.hoebel@hsbc.de