

Unser Ziel ist Ihr Erfolg.



WPAssetControlling- eine ASP-Lösung für Verwahrstellen

Praxisforum Depotbanken

Frankfurt, den 5. März 2014

Praxisforum Depotbanken



Agenda



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

- 1 Die dwpbank im Überblick
- 2 Lösungen für die Depotbankkontrollfunktion
- 3 WPAAssetControlling – technisches und fachliches Design

1

2

3



Die dwpbank betreut Kunden aus allen drei Sektoren der deutschen Kreditwirtschaft



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

Vorstand

Thomas Klanten

Ressort Informationstechnologie und
Ressort Unternehmenssteuerung

Dr. Christian Tonnesen,

Ressort Wertpapierservice und
Ressort Vertrieb

Aufsichtsrat

Wilfried Groos (Vorsitzender)

Mitglied des Vorstands der Sparkasse Siegen

Thomas Ullrich (stv. Vorsitzender)

Mitglied des Vorstands der DZ BANK AG

Gesellschafter

50,0 % DZ BANK

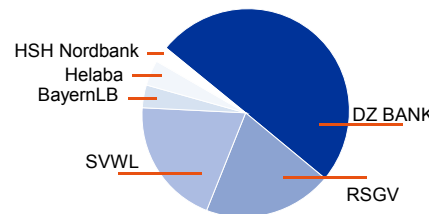
20,0 % RSGV

20,0 % SVWL

3,74501 % BayernLB

3,74499 % Helaba

2,51 % HSH Nordbank



Unternehmenssitz

Frankfurt am Main

Wertpapierdepots*

5,49 Millionen

Transaktionen*

19,37 Millionen

Verwahr volumen*

1, 773 Billionen Euro

Mitarbeiter*

rund 1.700 an 5 Standorten

Kunden*

~400 aus allen Sektoren der deutschen Kreditwirtschaft (+ rund 1.102 angeschlossene Institute über DZ BANK/WGZ BANK)

WP-System

WP2 (rund 250.000 User)

* Kennzahl zum 31.12.2012



Standorte

1

2

3

Grundlagen des Geschäftsmodells der dwpbank

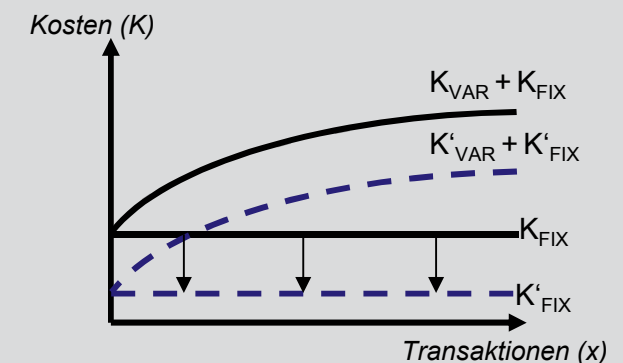
- Economies of Scale
 - Bündelung von Volumina
 - Wandlung von Fixkosten
 - Nutzung von Synergien
- Economies of Scope
 - Prozessinnovation und Standardisierung
 - Know-how-Konzentration (z. B. bei Abgeltungsteuer, MiFID, komplexen Produkten)
 - State-of-the-art-Software
- Control of operational risk
 - Verlagerung der operationellen Risiken
 - Erhöhung der Transparenz
 - Einsatz risikoreduzierender Infrastruktur (z. B. redundantes Orderrouting)

1

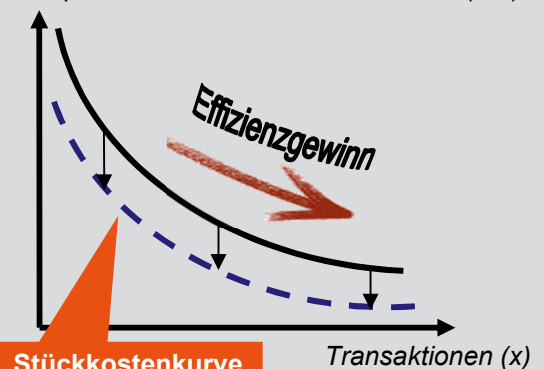
2

3

Kostenverläufe in Abhängigkeit von verarbeiteten Mengen



Mitarbeiter pro x Transaktionen, Stückkosten (K/x)



Stückkostenkurve konsolidierte IT-Systemplattform



Mehr als 3/4 aller Banken in Deutschland sind Kunden der dwpbank



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

Kunden

Genossensch. FinanzGruppe

- Mehr als 1.100 Volks- und Raiffeisenbanken gebündelt über DZ BANK und WGZ BANK

Sparkassen-Finanzgruppe

- Bereits ca. 360 Sparkassen und 7 Landesbanken

Privat-/Geschäftsbanken

- Rund 30 Institute unterschiedlicher Größe und Ausrichtung

z. B.



1

2

3

Etwa die Hälfte der deutschen Verwahrstellen nutzen die Wertpapierabwicklung und –verwahrung der dwpbank.



Agenda



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

- 1 Die dwpbank im Überblick
- 2 Lösungen für die Depotbankkontrollfunktion
- 3 WPAAssetControlling – technisches und fachliches Design

1

2

3

Aufstellung rund um die Systemwelt WP2



In dem komplexen regulatorischen Umfeld bietet die dwpbank als Bündler Lösungen



1. Regulatorisches Umfeld

- Die Anforderungen an die Verwahrstellen wachsen mit zunehmender Geschwindigkeit
- Depotbankrundschriften der BaFin aus 2010, Überarbeitung in 2014, u. a. Konkretisierung der Regelung zur Kontrollfunktion (u. a. Modell 1, 2) und Haftung zwischen Verwahrstelle und KVG



2. Was sind die Herausforderungen an Prozess und Technik?

- Intensivierung und Ausbau der Abwicklungs-, Kontroll- und Abstimmprozesse
- Steigende Komplexität in der täglichen Wertpapierabwicklung z. B. durch Fokus auf gesamte Verwahrkette
- Investitionen in IT Technik zur Automatisierung der Prozesse und Minimierung bzw. Handling der Risiken



3. Welches Lösungskonzept bietet die dwpbank an?

- WPAssetControlling (WPAC): eigenständiges System zur Automatisierung von Kontrollen, Anlagegrenzprüfung und Fondspreisberechnung
- Wertpapierabwicklung und Networkmanagement: Einrichtung & Betrieb von Lagerstellen für die Verwahrstellen
- Custody Portal: zielgerichtete Informationsbereitstellung für Verwahrstellen (z. B. mit Blick auf Lagerstellen, 3 Punkte Erklärung in der Verwahrkette)



Lösungen helfen den Kunden, sich auf das Kerngeschäft zu konzentrieren



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken



Rückschau auf die Auswirkungen

- Steigerung der Risiken
 - Haftung der Verwahrstellen
- Höhere Kosten
 - Intensivierung der Kontrollprozesse
Ausbau bzw. Neueinführung von Prozessen
- Entscheidungen bei Verwahrstellen hinsichtlich Modell 1 oder 2
 - Überprüfung Verwahrstellenfunktion



Vorteile durch Bündelung

- Skaleneffekte bei
 - Bündelung von Volumina
 - Konzentration Know-how
 - Prozessinnovation
- Risikominimierung
 - z. B. durch risikominimierende Infrastruktur
 - Verlagerung des operationellen Risikos auf die dwpbank (Ausprägung unterschiedlich abhängig vom Geschäftsmodell)
- Kostenreduzierung
 - Wandlung Fixkosten in variable Kosten

1

2

3



Agenda



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

- 1 Die dwpbank im Überblick
- 2 Lösungen für die Depotbankkontrollfunktion
- 3 **WPAAssetControlling – technisches und fachliches Design**

1

2

3



Die ASP-Lösung WPAAssetControlling bietet für die Kunden einen Service aus einem Guss



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken



RZ Infrastruktur

Betrieb des Systems in Rechenzentren und mit den Infrastrukturkomponenten der dwpbank
Schnittstellenanbindung der KVG, Depotbank, Marktdatenprovider an WPAC



Software

Bereitstellung von WPAAssetControlling mit integriertem MIG21 (Anlagegrenzprüfung)
Reportingtool, Archivierungssystem, EAI-Tool, Releasemanagement

WPAC als
Lösung im Sinne
Modell 2
für Verwahrstellen



Anforderungen

Abstimmung und Umsetzung von gesetzlichen oder individuellen Anforderungen an WPAC



Fachliche Services

Fachliche Beratung und Betreuung zentraler Ansprechpartner

1

2

3

Die operative Kontrollfunktion verbleibt bei der Verwahrstelle



WPAssetControlling wurde speziell für die Kontrollfunktion der Verwahrstellen realisiert



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

Fondsbuch

- WPAssetControlling ermöglicht durch die eigene Bestandsführung eine unabhängigen Kontrolle
- Eigenständige, von der KVG unabhängige NAV- und Fondspreisberechnung
- Unterschiedliche Formate und Buchungslogiken angebundener KVGs werden in eine einheitliche Zielsystematik konsolidiert

Abstimmung

- WPAssetControlling deckt die erforderlichen Umsatz- und Bestandsabstimmungen ab, beinhaltet u. a. auch die Abstimmung von Kursen und Geldumsätzen
- Differenzen werden maschinell ermittelt und komfortabel im Cockpit angezeigt und überwacht
- Die Abstimmung wird sofort, d.h. neartime, bei vorliegenden neuen Informationen, d.h. Schnittstelleneinspielungen, manuellen Eingaben etc., durchgeführt

Anlagegrenzprüfung

- Als Anlagegrenzprüfungssystem wird die etablierte Softwarelösung MIG21 der Fa. Princeton Financial Systems integriert.
- Anstoß, Status und Ergebnisse der Grenzprüfung sind im Cockpit von WPAC jederzeit sichtbar und werden archiviert.

1

2

3

Das Frontend von WPAC unterstützt die Workflows in den Kontrollprozessen und ermöglicht hohe Automatisierung und Flexibilität



WPAssetControlling nutzt die IT-Methoden und Kompetenz der Wertpapierabwicklung auch für das komplexe Umfeld der Verwahrstelle/KVG



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

dwpbank/Verwahrstelle

Wertpapierdaten
(Umsätze, Erträge, etc.)

KVG'en

Bestände
Umsätze

Verwahrstelle

Kontoauszug
Drittssysteme
Markt- und Stammdaten

Externe Partner

Marktdaten
Ratings

1

2

3

EAI-Tool
WP-
Integrator

Fondspreis-
Prüfung

Abstimm-
vorgänge

Kurse,
Markt-
gerecht-
heit

NAV-
Ermitt-
lung

Anlage-
grenz-
prüfung

Freigabe
Fondspreis

Fondspreis Abstimmung Prüfaufträge Abgleich Fondspreis Kurskontrolle AGP											
Stichtag		30.06.2011									
						Fondspreis		Gebühren			
Fonds			KAG	KAG-Daten gelief.	Berech. Fds.Prs.	errechneter Fondspreis	nächste Fds.preis- Bestätig.	be- stätigt	freige- geben	Bestätig. versandt	
Q	B	U	121111009 - RuN-ALL Fonds / D02400000		✓	102,9645973	H 01.07.2011	✓			
Q	B	U	121121013 - A-Aller Fonds / OXS6		✓	78,33940345	N H 30.06.2011				
Q	B	U	121121017 - Lazard-Sparkassen-Rend /		✓	98,64732544	N H 13.07.2011				
Q	B	U	121141021 - WMAM Graf Master-Fonds / 790		✓	-	N H 30.06.2011				
Q	B	U	121151022 - OP-Fonds-EWE-Stiftung /		✓	65,8763117	H 01.07.2011	✓			
Q	B	U	121161023 - Bauindustrie-Universa / 390100		✓	102,8149703	H 01.07.2011	✓			

Kriterien ausblenden

Web-Frontend für
alle Kontroll-
Prozesse

Reportingsystem
WPDynamic

Archivierungs-
tool
WEBControlID

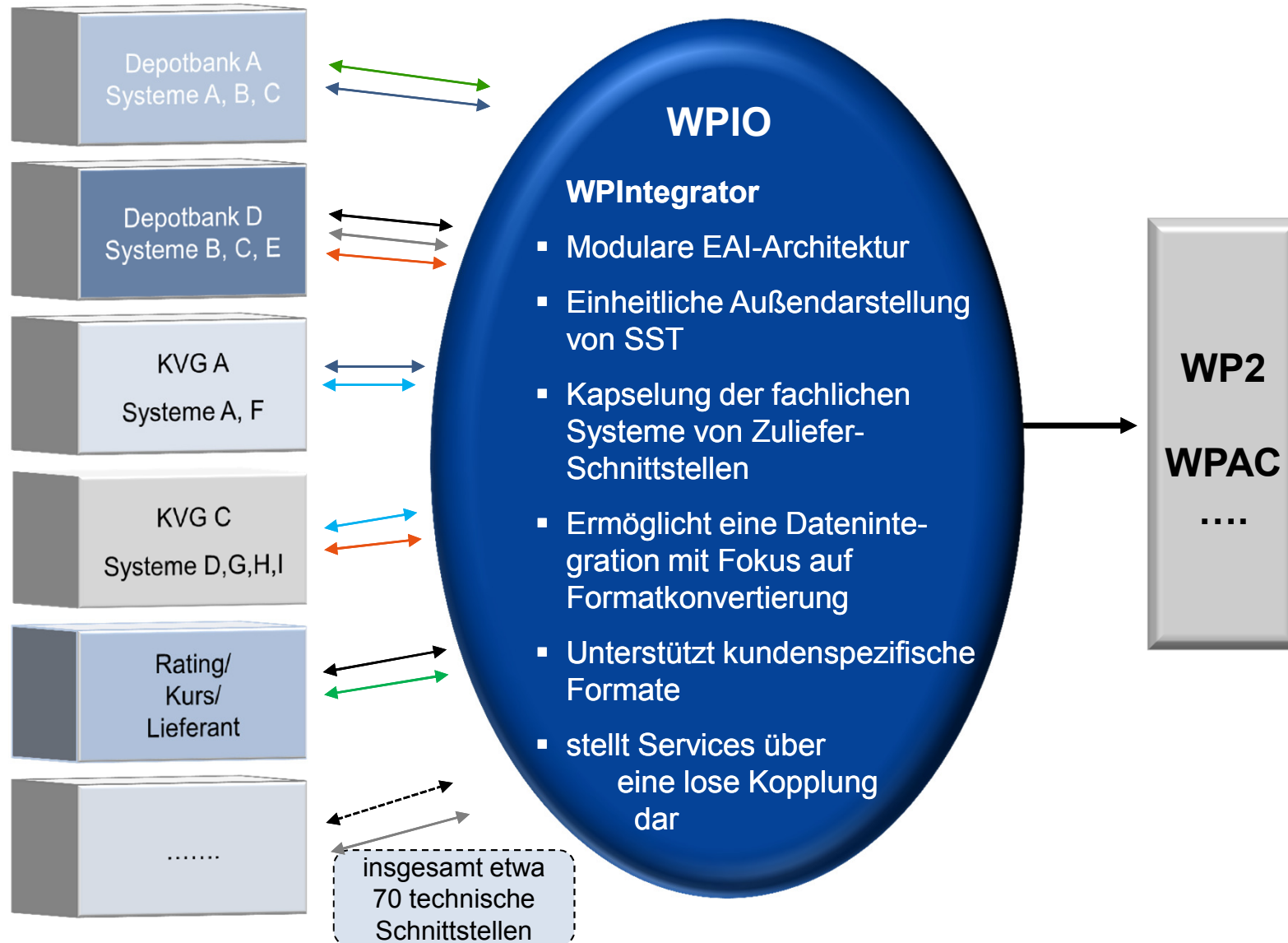


Über die EAI-Plattform WPIntegrator wird komplexe Marktanbindung flexibel und stabil gestaltet



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken



1

2

3



Die Funktionalitäten von WPAssetControlling decken das komplette Spektrum ab



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

■ Umsatzkontrollen / Bestandsabstimmung

■ Bewertungskursprüfung nach InvRBV (KARBV)

■ Marktgerechtigkeitsprüfung

■ Anspruchsermittlung für Zinsen und Dividenden

■ Anteilscheingeschäft

■ Fondspreisprüfung / NAV-Ermittlung

■ Abdeckung des gesamten Asset-Universums

interne Nr. Fonds

externe Nr. Fonds

KAG

Kontonummer

Stichtag

12009808

DKV

Universal Investment GmbH

124447506

20.03.2012

interne Nr. Segment

Fondsbezeichnung

Enthält

Fondsklasse

Publikumsfonds

1. Gruppierkriterium

2. Gruppierkriterium

3. Gruppierkriterium

Enthält

Enthält

Enthält

Rhein-Ruhr

Aktualisieren

Felder leeren

Fondspreis

Abstimmung

Prüfaufträge

Abgleich Fondspreis

Kurskontrolle

Marktgerechtigkeit

AGR

Zinsen

WPL-Info

Stichtag

20.03.2012

			Fonds	KAG	KAG-Daten gelte	Berech. Fds.-Prs.	errechneter Fondspreis		nächste Fds.preis - Bestätig.	Fondspreis be- stätigt	freie Gebühren geben	Fds.preis Bestätig- vorgandt	
Q	B	U	121111001 - Test 1 / D00059200	Deka	✓	✓	51,59220119	R	H	28.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111003 - Test 4 / D00058700	Deka	✓	✓	63,0474427	R	H	28.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121111004 - Test 6 / D07095000	Deka	✓	✓	89,6930231	R	H	10.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111005 - Test 8 / D07096200	Deka	✓	✓	55,16999867	R	H	21.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121111006 - Test 9 / D07096800	Deka	✓	✓	111,54813707	R	H	05.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111008 - Test 10 / D02402100	Deka	✓	✓	114,7935673	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111009 - Test 11 / D02400000	Deka	✓	✓	104,82022973	R	H	28.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121111010 - Test 12 / D02400300	Deka	✓	✓	109,77714398	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111011 - Test 13 / D07095200	Deka	✓	✓	98,4413188	N	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121111024 - Test 14 / D02402400	Deka	✓	✓	103,60380903	R	H	28.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121121012 - Test LZ 1 / 0VJL	Lazard	✓	✓	93,32719955	R	H	06.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121121014 - Test LZ 3 / 0Z1I	Lazard	✓	✓	104,43474525	R	H	27.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121121015 - Test LZ 4 / 0VJI	Lazard	✓	✓	43,28309557	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121121016 - Test LZ 5 / 0VJF	Lazard	✓	✓	70,12505203	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121121017 - Test LZ 6 / 0VJS	Lazard	✓	✓	99,47174376	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121131018 - Test LB 1 / 337	NORDLI	✓	✓	107,29287835	R	H	05.09.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121131020 - Test LB 4 / 315	NORDLI	✓	✓	102,10951212	R	H	05.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121141021 - Test Graf 1 / 790	WestLB	✓	✓	63,82418295	R	H	04.10.2011	✓	✓	✓
Q	B	U	121151022 - Test OP-Fonds 1 / 203100	Oppenhv	✓	✓	66,75399192	R	H	28.03.2012	✓	✓	✓
Q	B	U	121161023 - Test Universal Fonds 1 /	Universa	✓	✓	102,07606639	R	H	28.03.2012	✓	✓	✓

■ Zerlegung strukturierter Produkte

■ Anlagegrenzprüfung

■ Abdeckung gesetzlicher/vertraglicher Grenzen

■ Überwachung von Gebühren und Entgelten

■ Reporting für Depotbank

1

2

3

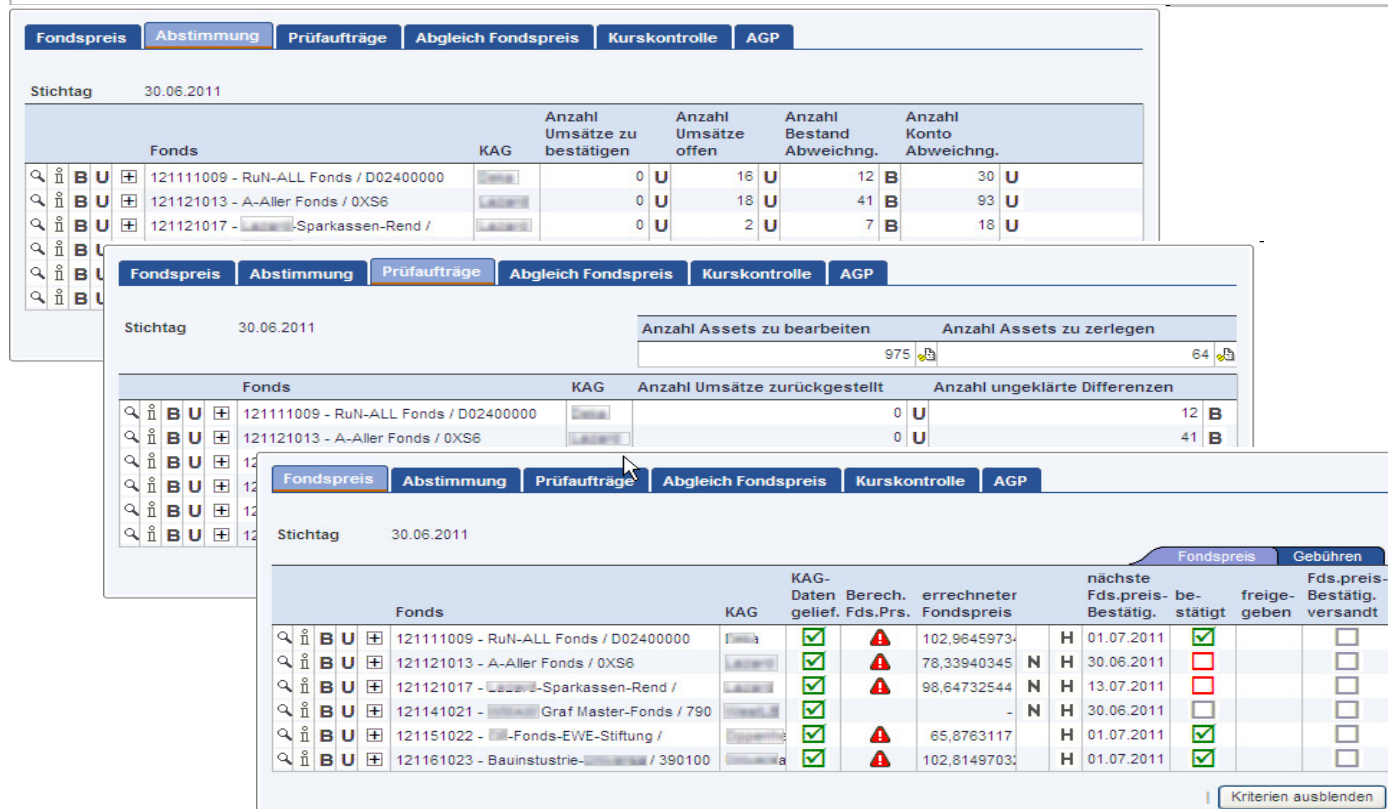
Mit der Cockpitfunktion hat der Bearbeiter den Status der Aufgaben immer im Blick

5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

WPAC – Cockpitfunktion

- Farblich dargestellte Status-Flags der wichtigsten ToDo's
- Workflow innerhalb der Bearbeitung wird über die Reiter ermöglicht
- Maus-Over zeigt relevante Status-Informationen
- Über View „Abstimmung“ direkter Klick auf „U“msatz und „B“estand



The screenshot displays the WPAC Cockpit function interface, which is used for managing tasks and assets. It features three overlapping windows, each with a set of tabs at the top: **Fondspreis**, **Abstimmung**, **Prüfaufträge**, **Abgleich Fondspreis**, **Kurskontrolle**, and **AGP**.

The top window shows a table with columns: **Fonds**, **KAG**, **Anzahl Umsätze zu bestätigen**, **Anzahl Umsätze offen**, **Anzahl Bestand Abweichung**, and **Anzahl Konto Abweichung**. The data rows are:

Fonds	KAG	Anzahl Umsätze zu bestätigen	Anzahl Umsätze offen	Anzahl Bestand Abweichung	Anzahl Konto Abweichung
121111009 - RuN-ALL Fonds / D02400000		0	16	12	30
121121013 - A-Aller Fonds / OXS6		0	18	41	93
121121017 - Sparkassen-Rend /		0	2	7	18

The middle window shows a table with columns: **Fonds**, **KAG**, **Anzahl Umsätze zurückgestellt**, and **Anzahl ungeklärte Differenzen**. The data rows are:

Fonds	KAG	Anzahl Umsätze zurückgestellt	Anzahl ungeklärte Differenzen
121111009 - RuN-ALL Fonds / D02400000		0	12
121121013 - A-Aller Fonds / OXS6		0	41

The bottom window shows a table with columns: **Fonds**, **KAG**, **KAG-Daten gelief.**, **Berech. Fds.Prs.**, **errechneter Fondspreis**, **nächste Fds.preis-Bestätig.**, **freigegeben**, and **Fds.preis-Bestätig. versandt**. The data rows are:

Fonds	KAG	KAG-Daten gelief.	Berech. Fds.Prs.	errechneter Fondspreis	nächste Fds.preis-Bestätig.	freigegeben	Fds.preis-Bestätig. versandt
121111009 - RuN-ALL Fonds / D02400000		✓	⚠	102,9645973	H 01.07.2011	✓	
121121013 - A-Aller Fonds / OXS6		✓	⚠	78,33940345	N H 30.06.2011		
121121017 - Sparkassen-Rend /		✓	⚠	98,64732544	N H 13.07.2011		
121141021 - Graf Master-Fonds / 790		✓	⚠	-	N H 30.06.2011		
121151022 - Fonds-EVVE-Stiftung /		✓	⚠	65,8763117	H 01.07.2011	✓	
121161023 - Bauindustrie- / 390100		✓	⚠	102,8149703	H 01.07.2011	✓	

At the bottom right of the bottom window, there is a button labeled **Kriterien ausblenden**.

MIG21 – Anlagegrenzprüfung

- Der Anwender nutzt MIG21 über die WPAC-Masken
 - Anstoß AGP-Prüfung und Prüfung der Ergebnisse
- Grenzverletzungen werden über Ampelfunktionen dargestellt

73 Einträge gefunden

« Erste | zurück | 1 | 2 | 3 | 4 | nächste | Letzte »

		Nr. Fonds/ Nr. Segment	ID-Regel	Kateg. Regel / Datum Grenzverl. ab / ID-Asset	Bezeichnung-Regel / Text Verletzung / Bezeichnung Asset	Limit / tats. Regelauslast./ Aktu. Tageswert Pos.
			32711	G	DE-KAGB: §199 - 10% Grenze für die Kreditaufnahme	-- / error / --
			32719	G	DE-KAGB: §206 (1) 1 - 10%-Grenze für Wertpapiere und Geldmarktinstrumente desselben Ausstellers	-- / error / --
			32720	G	DE-KAGB: §206 (1) 2 - Max. 40% NAV in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die pro Aussteller mehr als 5% ausmachen	-- / error / --
			32724	G	DE-KAGB: §206 (4) - 20%-Grenze für Bankguthaben und Marginkonten je Kreditinstitut	-- / error / --
			32725	G	DE-KAGB: §206 (5) 1 - MH - 20%-Grenze für den Gesamtwert aller Vermögensgegenstände je Aussteller ohne besondere Deckung	-- / error / --
			32783	G	DE-KAGB: EA 2 (1) (b) Ausreichende Liquidität	
			35524	V	vertragliche Regel - An max. 49 % des NAV au	
			32707	G	DE-KAGB: §197 (1) - Z Finanzderivaten	
			32748	G	DE-KAGB: DerV §2 - N vertraglich zulässige B	
			32781	G	DE-KAGB: §192 1 - Zul Vermögensgegenständ	
			35147	G	DQ-Regeln-A: Keine un vorhanden	
			32705	G	DE-KAGB: §192 2 - Kei Beleuerung über Edelm	
			32706	G	DE-KAGB: §195 2 - Nur Marginkonten bei Kredit Aufsichtsbestimmungen	
			32709	G	DE-KAGB: §198 1 - 4 - Wertpapiere, Aktien-Er Geldmarktinstrumente	
			32710	G	DE-KAGB: §198 4 - Nur §198	
			32712	G	DE-KAGB: §200 (1) 2 - 10% Grenze für Wertpapier-Darlehen an einen Darlehensnehmer	-- / 0 % / --

Fondsauswahl | Abstimmung | Prüfaufträge | Abgleich Fondspreis | Kurskontrolle | Marktgerechtigkeit | AGP | Zinsen

WPLEihe

Stichtag 28.03.2013

29 Einträge gefunden

« Erste | zurück | 1 | 2 | 3 | 4 | nächste | Letzte »

		Fonds	Aktueller Stichtag	Sts. AGP	Anzahl Datenfehler	Anzahl Warnungen	Anzahl Verstöße	
				02.04.2013		11	4	4
				04.04.2013		0	8	35
				28.03.2013				
				02.04.2013		0	68	26
				02.04.2013		7	0	4
				28.03.2013		13	0	8
				28.03.2013		0	0	1
				28.03.2013		9	0	5

Aktion für Markierte

Kriterien ausblenden



Als Bestandteil von WPAC wird mit WEBControlD eine Archivlösung angeboten



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

WEBControlD – Archivierungstool

- Gesetzliche Archivierung der Daten aus WPAC
 - Speziell z. B. Umsätze, Bestände, NAV-Ermittlung, Anlagegrenzprüfung, Freigaben Fondspreise,...
- Mittels Online-Zugriff können diese Daten entsprechend der Archivierungsfristen wieder aufgerufen werden.

CONTROL-D/WebAccess Server IICOWEBT - Microsoft Internet Explorer provided by dwpbank

Adresse: <https://webctdtu.dwpbank.de/wa/>

dwp bank

Sie sind als **xdze0221** mit dem **CONTROL-D Test_Host_Hannover** der dwpbank verbunden.

Ordner **START > REVIDZB > 6000 > 6000L > 6000LOM**

Reportname	Empfänger	Anf.Datum	Speichern	Drucken	E-Mail	Seiten	Anmerkung	Info	View
ORL-05473-NACHWEISLISTE NICHT GEMATCHTE SCHLUSSNO	6000LOM	09.02.2009				1			0
ORL-05473-NACHWEISLISTE NICHT GEMATCHTE SCHLUSSNO	6000LOM	02.02.2009				1			0
ORL-04149-ORDER UMSÄTZE JE WKN	6000LOM	26.01.2009				26			0
ORL-04149-ORDER UMSÄTZE JE WKN	6000LOM	02.02.2009				2			0
ORL-04149-ORDER UMSÄTZE JE WKN	6000LOM	09.02.2009				1			0
ORL-01272-ORDERBUCH	6000LOM	26.01.2009				68			0
ORL-01272-ORDERBUCH	6000LOM	02.02.2009				4			0
ORL-01272-ORDERBUCH	6000LOM	09.02.2009				4			0
ORL-04826-AWV-ANLAGE Z10 EINZELAUFLISTUNG-204	6000LOM	02.02.2009				1			0
ORL-05746-HINWEISE WG. FEHLENDER DEISENKURSE	6000LOM	19.01.2009				1			1
ORL-05746-HINWEISE WG. FEHLENDER DEISENKURSE	6000LOM	26.01.2009				1			0
ORL-05746-HINWEISE WG. FEHLENDER DEISENKURSE	6000LOM	02.02.2009				2			1
ORL-05746-HINWEISE WG. FEHLENDER DEISENKURSE	6000LOM	09.02.2009				3			0
ORL-05302-FEHLERPROTOKOLL XETRA-SCHLUSSNOTEN	6000LOM	26.01.2009				30			1
ORL-05302-FEHLERPROTOKOLL XETRA-SCHLUSSNOTEN	6000LOM	02.02.2009				3			0
ORL-05302-FEHLERPROTOKOLL XETRA-SCHLUSSNOTEN	6000LOM	09.02.2009				3			0
ORL-01901-WERTPAPIERABRECHNUNG	6000LOM	19.01.2009				2			0

1

2

3



Das Reportingsystem erlaubt eine individuelle und flexible Datenauswertung und -analyse



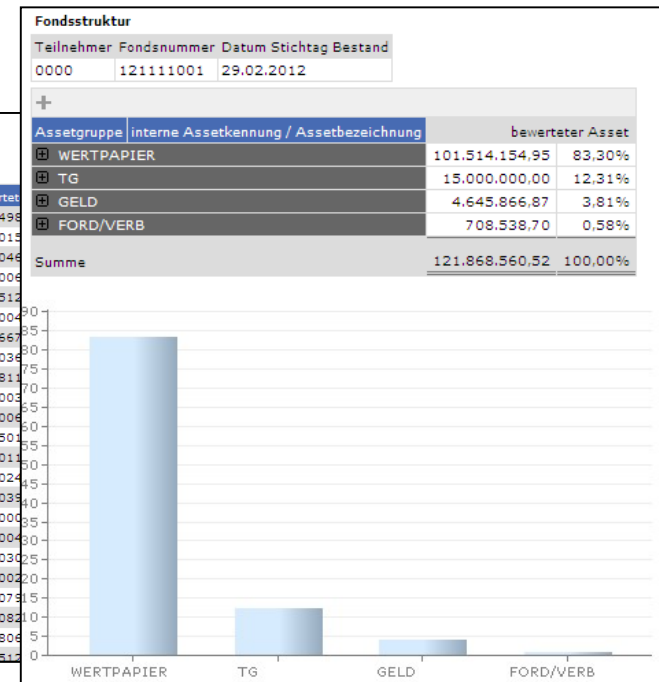
5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

WPDynamic – Reportingsystem

- Flexible Auswertungsmöglichkeiten über Fondsvolumen, Umsatznachverfolgung, Transaktionskosten, Fondspreisentwicklung
- Auswertung, Gruppierungen und grafisch aufbereitete Darstellungen sind verfügbar und werden weiter ausgebaut

Inventarliste									
Teilnehmer	Fondsnummer	Datum	Stichtag	Bestand	Assetgruppe				
0	121111001	29.02.2012			WERTPAPIER				
interne Assetkennung	Assetbezeichnung	Fälligkeit	Land	Währung	Menge Ziel	Bewertungskurs	Devisenkurs	bewertet	
DE000A0JRA7	DG HYP PF.R.930 VAR	30.08.2013	DE	EUR	500.000,00	99,77	1,0000	498,88	
DE000A0KAH03	BERL.H.H.BK.OE.PF.E144	30.08.2012	DE	EUR	1.000.000,00	101,55	1,0000	1.015,55	
DE000A0SLVZ0	HESSEN SCHA.09/14 S.0907	13.05.2014	DE	EUR	1.000.000,00	104,65	1,0000	1.046,50	
DE000A0SMN60	IKB DT.IND.BK.IS 09/12	10.09.2012	DE	EUR	1.000.000,00	100,67	1,0000	1.006,67	
DE000A0XFB38	BERLIN, LAND LSA09/13A267	09.04.2013	DE	EUR	500.000,00	102,46	1,0000	512,30	
DE000A0XXM87	K.F.W.ANL.V.09/2012	21.05.2012	DE	EUR	1.000.000,00	100,45	1,0000	1.004,50	
DE000A0Z1QQ5	HESSEN SCHA.10/15	16.06.2015	DE	EUR	650.000,00	102,75	1,0000	668,06	
DE000A0Z1QS1	HESSEN SCHA. 10/20	22.09.2020	DE	EUR	1.000.000,00	103,63	1,0000	1.036,30	
DE000A1A6SL9	SACHSEN-ANH.LS10/15	22.01.2015	DE	EUR	3.800.000,00	100,31	1,0000	3.811,58	
DE000A1A6SQ8	SACHSEN-ANH.LS10/14	19.03.2014	DE	EUR	1.000.000,00	100,30	1,0000	1.003,00	
DE000A1A6SU0	SACHSEN-ANH.LS10/14	01.04.2014	DE	EUR	2.000.000,00	100,30	1,0000	2.006,00	
DE000A1A6S27	SACHSEN-ANH.LS 11/15	28.10.2015	DE	EUR	500.000,00	100,33	1,0000	501,65	
DE000A1DAMK4	K.F.W.ANL.V.10/2013	17.06.2013	DE	EUR	1.000.000,00	101,19	1,0000	1.011,90	
DE000A1DAML2	KRED.F.WIED.10/14 MTN	04.08.2014	DE	EUR	1.000.000,00	102,49	1,0000	1.024,90	
DE000A1DAMM0	K.F.W.ANL.V.10/2017	21.09.2017	DE	EUR	1.000.000,00	103,93	1,0000	1.039,30	
DE000A1ELUG0	BRANDENBURG LSA 11/15 VAR	15.07.2015	DE	EUR	2.000.000,00	100,05	1,0000	2.001,00	
DE000A1ELY71	BERLIN, LAND LSA10/14A317	30.06.2014	DE	EUR	1.000.000,00	100,49	1,0000	1.004,90	
DE000A1EWEC0	KRED.F.WIED.10/15 MTN	30.11.2015	DE	EUR	1.000.000,00	103,07	1,0000	1.030,70	
DE000A1H3UX0	WL BANK AG OE.PF.R.623	15.04.2013	DE	EUR	2.000.000,00	100,10	1,0000	2.002,00	
DE000A1H36V3	K.F.W.IS.11/2016	08.04.2016	DE	EUR	1.000.000,00	107,99	1,0000	1.079,90	
DE000A1H36X9	K.F.W.ANL.V.11/2018	15.06.2018	DE	EUR	1.000.000,00	108,22	1,0000	1.082,20	
DE000A1KRA83	HESSEN SCHA.12/17	10.02.2017	DE	EUR	800.000,00	100,86	1,0000	806,88	
DE000A1KQUE1	KRED.F.WIED.11/13 MTN	15.11.2013	DE	EUR	1.500.000,00	100,81	1,0000	1.512,15	



1

2

3

WPAssetControlling ist gemeinsam mit mehreren Partnern entwickelt worden



Kooperationspartner:

Konsort/i2b: Konzeption, Test, Qualitätsmanagement

SIX Financial Information: Bewertung von liquiden und illiquiden Assets

Princeton Financial Systems: System MIG21 zur Anlagegrenzprüfung



Ihr Ansprechpartner



5. März 2014

Praxisforum Depotbanken

Fragen?



Christina Krämer

Leiterin Business Development

Anschrift: Derendorfer Allee 2
40476 Düsseldorf

Telefon: +49 69 5099 6750

E-Mail: christina.kraemer@dwpbank.de