

# Übersicht über die Funktionalitäten

**SARA**

Swiss  
ALM &  
Regulatory Reporting  
Application



Reporting date: 31-Mai-2015

Estimated remaining time:

Master data

Database

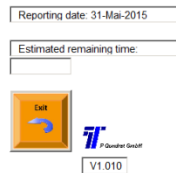
Reports

Exit

  
V1.010



# Aufbau von SARA



Die Benutzeroberfläche von SARA ist intuitiv nach dem Prinzip

„Click and Go!“ aufgebaut!

Mit drei Schaltflächen können alle Funktionen von SARA gesteuert werden.

1. Die Schaltfläche Masterdata ist für die Eingabe der kundenspezifischen Daten vorgesehen.
2. Die Schaltfläche Database ist für das Einlesen der Schnittstellen vom Bankenkernsystem sowie die Zinskurven bestimmt.
3. Die Dritte Schaltfläche dient für das Erstellen der Statistiken sowie des Audit Trails.

# Masterdaten




Company	Muster Bank	S	c	s	CHF
Department	Accounting	e	u		EUR
Address	Milky way	l	r		USD
ZIP-Code & City	8008 Zürich	e	r		GBP
User name:	Steven Hot	c	e		JPY
Telephone	04401234578	t	n		
Fax	04401234599	e	c		
E-Mail	<a href="mailto:steven.hot@musterbank.ch">steven.hot@musterbank.ch</a>	d	i		
SNB code	385428	e			ETC
Reporting date	31.05.2016				
Internal risk limit (board)	3.00%				
Int. risk limit (exec. board)	2.00%				
Equity in CHF (board)	85'000'000				
Equity in CHF (exec. board)	50'000'000				
Actual profit/(loss)	0				
Type of source data file	3 SARA file.csv (without header, standard interface)				
Employees in CH	56	ther			
Employees outside CH	0	ther			

List of possible data file types  
Please select the appropriate file  
type of the source data file



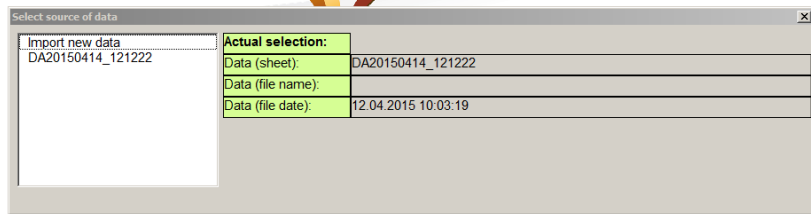
Beim aktivieren der Schaltfläche Masterdata werden alle relevanten kundenspezifische Daten in SARA erfasst.

Während des Jahres müssen lediglich das aktuelle Meldedatum sowie der laufende Gewinn erfasst werden.

Mit der Schaltfläche  kehrt man zum Hauptmenue zurück.



# Einlesen der Schnittstelle



Beim aktivieren der Schaltfläche Database kann die zu importierende Datenbank (Schnittstelle), welche vom Bankenkernsystem generiert wurde, eingelesen werden.

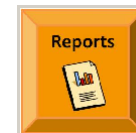
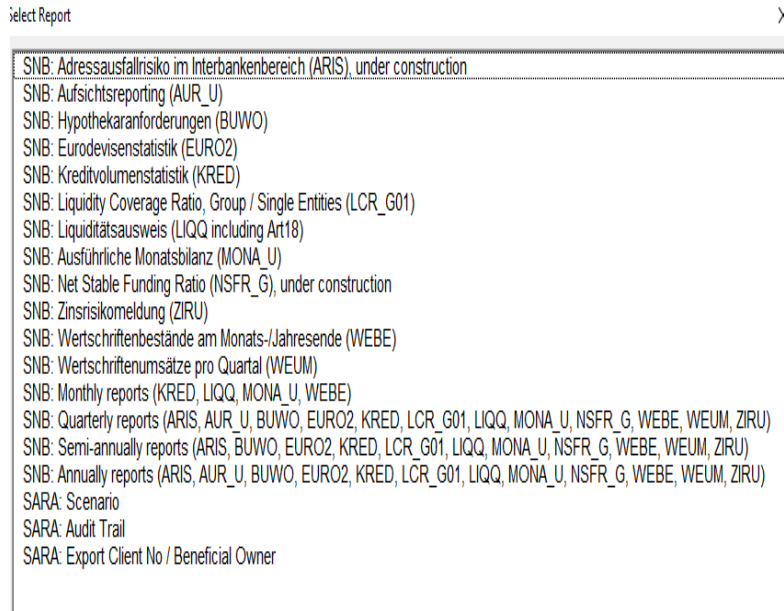
Je nach Schnittstelle werden mehrere Datensätze eingelesen.



# Umfang des Meldewesen



Beim aktivieren der Schaltfläche



werden Sie zum pop-up Menue der Reports geführt.

Beim aktivieren des entsprechenden Reports wird dieser automatisch erstellt.

# Zinsänderungsrisiken



	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
Currencies:	CHF	EUR	USD	GBP	JPY	ETC				
Time buckets	Inverted price shift (bp)									
>1d..1m	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>1m..2m	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>2m..3m	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>3m..6m	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>6m..9m	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>9m..1y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>1y..2y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>2y..3y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>3y..4y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>4y..5y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>5y..6y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>6y..7y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>7y..8y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>8y..9y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>9y..10y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>10y..15y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
>15y	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
	Price shift flat (bp)									
Increase(+):	+20	+20	+20	+20	+20	+20				
Decrease(-):	-20	-20	-20	-20	-20	-20				

Für die Messung der Zinsänderungsrisiken erwartet SARA die Eingabe von Zinskurven für diejenigen Währungen, welche in der Sektion Masterdata aktiviert wurden.

1. In Folder Scenario können die Zinskurven eingegeben werden.
2. Die Eingabe der inversen und linearen Zinsen kann von der Bank frei gewählt werden.
3. Die Applikation SARA berechnet gemäss SNB ein Zins-shift von plus/minus 100 bp.
4. Zusätzlich rechnet SARA die Szenarien gemäss inverser und linearer Zinskurve.
5. In den Foldern GapAnalysis und RiskSummary können, nachdem der Report Scenario unter Reports gestartet wurde, die Auswertungen der Zinsszenarien ausgewertet werden.

# Übernahme Stammdaten



Bei der Auslieferung einer neuen Release von SARA werden die Stammdaten von der bestehenden übernommen

1. SARA wird ständig den neuen Anforderungen der Rapportierungspflichten gegenüber der SNB und FINMA angepasst.
2. In diesem Zusammenhang werden neue Releases zur Verfügung gestellt. Damit die Masterdata in der neuen Release automatisch übernommen werden, ist folgendes Vorgehen erforderlich.
3. Rechter Mausklick in der angezeigten Umgebung und das Pop-up Menue erscheint. «Ganzer Bildschirm schliessen» aktivieren und alsdann Macro-Button aktivieren.
4. In angezeigtem Feld folgender Macroname eingeben: «**upgradesara**» und der Button Ausführen wird aktiv.
5. In einem weiteren Schritt wird nun die vorgängige Release von SARA ausgewählt. Alle Masterdaten dieser Version werden nun in die neue Release von SARA eingelesen.

A	B	C	F	G	J	K	N	O	R	S	V
Company	Neue Helvetische Bank				S	c	s	CHF			
Department	Accounting				e	u	r	EUR			
Address	Seefeldstrasse 215				l	r	USD				
ZIP-Code & City	8009 Zürich				e	r	GBP				
User name	Stefan Renold				c	e	JPY				
Telephone	044 204 56 70				t	n					
Fax	044 204 56 99				e	c					
E-Mail	stefan_renold@neuehelvetischebank.ch				d	i					
SNB code	300224				e		ETC				
Reporting date	31.05.2015										
Internal risk limit (board)	3.00%										
Int. risk limit (exec. board)	3.00%										
Equity in CHF (board)	30'500'000										
Equity in CHF (exec. board)	30'500'000										
Actual profit/(loss)	0										
Type of source data file	3: SARA file csv (without header, standard interface)										
Employees in CH	30		thereof female		5						
Employees outside CH	0		thereof female		0						

AU004: Adjustments and accruals / reserves for general risks as of end of previous year	
1	Accruals latent taxes
2.1	Adjustments & accruals
2.2	Adjustm. & accr. other
2.3	Accruals re-org
2.4	Accruals social benefits
2.5	Accruals other
2.5.1	Accruals proc. risks
2.6	Adjustm. offset assets
3	Accruals general risks

L102: Additional liquidity (according to Art. 19)	
SNB row no.	36

EU00: Exchange rate in CHF	
1	USD
100	JPY
1	GBP
1	EUR

for general risks as of end of previous year

# SARA, die umfassende Applikation



**Die moderne und komplette Lösung für das Meldewesen für Banken an die SNB**

