

Securities 2000

Auslegeordnung Regelwerk SecOps

04. Dezember 2003

Jürg Niederhauser, KSBP 31

SEC2000

Inhaltsverzeichnis

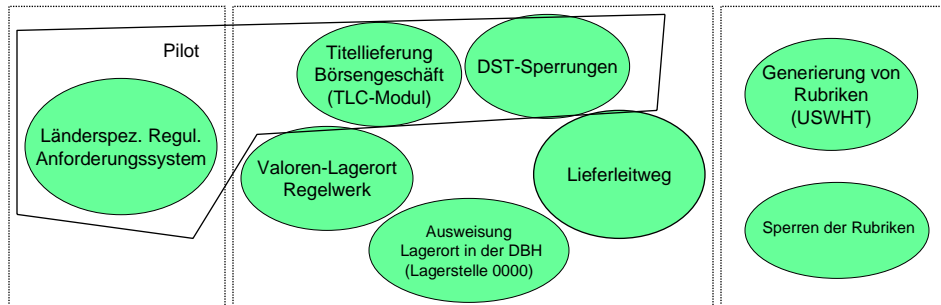
- Zielsetzung
- Ausgangslage / Auslegeordnung
- Business Rules / Instruktionen
- Prinzip eines Regelwerkes
- Zusammenfassung
- Weiteres Vorgehen

Zielsetzung

- Auslegeordnung aufzeigen
- Lösungsvorschlag präsentieren und diskutieren
- Weiteres Vorgehen festlegen

Ausgangslage / Auslegeordnung

- Das Business hat verschiedene dringende Bedürfnisse, die vorderhand applikatorisch nicht unterstützt werden, da teilweise die entsprechenden Lösungsansätze noch fehlen.
- Unten sind diejenigen Problemfelder aufgeführt, die zum heutigen Zeitpunkt relevant und dringend sind.
- Die Zusammensetzung ist auf Grund der thematischen Zugehörigkeit erfolgt.
- Die Themen haben eines gemeinsam. Für die korrekte Abwicklung eines Auftrages werden Business Rules benötigt.



Beispiel Instruktionen / Business Rules

Instruktionen

Geschäftsvorfall = Behandlung von Bezugsrechten

- > Kundensegment
- > Einzelkunde
- > Valorengruppe
- > Einzelvalor etc.



Mittels Instruktion wird folgende Ausführungs Variante bestimmt.



- Bezugsrecht zukaufen auf nächsten Slot und ausüben
- Bezugsrecht verkaufen auf nächsten Slot und ausüben
- alle Bezugsrechte verkaufen
- Brief an Kunden, mit Antwort

Business Rules

Ermittlung Lagerort

- > Entscheidungstabelle ISIN „CH“
- > BU = CS, Leu etc.
- > Lifä = Lieferfähigkeit
- > Tita = Titelart Gruppe 1 bis n
- > Titz = Zusatz zur Titelart „I = Inhaber“
- > Böpl = Börsenplatz vorhanden etc.



Mittels Business Rules wird Lagerort ermittelt.



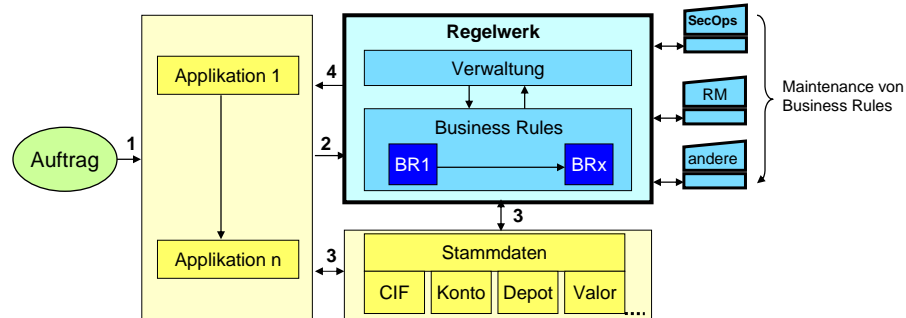
Bestimmung Lagerort

Abgrenzung von Business Rules und Instruktionen

- Business Rules und Instruktionen sind Verfahrensregeln zur Steuerung von Geschäftsvorfällen.
- Business Rules und Instruktionen unterscheiden sich nur in der Komplexität (Zusammensetzung und Kombination von Bedingungen und Logik).
- In einem Regelwerk hinterlegte Business Rules steuern die Applikationen, so dass die Geschäftsvorfälle immer nach den gleichen Verfahrensregeln abgearbeitet werden.
- In der CSG werden heute mittels Instruktionen nur einfache Bedingungen ohne Logik (geringe Komplexität) abgebildet. Künftig sollen mittels Regelwerken komplexe Strukturen (Business Rules mit Kombination von Bedingungen und Logik) aus den Applikationen entfernt und in Regelwerke integriert werden.

Prinzip eines Regelwerkes

Ein Regelwerk ist ein Mechanismus, der auf Grund von einem Input und den entsprechenden Business Rules einen Output (Ergebnis) generiert.



- 1: Ein Auftrag wird an die Applikation übergeben.
- 2: Die Applikation fragt die entsprechende Business Rules im Regelwerk ab.
- 3: Evtl. sind zusätzliche Stammdaten für die Bestimmung der Business Rules notwendig.
- 4: Das Ergebnis wird der Applikation zur Weiterverarbeitung des Auftrages übergeben.

Allg. Funktionen des Regelwerkes:

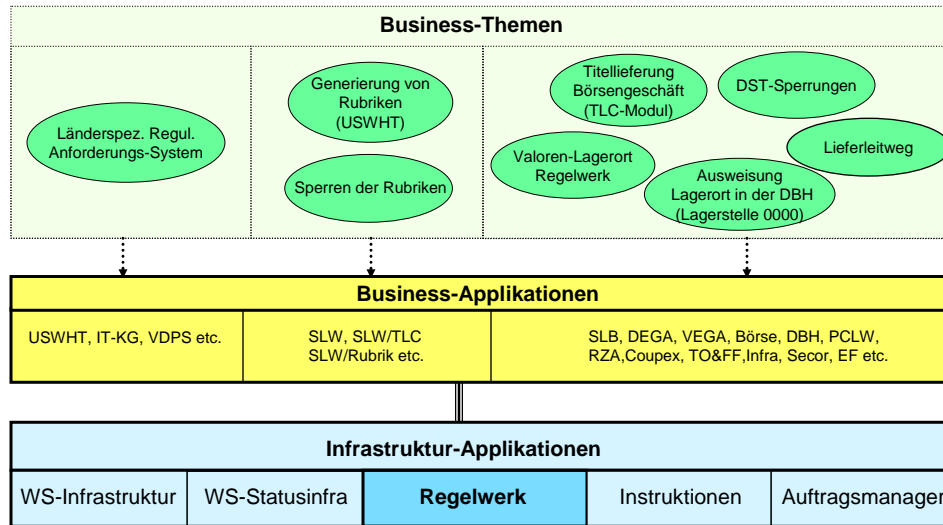
Historisierung, Nachvollziehbarkeit, Bewirtschaftung der Business Rules durch das Business sind sichergestellt.

Vorteile von Regelwerken und Business Rules

- > Durch die Vielfalt der Geschäftsvorfälle (Mengenproblem) werden die Bedingungen und Logiken für die Steuerung der Geschäftsvorfälle nicht mehr im Programmcode sondern auf den Daten gespeichert (Auslagerung von Bedingungen und Logik in Regelwerke).
- > Das Business kann künftig die Business Rules selber bewirtschaften. Dadurch ergibt sich eine klare Trennung zwischen Business- und IT-Aufgaben.
- > Erhöhung der Datenqualität, da Nachvollziehbarkeit und Erklärbarkeit der hinterlegten Business Rules durch das Business jederzeit selber gewährleistet werden kann.
- > Der Geschwindigkeit von Veränderungen im Business kann optimal Rechnung getragen werden.
 - Business-Änderungen im Programmcode => mind. 3 Monate auf den nächsten Zügelschub
 - Expressänderungen => 14 Tage
 - Änderungen von Business Rules im Regelwerk = jederzeit und sofort möglich

Zusammenhang Applikation / Regelwerk (1/2)

SEC2000



CREDIT SUISSE | **FINANCIAL SERVICES**

For internal discussion purposes only
Datum: 22.10.2002
Author: Jürg Niederhauser (KSBP31)

Zusammenfassung

SEC2000

- > Aufgrund der Analyse ist es möglich, mittels einem Regelwerk diese Business-Anforderungen zu unterstützen.
- > Die Umsetzung des Regelwerkes ist weitgehend von den Business-Anforderungen und Komplexität der Bedingungen sowie den wünschenswerten Funktionalitäten abhängig.
- > Regelwerke gehören zu den Infrastruktur-Applikationen.
- > Das Migrationspotenzial der einzelnen Applikationen ist von folgenden Grössen abhängig:
 - wieviel Logik kann aus den Applikationen ausgebaut werden
 - wie sieht die Schnittstelle zu den Applikationen aus
 - welche Bedingungen müssen im Regelwerk hinterlegt werden können

CREDIT SUISSE | **FINANCIAL SERVICES**

For internal discussion purposes only
Datum: 22.10.2002
Author: Jürg Niederhauser (KSBP31)

Weiteres Vorgehen

- | | | |
|--|--------|--------------|
| • Präsentation und Diskussion mit dem Business | KSBP | bis 15.12.03 |
| • Definition Pilot | KSBP | bis 15.12.03 |
| • PC erstellen | KSBP31 | bis 31.01.04 |
| • KS-Review | | am 19.02.04 |