

Automatisierung im Treasury

Das Treasury von Dürr will einen vollständig automatisierten FX-Prozess aufbauen. Dadurch kann der Maschinen- und Anlagenbauer nicht nur die Transaktionskosten pro Geschäft reduzieren. Text: Helmut Springer

— **Dürr ist ein** weltweit führender Maschinen- und Anlagenbauer mit ausgeprägter Automatisierungskompetenz. Auch das Treasury setzt auf Innovation und Automatisierung. Bereits seit 2010 nutzt der Konzern ein skalierbares Treasury-Management-System, um seine Finanzen effizient zu steuern. In der Software werden sämtliche Cash- und Risikopositionen zentral verwaltet und gemanagt.

Der Marktführer Dürr ist in 28 Ländern direkt vertreten und erzielte 2015 einen Umsatz von 3,77 Milliarden Euro. Dabei spielt das Devisenmanagement eine zentrale Rolle im Treasury. Entsprechend der Unternehmens-Policy, werden FX-Risiken konservativ gesichert. Das heißt, dass für FX-Risikopositionen über 50.000 Euro Sicherungsgeschäfte abgeschlossen werden müssen. 2015 belief sich das im Konzern gehandelte FX-Volumen auf rund 6,5 Milliarden Euro. Der Bestand zum Jahresende 2016 liegt bei rund 736 Millionen Euro bzw. 1.250 Einzeltransaktionen.

Mehr Effizienz

Bei diesen Volumina und Stückzahlen machen sich Prozessverbesserungen richtig bezahlt. Daher arbeitet das Treasury-Team daran, die Inhouse-Bank weiter auszubauen und manuelle Tätigkeiten auf ein Minimum zu reduzieren. „Unser Plan ist ein vollständig automatisierter FX-Prozess“, beschreibt Peter Härle, Vice President Corporate Finance & Treasury bei Dürr, die Zielsetzung des Projekts.

Aktuell werden sämtliche FX-Transaktionen inklusive Intercompany-Anfragen im Treasury-Management-System erfasst und verwaltet. Der Handel der FX-Transaktionen erfolgt manuell in 360T, der Abgleich der Devisengeschäfte automatisch über eine Schnittstelle zu Misys. Die Emir-Meldungen werden automatisiert erstellt und derzeit noch manuell in das Melderegister hochge-

laden. Die monatlichen Bewertungen der Geschäfte mit aktuellen Marktdaten nach IFRS 7 erfolgen automatisch. Die Credit-Value-Adjustments nach IFRS 13 werden manuell in Excel gemacht. Was für viele Finanzabteilungen schon nach der Erfüllung all ihrer Träume klingt, ist für das Dürr-Treasury noch lange nicht genug. „Wir wollen die Automatisierung weiter vorantreiben, um über Skaleneffekte die Transaktionskosten pro Geschäft zu reduzieren“, sagt Härle. „Je weniger manuelle Eingriffe und Schnittstellen es gibt, desto schneller und sicherer wird der FX-Prozess. Das ist auch in Zeiten von hoher Cyberkriminalität wichtig.“

Um Straight-through-Processing im FX-Workflow zu verwirklichen, müssen bei Dürr noch folgende drei Herausforderungen gelöst werden:

- **FX-Handel:** Einrichtung einer Schnittstelle zu 360T, so dass der FX-Handel von der IC-Anfrage über den Eigenhandel der Dürr AG automatisiert in 360T erfolgen kann. Nach Abschluss der FX-Geschäfte mit externen Bankpartnern muss sichergestellt werden, dass die FX-Kurse automatisch in die angelegten IC-Geschäfte im Treasury-Management-System gespiegelt werden können.
- **Emir:** Automatisches Hochladen der täglichen Emir-Berichte in das Melderegister sowie automatische Rückmeldung vom Melderegister.
- **IFRS 13:** Automatisierte Credit-Value-Adjustments der Geschäfte mit aktuellen Marktdaten nach IFRS 13.

„Mit dem nächsten Update unseres Treasury-Systems werden wir unsere FX-Prozesse durchgehend automatisiert abbilden können“, ist Härle zuversichtlich. Das Beispiel Dürr zeigt, wie durch die strategische Zusammenarbeit zwischen Treasury und Systemanbieter die technologischen Möglichkeiten voll ausgeschöpft werden können.

Autor

Helmut Springer ist Vice President und Prokurist bei Reval in Graz. helmut.springer@reval.com

