

Base Benchmark Lot 2

Gestion des titres dans les Benchmarks

Le contexte

AGF Asset Management a réalisé l'application « Base Benchmark » permettant de définir des « benchmarks » utilisés comme référence pour évaluer la performance d'un portefeuille client.

Un benchmark est composé d'indices du marché auxquels sont affectés des poids (c'est ce qu'on appelle le mandat de gestion).

Le benchmark peut ensuite être analysé selon différents axes de segmentation (type d'instrument, secteur économique, secteur géographique,...), les poids et performances composant ces axes étant calculés.

AGF Asset Management souhaite faire évoluer l'application Base Benchmark en introduisant la notion de titre au sein des indices et des benchmarks.



Salle de marché



Les objectifs de l'application Base Benchmark Lot 2

Benchmark est une application destinée au « reporting » du back-office financier permettant d'intégrer les valeurs des titres aux indices et aux benchmarks. Pour cela, elle offre les fonctionnalités suivantes:

→ Importer les données quotidiennes issues des providers :

Ces données sont fournies par des providers tels que DataStream, Reuters, Bloomberg. Les données à importer concernent le référentiel titre ainsi que les cours et autres données quotidiennes. Ces données portent sur les titres actions et obligations. Les titres peuvent appartenir à plusieurs indices; les valeurs quotidiennes sont donc fournies pour chaque provider potentiel du titre.

→ Calculer les données manquantes :

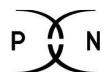
Lors de l'import, certaines données sont calculées. Par exemple, si un cours en Euro est manquant, il est calculé en fonction du cours en monnaie locale en appliquant le taux de change correspondant à la place de cotation.

→ Effectuer des contrôles de cohérence :

Une fois les données importées, un certain nombre de contrôles de cohérences sont offerts. Par exemple, les données manquantes sont listées, les sommes de pourcentages sont calculées et vérifiées.

→ Exporter les données vers les autres applications du back-office financier :

L'application Base Benchmark Lot 2 fait office de passerelle entre les providers, la base de données et les autres applications utilisées par le back office. Il est possible d'exporter une liste de benchmarks ou d'indices, leurs indices constituants pour une fourchette de dates données.





PACTE NOVATION a développé au forfait pour AGF ASSET Management une application permettant de gérer les valeurs des titres au sein des indices et des benchmarks.

Une architecture modulaire aux interfaces parfaitement définies :

- Un module Interface Homme/Machine générique et entièrement paramétrable permettant d'afficher l'ensemble des données de la base de données.
- Un module d'import de données performant et ouvert. Il assure l'import dans la base des données provenant de providers hétérogènes. La structure de la base et le code ont été optimisés afin de gérer l'import des 10 000 valeurs quotidiennes. Plus de 3 ans de données sont stockées dans la base.
- Un module de contrôle de cohérence offrant aux utilisateurs une batterie complète de tests sur les données. Il affiche le détail des données erronées complété de résumés.
- Un module d'export de données. Véritable pivot entre les applications du back office, l'application Base Benchmark lot 2 récupère les données importées quotidiennes et les exporte dans quatre formats d'export différents.



Entités		20/01/2003	21/01/2003	22/01/2003
B_BC6	Performance Journalière	-0,012730	-0,009103	-0,019033
31/12/2002 -> 01/01/2005				
Décomposition indices				
Décomposition titres				
[1..50]				
ABN Amro				
Accor				
Aegon				

Interface homme machine de l'application Base Benchmark Lot 2

Performante et complète, l'application Base Benchmark Lot 2 répond au besoin du département Asset Management d'AGF en offrant au back office financier le détail des valeurs des titres dans les indices et les benchmarks.

Elle importe les données quotidiennes venant de différents providers, assure des contrôles automatiques sur les données et calcule les données manquantes. Pivot des applications du back office, elle exporte les données de la base dans différents formats.

Le détail des valeurs des titres dans les indices et les benchmarks apporte une analyse plus fine des données boursières au département Asset Management.

Les technologies

- Java
- Base de données Sybase
- Conception objet UML, Design Patterns

