

19 de diciembre de 2016

Reportería de Rentabilidad

1. Reportería de Rentabilidad

En el presente documento se detalla el funcionamiento y uso de la reportería de rentabilidad de fondos.

1.1. Fuente de datos

Este sistema de reportería se basa en 3 fuentes de datos:

- ZHIS_SERIES_AJUSTADO
- BENCHMARKS_DINAMICA
- BENCHMARKS_ESTATICA
- BENCHMARKS_FONDOS
- ZHIS_SERIES_LUX
- ZHIS_SERIES_AJUSTADO
- MASTER_FONDOS
- FONDOSIR
- TAC

1.2. Funcionamiento

El sistema de reportería como tal, consiste en un script `ReturnReportGenerator.py` que corre a las 11:45am en el Servidor Wordpress. La ubicación relativa del script que se corre en el repositorio es la siguiente:

`mesagi/Proyectos/reportería_rentabilidad/ReturnReportGenerator.py`

A grandes rasgos, el sistema realiza las siguientes acciones:

1. Abre el archivo `RETURNREPORTGENERATOR.XLSX`, el cual contiene la plantilla a la que se renderizan los datos para el formatting del informe.
2. Se consulta a la tabla `FONDOSIR` para obtener la lista de fondos activos.
3. Por cada fondo se obtiene su valor cuota ajustado con TAC de la tabla `ZHIS_SERIES_AJUSTADO`. Además se obtiene la serie del benchmark de la tabla `BENCHMARKS_DINAMICA`.
4. Para cada intervalo de tiempo se calcula la rentabilidad de ambos vectores y adicionalmente se reconstruye el valor cuota sin TAC sumando el TAC acumulado del fondo, el cual se obtiene de la tabla `TAC`. Todos estos valores se almacenan finalmente en una lista la cual es insertada en la hoja `INPUTS` de la plantilla, en la fila asignada para el fondo.

5. Luego se repiten los 3 pasos anteriores pero para los fondos de Luxemburgo. La única diferencia, es que ahora conseguimos la lista de fondos desde la tabla ZHIS_SERIES_LUX y la serie desde ZHIS_SERIES_LUX.
6. Finalmente se repiten los 3 pasos anteriores pero para las carteras administradas. La única diferencia, es que ahora conseguimos la lista de carteras desde la tabla MASTER_FONDOS. La razón de esto, es porque esa tabla es una vista que proyecta la lista de fondos activos según SIGA. Dado que las carteras se mueven más, es necesario obtener la información de una tabla que se actualice automáticamente.
7. Ya con los datos necesarios en al hoja inputs, las otras hojas pueden referenciar la información que necesitan proyectar para el informe. Además, mantenemos en memoria una lista con los distintos tipos de carteras, ya que la vista si bien es estática, esta debe variar para obtener un pdf por tipo de cartera. La referencia al tipo va en al hoja inputs.
8. Finalmente se imprimen los pdf y se envían el correo con 3 pdf: Un informe para la agf, otro para el area comercial (sin benchmarks) y otro de carteras (para Portfolio Solutions).

1.3. Cómo agregar/borrar un fondo

Para agregar un fondo al reporte tenemos 3 casos:

- **Fondo:** En el caso de que sea un fondo común y corriente, este debe agregarse a la tabla FONDOSIR. Además, se debe corroborar que tenga un benchmark creado asignado a él¹. Luego, el programa debería reconocerlo y lo único que se debe hacer es reacomodar las celdas de la plantilla de rendereio para que se agregue al PDF.
- **Fondo de Luxemburgo:** El procedimiento es prácticamente igual, excepto en que ahora el fondo debe agregarse a la tabla FONDOSLUX.
- **Cartera administrada:** El informe debiese agregarlas de manera automática. Sin embargo, al igual que en los casos anteriores, la cartera debe estar ligada a un benchmark definido.

Para borrar un fondo del informe basta con poner en valro `active = 0` en FONDOSIR o FONDOSLUX el código del fondo a eliminar y quitar su asignación a benchmark. Para el caso de las carteras basta con quitar la asignación de la cartera a un benchmark.

1.4. Posibles puntos de falla

En caso de que en algún día el reporte no corra o no se llegue el correo, se recomienda tomar en cuenta los siguientes puntos:

- Si no hay datos de los benchmarks el informe no funcionará ².
- Si uno hay valor cuota a la fecha el output no será el correcto (Chequear si la tabla ZHIS_SERIES tiene información acutalizada).
- Si hay un excel abierto en el servidor aparte de RETURNREPORTGENERATOR.XLSX el programa lo tomará como base para el informe y se caerá.
- Verificar que los factores de ajuste y reparto acumulado estén a la fecha en la tabla FACTORES.
- Verificar que los valores cuota de los fondos de Luxemburgo estén a la fecha en la tabla ZHIS_SERIES_LUX.

¹Ver documentación de benchmarks

²Ver puntos de falla en documentación de Benchmarks.