

19 de diciembre de 2016

Carga de Factores de Ajuste y Reparto

1. Carga de Factores de Ajuste y Reparto

En el presente documento se detalla el funcionamiento del script para actualizar los factores de reparto y ajuste acumulados de los fondos mutuos.

1.1. Esquema de almacenamiento

Dado que el valor cuota que publica ZHIS.SERIES no considera repartos de dividendos ni ingresos extraordinarios, es necesario obtener un factor de reparto y de dividendo para ajustar la serie del fondo. Esta información se publica en SIGA1, por lo que sólo esta disponible para fondos mutuos. El script que se detalla en este documento trae ese valor, lo acumula y luego sube los factores acumulados a la base de datos. El detalle de los esquema para la tabla descrita se encuentra en el Cuadro 1.

FACTORES (Fecha: date, Codigo_Fdo: string, Codigo_Ser: string, Factor_Ajuste_Acumulado: double, Factor_Reparto_Acumulado: double)

Cuadro 1: Esquema de tabla de almacenamiento de factores

1.2. Script de actualización

Todos los días corre un script en el servidor Wordpress que calcula los factores acumulados en base a los factores obtenidos desde SIGA1 y los inserta en la tabla FACTORES, para esto se borra y se reconstruye toda la historia a la fecha. La ubicación relativa del script que se corre en el repositorio es la siguiente:

`mesagi/Proyectos/carga_factores/factores_uploader.py`

Es importante mencionar que toma todos los fondos presentes en SIGA1, es decir si un fondo nuevo se agrega a SIGA este debiese ser captado de forma automática. Lamentablemente, para los fondos de inversión la bolsa no provee la información de los factores.