

19 de diciembre de 2016

## Carga de Valores Cuota de Fondos de Luxemburgo

### 1. Carga de Valores Cuota de Fondos de Luxemburgo

En el presente documento se detalla el funcionamiento del script para actualizar el valor cuota de los fondos con cuotas de fondos en Luxemburgo.

#### 1.1. Esquema de almacenamiento

Dado el cambio de moneda del fondo RF Latam a pesos y las inconsistencias que dejó en la contabilidad de SIGA, se decidió llevar un cálculo en paralelo del valor cuota de los fondos de Luxemburgo. Para esto se tiene un script que todos los días descarga los datos del valor cuota de estos fondos desde Bloomberg y los almacena en la base de datos. El detalle de los esquemas para las tablas descritas se encuentra en el Cuadro 1.

- FONDOS\_BENCHMARK (Codigo\_Fdo: string, Ticker: string, Nombre\_Fdo: string, active: integer)
- ZHIS\_SERIES\_LUX (Fecha: date, Ticker: string, Valor: double)

Cuadro 1: Esquema de tablas de almacenamiento de fondos de Luxemburgo

#### 1.2. Script de actualización

Todos los días corre un script en el Bloomberg de Portfolio Solutions que carga los valores cuota de los fondos presentes en la tabla FONDOS\_BENCHMARK. Los datos se insertan en la tabla ZHIS\_SERIES\_LUX, pisando las tuplas de los últimos 20 días. La ubicación relativa del script que se corre en el repositorio es la siguiente:

`mesagi/Proyectos/carga_fondos_lux/LuxUploader.py`

#### 1.3. Cómo agregar/borrar un nuevo fondo

Para agregar un nuevo fondo basta con definirlo en la tabla FONDOS\_BENCHMARK y dejarlo activo. Además se debe cargar la historia manualmente a la base de datos.

En caso de que se quiera borrar un fondo o dejar de utilizarlo, basta con setear `active = 0` en la tabla FONDOS\_BENCHMARK y el programa no lo tomará más en cuenta.