

19 de diciembre de 2016

Carga de Cartera de Benchmarks

1. Cartera Benchmarks

En el presente documento se detalla el proceso de carga de cartera de los benchmarks de los respectivos benchmarks a las bases de datos de la AGF.

1.1. Esquema de almacenamiento

Dada la necesidad de algunos fondos de compararse contra un benchmark, todos los días se almacena la cartera de cada benchmark en las bases de datos. Esto se almacena como información histórica y dependiendo del benchmark, los datos se obtienen de distintas fuentes de origen..

El detalle de los esquemas para las tablas correspondientes al modelo de los benchmarks se encuentra en el Cuadro 1.

- BENCHMARKS.ESTATICA (Benchmark.Id: integer, Nombre.Benchmark: string)
- FONDOS.BENCHMARK (Codigo.Fdo: string, Benchmark.Id: integer, Requiere.Homologar: integer)
- ZHIS.CARTERAS.BMK (Fecha: date, Codigo.Fdo: string, Codigo.Emi: string, Codigo.Ins: string, Weight: double, ...)

Cuadro 1: Esquema de tablas de almacenamiento cartera de benchmarks

1.2. Carga de Carteras

Para subir la posición diaria de cada benchmark a ZHIS_CARTERAS_BMK se corre un script en el servidor Bloomberg de Portfolio Solutions. La ubicación relativa del script que se corre en el repositorio es la siguiente:

`mesagi/Proyectos/descarga_carteras_benchmarks/BmkPosUploader.py`

Es importante mencionar que la hora en que se corre el script no puede ser inferior a las 11am, dado que existen benchmarks que son subidos por RiskAmerica en ese horario. Otro punto a mencionar es que se descargan sólo fechas de Lunes a Viernes.

1.3. Funcionamiento

Tal como fue mencionado, existen dos fuentes desde donde se descargan las posiciones de los distintos benchmarks de los portafolios. A continuación se detalla a grandes rasgos cómo funciona el script de carga de cartera de benchmarks:

- Se descarga una lista con todos los fondos que compiten activamente contra un benchmark (columna alpha seekers)
- Para cada fondo se detecta si su benchmark se aloja en Bloomberg o en RieskAmerica.
- En el caso de Bloomberg, los datos se descargan directamente a través de la API BBL y luego se mapea cada ticker contra la tabla MAPPING_BBL_BCS.
- En el caso de RiskAmerica, los datos deben ser descargados desde su servidor SFTP. Los datos de conexión para este protocolo son los siguientes:

servidor: sftp.riskamerica.com
 usuario: AGF_Credicorp
 puerto: 22
 clave: dX{/”4YjA

- Finalmente se carga la información a la tabla ZHIS_CARTERAS_BMK.

1.4. Carga de nuevos benchmarks

En caso de que se quiera agregar un nuevo benchmark a la base de datos, los pasos son los siguientes:

1. Agregar los índices que se necesiten para componer a la base de datos (ver documentación benchmarks).
2. Definir el benchmark con su nombre y moneda en BENCHMARKS_ESTATICA.
3. Asignar el benchmark a los distintos fondos/carteras correspondientes en FONDOS_BENCHMARK.
4. Definir en FondosIR que el fondo es un alpha seeker y la fuente de donde proviene el benchmark.

Finalmente, es importante mencionar que en caso de que un benchmark se deje de usar, **se recomienda fuertemente borrar toda su información**, tanto de las tablas estáticas como dinámicas.

1.5. Posibles puntos de falla

En caso de que en algún día los índices o los benchmarks no aparezcan a la fecha en las tablas, se recomienda tomar en cuenta los siguientes puntos:

- Si no hay datos de los benchmarks, corroborar que el script correrá en el servidor.
- Si un ticker no tiene información en la fecha de 20 días atrás o se discontinúa, entonces el programa que carga índices fallará. Si dejó de existir información histórica de un índice, se debe consultar a Bloomberg help el origen de esta falta, lo mismo con RiskAmerica.
- Los benchmarks deben agregarse a la tabla benchmarks estática.
- El fondo debe estar declarado como alpha seeker en la tabla FondosIR.