Оглавление

[Источники данных и порядок формирования файлов 2](#_Toc401763594)

[Памятка для ответственного от бизнеса 3](#_Toc401763595)

[Требования к файлам, обрабатываемым макросами 3](#_Toc401763596)

[Требования к файлам, обрабатываемым вручную 3](#_Toc401763597)

[Пример работы с макросами 4](#_Toc401763598)

[Ежемесячные заливки – как правильно подготовить все файлы 7](#_Toc401763599)

[Памятка для ответственного от ИТ 8](#_Toc401763600)

# Источники данных и порядок формирования файлов

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Источник данных** | **Периодичность загрузки в БД** | **Ответственный от бизнеса** | **Ответственный от ИТ** | **Способ подготовки** | **Что включает выходной набор** |
| Финансовая отчетность МСФО | Раз в месяц | Вячеслав | Константин | Макрос | COLLECTIONS\_FACT (фактические сборы);  TAXES\_FACT (налог на прибыль факт);  COSTS\_OPER (операц расходы факт);  COSTS\_OTHER (расходы ГО факт);  COSTS\_PCT (факт % расходы факт;) |
| Оценка портфеля | По мере необходимости (раз в месяц и чаще) | Вячеслав | Константин | Макрос | PORTFOLIOS (входные характеристики);  COLLECTIONS\_PLAN (сборы план);  PROFIT\_OPER\_PLAN (плановая опер прибыль);  EBITDA\_PLAN (изнач план EBITDA);  COSTS\_OPER\_PLAN (план операц расходы)  COSTS\_OPER\_PLAN\_MARGIN (плановая маржа операц расх) |
| Плановая маржа операционных расходов1 | По мере необходимости (раз в год и чаще) | Вячеслав | Константин | Вручную (базис) | COSTS\_OPER\_PLAN\_MARGIN (плановая маржа операц расх) |
| Прогнозные сборы2 | По мере необходимости (раз в год и чаще) | Вячеслав | Константин | Вручную | COLLECTIONS\_PRED (прогнозные сборы) |
| Модель пересчета потоков | По мере необходимости | Вячеслав | Константин | Макрос | NPV\_FACT  NPV\_PLAN |

1 Раз в год, или чаще, пересчитываем в Excel ВСЕ портфели и подливаем отдельно, пометив актуальность поля DATE\_LOAD через **Год/НомерПересчета** (например 2014/1, 2014/2). **Это базис**. Все новые портфели в течение года добавляются из обработанного макросом файла (см выше), в момент запуска юзер указывает номер пересчета, соответствующий самому последнему глобальному пересчету по всем портфелям (например 2014/2, если их всего было два таких)

2 При добавлении всех новых портфелей каждый месяц, прогноз их сборов=плану по сборам из оценок до тех пор, пока по ним не будет проведена переоценка.

# Памятка для ответственного от бизнеса

## Требования к файлам, обрабатываемым макросами

**Файл финансовой отчетности МСФО**

- из файла МСФО макрос использует вкладку "Purchased portfolios 2";

- алгоритм макроса опирается на названия по столбцу 2;

- последней строкой идут Операционные расходы, они рассчитываются вручную. Название в ячейке должно быть строго равно "Операц расх".

**Файл Оценка портфеля**

- алгоритм макроса опирается на формат файла, утвержденный в октябре 2014;

- рабочий лист «Экономика портфеля»;

**Файл Модель пересчетов**

- рабочий лист «Аналитика»;

- алгоритм макроса опирается на названия по столбцу 6;

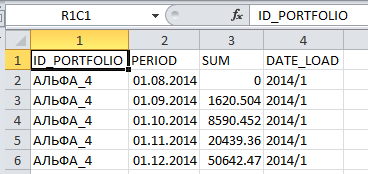
Примечание: При добавлении всех новых портфелей каждый месяц, необходимо так же сформировать прогноз их сборов. Данный реестр COLLECTIONS\_PRED = плану по сборам из оценок COLLECTIONS\_PLAN до тех пор, пока по ним не будет проведена переоценка. Т.е. заливаем плановые значения в прогнозную таблицу COLLECTIONS\_PRED, проставляя актуальность по полю [VERSION] = значению из последней актуальной массовой заливки.

Или же можно попросить ответственного от ИТ, чтобы он сделал это через SQL-скрипт.

## Требования к файлам, обрабатываемым вручную

**Файл Плановая маржа операционных расходов (базис)**

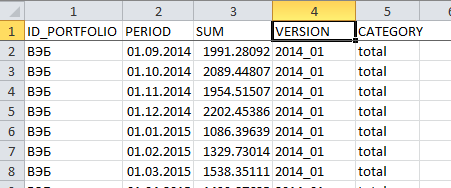
Базис, пересчитываем раз в год (иногда чаще), включает все портфели и все периоды. Шапка выходного набора с именем **COSTS\_OPER\_PLAN\_MARGIN** выглядит следующим образом:



Где **DATE\_LOAD** – это параметр, отражающий актуальный номер пересчета (2014 – год пересчета базиса, 1 – это номер пересчета). Если в 2014 году пересчитывали дважды: в январе и в октябре, то более актуальный будет второй и он должен быть записан как **2014/2.**

**Файл прогнозные сборы**

Пересчитываем раз в год или чаще. Шапка выходного файла с именем **COLLECTIONS\_PRED** имеет вид:



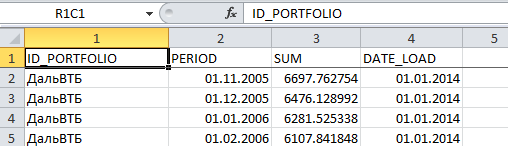
Где **VERSION** – это параметр в формате ГГГГ\_ММ, отражающий актуальность пересчета (2014 – год, 01 – месяц когда сделан преесчет);

**CATEGORY** – всегда ставим **total.**

**Файл Модель пересчета потоков.**

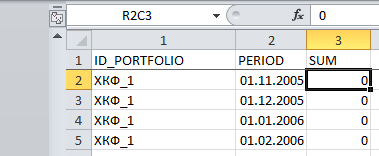
Пересчитываем по мере необходимости по всем портфелям. На выходе вы предоставляете два файла: NPV\_FACT и NPV\_PLAN. Шапка имеет следующий вид:

**NPV\_FACT**



Где **DATE\_LOAD** - это параметр, отражающий актуальный номер пересчета. Он представлен в виде даты ДД.ММ.ГГГГ

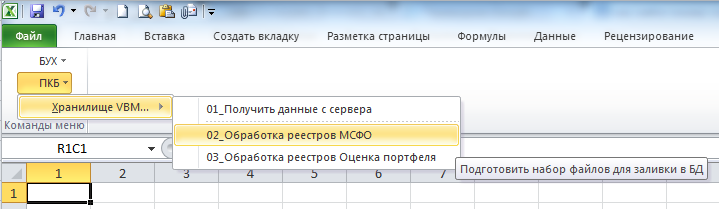
**NPV\_PLAN**



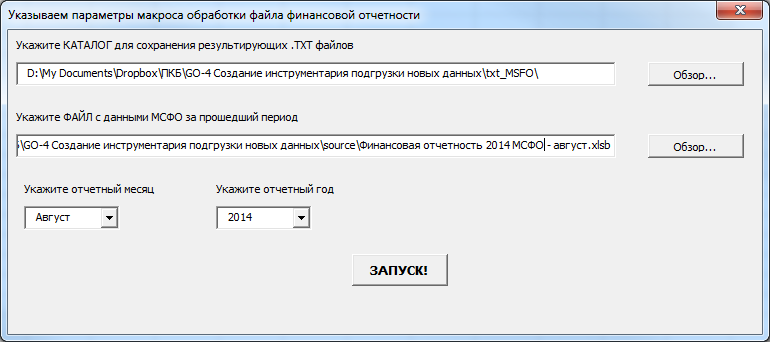
## Пример работы с макросами

1. **Подготовка набора файлов из файла Финансовой отчетности**

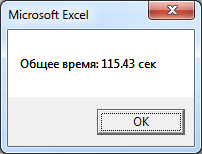
Запускаем макрос из надстройки ПКБ (макрос можно запускать из ЛЮБОЙ открытой книги Excel):



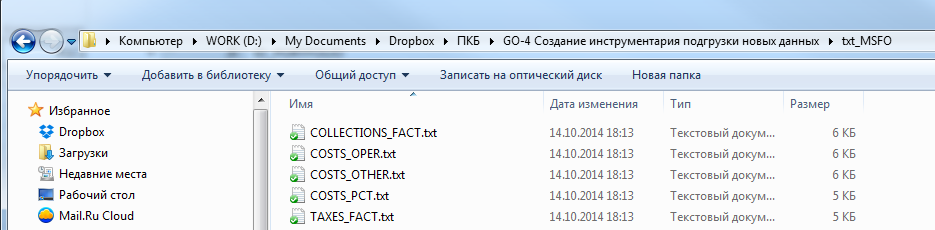
В появившейся форме указываем пути через кнопки ОБЗОР, указываем месяц и год обрабатываемого периода и нажимаем кнопку ЗАПУСК.



Макрос производит нужные расчеты и по окончании работы выдает сообщение:

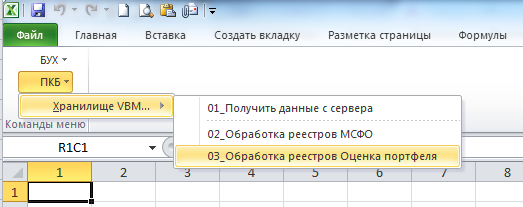


В результате работы макрос создал книгу со вкладками, а также сохранил каждую вкладку как отдельный текстовый файл в указанную при запуске директорию.



1. **Подготовка набора файлов из файла Оценка портфеля**

Запускаем соответствующий макрос:

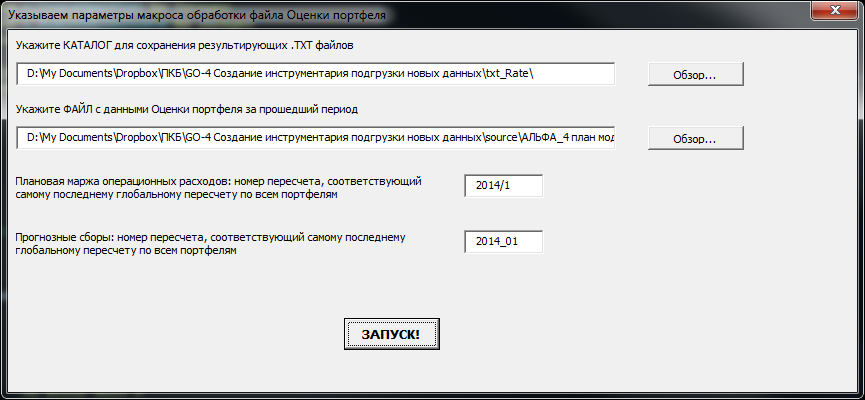


В появившейся форме указываем пути через кнопки ОБЗОР, а также:

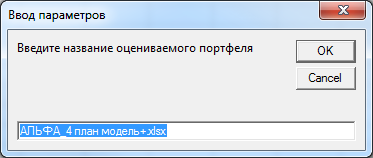
- номер пересчета «Плановой маржи операционных расходов», соответствующий актуальному базисному номеру из БД;

- номер пересчета «Прогнозных сборов» по всем портфелям, соответствующий последней актуальной заливке.

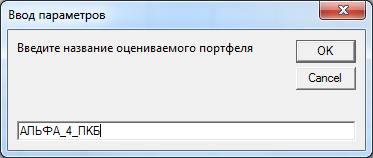
и нажимаем кнопку ЗАПУСК.



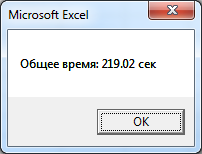
Макрос начинает работу, после чего он уточняет имя оцениваемого портфеля, которое будет загружено в БД. По умолчанию макрос предлагает имя, соответствующее названию файла оценки:



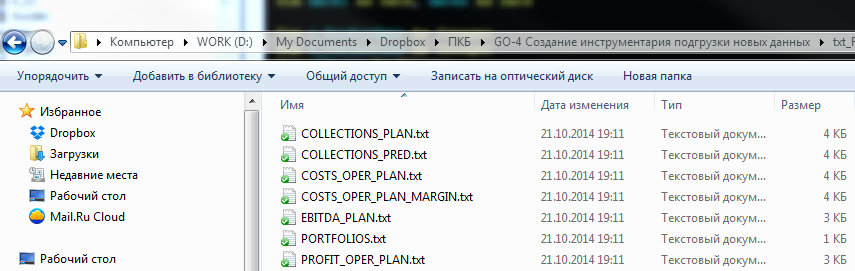
Корректируем имя и жмем ОК:



По окончании сработки макроса выдается сообщение:



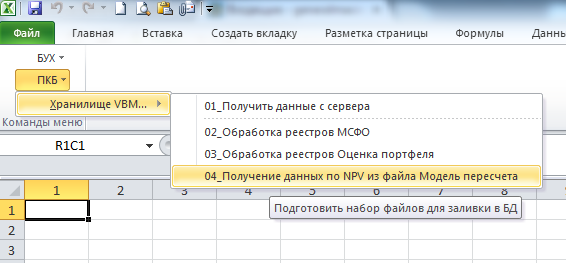
В результате работы макрос создал книгу со вкладками, а также сохранил каждую вкладку как отдельный текстовый файл в указанную при запуске директорию.



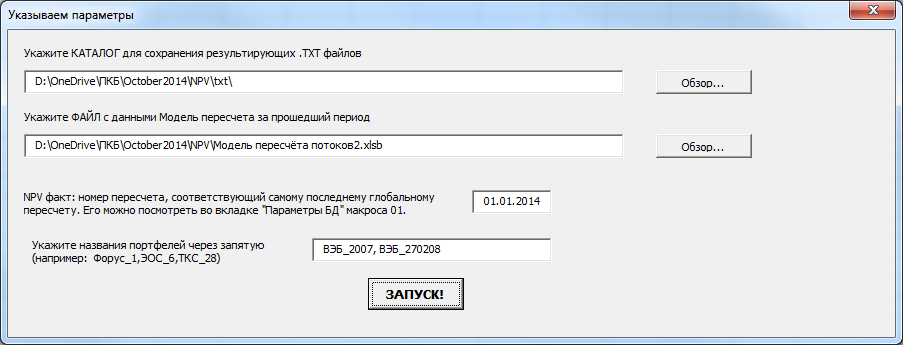
Если по какой-то причине вы готовите набор данных для заливки вручную, ориентируйтесь на список файлов выше и не забывайте создать отдельный набор данных для COLLECTIONS\_PRED, несмотря на то что для новых портфелей прогноз соответствует плану. Эти вещи хранятся в разных таблицах. Поэтому нужен свой файл.

1. **Подготовка набора файлов из файла Модель пересчетов**

Запускаем соответствующий макрос из чистой книги:

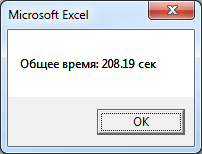


В появившейся форме указываем параметры запуска:

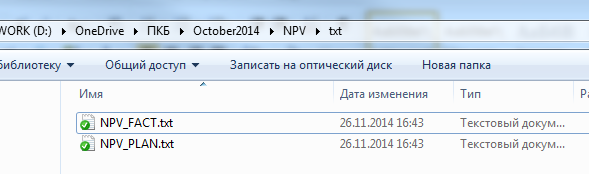


Список портфелей нужно указывать через запятую. Допустим пробел после запятой, но не перед ней. Главное чтобы указываемые названия полностью соответствовали названиями портфелей в файле Модель пересчета. В свою очередь названия портфелей в файле Модель пересчета должны совпадать с залитыми в базу портфелями (включая регистр букв).

По окончании сработки макрос выдает сообщение:



В результате работы макрос создал книгу со вкладками, а также сохранил каждую вкладку как отдельный текстовый файл в указанную при запуске директорию.



## Ежемесячные заливки – как правильно подготовить все файлы

Закончился очередной месяц. У нас есть файл «финансовая отчетность МСФО», а также набор файлов «Оценок портфелей», купленный в данном месяце. Наши действия:

Подготавливаем текстовые файлы через макросы.

**Важно:** при добавлении всех новых портфелей каждый месяц, прогноз их сборов=плану по сборам из оценок до тех пор, пока по ним не будет проведена переоценка. Поэтому сформированный COLLECTIONS\_PRED совпадает по суммам с COLLECTIONS\_PLAN.

Необходимо так же подготовить реестр NPV\_PLAN и NPV\_FACT. Формат файлов приведен выше..

Подготовленные текстовые файлы пересылаем в ИТ подразделение.

Для того чтобы не запутать ответственного от ИТ, группируйте файлы на новую информацию и на перезаливаемую информацию. В случае если необходимо поменять % ставку по расчету процентов или долю заемных средств – так же сообщаем ответственному от ИТ об этом.

Важно: в базе данных вся числовая информация хранится в тысячах рублей, соответственно при ручной подготовке реестов не забывайте делить на 1000, где это необходимо.

# Памятка для ответственного от ИТ

1. Новая информация

Со стороны бизнеса вам поступают файлы для подливки в БД. Имена файлов перечислены в таблице выше (см. последний столбец).

Вы осуществляете загрузку этих данных в таблицы БД. Имена целевых таблиц соответствуют названиям файлов. Имена столбцов в файлах так же соответствуют названиям столбцов целевой таблицы.

Таблица PORTFOLIOS является родительской по отношению к другим.

2. Изменения переменных расчета

Со стороны бизнеса может поступить запрос о необходимости изменить параметр «Доля заемных средств». Предположим, что «бизнес» просит нас поменять значение параметра на 27.9%, тогда:

/\*1.

В случае изменения параметра "Доля заемных средств" (известит ответственный от бизнеса) необходимо обновить его значение в БД, запустив команду:\*/

*update [SYS\_LKP\_CODE]*

*set [CODE] = 0.279, [DESCRIPTION] = N'Comment'*

*where CATEGORY = N'LEVERAGE\_RATIO'*

-- где 'Comment' – необязательный комментарий, который тоже можно задать при необходимости

-- где 0.279 - это непосредственно доля заемных средств = 27.9% (тестовый VBM)

3. Перезаливка

Со стороны бизнеса может поступить запрос о перезаливке некоторых данных за прошлые периоды. В этом случае необходимо удалить прежнюю информацию из БД. Уточняйте подробности у бизнеса.

Для решения данной задачи можно выстроить следующий алгоритм:

- импорт новых данных в буферные таблицы (BUFFER\_);

- удаление старых данных из основных таблиц. Искомое удаляемое множество можем определить по совпадению с primary key основной таблицы;

- перенос данных из буфера в основные таблицы;

- очистка буфера.

Буферные таблицы повторяют структуру основных одноименных таблиц. Добавляется префикс BUFFER\_. Не содержат primary key и других ограничений.

При отсутствии буферного аналога основной таблицы – создайте его через скрипт и используйте по алгоритму…

4.

ПОСЛЕ ТОГО КАК В БД БЫЛИ ПРОИЗВЕДЕНЫ ИЗМЕНЕНИЯ:

/\*После подгрузки данных нового отчетного месяца в первую очередь необходимо произвести обновление таблицы с переменными.\*/

*DECLARE @return\_value int*

*EXEC @return\_value = [dbo].[sp\_Updating\_tmp\_UFN\_VALUES]*

*SELECT 'Return Value' = @return\_value*

/\*Далее необходимо выполнить на сервере хранимые процедуры в следующем порядке\*/

--обновление

*DECLARE @return\_value int*

*EXEC @return\_value = [dbo].[sp\_Updating\_tmp\_COSTS\_PCT\_PRED]*

*SELECT 'Return Value' = @return\_value*

--обновление

*DECLARE @return\_value int*

*EXEC @return\_value = [dbo].[sp\_Updating\_tmp\_UNPAY\_COST\_WITHOUT]*

*SELECT 'Return Value' = @return\_value*

--обновление

*DECLARE @return\_value int*

*EXEC @return\_value = [dbo].[sp\_Updating\_tmp\_UNPAY\_COST\_WITH]*

*SELECT 'Return Value' = @return\_value*

Важно: не забывайте делать резервную копию БД перед заливкой новых данных, полученных от бизнеса.