



TSI

GESTION DE PORTEFEUILLES – OPCVM



VALEURS GEREES

- Actions et assimilés
- Valeurs mobilières à intérêts post-comptés
- Valeurs mobilières à intérêts précomptés
- Immobilier
- Devises
- Espèces
- Opérations diverses :
 - Remboursements
 - Tombées de coupon

COURS ET RATING

- Cotation des valeurs mobilières
- Edition de la cotation des valeurs mobilières par jour
- Cotation des indices boursiers
- Importation des cours à partir d'un fichier
- Edition de l'historique de la VL d'un OPCVM
- Edition VL pour le CMF
- Edition VL pour les clients

GESTION DES ORDRES

- Saisie ordres par compte et par client
- Edition des ordres par contrepartie
- Saisie ordres des clients



CARACTÉRISTIQUES TECHNIQUES

- Environnement de développement :

- Langage et Framework : C#, .Net6, Angular, Framework Core 6, Bootstrap, Devexpress
- Base de données : Microsoft® SQL Server® 2012 – Express Edition
- Reporting : Paramétrable par l'utilisateur : En plus de l'aperçu d'avant impression habituel les états sont exportables vers PDF, Excel et Word

- Architecture de développement :

- Côté client (Angular) : Modules, Composants, Services
- Côté serveur (API REST) : Controllers, CQRS, Handlers, Mediator, Services, Repositories, Entity Framework, Database

- Ordres groupés
- Edition des ordres des clients

TRANSACTIONS

- Saisie des différents types de transaction (Actions et assimilés, Post compté, Pré compté, Espèce et Divers) avec génération des écritures comptables
- Annulation de transaction avec génération d'écriture comptable d'annulation
- Annulation de transaction avec génération d'écriture comptable de contre-passation
- Gestion des échéanciers de transactions
- Gestion des dénouements
- Suivi des règlements de frais
- Edition de la liste des transactions : Dénouées, non dénouées ou toutes, par client, par entité juridique, type d'opération, valeur mobilière et date dénouement
- Edition de la fiche de transaction (différente par type de transaction)
- Edition de la fiche de transaction (différente par type d'opération)
- Edition de la liste des transactions par type de transaction
- Edition de la liste des transactions par type d'opération
- Edition de l'échéancier des transactions par client, par entité juridique, par type valeur mobilière, par valeur mobilière et par date
- Rapprochement bancaire



- Architecture de déploiement :

- Déployer la solution Frontend (Angular) et Backend (.NET) selon l'infrastructure disponible sur un serveur unique ou sur deux serveurs distincts
- Cette architecture modulaire et structurée améliore la maintenabilité, la testabilité et la scalabilité de l'application

- Autres caractéristiques techniques :

- Journalisation des actions des utilisateurs par table et par enregistrement
- Gestion des priviléges (droits d'accès) par groupe d'utilisateur et par fonctionnalité
- Tous les écrans et les états qui comportent des listes permettent l'export vers Excel

TRAITEMENTS DE FIN DE JOURNÉE

- Calcul de l'actif de fin de journée de chaque client
- Calcul provisoire de la VL avec génération des écritures comptables
- Validation du calcul et verrouillage de la journée
- Portefeuille d'un client à une date : Liste des valeurs mobilières à la date en cours : Valeur mobilière, (dossier d'achat pour les BTA), quantité, prix de revient unitaire, montant prix de revient, intérêt couru, intérêt couru intercalaire, intérêt acheté, plus ou moins-value potentielle, plus ou moins-value sur remboursement BTA et valeur boursière
- Portefeuille d'un client ou d'un OPCVM à une date : Liste des valeurs mobilières du client ou d'un OPCVM à la date en cours : Valeur mobilière, quantité, prix de revient unitaire, montant prix de revient, intérêt de détention potentiel, intérêt intercalaire potentiel, intérêt acheté, plus ou moins value potentielle, intérêt acheté, plus ou moins value sur remboursement BTA et valeur boursière
- Vérification du solde espèces à partir de celui de la veille (J-1) / J et des transactions dénouées du jour (c'est-à-dire les mouvements d'espèces)
- Souscription/Rachat : Liste des souscriptions et rachats du jour
- Mouvement OPCVM : Liste de toutes les transactions du jour pour les OPCVM
- Liste des frais de gestion du jour
- Registre de porteurs : Liste des porteurs de parts de L'OP CVM à la date en cours avec la quantité acquise par chacun d'eux
- VL méthode 1: Calcul du solde comptable titre, du solde des tiers et compte financiers et de l'actif net avant et après frais de gestion
- VL méthode 2 : Calcul des sommes distribuables de l'exercice en cours et de l'exercice antérieur, des sommes non distribuables exercice en cours et exercice antérieur et de la somme distribuable report à nouveau N-1

PORTEFEUILLE D'UN COMPTE, D'UN CLIENT, OU OPCVM

- Les clients : informations générales, liste des comptes et liste des représentants légaux
- Historiques des mouvements, par type opération, par valeur mobilière et par date
- Calcul du solde espèces du jour à partir de celui de la veille
- Liste des frais du jour
- Liste des transactions du jour
- Les OPCVM
- Edition de fiche client
- Historiques des mouvements
- Edition de l'historique des mouvements par client, par type opération, par valeur mobilière et par date
- Edition de l'attestation client : Affichage du nombre de parts acquis de chaque OPCVM.
- Transactions : Liste des transactions du jour autre que les souscriptions et rachats par client ou par OPCVM
- Trésorerie prévisionnelle d'un client
- Trésorerie prévisionnelle d'un OPCVM

ÉCRITURES COMPTABLES

- Paramètres comptables : Exercices comptables, Journaux comptable
- Interface avec le système comptable de l'entreprise
- Grand livre, Balance des comptes, Etats financiers paramétrables
- Actif net
- Détails de la VL
- Journal de la VL : Ecritures comptables de la VL (contre passations, résultat potentiel à j-1, résultat potentiel à j, et écritures comptable des frais de gestion)
- Etat de la VL
- Edition de contrôle : $14 = 14 (2+3+4+5 = 6+7+1)$
- Détails de la VL extra comptable
- Edition de contrôle des cumuls des souscriptions et rachats en nominal :
Mnt cumulé des souscriptions en nominal /
nbre de parts souscrites = Mnt cumulé
des rachats en nominal / nbre de parts rachetées = VL nominale
- Journal comptable
- Etats financiers

PARAMÈTRES

- Types de valeurs mobilières : Actions VA & DR, Obligations, BTA, BTC, BTZC, FCP, Sicav, BIT à moins d'un an, BIT à plus d'un an, Certificat de dépôt à plus d'un an, Certificat de dépôt à moins d'un an, DAT à moins d'un an, DAT à plus d'un an, Bons de caisse à moins d'un an, Bon s de caisse à plus d'un an
- Les règles de comptabilisations par type d'opération, par type de produit et par type de frais
- Intermédiaires, Dépositaires, Contreparties, Emetteurs, Distributeurs

- Indices boursiers, Agences de rating, Notes des émetteurs
- Paramètres des valeurs mobilières
- Bases de calcul : exact, 360 ou 365
- Secteurs d'activités : Assurance, Banque ...
- Groupes de cotation : montant, taux, prix et en pourcentage de prix
- Modes de cotation
- Fréquences coupon : annuelle, semestrielle, trimestrielle et mensuelle
- Types taux : indexé au TMM, variable et fixe
- Types amortissement : in fine, linéaire
- Assiettes des frais : Montant brut, Actif net
- Comptes bancaires
- Jours fériés
- Devises
- Type d'opérations : Achat, Vente, Détachement coupon, Remboursement, Entrée et Sortie de ligne...
- Valeurs mobilières : STB, BIAT, BTA, BTC Avec échéances théoriques de chaque valeur mobilière
- Types de frais de transaction : Frais de courtage sur actions VA & DR, frais / encaissement dividendes actions ...
- Types de frais de gestion : Redevance CM F, commission du gestionnaire ...
- Types de produits : Agios créditeurs/DAV ...

AUTRES PARAMÈTRES

- Paramètres comptables
- Exercices comptables : 2009, 2010, 2011 ...
- Journaux comptable : journal de la VL, des frais de gestion, des transactions, divers, des produits et de dénouement
- Les comptes comptables : comptes de la norme NC18 ou du système comptable 1997
- Paramètres des clients
- Types client compte : client OPCVM et client sous mandat
- Catégories de client : averse au risque ou peu averse au risque
- Catégories socio professionnelle : médecin, avocat ...
- Chargés de clientèle
- Apporteurs d'affaire
- Pays et Ville
- Mandataires
- Paramètres des valeurs mobilières
- Bases de calcul : exact, 360 ou 365
- Secteurs d'activités : Assurance, Banque ...
- Groupes de cotation : montant, taux, prix et en pourcentage de prix
- Modes de cotation
- Fréquences coupon : annuelle, semestrielle, trimestrielle et mensuelle
- Emetteurs
- Distributeurs
- Post pré
- Types taux : indexé au TMM, variable et fixe
- Types amortissement : linéaire, in fine
- Paramètres des OPCVM
- Gérants
- Types VL : VL connue ou inconnue
- Divers
- Assiettes des frais : montant brut, actif net
- Comptes bancaires
- Intermédiaires en bourse
- Dépositaires
- Contreparties
- Indices boursiers
- Agences de rating

RÉFÉRENCES



RÉFÉRENCES

