

Pré-requis

Aucun pré-requis

Paramétrage

RN_2073 : Valorisation avec déformation des taux Forward

Lors de certains calculs de valorisation, on a besoin d'utiliser des structures de déformation différentes pour déformer les taux d'actualisation et les taux forward. Rappel : la structure de déformation à appliquer aux taux d'actualisation se paramètre au niveau des scénarios de valorisation. Dans le paramétrage des taux composés, la zone 'Tx Forward' permet d'indiquer la courbe à utiliser pour calculer les taux forward. On dispose maintenant d'un nouveau champ 'Structure Spread' dans le masque de saisie des Taux Composés. Lors des calculs de valorisation, les taux forward sont alors calculés à partir de la structure de taux saisie dans 'Tx forward' à laquelle on applique la structure de déformation saisie dans 'Structure Spread'.

RN_2074 : Valorisation / Courbe de taux futures

Un nouveau champ 'Maturité' est ajouté sur le paramétrage des 'Taux de Marché Futures'. Ce champ détermine la maturité jusqu'à laquelle les valeurs des contrats futures sont prises en compte pour le calcul des taux zéro-coupons. A titre d'exemple, pour une maturité de 2 Ans, les taux zéro coupons de maturité inférieure à 2 ans sont calculés à partir des taux futures, et les taux zéro coupon supérieurs à 2 ans sont calculés à partir de la courbe de taux de marché 'classique'. Par défaut, la maturité prise en compte pour les Taux de Marché Futures est égale à 1 An.

RN_2083 : Echelle d'Intérêts / Estimation des taux futurs

Arpson permet maintenant de calculer des Echelles d'Intérêts prévisionnelles en se basant sur des calculs de taux forward. A cet effet, un nouveau champ 'Taux Futurs' est ajouté dans le masque de paramétrage des Echelles d'Intérêts. Ce champ permet de déterminer quelle méthode est utilisée pour estimer les flux futurs. Ce champ peut prendre les valeurs suivantes :

- 'Crs Cristallisé' : le module cristallise alors le dernier cours connu en date de traitement pour estimer les flux futurs. C'est la valeur par défaut.
- 'Tx Forward' : dans ce cas, le module effectue un calcul de taux forward en date de traitement pour estimer les flux futurs. Remarque importante : l'option 'Taux Futurs' impacte non seulement les flux futurs issus des opérations, mais également les taux de rémunération utilisés pour calculer les agios (ceux paramétrés dans la structure de 'Taux de Refinancement')

RN_2097 : Structures de Déformation

Afin de gérer les décalages de dates dues aux jours fériés sur les structures de déformation, deux nouveaux champs sont ajoutés dans le masque de saisie des 'Structures de Déformation' :

- Calendrier : indique le calendrier utilisé pour déterminer si une date est un jour férié.
- Ajustement : indique la méthode d'ajustement si la date calculée tombe un jour férié (jour ouvré suivant, jour ouvré précédant, ...)

RN_2101 : Scénarios de Frais

Afin de pouvoir affecter des scénarios de Frais aux opérations selon des règles complexes, il est maintenant possible de paramétrer une correspondance de Scénarios de Frais au niveau du code opération des classes de marché concernées. Remarque : les correspondances de Scénarios de Frais sont les correspondances dont le champ 'Type' est égal à 'Frais'.

RN_2111 : Fiche en Valeur / Contrevalorisation

Dans le module 'Fiche en Valeur', on a maintenant la possibilité d'effectuer de calculer le 'Solde Moyen Ctv' en effectuant une contrevalorisation quotidienne du solde moyen. A cet effet, un nouveau champ 'Contrealeur' est ajouté sur le masque de paramétrage des Fiches en Valeur :

- 'Standard' : dans ce cas, le 'Solde Moyen Ctv' est calculé en contrevalorisant la valeur du 'Solde Moyen' à la date courante.
- 'Quotidien' : dans ce cas, le 'Solde Moyen Ctv' est calculé en effectuant une contrealeur quotidienne du solde, puis en calculant la moyenne de ce solde quotidien contrevalorisé.

RN_2116 : Appels de Marge / valorisation retenue

Lors du traitement d'appel de marge, la valorisation retenue pour calculer les appels de marge peut être négociée avec la contrepartie (en général, il s'agit d'une moyenne entre la valorisation calculée par Arpson et la valorisation calculée par la contrepartie). Nous avons maintenant la possibilité de stocker dans le système la valorisation de la contrepartie (en sus de la valorisation calculée par Arpson et de la valorisation retenue). A cet effet, le format du fichier d'import des valorisations externe est modifié : ajout d'une nouvelle colonne contenant la valorisation contrepartie. De plus un nouveau critère 'Valoris Ctp' est disponible dans l'onglet 'Critères' du masque de paramétrage des Collatéralisation. Une option 'Valo Retenue' est également ajoutée sur le paramétrage des contrats de collatéralisation. Cette option permet de déterminer quelle est la valorisation retenue pour calculer les appels de marge. Les choix possibles sont :
- 'Valo Calculée' : c'est la valorisation Arpson qui est retenue.
- 'Valoris Ctp' : c'est la valorisation de la contrepartie qui est retenue
- 'Moyenne Arithm' : le système utilise la moyenne entre la valorisation Arpson et la valorisation donnée par la contrepartie pour calculer les appels de marge.
- 'Valeur Externe' : le système utilise la valorisation fournie dans la colonne 'Valeur Externe' du fichier de valorisation externe pour calculer les appels de marge. Par défaut, c'est cette option qui est retenue.

RN_2133 : Echelle d'Intérêts / Opérations nettes

Release Note N2.16

Lors du lancement du module 'Echelle d'Intérêts', le netting des opérations est maintenant pris en compte si l'option 'Netting Inclus' du rapport sous-jacent est cochée.

RN_2136 : Fiches En Valeur / Export Constantes

Dans le module 'Fiches En Valeur', on peut maintenant paramétrer une Constante dans le 'Format d'Export'.

RN_2156 : Echelle intérêts / analyse par 'num histo'

Afin de permettre d'analyser et de justifier les résultats fournis par le module 'Echelles d'Intérêts', on dispose maintenant de la possibilité de lancer le module en ventilant les résultats opération par opération. Pour cela, il suffit de paramétrer le champ 'Clef' avec la valeur 'Num Histo'.

RN_2157 : Périodicité / Fin de Trimestre civil

Dans le masque de paramétrage des périodicités, on dispose maintenant de la Fonction 'Fin Trimestre Civil'. Une périodicité donnant les dates du 31 Mars, 30 juin, 30 septembre et 31 décembre de chaque année se paramètre alors de la façon suivante : . Ajouter jour +1 . Fin Trimestre Civil

RN_2160 : Standard / Redirection

Pour "l'intégration du Standard", on dispose maintenant de la possibilité de rediriger les Codes Opérations.

Evolutions des Masques de Saisies

RN_2124 : Change / Frais de Gestion

Ajout du champ 'Frais de Gestion' sur la classe de marché 'Change'. La valeur de ce champ est pilotée par les scénarios de Frais via le champ 'Frais de Gestion' des 'Modèles Change'.

RN_2125 : Change / dates de valeur

Pour certaines opérations de change avec la Clientèle (spot, terme, swap de change), les flux échangés dans les deux devises ne tombent pas nécessairement le même jour. Il peut exister un décalage (+1 jour, -1 jour, etc...). Pour gérer ce type d'opérations, deux nouveaux champs sont ajoutés sur le masque de saisie des opérations de change : - 'Dt Valeur Ctp' : Indique la date de règlement du flux en devise contrepartie, à l'engagement de l'opération. - 'Dt Valeur Echéa Ctp' : Indique la date de règlement du flux en devise Contrepartie, à l'échéance de l'opération. Remarque : ces champs ne sont actifs que pour les opérations de change non optionnelles. La valeur de ces champs est pilotée par des scénarios de règlement, paramétrés sur le code opérations dans les champs 'Dt Règlement Ctp' Afin de piloter la valeur de ces champs, deux nouveaux champs sont ajoutés sur le masque de saisie des 'Modèles Change' : - 'Dt Règlement Ctp' : Indique un Scénario de Règlement permettant de générer dynamiquement la 'Dt Valeur Ctp' de l'opération, c.a.d. la date de règlement du flux en devise Contrepartie, à l'engagement de l'opération. - 'Scénario Rgl't Ctp' : Indique une correspondance de Scénarios de Règlement permettant de générer dynamiquement les dates de valeurs (de règlement) des échéances futures des flux dans la devise Contrepartie. De plus, les correspondance de Scénarios de Règlement paramétrées dans le champ 'Dt Règlement' des 'Modèles Change' sont maintenant correctement prises en compte.

RN_2155 : Lignes de Crédits / Augmentation - Diminution du montant disponible

Sur le module 'Ligne de Crédit', on dispose maintenant de la possibilité d'augmenter (ou de diminuer) le montant de la ligne de crédit (c'est à dire la quantité disponible pour effectuer des tirages). A cet effet, la fonctionnalité 'Netting' a été renommée en 'Ajout/Netting'. Le champ 'Type' sur le masque de saisie des lignes de crédit permet de déterminer si l'évènement saisi est une augmentation (ajout) ou une diminution (netting) du montant de la ligne de crédit.

Nouvelles Variables

RN_2107 : TIE Appliqué Actu

La variable 'TIE Appliqué Actu' donne : . pour les opérations à taux fixe : le TIE stocké au niveau de l'opération . pour les opérations à taux variable ou révisable : la marge TIE stockée au niveau de l'opération PLUS le taux zéro coupon à l'échéance de l'opération, calculé avec la courbe de taux définie dans la zone 'Tx Forward' du taux de l'opération.

RN_2135 : Fixing Taux Dt Ref

La variable 'Fixing Taux Dt Ref' donne, pour les opérations à taux variable ou révisable, la valeur du fixing de l'indice sous-jacent au taux en Date de Traitement.

Méthodes de Calcul

RN_2137 : Simulations Combinées / Taux de Marché

Les structures de 'Simulations Combinées' permettent d'effectuer des calculs de valorisation en effectuant un choc sur les données de marché. Afin d'homogénéiser cette notion, la modification suivante est effectuée : lors des calculs de valorisation utilisant une structure de 'Simulations Combinées' sur une courbe de 'Taux de Marché', la simulation s'applique maintenant directement sur les taux de marché (ceux qui sont stockés dans l'historique des Indices de Bases), et non plus sur les taux zéro-coupon issues de cette courbe.

RN_2147 : Couverture / Date de Fin de Couverture

Lors de la saisie d'une relation de couverture de risque de taux, la date d'échéance de la couverture est maintenant prise en compte. Cette date représente la date de fin de la relation de couverture. Les calculs de test d'efficacité sont alors effectués en ne prenant pas en compte les flux des opérations postérieurs à cette date de fin de couverture.

RN_2151 : Couverture / Rétro-valorisation

Lors des calculs d'efficacité des relations de couverture, la méthode de calcul de la rétro-valorisation a été ajustée lorsque la courbe de taux utilisée est une courbe de 'Taux de Marché Futures'

RN_2159 : Couverture CFH / Composante Efficace

Pour les couvertures en Cash Flow Hedge, le calcul des composantes Efficace et non efficace est modifié. Les formules appliquées sont les suivantes :

Si efficacité 'plein coupon' - Test d'efficacité = ('Risque' - 'Rétro Valoris')des opérations de couverture / ('Risque' - 'Rétro Valoris')de l'opération à couvrir

Si Test efficacité > 100% - Compos. Efficace = 'Valorisation' des opérations de couverture / 'Test Efficacité' - Compos. Inefficace = 'Valorisation' des opérations de couverture - Compos. Efficace

Si Test efficacité <= 100% - Compos. Efficace = 'Valorisation' des opérations de couverture - Compos. Inefficace = 0

Si efficacité 'pied de coupon' - Test d'efficacité = ('Compos. Taux PdC')des opérations de couverture / ('Compos. Taux PdC')de l'opération à couvrir

Si Test efficacité > 100% - Compos. Efficace = ('Valorisation' des opérations de couverture - ICNE des opérations de couverture) / 'Test Efficacité'

Si Test efficacité <= 100% - Compos. Efficace = ('Valorisation' des opérations de couverture - ICNE des opérations de couverture) - Compos. Inefficace = 0

Fonctionnalités Système

RN_2088 : Message Queuing

Les messages MQ présentent en fin d'exécution le fichier de rejet, le cas échéant, afin d'obtenir toutes les informations pouvant expliquer en quoi une tâche ne s'est pas correctement exécutée.

Ajustements Divers

RN_2051 : Taux de Marché Futures / Personnalisation

On peut maintenant personnaliser le masque de saisie des 'Taux de Marché Futures'.

RN_2058 : Taux de Marché Futures / Reporting

On peut maintenant effectuer des rapports en mode 'Référéntiel' et en mode 'Données de Marché' sur la classe de Référéntiel 'Taux de Marché Futures'.

RN_2059 : Produit Structuré / variable 'Evènement'

La variable 'Evènement' dans un rapport en mode 'Série de flux' renvoie maintenant la bonne valeur ('Echea.Interméd.' ou 'Echéance Finale') dans le cas d'une opération avec un produit structuré.

RN_2060 : Traitement de validation

Le traitement de validation en masse prend maintenant en compte les restrictions éventuelles telles que la non auto validation.

RN_2063 : Interface règlementaire XML-BAM

Le format des fichiers de déclaration règlementaire XML-BAM a été modifié. Lors de la génération d'un fichier par une interface dont le champ 'Format' vaut 'XML BAM', les modifications sont les suivantes :

- La balise <IDENTIFICATION> est renommée en <IDENTIFIANT>.
- La balise <operations> est renommée en <contenu>.

RN_2079 : Réf. Collat

Il est maintenant possible de lancer des rapports avec un domaine dynamique sur le paramètre 'Réf. Collat'.

RN_2093 : Collatéral

Ajout du champ 'Collatéral' dans le masque de saisie des classes de marché : F.R.A. et Change; ainsi sur sur les Modèles d'Opération associés afin de pouvoir lancer des traitements d'appel de marge sur cette classe de marché.

RN_2094 : Variable 'Valo Deb Pnl Mrkt'

Modification du comportement de la variable 'Valo Deb Pnl Mrkt' dans le cas où la Date de Traitement est égale à la date de valeur de l'opération. Avant la modification, la variable 'Valo Deb Pnl Mrkt' calculée en date de valeur de l'opération renvoyait le montant net. Maintenant, cette variable renvoie le résultat du calcul de valorisation (ou la valeur marché dans le cas des valeurs mobilières). Rappel du comportement de la variable 'Valo Deb Pnl Mrkt' :

- lancée à une date supérieure ou égale à la date de valeur (quand on est 'en bilan'), cette variable donne la valorisation (ou la valeur marché,c.a.d. cotée, dans le cas des valeurs mobilières
- lancée à une date comprise entre la date d'opération (inclue) et la date de valeur (exclue), (quand on est 'hors bilan'), cette variable donne la valorisation moins le montant net actualisé.

RN_2095 : Valorisation opérations à départ décalé

On peut maintenant effectuer un calcul de valorisation à une date antérieure à la date d'opération.

RN_2096 : Purge-Archivage

Lors du traitement de 'Purge-Archivage', on peut maintenant purger (ou archiver) les opérations sans condition sur le flag de ces opérations. Il n'est donc plus obligatoire de passer par une interface de 'flaguage' avant de purger (ou archiver) les opérations. En terme de mode opératoire, un nouveau choix 'Tous' est disponible pour le champ 'Statut' dans la fenêtre de lancement du traitement de 'Purge-Archivage'. Dans ce cas, toutes les opérations concernées par les critères de sélection choisis (dates, classe de marché) sont purgées (ou archivées). Attention, ce type de manipulation étant irréversible, il est conseillé d'effectuer une sauvegarde de la base avant de lancer le traitement.

RN_2100 : F.R.A.

La méthode de valorisation utilisée pour valoriser les F.R.A. a été renommée en 'Flux Projetés' (auparavant, elle s'appelait 'Zéro coupon'). Les calculs ne sont pas impactés par cette modification.

RN_2103 : Volatilités de Marché

Correction d'un effet de bord sur le calcul des surfaces de 'Volatilités de Marché'. Impact possible sur les calculs de valorisation des cap/floor, des swaptions et des swap callable dans certains cas spécifiques (lorsqu'une échéance tombe aux alentours d'un 28 février).

RN_2105 : Calcul taux zéro-coupons

Ajustement de l'algorithme de boot-strapping dans le cas de maturités très longues (50A et plus).

RN_2109 : Annulation des opérations temporaires (configuration Oracle)

Correction d'un problème survenant lors de l'annulation des opérations temporaires sous Oracle. L'opération concernée est

Release Note N2.16

maintenant définitivement supprimée de la base.

RN_2110 : Variables 'Pts Delta'

Les variables 'Pts Delta' sont maintenant calculées dans le cas des calculs de valorisations effectués sur des courbes de taux basés sur les 'Taux de Marché Futures'.

RN_2115 : Appels de Marge

Lors du traitement d'Appels de Marge, correction d'un effet de bord sur le calcul des intérêts, lorsque le solde de marge devient nul en cours de période.

RN_2117 : Appel de Marge / Modification des mouvements induits

Au niveau des contrats de Collatéralisation, les fiches d'appel de marge et d'intérêts générés par le système sont historisées. Dans le cas où la dernière fiche traitée est un Appel de Marge, le système ne permet de modifier que cette dernière fiche. Dans le cas où la dernière fiche traitée est une fiche d'Intérêts, le système permet de modifier cette dernière fiche, ainsi que la fiche précédente, uniquement si celle-ci n'a pas d'impact sur le calcul de la dernière fiche d'Intérêts.

RN_2123 : Variables / Scénarios

Correction d'un problème survenant lors du lancement de certaines variables lorsque le champ 'Scénario' est renseigné.

RN_2127 : Appels de Marge

Divers ajustements sur le traitement d'Appels de Marge sont réalisés :

- Correction d'un effet de bord pour les calculs de valorisation (Certaines valorisations n'étaient pas calculée à la bonne date).
- Modification des règles d'arrondi lorsque le champ 'Multiple' est renseigné.
- Les dates de tombées d'Intérêts sont déterminées en prenant comme date de roll la date d'intérêts Initiale.
- Ajout de la notion d'Ecart Toléré sur les contrats de Collatéralisation.

RN_2129 : Produit Structuré / Amortissement

Suite à la réalisation RN_1772 (version N2.14), l'échéancier d'une opération amortie ayant un produit structuré ne se calculait pas correctement dans certains cas. Ce problème est maintenant résolu.

RN_2130 : Interface de Ré-importation / Statut administratif

Fiabilisation de la procédure de flagage lors des interfaces de ré-import.

RN_2131 : Couverture / Test d'efficacité

Lors du calcul des test d'efficacité sur le module Couverture, le calcul du coupon couru de l'élément hypothétique est ajusté dans le cas des test d'efficacité Pied de Coupon (i.e. si l'option 'Test Effic. PdC' est cochée).

RN_2134 : Swaps Temporisés / Annulation

Lorsque l'on annule un swap qui a été temporisé, les deux jambes sont maintenant supprimées.

RN_2140 : Traitement Rééval / Provisions

Correction d'une anomalie sur le calcul des Provisions lors du lancement du Traitement de Réévaluation sur la classe de marché 'Valeurs Mobilières'.

RN_2142 : Couverture / Cap Floor

Correction d'une anomalie sur les calculs d'efficacité des couvertures en Cash Flow Hedge dans le cas où l'élément de couverture est un Cap/Floor. Rappel : pour les calculs d'efficacité, on prend en compte la valorisation d'un swap équivalent (taux de référence du cap versus taux d'exercice du cap)

RN_2145 : Couverture / Mvts Divers

Les calculs de test d'efficacité sont maintenant effectués lors de la saisie d'une relation de couverture sur des Mouvements Divers.

RN_2150 : Variable Composites / valeur absolue

Dans la ventilation d'une variable composite, l'option 'Valeur absolue' du sous-jacent est maintenant prise en compte.

RN_2153 : Importation Entités Libres Historisables

Correction d'une anomalie lors de l'importation des entité libres historisables via le module 'Historique des Référentiels'. Remarque : suite à cette modification, le format du fichier généré lors d'un export via le module 'Historique des Référentiels' est modifié. Le fichier d'export généré est maintenant au même format que le fichier d'import.

RN_2158 : Couverture / Test Efficacité Pied de Coupon

Sur le module Couverture, afin de faciliter la justification des calculs de test d'efficacité lorsque ceux-ci sont effectués 'Pied de Coupon', les valeurs affichées dans les colonnes 'Coupon Couru Risq' et 'Coupon Couru Rétro' prennent maintenant en compte les pourcentages saisis dans la ventilation de la couverture. Remarque : cette modification est sans impact sur les calculs de test d'efficacité.

Améliorations Diverses

RN_2062 : Archivage sur Historique Mono-Devise

La taille des historiques de cotation de l'entité 'Historique Mono-Devise' est limitée à environ 2000 lignes (soit 8 années de cotation). Afin de pouvoir gérer des historiques sur des durées plus longues, un mécanisme d'archivage est mis en place. La procédure d'activation de l'archivage est décrite dans la documentation correspondante.

RN_2064 : Livraison Equity Swap / Annulation

Lorsqu'on clique sur le bouton "Livraison" dans le masque des equity swaps, Arpson génère une opération de valmob. Si on annule cette opération, le système "annule" maintenant automatiquement la mention "Livraison" sur le champ "Type Dénouement" de l'equity swap.

RN_2078 : Echelles d'intérêts / Export de données complémentaires

Rappel : lors d'un calcul d'Echelles d'Intérêts, on a la possibilité d'exporter les résultats sous la forme de 'Mouvements Divers' ou de 'Mouvements Cash' (si la paramètre 'Type d'Export' vaut 'Journal' ou 'Opérations') On dispose maintenant de la possibilité d'exporter des informations complémentaires calculées par le module (telles que le Solde Moyen sur la période) via un paramétrage s'effectuant sur l'onglet 'Critères' du masque de saisie des Echelles d'Intérêts. ATTENTION, cette modification a un impact sur le comportement du module 'Echelles d'Intérêts', lorsque l'onglet 'Critères' est paramétré. Le paramétrage existant de l'onglet 'Critères' du module 'Echelles d'Intérêts' est désactivé

• Mode opératoire :

L'onglet 'Critères' est composé de deux colonnes

- 'Critères' : on indique ici la donnée complémentaire que l'on veut exporter (exemple : 'Solde Moyen', ou 'Intérêts Ctv')
- 'Affectation' : on indique ici le champ du Mouvement Divers (ou du Mouvement Cash) dans lequel la donnée complémentaire est exportée. Remarque importante : la valeur de ce champ doit obligatoirement correspondre à un critère libre présent dans la personnalisation du masque des Mouvements Divers (ou des Mouvements Cash). De plus, ce critère doit obligatoirement être au format 'Montant'. Liste des données complémentaires que l'on peut exporter :
- 'Intérêts' : la valeur des agios pour la période considérée, en devise. Remarque : cette valeur est déjà exportée par défaut dans le 'Montant' du Mouvement divers (ou mouvement cash) généré.
- 'Intérêts Ctv' : la valeur des agios contrevalorisés en devise de Contrevaaleur paramétrée sur le module d'Echelle d'Intérêts
- 'SoldeMoyen' : le solde moyen (i.e. la moyenne des soldes quotidiens) pour la période considérée
- 'Solde Moyen Ctv' : le solde moyen contrevalorisé en devise de Contrevaaleur (i.e. la moyenne des soldes quotidiens contrevalorisés)
- 'Fraction Annuelle' : la durée de la période considérée, exprimée en fraction annuelle (calculée en base Exact/Exact)

RN_2080 : Collatéralisation / Dt Intérêts Init

Ajout d'un nouveau champ 'Dt Intérêts Init' sur le masque de saisie des contrats de Collatéralisation. Ce champ permet de définir, à l'initialisation du contrat de collatéralisation, la date de la précédente tombée d'intérêts. Le calendrier de tombées d'intérêts liés à ce contrat de collatéralisation est alors calculé à partir de cette date d'initialisation, et de la périodicité paramétrée dans le champ 'Périodicité'.

RN_2081 : Appels de Marge / Export de données complémentaires

Lors d'un traitement d'Appels de Marge, le module matérialise les flux d'appel de marge ou d'intérêts sous forme de Mouvements Cash ou de Mouvements Divers. On dispose maintenant de la possibilité d'exporter des informations complémentaires utilisées par le module (telles que la Valorisation Externe) via un paramétrage s'effectuant sur l'onglet 'Critères' du masque de saisie des contrats de Collatéralisation.

• Mode opératoire :

L'onglet 'Critères' est composé de deux colonnes

- 'Critères' : on indique ici la donnée complémentaire que l'on veut exporter (exemple : 'Valeur Externe', ou 'Valo Calculée')
- 'Affectation' : on indique ici le champ du Mouvement Divers (ou du Mouvement Cash) dans lequel la donnée complémentaire est exportée. Remarque importante : la valeur de ce champ doit obligatoirement correspondre à un critère libre présent dans la personnalisation du masque des Mouvements Divers (ou des Mouvements Cash). De plus, ce critère doit obligatoirement être au format 'Montant'. Liste des données complémentaires que l'on peut exporter :
- 'Valeur Externe' : la valorisation externe utilisée pour calculer les appels de marge
- 'Valo Calculée' : la valorisation calculée par Arpson. Cette valorisation est utilisée pour calculer les appels de marge si on ne dispose pas de 'Valeur Externe'.

Release Note N2.16

- 'Solde Initial' : le solde du compte de marge servant au calcul de l'appel de marge courant
- 'Seuil' : le seuil utilisé pour déterminer la valeur de l'appel de marge.
- 'Franchise' : la franchise utilisée pour déterminer la valeur de l'appel de marge.

RN_2090 : Archivage sur Taux de Marché Futures

La taille des historiques de cotation des 'Taux de Marché Futures' est limitée à environ 4000 lignes (soit moins de deux années de cotation). Afin de pouvoir gérer des historiques sur des durées plus longues, un mécanisme d'archivage est mis en place. La procédure d'activation de l'archivage est décrite dans la documentation correspondante.

RN_2106 : Collatéralisation / Valorisation coupon inclus

Lors du traitement d'appels de marge, on peut maintenant choisir d'effectuer une valorisation 'Coupon Inclus' pour déterminer le montant des appels de marge. Pour cela, un nouveau champ 'Coupon Inclus' est ajouté sur le masque de paramétrage des contrats de Collatéralisation.

RN_2128 : OATi / Echancier forcé

On a maintenant la possibilité de forcer l'échéancier des Titres dans le cas des titres indexés inflation (OATi)

RN_2146 : Valorisation / Mvts Divers

Les calculs de valorisations sont branchés sur la classe de marché 'Mouvements Divers'. A cet effet, un champ 'Scénario Valo' est ajouté sur le masque de saisie des 'Modèles Mouvements Divers'.