



IMPORTIEREN
TRANSFORMIEREN
SELEKTIEREN
EXPORTIEREN

Konsolidierte
Kursaufbereitung
im Handumdrehen

Kursverarbeitung über CFIDB

Finanzinformationen auf sicherer Basis

«Die CFIDB (Consolidated Financial Instruments Data Base) ermöglicht es Ihnen, Finanzinformationen verschiedener Datenanbieter zusammengefasst zu integrieren, kombinieren, verarbeiten und auszuwerten.»

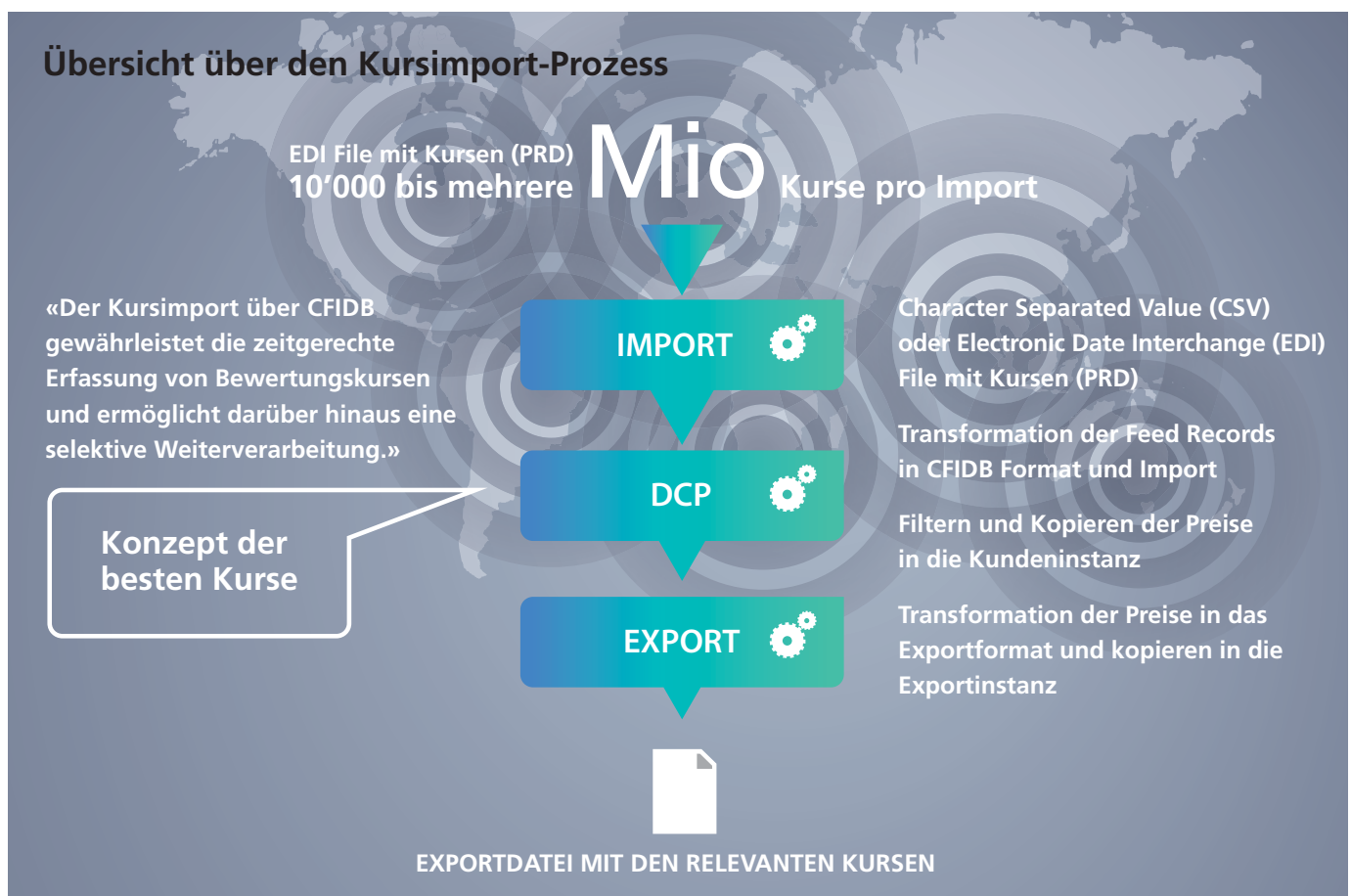
CFIDB – Die IT-Plattform für Datenintegration aus aller Welt.

Das Basisprodukt der FBA AG ist die CFIDB (Consolidated Financial Instruments Data Base), eine Plattform, welche die Integration von Finanzinformationen verschiedener Datenanbieter ermöglicht.

Es können entweder die Daten eines einzelnen Lieferanten hereingenommen, oder die Daten verschiedener Anbieter kombiniert werden.

Diese Plattform ermöglicht ebenfalls das Eröffnen und Pflegen eigener Instrumente mittels vordefinierten Regeln pro Instrumententyp, -subtyp und Region (OTC Produkte etc.).

Das diesem Produkt zugrunde liegende, umfassende Datenmodell erlaubt den Unterhalt von Stamm- und Ereignisdaten, sowie Snapshots und Bewertungskursen.



Solider Kursimport für zuverlässige Informationsprozesse.

Bewertungskurse (Real-time Snapshots und EOD-Bewertungskurse)

Der Kursimport ist einer der Hauptprozesse innerhalb des CFIDB-Systems. Da es für viele unsere Kunden geschäftskritisch ist, wenn die Bewertungskurse nicht oder nicht rechtzeitig produziert würden, ist dieser Prozess entsprechend robust designed und gebaut. Zusätzlich können verschiedene Modelle für Backup Lieferungen in solchen Fällen eingesetzt werden (z.B. keine oder unvollständige Lieferung eines Datenlieferanten etc.).

Die Lieferung dieser Kurse erfolgt durch jeden Datenlieferanten unterschiedlich.

Beispiel: Die Kurslieferungen von SIX Financial Information erfolgen über den Tag verteilt in sechs Files, sowie am Wochenende in einer zusätzlichen Datei.

Der Kursimport normalisiert diese Prozesse

- transformiert die Kurse in das interne CFIDB Format
- filtert die nicht relevanten Kurse
- selektiert die Kurse nach Wichtigkeit
- und gibt sie im geeigneten Format zu den definierten Zeiten an das/die Zielsystem(e) weiter
- protokolliert diese Schritte und lässt nachvollziehen, warum welcher Kurs ausgewählt wurde

Hauptmerkmale

- flexibel: alle Prozessschritte werden durch externe Definitionen/Konfigurationsparameter gesteuert
- hochperformant: 2,5 Mio Preisupdates einer Lieferung werden beispielsweise in 15 Minuten verarbeitet
- voll mandantenfähig: eine unbeschränkte Anzahl von

Mandanten wird von einer Instanz beliefert

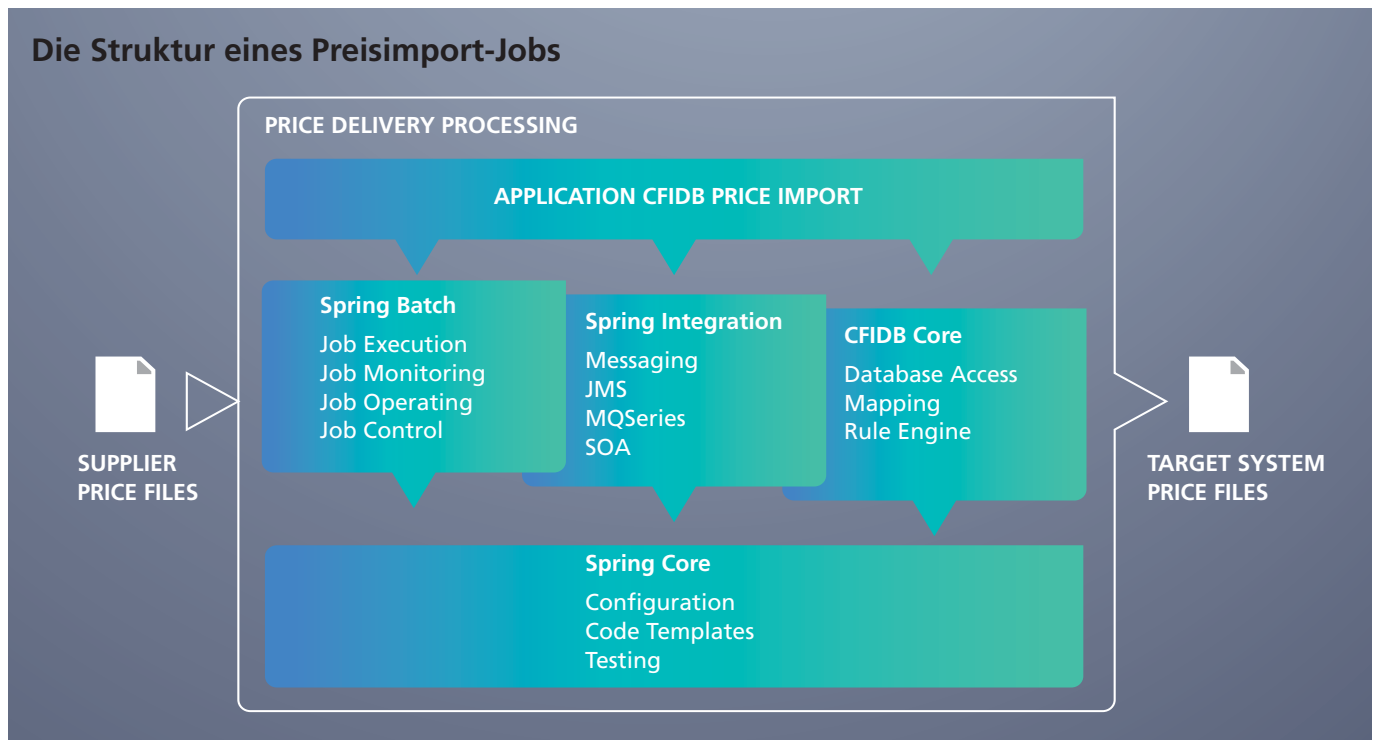
- Software ist stark modularisiert und vereinheitlicht, was die Verarbeitung von weiteren Feeds sehr einfach macht
- Nachvollziehbarkeit, warum welcher Kurs zu einem Finanzinstrument selektiert wurde (Log)
- Bewertungskurse können als real-time Snapshots oder als «offizielle» Bewertungskurse in der Tages-, Monats- oder Jahresendverarbeitung angezogen werden
- Auch weitere Kursarten, wie z.B. Jahresend- oder Steuerkurse werden verarbeitet
- Von verschiedenen Lieferanten gestellte Preise können in die Verarbeitung(en) einbezogen werden
- Verschiedene Backup-Modelle können eingesetzt werden

Prozess-Schritte

- Mapping der Input-Daten (z.B. von SIX Financial Information: PRD-DOCs) auf CFIDB Price Records
- Filtern der nicht relevanten Daten
- Import der CFIDB Price Records in die CFIDB Inputtabelle.
- Selektion der 'besten' Kurse gemäss Börsenkonzept des Kunden mit Logging der Entscheidungen
- Kopieren der Bewertungskurse für die definierten Mandanten in die Outputtabelle(n)
- Export der Kurse in die Exporttabelle
- Export in die von den Zielsystemen benötigten «Flat Files»

Nur die aktuellen Kursen pro Kurstyp, -subtyp, Börse und Währung werden vorgehalten.

«Als flexibles, hochperformantes und voll mandantenfähiges Informations-Programm importiert, filtert, selektiert und exportiert CFIDB Finanzdaten aufgrund individuell vorgelegter Parameter.»



Technische Umsetzung in Datenbank und Software.

Datenbank

Für eine performante Verarbeitung der Kurse werden:

- Die Kurse, die zusammen verarbeitet werden können, auf der Platte physisch in möglichst wenigen Blöcken abgelegt
- Alle notwendigen Daten immer nur einmal und möglichst effizient gelesen
- Alle Änderungen mit nur einem Batch Insert und einem Batch Update geschrieben

Software

Neben einer starken Modularisierung und einem performanten Datenbankzugriff kommen zuverlässige Batch-Programme zur Anwendung, die klaglos ihren täglichen Dienst verrichten. Dazu gehören Logging, robuste Fehlerbehandlung, Prozessstatistiken und ein einfaches Start/Restart-Konzept. In den letzten Jahren wurde ein Framework entwickelt, das die oben genannten Anforderungen weitestgehend erfüllt, das «Spring Batch» Framework, eine Erweiterung des «Spring» Frameworks, eine «State-of-the-art»-Technologie kombiniert mit jahrzehnte langer

Erfahrung im Bereich der Entwicklung von Batch-Anwendungen. Alle Batch-Jobs im CFIDB-System, insbesondere auch die Kursverarbeitung, sind als Spring Batch-Module implementiert. Der Code zur Verwaltung und Steuerung der Prozesse wird weitgehend vom Framework übernommen, der CFIDB spezifische Code umfasst nur die geschäftsspezifischen Module, die die eigentlichen Funktionen der Datenverarbeitung – Lesen, Transformieren und Schreiben – implementieren.

Filterarten

- Null Amount: Filtert Nullkurse heraus
- Relevante Instrumente: Selektiert Kurse von vom Mandanten gewünschten Instrumente
- Relevant Listing: selektiert Kurse zu einem Instrument an einer vom Mandanten gewünschten Börse
- Preis-Typen: Filtert Kurse nach pricetype, pricesubtype und Börse. Der Filter wird über eine einfache ASCII-Datei definiert: pro Zeile eine Filterbedingung, Zeilen sind über logisches «oder» miteinander verknüpft, Bedingungen einer Zeile sind über logisches «und» verknüpft

Zürich

FBA AG
Beethovenstrasse 9/11
8002 Zürich
Schweiz
T +41 44 280 21 81

Weinfelden

FBA AG
Sangenstrasse 3A
8570 Weinfelden
Schweiz
T +41 71 622 75 25

Südafrika

FBA Pty Südafrika (Repräsentanz)
2nd Floor
Nelson Mandela Square
Maude Street
Sandown 2196
South Africa
T +27 11 881 5774

fba-ag.ch

info@fba-ag.ch