

Administrationsmodul til Bloomberg Integrationen

Hvem er jeg?



Peer Larsen

Business System Consultant

Adm. til Bloomberg integrationen

Agenda

Bloomberg integrationen – as is

- Bloomberg Basic Data og Bloomberg Prices
- Hvordan virker integrationen i dag?

Planen fremadrettet

- Og hvilken indflydelse kan jeg få?

Bloomberg integrationen – ambition

- Brugeroplevelse
- Fleksibilitet
- Kvalitet

Bloomberg integration – MyVitec

Bloomberg Basic Data og Bloomberg Prices

Integrations / Data

Bloomberg Basic Data

Bloomberg FXGO

Bloomberg PC

Nordic Bond Pricing (NBP)

PORTMAN API

Post Trade Processing

×

Hjem

Dokumentation +

Drift og support +

Produktnyt +

Produktinfo +

Moduler

Hosting

Nyheder +

Kontakt os ↗

Log ud

Bloomberg integration – as is

Hvordan virker integrationen i dag?

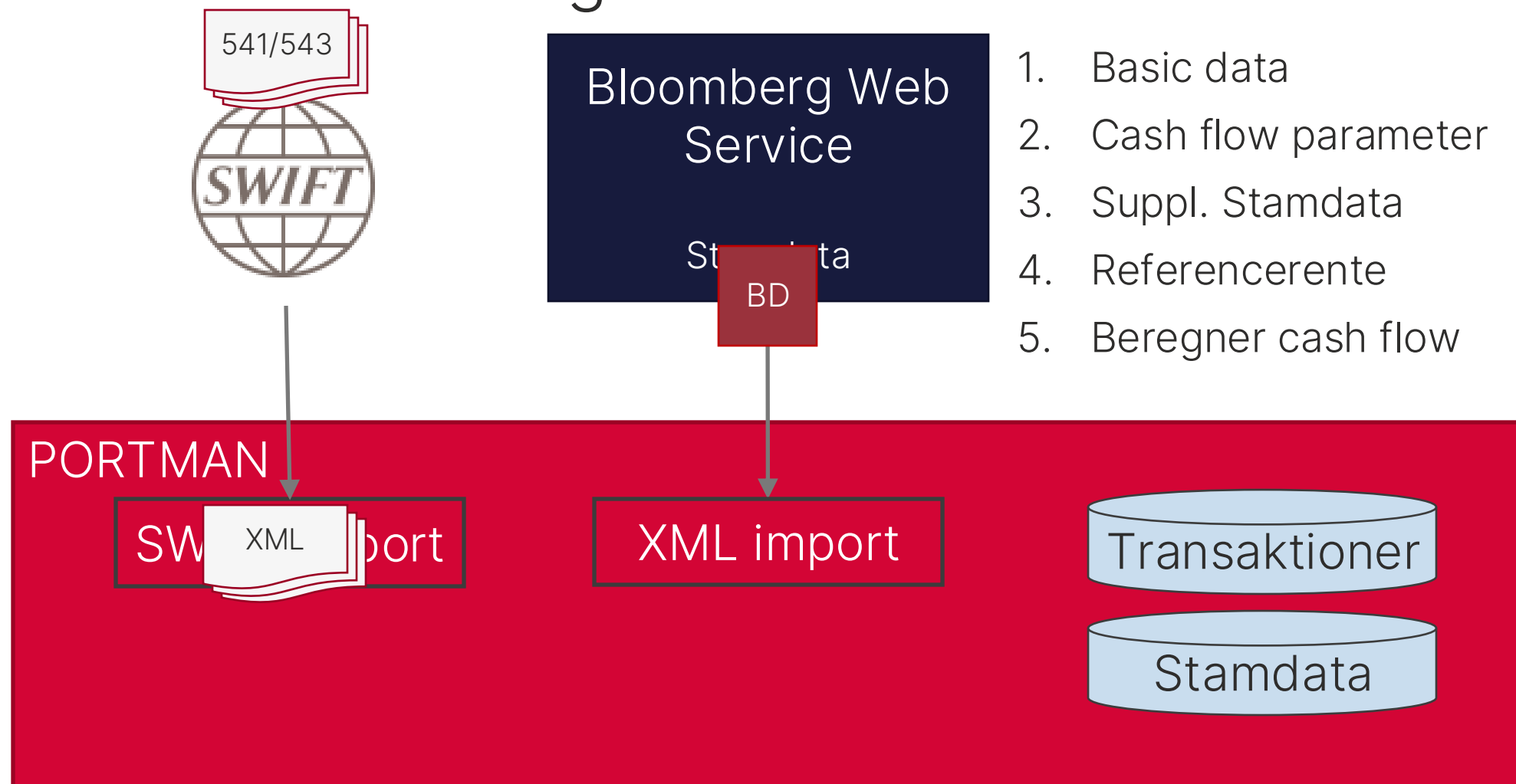
Bloomberg Basic Data

- Initial registrering
- STP på import af handler
- Forbedret indhold af stamdatafelterne

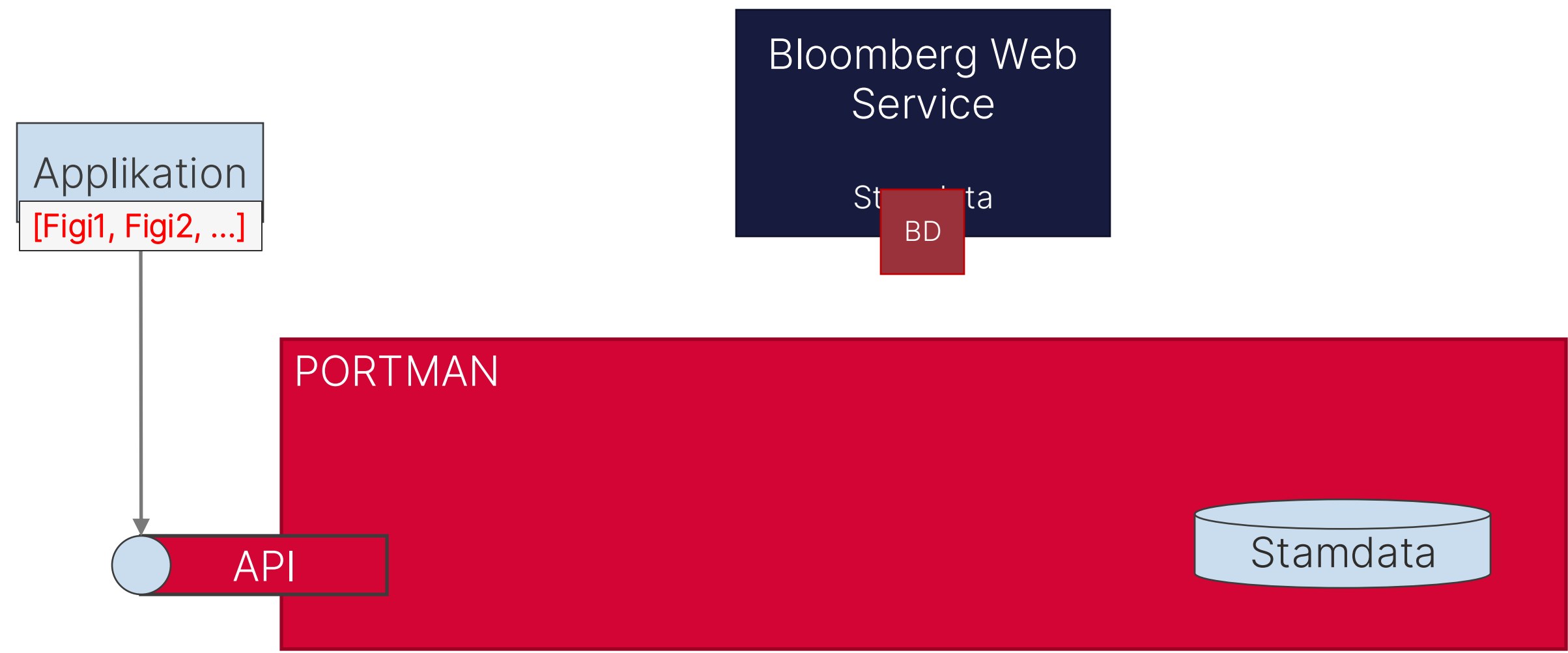
Bloomberg Prices

- Priser og valutakurser
- Spread curve points og markedsrenter

STP handler med Bloomberg stamdata – as is



Bloomberg stamdata – PORTMAN API – as is



Bloomberg – Priser – as is

December: Web

Additional info. (Change)

ID code:

1000144

Jyske Bank

Expanded name:

Provider:

Bloomberg:PX_LAST:BMRK

FIGI code exch. level:

Bloomberg:PX_LAST

Unique security code:

Bloomberg:PX_LAST:BGN

Bloomberg ticker:

Bloomberg:PX_LAST:BLC

Reuter code:

Bloomberg:PX_LAST:BMRK

SEDOL code:

Bloomberg:PX_LAST:BVAL

ISIN code:

Bloomberg:PX_LAST:BVLII

CUSIP code:

Bloomberg:PX_LAST:CMPI

52a-share:

☐ Capital adequacy:

0,00

MIC code:

Number of trades decimals:

Not specified

Omit from fee calc.:

No

Omit from booking:

No

Omit from rebalancing:

No

How key:

None

Groupings

Int. sector groupings I

Int. sector groupings II

LCR-COREP

MIFIR

Tax

Country code:

DK

Denmark

Issuer ID:

Ultimate parent:

Additional asset type:

Report code:

None

```
<importkeyfigures>__Bloom
<programflagstamdata>__Bloo
<programflagprices>__Bloombe
  <batchtime><!--Tidspunkte
    <spreads>__Bloomberg-W
    <spreads1>__Bloomberg-W
    <spreads2>__Bloomberg-W
    <currencyrates>__Bloom
    <currencyrates1>__Bloo
    <currencyrates2>__Bloo
    <prices>__Bloomberg-We
    <prices1>__Bloomberg-W
    <prices2>__Bloomberg-W
  </batchtime>
<keyfigures>__Bloomberg-We
</batchdays>
  <monday> Bloomberg-WebSe
```

Priser

Stamdata

ISIN, CUSIP, SEDOL, BB
Ticker, ...]

Planen fremadrettet

Roadmap og kundeinvolvering

Roadmap

- Igangsætning Q2 2025

Fællesskabsløsning (Standard)

- Stor fællesmængde
- Prioritering er nødvendigt

Kundeinvolvering

- Igangsætning annonceres
- Invitationer til reviews af analyser og udvikling

Adm. til Bloomberg – Ønsker

Nogle af de væsentligste

Opdatering af stamdata

- Validt grundlag for ledelsesrapportering
- Ejerandel, risikovurdering, osv.

Kontrol

- Fravalg af dyre data

Ad – hoc priser og stamdata

- Ekstraordinære hændelser
- Kontrol af data

Adm. til Bloomberg integration – Overview

Data Providers

Overview Administration Actions ...

- Position overview
- Instrument
- Client administration
- Data Providers

- Priser med timestamp
- Stamdata med timestamp
 - Nye/opdateret, hvilke felter er opdateret, før/efter, historik
 - Advarsel ved ny af aktie eller obligation der er default
- Tilstandslog
 - Advarsler, fejl og årsager
 - Bloomberg fejlmeddelelser, N.S., N.A., osv.
- Fejlretning
 - Manuel registrering af referencerente, o.a.

Adm. til Bloomberg integration – Administration

Stamdata – Opdateringer

The screenshot shows a web application interface with a dark blue header and a red sidebar. The header has a tab labeled "Data Providers" and a navigation bar with "Overview", "Administration" (highlighted), "Actions", and "...". The sidebar contains four icons: "Position overview" (a 3x3 grid), "Instrument" (a diamond with a downward arrow), "Client administration" (a person icon), and "Data Providers" (a circular arrow icon). The main content area is dark blue and contains a list of bullet points.

Data Providers

Overview Administration Actions ...

- Hvilke felter
 - Sektor, **Rating**, udstedt mængde, reference renter, **SEDOL**, o.a.
- Hvornår
 - Datoer og frekvens: Ugentligt, månedligt og kvartalsvist
- Instrumenter
 - Alle, asset class, instrument

Adm. til Bloomberg integration – Administration

Priser – Type og kilde

Data Providers

Overview Administration Actions ...

- Position overview
- Instrument
- Client administration
- Data Providers

- Default på Asset class niveau
 - Land, branche, valutakode
 - Specifik på instrument niveau
- Kunne oprette nye typer og kilder fra GUI
 - Typer: PX_LAST, PX_YEST
 - Kilder: BGN, BVAL, NY3PM
 - I princippet uafhængigt, men bør regelstyres
- Flere (Type, Kilde) <-> Prissæt

Adm. til Bloomberg integration – Administration

Priser – Tidspunkter

Data Providers

OverviewAdministrationActions...


Position overview


Instrument


Client administration


Data Providers

- Tidspunkter
 - Ugedage, klokkeslæt (flere gange om dagen)
- Forskellige typer på forskellige tidspunkter
 - PX_LAST om aftenen og PX_YEST næste morgen
- Embarco regler
 - 3 timer på NYSE lukkekurser
 - 24 timer på EURIBOR og NIBOR

Adm. til Bloomberg integration – Administration

Priser – Positioner og instrumenter

The screenshot shows a web application interface with a dark blue header and a sidebar. The header has a tab labeled "Data Providers" which is highlighted. Below the header, there are tabs for "Overview", "Administration" (which is selected and highlighted in red), "Actions", and "...". The sidebar on the left contains four icons with labels: "Position overview" (a 3x3 grid of circles), "Instrument" (a diamond shape with a circle inside), "Client administration" (a person icon), and "Data Providers" (a circular arrow icon). The main content area is dark blue and contains a list of four bullet points.

Data Providers

Overview Administration Actions ...

- Ikke hente priser på 0 positioner
- Aktivering/deaktivering af prisindsamling for futures
- Nulkuponer
- Automatisk opdatering af priskorrekationer

Adm. til Bloomberg integration – Actions

Data Providers

Overview

Administration

Actions

...



Position overview



Instrument



Client administration



Data Providers

- Nyt interface til manuel stamdata indsamling (og opdatering)
- Ad-hoc indsamling af priser
- Test af instrumentstamdata
 - Sammenlign med eksisterende stamdata uden registrering

Adm. til Bloomberg – opsamling

Brugeroplevelse, kvalitet og fleksibilitet

Adm. til Bloomberg

Overblik og administration

- Overblik over dagens dataindsamling
- Konfigurere hvad og hvornår
- Manuel indgriben

Stamdata

- Opdateringer
- Øget kvalitet

Priser

- Tidspunkter – øget fleksibilitet
- Instrumentklasser
- Ad – hoc indgriben