

Formules de calcul Transaction

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
CalculerDateDernierCouponTransaction	dateTransaction, valMobId	Détermine la dernière date de coupon avant la transaction en fonction de valMob.DateJouissance , des échéances valMob.ValMobEcheances.DateEcheanceModifiée et de valMob.DateEcheanceRadiation . Si la date de transaction dépasse la radiation ou qu'aucune échéance valide n'existe, retourne null ou la date de jouissance selon le cas.	N/A
CalculerDateEcheanceTransaction	valMobId	Retourne la date d'échéance de radiation (valMob.DateEcheanceRadiation) d'un instrument financier. Null si l'instrument n'existe pas.	N/A
CalculerMntCouponcouruAchatTransaction	qte, nbreJourTotalAnne, nominal, formuleCalcul, formIntDenom0, tauxInteret, dateDenouementTheorique, dateDernierCoupon, nbDecimales	Calcule le montant des intérêts courus pour un achat (coupon couru). Retourne null si la date de dénouement est avant le dernier coupon.	$\text{mntCouponcouruAchat} = \text{qte} \times \text{InteretsCourusTotal}(\dots)$
CalculermntInteretsIntercairesBrutTransaction	qte, nbreJourTotalAnne, nominal, formuleCalcul, formIntDenom0, tauxInteret, dateDenouementTheorique, dateDernierCoupon, nbDecimales	Calcule le montant brut des intérêts intercalaires. Retourne null si la date de dénouement est après le dernier coupon.	$\text{mntInteretsIntercalairesBrut} = \text{qte} \times \text{InteretsCourusTotal}(\dots)$
CalculermntInteretsIntercairesTransaction	qte, nbreJourTotalAnne, nominal, formuleCalcul, formIntDenom0, tauxInteret, dateDenouementTheorique, dateDernierCoupon, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule le montant net des intérêts intercalaires après retenue à la source.	$\text{mntInteretsIntercalaires} = \text{mntInteretsIntercalairesBrut} \times (1 - \text{retenueALaSource})$

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
CalculerMntPiedCouponTransaction	txPiedCoupon, nominal, qte	Calcule le montant du pied de coupon.	$\text{mntPiedCoupon} = (\text{txPiedCoupon} / 100) \times \text{nominal} \times \text{qte}$
CalculerTauxCouponcouruAchatTransaction	nbreTotalJourAnne, nominal, formuleCalcul, formIntDenom0, tauxInteret, dateDenouementTheorique, dateDernierCoupon, nbDecimales	Calcule le taux du coupon couru pour un achat. Retourne le montant des intérêts divisé par le nominal.	$\text{tauxCoupon} = \text{Interets}(\dots) / \text{nominal}$
CalculerMntCouponCouruTransaction	nbreJourTotalAnne, formuleCalcul, formIntDenom0, txPiedCoupon, nbDecimales, tauxInteretTransaction, dateDernierCoupon, dateDenouementTheorique, nominal, nbre	Calcule le montant total du coupon couru pour la transaction : somme du coupon couru et du pied de coupon.	$\text{mntTotalCoupon} = \text{mntCouponcouruAchat} + \text{mntPiedCoupon}$
CalculerTauxInteretTransaction	dateTransaction, valMobId	Retourne le taux d'intérêt applicable à la transaction en fonction de valMob.TauxInteret ou de l'indice (valMob.Indice) si défini.	N/A
CalculerDateDénouementThéorique	dateTransaction, typeOpeld	Détermine la date théorique de dénouement en fonction du typeOpe.DelaiDenouement , en excluant les jours non ouvrés et jours fériés.	$\text{dateDénouement} = \text{dateTransaction} + \text{delaiValide}$
CalculerNbreJourCouruTransaction	dateDernierCoupon, dateDenouementTheorique	Calcule le nombre de jours courus entre le dernier coupon et la date de dénouement théorique.	$\text{nbreJourCouru} = \text{dateDenouementTheorique} - \text{dateDernierCoupon}$
GetNominalTransaction	valMob	Retourne le nominal (valMob.Nominal) d'un instrument financier. Null si l'instrument n'existe pas.	N/A

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
GetNbDecimalesTransaction	clientCompte	Retourne le nombre de décimales associé à la devise du compte (Devise.NbDecimales).	N/A
GetDateTransaction	clientCompte	Retourne la date de transaction (ClientCompte.JourneeEnCours) pour un compte donné.	N/A
GetDeviseTransaction	clientCompte	Retourne l'ID de la devise associée au compte (ClientCompte.Devise).	N/A
GetContrepartieTransaction	clientCompte	Retourne l'ID de la contrepartie associée au compte (ClientCompte.Contrepartie).	N/A
GetCurrencyDeviseTransaction	clientCompte	Retourne le symbole de la devise du compte (Devise.Symbole).	N/A
GetDepositaireTransaction	clientCompte	Retourne l'ID du dépositaire par défaut pour le compte (ClientCompte.DepositaireParDefaut).	N/A
GetRetenueALaSourceTransaction	valMob	Retourne le taux de retenue à la source d'un instrument financier (valMob.RetenueALaSource).	N/A
GetNbTotalJourAnneeTransaction	valMobId, dateDenouementTheorique	Retourne le nombre de jours par an utilisé pour le calcul des intérêts (valMob.BaseCalculNavigation.NbreJourAn ou par défaut via les échéances).	N/A
GetFormuleCalculTransaction	valMob	Retourne la formule de calcul des intérêts pour l'instrument financier (valMob.FormuleCalcul).	N/A

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
GetFormIntDenom0Transaction	valMob	Retourne la valeur du dénominateur utilisé dans la formule d'intérêts (valMob.FormIntDenom0).	N/A
GetPrixUnitaire	valMob, compte	Retourne le prix unitaire applicable : soit le nominal, soit selon la méthode de valorisation du compte (Cours.CMP ou Cours.Cloture).	N/A
CalculMntBrutTransaction	prixUnitaire, nbre	Calcule le montant brut d'une transaction : prix unitaire × quantité.	$\text{mntBrut} = \text{prixUnitaire} \times \text{nbre}$
GetSensTransaction	typeOpe	Retourne le sens de la transaction associé au type d'opération (TypeOpe.SensTransaction).	N/A
CalculerMntPrixRevientTransaction	transactionsDossiers, clientCompte, valmob, dateTransaction, deviseld, prixUnitaire, qte, sensTransaction	Calcule le prix de revient d'une transaction. Si des transactions précédentes existent, fait la moyenne pondérée.	$\text{prixRevient} = \text{qte} * (\sum(\text{transactionsDossiers.TransctAchat.PrixUnitaire} * \text{transactionsDossiers.Nbre}) / \sum(\text{transactionsDossiers.Nbre}))$ OU $\text{prixRevient} = \text{prixUnitaire} * \text{qte}$
CalculerListFraisTransaction	typeOpe, contrepartie, clientCompte, dateTransaction	Retourne la liste des frais applicables à une transaction selon le type d'opération, le type de client et la date.	N/A
CalculMontantFraisTransaction	typeOpeContrepartie, transactions	Calcule le montant des frais pour une transaction selon le type de frais, l'assiette et les tranches éventuelles.	mntFrais calculé à partir de $\text{transactions.Nbre} * \text{transactions.PrixUnitaire}$ et coefficients
CalculerListTransactionEcheance	qte, typeOpe, valmob, dateTransaction	Génère la liste des échéances (intérêts et capital) pour une transaction, selon les échéances modifiées de Valeur Mobilière.	$\text{mntEcheance} = \text{qte} * \text{MntInteretsNet_Modifie}$ ou $\text{mntBrut} = \text{qte} * \text{MntInteretsBruts}$

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
CalculerListTransactionsDossiers	clientCompte, valMob, dateTransaction, sensTransaction	Retourne la liste des transactions dossiers disponibles pour un achat ou une vente selon le sens de la transaction.	N/A
GetListTransactionsDossiersByTransactionsAchat	clientCompte, valmob, dateTransaction	Appel SQL pour récupérer les transactions dossiers disponibles pour un achat selon le compte, instrument et date.	N/A
CalculerMntIntEchusTransaction	transactionsDossiers, nbDecimales	Calcule le montant total des intérêts échus pour une collection de dossiers de transactions.	$\text{mntIntEchus} = \sum(\text{transactionsDossiers.MntInteretsCourusDetention})$
CalculerMntPMVPostTransaction	transactionsDossiers, nbDecimales	Calcule le montant total des plus ou moins-values après transaction.	$\text{mntplusOuMoinsVal} = \sum(\text{transactionsDossiers.MntplusOuMoinsVal})$
CalculMntFraisTransaction	transactionFrais, nbDecimales	Calcule le montant total des frais associés aux transactions.	$\text{mntFrais} = \sum(\text{transactionFrais.Montant})$
CalculerMntInteretsCourusDetentionTransaction	transactionsDossiers, nbDecimales	Calcule le montant total des intérêts courus en détention pour une collection de dossiers de transactions.	$\text{mntIntEchus} = \sum(\text{transactionsDossiers.MntInteretCouruNet})$
CalculerMontantRSTransaction	transactionsDossiers, nbDecimales	Calcule le montant total de la retenue à la source (RS) sur les intérêts en détention.	$\text{mntIntEchus} = \sum(\text{transactionsDossiers.MntRSIntDetention})$
CalculerSurcoteDecoteVenteTransaction	transactionsDossiers, dateVente, capitalRes, nbDecimales	Calcule le montant de surcote ou décote à la vente pour une collection de dossiers de transactions.	$\text{mntSurcoteDecote} = \sum [((\text{capital} - \text{capital} * \text{TxPiedCoupon}) * \text{NbreAchat} / \text{NbreJourTotal}) * \text{JoursDetention} * (\text{NbreVente} / \text{NbreAchat})]$

Calcul de Dossier de Vente:

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
CalculTransactionsDossiersMntCouponCouruAchat	transactionAchat, qte, dateDernierCoupon, nbDecimales	Calcule le montant du coupon couru à l'achat pour une transaction spécifique.	$\text{MntCouponCouru} = \text{MntCouponCouruAchat} * \text{qte} / \text{Nbre}$
CalculTransactionsDossiersMntRSIntAchete	transactionAchat, qte, dateDernierCoupon, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule la retenue à la source sur les intérêts achetés.	$\text{MntRSIntAchete} = \text{MntCouponCouruAchat} * \text{qte} * \text{retenueALaSource} / \text{Nbre}$

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul
CalculTransactionsDossiersMntIntAcheteNet	transactionAchat, qte, dateDernierCoupon, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule le montant net des intérêts achetés après retenue à la source.	$\text{MntIntAcheteNet} = \frac{\text{MntCouponCouruAchat} * \text{qte} * (1 - \text{retenueALaSource})}{\text{Nbre}}$
CalculTransactionsDossiersNbreJoursCourus	transactionAchat, qte, dateDernierCoupon, dateVente	Calcule le nombre de jours de détention entre la date d'achat et la date de vente ou le dernier coupon.	$\text{NbreJoursCourus} = (\text{dateVente} - \max(\text{dateDernierCoupon}, \text{DateDenouement}))$
CalculTransactionsDossiersMntInteretsCourusDetention	nbreJourTotalAnne, formuleCalcul, formIntDenom0, transactionAchat, qte, capitalRes, tauxInteret, dateDernierCoupon, dateVente, nbDecimales	Calcule les intérêts courus en détention pour une transaction.	$\text{MntInteretsCourusDetention} = \text{InteretsCourusTotal}(\dots)$ (via GeneralCalculator)
CalculTransactionsDossiersMntRSIntDetention	nbreJourTotalAnne, formuleCalcul, formIntDenom0, transactionAchat, qte, capitalRes, tauxInteret, dateDernierCoupon, dateVente, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule la retenue à la source sur les intérêts courus en détention.	$\text{MntRSIntDetention} = \text{MntInteretsCourusDetention} * \text{retenueALaSource}$
CalculTransactionsDossiersMntInteretCouruNet	nbreJourTotalAnne, formuleCalcul, formIntDenom0, transactionAchat, qte, capitalRes, tauxInteret, dateDernierCoupon, dateVente, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule le montant net des intérêts courus en détention après retenue à la source.	$\text{MntInteretCouruNet} = \text{MntInteretsCourusDetention} * (1 - \text{retenueALaSource})$
CalculTransactionsDossiersMntCouponCouruVendu	nbreJourTotalAnne, formuleCalcul, formIntDenom0, transactionAchat, qte, capitalRes, tauxInteret, dateDernierCoupon, dateVente, nbDecimales, retenueALaSource	Calcule le montant total du coupon couru lors de la vente, incluant le net d'intérêts.	$\text{MntCouponCouruVendu} = \text{MntCouponCouruAchat} + \text{MntInteretCouruNet}$
CalculTransactionsDossiersMntPlusOuMoinsVal	transactionAchat, qte, capitalRes, tauxVente, nbDecimales	Calcule la plus ou moins-value réalisée pour la transaction.	$\text{MntPlusOuMoinsVal} = \text{qte} * (\text{tauxVente} - \text{TxPiedCoupon}) * \text{capitalRes}$

Calcul de plus ou moins value et stock:

Nom de la méthode	Paramètres principaux	Résumé / Fonction	Formule / Calcul / Remarques

Calculer CmpApr esTrans action	clientCompte, valmob, dateTransactio n, devise, qte, prix, typeOpe, nbDecimales	<p>Calcule le coût moyen pondéré (CMP) et le stock après une transaction, pour un client ou un compte spécifique. Le calcul se fait à l'aide des procédures stockées</p> <pre>GenerateCmpByClientCompteAndValmob_PS (pour le compte) et GenerateCmpByClientAndValmob_PS (pour le client).</pre>	<p>Le calcul du CMP se fait à partir des dernières valeurs de stock et CMP récupérées via les procédures stockées :</p> <pre>transactionPrecCompte = GenerateCmpByClientCompteAndValmob_PS(...) transactionPrecClt = GenerateCmpByClientAndValmob_PS(...)</pre> <p>Achat (SensTransaction=1) :</p> <pre>StockAprès += qte, CmpAprès += qte*prix</pre> <p>Vente (SensTransaction=-1) :</p> <pre>MntPMV = qte*prix - CMP/qte, StockAprès -= qte, CmpAprès -= CMP/qte</pre> <p>Autre (SensTransaction=0) :</p> <pre>CmpAprès += qte * SensPrixRevientClient * prix</pre>
---	--	---	--

Revision #9

Created 2025-12-26 13:57:25 UTC by Admin

Updated 2025-12-26 15:31:40 UTC