

# Développement d'une application de suivi des historiques des fortunes des fonds de placement Lombard Odier Darier Hentsch & Cie

## Contexte

Banquiers privés depuis 1796, LODH se distingue de part un excellent savoir-faire en matière de gestion des fonds de placements.

Cette gestion de qualité nécessite des spécialistes ainsi que l'utilisation d'outils et méthodes de travail rigoureuses et efficaces.

## Problématique

L'une des méthodes de gestion des fonds se base sur une analyse statistique de l'évolution des fortunes des fonds.

Pour trouver une fortune de fonds il est nécessaire de procéder à un regroupement des compartiments sous-jacents à ce fonds et de calculer la fortune totale.

Cette manipulation est effectuée manuellement et présente des risques d'erreurs à savoir mauvaise saisie, ou encore, calculs erronés.

## Solution

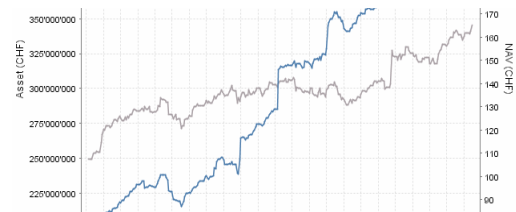
Il est évident qu'une solution informatique peut répondre à cette problématique.

A cet égard, il a été développé une application orientée web qui permet, sur la base d'une sélection de fonds, d'afficher :

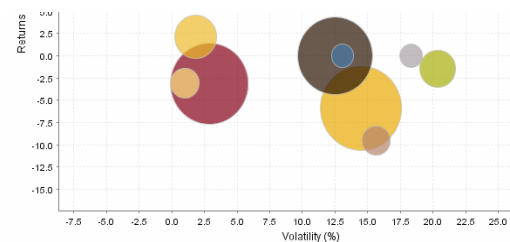
- 1) Un tableau synoptique des valeurs quantitatives des fonds.

Date	Total Asset (CHF)	Net Asset Value (CHF)	Performance YTD (%)
30.08.2005	558,521,045.79	264.73	20.8
31.08.2005	560,844,857.25	265.89	21.4
01.09.2005	563,297,806.24	267.08	21.9
02.09.2005	564,078,875.12	267.45	22.1
03.09.2005	564,078,875.12	267.45	22.1
04.09.2005	564,078,875.12	267.45	22.1
05.09.2005	565,559,099.62	267.20	22.0
06.09.2005	567,961,977.71	269.64	23.1
07.09.2005	567,961,977.71	269.64	23.1
08.09.2005	573,866,267.64	272.36	24.3
09.09.2005	576,693,569.02	273.68	24.9
10.09.2005	576,693,569.02	273.68	24.9
11.09.2005	576,693,569.02	273.68	24.9
12.09.2005	579,724,972.24	275.86	25.9
13.09.2005	579,829,794.94	274.60	25.3
14.09.2005	572,488,163.77	275.24	25.6
15.09.2005	572,694,223.75	275.37	25.7
16.09.2005	573,829,794.94	275.98	26.0
17.09.2005	573,829,794.94	275.98	26.0

- 2) Une représentation graphique de l'évolution des fortunes et des cours des fonds.



- 3) Un graphique à bulles qui affiche le Risk-Return Profile et qui positionne les fonds par rapport à leur risque d'investissement, leur rendement et leur fortune.



## Environnement & Technologies

Cette application a été développée sur la base de la plateforme Java 2 Entreprise Edition. Celle-ci met à disposition une infrastructure idéale pour le déploiement d'applications web.

La partie interface utilisateur utilise les technologies des servlets et des JSP qui permettent la création dynamique de page web.

L'application est mise à disposition au travers du portail Intranet de LODH selon la spécification JSR168.

Afin d'intégrer la notion d'industrialisation du processus de développement de LODH il a été nécessaire d'utiliser divers outils. Ceux-ci permettent, entre autres, le travail en équipe, le contrôle continu, la gestion des versions et l'archivage.

**Auteur:** Romagnoli Vincent  
**Répondant externe:** Biffiger Emmanuel  
**Prof. responsable:** Seydoux Jean-Marc  
**Sujet proposé par:** Lombard Odier Darier Hentsch & Cie