



NOTE INTERNE

DETAIL DES DONNEES UTILISEES DANS LE CASE EDR/ALBERT SCHOOL

DATE	14/02/2024
DESTINATAIRE	Edouard NEUVILLE (ALBERT SCHOOL)
COPIE	
EMETTEUR	Eric LASCENSION
OBJET	Définition des points de données à utiliser dans l'étude du cas EDR / ALBERT SCHOOL

Fichier Passif – Détention des fonds analysés à fréquence mensuelle dans l'onglet Feuil1, l'onglet GlobalAM est inutile dans le cas

- Owner : inutile, commercial en charge
- Business Relation(BR) : entité client
- Fund : SICAV ou FCP concerné
- Share / ISIN : part concernée
- Date de la position
- AUM : actifs totaux détenus
- Quantity : nombre de parts détenues
- Net inflows MTD / YTD : volume acquis/vendus depuis le premier jour du mois (Month To Date) – depuis le 01/01 (Year To Date)
- BR segmentation : segmentation client
- Business Country : pays de la BR
- Asset class : catégorie du fonds détenu

Bench Lignes – Composition du benchmark de chacun des fonds à fréquence mensuelle

- Security ISIN / Security Name : titre composant le benchmark
- Percentage Dirty Value : poids du titre dans le benchmark au jour de la composition



Caractéristiques Parts - Données statiques de chaque part

- Les noms paraissent clairs
- Portefeuille Hedgé ? : la part est-elle couverte si elle est dans une devise différente de celle du fonds
- Nom du benchmark explicite

Fixing

- Cours quotidien sur la période EUR contre devises majeures utiles pour le cas (USD, CHF, GBP)

Frais

- Frais quotidiens pris payés par chacun des fonds du cas

Taux

- Historique du taux USD à 10 ans

Perf Bench – performance quotidienne du benchmark

- Analysis date : date de la performance
- TWR_NET_CUMULATED : performance cumulée sur la période
- Rendement à pas calendaire (ceux à utiliser, inutile de compliquer avec le rolling qui doit être très proche avec peu d'intérêt supplémentaire pour les étudiants), qui permet de reconstituer la performance du benchmark (et du fonds identiquement)
 - o TWR_1DC : rendement 1 jour
 - o TWR_1WC : rendement 1 semaine
 - o TWR_1MC : rendement 1 mois
 - o TWR_3MC : rendement 3 mois
 - o TWR_6MC : rendement 6 mois
 - o TWR_YTD : rendement YTD
 - o Ensuite 1 an, 3 ans, 5 ans, 10 ans (si assez d'historique)

Idem pour Perf Fonds – performance quotidienne de la part**Fichiers Positions**

- Détaille les actifs détenus dans chacun des fonds du cas à fréquence quotidienne
 - BALANCE_NOMINAL_OR_NUMBER : nombre/volume détenu du titre concerné
 - DIRTY_PRICE : cours du titre
 - DIRTY_VALUE_TOTAL_PC : taille de la position en devise de portefeuille
 - DIRTY_VALUE_TOTAL_QC : taille de la position en devise de cotation (titre en devise)
 - DWH_EXPO_QC : Exposition en devise de cotation (à utiliser pour les produits dérivés plutôt que le Dirty Price)