

Novembre 25th 2021

o LCF \rightarrow cash management PROD 15/12/2021

o Pas de dér \Rightarrow paramétrisation

* Amundi: hedge par le dépositaire

* Cypa : ? qui fait

* TOT: NO

Planac: S/R sur la dette

↳ génération auto achat BIP

automatisation \rightarrow outil très
 \rightarrow NO \Rightarrow BNM

* Planac: TA = Trading Advisor

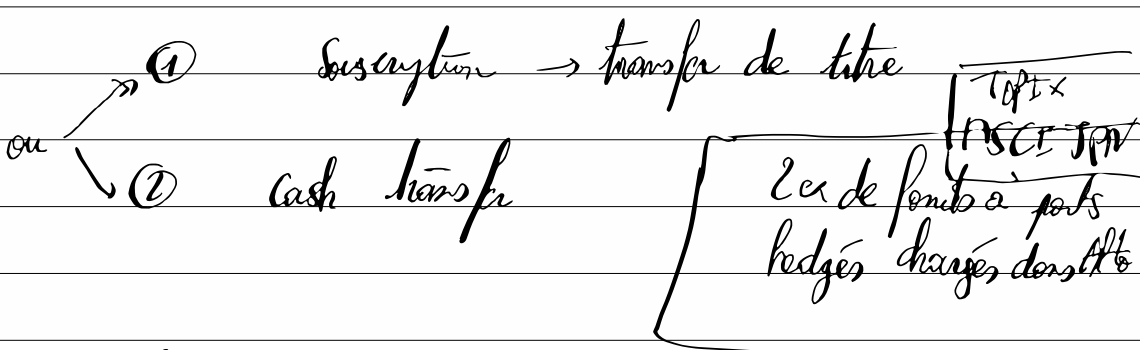
Novembre 26th 2021

Lyxor TOPIXUSCA
US Tre 7-10
Core global gov

Part hedges

Master feeder ERM
↳ #6

Feeder → Master



Der font par la gestion ⇒ uniquement dette

Deck

1 ? Eurostoxx
fin de journée

* Batch matin

↳ Epoque données figée le matin

Hedge FI :

lier grec à un
indie

→ caractéristique de
l'indie

Novembre 30th

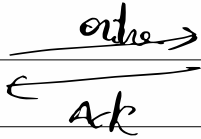
ETF 4

① Market AP



②

LAX



GSB



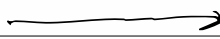
③

Alt to GSR



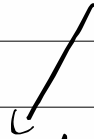
④

Alt to APK



Deck

Alt to PA

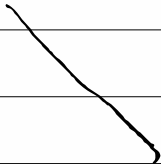


greek

MS



swap de change



Alt to IT



Basket

Alt to PA

x Algo trading operation

x part

□ montant

x technical effects

⇒ compte à compte | comptable
| pas auto

< Swap technique:

↳ pas d'impact marché: transfert de poche à poche

⇒ intervention F20, à repousser

↳ ETA: fin janvier

Décembre 3

