

NEWSLETTER

Reporting Excel

ePOCA®		Mandant Monnaie de référence CHF Au 31.12.2012									
Comparaison de la performance											
Catégorie d'investissement	Portfolio	Benchmark	Performance						Investissement		
			Demier mois		Demier trimestre		YTD		Effectif	Stratégie	
			Portfolio	Benchmark	Portfolio	Benchmark	Portfolio	Benchmark	Mio CHF	%	%
Liquidités		BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.07	-0.01	-0.32	-0.04	0.22	-0.05	22 088 572.67	13.21	5.00
	Portfolio 1	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.02	-0.01	-0.07	-0.04	0.37	-0.05	3 460 140.12	2.07	5.00
	Portfolio 2	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.07	-0.01	0.06	-0.04	0.37	-0.05	9 413 933.81	5.63	5.00
	Portfolio 3	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.20	-0.01	-0.58	-0.04	1.28	-0.05	4 103 592.62	2.45	5.00
	Portfolio 4	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	-0.07	-0.01	-0.62	-0.04	-0.07	-0.05	3 930 970.22	2.35	5.00
	Portfolio 5	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.22	-0.01	-0.62	-0.04	0.03	-0.05	1 155 152.24	0.69	5.00
	Portfolio 6	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	-1.12	-0.01	8.02	-0.04	50.05	-0.05	24 783.64	0.01	5.00
Obligations CHF		BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (5	0.11	-0.10	0.48	0.39	3.83	4.21	49 346 055.97	29.52	32.00
	Portfolio 1	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.13	-0.10	0.47	0.39	4.54	4.21	13 207 476.55	7.90	32.00
	Portfolio 2	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.20	-0.10	0.69	0.39	5.45	4.21	11 819 164.22	7.07	32.00
	Portfolio 3	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.04	-0.10	0.32	0.39	2.49	4.21	10 853 245.53	6.49	32.00
	Portfolio 4	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.12	-0.10	0.31	0.39	2.78	4.21	4 674 589.48	2.80	32.00
	Portfolio 5	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.11	-0.10	0.61	0.39	7.37	4.21	5 860 670.35	3.51	32.00
	Portfolio 7	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
Obligations ME		BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
	Portfolio 1	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
	Portfolio 2	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
	Portfolio 3	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
	Portfolio 4	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
	Portfolio 5	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (
Actions suisses		BM AKTIEN SCHWEIZ (
	Portfolio 1	BM AKTIEN SCHWEIZ (
	Portfolio 2	BM AKTIEN SCHWEIZ (
	Portfolio 3	BM AKTIEN SCHWEIZ (
	Portfolio 4	BM AKTIEN SCHWEIZ (
	Portfolio 5	BM AKTIEN SCHWEIZ (
Actions étrangères		BMc AKTIEN AUSSER SCHWEIZ (
	Portfolio 1	BMc AKTIEN AUSSER SCHWEIZ (
	Portfolio 2	BMc AKTIEN AUSSER SCHWEIZ (
	Portfolio 4	BMc AKTIEN AUSSER SCHWEIZ (
	Portfolio 5	BMc AKTIEN AUSSER SCHWEIZ (
Immobilier suisse		BMc IMMOBILIER SUISSE (
	Portfolio 1	BMc IMMOBILIER SUISSE (
	Portfolio 2	BMc IMMOBILIER SUISSE (

ePOCA®		Mandant Monnaie de référence CHF Au 31.12.2012									
Attribution de performance											
Anlagekategorie	Investissement		Performance			Portfolio Contribut.	Benchmark Contribut.	Excess Return	Attribution		
	effectif	stratégie	effectif	Benchmark	MWR				Allocation	Selection	Interaction
Liquidités	14.02	5.00	0.22	-0.05	0.35	0.04	0.00	0.05	0.00	0.01	0.04
Obligations CHF	28.98	32.00	3.83	4.21	3.76	1.11	1.36	-0.26	-0.14	-0.12	0.01
Obligations ME	4.43	3.00	3.98	-1.11	3.97	0.17	-0.02	0.19	0.01	0.14	0.04
Actions suisses	12.73	13.00	18.10	17.72	18.21	2.19	2.22	-0.03	-0.07	0.05	0.00
Actions étrangères	11.12	15.00	11.65	13.37	11.56	1.25	1.99	-0.74	-0.56	-0.18	0.01
Immobilier suisse	11.41	12.00	6.72	4.00	6.75	0.76	0.48	0.29	-0.02	0.33	-0.02
Immobilier étranger	3.03	5.00	5.99	4.43	5.67	0.17	0.22	-0.05	-0.09	0.08	-0.04
Placements alternatifs	10.23	15.00	0.02	1.18	-1.68	-0.12	0.24	-0.38	-0.27	-0.16	0.05
Protection du capital	4.04	0.00	1.45	0.00	1.64	0.07	0.00	0.07	0.00	0.00	0.07
Changés à terme	13.80	10.00	1.08	1.07	1.10	0.11	0.12	-0.01	0.02	0.00	-0.03
Total	100.00	100.00	5.76	6.62	5.74	5.75	6.62	-0.86	-1.14	0.16	0.13



Depuis quelques années ePOCA dispose d'un reporting « MS Office » permettant de générer des rapports financiers ou des rapports d'investissement dans MS Word. Vous trouverez des exemples de tels rapports sur notre site internet. Cette fonctionnalité d'ePOCA connaît un franc succès car elle permet de réaliser des rapports de qualité sans effort supplémentaire.

Technologie

Le principe de fonctionnement de ces rapports est très simple : ePOCA exporte les données nécessaires pour un rapport sans se préoccuper de son formatage, celui-ci étant défini dans un rapport-modèle qui est un document MS Word normal. Ainsi les rapports-modèles peuvent être créés dans MS Word, sans devoir acquérir les connaissances spéciales d'un outil de reporting.

Il n'est toutefois pas nécessaire de produire soi-même des rapports-modèles : ePOCA dispose de plus d'une centaine de ces rapports-modèles qui représentent la demande de la plupart de nos clients. Il est cependant possible de développer des rapports individualisés tenant compte de l'image corporative de l'entreprise. Certains de nos clients, essentiellement prestataires de service, ont profité de cette possibilité et offrent à leurs clients des rapports individualisés, aussi bien du point de vue du contenu que celui de l'apparence.

Nous avons maintenant développé une technologie similaire pour la création de rapports dans MS Excel. Dans ce cas également les données nécessaires sont fournies par ePOCA et le formatage est donné dans un rapport-modèle MS Excel. Deux exemples de ces rapports sont montrés ci-haut soit l'« attribution de performance » et la « comparaison de la performance » :

-  Le rapport d'attribution de performance comporte les valeurs classiques de ce type de rapport : performance (TWR) de l'investissement et du benchmark, contribution à la performance et performance relative (« excess return »), qui est divisée en ses composantes d'allocation, de sélection et d'interaction. Une colonne renseignant la performance MWR de l'investissement a été ajoutée, permettant de mettre en évidence des différences avec la performance TWR résultant d'importants flux de capitaux.
-  Le rapport de comparaison des mandats montre pour chaque classe d'actifs, p.ex. les actions suisses, quelle a été la performance de ce mandat pour le dernier mois, le dernier trimestre et l'année en cours. La performance du benchmark correspondant est également donnée. Ce rapport permet donc de comparer les différents mandats de gestion pour chaque classe d'actifs, fonctionnant également pour des mandats mixtes.

Avantages / désavantages

Quels sont les avantages et les désavantages d'un rapport MS Excel et d'un rapport MS Word

Rapport MS Word		Rapport MS Excel	
-	Limité en largeur par le format de la feuille de papier (en général A4)	+	Non limité en largeur, peut contenir toutes les colonnes désirées.
-	Les nombres sont formatés comme texte	+	Les nombres sont vraiment des nombres
-	Le rapport peut être complété seulement avec du texte.	+	Le rapport peut être complété avec du texte et des formules sur les nombres
+	Le rapport peut contenir tous ses éléments dans un document continu, y compris une page de titre et une table des matières.	-	Le rapport complet consiste en plusieurs fichiers Excel ou un fichier Excel avec plusieurs onglets.
+	Le rapport peut être imprimé directement	-	Le rapport imprimé n'est pas forcément facile à lire (petits caractères ou tableau sur plusieurs pages).

Comme le montre le tableau ci-dessus le reporting avec MS Excel n'est pas un remplacement, mais un complément du reporting avec MS Word. Avons-nous éveillé votre intérêt ? Il nous fera le plus grand plaisir de vous informer plus à ce sujet. N'hésitez pas à nous contacter pour toute question

Votre équipe C&H

ePOCA® - le logiciel professionnel numéro 1 pour la comptabilité des titres et le rapport d'investissement, directement dérivé des données comptables. Pour davantage d'informations concernant ePOCA veuillez consulter notre site internet: www.chsoft.ch



Freudenbergstrasse 142

epoca@chsoft.ch

8044 Zürich

+41 44 366 66 66