

CERGY 2017-2018 VALORISATIONS

Numéro/Nom/ Prénom: /..... //.....

Présentez les résultats en Euro avec 2 décimales, et les résultats en % avec 4 décimales.

1- Récupération des Taux	
01-01 Taux Eonia au 30 mars 2017
01-02 Capitalisation du taux Eonia+200bp du premier trimestre 2017
01-03 Capitalisation du taux Euribor3M+200bp du premier trimestre 2017
01-04 Taux de marché la seconde opération du portefeuille au 30 mars 2017

2- Résultat Réalisé	
02-01 Résultat réalisé sur la période

3 - Valorisations et résultat en couru	
3-01 Valorisation du portefeuille au 31 décembre 2016
3-02 Valorisation du portefeuille au 30 mars 2017
3-03 Résultat latent sur le portefeuille sur la période

4 - Valorisations et résultat en cout amorti	
4-01 Valorisation du portefeuille au 31 décembre 2016
4-02 Valorisation du portefeuille au 30 mars 2017
4-03 Résultat latent sur le portefeuille sur la période

5 - Valorisations et résultat en MTM	
5-01 Valorisation du portefeuille au 31 décembre 2016
5-02 Valorisation du portefeuille au 30 mars 2017
5-03 Résultat latent sur le portefeuille sur la période

5 – Trésorerie	
5-01 Calcul du solde initial du aux capitaux à financer au 31 décembre 2016
5-02 Cout de Financement lié au solde initial des capitaux
5-03 Calcul du solde initial en couru
5-04 Calcul du solde initial en cout amorti

5-05 Calcul du solde initial en MTM
5-06 Calcul du cout de financement total avec un solde initial en couru	
5-07 Calcul du cout de financement total avec un solde initial en cout amorti	
5-08 Calcul du cout de financement total avec un solde initial en MTM	

7 - Calcul du résultat complet	
7-01 Calcul du résultat complet en Couru
7-02 Calcul du résultat complet en cout amorti
7-03 Calcul du résultat complet en MTM

8 - Calcul du résultat sur le portefeuille d'ouverture	
8-01 Résultat réalisé
8-02 Valorisation MtM du portefeuille au 31 décembre 2016
8-03 Valorisation MtM du portefeuille au 30 mars 2017
8-04 Résultat latent mtm
8-05 Solde à financer
8-06 Financement global du portefeuille	
8-07 Résultat complet sur les opérations vivantes en début de période	

9 - Risques au 31 décembre 2016	
9-01 Duration du portefeuille d'ouverture au 31/12/2016
9-02 Sensibilité du portefeuille d'ouverture au 31/12/2016
9-03 Convexité du portefeuille d'ouverture au 31/12/2016

10 - Calcul des Risques	
10-01 Simulation de l'effet taux sur le sous-portefeuille à la date du 30 dec 2016
10-02 Simulation d'une hausse de 10bp sur le sous-portefeuille
10-03 Simulation d'une baisse de 10bp sur le sous-portefeuille
10-04 Impact d'une variation théorique de 10bp au premier ordre
10-05 Impact d'une variation théorique de 10bp au second ordre
10-06 Impact d'une variation théorique de 10bp aux ordres 1 et 2
10-07 Variation moyenne des taux sur le trimestre (par rapport variation théorique)

-/-/-

Fin de l'exercice.