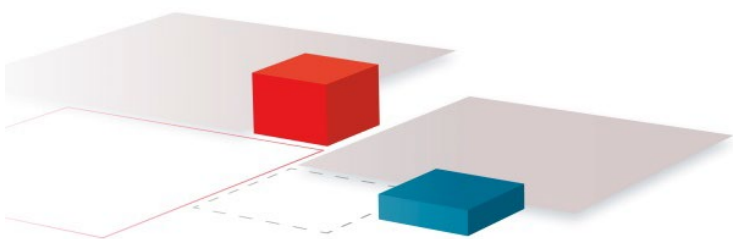


Transparisation des OPC d'actifs cotés de la Caisse des dépôts

Affaire n°20255355

Cahier des clauses techniques particulières (C.C.T.P)



SOMMAIRE

1.	ÉLÉMENTS DE CONTEXTE.....	3
1.1.	LES MISSIONS DE LA CAISSE DES DEPOTS.....	3
1.2.	DIRECTION DES GESTIONS D'ACTIFS (GDA).....	4
1.2.1.	Présentation	4
1.2.2.	Missions et actions de l'entité prescriptrice.....	4
1.2.3.	Organisation	4
2.	CONTEXTE ET OBJECTIFS DE LA PRESTATION	5
2.1.	CONTEXTE PRECIS DE LA PRESTATION	5
2.2.	COMITOLOGIE MISE EN PLACE POUR LE PILOTAGE DE LA PRESTATION	6
2.3.	OBJET DE LA PRESTATION	7
3.	DETAIL DES PRESTATIONS ATTENDUES	8
3.1.	MISSION 1 : BASE DE DONNEES SOUS FORMAT EXCEL® CONSOLIDÉE DÉDIÉE À CHAQUE ÉTABLISSEMENT SOUS FORMAT TPT AMPERE V.6.0 (ET ULTERIEURE)	8
3.1.1.	Définition	8
3.1.2.	Réalisation	8
3.1.3.	Livrables.....	8
3.2.	MISSION 2 : PRODUCTION DE RAPPORTS PRESENTANT DES EXPOSITIONS AGREGÉES	9
3.2.1.	Définition	9
3.2.2.	Réalisation	9
3.2.3.	Livrables.....	10
3.3.	MISSION 3 (PRESTATION SUPPLEMENTAIRE EVENTUELLE FACULTATIVE) : CALCULER LES BESOINS EN FONDS PROPRES LIES AUX OPC	12
3.3.1.	Définition	12
3.3.2.	Réalisation	12
3.3.3.	Livrables.....	12
4.	COMPETENCES REQUISES.....	13
5.	CONDITIONS D'EXECUTION	13
5.1.	LIEU D'EXECUTION DE LA PRESTATION	13
5.2.	DOCUMENTS MIS A DISPOSITION	13

1. ÉLÉMENTS DE CONTEXTE

1.1. Les missions de la Caisse des Dépôts

La Caisse des Dépôts est un établissement financier public qui remplit des missions d'intérêt général en appui des politiques publiques. Une mission confiée par la loi. Gestionnaire de confiance pour le compte de tiers, investisseur et prêteur de long terme, la Caisse des Dépôts facilite la réalisation de projets innovants, durables et solidaires et participe au développement économique du pays.

Avec l'arrivée en 2020 du groupe la Poste au sein du groupe Caisse des Dépôts, celui-ci devient le premier pôle financier public français, l'un des plus importants au monde.

Organisé autour de **5 métiers**, il s'engage au quotidien à réduire les inégalités sociales et territoriales.

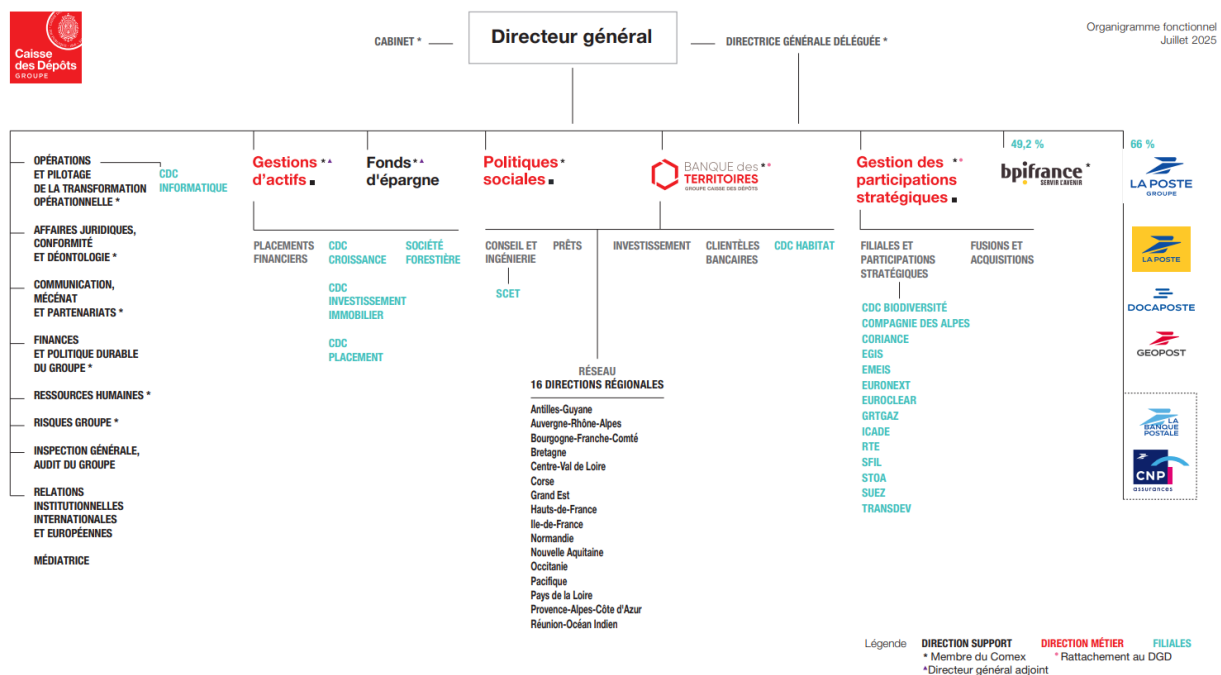
- **Le soutien aux projets des territoires : La Banque des Territoires** conseille, finance, opère tous les projets auprès des collectivités locales, des organismes de logement social, des entreprises publiques locales et des professions juridiques pour des territoires plus durables, inclusifs, attractifs et connectés ;

- **Le financement des entreprises : Bpifrance** accompagne les entreprises avec un continuum de financement (prêts, garanties, prises de participation, conseil et accompagnement) à toutes les étapes de leur développement, en France et à l'international ;

- **Politiques sociales**, métier historique de gestionnaire de mandats publics, la Caisse des Dépôts est un acteur majeur de la cohésion sociale, assurant un rôle dans la qualification professionnelle de 33 millions de Français et contribuant au défi du régime universel des retraites. Elle est aussi en charge du nouveau Compte personnel de formation ;

- **La gestion des actifs** permet à la Caisse des Dépôts de financer et d'accompagner des projets d'intérêt général sur tous les territoires. Le Groupe contribue au financement de l'économie française avec une prise en compte toujours plus forte des critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) ;

- **Gestion des participations stratégiques**, elle accompagne dans la durée le développement de ses filiales dont les résultats financiers soutiennent ses missions d'intérêt général (Transdev, Egis, Icade, Compagnie des Alpes, RTE...).



1.2. Direction des Gestions d'actifs (GDA)

1.2.1. Présentation

La direction des Gestions d'actifs (GDA) exerce un des 5 métiers du groupe CDC et contribue à faire de la CDC le premier gérant d'actifs de statut public. Elle regroupe les gestions d'actifs internes à l'Etablissement public ou portées par des filiales spécialisées. Les placements financiers réalisés par la direction des gestions d'actifs sont distincts des participations stratégiques, des financements de projets réalisés dans les territoires par la Banque des Territoires et des financements d'entreprises opérés par Bpifrance. Ils correspondent à un métier d'investisseur institutionnel, gestionnaire d'actifs. La direction est organisée en 2 départements :

- Le département gestion des placements (GDAP)
- Le département finance et opérations (GDAF)

1.2.2. Missions et actions de l'entité prescriptrice

Le département GDAF se compose de 3 pôles d'activités et d'un service.

- le pôle Intermédiation & Actionnariat assure la négociation des ordres de marchés au service des gérants de portefeuilles ainsi que la surveillance et la déclaration des franchissements de seuils de détention du groupe Caisse des Dépôts dans les sociétés.
- le pôle Pilotage financier a la responsabilité du pilotage budgétaire, du contrôle de gestion, de la répartition des coûts, ainsi que de la production du compte de résultat analytique du métier gestion d'actifs ; il élabore également le plan stratégique moyen terme de GDA et assure le suivi du contrat d'objectifs
- le service relations institutionnelles et externes constitue une interface entre GDA et les instances internes et externes de gouvernance et de supervision ; il prend également en charge la politique de communication du métier gestion d'actifs
- le pôle Analyse de portefeuille, exerce des fonctions de mesure, d'analyse, de contrôle, de certification et de restitution des données et des indicateurs permettant un éclairage qualifié (expertise), indépendant, fiable et pertinent afin d'appuyer la décision financière. **Ce Pôle joue un rôle de coordinateur dans le cadre du présent Appel d'Offre.**

1.2.3. Organisation

La Caisse des Dépôts ne sera pas l'unique bénéficiaire final de la présente prestation. L'Etablissement public agira au titre de son pouvoir adjudicateur et, en conséquence, pilotera la prestation de transposition pour le compte du **FRR** et de l'**ERAFF**, ceux-ci auront ainsi chacun la qualité de client externe (ci-après Client(s) Externe(s)) auprès de celui-ci.

Le **Fonds de Réserve pour les Retraites** (ci-après le « FRR ») est un établissement public administratif créé par la loi n°2001-624 du 17 juillet 2001 dont la mission est d'investir au nom de la collectivité les sommes que lui confient les pouvoirs publics en vue de participer au financement des retraites.

L'Etablissement de Retraite Additionnelle de la Fonction Publique (ci-après « l'ERAFF ») est un établissement public à caractère administratif sous tutelle de l'État créé par l'article 76 de la loi n° 2003-775 du 21 août 2003 portant réforme des retraites et en charge de la gestion du Régime de Retraite additionnelle de la Fonction publique (RAFP).

2. CONTEXTE ET OBJECTIFS DE LA PRESTATION

2.1. Contexte précis de la Prestation

Concernant la direction GDA de la Caisse des Dépôts :

Le Parlement européen a adopté une série de mesures législatives appelée le « paquet bancaire » et publiées au Journal officiel de l'Union européenne (JOUE) le 7 juin 2019. Ces mesures visent à reformer quatre textes majeurs de l'industrie bancaire :

- Le Règlement sur les exigences en capital, appelé CRR II
- La Directive sur les exigences en capital, appelée CRD V
- La Directive sur le redressement des banques et la résolution de leurs défaillances, appelé BRRD II
- Et le Règlement sur le mécanisme de résolution unique, appelé SRMR2

CRR2 et SRMR2 s'imposent aux établissements bancaires au 28 juin 2021. Toutefois, la CDC dispose d'une période transitoire. Ainsi, CRR2 (Règlement sur les exigences en capital) ne s'imposera à elle qu'au 1^{er} janvier 2023. Bien que la transparençation ne revêt pas encore un enjeu majeur d'un point de vue réglementaire, celle-ci est primordiale pour la mesure de risques et des expositions et plus largement pour le pilotage des investissements. La transparençation a pour objectif de reconstituer le détail ligne à ligne des sous-jacents dans lesquels les OPC (Organisme de placement collectif) sont investis. A terme, cette capacité de connaître et de maîtriser les sous-jacents détenus par un OPC permettra à la CDC de calculer de manière fine les exigences de besoins en fonds propres pour ses expositions sous forme de parts ou d'actions d'OPC

La collecte, la fiabilisation et l'exploitation des données fournies par le gérant à l'investisseur sont autant d'étapes chronophages et sources d'erreurs. Cela s'explique notamment par l'hétérogénéité des inventaires tant sur le fond que sur la forme, du fait de la multitude de sociétés de gestion et de classes d'actifs concernés. Le Club AMPERE, groupe de travail de place, voit le jour en 2007. Les membres du Club accompagnés du Cabinet de Conseil EFESO Consulting ont élaboré divers reporting dont un format d'inventaire tripartite normalisé. Toutefois, bien que l'inventaire TPT AMPERE soit largement utilisé par les sociétés de gestion, les champs requis ne sont pas renseignés de manière exhaustive ou normalisée. Forte de ce constat, la CDC souhaite sélectionner un prestataire en capacité de transparençiser les OPC dans lesquels elle est investie.

Par ailleurs, le [Règlement \(UE\) 2019/876 du Parlement européen et du Conseil du 20 mai 2019](#) permet à un établissement bancaire de s'appuyer sur trois approches pour calculer ses exigences de besoins en fonds propres. L'approche par transparence étant la plus fine est privilégiée par le régulateur. A défaut de pouvoir mettre en œuvre cette approche, celui-ci prévoit deux autres approches : une approche fondée sur le mandat et une approche alternative lourdement pénalisante. Dans ce contexte, la CDC souhaiterait s'appuyer sur l'expertise d'un prestataire pour calculer ses besoins en fonds propres liés à ses investissements au travers de parts ou d'actions d'OPC. Conformément à la réglementation, le prestataire devra, lorsque cela est pertinent, appliquer l'approche par transparence. Lorsque cela se justifie, l'approche par mandat pourra être retenue.

Concernant le FRR :

Le FRR a été créé par la loi n°2001-624 du 17 juillet 2001 codifiée pour la partie législative aux articles L.135-6 à L.135-15 du Code de la sécurité sociale (ci-après le « CSS ») et pour la partie réglementaire aux articles R.135-18 à R.135-29 de ce même code.

Le FRR est un établissement public administratif, placé sous la tutelle de l'Etat, ayant pour mission de gérer les sommes qui lui sont affectées afin de constituer des réserves destinées à contribuer à la pérennité des régimes de retraites par répartition.

La politique d'investissement du FRR doit viser à optimiser le rendement des placements effectués dans les meilleures conditions de sécurité possibles. Elle doit être cohérente avec le respect d'un certain nombre de valeurs collectives favorables à un développement économique, social et environnemental équilibré.

Pour la gestion de ses actifs, le FRR recourt, en application des dispositions de l'article L.135-10 du Code de la sécurité sociale, à des prestataires de services d'investissement. Ces derniers exercent le service de gestion de portefeuille pour compte de tiers visé au 4 de l'article L.321-1 du Code monétaire et financier.

Aux termes de l'arrêté du 24 mai 2016 relatif au Fonds de Réserve pour les Retraites, le FRR est soumis à des contraintes réglementaires qui lui imposent de mesurer son exposition directe et indirecte aux instruments financiers dans lesquels il est investi, notamment, via des organismes de placement. Des ratios de composition de l'actif net (similaires à ceux définis par l'Agence de Marché Financier pour les OPCVM) du FRR en transparence limite ainsi la concentration de ses risques.

C'est dans ce contexte, que le FRR doit disposer d'une expertise externe capable de collecter, contrôler et consolider les données pour homogénéiser les positions afin que le FRR puisse mesurer son exposition par émetteurs / contreparties, par devises étrangères, par types d'instruments, par zone géographique et par notations.

Pour plus d'information, veuillez consulter le site internet du FRR : www.fondsdereserve.fr/fr

Concernant l'ERAFP :

L'Etablissement de retraite additionnelle de la fonction publique (ci-après l'« ERAFP »), a été créé par l'article 76 de la loi n°2003-775 du 21 août 2003 portant réforme des retraites ; ses modalités de fonctionnement ont été fixées par le décret n°2004-569 du 18 juin 2004 relatif à la retraite additionnelle de la fonction publique et par l'arrêté du 26 novembre 2004 portant application du décret n° 2004-569 du 18 juin 2004 relatif à la retraite additionnelle de la fonction publique.

L'ERAFP est un établissement public administratif, placé sous la tutelle de l'État, ayant pour mission de gérer le régime public de retraite additionnelle obligatoire des agents titulaires des trois fonctions publiques ; il fonctionne en capitalisation et par points.

La politique d'investissement de l'ERAFP vise à optimiser le rendement des placements, effectués dans les meilleures conditions de sécurité possibles. Elle s'inscrit dans le respect d'un certain nombre de valeurs collectives favorables à un développement économique, social et environnemental équilibré.

Pour la gestion de ses actifs, et en application des dispositions de l'article 29 du décret du 18 juin 2004, l'ERAFP recourt, soit à des prestataires de services d'investissement, soit à des placements en direct.

Les articles 19 à 23 de l'arrêté du 26 novembre 2004 limitent l'exposition que l'ERAFP peut prendre sur certains actifs financiers ; dès lors, l'ERAFP doit mesurer son exposition directe et indirecte aux instruments financiers dans lesquels il est investi notamment via des organismes de placement.

C'est dans ce contexte, que l'ERAFP doit disposer d'une expertise externe capable de collecter, contrôler et consolider les données pour homogénéiser les positions afin que l'ERAFP puisse mesurer son exposition par émetteurs et contreparties, par devises étrangères, par types d'instruments, par zones géographiques et par notations.

Pour plus d'informations, veuillez consulter le site internet de l'ERAFP : www.rafp.fr.

2.2. Comitologie mise en place pour le pilotage de la prestation

Un comité ci-après « Comité Utilisateurs » devra être tenu à minima trimestriellement. Ce Comité Utilisateurs réunira les représentants de la CDC et de ses Clients Externes avec le Prestataire (tel que ce terme est défini à l'article 2.3 ci-après). L'objet dudit comité sera d'échanger sur les prestations rendues dans le cadre de ce Marché.

La CDC pilotera la relation avec le Titulaire du Marché (tel que ce terme est défini ci à l'article 2.3 ci-après), il est toutefois précisé que chaque Client Externe sera également amené à être en contact avec le Prestataire. En particulier, chaque Client Externe doit pouvoir communiquer avec le Prestataire afin de traiter les éventuelles questions liées au processus de collecte de données, à la compréhension et la complétude des livrables de chacune des missions.

En tout état de cause, aucun Client Externe n'aura de pouvoir de décision dans l'exécution du Marché.

Il est en outre précisé qu'au titre de son activité de pilote de la relation avec le Prestataire, la CDC communiquera par Bon de Commande au Prestataire, à minima tous les mois, les prestations à livrer.

Chaque Bon de Commande comprendra à minima la liste des OPC à transcrire pour chacun des établissements en distinguant chacun des périmètres CDC, FRR, ERAFP, avec le nombre de parts détenues par chaque établissement. Il précisera aussi les livrables attendus.

2.3. Objet de la prestation

Le présent Marché porte sur la sélection d'un prestataire externe (ci-après le « Prestataire » ou le « Titulaire ») en capacité de transcrire (au 1^{er} niveau) l'ensemble des OPC d'actifs cotés qui lui seront communiqués et de transcrire au second niveau les fonds de fonds (le « Marché »).

L'objet du Marché est de collecter, fiabiliser, enrichir et homogénéiser les données provenant d'inventaires des OPC d'actifs cotés. Le Titulaire devra exécuter l'objet du Marché dans les conditions prévues par les Documents Contractuels tels que définis dans le Cahier des Clauses Administratives Particulières.

Ainsi le Titulaire a pour mission et s'engage à :

- a) Collecter auprès des sociétés de gestion les inventaires des OPC d'actifs cotés dans lesquels la CDC, FRR et l'ERAFP sont investis (et dont la liste figurera dans un Bon de Commande) ;
- b) Contrôler la qualité des données envoyées par les sociétés de gestion;
- c) Enrichir certains titres et contrats financiers détenus dans les OPC;
- d) Consolider sous la forme d'un reporting au « Format Tripartite » (AMPERE) version V 6.0 et toute version ultérieure et homogénéiser l'ensemble des titres et contrats financiers détenus par les OPC;
- e) Produire mensuellement (pour le périmètre CDC) trimestriellement (pour le périmètre FRR et celui de l'ERAFP) un ou des rapports détaillés permettant de mesurer son exposition globale indirecte sur les titres financiers et les contrats financiers ;

En tant que prestation supplémentaire éventuelle facultative et conformément à ses réponses apportées aux questions du point 3.4 du Questionnaire d'Offre, le Titulaire pourra également se voir confier la prestation suivante :

f) Calculer à minima trimestriellement la pondération en fonction du risque pour chacun des actifs sous-jacents détenus dans les OPC et pour chaque OPC conformément à CRR2.

Les livrables devront être conformes aux obligations du Marché et plus particulièrement aux termes et conditions prévus au point 3 ci-après.

A titre indicatif, le périmètre concerné par établissement (en nombre de fonds) est le suivant :

	Transcription de 1 ^{er} niveau	Transcription de 2 nd niveau
CDC	220	5
ERAFP	100	2 fonds de fonds dont une quarantaine de fonds sous-jacents
FRR	30	Transcription des OPC « maison » détenus dans l'OPC du gestionnaire
TOTAL	350	

Remarque : les données communiquées ci-dessus, en termes de volumétrie, sont indicatives et non contractuelles. Elles ne présagent en rien de celles qui seront effectives dans le cadre de l'exécution du Marché.

Le candidat devra être en capacité d'organiser la mise en place et la signature des accords de confidentialités (NDA) engageant sociétés de gestion, lui-même et ses clients (cf. questionnaire d'offre - 46 Ter).

3. DETAIL DES PRESTATIONS ATTENDUES

3.1. Mission 1 : Base de données sous format Excel© consolidée dédiée à chaque établissement sous format TPT AMPERE V.6.0 (et ultérieure)

3.1.1. Définition

Le Titulaire devra être en mesure de collecter auprès des sociétés de gestion l'entièreté des inventaires des fonds dans lesquels la CDC, le FRR et l'ERAFP sont investis afin de restituer l'inventaire de l'actif net détenu par la CDC et ses Clients Externes. Le reporting implique donc trois inventaires distincts agrégeant les positions de chaque OPC dans lesquels ces établissements seraient investis tout en gardant la décomposition ligne à ligne par OPC. Les données devront être enrichies pour les titres cotés et les dérivés OTC. A minima, les inventaires devront respecter le format TPT AMPERE V.6.0 et ultérieure. Le reporting final attendu comprendra des champs additionnels (cf. livrables).

3.1.2. Réalisation

La CDC communiquera a minima la liste des OPC et le nombre de parts détenues par chacune des trois entités dans le Bon de Commande.

Les livrables de la mission 1 (ci-après les « Livrables 1 ») devront être communiqués par le Prestataire à J +20 Jours maximum. Étant pris en considération que ces délais sont déterminés en jour ouvré, et que J constitue le dernier jour ouvré du mois précédent.

Ces inventaires devront prioritairement être envoyés sous format AMPERE. Cependant le Titulaire doit pouvoir prendre en charge tout format d'inventaire transmis par les sociétés de gestion

Les livrables seront communiqués selon les modalités qui auront été arrêtées par le Titulaire et la CDC lors de la mise au point du Marché.

3.1.3. Livrables

Le livrable de la mission 1 correspond à des reporting (sous forme de base de données) au format Excel© consolidés et homogénéisés :

- « AAAAMM_TPT_CDC.xlsx » pour la CDC
- « AAAAMM_TPT_FRR.xlsx » pour le FRR
- « AAAAMM_TPT_ERAFP.xlsx » pour l'ERAFP et les inventaires concaténés (différenciés entre fonds directs et fonds de fonds)

Dont les caractéristiques suivantes seront respectées :

- Format TPT AMPERE (version 6.0) (cf. Annexe 2 du questionnaire d'offre) et ultérieure
- Permettant le regroupement par instrument financier de positions homogènes et enrichies
- Permettant d'identifier l'exposition des positions (y compris les dérivés OTC) aux émetteurs (et contreparties), aux pays, aux secteurs, aux devises et au risque de crédit (notations, séniorité)
- Les codes LEI devront être homogénéisés et systématiquement enrichis dès lors que l'émetteur ou la contrepartie dispose d'une telle certification

Ce format sera complété par d'autres données spécifiques à la CDC, au FRR et à l'ERAFP présentées dans des colonnes additionnelles au reporting TPT AMPERE. Ces données seront facilement intégrables par le Titulaire, à partir d'une base référentielle qui sera communiquée par la CDC, en prenant le code ISIN des OPC transparisés comme pivot. Ces données spécifiques porteront notamment sur des références internes (ex : le portefeuille, le lot, le mandat, la classe d'actifs ou le fond de fonds dans lequel le fond est détenu) et les parts détenues par la CDC, le FRR et l'ERAFP dans l'OPC. Ces données seront communiquées par la CDC conformément au point 5.2 du présent document.

En outre, ce reporting devra être enrichi de caractéristiques spécifiques aux positions détenues, notamment :

- L'ensemble des notations différenciées selon le type de notation : notation émission, notation émetteur (si le titre est non noté et qu'il ne s'agit pas d'une obligation subordonnée) ou bien la notation du groupe de l'émetteur (si l'émetteur n'est pas noté) de chacune des 3 principales agences de notation (Fitch/S&P/Moody's pour lesquels les trois utilisateurs bénéficient déjà de licences) ainsi que la notation Bâloise (note médiane) découlant des notations publiées par ces trois agences ;
- Les secteurs GICS (Global Industry Classification Standard) de niveau 2 pour les émissions corporate complétés de secteurs spécifiques pour les instruments de taux émis par des entités non corporate (ex souveraines, supranationales, ...) ;
- Le pays de risque (selon la définition Bloomberg)
- L'exposition de la CDC, du FRR et de l'ERAFP aux pays présents sur des listes d'interdiction ou d'abstention (les listes des pays non coopératifs (ETNC) France et de l'Union Européenne, les deux listes GAFI, la liste des pays à haut risque de la Commission européenne, les pays sous embargo, etc. seront communiquées trimestriellement au prestataire) ;
- La place de cotation de l'instrument (code MIC, ISO 10383)
- La qualification STS pour les titrisations éligibles au label « Simples, Transparentes et Standardisées ».

Les référentiels retenus et leurs définitions et leurs modalités d'accès et d'application seront précisés et feront l'objet d'un échange avec le Prestataire au moment de la mise au point du Marché.

3.2. Mission 2 : Production de rapports présentant des expositions agrégées

3.2.1. Définition

Sur la base des données collectées et enrichies sous format TPT AMPERE, des rapports additionnels devront être fournis pour chaque établissement public. Ces rapports porteront sur des expositions à certaines caractéristiques de titres à différents niveaux de granularité.

Le livrable sera communiqué selon les modalités qui auront été arrêtées par le Titulaire et la CDC lors de la mise au point du Marché.

Il est à noter que les rapports listés ci-dessous sont présentés à titre indicatif et pourront faire l'objet de modifications mineures lors du lancement de la prestation. La liste des livrables pourrait être complétée au cours du Marché.

3.2.2. Réalisation

Les livrables de la mission 2 (ci-après les « Livrables 2 ») devront être communiqués par le Prestataire à J +20 jours maximum. Étant pris en considération que ces délais sont déterminés en jour ouvré, et que J constitue le dernier jour ouvré du mois précédent.

Les livrables seront communiqués selon les modalités qui auront été arrêtées par le Titulaire et la CDC lors de la mise au point du Marché.

3.2.3. Livrables

Les rapports décrits ci-après devront être remis sous format Excel®. Ceux-ci sont présentés à titre indicatif et pourront faire l'objet d'adaptations à la marge pour la CDC et ses Clients Externes.

- Rapport 1 : Répartition par émetteur/contrepartie

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC

Un reporting au niveau du portefeuille global du FRR

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Groupe d'appartenance de l'émetteur / de la contrepartie	Code du groupe d'appartenance de l'émetteur / de la contrepartie	Emetteur / contrepartie	Code Emetteur / contrepartie	Notation Bâloise du groupe d'appartenance de l'émetteur	Exposition (en M€)
					49_Name_of_the_group_of_the_issuer	50_Identification_of_the_group	46_Issuer_name	47_Issuer_identification_code		
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	Aquarius + Investments Plc	635400GCDUBCNKKFJC68	A	0,70
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BGL BNP Paribas	UAIAINAJ28P30E5GWE37	A	0,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	A	2,12
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BBB	0,69
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BNP PARIBAS	ROMUWSFPU8MPROB8SP83	BBB-	2,61
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ALLIANZ MALAYSIA BERHAD.	549300HV4G0IOIOKH067	ALLIANZ MALAYSIA BERHAD.	549300HV4G0IOIOKH067	NR	0,01
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Allianz SE	529900K9B0N5BT694847	ALLIANZ BANQUE	969500B1EE984QA2K57	AA	0,01
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Allianz SE	529900K9B0N5BT694847	Allianz Finance II B.V.	529900K9B0N5BT694847	A+	0,46
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Allianz SE	529900K9B0N5BT694847	Allianz SE	529900K9B0N5BT694847	A+	3,55

- Rapport 2 : Répartition par instruments financiers

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Type d'instrument	Instrument titrisé ?	Qualification STS?	Exposition (en M€)
					131_Underlying_asset_category	56_Securitisation	56_Securitisation	
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Obligations souveraines	Non	Non	1 300,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Obligations d'entreprises	Non	Non	1 400,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Actions Listées	Non	Non	800,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Fonds d'investissement	Non	Non	45,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Titres structurés	Non	Non	5,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Titrisations	Oui	Oui	1,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Liquidité	Non	Non	200,00

- Rapport 3 : Répartition par devises

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale CDC de la et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Devise	Exposition (en M€)
					21_Quotation_currency_(A)	
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AED	1,45
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ARS	25,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AUD	- 50,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	BRL	100,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	CAD	- 7,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	CHF	1,00

- Rapport 4 : Répartition par notation Bâloise et par type d'instrument

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC et de l'OPC



Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Notation Bâloise des instruments financiers	Type Instrument 131_Underlying_asset_category	Exposition (en M€)
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	A	Obligations souveraines	100,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	A-	Obligations souveraines	50,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	A+	Obligations souveraines	70,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AA	Obligations souveraines	60,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AA-	Obligations souveraines	10,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AAA	Obligations souveraines	5,00

- **Rapport 5 : Répartition par secteur d'activité***

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Secteur 54_Economic_sector	Etat ou Agence ?	Exposition (en M€)
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Agriculture, sylviculture et pêche	Non	3,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Industries extractives	Non	100,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Industrie manufacturière	Non	500,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Production et distribution d'électricité, de gaz, de vapeur et d'air conditionné	Non	85,00
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	Production et distribution d'eau; assainissement, gestion des déchets et dépollution	Non	6,00

**Les secteurs repris proviendront de la nomenclature NACE pour la CDC et GIGS pour le FRR et l'ERAFP*

- **Rapport 6 : Répartition par pays d'incorporation**

- Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC et de l'OPC

- Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne de la CDC et de l'OPC

- Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Pays d'incorporation 52_Issue_country	Pays coopératif (ETNC)	Liste noire UE	GAFI 1&2	Pays à très haut risque	Exposition (en M€)
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AFRIQUE DU SUD	Oui	Non	Non	Non	90
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ANGOLA	Oui	Non	Non	Non	2
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ALLEMAGNE	Oui	Non	Non	Non	78
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	FRANCE	Oui	Non	Non	Non	120

- **Rapport 7 : Répartition par pays de risque Bloomberg :**

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Pays de risque Bloomberg	Exposition (en M€)
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	AFRIQUE DU SUD	90
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ANGOLA	2
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	ALLEMAGNE	78
XXX	XXX	XXX	XXX	XXX	FRANCE	120

- **Rapport 8 : Répartition par séniorité en incluant la notation bâloise des instruments**

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Epargne CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau de portefeuille global, par OPC et par classe d'actifs

Un reporting au niveau du portefeuille global de l'ERAFP ainsi que différencié entre fonds directs et fonds de fonds

Classe d'actifs	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 1er niveau)	Identifiant de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Nom de l'OPC (Transparisation de 2nd niveau)	Garantie implicite du pays de l'émetteur : Y / N	Dettes subordonnées : Y / N	Dettes couvertes / non couvertes : C / NC	Nature de la tranche	Notation Bâloise des instruments financiers	Exposition (en M€)
					57_Explicit_guarantee_by_the_country_of_issue	58_Subordinated_debt	55_Covered_not_covered	58b_Nature_of_the_tranche		
XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	N	N	C		A	5,00
XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	N	N	C		AA+	0,01
XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	N	N	C		AAA	0,11
XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	XXXX	N	N	C		B	8,00

3.3. Mission 3 (Prestation supplémentaire éventuelle facultative) : Calculer les besoins en fonds propres liés aux OPC

3.3.1. Définition

Cette prestation (Mission 3) s'ajoute à la prestation de base (Mission 1 et Mission 2), si elle est retenue par la CDC lors de l'attribution de l'accord-cadre.

Le candidat détaille la PSE facultative qu'il propose dans un mémoire technique et la chiffre dans sa proposition financière qu'il joint à son offre technique.

Conformément au RÈGLEMENT (UE) 2019/876 DU PARLEMENT EUROPÉEN ET DU CONSEIL du 20 mai 2019, il s'agira de calculer trimestriellement le montant d'exposition pondéré des expositions de la CDC sous forme de parts ou d'actions d'un OPC en multipliant le montant d'exposition pondéré des expositions de l'OPC, calculé selon l'approche par transparence (ou par mandat lorsque l'approche par transparence n'est pas possible ou pertinente, c'est-à-dire lorsque le montant d'exposition est sensiblement similaire en adoptant l'approche par transparence ou par mandat).

Seuls les OPC détenus en direct par la CDC feront l'objet de ladite prestation.

3.3.2. Réalisation

Les livrables de la mission 3 (ci-après les « Livrables 3 »)

devront être communiqués par le Prestataire à J +20 jours maximum. Étant pris en considération que ces délais sont déterminés en jour ouvré, et que J constitue le dernier jour ouvré du mois précédent.

Les livrables seront communiqués selon les modalités qui auront été arrêtées par le Titulaire et la CDC lors de la mise au point du Marché.

3.3.3. Livrables

Les rapports attendus porteront sur les périmètres suivants :

Un reporting au niveau du portefeuille global de la Section Générale de la CDC et de l'OPC

Un reporting au niveau du portefeuille global du Fonds d'Épargne de la CDC et de l'OPC

Ce rapport devra contenir à minima le libellé et l'ISIN du fonds concerné, les références du ou des portefeuilles concernés, toutes les caractéristiques des titres ou instruments nécessaires aux calculs d'exigence de fonds propres ainsi que les étapes de calcul permettant de définir la pondération d'exposition pour chaque titre/instrument et pour chaque fonds.

4. COMPETENCES REQUISES

Il est attendu une prestation d'administration des données de qualité impliquant notamment disponibilité, expertise et compétences de l'équipe dédiée. Celle-ci doit justifier d'une connaissance approfondie en matière de gestion de bases de données de marchés ou de référentiel d'instruments financiers et d'analyse de risques. Il est également souhaité que l'équipe dédiée soit francophone.

5. CONDITIONS D'EXECUTION

5.1. Lieu d'exécution de la prestation

La prestation sera réalisée dans les locaux du Titulaire, du sous-traitant ou du membre du groupement en charge de ces missions.

5.2. Documents mis à disposition

Le titulaire se verra remettre a minima les éléments suivants, mensuellement (pour le périmètre CDC) et trimestriellement (pour le périmètre Clients Externes), au maximum à J+4.

Etant pris en considération que les délais ci-dessus sont déterminés en jour ouvré et que J constitue la date de valorisation fin de mois des OPC (dernier jour ouvré du mois précédent).

Classe d'actifs	Code ISIN de l'OPC	Libellé de l'OPC	Nombre de part détenues	Net Asset Value des parts détenus*	Net Asset Value totale de l'OPC*	Quote-part dans l'OPC (NAV parts/NAV fonds)
Monétaire	XXXX	XXXX	20	100	9 000	22,2%
HY euro	XXXX	XXXX	10	30	7 000	4,2%
...						

*Les montants communiqués seront contre valorisés en Euro.