

Le Sentiment-Exposure-Index (SEI)

« Je suis le commandant de bord,
nous naviguons dans le brouillard,
nous avons tous les instruments à disposition,
mais le SEI est notre référence externe
dans le 'Decision Making' »

Citation d'un institutionnel de Bienne

Le 8 janvier 2013

Définition & Périodicité

Vous recevez

> chaque mercredi, par mail, un chiffre (en %) compris entre 30% et 150%

Le SEI vous dit

> combien d'exposition en action

Le SEI est le résultat d'un algorithme

> mesure holistique

> sciences de la communication comme fondement

> scientifically proven

L'algorithme

Les données primaires proviennent de Bloomberg, Nasdaq, U.S. Department of the Treasury, Fixed Income, Markit Indices, S&P 500 et MSCI World.

A l'aide de 60 catégories, 491 dimensions et 15 agrégations empiriques, notre algorithme traite environ 60'000 codes primaires par semaine.

A l'aide d'un Sentiment-Converter asymétrique, le résultat est traduit en un unique chiffre d'exposition en action (de propension au risque jusqu'à aversion au risque, resp. de 150% à 30%), le Sentiment-Exposure-Index.

Utilité

1. Contribution à votre 'Decision Making'
2. Recherche de pointe comme couverture
3. Augmentation du rendement grâce à une concentration sur l'essentiel

Scientifically proven

Modélisation du SEI 2008 à 2012 > Alpha de 3%
« approche très prometteuse »

Prof. Dr Th. Hens

Modélisation du SEI 2010 « Le résultat est fantastique »



Fondements de recherche empirique

2008 - 2013
« Marchés financiers, médias et émotions »
Recherche interdisciplinaire



2010
« Information, Media and Finance »
entre autres avec Prof. Dr. Jan-Egbert Sturm



Depuis 2003, charge de cours
« Marchés financiers en tant que système de
communication – un modèle holistique »



1999
« Stéréotypisation dans les médias »
Travail de thèse



Prix d'abonnement

Sur demande : office@as1994.ch

Le SEI est la clef de voûte de notre Asset Management et pour des porteurs de parts du AS Global Behavior ETF Lux Fonds (projet) sans frais.

Abonnement d'essai voir [Abonnement](#)

Contact

AS Asset Services SA
Avenue Beauregard 31
2036 Neuchâtel-Auvernier
Suisse

Tél. 00 41 32 731 31 32
office@as1994.ch