

Programme SIGMA

Point d'information CSSCT – 18 Mars 2021



**Caisse
des Dépôts**
GROUPE

Sommaire - Point d'information CSSCT – Mars 2021

| | | |
|-----------|--|----|
| 01 | Rappel - contexte et objectifs du Programme SIGMA | 4 |
| 02 | Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE | 7 |
| 03 | Mises en Production à venir - facteurs de succès | 16 |
| 04 | Annexes | 20 |

01

**Rappel - contexte et objectifs du Programme
SIGMA**

Contexte et objectifs du Programme SIGMA

RAPPEL DU CONTEXTE [1/2]

1. Un SI de filière

- Les activités de la filière investisseur de la Caisse des dépôts s'appuient sur un système d'information hétérogène
- La complexité du SI investisseur est **source de difficultés** dans sa maintenance et son évolution au regard des contraintes réglementaires, des pratiques de marché ou des demandes internes pour garantir la bonne exécution et la sécurisation des activités pour compte propre et compte de tiers
- Le caractère daté et parfois obsolète des outils de la filière contraignent les opérationnels à pallier les lacunes SI par un investissement redoublé afin d'assurer la production au standard de qualité et de sécurité requis
- Dans ce contexte, la filière investisseur a engagé un projet de refonte de son SI, baptisé SIGMA (Système d'Information de Gestion des activités de Marché), motivé par l'opportunité de mettre en place une **solution intégrée de gestion de portefeuilles front to back**. Le projet a l'ambition de couvrir les besoins de la filière investisseur impliquée et vise à :

Moderniser le système actuel et étendre la couverture fonctionnelle

Optimiser et sécuriser les processus de traitement front to back

Accroître la flexibilité et l'évolutivité du système

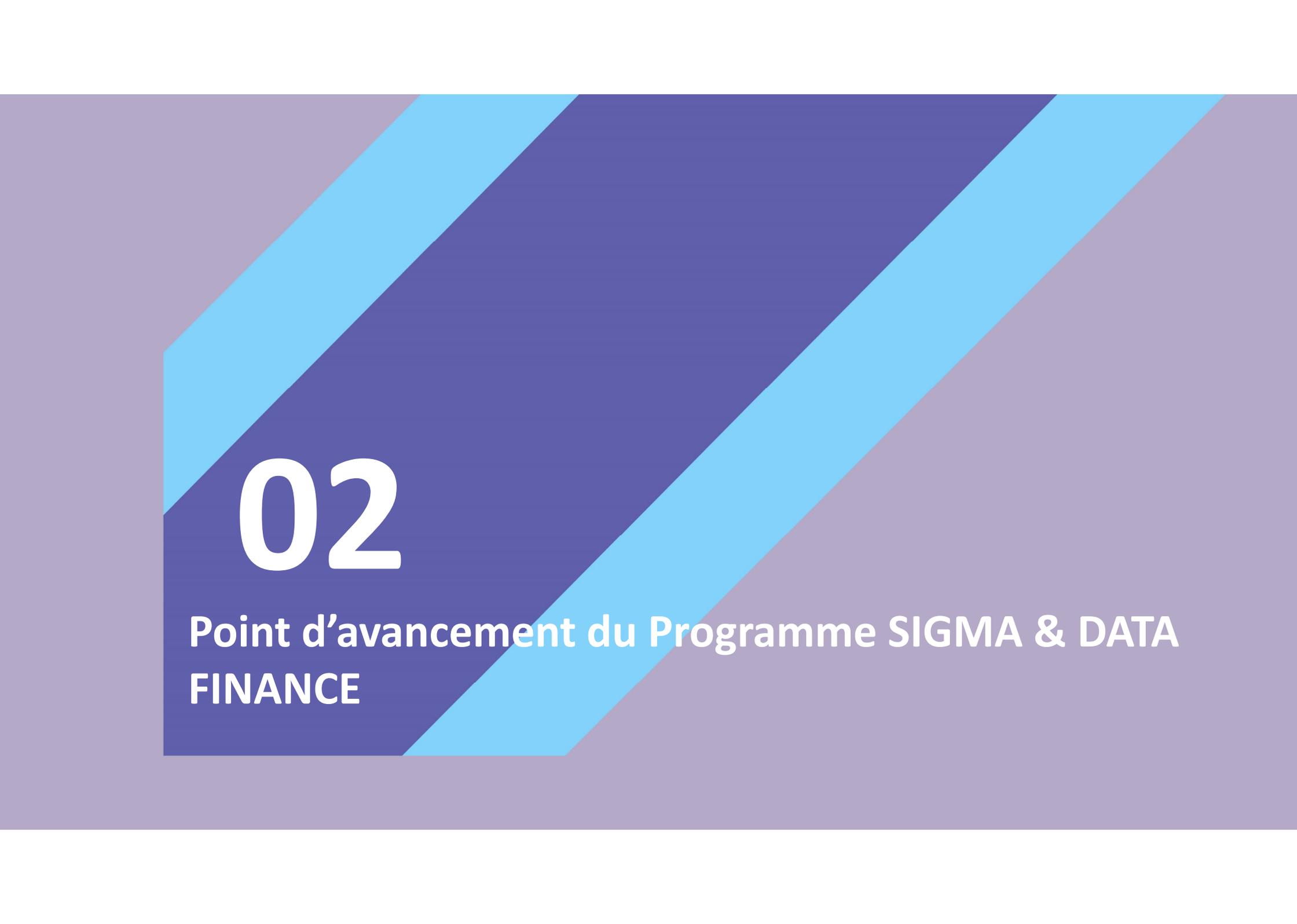
- **MX.3 de Murex** est le progiciel retenu comme solution cible

Contexte et objectifs du Programme SIGMA

RAPPEL DU CONTEXTE [2/2]

2. Dialogue social

- Quatre points d'information ont été réalisés en CHSCT puis CSSCT le 13 Juin 2017, le 13 mars 2018, le 17 Mai 2019 et le 22 Septembre 2020.
- Cette information est reconduite de manière périodique pour partager l'état d'avancement du projet et prendre en compte les points d'attention des représentants du personnel
- Le programme ayant franchi des étapes importantes, **avec quatre mises en production**, la dernière en date du **25 Janvier 2021**



02

**Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA
FINANCE**

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 1/6

- Ce dernier lot mis en Production le 25/01/2021 était le **plus structurant du programme en termes de complexité et de diversité** : taux d'avancement du programme de 85%

Q3 2018

25/01/2021

Démarrage
MEP 3.2 & 3.3

- **Quatre semaines de production sans incident majeur** avec une forte réactivité de l'ensemble des équipes métiers, filière SI et MUREX
- Pilotage du backlog avec **gestion des anomalies prioritaires et task-forces dédiées « SI & Métier et MUREX »**
- Ouverture du Système et Infrastructure : **rien à signaler**
- Traitement de fin de journée (batch) : **fonctionnement normal** (yc la production des CRE pour le système comptable)
- Poursuite des **travaux de sécurisation de l'arrêté trimestriel (fin mars 2021)** avec les applications avales

Migration / reprise des
données

Globalement bien déroulée avec quelques écarts de valorisation constatés (un dossier en cours de documentation pour les CAC pour fin février avec consolidation fin Mars)

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 2/6

Q3 2018

25/01/2021

Démarrage
MEP 3.2 & 3.3

Progiciel MUREX

Pas d'incident de gravité constaté depuis le démarrage du 25/01 sur l'ensemble des modules de MUREX. Mobilisation des équipes métiers & SI en lien avec MUREX sur **deux chantiers spécifiques** :

- **Déclaration réglementaire EMIR – DTCC** (déclaration de transactions dérivés OTC auprès des Référentiel Centraux) : **12 % de rejets le 15/02 (cible 5% au 8/03 – demande AMF)**
- **Comptabilité (CRE quotidien, CRE valorisation, Rapports) :**
 - **Gros travail effectué par les équipes comptables afin d'apurer les suspens** pour pouvoir respecter les délais et opérer les corrections manuelles qui permettent l'envoi de la déclaration réglementaire.
 - Les corrections d'anomalies comptables sont priorisées pour stabiliser l'arrêté de mars (capacité de développement de MUREX maintenue)

NB : la source majeure de suspens est identifiée – clé de ventilation entre DFE et SG pour les appels de marge

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 3/6

Q3 2018

25/01/2021

Démarrage
MEP 3.2 & 3.3

Applications avals
quotidiennes

Pas d'incident depuis le démarrage (SUTRA - DFE / ASTREE - DFINF / Risk Origin – DRICI)

Applications avals
mensuelles / trimestrielles

Quelques évolutions prioritaires identifiés (ALM BFI – DFINF, QRM, PREV CT). Ajustement et travaux en cours avec les équipes

DATA Finance

Accompagnement de l'équipe Projet pour l'analyse des données auprès des métiers en cours (Priorisation réalisée)

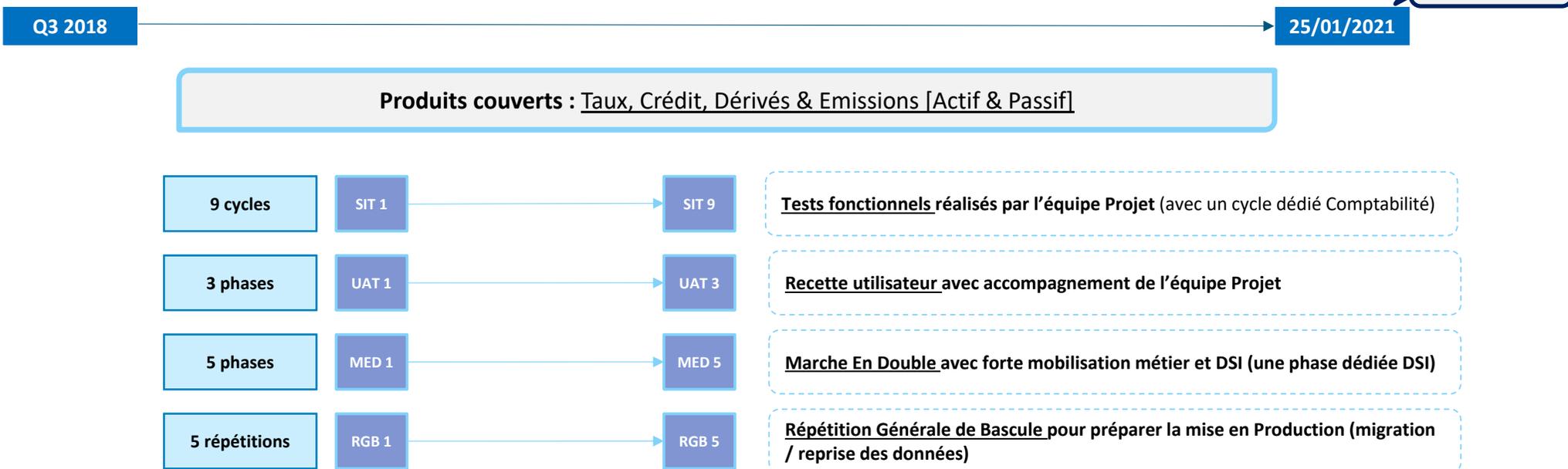
Planning à préciser afin de remplacer les solutions de contournement mises en place au démarrage du 25/01

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 4/6

- **RAPPEL**

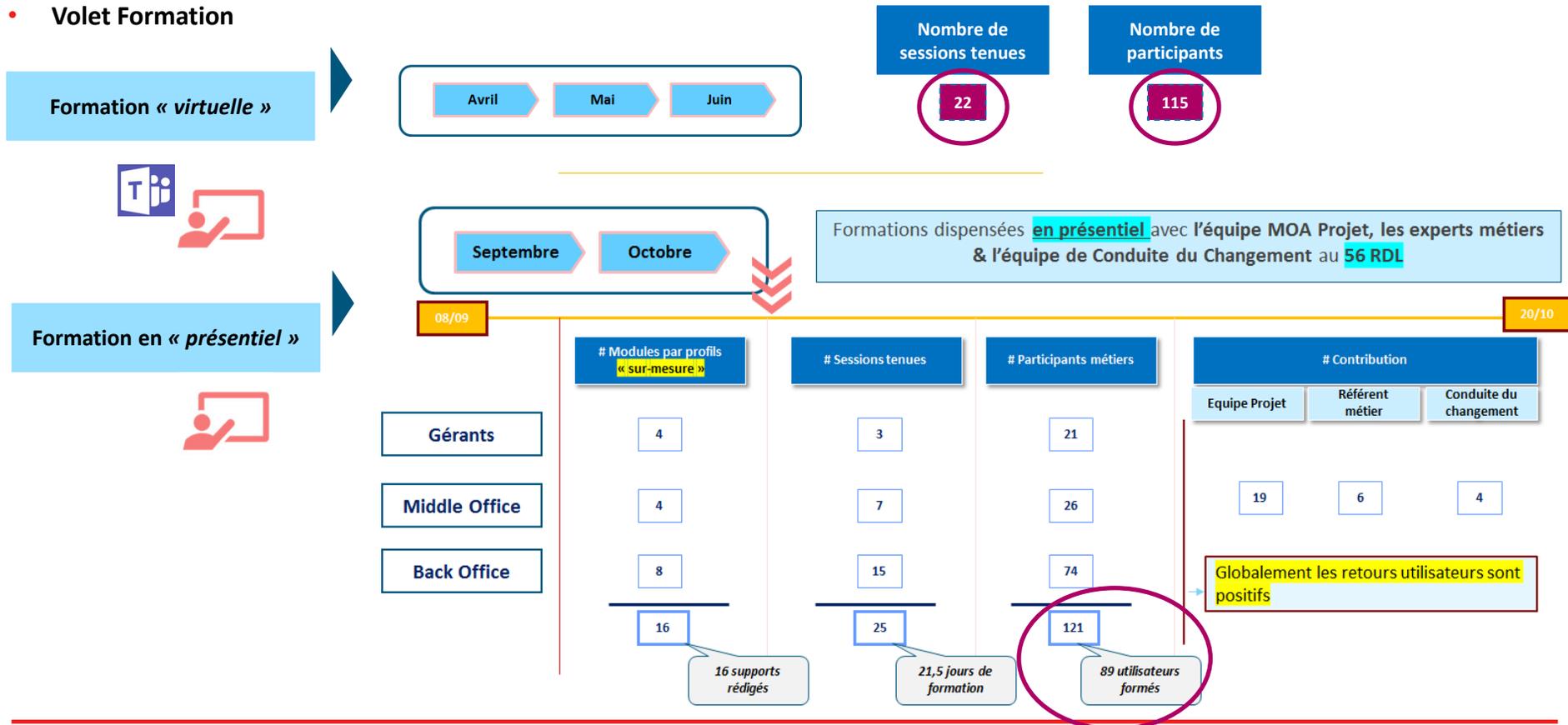
- Quelques chiffres clés avec une **forte mobilisation de l'équipe métier et de l'équipe DSI** depuis plusieurs mois



Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 5/6

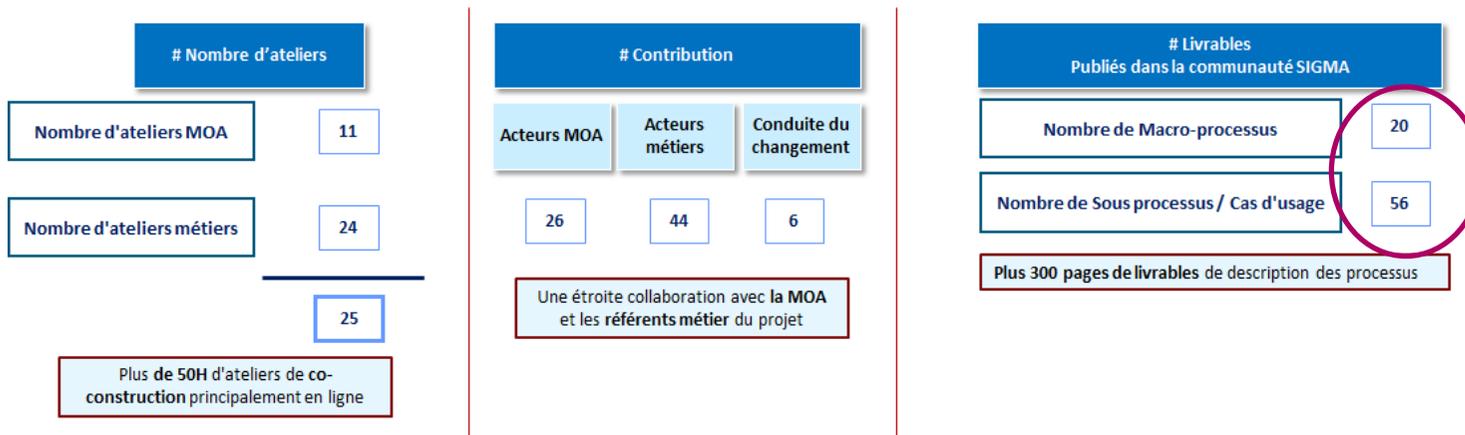
- Volet Formation



Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

Focus sur la dernière Mise en Production « MEP 3.2 & 3.3 » réalisée le 25 Janvier 2021 - 6/6

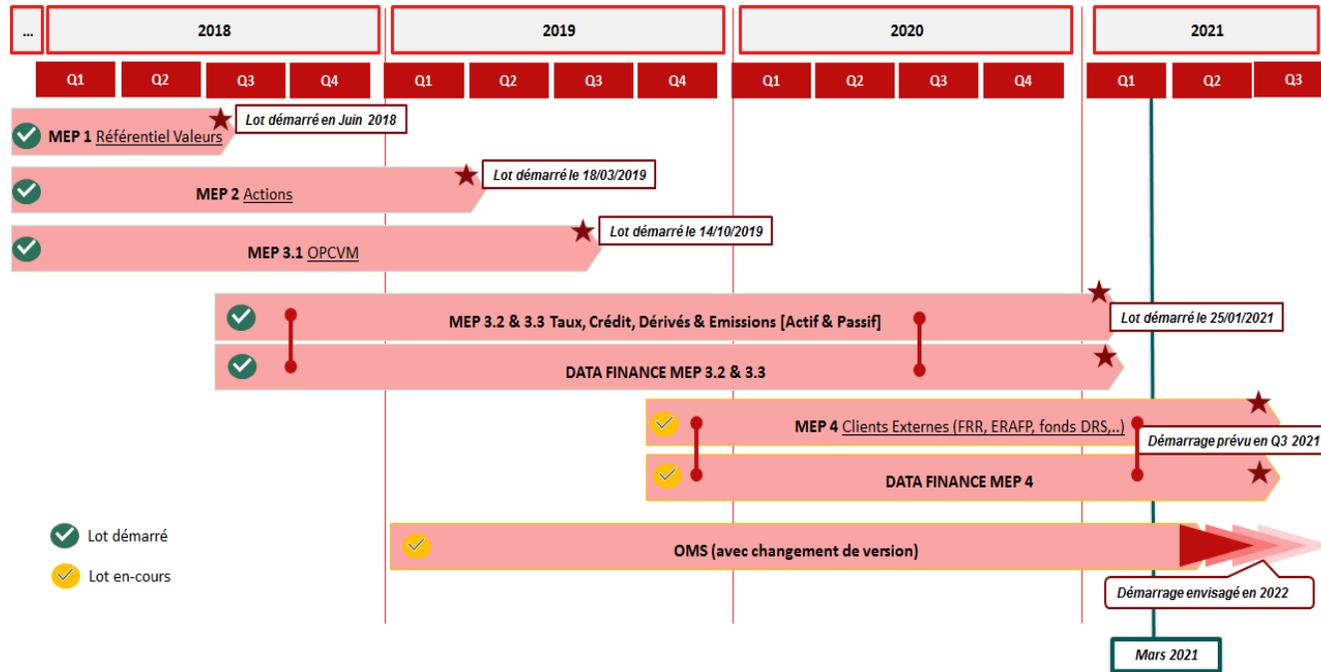
- Volet Processus



| Statut | Nombres |
|--------------------------------|-----------|
| Gestion | 7 |
| Middle Office | 6 |
| BO Flux & Tenue de position | 33 |
| BO Référentiels & Comptabilité | 8 |
| Total | 54 |

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

CALENDRIER ET EVENEMENTS DU PROGRAMME



MEP : Mises En Production importantes déjà réalisées ou à venir

SIGMA - MEP 1 : Fin juin 2018
Référentiel valeurs fédéral



SIGMA - MEP 2 : 18/03/2019

Filière front-to-back-to-comptabilité sur la classe d'actifs Actions



SIGMA - MEP 3.1 : 14/10/2019

Filière Front-to-back-to-comptabilité portant sur les OPCVM et les fonds



SIGMA & DATA FINANCE - MEP 3.2 & 3.3 : 25/01/2021

Filière Front-to-back-to-comptabilité portant sur les taux et dérivés & DATA FINANCE (Accès via Tableau – vision unifiée et centralisée de tous actifs)



SIGMA - MEP 4 : prévu 04/10/2021

Gestion de clients externes



EN COURS

OMS (avec changement de version) : en 2022

OMS – Ordre Management System de MUREX (OMS : gestion des ordres de gérants ainsi que leurs exécutions sur les marchés)



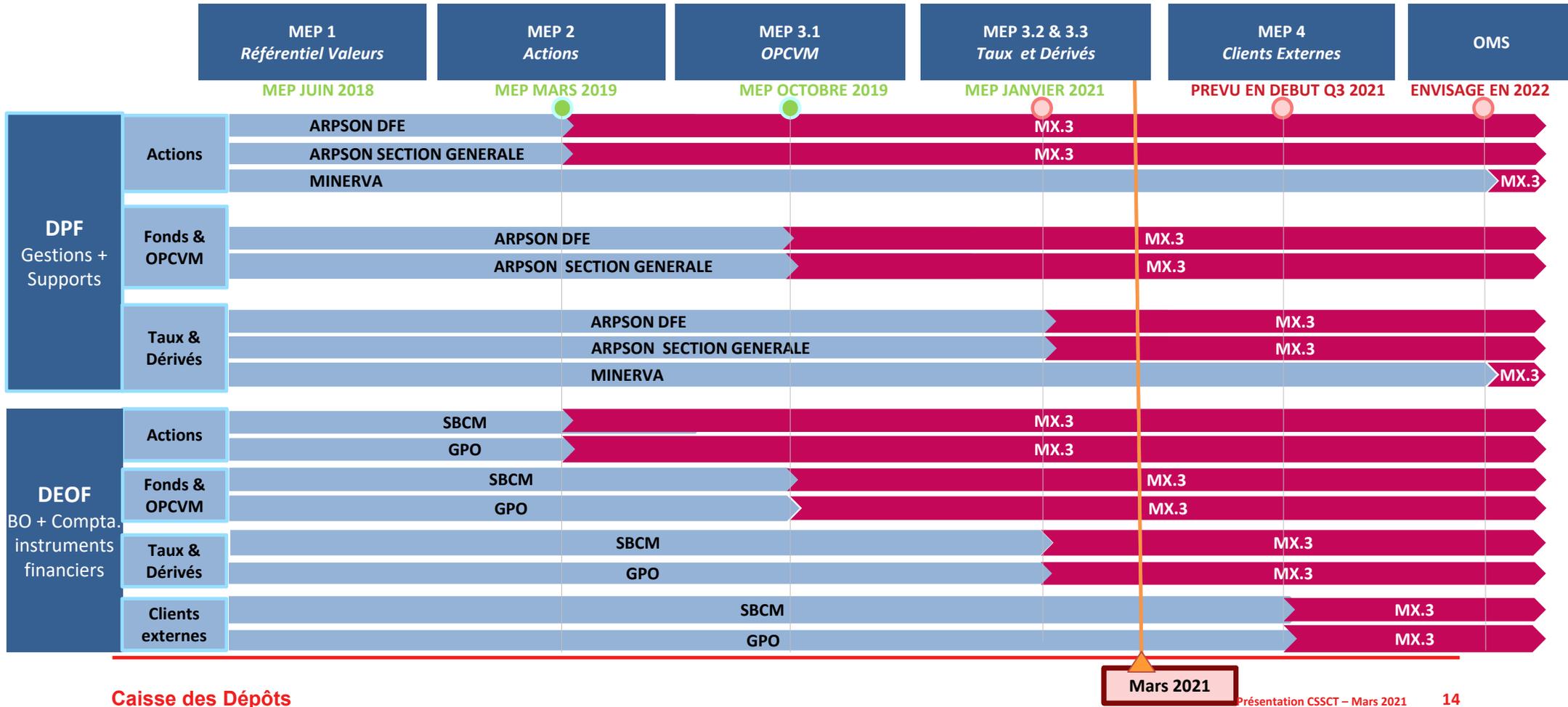
EN COURS

Compte tenu de la durée du projet et du déploiement progressif, des collaborateurs sont amenés à travailler sur les systèmes actuels et sur l'outil Murex.

85% du projet est en production au 25/01/2021

Point d'avancement du Programme SIGMA & DATA FINANCE

COEXISTENCE DU SI PENDANT LA DUREE DU PROJET



Caisse des Dépôts

03

Mises en Production à venir – facteurs de succès

Mises en Production à venir – facteurs de succès

MEP 4 « Gestion des clients externes » - 1/3

Les différents facteurs de succès ont été mis en place pour

- réduire les risques éventuels sur la trajectoire du Programme SIGMA – **démarrage MEP4 prévu le 04/10/2021**
- avoir un meilleur accompagnement pour les différents participants & contributeurs sur le Programme SIGMA

NB : Les travaux se poursuivent sans difficultés majeures pendant cette période sanitaire délicate avec une adaptation rapide et une capacité d'innovation de l'ensemble des contributeurs dans les différents travaux réalisés (via TEAMS des ateliers / comités / réunions)

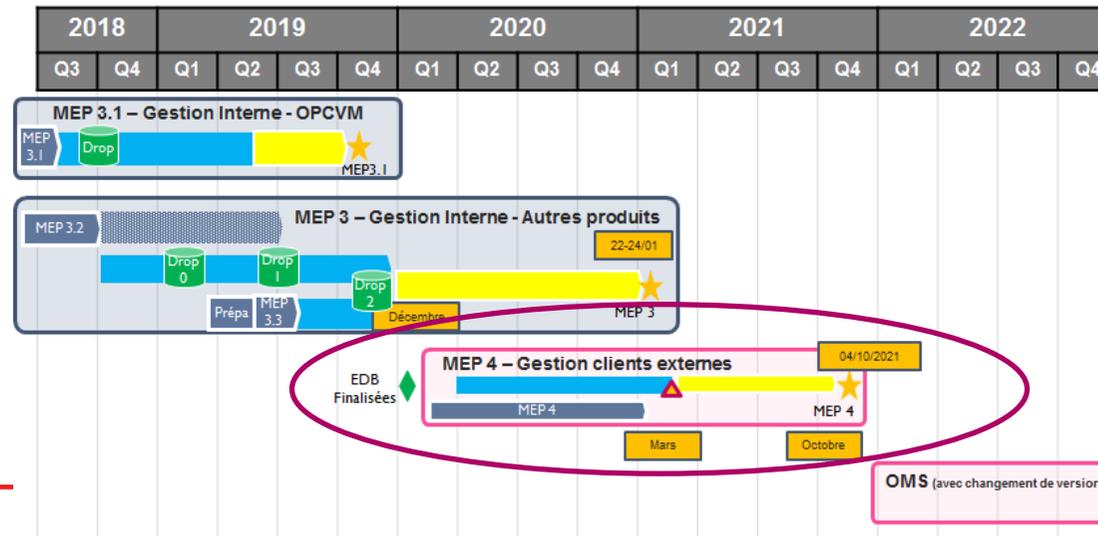
METHODOLOGIE
PROJET
(CYCLE V & AGILE) – 1/2



- Gestion du programme encadré par la réglementation « marché public » avec un planning comprenant les différentes phases d'un projet et des rôles entre l'éditeur et la CDC définis :

CONCEPTION REALISATION SIT / RECETTE METIERS

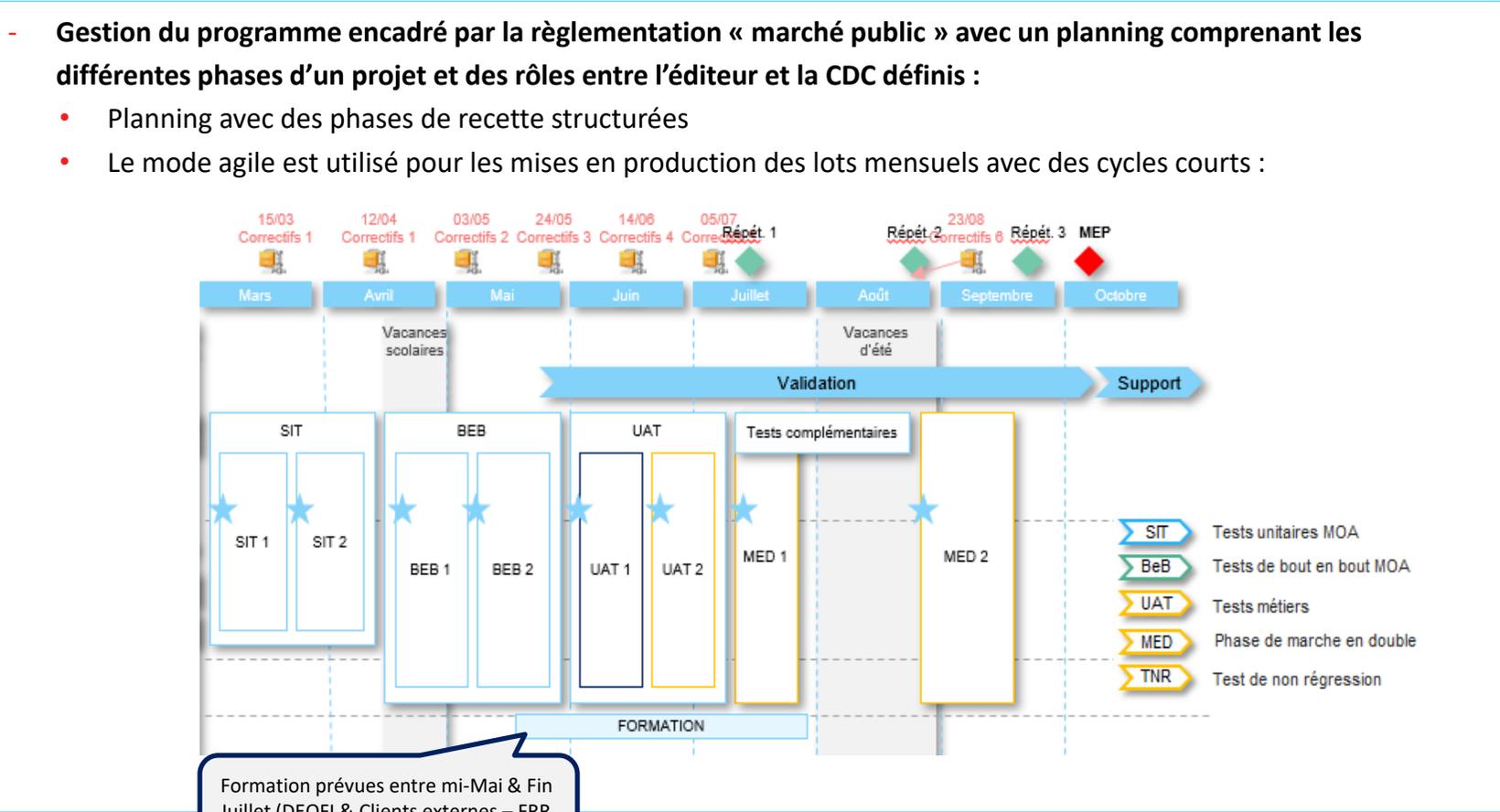
- Planning avec des phases de conception, de développement et de recette



Mises en Production à venir – facteurs de succès

MEP 4 « Gestion des clients externes » - 2/3

METHODOLOGIE
PROJET
(CYCLE V & AGILE) – 2/2



Mises en Production à venir

MEP 4 « Gestion des clients externes » - 3/3



Des contacts sont en cours avec le prestataire spécialisé CECIAA.

Le sujet sera traité de manière globale après finalisation de la MEP 4, en lien avec la mission handicap et la médecine de prévention.

04

Annexes

Annexe 1 – Les risques psycho sociaux – MEP 1, 2 et 3.1 [1/2]

| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque |
|--|---------------------------|---|---------------|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|---|
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | |
| Phase post-projet lots 1 / 2 et 3.1 | | Deux temps de cotation : au lancement du projet (grille 1 et 2 à remplir) et une nouvelle cotation avant à la mise en place de l'application (par ex au COPIL de GO/NO GO) | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des changements de travail | | Risques qui sont liées à des changements organisationnels des contextes de travail | | | | | | |
| Absence d'adhésion / rejet de la solution par les utilisateurs | | 2 | | 1 | | | 2 | La permanence d'une attention technique sur la fonctionnalité des lots 1 / 2 et 3.1 permet un maintien accru de la vigilance sur la perception et l'appropriation de l'outil auprès des collaborateurs, notamment en ce qui concerne le déploiement des référentiels valeurs. |
| Difficulté sur l'appropriation des enjeux stratégiques au regard des habitudes opérationnelles | | 2 | | 1 | | | 2 | |
| Dimensionnement insuffisant des mesures d'accompagnement | 1 | | | 1 | | | 1 | |
| | | 2 | | | 2 | | 4 | |
| Choix d'une solution éloignée des contraintes opérationnelles | | 2 | | 1 | | | 2 | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des contraintes de travail | | Risques qui sont liées à des contraintes entre les objectifs de travail et les moyens mis à disposition ou entre le niveau de prescription et les marges de manœuvre possibles ou entre les efforts exigés et les possibilités de récupérations | | | | | | |
| Marche en double au-delà d'1 mois | | 2 | | | 2 | | 4 | Les mesures déployées ont permis de prévenir les principaux risques de cette nature. Ces mesures sont renforcées par de nouvelles ressources (CDP / prestataires, ...), jusqu'à la stabilisation de l'ensemble des lots. |
| Risque de surcharge de travail induite par la bascule | | 2 | | | 2 | | 4 | |
| Mobilisation dense des équipes pour réaliser le plan de formation dans les temps contraints | | 2 | | | 2 | | 4 | |
| Adaptation ergonomique de la solution SI insuffisante ou dégradée | | 2 | | | 2 | | 4 | |

Annexe 1 – Les risques psycho sociaux – MEP 1, 2 et 3.1 [2/2]

| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque |
|--|---------------------------|---|---------------|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|---|
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | |
| Phase post-projet lots 1 / 2 et 3.1 | | Deux temps de cotation : au lancement du projet (grille 1 et 2 à remplir) et une nouvelle cotation avant à la mise en place de l'application (par ex au COPIL de GO/NO GO) | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des valeurs et exigences du collaborateur | | Risques qui sont liées à des exigences en tension entre les attentes individuelles de parcours professionnel et les exigences de l'entreprise à court terme ou entre les contraintes professionnelles et la vie hors travail, | | | | | | |
| Décalage entre compétences existantes et attendues | 1 | | | 1 | | | 1 | Mise en place de mesures de suivi et de plans de vigilance accrus, notamment envers les équipes de la comptabilité (prestations en fin de chaîne). Par ailleurs une task force est mise en place avec l'éditeur pour prévenir tout risque de dégradation de service en cas de décalage du |
| Sentiment de perte de performance individuelle/collective | | | 4 | | 2 | | 8 | |
| Dégradation de la qualité de service produit | | | 4 | | 4 | | 16 | |
| Impacts conséquents sur l'ergonomie du travail | | 2 | | | 4 | | 8 | |
| Livraison de la solution incomplète au regard des processus métier | | 1 | | | 4 | | 4 | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des comportements | | Risques qui sont liées aux relations interpersonnelles, entre les groupes et/ou entre les individus | | | | | | |
| Démotivation des utilisateurs | | 2 | | | 2 | | 4 | Accompagnement managérial Soutien RH |
| Sentiment de perte d'expertise métier | 1 | | | 1 | | | 1 | Exploitation RH des supports EPA et repérage des situations sensibles Revue de personnels orientées SIGMA |
| Perturbation dans le fonctionnement des services impactés | | 2 | | | 2 | | 4 | Entretiens RH spécifiques post MEP avec TOUS les agents concernés - Déploiement du parcours de formation managérial SIGMA monté en lien avec l'Université du Management. |

Annexe 2 – Les risques psycho sociaux – MEP 3.2 & 3.3 et 4 [1/4]

Grille 2 : Evaluation des projets SI sur la typologie des risques psycho-sociaux

| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque | | |
|---|---------------------------|---------------|---|------------------|---------------|---------------|--|--|----|--|
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | | | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | | | |
| Phase projet lots 3.2 / 3.3 / 4 | | | | | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des changements de travail | | | Risques qui sont liées à des changements organisationnels des contextes de travail | | | | Toutes actions qui permettront de minimiser le risque de rejet de la solution et d'accompagner les utilisateurs | | | |
| Remplacement d'une version ancienne et structurante pour l'activité (supérieure à 10 ans) | | | | | 4 | | | 4 | 16 | Le choix initial du fournisseur MUREX a intégré ces aspects dès le lancement de la phase d'appel d'offre. Le calendrier global du projet a été resserré pour limiter les périodes de marche en double et réduire les tensions sur la production. Plusieurs ajustement organisationnels sont opérés tout au long u projet et notamment une nouvelle répartition des activités entre SM1 et SM3 qui est en cours réflexion à DPF |
| Choix d'une solution packagée difficile à intégrer dans le SI | | | | 2 | | | 2 | 4 | | |
| Evolution significative du mode d'organisation du projet | | | | | 4 | | | 4 | | |
| impact organisation ponctuel | | | | | 4 | | | 4 | | |

Annexe 2 – Les risques psycho sociaux – MEP 3.2 & 3.3 et 4 [2/4]

| Grille 2 : Evaluation des projets SI sur la typologie des risques psycho-sociaux | | | | | | | | |
|--|---------------------------|---|---------------|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|--|
| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque |
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | |
| Phase projet lots 3.2 / 3.3 / 4 | | | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des contraintes de travail | | Risques qui sont liées à des contraintes entre les objectifs de travail et les moyens mis à disposition ou entre le niveau de prescription et les marges de manœuvre possibles ou entre les efforts exigés et les possibilités de récupérations | | | | | | |
| Déficit des ressources métier et/ou SI | | 2 | | | 2 | | 4 | Des renforts spécifiques dédiés SIGMA supplémentaires ont été affectés au projet : 4 CDP et 2 prestataires à compter de nov. 2019 |
| Manque de compétences | | 2 | | 2 | | | 4 | L'ensemble des dispositions de conduite du projet sont réajustées afin de palier ce risque, notamment les formations outils afin que celles-ci soient mieux en adéquation avec les dates de mise en production et / ou de test. |
| Exigences de reporting/ impacts administratif important | | 2 | | 1 | | | 2 | Conditions inchangées par rapport aux lots SIGMA antérieurs. |
| Impacts sur conditions de travail (besoins locaux, moyens de communication à calibrer,...) | | 4 | | | 2 | | 8 | Conditions inchangées par rapport aux lots SIGMA antérieurs à l'exception de la conception du lot 4 pour laquelle une recherche de locaux adaptés est en cours avec le service immobilier de l'EP |
| Impacts conséquents sur la révision des procédures et des process métiers | | | 4 | | 2 | | 8 | Tous les process de gestion sont analysés et réécrits. Ceci constitue une phase inhérente au projet prise en charge dans le phasage intégré à la gestion courante. |
| Programmation de contraintes horaires sur les équipes projets | | 2 | | | 2 | | 4 | Les périodes d'astreintes liées aux MEP seront anticipées pour les lots 3.2/3.3 et 4 comme elles l'ont été précédemment, permettant une gestion prévisionnelle du temps de travail hors plages horaires. Par ailleurs la DSI a demandé l'ouverture anticipée d'un CDP supplémentaire pour les nouveaux entrants. |

Annexe 2 – Les risques psycho sociaux – MEP 3.2 & 3.3 et 4 [3/4]

Grille 2 : Evaluation des projets SI sur la typologie des risques psycho-sociaux

| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque |
|---|---------------------------|---------------|---------------|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|---|
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | |
| Phase projet lots 3.2 / 3.3 / 4 | | | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des valeurs et exigences du collaborateur | | | | | | | | |
| Risques qui sont liées à des exigences en tension entre les attentes individuelles de parcours professionnel et les exigences de l'entreprise à court terme ou entre les contraintes professionnelles et la vie hors travail, | | | | | | | | |
| Manque de partage des enjeux et objectifs du projet ("le sens") | 1 | | | 1 | | | 1 | Actions de communication renforcées et organisées autour de 3 axes : la communication managériale 'Grandissons ensemble' / des réunions d'information directes et plus fréquentes / une communauté Next active |
| Sentiment de déficit de reconnaissance de la contribution individuelle | | 2 | | | 2 | | 4 | Rédefinition du dispositif de "primes SIGMA" défini avec la DRH à l'origine du projet. |
| Sentiment d'insatisfaction sur le livrable final | | | 4 | | 2 | | 8 | Travail au niveau managérial sur les dissonances entre le ressenti exprimé dans les équipes et les travaux menés en vue, notamment, d'alimenter les 'Rencontres SIGMA' afin de redonner une 'vision marketing' au projet pour en réexprimer le sens. Accompagnement des métiers renforcé avec la gestion de Patrimoine, Formalisation et mis en place du dispositif post-démarrage pour mieux accompagner les utilisateurs |
| Impacts sur la culture d'entreprise | 1 | | | 1 | | | 1 | L'ensemble des travaux induits par le projet amène les équipes de DPF et de DEOF à travailler en synergie et à partager de nouveaux process communs. Cette transversalisation de la gestion dans une logique 'bout-en-bout' induit une évolution de la culture propre à chacune des deux direction et favorise leur décloisonnement. |
| Absence de certaines expertises dans le groupe projet | 1 | | | 1 | | | 1 | Sans objet (recours à des prestataires et fournisseurs spécialisés) |

Annexe 2 – Les risques psycho sociaux – MEP 3.2 & 3.3 et 4 [4/4]

Grille 2 : Evaluation des projets SI sur la typologie des risques psycho-sociaux

| Qualification du risque | Probabilité de survenance | | | Niveau de risque | | | Total | Plan d'actions de réduction de la survenance du risque |
|--|---------------------------|---------------|---|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|--|
| | Peu ou pas probable | Probable | Très probable | Faible | Moyen | Fort | Probabilité x niveau risque | |
| | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | coefficient 1 | coefficient 2 | coefficient 4 | Total | |
| Phase projet lots 3.2 / 3.3 / 4 | | | | | | | | |
| Risques identifiés sur des tensions du côté des comportements | | | Risques qui sont liées aux relations interpersonnelles, entre les groupes et/ou entre les individus | | | | | |
| Mécommunication / dialogue entre pilotage et équipe opérationnelle | | 2 | | 1 | | | 2 | Mise en place de mesures d'information ponctuelles (réunions d'information / flash info communauté SIGMA) et de nouvelles réunions ponctuelles d'information sur tous sujets opérationnels nécessitant explication. |
| D'impact sur la qualité du management (manque d'écoute, trop en contrôle, ...) | | 2 | | | 2 | | 4 | Mise en place d'un dispositif de formation managériale "sur mesure" SIGMA monté en lien avec l'Université du Management et s'inscrivant dans le cadre 'Grandissons ensemble'. |
| Sur la définition du rôle de chacun sur le projet | | 2 | | 1 | | | 2 | Mise en place d'un "comité décisionnaire" hebdomadaire permettant de suivre en temps réel les orientations et décisions prises par chacun au fil de l'eau. Mise en place à DEOF d'un planning de suivi de l'ensemble des ressources (opérationnel / projet). |

Annexe 3 – Planning « prévu / réalisé »

| LOT | Date prévue (CET lancement 2017) | Date réalisée à Février 2021 |
|-------------------------|----------------------------------|--|
| MEP1 (Référentiel) | Q1 2018 | Q2 2018 (avec la fin diffusion au 30/06/2019) |
| MEP2 (Actions) | Q4 2018 | Q1 2019 |
| MEP3 (Autres actifs) | Q1 2020 | Q1 2021 |
| MEP4 (Clients externes) | Q4 2020 | Q3 2021 (à venir) |
| OMS (Intermédiation) | Q4 2021 | A planifier en 2022 (car besoin de faire un changement de version) |

caissedesdepots.fr



Fin de document