

NOTRE OFFRE ASSET MANAGEMENT

Nexialog Consulting accompagne les *Asset Manager* dans leurs problématiques de gestion, de risques et de reportings.

Le contexte actuel d'investissement est marqué par le niveau des taux d'intérêt très bas, les perspectives d'une croissance limitée sur les marchés actions et une compétition accrue sur les performances des fonds proposés et les frais prélevés.

A cela s'ajoute des exigences réglementaires en constante évolution avec le renforcement de la protection des investisseurs et les contraintes spécifiques au secteur de l'Asset Management.

Grâce à nos équipes d'experts, Nexialog Consulting répond à vos enjeux actuels et à venir.

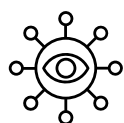
Les défis :

- Gagner des parts de marché en renouvelant l'offre avec des produits innovants, performants toujours plus orientés vers les clients ;
- Rester compétitif en optimisant les coûts, en rationalisant le choix des fournisseurs et les gammes produits, en industrialisant les processus de production et en saisissant la transformation digitale ;
- Les changements réglementaires qui nécessitent d'instaurer une vraie culture du risk management et aussi de collecter et fournir toujours plus d'informations aux assurés pour les protéger.

Nexialog Consulting et son département Global Markets (GM) :

GM accompagne les sociétés de gestion d'actifs et les directions d'investissements de grandes compagnies d'assurance. Composé d'ingénieurs, chefs de projet, experts métiers avec une parfaite maîtrise des systèmes d'information financiers, GM propose des approches innovantes, performantes et robustes en s'appuyant sur ses principaux atouts :

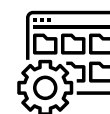
- Une connaissance approfondie de votre environnement
- Une approche multi-expertises grâce à la diversité et à la qualité de ses consultants
- Un savoir-faire reconnu



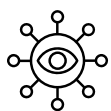
**Modélisation et
Analyses**



Réglementations



**Système
d'information et
Data Management**



Modélisation et analyses

Vos enjeux : Nouveaux modèles et nouveaux sous-jacents

- Nouveaux modèles, adaptations et validations en allocation d'actifs ou solutions d'investissement
- Recherche de performance : Trouver des alternatives crédibles aux fonds traditionnels et aux fonds en euros.
- Création ou amélioration de reportings sur des informations financières (performance, risques, attribution de performances, ...) ou extra-financière pour les professionnels et pour les clients.
- Nouveaux sous-jacents : ISR et critères ESG, fonds thématiques, ...

Nos domaines d'intervention :

- Modélisation des produits dérivés et structurés
- Calculs de métriques de risque et de stress tests
- Implémentation d'outils d'aide à la sélection
- Contrôles de limite, backtesting d'indicateurs
- Reportings intelligents et d'attribution de performance,

Notre savoir-faire :

- Expertise en modèle de calcul de risque/performance
- Mise en œuvre du modèle : codage, simulations, scénarios économiques, tests d'impact
- Gouvernance et documentation détaillée
- Suivi de projet pour la mise d'outils et de reportings
- Accompagnement des équipes (Ateliers, formations)

Exemples de missions réalisées :

Valorisation produits structurés | Modélisation et valorisation d'obligations structurées, Validation des cash flows des produits exotiques, Explication de P&L, suivi des indicateurs de marché et génération de KPIs, Mise en place d'un outil de calcul de sensibilité du prix des produits structurés aux variations du marché

Alternatives au fonds en € | Constitution de dossiers d'offre d'investissement sécurisées (fonds à protection permanente ou structurées) pour la clientèle patrimoniale : comparaison (forces et faiblesses), création de produits.

Règlementations



Vos enjeux : Nouvelles réglementations et impacts opérationnels

- Obligations vis-à-vis des autorités de tutelle : calculs, reportings, audit, collecte d'informations.
- Obligations vis-à-vis des clients : KYC, reportings, suivi ...
- Obligation réglementaire : calculs, rentabilité des activités, attribution de performance, ratio risque/rentabilité, limite d'engagement stratégie d'investissement, etc...
- Reportings internes et externes (BCE, ESMA, AMF, etc ...)

Nos domaines d'intervention :

- Mise en conformité PRIIPS (Sécurisation Data tout au long de la chaîne et mise en conformité des reportings)
- Politique ISR, critères ESG et Green Investment
- Réglementation Benchmark
- Expertise sur tous les sujets réglementaires en vigueur (UCITS IV, AIFMD, EMIR, KYC, MIFID II, ...)

Notre savoir-faire :

- Réactivité et adaptabilité vis-à-vis des nouvelles réglementations grâce à la veille permanente
- Coordination des équipes pour pouvoir y répondre
- Suivi de projet pour la mise en place de la réglementation et l'automatisation des process
- Accompagnement des équipes (Ateliers, formations)

Exemples de missions réalisées :

EMIR | Migration du système front-to-back de la direction des investissements dans le cadre de la réglementation EMIR, Reportings réglementaires sur les dérivés (positions, collatéral, valorisation, couverture asset-swap)

Extension du programme d'activité aux instruments financiers complexes | Direction des risques : Valorisation indépendante et calibration des seuils de contrôle sur des produits Autocalls (Athena et Phoenix) et Obligations Contingentes Convertibles



Système d'information et Data Management

Vos enjeux :

- Rationalisation du système d'information
- Prise en compte de nouveaux périmètres (pays, sous-jacent, marché),
- Amélioration de la qualité de la donnée
- Migration de systèmes, changement de modèle

Nos domaines d'intervention :

- Automatisations de process métiers
- Développement d'outils risque et middle-office
- Projets de migration de système front-to-back
- Industrialisation de reportings réglementaires, de performance et de production financière
- Reportings innovants à l'aide d'outils data viz (Tableau, Spotfire, Click ...)

Notre savoir-faire :

- Nouvelles technologies, digitalisation, automatisation des process
- Data sciences : certification, Machine learning (codage, apprentissage, tests)
- Langages : Python, R, Matlab, SAS, ...
- Big Data au service du traitement des données
- Projets, Workflow : partage des informations entre les équipes, outil de communication
- Accompagnement des équipes (Ateliers, formations)

Exemples de missions réalisées :

Migration d'un système front-to-back | Accompagnement d'une direction des investissements : migration des positions sur valeurs mobilières, produits structurés dans SimCorp Dimension.

Monitoring actifs financiers | Assurer un monitoring économique et comptable quotidien/mensuel de l'ensemble du portefeuille du groupe (couvrant une large gamme d'actif financiers physiques et dérivés), Définition et mise en place de reportings quotidiens/mensuels pour tout le portefeuille, Définition des données nécessaires et participation à l'architecture et à la création du data lake selon l'approche BIG Data





Notre méthodologie générale d'intervention

Nexialog Consulting a pour particularité d'avoir une approche très opérationnelle qui s'adapte à chaque situation. Nous sommes à l'écoute de vos demandes et nous vous proposons les solutions les plus adaptées sur le long terme. Tout au long du déroulement de la mission, Nexialog met en place une gouvernance qui s'engage sur la qualité de service de la prestation effectuée.

**Votre projet
Votre besoin**

01

Lancement de la mission :

Confirmer le périmètre, le budget et les jalons du projet ; Formuler les objectifs et enjeux ; Identifier les livrables clés ; Définir la gouvernance ; Identifier les risques, les dépendances et les contraintes > **Rédaction d'une note de cadrage et kick-off**

02

Analyse de l'existant :

Conduire des entretiens ; Documenter l'organisation, les processus et les systèmes en place ; Identifier forces et faiblesses > **Expression des besoins**

03

Définition de la solution cible :

Présenter les scénarios envisagés ; Fournir une analyse documentée et chiffrée des coûts et gains pour ces solutions > **Validation de la cible**

04

Analyse des écarts :

Identifier les activités nécessaires pour atteindre la cible ; Documenter les impacts en termes d'organisation, processus, outils et systèmes. > **Produire les spécifications générales**

05

Définition de la trajectoire pour atteindre la cible :

Planning, lotissement, gouvernance, chemin critique et documentation > **Feuille de route et budget**

GO



Recherche & Développement

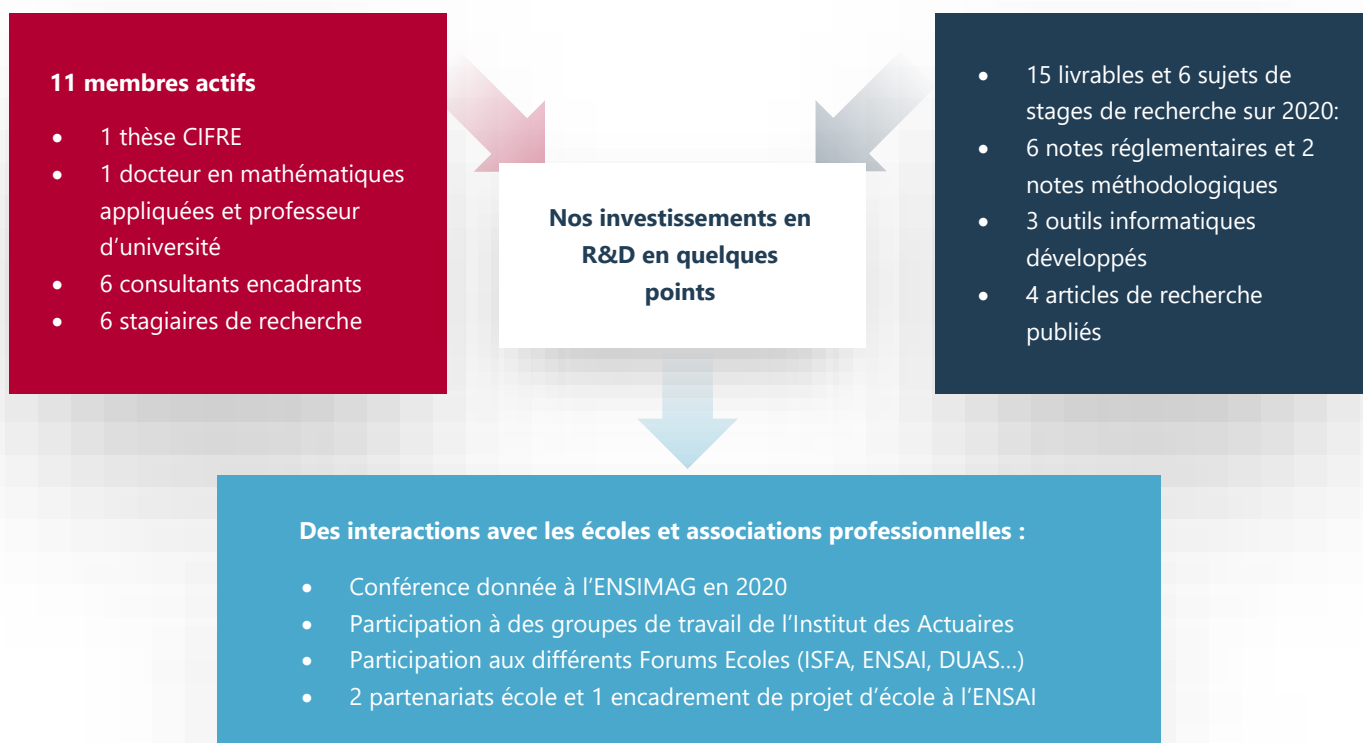
Un acteur clé de notre partenariat

Notre département R&D s'appuie sur nos équipes pluridisciplinaires (Financiers, Risk Management, Actuaire, Data Scientists), pour conduire nos travaux de Recherche, nous permettant d'être au fait des dernières évolutions du secteur, à la fois réglementaires, méthodologiques et techniques :

- **Actualité réglementaire Asset Management** : PRIIPS, EMIR, Benchmark, ESTR, UCITS, ISR, Directive AIFM etc...
- **Actualité réglementaire Banque** : Bâle 2 et 3, FRTB, IFRS 9, Anacredit, exercices TRIM, exercices de Stress-tests, xVA, Initial Margin, transition IBOR etc...
- **Développement d'une expertise Datascience** : Modèles de Machine Learning, Business Intelligence (Tableau Software, Spotfire, Qlickview), Big Data

L'équipe a ainsi mis en place un programme visant à **diffuser la connaissance** auprès de nos **collaborateurs** et de nos **clients**, permettant la construction de partenariats pérennes avec nos clients

- Publications **d'articles** dans des revues spécialisées
- Publications de **notes internes**
- Mise en place d'un **programme de formation** par des intervenants externes ou internes (exemples : « Bâle 3 risque de contrepartie », « Les méthodes de provisionnement en assurance », « Le risque opérationnel », « La blockchain », etc.)
- **Présentation de retours d'expérience** dans le respect des règles de confidentialité sur des problématiques similaires
- Des partenariats de Recherche chez nos clients (conférences, travaux en commun...)

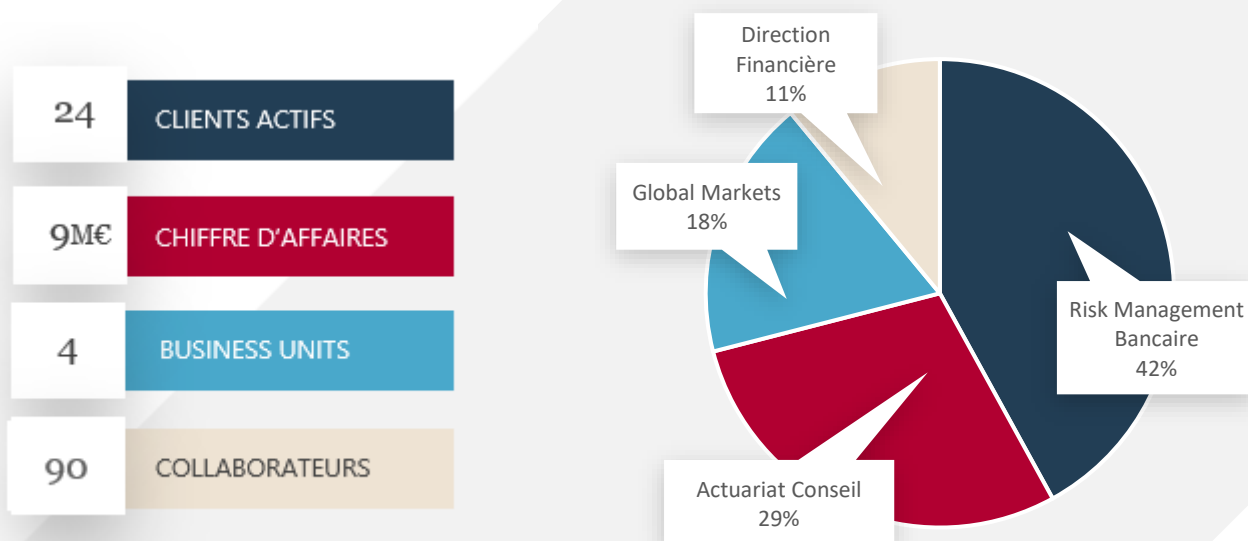


Nexialog Consulting en quelques mots

Cabinet de conseil indépendant en actuariat, gestion des risques et services financiers, Nexialog Consulting connaît une croissance forte et régulière depuis sa création en 2006.

Organisés autour de nos quatre pôles d'expertise (Actuariat Conseil / Risk Management Bancaire / Global Markets / Direction Financière), Nexialog Consulting s'est imposé ces dernières années comme un acteur de référence dans le secteur du conseil.

Fort de ses 90 collaborateurs, le cabinet accompagne les plus grands acteurs de l'assurance et de la banque afin de répondre à leurs enjeux opérationnels et réglementaires.



Ils nous font confiance...



SOCIETE GENERALE



banque et assurance
vous, tout simplement

BNP PARIBAS
CARDIF

BNP PARIBAS



malakoff humanis

NATIXIS

SwissLife

PROBTP

CRÉDIT AGRICOLE
CORPORATE & INVESTMENT BANK

CA

ASSURANCES



NOUS CONTACTER



Ali BEHBAHANI

Associé Fondateur

Tel. : +33 (0)1 44 73 86 78

Mob. : +33 (0)6 64 23 58 19

abehbahani@nexialog.com



Christelle BONDOUX

*Associée,
Directrice Commerciale et
Recrutement*

Tel. : +33 (0)1 44 73 75 67

Mob. : +33 (0)6 99 30 42 49

cbondoux@nexialog.com



Paul-Antoine DELETOILLE

*Responsable de Compte
Global Markets*

Tel. : +33 (0)1 44 73 75 70

Mob. : +33 (0)7 64 57 86 69

padeletoille@nexialog.com



Pierre GINESTE

*Manager
Global Markets*

Mob. : +33 (0)6 12 68 29 71

pgineste@nexialog.com



Eric BAESEN

*Senior Manager
Global Markets*

Mob. : +33 (0)7 70 34 64 62

ebaesen@nexialog.com

THINK SMART, ACT DIFFERENT

110, avenue de la
République 75011 Paris

France

+33 (0)1 44 73 75 60

www.nexialog.com

© Mai 2021- Nexialog Consulting

Tous droits réservés