

Asset Management

Dans un contexte de fortes **exigences réglementaires** et de **performance**, ainsi que de baisse des frais de gestion, disposer d'une organisation et d'outils **efficaces** comme **évolutifs** devient clef pour les acteurs de la gestion d'actifs.

Command Strategy vous accompagne dans le **choix** et **l'implémentation** du modèle « **best in class** » pour votre organisation.

Une couverture de bout en bout de la chaîne de la gestion d'actifs

OPTIMISER LA GESTION DES INVESTISSEMENTS ET LA MESURE DES RISQUES, AU SEIN D'UN SEUL ÉCOSYSTÈME, EN PILOTANT LE PLUS EN AMONT POSSIBLE LA CHAÎNE DE VALEUR...



Un large éventail d'expertises

Portfolio management

- Optimisation de l'allocation Actif / Passif
- Modélisation des instruments et des opérations
- Analyse financière et sélection de titres
- Tableaux de bord de pilotage, simulation, Compliance pre/post trade et passage d'ordres
- Réconciliation titre & cash
- Tenue de position et Valorisation
- Mesure de performance, Transparisation



Référentiels / Data Management

- Gestion des Référentiels Portefeuilles, Valeurs, Tiers et de marché
- Mise en place d'un Référentiel Centralisé avec une « Golden Copy »
- Connexion optimisée aux data providers
- Optimisation de la gouvernance et de la qualité de la donnée (Dictionnaire)



Transformation

- Pilotage de programmes de transformation
- Diagnostic organisationnel et recommandations (gouvernance, fonctions, processus, contrôles)
- Optimisation de l'efficacité opérationnelle
- Rédaction documentaire (processus, mode opératoire)
- Veille financière et réglementaire



SI

- Définition de schéma directeur et de l'architecture SI cible
- Benchmark et sélection des solutions
- Rédaction du cahier des charges
- Implémentation d'outils : gestion des paramétrages en multi-environnements (DEVOPS), plan de tests, validation et livraison
- Mise en œuvre de stratégie de migration et d'onboarding
- Gestion des upgrades de version et des patches
- Support aux utilisateurs



Exemple de mission

Enjeux et objectifs

Implémentation d'une solution intégrée
Front to Back to Compta to Trésor chez un Asset Manager

Travaux réalisés

- ☑ Rationalisation de l'architecture SI
- ☑ Accompagnement des métiers et conduite du changement
- ☑ Relation éditeur (workshops, négociation, POC, Design authority, ...)
- ☑ Animation des workshops avec les métiers, la DSI et l'éditeur
- ☑ Modélisation des instruments financiers : impacts en gestion, en comptabilité, en trésorerie
- ☑ Diagnostic d'efficacité opérationnelle
- ☑ Interface du PMS avec les ERP de comptabilité et de trésorerie
- ☑ Développement de reportings via des outils BI

Enjeux et objectifs

Mise en place d'algorithmes de calcul
de ratings internes chez un grand Assureur

Travaux réalisés

- ☑ Implémentation des algorithmes d'alimentation des *direct ratings* des 3 agences (Moody's, S&P, Fitch)
- ☑ Implémentation des algorithmes de calcul des ratings internes :
 - ✓ Note Second Best ;
 - ✓ Note de synthèse émission et émetteur selon les critères de la Direction des Risques (titrisation, séniorité, ...);
 - ✓ Note de synthèse IFRS 9 (prise en compte de forçage métier, reprise historique, Watch list, données sensibles, ...).

Nos domaines d'intervention



ASSET MANAGEMENT

- Mise en œuvre Front-to-Back-to Compta., avec lien trésorerie
- Toutes classes d'actifs : VMOB, Monétaire, Non Cotés, Dérivés

OFFRES CLÉS :

- Référentiel - Data Management
- Portfolio Management
- Investment Management
- Fund Accounting
- Sélection et migration d'outils



ALM

- ALM assurantiel et bancaire
- Modélisation et projection de l'actif financier & du passif économique
- Calcul d'indicateurs de risques

OFFRES CLÉS :

- Allocation d'actifs sous contraintes
- Elaboration de stratégies d'investissement
- Réalisation de stress-tests



RISK MANAGEMENT

- Optimisation du suivi des risques de marché et de crédit
- Gouvernance, Risques, Conformité (GRC)

OFFRES CLÉS :

- Gouvernance des risques
- Calibration de modèles (dont LGD, PED, VaR)
- Gestion du risque opérationnel



RÉGLEMENTAIRE

- Veille réglementaire
- Cadrage et déclinaison des règles
- Simulation et analyse d'impacts
- Mise en œuvre multinormes

OFFRES CLÉS :

- French Gaap, Loi Pacte
- IFRS (IAS 39, IFRS 9 & IFRS 17)
- S2
- EMIR, MIFID, FRTB
- ISR / ESG



COMPTABILITÉ

- Accompagnement des Directions Financières et Comptables
- Appui au contrôle de gestion
- Administration des systèmes

OFFRES CLÉS :

- Comptabilité Générale & Technique
- Comptabilité des Placements
- Comptabilité Bancaire
- Interpréteurs comptables
- Fast close

IT - DATA SCIENCE



- Évolution de schéma directeur
- Sélection d'outils (RFI, RFP, POC)
- Conception d'outils : internes cabinet ou internes aux clients
- Design Authority
- Implémentation de solution
- Support aux opérations

OFFRES CLÉS :

- Optimisation de la gestion de la donnée (Data Governance)
- BIG DATA & Reporting BI
- DATA SCIENCE
- Partenariats et expertise : SAS, IBM, Qlik, Microsoft, Alteryx

Command Strategy

Un cabinet récent et indépendant, spécialisé en services financiers, qui accompagne les Asset Managers, Assureurs, Asset Servicers, Banques et Organismes gouvernementaux dans la réalisation de leurs projets.

Couvrant toute la chaîne du conseil, de l'analyse stratégique à la mise en œuvre opérationnelle, Command Strategy met au profit de ses clients sa triple compétence en Finance, SI et en Gestion de projet

Nous Contacter

Command Strategy Advisory,
33 Avenue du Maine, 75015 Paris
01.44.10.42.82
contact@commandstrategy.com
www.commandstrategy.com