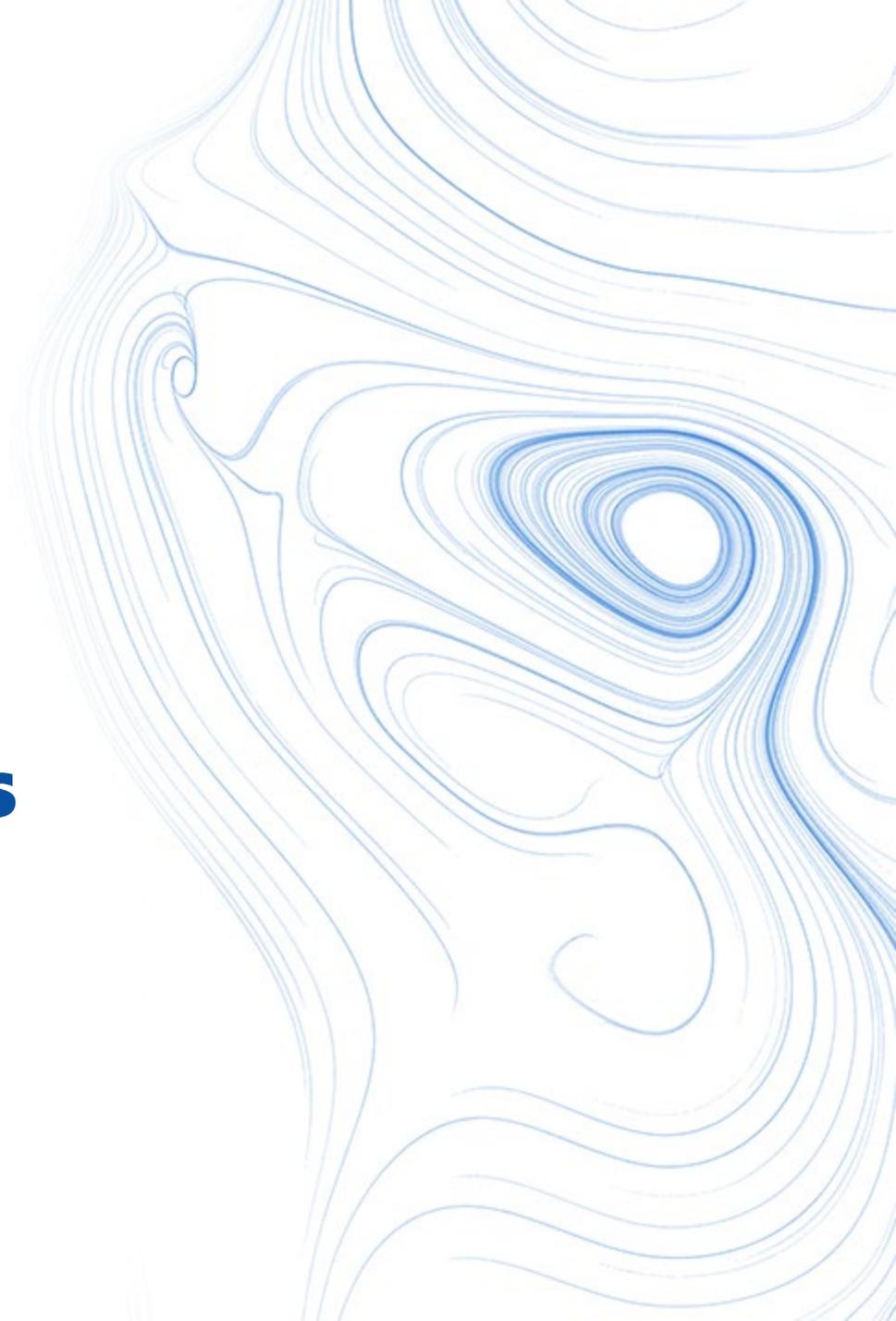




# **Il supporto offerto da Quantalys nella gestione del cliente in periodi di volatilità dei mercati**

27 gennaio 2022





**Quantalys**



**Gli elementi distintivi della piattaforma**



**Contatti**

Quantalys è una **società indipendente** fondata nel 2007 in Francia e specializzata nella fornitura di dati, nell'analisi di strumenti finanziari e nella costruzione e ottimizzazione di portafogli di investimento.

Quantalys apre la sua prima sede distaccata in Italia nel 2016 a seguito di una decennale collaborazione con Benchmark & Style.

Quantalys, forte di un database europeo con più di **250 mila prodotti finanziari**, permette agli investitori ed ai loro consulenti di effettuare analisi su fondi e portafogli di investimento basate su un approccio quantitativo che garantisce **indipendenza ed obiettività**.

Quantalys fonda il suo core business su 3 principali attività:

- 🕒 Fornitura di dati;
- 🕒 Soluzioni informatiche di analisi finanziaria;
- 🕒 Consulenza.



Data



Solutions



Consulting

GENERALI LUXEMBOURG  
NATIXIS LIFE BEYOND BANKING  
AXA  
Rfi-Esca LUXEMBOURG  
CREDIT SUISSE

GROUPE AESIO  
MAIF  
CO vea  
AXA  
NATIXIS WEALTH MANAGEMENT BEYOND BANKING  
BNP PARIBAS  
CNP assurances  
Allianz  
BPCE  
CRÉDIT AGRICOLE  
GENERALI  
ODDO BHF  
CARDIF GROUPE BNP PARIBAS  
SOCIETE GENERALE  
SURAVENIR  
SwissLife

Deutsche Bank  
MONTE DEL PASCHI DI SIENA BANCA DAL 1472  
Allianz Bank  
Banca Popolare Pugliese  
ING  
Banca del Lazio Popolare

MoneyStore.be  
Deutsche Bank  
PROCAPITAL

investir.ch  
LA FINANCE S'ENGAGE



Data

**Quantalys Data** fornisce ed alimenta i database di istituti finanziari e media. Possiede un database composta da **+ di 250 000 prodotti finanziari**.



Solutions

**Quantalys Solutions** offre strumenti e tool di supporto all'attività di consulenza in materia di investimenti (**10 000 licenze**) a più di **6000 FAs** in Europa. Tutti gli strumenti forniti da Quantalys sono MIFID 2 Compliant.



Consulting

**Quantalys Consulting** fornisce a piattaforme, Fas, Private Bankers e Operatori istituzionali tool di supporto nella selezione dei fondi e mette a disposizione i propri Port. Modello in base al profilo di rischio del cliente.

## Qualche esempio per Quantalys Italia



**MONTE  
DEI PASCHI  
DI SIENA**  
BANCA DAL 1472



+ 1100 FAs

**Allianz Bank**



**STATE STREET** GLOBAL  
**SPDR** ADVISORS



1

Quantalys

2

**Gli elementi distintivi della piattaforma**

3

Contatti



**DATABASE PERSONALIZZATO**



**MOTORE DI OTTIMIZZAZIONE PER  
LA SELEZIONE DEI PRODOTTI**



**ANALISI DI PORTAFOGLIO**



**SCOMPOSIZIONE DELLA PERFORMANCE**



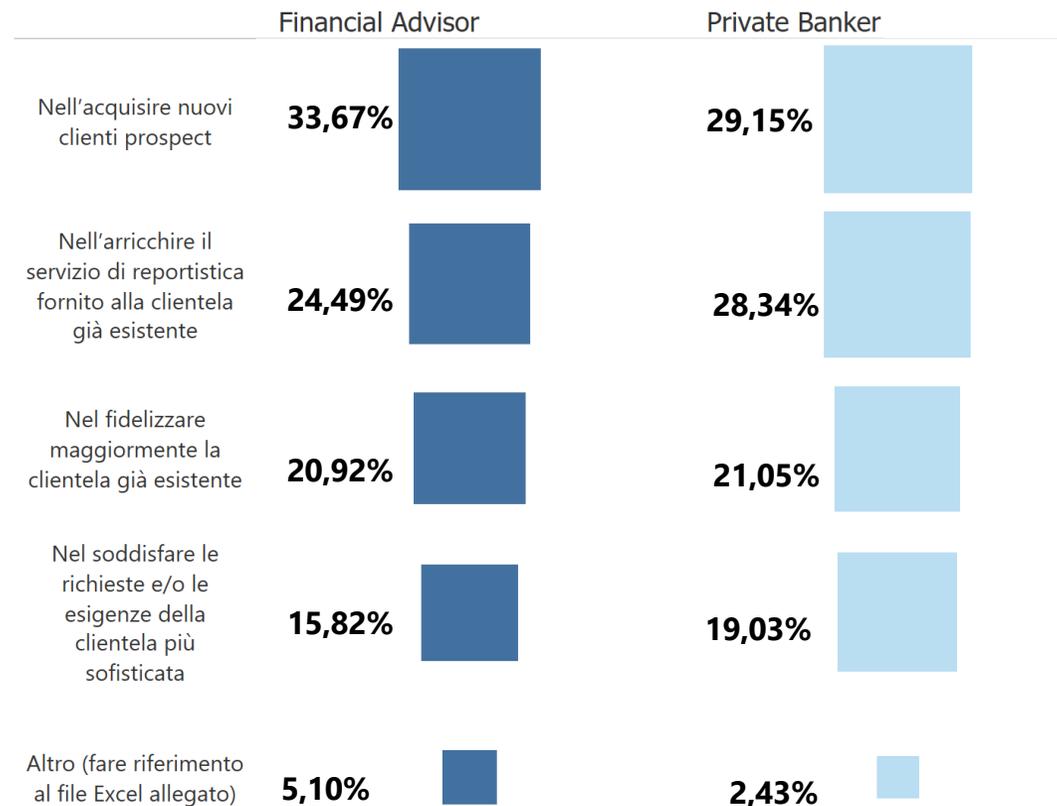
**ASSET ALLOCATION**



**DUE DILIGENCE E CONSULTING**

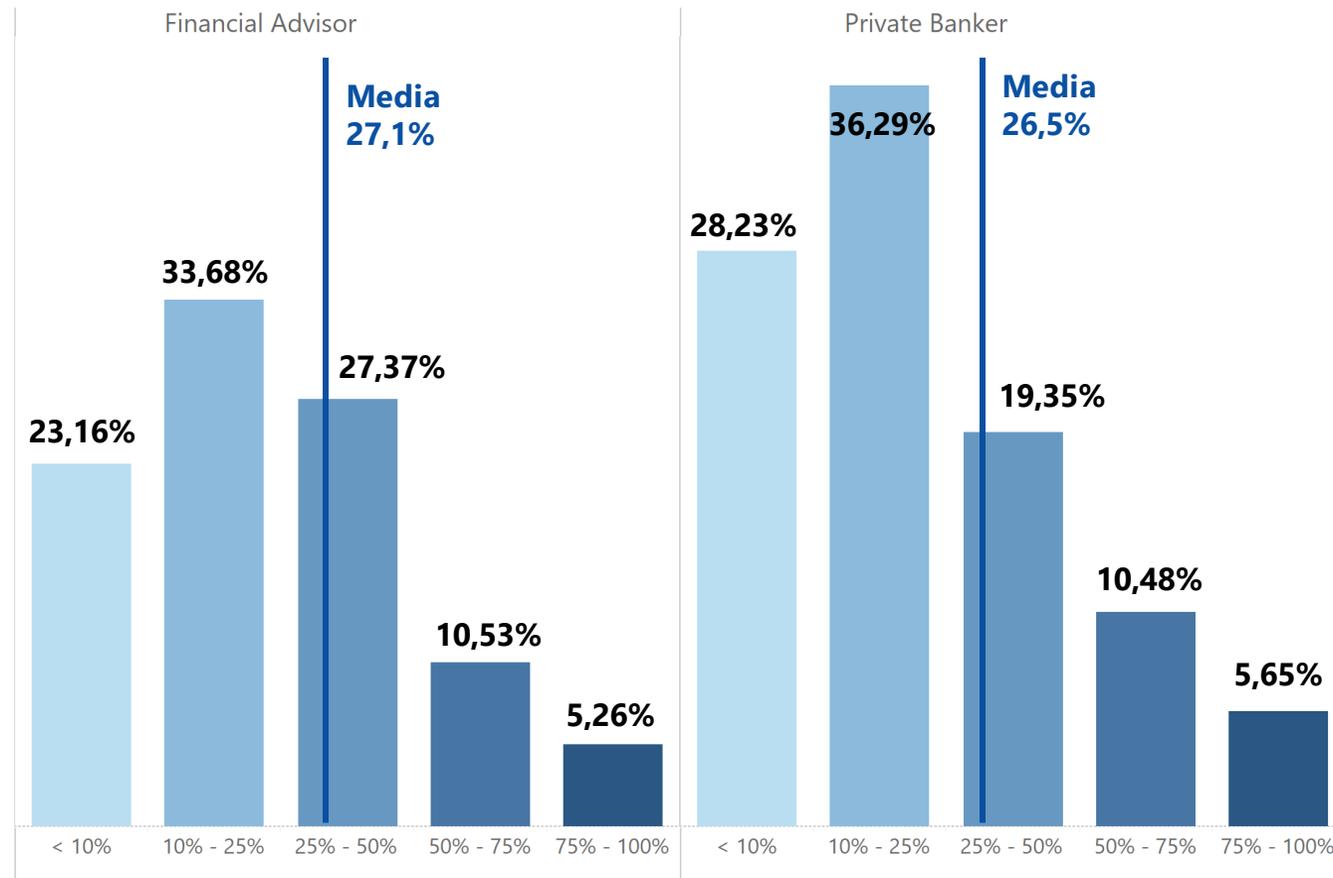
- 1) In quale delle seguenti attività di gestione della relazione con la clientela ritiene che la piattaforma Quantalys l'abbia supportata maggiormente permettendole di raggiungere interessanti risultati?

### Supporto di Quantalys nella gestione con la clientela



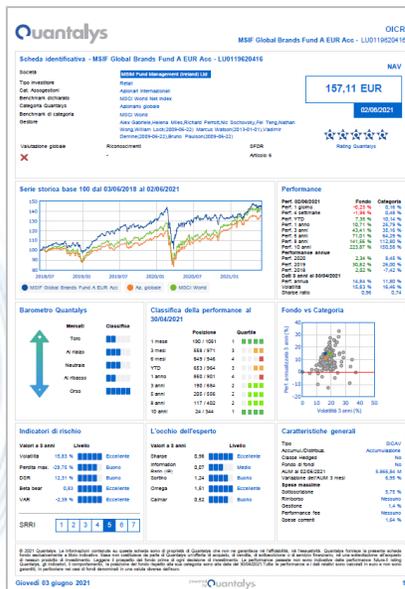
- 2) Ponendo pari a 100 la nuova raccolta da Lei registrata nel corso dell'ultimo anno, quale è la quota parte per la quale l'utilizzo di Quantalys si è dimostrato uno supporto fondamentale?

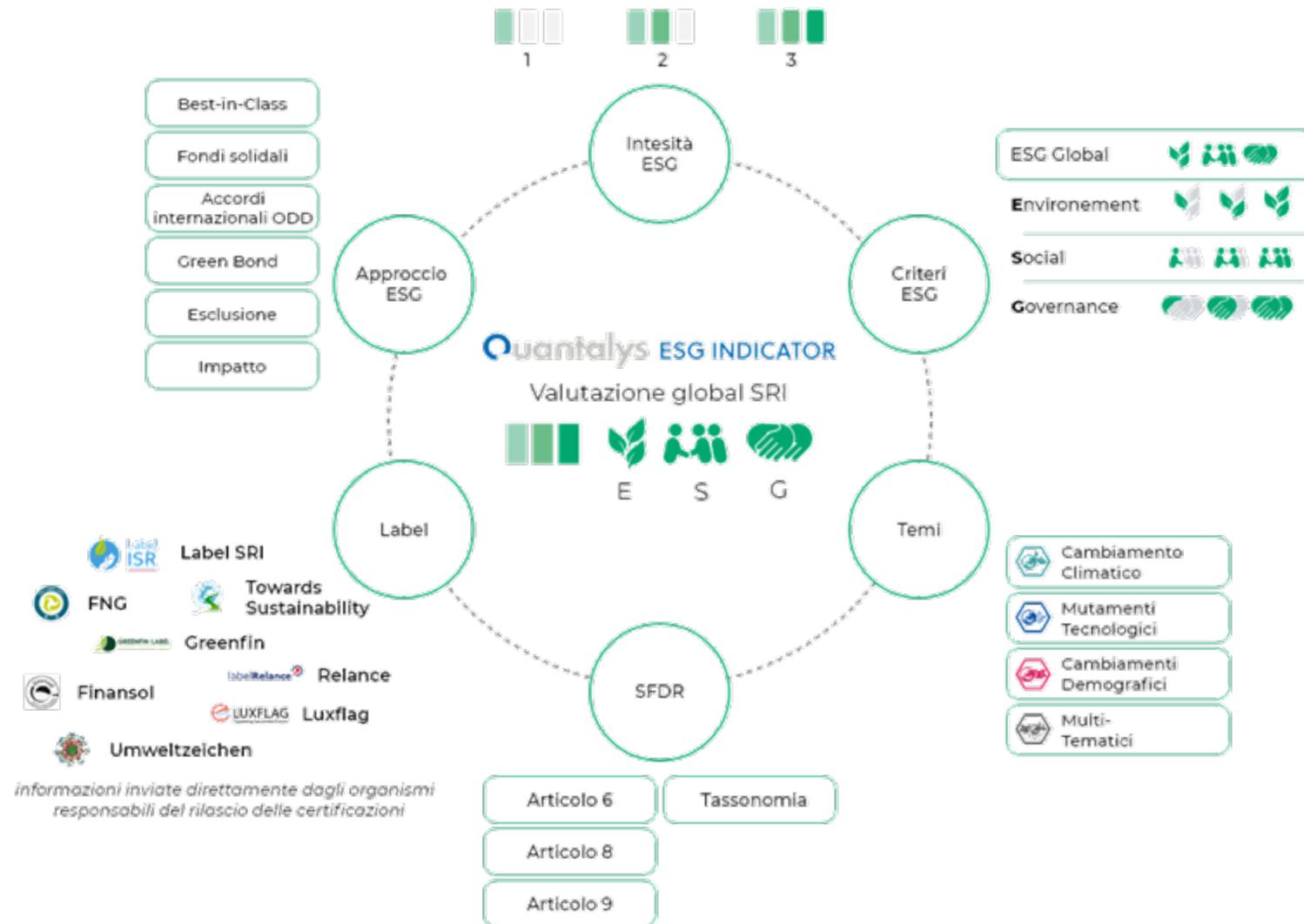
### Nuova raccolta con il supporto di Quantalys



La piattaforma offre la possibilità di arricchire il database Quantalys – indipendente e proprietario - con l’inserimento di **specifici prodotti/strumenti/servizi**.

I tools di ricerca e confronto consentono di analizzare il proprio catalogo prodotti, creare delle short list e mantenerle nel tempo grazie alla possibilità di salvare i criteri di ricerca.



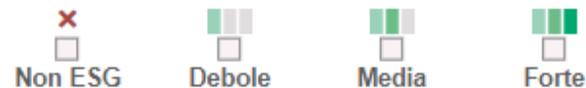


Quantalys ha sviluppato una **metodologia proprietaria per la valutazione e l'analisi ESG** dei fondi per rispondere alla crescente attenzione che gli investitori e le autorità di vigilanza stanno dedicando a questo argomento.

**La classificazione ESG Quantalys** è basata su **quattro assi principali – intensità, criteri, approcci, tematiche** - che hanno ulteriormente arricchito le analisi sia a livello di singolo fondo che di portafoglio.

## Investimenti Sostenibili: Criteri ESG e SFDR

### Intensità ESG



### Domaine ESG ?



### SFDR



Riconoscimenti

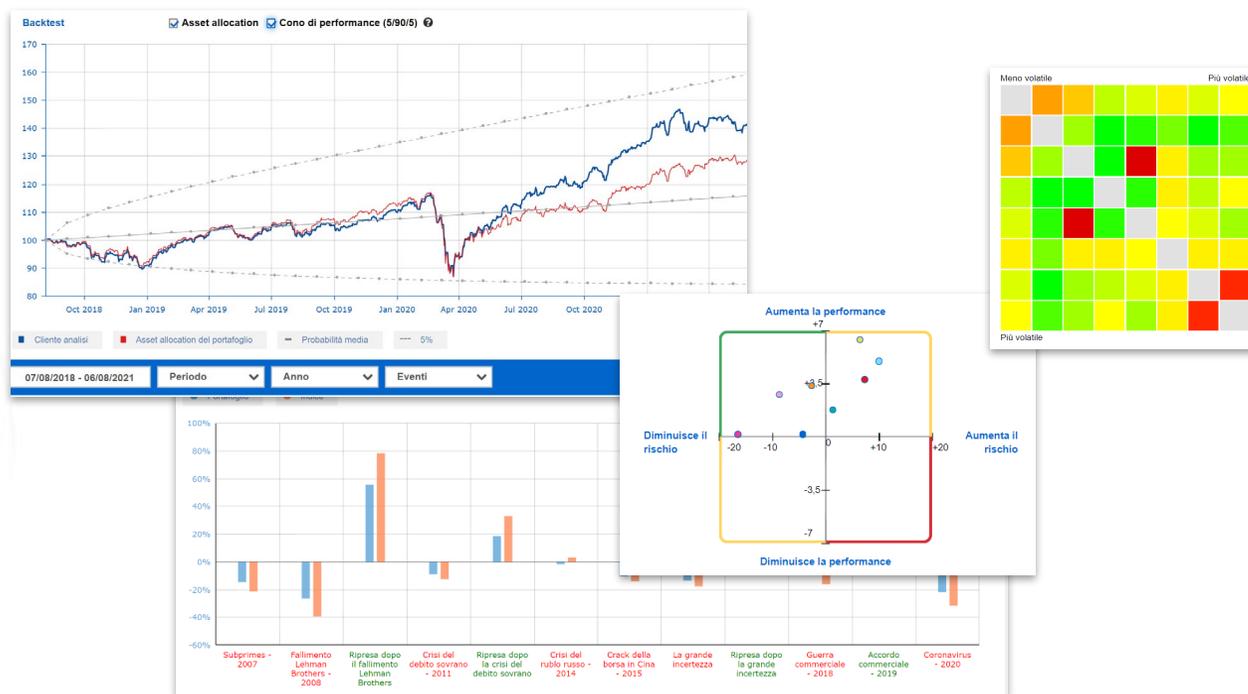
Approccio

### Tematiche

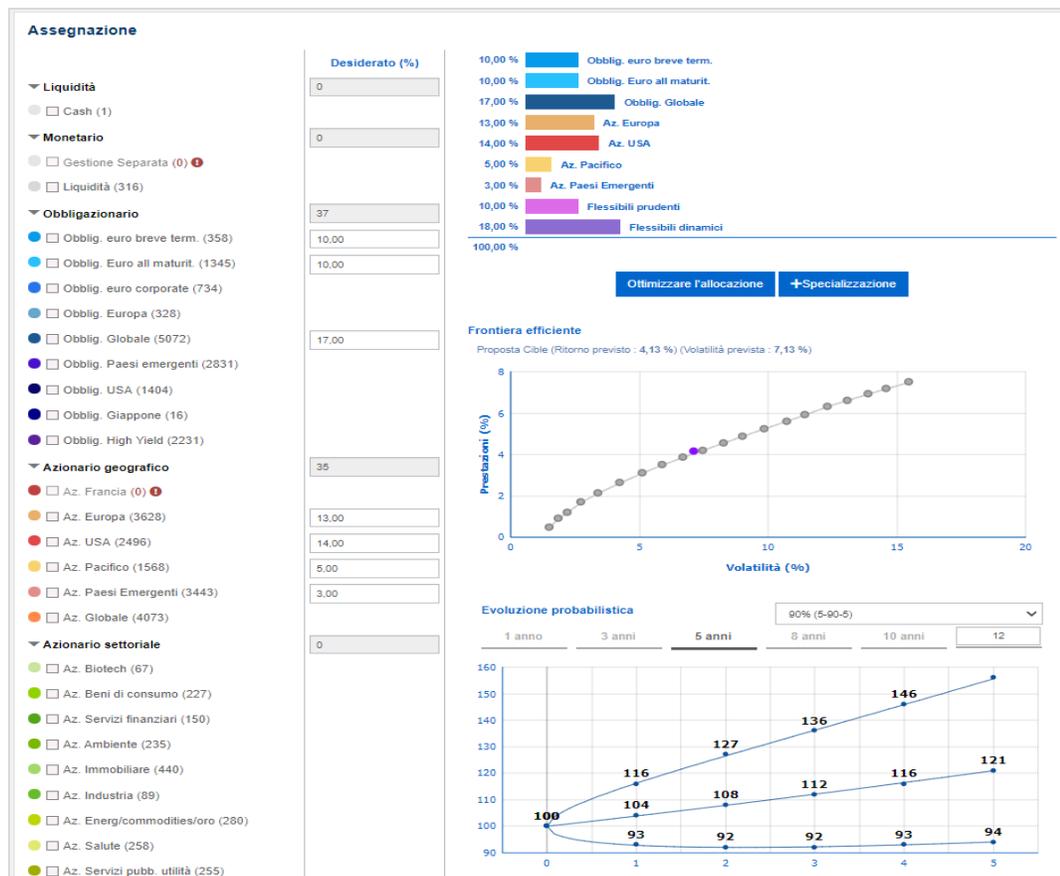
Tematica

La piattaforma offre numerosi tools di analisi del portafoglio quali ad esempio:

- il posizionamento del portafoglio rispetto ai portafogli modello della frontiera efficiente Quantalys per valutare l'efficienza del trade off rendimento/rischio;
- l'analisi del contributo marginale al rendimento ed al rischio dei prodotti presenti nel portafoglio.



Quantalys e B&S elaborano portafogli modello in asset class per l'asset allocation strategica e tattica con metodologie che favoriscono la diversificazione di portafoglio e la robustezza delle stime.



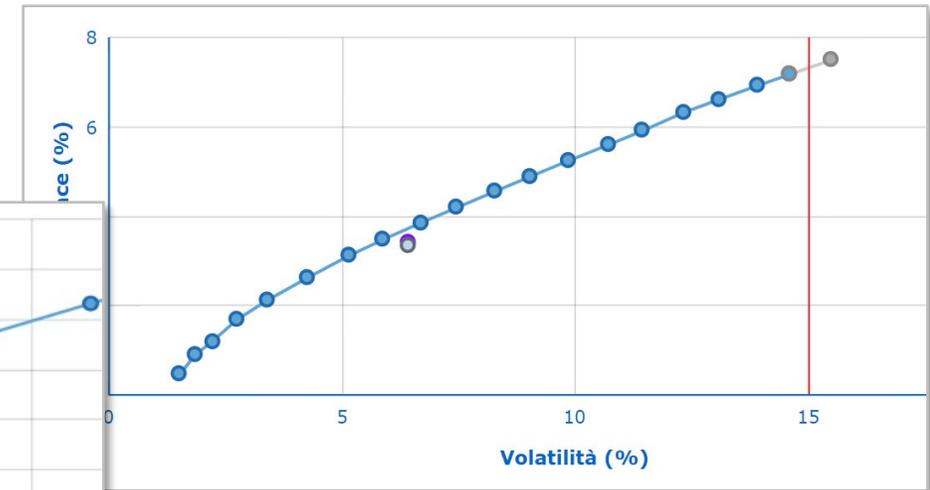
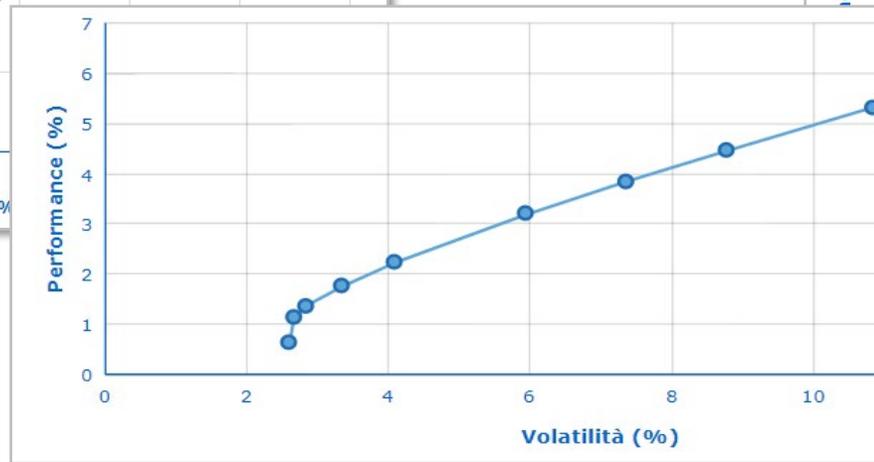
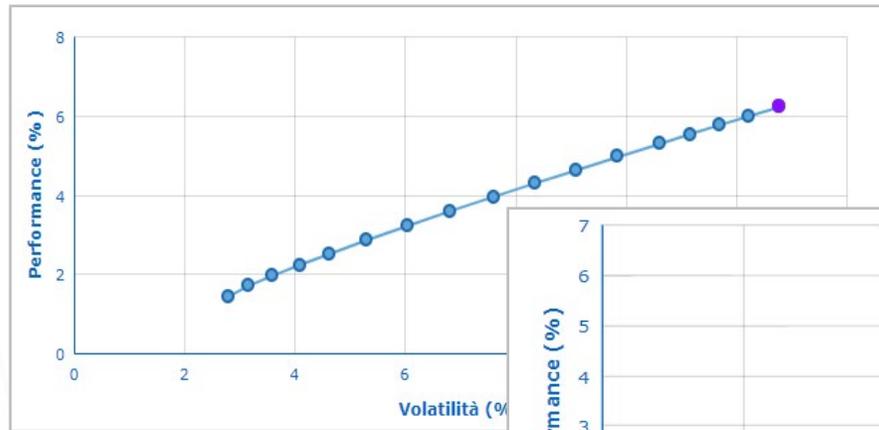
Scelta numero e  
tipologia  
di **asset class**



Numero e tipologia di  
**portafogli modello**

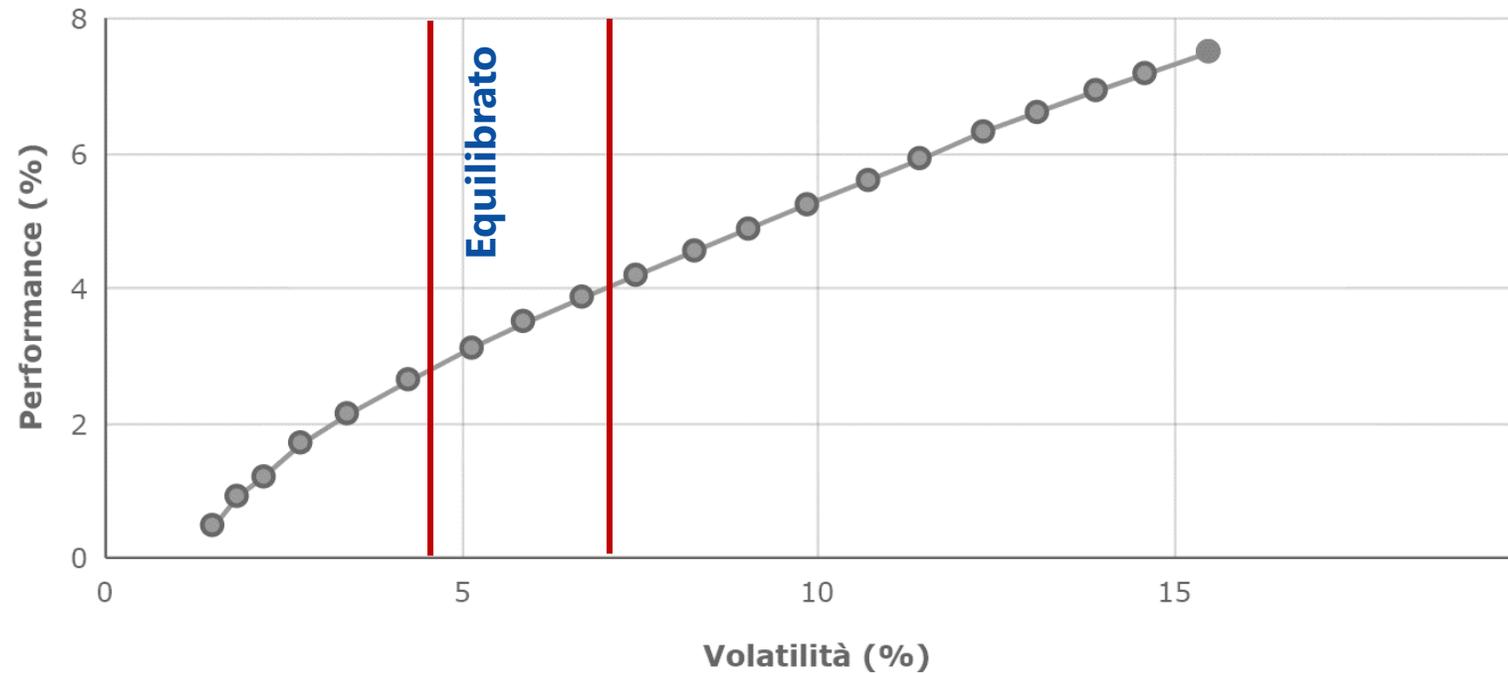


Frontiere personalizzate in  
base alla tipologia di cliente  
**affluent – retail e private**



## Individuazione del profilo di rischio del cliente

- ❖ Molto prudente
- ❖ Prudente
- ❖ **Equilibrato**
- ❖ Aggressivo
- ❖ Molto aggressivo



## Individuazione degli obiettivi di investimento del cliente

### ❖ Obiettivo 1

Importo dell'investimento 250.000€

Orizzonte temporale 3 anni

### ❖ Obiettivo 2

Importo dell'investimento 200.000€

Orizzonte temporale 7 anni

### ❖ Obiettivo 3

Importo dell'investimento 150.000€

Orizzonte temporale 15 anni

❖ Profilo di rischio: Equilibrato

❖ Patrimonio complessivo: 600.000€

❖ 42% breve termine

❖ 33% medio

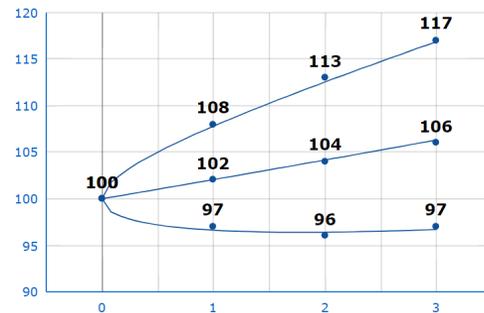
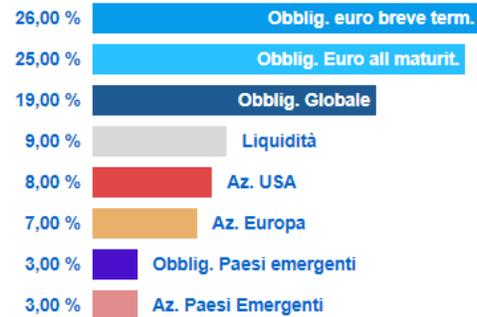
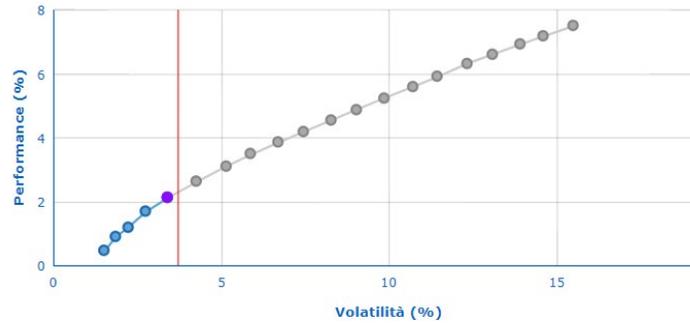
❖ 25% lungo

### Orizzonte temporale

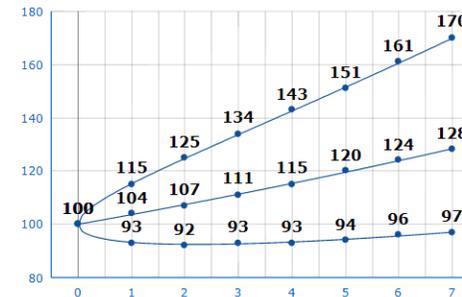
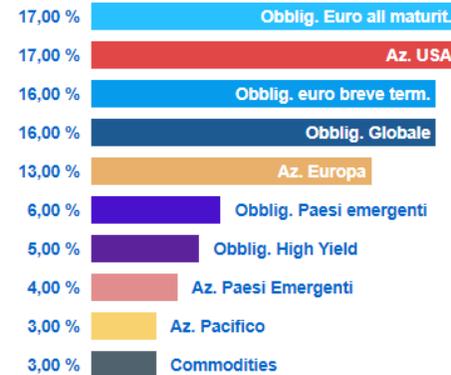
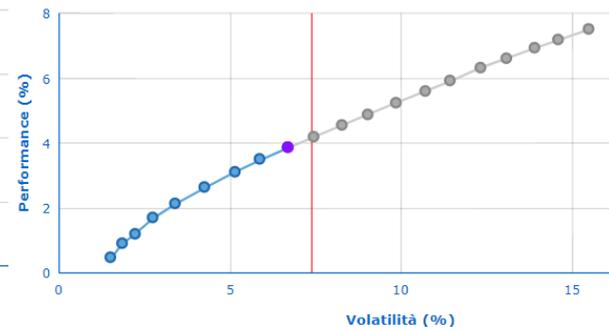


Selezione sulla FE del PTF in asset class coerente con l'obiettivo di investimento

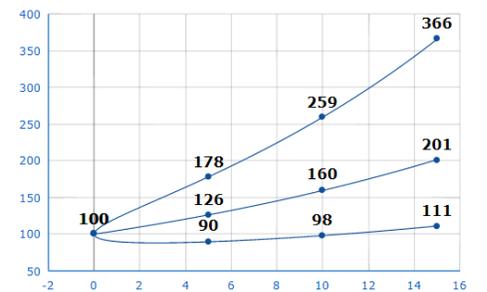
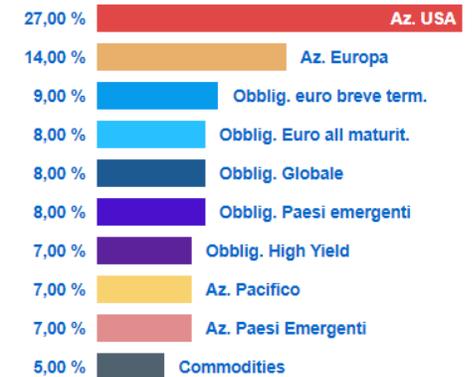
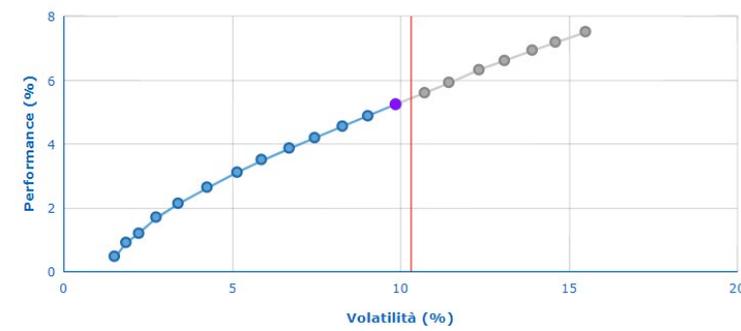
### Breve



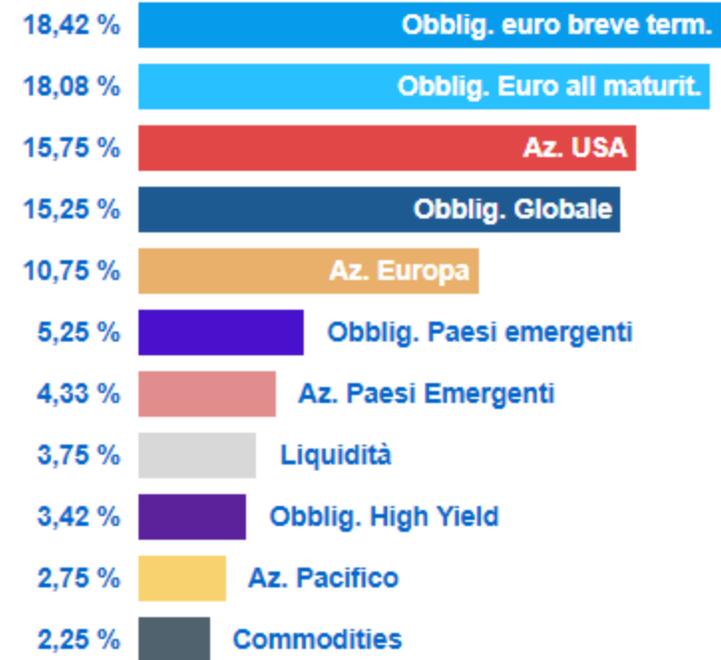
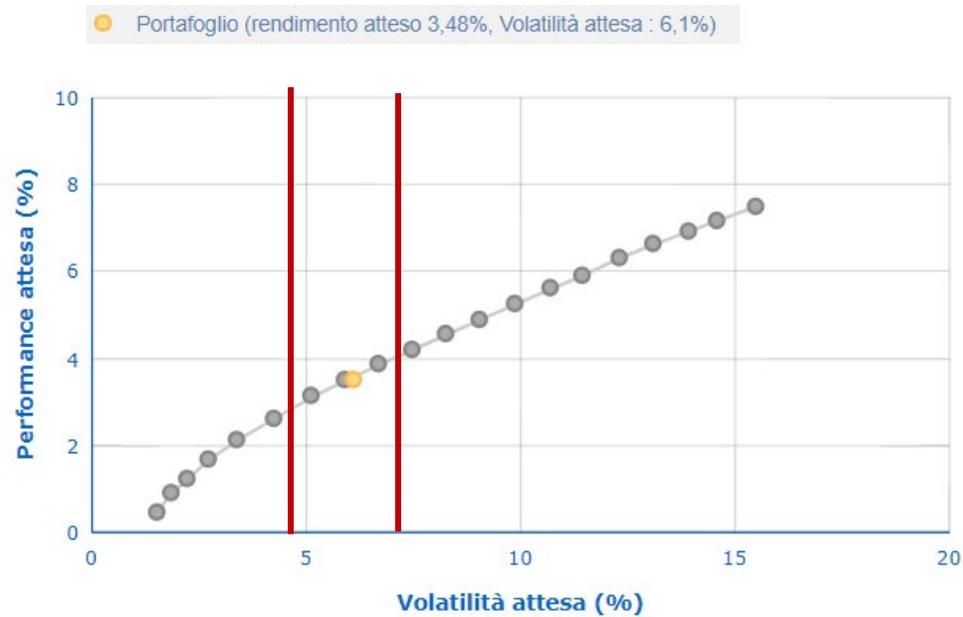
### Medio



### Lungo



### Il portafoglio complessivo del cliente



La piattaforma offre un tool avanzato di costruzione di portafogli mutimanager basato sul modello di Baierl-Chen che consente di salvaguardare la **coerenza rispetto all'asset allocation** e di selezionare i prodotti che offrono il **miglior trade off tra rendimento attivo** (alpha) e **rischio attivo** (tracking error volatility).

**Ottimizzazione avanzata**

**Caratteristiche del portafoglio**

Diversificazione :  Debole  Media  Forte

Peso minimo per fondo (%) :

Peso massimo per fondo (%) :

Tipo di gestione privilegiata :  Gestione passiva  Gestione a rischio controllato  Gestione attiva

Ottimizza con fondi specializzati ?  No  Si

Domicilio del fondo :  Tutte  Italia  Estero

Valuta :  Tutte  Euro

Rating ? :

Età dei fondi ? :  Tutte  1 anno  3 anni  5 anni

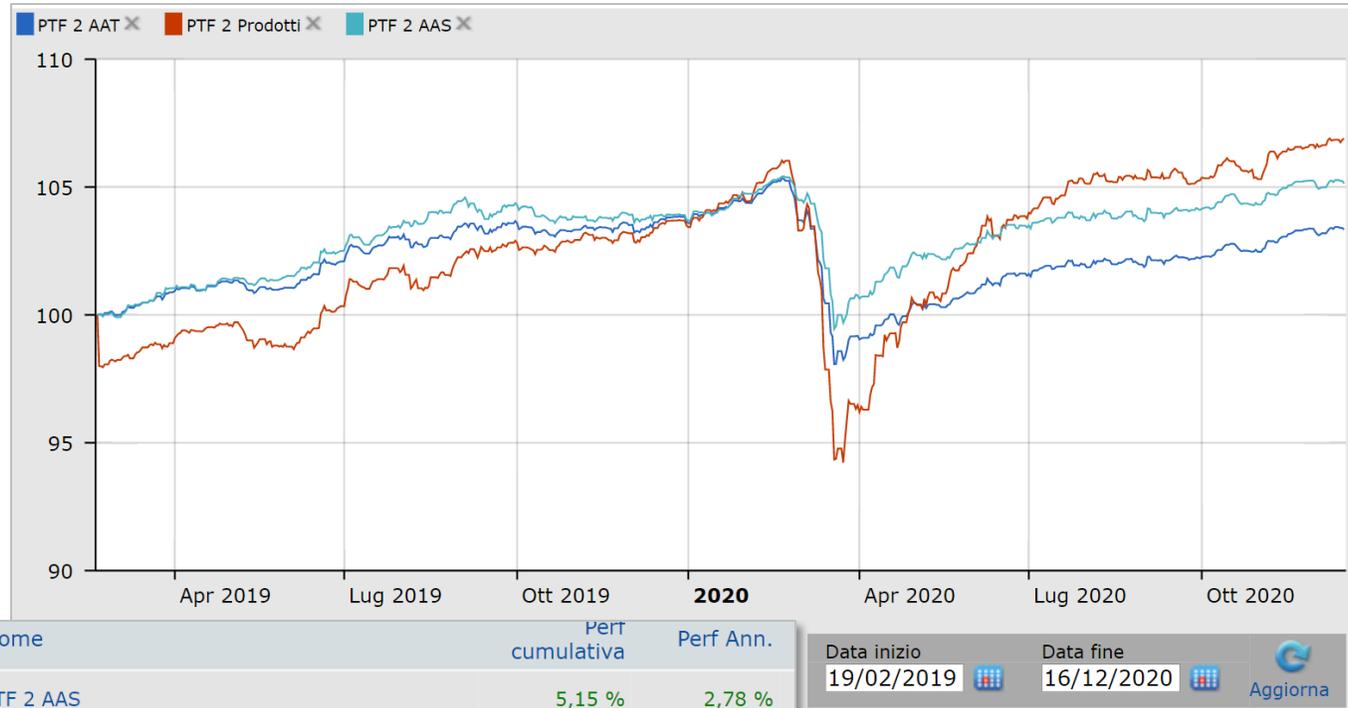
Distribuzione ? :  Tutte  Accumulazione  Distribuzione

Spese Massime (%) :

Privilegiare i fondi ESG ?  No  Si



## Scomposizione della performance





Benchmark and Style supporta le banche interessate ad una personalizzazione della piattaforma standard o alla due diligence/revisione dei loro attuali supporti con riferimento a:

- questionario di profilatura del rischio;
- costruzione dei **portafogli modello strategici** con relativo abbinamento ai diversi profili di rischio/orizzonti temporali degli investitori;
- definizione delle logiche e delle modalità per la **manutenzione tattica dei portafogli** con partecipazione al Comitato Investimenti periodico;
- definizione delle soglie di **adeguatezza**;
- definizione delle logiche e delle modalità per la creazione delle short list dei prodotti **best in class** presenti nel catalogo della Banca;
- definizione delle **priorità** di intervento commerciali sulla clientela.



Quantalys



Gli elementi distintivi della piattaforma



**Contatti**



**Emanuele CARLUCCIO**  
ecarluccio@quantalys.it



**Paolo LUBRANO**  
plubrano@quantalys.it

## Quantalys Italia

Via San Siro 33, 20149 - Milano

(+39) 02 48 199 365

[Info@quantalys.it](mailto:Info@quantalys.it)

[www.quantalys.it](http://www.quantalys.it)

[group.quantalys.com/it](http://group.quantalys.com/it)

## Menzioni Legali

© **Quantalys. Tutti i diritti riservati.** Le informazioni contenute nel presente documento sono di proprietà di Quantalys; non è consentito copiarle e/o distribuirle; non se ne garantisce l'accuratezza, la completezza, l'aggiornamento e la tempestività. Le informazioni qui riportate hanno carattere puramente indicativo, non costituiscono offerta al pubblico di prodotti finanziari e non possono, quindi, essere intese come consulenza, raccomandazione o sollecitazione all'investimento. Quantalys non si assume alcuna responsabilità per le eventuali conseguenze derivanti da decisioni assunte o iniziative intraprese sulla base delle informazioni riportate nel presente documento.

## Seguici su:



[Twitter Official Page](#)



[LinkedIn Official Page](#)



[YouTube Official Page](#)