



**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

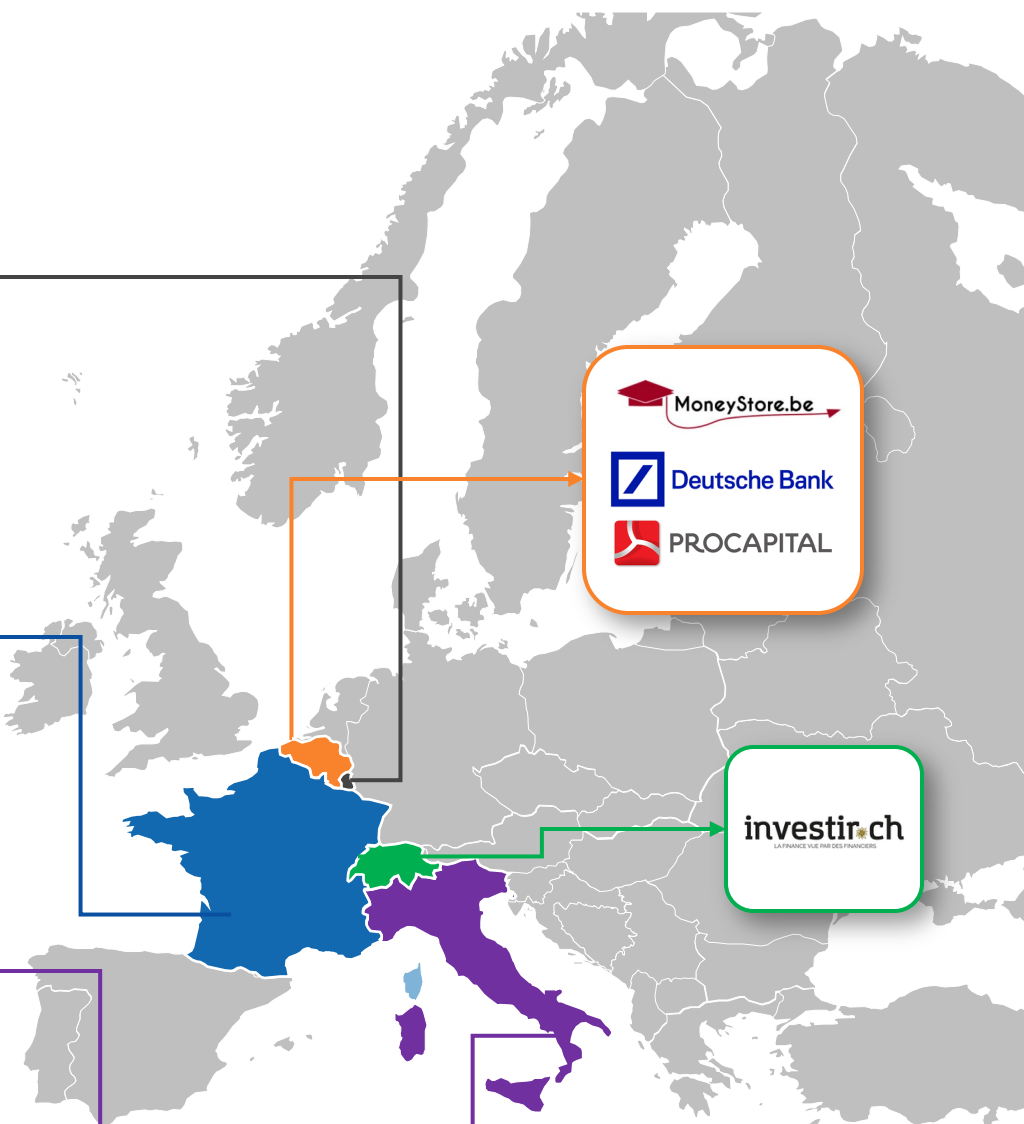
GENERALI LUXEMBOURG
NATIXIS LIFE BEYOND BANKING
AXA
Rfi-Esca LUXEMBOURG
CREDIT SUISSE

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
BPP Banca Popolare Pugliese
ING
Banca del Lazio Popolare

MoneyStore.be
Deutsche Bank
PROCAPITAL

investir.ch
LA FINANCE S'ÉCARTANNONE





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

ING



ADHOC



CARMIGNAC
RISK MANAGERS



Deutsche Bank



+ 1100 FAs

Allianz Bank



widiba



**Banca del Lazio
Popolare**

**STATE STREET GLOBAL
ADVISORS
SPDR®**



Banco Desio

BPPB

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



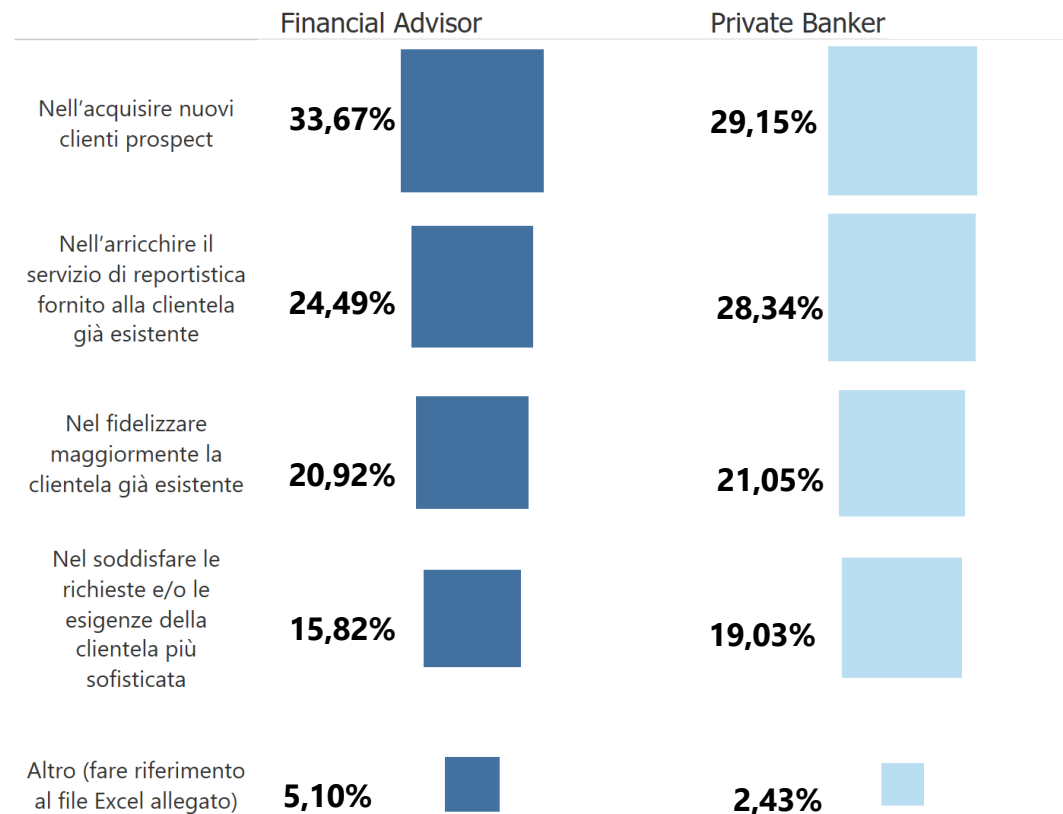
ASSET ALLOCATION



DUE DILIGENCE E CONSULTING

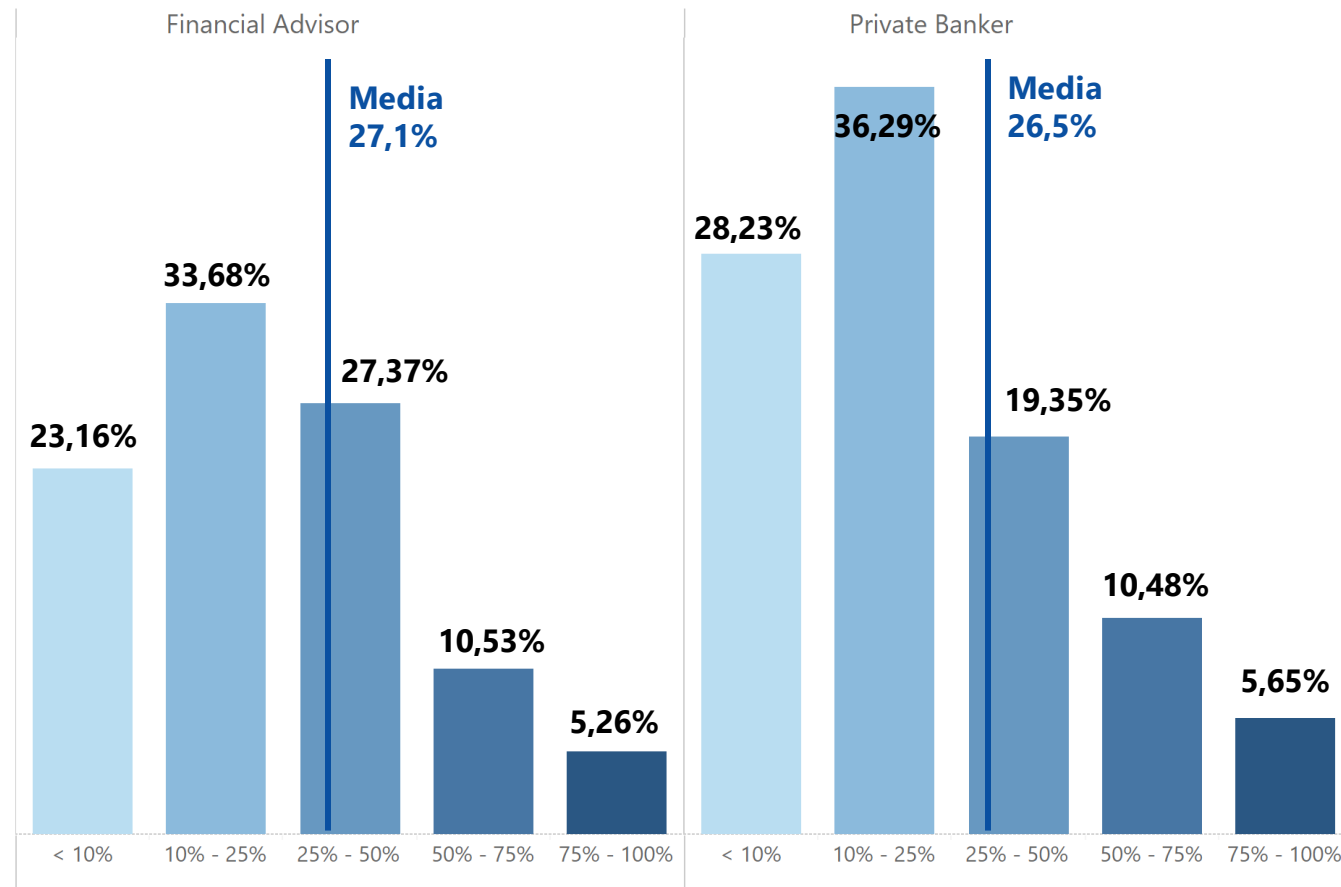
- 1) In quale delle seguenti attività di gestione della relazione con la clientela ritiene che la piattaforma Quantalys l'abbia supportata maggiormente permettendole di raggiungere interessanti risultati?

Supporto di Quantalys nella gestione con la clientela



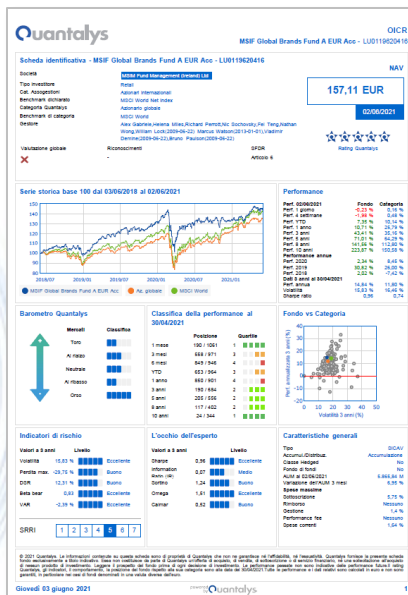
- 2) Ponendo pari a 100 la nuova raccolta da Lei registrata nel corso dell'ultimo anno, quale è la quota parte per la quale l'utilizzo di Quantalys si è dimostrato uno supporto fondamentale?

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.



SCHEDE FONDO

PRODOTTI SPECIFICI
(Unit linked, gestioni patrimoniali)

+ 70.000 PRODOTTI

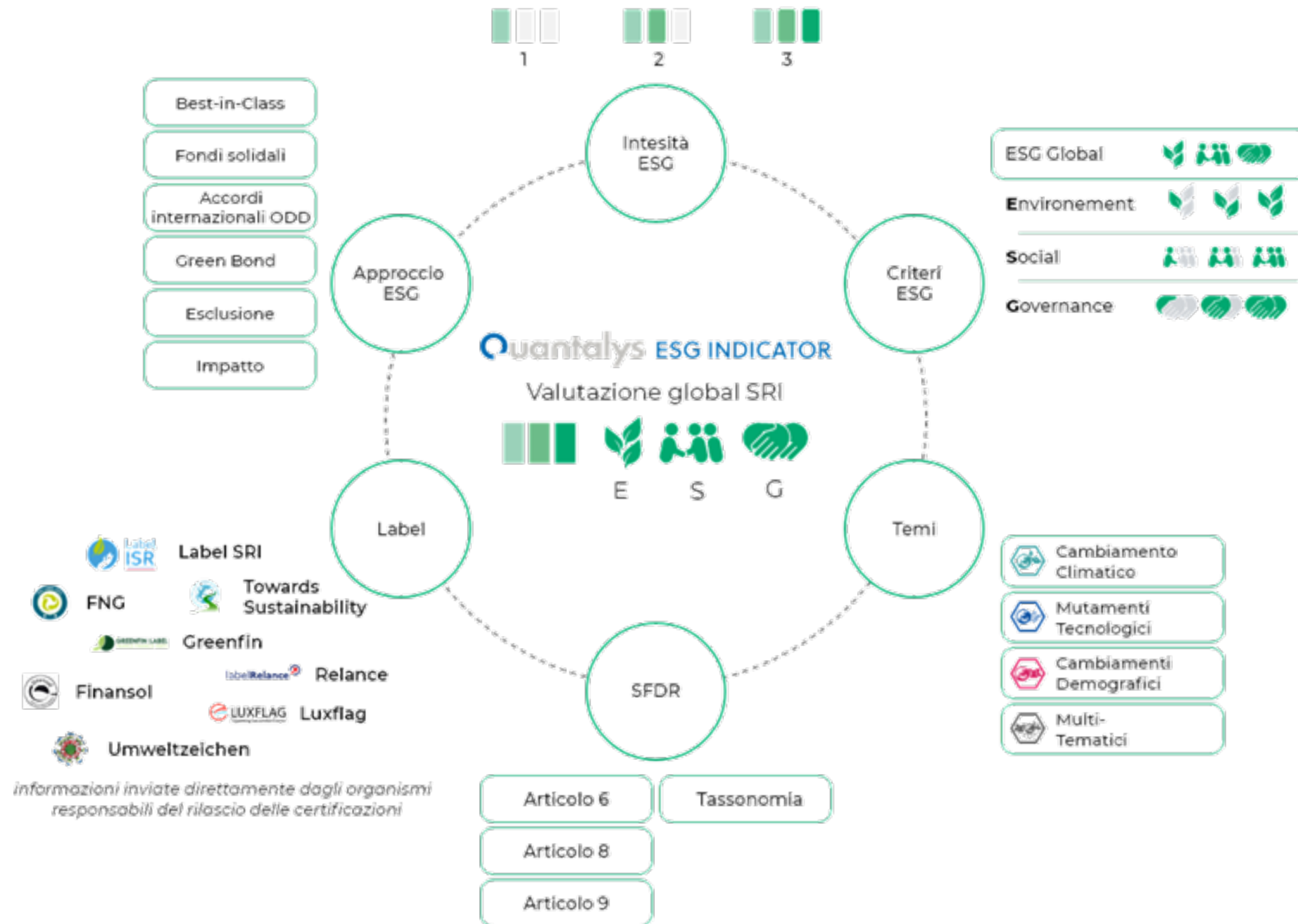
AMPIA GAMMA DI STRUMENTI FINANZIARI

ACCESSO DOCUMENTAZIONE UFFICIALE
(KIID, Prospetto etc.)

TOOLS AVANZATI DI DATA EXPORT
(Add-in e API)

+ 60 CRITERI DI RICERCA E ANALISI PRODOTTI

AGGIORNAMENTO QUOTIDIANO

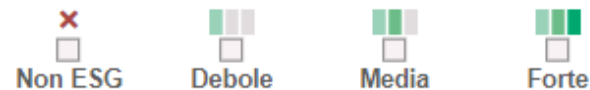


Quantalys ha sviluppato una **metodologia proprietaria per la valutazione e l'analisi ESG** dei fondi per rispondere alla crescente attenzione che gli investitori e le autorità di vigilanza stanno dedicando a questo argomento.

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

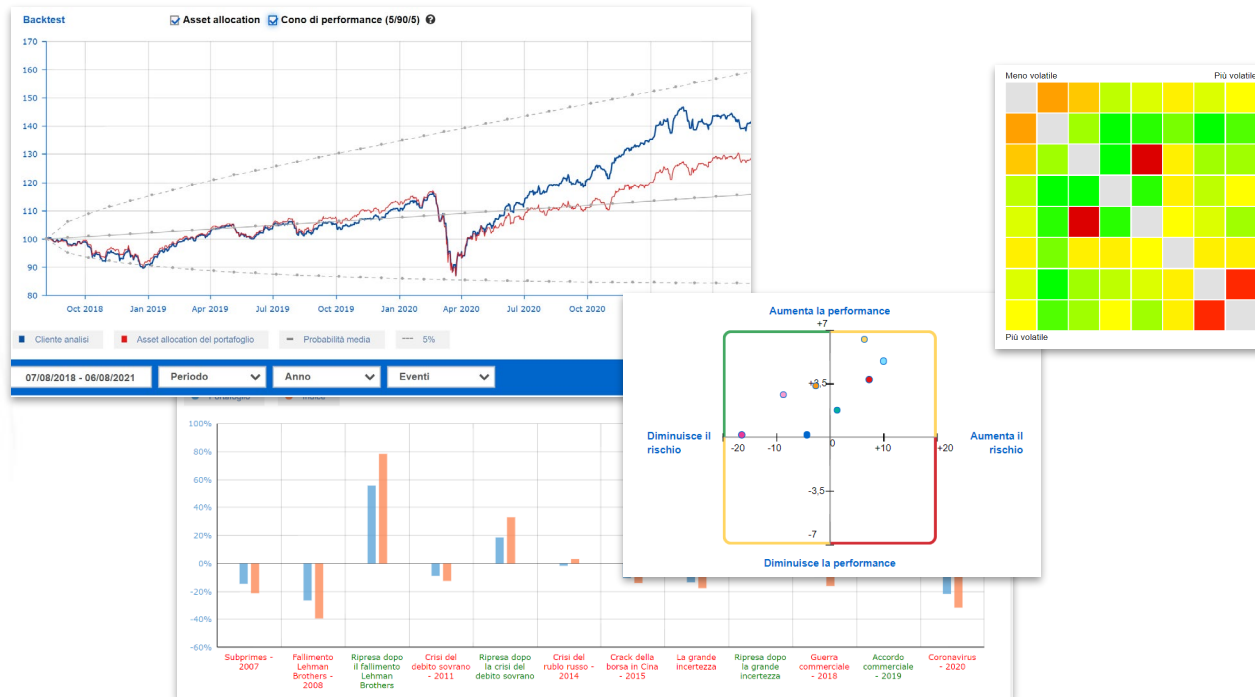
Approccio

Tematiche

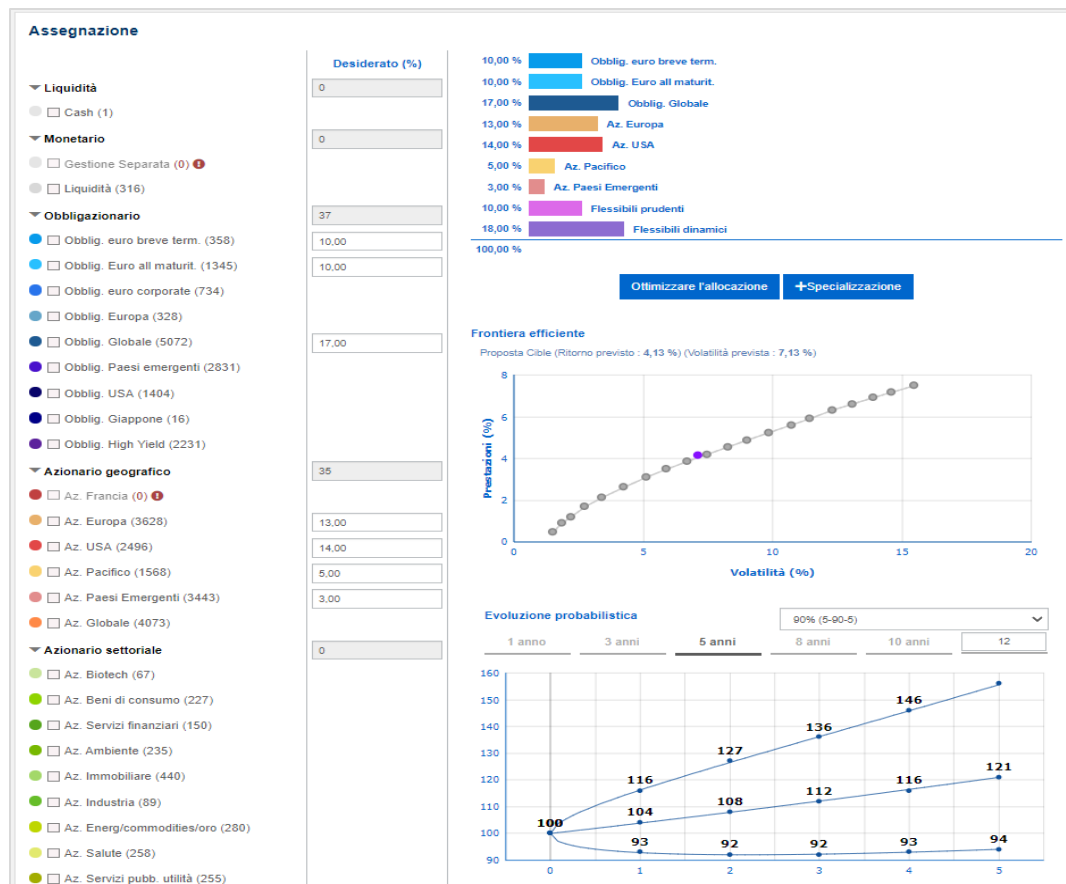
Tematica

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.



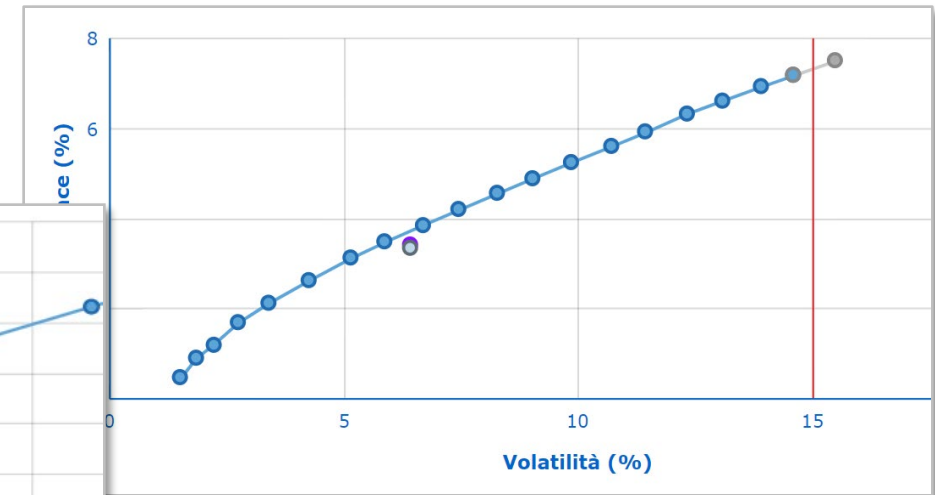
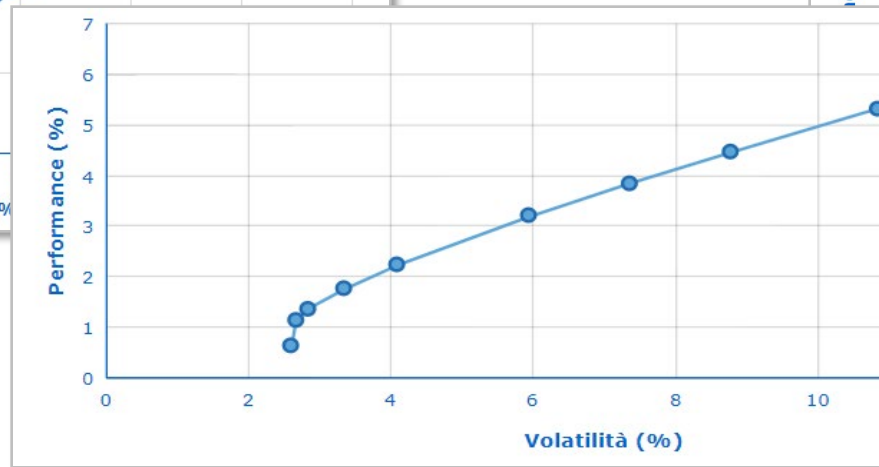
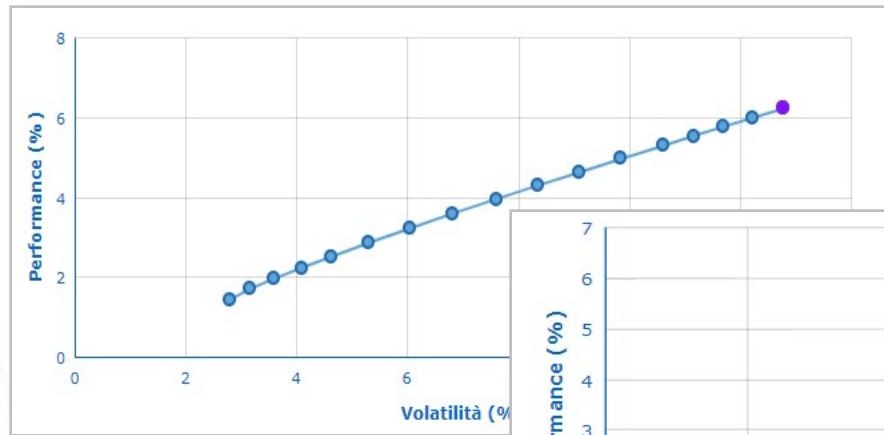
Scelta numero e
tipologia
di **asset class**



Numero e tipologia di
portafogli modello

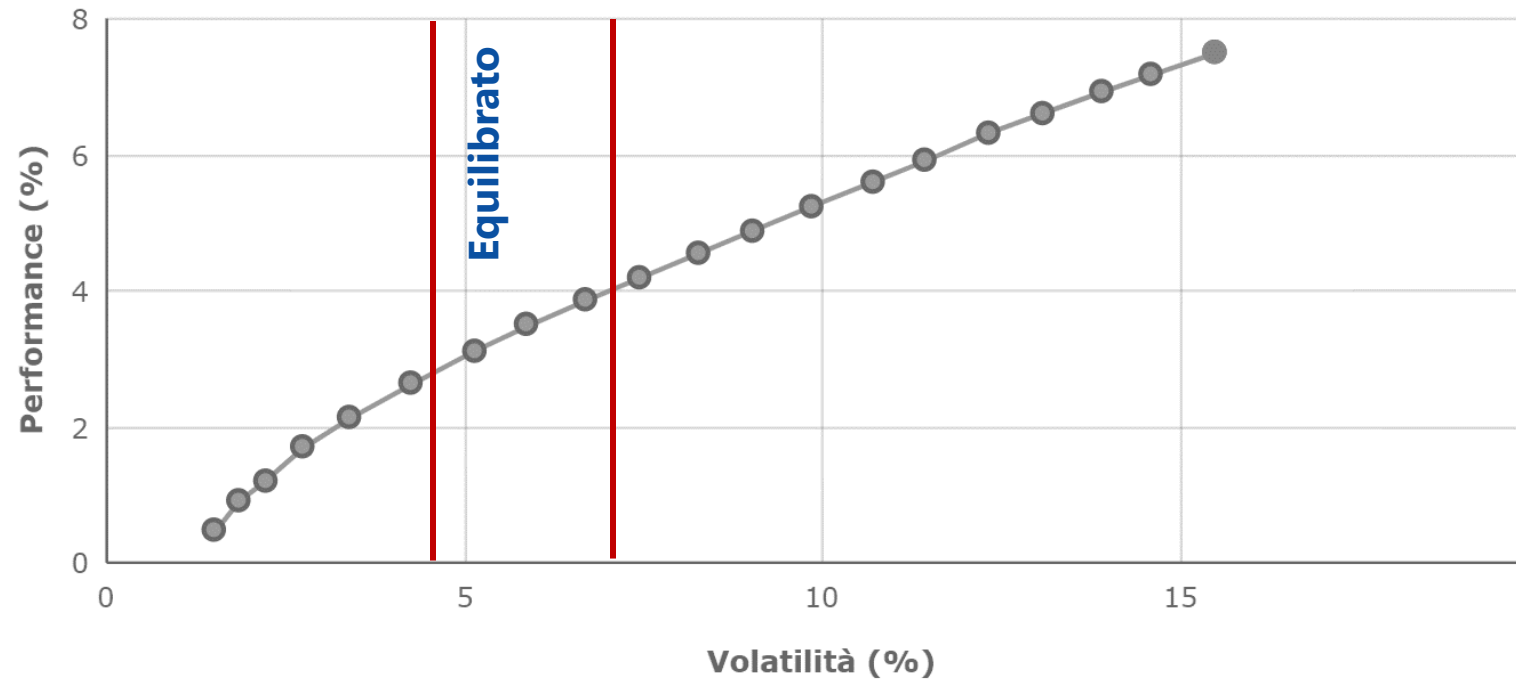


Frontiere personalizzate in
base alla tipologia di cliente
affluent – retail e private



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

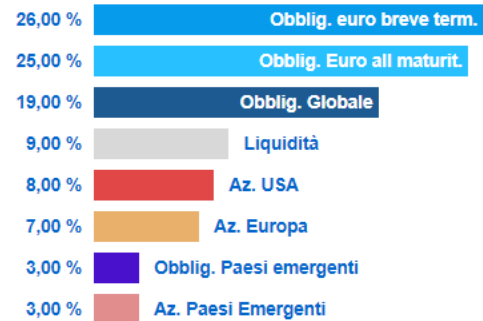
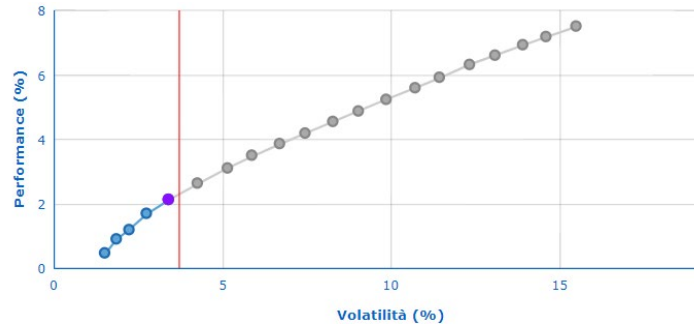
❖ 25% lungo

Orizzonte temporale



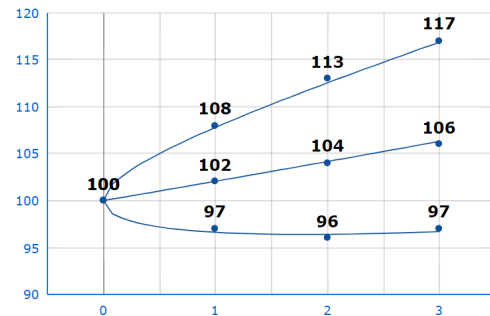
Selezione sulla FE del PTF in asset class coerente con l'obiettivo di investimento

Breve

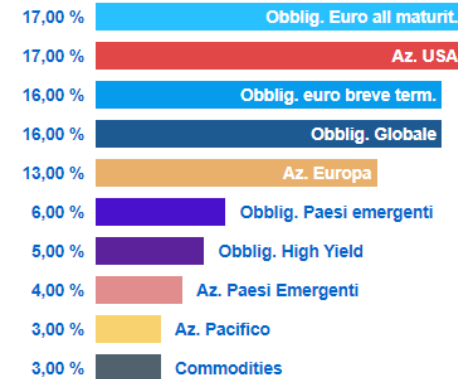
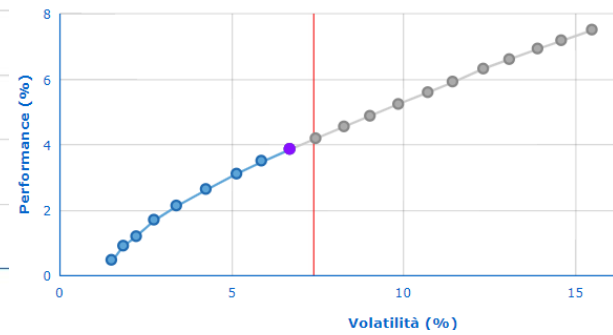


Evoluzione probabilistica 90% (5-90-5)

1 anno **3 anni** 5 anni 8 anni 10 anni 12

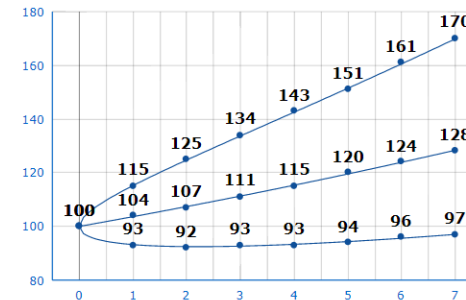


Medio

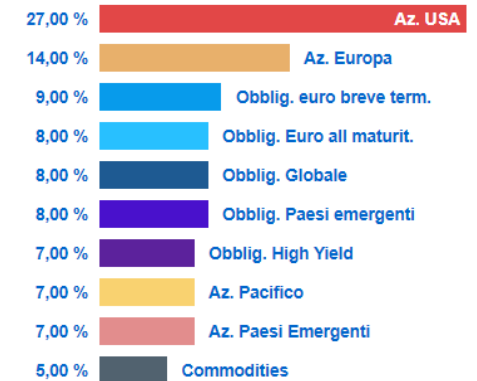
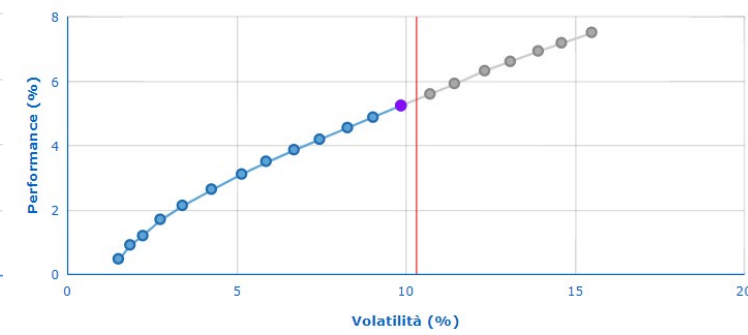


Evoluzione probabilistica 90% (5-90-5)

1 anno 3 anni 5 anni 8 anni 10 anni **7**

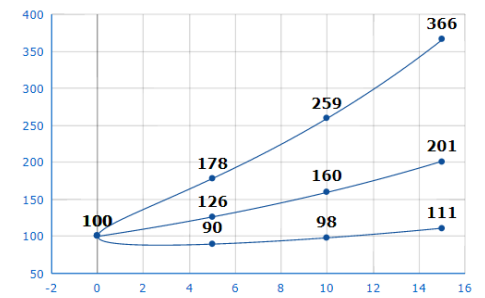


Lungo

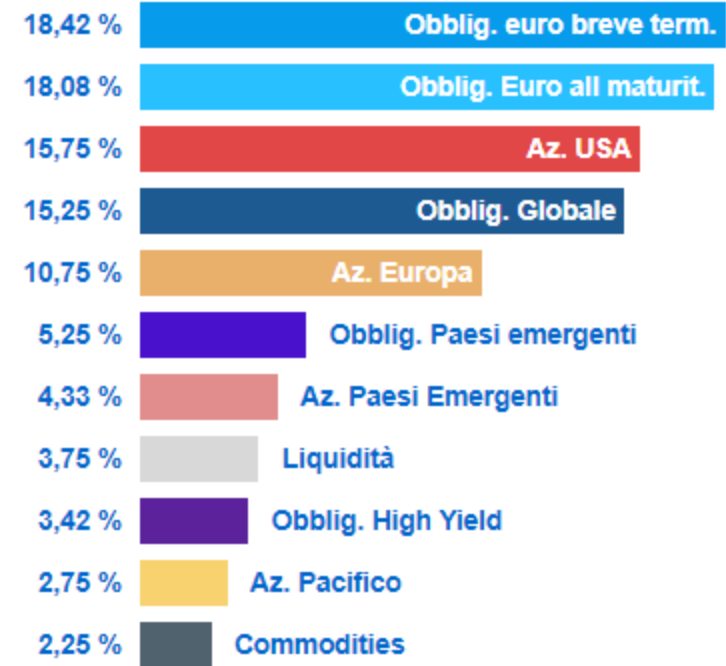
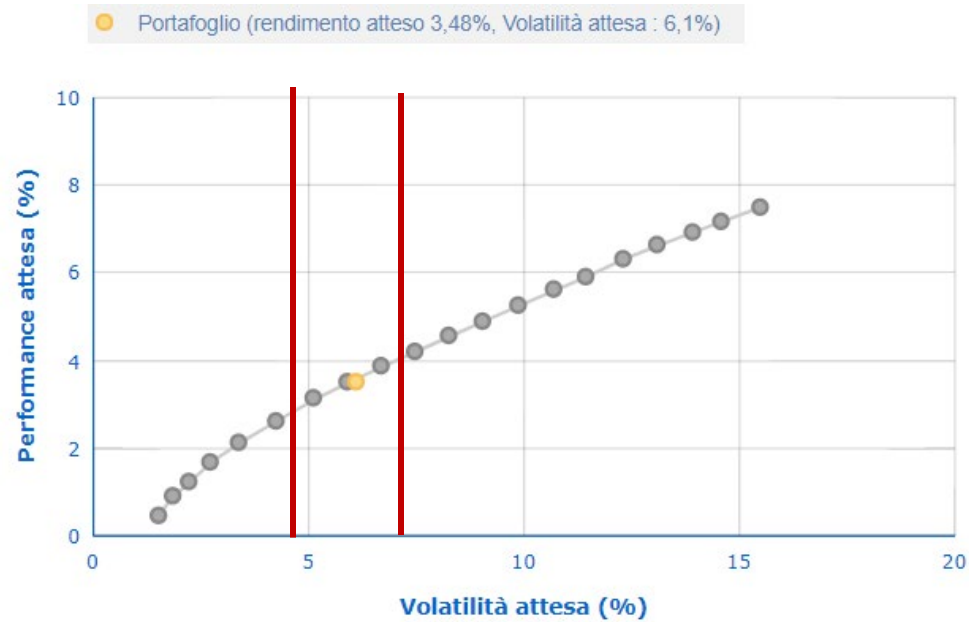


Evoluzione probabilistica 90% (5-90-5)

1 anno 3 anni 5 anni 8 anni 10 anni **15**



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

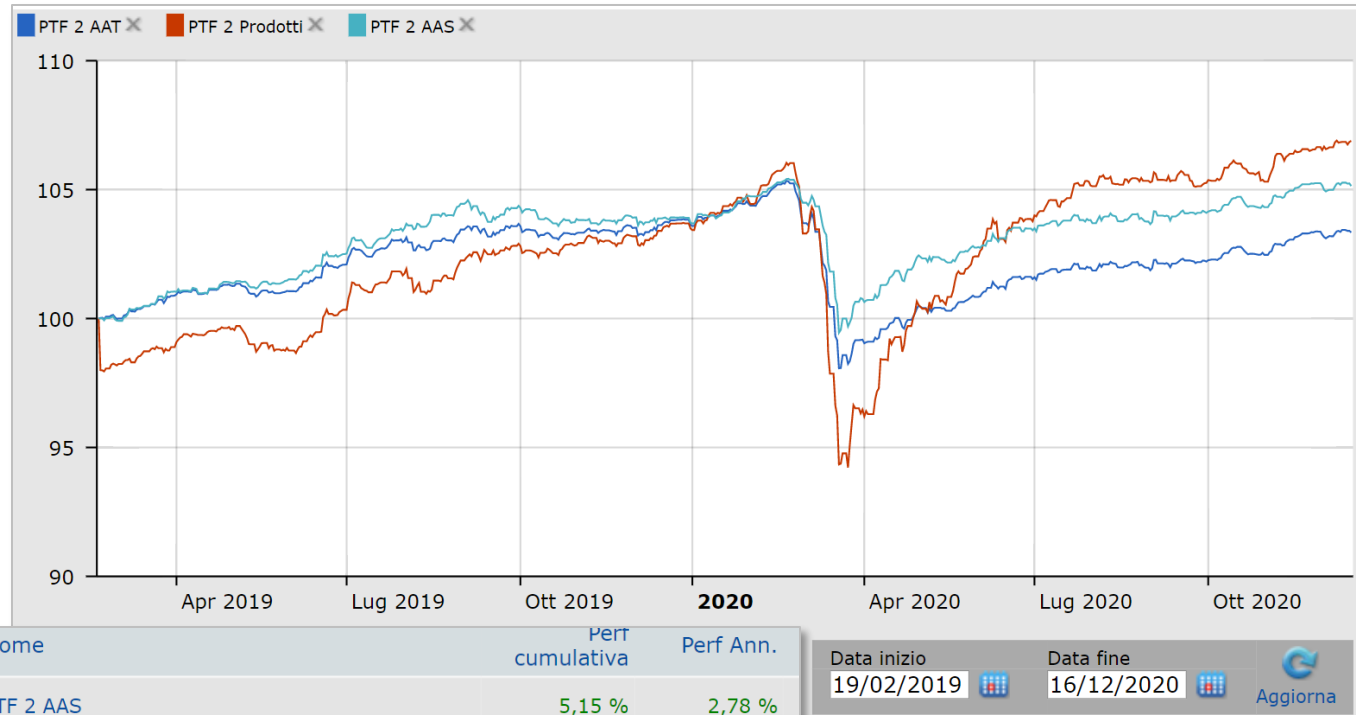
Distribuzione ? : Tutte Accumulazione Distribuzione

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

www.quantalys.it

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](#)