

AURIS
GESTION

**SERVICES DÉDIÉS
AUX INSTITUTIONNELS**

METTRE LE MEILLEUR DE LA GESTION INSTITUTIONNELLE AU SERVICE DE TOUS.

 **SALAMANDRE**
x **AURIS GESTION**



Confier la gestion financière d'actifs sous mandat ou via un fonds dédié à AURIS GESTION, c'est non seulement bénéficier de notre expertise en matière de gestion sous contraintes prudentielles mais aussi profiter d'un accompagnement sur mesure : cahier des charges précis et flexible en matière de politique d'investissement et de suivi du risque, reportings adaptés au suivi des contraintes comptables et réglementaires du client, reportings individualisés...

Les besoins de nos clients institutionnels en matière d'information et de conseil sont pris en compte dans notre approche globale d'accompagnement.

Notre équipe, ayant réalisé une partie de sa carrière dans le monde de l'assurance, est particulièrement rompue aux attentes de la clientèle institutionnelle en matière :

- **d'analyse des risques financiers** (cartographie globale des risques financiers, réalisation d'études sur des facteurs de risque spécifiques, proposition de mesures calculatoires jugées adéquates, accompagnement possible en matière d'allocation stratégique des actifs) ;
- et de **reporting financier adapté au suivi des contraintes comptables et réglementaires.**

NOUS INTÉGRONS AINSI À NOS REPORTINGS DES DONNÉES DE RISQUE, AU PREMIER RANG DESQUELLES FIGURENT LE SCR MARCHÉ ET SES COMPOSANTES.

Le calcul du SCR Marché et de ses composantes est réalisé en étroite collaboration avec le client afin de valider, en amont, la cohérence des hypothèses retenues avec celles de chaque client.

Nous déployons, au bénéfice de nos clients, des instruments de suivi et de gestion de leur risque de marché permettant **le meilleur pilotage possible du niveau de solvabilité**. A ce titre, nous travaillons activement avec les équipes d'actuariat de nos clients afin de pouvoir intégrer au mieux la gestion des risques de marché au sein du pilotage des risques globaux du client.

Notre connaissance des contraintes diverses de la clientèle institutionnelle, notre veille permanente sur les travaux de place afin de mieux les intégrer (e.g. inventaire en transparence format TPT – AMPERE V3...) et la flexibilité qui caractérise notre structure nous permettent d'accompagner nos clients institutionnels dans la durée.

L'ENSEMBLE DES DONNÉES ET DOCUMENTS D'INFORMATION ET DE REPORTING LIÉS AUX MANDATS DE GESTION ET AUX FONDS DÉDIÉS CONFIEÉS PAR NOS CLIENTS EST DISPONIBLE DANS UN ESPACE PRIVÉ DÉDIÉ DE NOTRE SITE INTERNET (CHAQUE CLIENT AYANT UN ACCÈS RÉSERVÉ AU SEUL PÉRIMÈTRE LE CONCERNANT).

Nous sommes par ailleurs en mesure de fournir à nos clients institutionnels :

- une prestation de **conseil en investissements ou en allocation générale** ;
- une prestation de réalisation de reportings consolidés agrégeant différents portefeuilles confiés à d'autres sociétés de gestion afin de disposer d'un document unique facilitant le suivi du **périmètre global de leurs actifs financiers** ;
- des éléments contribuant à l'établissement de leur **évaluation ORSA**.

L'expérience de notre équipe lui permet des **interactions étroites avec les interlocuteurs désignés au sein de chaque institution accompagnée** que ce soit dans le suivi de notre gestion financière (au travers, par exemple, de comités consultatifs intégrant des représentants de l'institution), dans la préparation de documents de reporting requis sur évènement ou encore pour présenter nos travaux devant les instances de l'institution concernée.

Enfin, dans le cadre de la **mise en œuvre de critères extra-financiers dans la gestion dédiée à une institution**, nous sommes en mesure, grâce à nos contacts auprès d'acteurs spécialisés et indépendants (fournisseurs de données, bureaux d'analyse...), de fournir une gestion financière tenant compte de cette contrainte complémentaire et de rendre compte sur le respect de cette dernière (notation ESG des portefeuilles gérés, mesure de l'empreinte carbone des portefeuilles gérés avec indicateurs d'impact ESG notamment dans le cadre du dispositif issu de la Loi de Transition Énergétique).

NOTRE APPROCHE EXPRIMÉE :

Parce que nous partageons la culture de nos clients institutionnels, nous agissons comme un prolongement naturel de l'institution cliente et allons ainsi au-delà des prestations classiques d'un gérant d'actifs en proposant un accompagnement de proximité. Nos moyens humains et techniques nous permettent de faciliter la compréhension et le suivi des portefeuilles gérés en remettant à nos clients une information détaillée, utile et exploitable sur divers supports. Une relation de proximité, c'est aussi être en mesure de parler le langage de nos clients et, par exemple, de rendre compte, sur demande, devant leurs instances.

par **Sébastien GRASSET**



RÉPONSES À DES BESOINS SPÉCIFIQUES DE REPORTING

(par exemple : reportings intégrant des éléments extra-financiers, reportings particuliers sur des produits structurés en portefeuille, reportings consolidés intégrant les positions gérées par d'autres sociétés de gestion)



REPORTINGS INSTITUTIONNELS

(comptables, financiers et réglementaires) sur les portefeuilles gérés (sous mandat ou sous forme d'OPC dédié) par Auris Gestion selon une fréquence définie avec l'institution (et en tout état de cause, a minima, trimestrielle)*



ÉTUDES CONSOLIDÉES DES RISQUES FINANCIERS

sur les différents portefeuilles confiés à Auris Gestion et à des sociétés de gestion tierces, fourniture d'éléments utiles à l'établissement de l'ORSA, accompagnement dans l'optimisation de la globalité du portefeuille d'actifs de l'institution



ÉTUDE PRÉCISE DE LA SITUATION DU CLIENT

(connaissance de l'activité et des enjeux du client, de la structure du passif, de contraintes spécifiques structurelles et/ou conjoncturelles)



POSSIBILITÉ DE PARTICIPATION À CERTAINES INSTANCES

de l'institution (comités d'audit, commissions financières, conseils d'administration...)



POINTS RÉGULIERS AVEC LE CLIENT

sous forme de comités consultatifs et de réunions ad hoc avec la Direction Financière et/ou le Responsable des placements du client ainsi que tout consultant accompagnant le client

* Cela inclut notamment :

- l'inventaire, les mouvements (avec mise à disposition des tickets d'opération), la structure du portefeuille et le suivi des contraintes de gestion,
- le calcul et le suivi des ratios SCR (Solvabilité 2) avec et sans intégration des éléments de passif,
- le suivi du compte de résultat financier et la prise en compte des objectifs du client en tenant compte des produits financiers nets,
- le suivi des risques de Provision pour Risque d'Exigibilité et de Provision pour Dépréciation Durable,
- la mise en évidence de la situation de plus ou moins-value latente globale et ligne à ligne avec et sans surcote/décote,
- le suivi du TRA du portefeuille et en ligne à ligne,
- l'historique et l'attribution de performance,
- la situation sur les éventuels produits structurés en portefeuille (suivi et valorisation de l'échéancier de flux propre au produit, contre-valorisation indépendante et suivi de vecteurs de risque dont les grecs),
- le calcul de la VaR du portefeuille et l'intégration d'indicateurs de suivi des risques pertinents selon les sous-jacents du portefeuille et sa stratégie (ventilation du portefeuille par types d'exposition, sensibilités, stress tests...),
- les informations utiles pour l'établissement des états réglementaires requis par Solvabilité 2 (e.g. reportings transparents trimestriels ou plus fréquents) et plus largement par les autorités de contrôle de nos clients institutionnels.



153 BOULEVARD HAUSSMANN - 75008 PARIS

contact@aurisgestion.com

+33 (0)1 78 41 00 31 / +33 (0)1 42 25 83 40

www.aurisgestion.com

 **SALAMANDRE**
x AURIS GESTION

Ce document a été réalisé par la société AURIS GESTION. Société de gestion de portefeuille agréée sous le numéro AMF : GP-04000069. RCS Paris n° : 479 789 778. Les informations contenues dans ce document ne constituent en aucun cas une incitation à acheter ou à vendre des titres (en ce compris des parts ou actions d'OPC) ni encore une quelconque sollicitation ou offre de souscription aux OPC et services financiers qui y sont décrits. Il est rappelé aux destinataires de ce document qui envisagent de souscrire aux OPC décrits dans ce document qu'une telle opération doit être exclusivement envisagée sur la base des informations figurant dans le prospectus des OPC, qui peuvent être différentes de celles présentées dans le présent document. Les performances passées ne sauraient préjuger des performances futures. Elles ne sont notamment pas constantes dans le temps. « Salamandre by Auris Gestion » est une dénomination commerciale du groupe Auris Gestion.