

ACTIVE ASSET ALLOCATION

REMORTE L'APPEL D'OFFRES DE L'URSSAF CAISSE NATIONALE POUR DES PRESTATIONS DE CONSEIL ET D'ASSISTANCE EN GESTION FINANCIÈRE

Durant l'été 2021, l'Urssaf Caisse nationale lançait un appel d'offres visant à trouver un prestataire de conseil en allocation d'actifs, afin de l'accompagner dans la gestion des réserves financières du Conseil pour la protection sociale des travailleurs indépendants (CPSTI*).

Forte de plus de 10 ans d'excellent track-record et d'une méthodologie d'allocation d'actifs propriétaire et brevetée, c'est Active Asset Allocation qui remporte cet appel d'offres.

La solution proposée a pour objectif d'optimiser l'allocation stratégique et tactique des deux régimes du CPSTI, sous contrainte d'une gestion actif/passif. Pour ce faire, elle tiendra compte des caractéristiques des différentes classes d'actifs, des profils des sous-jacents susceptibles d'être investis, du profil du passif des régimes et de leurs contraintes réglementaires.

Pour ces deux régimes, qui totalisent près de 20 milliards d'euros d'encours, l'étude pour l'allocation stratégique visera à identifier l'exposition cible des réserves aux principales classes d'actifs sur le long terme, ainsi que les marges d'intervention. Des études ponctuelles pour l'allocation tactique permettront d'ajuster l'exposition des régimes sur un horizon de court terme, en vue de réduire les risques et bénéficier des opportunités de marché.

Au delà de son expertise en allocation d'actifs, Active Asset Allocation apporte à l'Urssaf Caisse nationale son savoir-faire en projections stochastiques et en Intelligence Artificielle. Il s'agit d'un véritable échange d'expertises entre une FinTech et une grande institution, qui démontre une fois encore que le domaine de la Finance évolue, et que l'alliance des expertises permet d'aller plus loin dans la gestion des ressources des cotisants.

Adina Grigoriu, Présidente et fondatrice d'Active Asset Allocation, ajoute : « *La mission d'AAA est de participer, par son approche de l'allocation d'actifs par les risques, à la préservation des ressources financières à long terme. Le fait de pouvoir explorer tous les possibles grâce à l'intelligence artificielle confère à notre approche une place à part dans la prise de décision des institutions. Je tiens tout particulièrement à remercier l'Urssaf de nous faire confiance dans le cadre de l'optimisation de l'allocation stratégique et tactique des régimes pilotés par le CPSTI* ».

Pour l'Urssaf Caisse nationale, Active Asset Allocation donne aux simulations prospectives une autre dimension, permettant ainsi de compléter l'approche standard. Son approche nous apporte la vision holistique des risques et rendements anticipés que nous attendions.

*Pour mémoire, le CPSTI pilote le régime complémentaire d'assurance vieillesse obligatoire et le régime invalidité-décès des travailleurs indépendants, ainsi que la gestion des capitaux destinés à la mise en oeuvre de ces régimes.

À propos d'Active Asset Allocation

Active Asset Allocation est un expert reconnu de l'allocation d'actifs quantitative, basée sur la gestion de la perte maximale en capital.

Sa mission est de créer des solutions d'investissement sur mesure pour permettre à chaque institution et chaque personne d'atteindre son objectif financier quel que soit son niveau de richesse ou d'éducation. Pour cela, elle met au coeur de ses algorithmes en plus du comportement des marchés financiers, les objectifs, les contraintes et limites de risque des investisseurs.

En plus de ses solutions qui permettent de mettre en place des offres de gestion pilotée / sous mandat / retraite innovantes, à base d'ETF et de fonds, AAA propose des outils ludiques et pédagogiques d'aide à la vente pour les réseaux de distribution. Ces outils donnent également accès à des reporting client créés sur mesure avec de l'intelligence artificielle, des reporting réglementaires PRIIPS ainsi que des outils de suivi pour l'équipe de gestion.

Plus d'informations sur : www.active-asset-allocation.com

Contact presse :
[presse@active-asset-
allocation.com](mailto:presse@active-asset-allocation.com)