



DUE DILIGENCE

ANALYSIS

WHAT IF SCENARI

STRATEGIES

ORDER BOOK

COMPLIANCES & LIMITS

BUSINESS RULES

PORTFOLIO MODELING

TREASURY MANAGEMENT

LIABILITIES MANAGEMENT

MANAGEMENT FEES

NAV CALCULATION

MATCHING

PERFORMANCES

ATTRIBUTION

PROFIT & LOSS

REPORTING

WORKFLOWS

AUDIT TRAIL

Tracker Portfolio Management

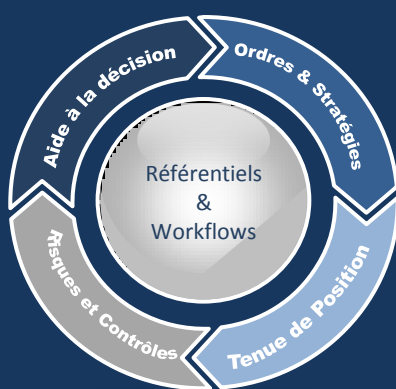
The New Approach to Management Systems

NEXFI ET LA GESTION D'ACTIFS

Depuis sa création en 2002, NEXFI accompagne l'industrie de l'Asset Management dans son évolution.

- Gestion Diversifiée,
- Multi Gestion,
- Gestion Institutionnelle ,
- Gestion Structurée,
- Gestion Alternative

NEXFI innove en permanence pour adapter son offre aux besoins de la gestion d'actifs.



UNE SOLUTION COMPLETE

Tracker est une solution de **Front et Middle Office** construite autour d'un référentiel, d'un moteur de règles et de process adaptables.

Elle couvre **tous les instruments financiers** et toutes les fonctions nécessaires à la gestion d'actifs pour compte de tiers.

UNE OUVERTURE NATIVE

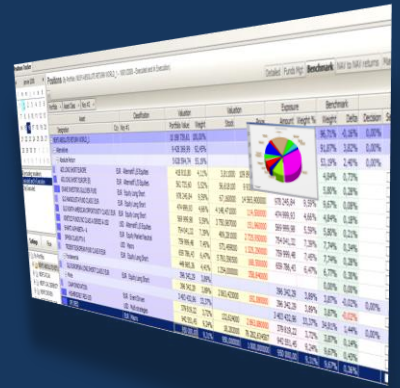
Tracker est une solution « **Full STP** » qui communique nativement avec les autres systèmes. De nombreux liens ont déjà été mis en place avec des solutions de Back Offices (dépositaires, valorisateurs) et des fournisseurs de données.

SUR SITE OU EN ASP, UN ACCES SIMPLE ET SECURISE

Tracker peut être installé sur site ou utilisé en ASP. Dans tous les cas vous bénéficiez d'un accès sécurisé par mot de passe avec traçage complet et permanent de toute l'activité.

DES FONCTIONS STANDARD, COMPLÈTES ET ERGONOMIQUES

- **Carnet d'ordres** avec moteur FIX. Workflow paramétrable
- **Modèles** : Construction de modèles et gestion par rebalancing. Simulations en poids, sensibilité, ...
- **Position temps réel** : tris par classe d'actif, style de gestion, zone géographique d'exposition, classe de sensibilité...
- **Aide à la décision** : Propositions automatiques de couverture par instrument dérivé, arbitrages de positions (arbitrage ou fusion), simulations détaillées.
- **Valorisation** : Méthodes standard (interpolation de courbes, Black...) et règles métiers paramétrables par instrument et par titre.
- **Risques** : Tracking Error et indicateurs de risques (Treyner, Jensen,...) Risque de Liquidité avec scenarii paramétrables, Risques de trésorerie en fonction du passif, VaR Monte Carlo (avec APT®).
- **Expositions** marché, devise et taux (axes de transparence, sensibilités...)
- **Contraintes** à la volée, en pre trade, en post trade
- **Performance** et attribution de performance
- **Gestion de Trésorerie** : Ajustements centralisés des soldes, trésorerie prévisionnelle.
- **Réconciliation** des flux, positions Titres et Espèces.
- **Reporting personnalisé** : Fund factsheets, accès Web, ...



GESTIONS SPECIALISEES

Gestion Alternative : Long Short & Stratégies avec décomposition des résultats par poche .

Assurance : FIFO, réserve de capitalisation, surcote/décote, calculs actuariels...

MultiGestion : parts multi classes, multi devises avec frais de gestion et de surperformance (Hurdle Rates, High Watermarks). Suivi des NAV par statuts (estimée, validée...)

MultiGestion Alternative : Due Diligences, création et traitement de questionnaires paramétrables. Gestion des processus d'égalisation EQF, EQS, Series et administration de Side Pocket. Gestion exhaustive des règles de souscription et de rachat : fund gating, droits d'entrée/sortie, rétrocessions et gestion des pénalités (hard et soft lockup)

Gestion du passif : Suivi des positions et des résultats par investisseur avec durée de détention et calculs des rétrocessions.

Gestion Structurée : Le référentiel valeurs flexible permet la structuration de tout instrument financier grâce à des composants modulables.

DUE DILIGENCE

ANALYSIS

WHAT IF SCENARI

STRATEGIES

ORDER BOOK

COMPLIANCES & LIMITS

BUSINESS RULES

PORTFOLIO MODELING

TREASURY MANAGEMENT

LIABILITIES MANAGEMENT

MANAGEMENT FEES

NAV CALCULATION

MATCHING

PERFORMANCES

ATTRIBUTION

PROFIT & LOSS

REPORTING

WORKFLOWS

AUDIT TRAIL

NEXFI

8 rue Auber – 75009 Paris

Tel +33 1 53 63 16 00 - Fax +33 1 53 63 16 01

www.nexfi.fr