



STRATEGGYZ PRODUITS STRUCTURÉS



SOMMAIRE

I. Rôle des Produits Structurés

II. Dimension Green

III. Process

IV. Strateggyz

V. Prochaines Étapes

VI. Disclaimer

I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS POUR UNE GESTION EFFICACE.

- Gestion de l'équilibre bilanciel
- Optimisation du couple risque/rendement
- Gestion active des risques
- Pilotage de la liquidité
- Alignement stratégique à long terme
- Contribution à la performance globale

REPACK

Un **repack** (ou **repackaging**) est un produit structuré qui consiste à **transformer un actif existant** (souvent une obligation, un panier de titres, ou un dérivé) en un instrument financier adapté à des besoins spécifiques d'investisseurs (profil de rendement, risque, devise, fiscalité, etc.).





I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

1 SOUS-JACENT (COLLATÉRAL)

2 STRUCTURE DU COUPON

3 CAPITAL / PRINCIPAL

4 DEVISE

5 DURÉE / MATURITÉ

6 ÉMETTEUR DU REPACK

7 LIQUIDITÉ & COTATION

8 FISCALITÉ

9 PROFIL DE RISQUE ET SCÉNARIO

10 ACCESSIBILITÉ ET TAILLE

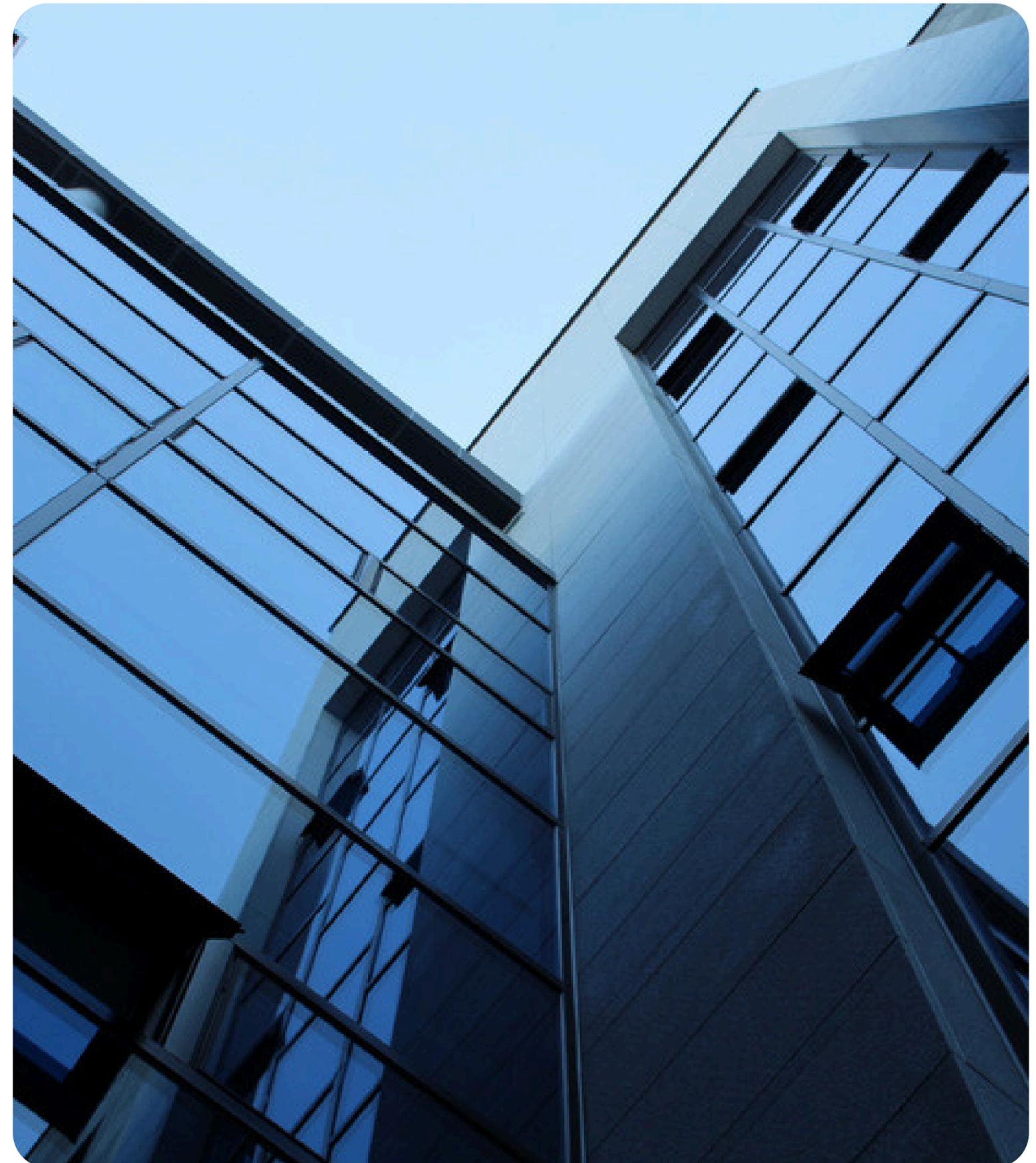
I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

SOUS-JACENT (COLLATÉRAL)

- Obligation souveraine ou corporate
- Titres subordonnés (Tier 2, AT1...)
- ABS/MBS et CLO
- CDS ou tranches de CDS (e.g. iTraxx, CDX)
- Actions ou indices actions
- Fonds (OPCVM, hedge funds, etc.)
- Produits structurés eux-mêmes (nestedrepacks)

STRUCTURE DU COUPON

- Fixe / Variable / Capped/ Floored
- Indexation : Taux (Euribor, CMS, inflation...); Actions ou indices; Spread de crédit (iTraxx, single nameCDS); Change (devise croisée)
- Coupon conditionnel (e.g. knock-in/out, reverse convertible)
- Coupon risqué (exposé à une tranche de crédit ou à un événement)





CAPITAL / PRINCIPAL

- Protection du capital à maturité (sauf défaut de l'émetteur)
- Non garanti / exposé à un risque de marché ou crédit
- Effet de levier sur le collatéral
- Amortissement partiel ou total

DEVISE

- Devise de souscription vs devise du collatéral
- Avec ou sans couverture de change (FX hedged)
- Option de multi-devises FX barrier ou mécanisme de protection

I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

DURÉE / MATURITÉ

- Fixe (e.g. 3, 5, 7 ans)
- Modulation de la maturité
- Callable / putable / autocallable
- Échéance liée à un événement (e.g. trigger crédit, sortie d'un fonds)

ÉMETTEUR DU REPACK

- Banque d'investissement / SPV (Special Purpose Vehicle)
- Risque lié à cet émetteur (signature)

LIQUIDITÉ & COTATION

- Cotation sur Euroclear / Bloomberg et autres
- Cotation OTC uniquement
- Marché secondaire organisé par le structurant
- Période de lock-up

I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

FISCALITÉ

- Nature des revenus (intérêts vs plus-value)
- Lieu d'émission et impact sur la fiscalité locale
- Éligibilité PEA / assurance-vie / CTO

PROFIL DE RISQUE ET SCÉNARIO

- Stress tests : évolution du sous-jacent, du spread, des taux
- Sensibilité aux chocs de volatilité, corrélation, convexité
- Probabilité de remboursement à 100% vs scénarios de perte

ACCESSIBILITÉ ET TAILLE

- Tranches spécifiques pour clients privés ou institutionnels
- Distribution (placement privé, EMTN, etc.)



I. RÔLE DES PRODUITS STRUCTURÉS

1 SOUS-JACENT (COLLATÉRAL)

2 STRUCTURE DU COUPON

3 CAPITAL / PRINCIPAL

4 DEVISE

5 DURÉE / MATURITÉ

6 ÉMETTEUR DU REPACK

7 LIQUIDITÉ & COTATION

8 FISCALITÉ

9 PROFIL DE RISQUE ET SCÉNARIO

10 ACCESSIBILITÉ ET TAILLE

II. DIMENSION GREEN

- Critères ESG
- ODD de l'ONU
- CSRD / SFDR / Taxonomie Verte
- Impact / Bilan Carbone
- Communication

MÉDIA GREEN FINANCE

Média référence de la finance verte à destination des institutionnels et asset managers avec près de 10 000 abonnés, près de 4 000 publications, des conférences avec des speakers de haut niveau, des communications avec des partenaires médias : Les Echos, Challenges, AFP, Bloom, Reuters, Morningstar...
<https://green-finance.fr/qui-sommes-nous/>





III. PROCESS

Step n°1 : Identifier les besoins et objectifs spécifiques

Step n°2 : Lettre de mission de votre Conseiller en
Investissement Financier

Step n°3 : Appel d'offres

Lancement d'un appel d'offres auprès de nos partenaires stratégiques
Goldman Sachs, J.P. Morgan, BNP, UBS, Nomura, Citi, Credit Suisse,
Deutsche Bank, CIC et autres...

Goldman
Sachs

J.P.Morgan



NOMURA

citi

CREDIT SUISSE

Deutsche Bank





III. PROCESS

Step n°4 : Évaluation des Solutions

Analyse des propositions et sélection de la solution la plus adaptée.

Step n°5 : Implémentation de la solution retenue et suivi
des performances.

IV. STRATEGGYZ

DERNIÈRE ÉMISSION :

- STR - Strateggyz | 7Y 100% Capital Protégé - NDX / EEM / GLD UP - XS2794298773

AUTRES :

- Single Name CLNs on ESG-Screened Corporates - iTraxx MSCI ESG Series
- Linear Index CLNs on iTraxx MSCI ESG Index
- Levered Index CLNs on iTraxx MSCI ESG Index
- Index Tranche CLNs on iTraxx MSCI ESG Index
- Index Tranche CLN with ESG Equity Bonus Coupon
- Repack CLNs collateralized by a Sustainability-Linked Bond
- Green Bond Cross Currency Repacks



IV. STRATEGGYZ



BRUNO BOGGIANI

Conseiller en Investissements
Financiers et ancien
Administrateur CNCIF.

Expert reconnu en structuration de produits financiers, il débute sa carrière dans la finance de marché au sein de grandes banques, où il conçoit, suit et analyse des produits structurés complexes à destination d'investisseurs institutionnels.

En parallèle de son expertise produit, Bruno s'intéresse très tôt à l'investissement responsable et à la finance verte. En 2018, il crée Green Finance, média de référence sur la finance durable, avec l'objectif de centraliser les bonnes pratiques du secteur. Green Finance fédère aujourd'hui une communauté de près de 10 000 abonnés professionnels : institutionnels, asset managers, investisseurs, experts et décideurs financiers.

En 2014, il fonde Strateggyz, société de conseil en allocation et structuration, avec une approche globale de l'investissement – allant des startups aux produits structurés, jusqu'à l'immobilier – en fonction du profil de risque de chaque client, particulier ou entreprise.

Depuis 2016, Bruno dirige également Next Fi, structure spécialisée dans la communication financière dédiée aux professionnels de la gestion d'actifs et de l'investissement institutionnel.

Diplômé d'un MBA à l'ESG et d'un Master en finance de marché, il intervient désormais comme enseignant en structuration et finance durable, transmettant son savoir-faire technique et stratégique aux nouvelles générations.



V. PROCHAINES ÉTAPES

STEP N°1 : IDENTIFIER LES BESOINS ET OBJECTIFS
SPÉCIFIQUES

Définir la prochaine date... Situation initiale / Situation finale

VI. DISCLAIMER

Les informations contenues dans cette présentation sont fournies à titre informatif uniquement et ne constituent pas une offre ni une recommandation d'investissement. Les produits structurés mentionnés peuvent comporter des risques, y compris le risque de perte en capital. Avant de prendre toute décision d'investissement, les investisseurs doivent consulter leurs propres conseillers financiers et s'assurer de bien comprendre les risques associés. L'émetteur décline toute responsabilité en cas de perte ou de dommage résultant de l'utilisation de ces informations.

STRATEGGYZ SAS au capital de 60 000 EUR - SIRET 802632844 RCS Paris - STRATEGGYZ, 12 rue de Chabanais 75002 Paris - Tél. : +33 (0)1 40 20 13 13 - bruno.boggiani@strateggyz.com - contact@strateggyz.com - Immatriculé à l'ORIAS n° 14004518 - www.orias.fr - CIF, Conseiller en Investissement Financier, COA, courtage en assurance, membre de l'ANACOFI - anacofi.asso.fr - N° D014369 - Activité de transaction sur immeubles et fonds de commerce. Carte professionnelle n° T15642 Paris - garantie financière : Beazley Solution - Ltd V°090007PNMAS015774 - www.strateggyz.com



CONTACT



01 40 20 13 13



www.strateggyz.com



contact@strateggyz.com



12, rue Chabanais 75002 Paris