

Fabien Dornier
Né le 12 octobre 1977
Mobile : (33) 7 68 00 92 60
Email : fabien.dornier@gmail.com

Nationalité française
6, square Gabriel Fauré
75017 Paris
France

EXPERT GESTION D'ACTIFS ESG/ISR, SMART BETA, IMPACT INVESTING

EXPÉRIENCE PROFESSIONNELLE

Consultant indépendant

Paris, juillet 2017 - aujourd'hui

- Consultant pour des sociétés de gestion d'actifs, cabinets de conseil et startups Fintech :
 - Avr. 2021 - Dec. 2021 :
 - Client : société de gestion multi-classe d'actifs (>100 Md€)
 - Conduite du process de labellisation de multiples fonds (ETF, fonds de fonds, managed account) : collecte des informations, rédaction des codes de transparence, choix des indicateurs d'impact, échanges avec les auditeurs, mise en place du plan de remédiation en mode projet et conception de RACIs.
 - 19 fonds labellisés ISR, GREENFIN et Towards Sustainability
 - Déc. 2020 - Fév. 2021 :
 - Client : société de gestion multi-classe d'actifs (~ 10 Md€)
 - Préparation à la labellisation ISR V2 de 6 fonds (fonds actions, fonds crédit/taux, fonds diversifiés, fonds de fonds) et documentation de l'ensemble des process de gestion (ISR ou non)
 - Janv. 2019 - En cours (temps partiel):
 - Client : [Sismo](#), plateforme d'analyse et de visualisation de données à destination des gérants discrétionnaires
 - Audit des fonctionnalités existantes, ajout de fonctionnalités liées à l'investissement factoriel, transcription en spécifications pour l'équipe de développement, participation à la phase de dev en mode *scrum*, aide à la commercialisation (>40 présentations chez des AM parisiens)
 - Déc. 2019 - Mars 2020 :
 - Client : société de gestion multi-classe d'actifs (~ 4Md€)
 - Revue détaillée de l'offre des 5 principaux fournisseurs de données ESG (des méthodologies de scoring jusqu'à la tarification)
 - Déc. 2018 - Janv. 2019 :
 - Client : cabinet de conseil en gestion d'actifs, spécialisé en ISR
 - Revue exhaustive de l'environnement réglementaire américain ayant des impacts positifs et négatifs sur le développement de l'ESG : corporate disclosures, obligation fiduciaire des trustees, proxy voting...

[Ossiam](#), filiale de Natix Global Asset Management

Paris, février 2010 - juillet 2017

Co-fondateur - Directeur des investissements (« Chief Investment Officer »)

- Actifs sous gestion : 2,6 Md€ au 30 juin 2017
- Conception et gestion de stratégies Smart Beta et Pure Beta, sur l'ensemble des classes d'actifs (actions, obligations et matières premières) et tous supports (ETF, fonds dédiés et managed accounts)
- Responsable de l'ensemble des activités d'investissement : recherche quantitative, conception des indices, filtres ESG, structuration des fonds, suivi des indices et gestion quotidienne des fonds
- Lancements d'ETFs en version ESG: exclusions normatives, best-in-class, réduction et reporting des émissions de GES...
- Surperformance significative ajustée du risque par rapport aux indices pondérés par la capitalisation boursière : *Min Variance*, stratégie de rotation sectorielle développée avec M. Robert Schiller, matières premières, *Equal Weight*
- Management d'une équipe de 12 personnes : gérants/chercheurs, informaticiens, traders, comptables
- Promotion des produits Ossiam auprès des clients : présentations, conférences, ateliers...
- Responsable des relations avec les brokers, les contreparties de swap et les participants autorisés

Pentelia Capital, filiale de Natix & White Mountains

Bermudes, juillet 2007 - février 2010

Gérant Senior

- Actifs sous gestion : 800mln\$
- En charge de la gestion des classes d'actifs suivantes : obligations catastrophes, ILWS, dérivés climatiques, assurance terrorisme, divers (aviation, assurance automobile, etc.)
- Responsable de la modélisation, négociation et de la gestion quotidienne de ces produits
- Performances nettes auditées de +12,75 % de juin 2007 à août 2009 (Eolia Diamond-ART Fund)
- Types de produits : obligations, produits dérivés (ISDA) et contrats de réassurance/rétrocession

SYSTEIA Capital, filiale de Crédit Agricole

Paris, septembre 2001 - juillet 2007

Gérant de portefeuille - Fonds de dérivés d'assurance

- Lancement et gestion des fonds dérivés d'assurance et climatiques (actifs sous gestion : 100 mln€)
- Expansion vers de nouveaux produits : TRS sur obligations catastrophes, ILWs, protection risque aviation, mortalité, risque industriel, options *gap* sur hedge funds et indices boursiers, stratégies de couverture sur matières premières
- Performances nettes auditées de +29,10 % de mai 2003 à juin 2007 (Ticker : SYSNAED KY)
- Responsable de la modélisation, la négociation et de la gestion quotidienne de ces produits
- Participation à l'effort commercial

Gérant de portefeuille - Equipe Multistratégies / Responsable de la recherche quantitative

- Lancement et gestion en équipe des fonds Multi-Stratégies (actifs sous gestion : 110mln€) et des fonds de Hedge Funds investissant dans des fonds internes et externes (actifs sous gestion : 55mln€)
- Structuration sur fonds internes : swaps à effet de levier, CPPI et options sur fonds
- Management d'une équipe de 3 chercheurs indépendants dédiés à l'application de techniques issues de domaines scientifiques (économétrie, physique) afin d'améliorer les stratégies internes (Event Driven, CTA, Long/Short, Vol Arb, Stat Arb, Macro...)
- Domaines explorés : trend-following, corrélations, clustering, analyse fractale, optimisation du portefeuille, factor rotation, couverture systématique avec options...

BAREP AM, filiale de Société Générale

Paris, avril 2000 - septembre 2001

Gérant de portefeuille

- Co-gérant du fonds de dérivés climatiques et obligations catastrophe
- Développement et mise en œuvre de stratégies de trading sur les marchés américains, européens et asiatiques
- Recherche quantitative sur la modélisation des séries de températures quotidiennes pour le pricing de dérivés climatiques

ÉDUCATION

Ecole Nationale Supérieure de l'Aéronautique et de l'Espace (ISAE - Supaero)

Toulouse (FR), 1997 - 2000

- Cours ingénieur
- Formation à l'aéronautique, à la physique et à l'informatique
- Majeure: Mathématiques Appliquées

Université Paul Sabatier

Toulouse (FR), 1999 - 2000

- Master 2 en Mathématiques Appliquées à la Finance

Candidat au certificat ESG Investing du CFA Institute UK

Paris, 2021

Lauréat du MOOC HEC/Ticket For Change « Devenir Entrepreneur du Changement »

Paris, 2017

LANGUES ÉTRANGÈRES ET COMPÉTENCES INFORMATIQUES

Français : Langue maternelle

Anglais : Courant (3 années d'expérience aux Bermudes)

Logiciels /Langages :

- Microsoft Office Suite : Word, Powerpoint, connaissances avancées d'Excel & VBA
- Connaissance basique de SQL : navigation et récupération de données en base via requêtes SQL

ACTIVITÉS ET INTÉRÊTS

Business Angel/Impact Investing :

- Acquisition de [participations](#) dans des startups, majoritairement à impact social ou environnemental positif
- Mentorat/Consulting pour entrepreneurs sociaux : [L-Wheel Share](#), [Ecodair](#)
- Membre du comité d'investissement et expert ESG pour [Lita.co](#) : Crowdequity, Impact Investing
- Ex-membre d' [Investessor](#) (plus grand réseau français d'Business Angels)

Volontaire pour les Restos du Cœur : distribution gratuite de repas aux pauvres et aux sans-abris

Membre de La Louve : plus grand supermarché coopératif en France

Musique, cinéma, lecture, pêche, voyages