

BeeAM RISK

SOLUTION DE SUIVI ET
MAITRISE DES RISQUES DE
MARCHÉ EXTERNALISÉE



Un service de suivi de
risque performant



Toutes les classes
d'actifs sont couvertes



Méthodologies de
calcul multiples



Répond aux exigences
du régulateur

POUR QUI ?

Asset Manager,
Investisseurs
institutionnels, Board,
Dirigeants, CEO, RCCI.

PAR QUI ?

Des professionnels du
risk-management

AVEC QUI ?



CARACTÉRISTIQUES

Sans frais d'intégration



Risque de marché, Stress
Tests marché/Liquidité



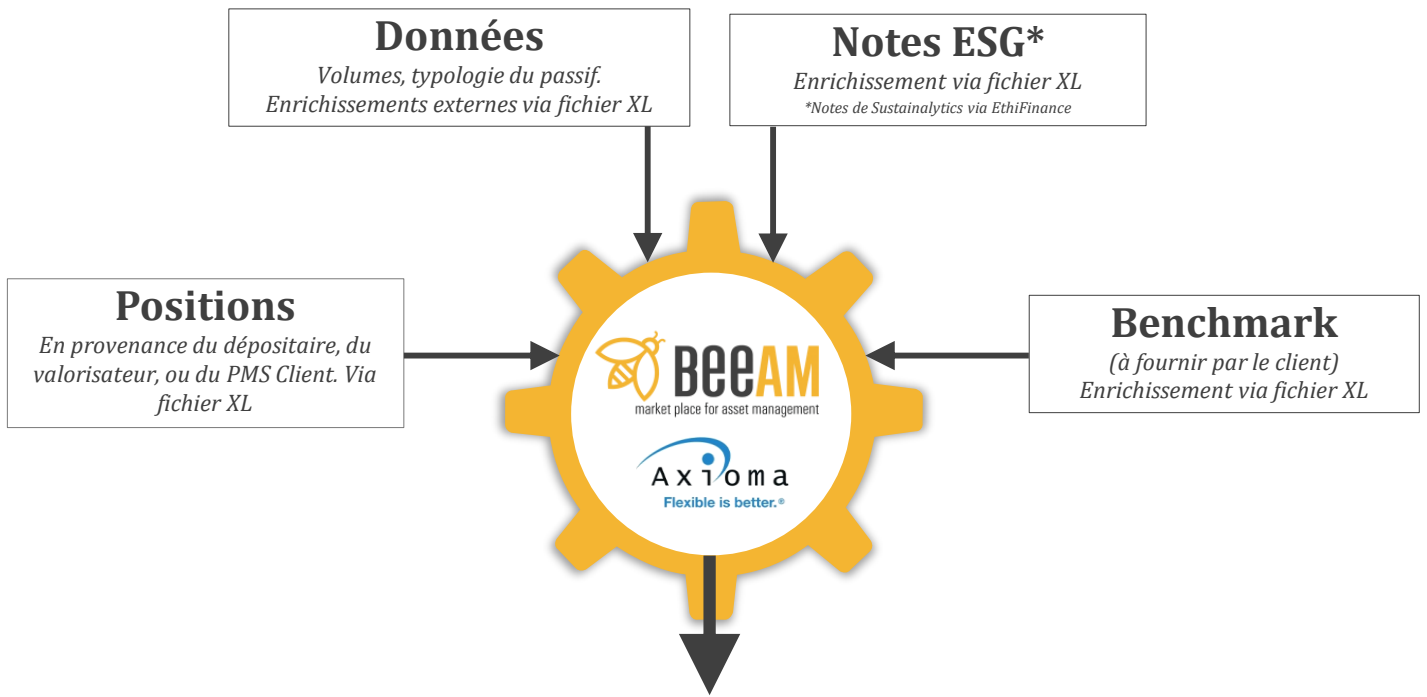
Intégration de la charte
graphique



Délais d'initialisation :
1 semaine



TARIFICATION ANNUELLE EN FONCTION DU TYPE DE SOUS-JACENT,
DU NOMBRE DE PORTEFEUILLES ET DE LA FRÉQUENCE



REPORTING DE RISQUES

Commentaires et analyses par un Risk Manager confirmé

Expositions	Leviers	Notations ESG	Limites de risques interne, Tableau de bord.	Volatilité, VaR, Risk, Tracking Error ...	Stress Tests Marché Liquidité
-------------	---------	---------------	--	---	-------------------------------------

LIVRABLES

Market Risk Reporting
Approche multi factorielle

Client : BeeAM
Portefeuille : BeeAM Action Euro
Date : 19/08/2016

VOLATILITE

Horizon	Volatilité
1 an	23%
3 ans	17%
2008	42%

La volatilité ex ante du portefeuille, calculée suivant une méthodologie multi-factorielle, est de 23% en prenant un historique de données de 1 an et 16% sur 3 ans. Sur l'année 2008, cette volatilité est de 35%. Il n'y a pas de facteur de dégressivité retenu.

VALUE AT RISK

Horizon	VaR (99%, 1J)	CVaR (99%, 1J)
1 an	2,58%	2,99%
3 ans	2,05%	2,39%
2008	5,00%	6,23%

La VaR, calculée sur une période de 1j, avec un une profondeur d'historique de 1 an, avec un pas d'observation quotidien est de 2,70%, alors que la moyenne des pertes au delà de la VaR (ou CVaR), est de 3,13% (soit 16% de plus). Cette distribution indique la présence d'une queue de distribution "normale". La queue de distribution est identique 3 ans, mais beaucoup deux fois plus épaisse sur 2008, ce qui est normal dans le cas de marchés stressés.

Market Risk Reporting
Approche multi factorielle

Client : BeeAM
Portefeuille : BeeAM Action Euro
Date : 19/08/2016

NOTES ESG - Volatilité

Note ESG	Contribution volatilité
Non noté	7%
[1 - 55]	6%
[55 - 70]	27%
[70 - 85]	57%
[85 - 100]	2%
Total	100%

Les notes les plus faibles représentent plus de la moitié du niveau de risque

NOTES ESG - VaR

Note ESG	Contribution VaR (99%, 1J)
Non noté	6%
[1 - 55]	6%
[55 - 70]	26%
[70 - 85]	49%
[85 - 100]	2%
Total	100%

*Notation ESG Sustainalytics via Ethifinance

Market Risk Reporting
Approche multi factorielle

Client : BeeAM
Portefeuille : BeeAM Action Euro
Date : 19/08/2016

Profil de liquidité

La liquidité du portefeuille, est tout à fait satisfaisante. Il n'y a pas de déformation sensible en fonction de la durée moyenne prise en compte.

Volumétrie fournie par Infront

Temps	Liquidité du portefeuille
1 jour	72%
2-3 jours	89%
4-5 jours	94%
5-10 jours	98%
> 10 jours	100%

Temps	Liquidité du portefeuille
1 jour	87%
2-3 jours	97%
4-5 jours	97%
5-10 jours	98%
> 10 jours	100%

Temps	Liquidité du portefeuille
1 jour	90%
2-3 jours	96%
4-5 jours	98%
5-10 jours	99%
> 10 jours	100%

