

REPORTING DE PERFORMANCE ET DE RISQUE

CACEIS propose un ensemble de solutions d'externalisation éprouvées pour permettre à ses clients de limiter leurs risques, réduire leurs coûts et améliorer leur efficacité. CACEIS a développé une expertise reconnue en reportings à valeur ajoutée.

UNE BASE DE DONNÉES RICHE, GARANTISSANT QUALITÉ DES DONNÉES ET TRANSPARENCE DES ACTIFS



- Variété et richesse des données recensées
- Procédures de gouvernance interne couvrant notamment l'exactitude, l'exhaustivité et la pertinence des informations
- Moteur de calcul performant et transparent répondant aux exigences de Bâle III et de Solvabilité II
- Expertise attestée par la certification ISO 9001 et les audits au regard des normes SSAE 16 et ISAE 3402 type II
- Parfaite maîtrise des délais de production et de livraison (98 % de livraison dans les délais pour 22 000 reportings par an)
- Fiabilité des données restituées (taux de retour inférieur à 1 %)

UN PROCESSUS INTÉGRÉ ET AUTOMATISÉ, DE LA COLLECTE DES DONNÉES AU REPORTING FINAL, GARANTISSANT SÉCURITÉ ET FIABILITÉ



- Outils de calcul perfectionnés
- Processus efficace, assorti de contrôles à chaque étape
- Reporting standard ou sur mesure (fréquence, choix des données à afficher et des indicateurs à mettre en avant, choix des couleurs, des logos, des polices, etc.)
- Reporting accessible via le module performance du portail internet OLIS

PRIME REPORT : EXPERTISE EN MATIÈRE D'ANALYSE DE PERFORMANCE ET DE RISQUES

ALLOCATION D'ACTIFS

Photo du portefeuille (ventilation par classe d'actifs, devise, secteur, rating, etc.)

RISQUE DE MARCHÉ

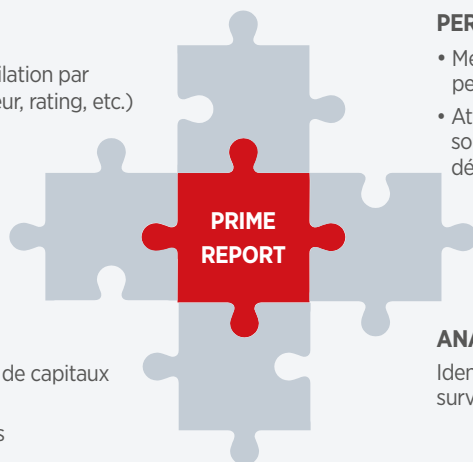
- Bâle, Solvency: minimum de capitaux propres
- Calcul de VaR, Stress tests

PERFORMANCE

- Mesure: calculer et comparer la performance par rapport aux benchmarks
- Attribution: identifier et quantifier les sources de la surperformance pour déterminer l'origine de la valeur ajoutée

ANALYSE RISQUE/RENDEMENT

Identifier et quantifier les sources de la survolatilité

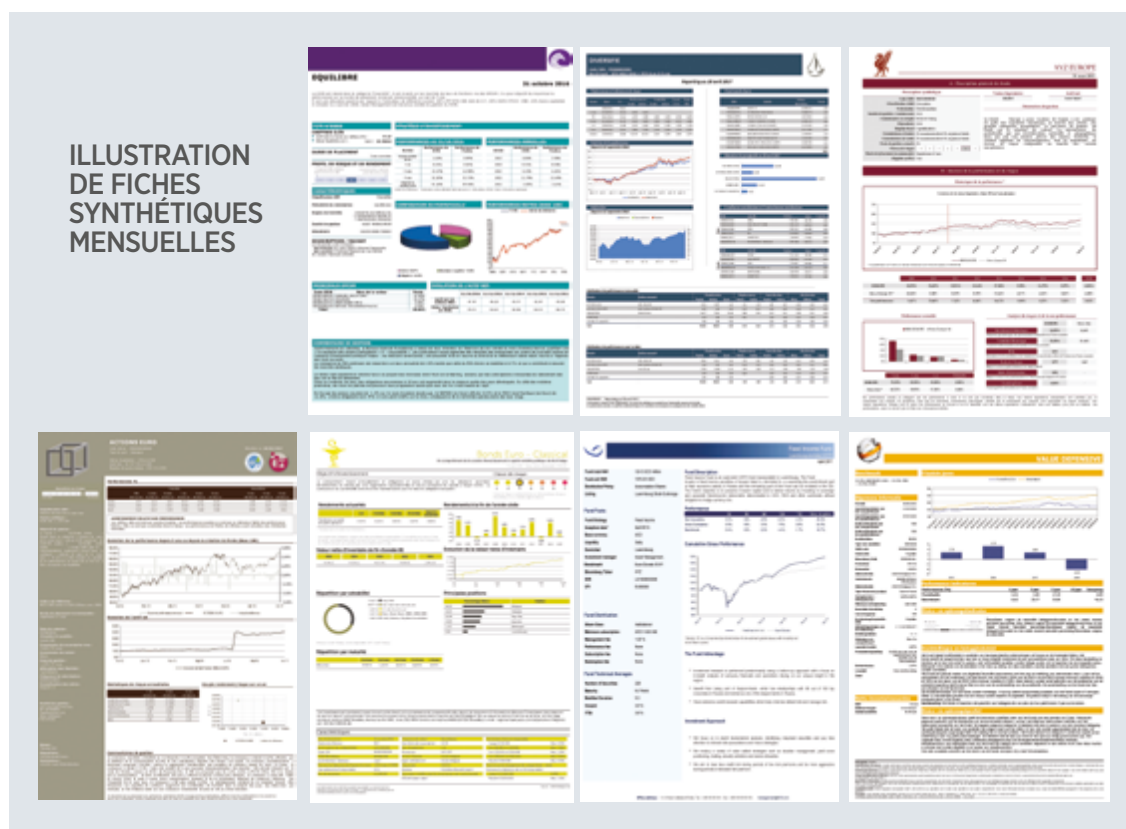


UN LARGE ÉVENTAIL DE RAPPORTS FINANCIERS PERSONNALISÉS EN FONCTION DE CHAQUE PROFIL DE RISQUE ET INSTRUMENT



- Fiches synthétiques de performance avec indicateurs de risque (ex : volatilité du portefeuille et du benchmark, tracking error ex post, ratio de Sharpe, ratio d'information, etc.)
- Fiches synthétiques mensuelles présentant les caractéristiques du portefeuille, ainsi qu'une brève analyse de la performance et des actifs selon différents critères (ex : ventilation par classe d'actifs, zone géographique, devise, secteur, rating, etc.)
- Grilles de performance présentant une synthèse des performances d'un groupe de portefeuilles par rapport à leur benchmark
- Fiches synthétiques de contribution à la performance mesurant la contribution de chaque poche et/ou actif à la performance globale du portefeuille
- Fiches synthétiques d'attribution de performance (actions et taux)
- Tableaux de bord mensuels complets destinés aux investisseurs institutionnels, présentant de façon plus détaillée les informations contenues dans les fiches de synthèse mensuelles (ex : mesure du risque, de la performance et de la qualité)
- Rapports d'attribution de la volatilité
- Calcul et analyse de la value-at-risk
- Simulations de stress-tests
- Reporting Solvabilité II (calcul du SCR de marché, production du fichier Tripartite)
- Executive reports à l'intention des dirigeants, leur permettant de piloter et évaluer l'ensemble des risques (distribution, administration, gestion) d'un fonds d'investissement donné

ILLUSTRATION DE FICHES SYNTHÉTIQUES MENSUELLES



WWW.CACEIS.COM