

>> RISK REPORT

au service de la maîtrise de vos risques

OTC Conseil propose à ses clients « Asset Managers » ou Investisseurs Institutionnels un service d'analyse des risques présents dans leurs portefeuilles : c'est l'offre RISK REPORT.

Différents modules calculatoires, assemblés selon les besoins spécifiques du client, permettent de traiter tous les types de portefeuilles ou d'instruments financiers. Ils couvrent un ensemble complet d'indicateurs et de paramètres d'évaluation des risques depuis les approches probabilistes (VaR,...) jusqu'à la modélisation des risques extrêmes (Stress Tests,...).

Associé au savoir-faire reconnu d'OTC Conseil en matière de traitement de données, l'ensemble de ces modules permet de définir, de quantifier et d'analyser les risques des portefeuilles selon les standards les plus exigeants. La modularité de la démarche permet également d'adapter la production des calculs aux process existants chez nos clients.

Ce service comprend un ensemble de processus fonctionnels regroupés en quatre parties distinctes :

- 1 **Traitement des données des inventaires** : contrôle de cohérence des données et traitement d'homogénéisation fondé sur l'utilisation de la technologie OTC Conseil en filtrage statistique (OST, reconstitution des données manquantes et/ou aberrantes, rebasage des séries historiques,...).
- 2 **Constitution des bases historiques nécessaires.**
- 3 **Calculs des différents indicateurs de risques** via une interface utilisateur paramétrable ; l'utilisateur peut choisir et définir les paramètres à calculer.
- 4 **Production des reportings** via une interface utilisateur paramétrable.

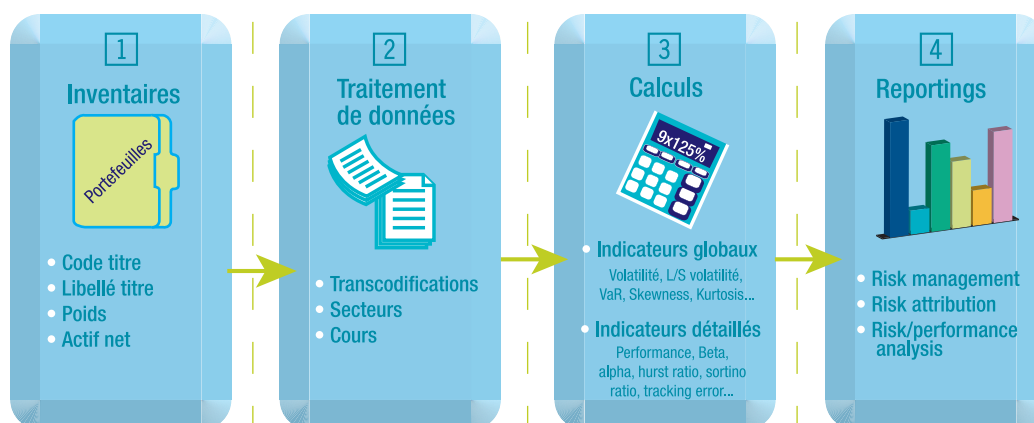
Trois niveaux de reportings pré-formatés sont mis à disposition de nos clients. Ils sont un cadre de départ à partir duquel nos clients spécifient leurs besoins en fonction de leurs pratiques propres.

- **Risk Management** : Evaluation et quantification du profil de risque global du portefeuille.
- **Risk Attribution** : Analyse marginale de la participation au risque global avec une répartition ligne par ligne, par type d'actif, par secteur, et par maturité à l'intérieur du portefeuille.
- **Risk/Performance Analysis** : Analyse croisée des indicateurs de performance au regard des risques utilisés.

Cet ensemble très complet et parfaitement modulaire, fait de Risk Report une offre au service de tous les processus de Risk Management. Il permet d'assurer l'ensemble de la chaîne de traitement et de production des analyses de risques, depuis la collecte des données jusqu'au formatage des différents rapports.

Mais, au-delà de ces modèles pré-définis, tous les modes d'organisation des indicateurs et d'expression des résultats peuvent être proposés à nos clients. Cette flexibilité d'utilisation fait de Risk Report une offre performante pour tous les processus de suivi et d'analyse des risques.

L'équipe Risk Report est organisée autour d'un groupe d'experts quantitatifs en charge de l'évolution de ce service. Cette offre vient enrichir une bibliothèque fonctionnelle qui couvre tous les types de problématiques que peuvent rencontrer nos clients dans l'identification et la quantification de leurs risques.



Aujourd'hui, Risk Report est une offre complète d'analyse de risques indépendante. Sa simplicité d'intégration et d'utilisation en fait un service flexible, réactif et fiable. L'ensemble des fonctionnalités proposées, la capacité à traiter les fonds de fonds sur le mode transparence sont des atouts incontournables. La conception originale de cette offre de services assure un complément naturel à l'expertise risques d'OTC Conseil. Les synergies entre les différentes équipes impliquées dans ces projets établissent une dynamique qui permet à OTC Conseil de répondre aux besoins de ses clients de manière indépendante ●

VOS CONTACTS
OTC CONSEIL

Gilles GARNIER – ggarnier@otc-conseil.fr et Siavash VAZIRI – svaziri@otc-conseil.fr