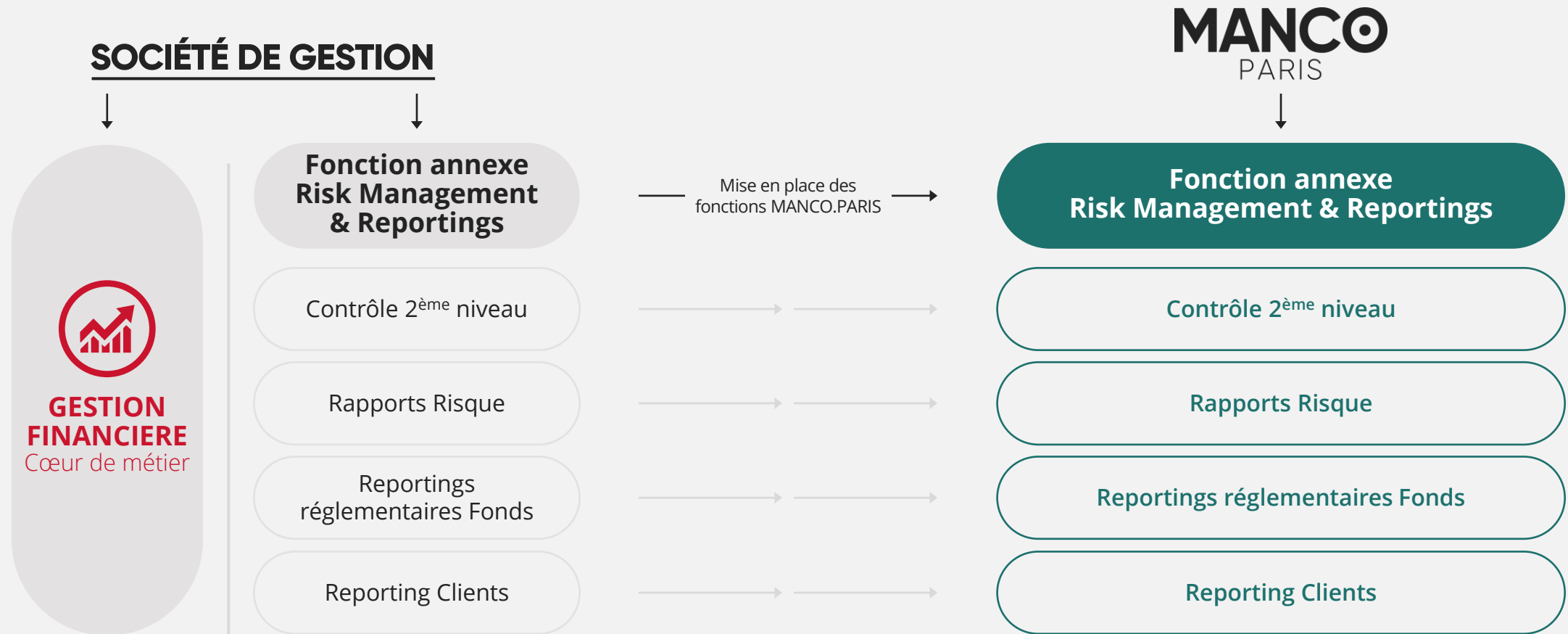


# **FONCTIONS DE RISK MANAGEMENT**

# Organisation cible



# Contrôles de Deuxième niveau

## Contrôle du respect des ratios réglementaires

Ratio de composition de l'actif

Ratios de division des risques

Ratios d'emprise

Ratio de risque global

## Contrôle des contraintes d'investissement

Contraintes découlant de l'orientation de gestion telle que définie dans le prospectus

## Contrôle de l'application de la méthode ESG retenue en cas d'engagement significatif ou d'approche non-engageante

Amélioration de note / sélectivité / amélioration d'indicateur extra-financier / autres approches

# Rapport de risques

➔ Une synthèse des compositions des Fonds

➔ Les évolutions des métriques de Risque

Volatilité ex-ante, ex-post, Levier, VaR, ratio de Sharpe, ratio d'Information, corrélations, Tracking Error, SRRI, ...

➔ Les résultats des Stress Marché et de Liquidité

Stress de Liquidité : via une méthode prenant en compte la structure du Passif

➔ La cartographie des risques, les seuils en place, et les éventuelles alertes activées sur la période

➔ Mise à disposition de l'outil RiskRadar permettant les contrôles de 1<sup>er</sup> niveau des ratios réglementaires, contraintes d'investissement et calculs de métriques de risque ex-ante

➔ Les évolutions réglementaires

# Responsable du Pôle Gestion des Risques

Votre contact



Etienne Martin

+33 1 88 40 45 73

[emartin@manco.paris](mailto:emartin@manco.paris)