

SummaRisk

A caccia di “cigni neri”

Innovation
Made in Italy

Risk & Performance FinTech
Innovative Quantitative Engine



La nostra **mission** è di aiutare tutti gli asset manager ad eseguire decisioni strutturate di investimento



Portfolio

Cerca per descrizione portafoglio, cliente o codice SummaRisk



Tools

Utilizza i tools di SummaRisk



Asset

Cerca un titolo per codice ISIN, descrizione o codice SummaRisk

Una **piattaforma** per il calcolo e l'analisi di **rischio e performance** di portafogli attraverso metodi quantitativi che consentono decisioni info-based per un multi-asset management.

Attraverso un'applicazione web semplice e veloce si agevola il lavoro di risk & performance management fornendo misure **affidabili**, ottimizzando i **tempi** e riducendo i **costi**.

Risk

Portafoglio: Portafoglio Demo - Bilanciato 50-50

Data Riferimento: 01/02/2018

Allocation Performance Portfolio

	Orizzonte	Tipo	VaR 1%	VaR 5%	VaR 50%	VaR 95%	VaR 99%	Worst Case	Expected Shf 5%
Dettagli	1 Giorno	PTF	-1,03%	-0,59%	0,03%	0,63%	0,93%	-1,46%	-0,92%
Dettagli	1 Giorno	BMK	-0,98%	-0,63%	0,02%	0,63%	0,92%	-1,28%	-0,89%
Dettagli	1 Giorno	REL	-0,44%	-0,24%	0,02%	0,28%	0,42%	-0,72%	-0,38%
Dettagli	1 Mese	PTF	-3,74%	-2,35%	0,63%	3,62%	4,53%	-5,84%	-3,36%
Dettagli	1 Mese	BMK	-3,61%	-2,63%	0,39%	3,29%	4,99%	-6,56%	-3,70%
Dettagli	1 Mese	REL	-1,70%	-1,13%	0,24%	1,53%	2,00%	-2,27%	-1,53%
Dettagli	2 Mesi	PTF	-4,92%	-3,50%	1,12%	5,53%	7,80%	-6,30%	-4,70%
Dettagli	2 Mesi	BMK	-6,24%	-3,51%	0,71%	5,09%	7,16%	-11,77%	-5,52%
Dettagli	2 Mesi	REL	-2,76%	-1,62%	0,49%	2,44%	3,18%	-6,62%	-2,63%
Dettagli	3 Mesi	PTF	-5,48%	-3,78%	1,45%	7,11%	9,52%	-7,32%	-5,25%
Dettagli	3 Mesi	BMK	-7,26%	-3,89%	0,92%	6,84%	9,66%	-13,41%	-6,46%
Dettagli	3 Mesi	REL	-4,07%	-2,57%	0,41%	3,09%	4,11%	-8,38%	-3,91%
Dettagli	6 Mesi	PTF	-7,69%	-4,63%	3,31%	11,66%	17,04%	-8,61%	-6,56%
Dettagli	6 Mesi	BMK	-9,30%	-5,20%	1,96%	10,11%	15,74%	-13,82%	-8,13%
Dettagli	6 Mesi	REL	-5,18%	-2,81%	1,35%	5,33%	7,50%	-7,88%	-4,41%
Dettagli	1 Anno	PTF	-7,97%	-3,63%	7,62%	20,59%	25,57%	-15,98%	-7,21%
Dettagli	1 Anno	BMK	-11,01%	-6,85%	4,11%	15,66%	21,30%	-20,31%	-10,36%
Dettagli	1 Anno	REL	-5,11%	-1,95%	3,68%	10,11%	14,60%	-8,31%	-4,17%
Dettagli	Fine Anno	PTF	-7,35%	-4,30%	6,94%	18,73%	23,74%	-14,20%	-6,87%
Dettagli	Fine Anno	BMK	-11,15%	-7,15%	4,01%	14,79%	18,85%	-18,62%	-9,27%
Dettagli	Fine Anno	REL	-4,18%	-2,41%	3,40%	9,04%	12,21%	-7,72%	-4,00%



La nostra passione è dimostrata nella cura della gestione del rischio di oltre 10 clienti, 16.000 titoli, 300 fondi

L'automatizzazione delle procedure di calcolo permette un'ottimizzazione del tempo a disposizione dei fund manager. L'interfaccia web è user-friendly e intuitiva. Il monitoraggio degli obiettivi di rischio e rendimento, della raccolta e del rispetto delle normative è parte integrante della nostra reportistica, anche con l'ausilio di strumenti di business & data analytics. La nostra competenza ed esperienza garantisce sicurezza ed efficienza anche in presenza di ispezione degli organi preposti. Le nostre competenze quantitative saranno sempre pronte a soddisfare le vostre esigenze, mettendo a vostra disposizione gli elementi di cui sotto.



FABRICA IMMOBILIARE



SYMPHONIASGR

FPA

FOONDO PENSIONE AGENTI PROFESSIONISTI DI ASSICURAZIONE
www.fonage.it

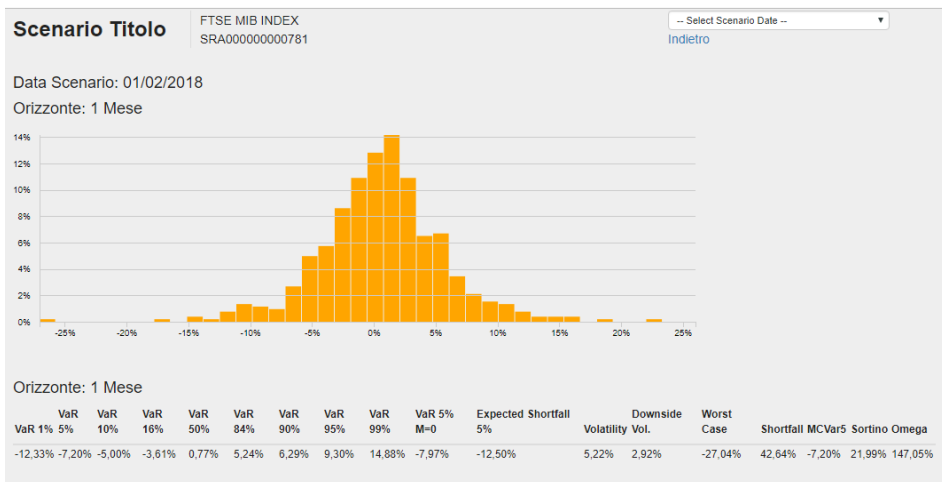
Risk Ex-Ante	Gestioni Patrimoniali Aggregati	Performance Ex-Post	Custom Reports & Applications
Investment Limits	Gestioni Patrimoniali Mandati	Performance Analysis	Flessibilità



Il modello quantitativo, ampiamente testato, permette di analizzare puntualmente lo scenario finanziario in termini di rischio e le metriche associate a ogni asset

Titoli -- Select Type --
[Crea Nuovo Titolo](#) Titoli Incompleti

ID	Descrizione	ISIN	Divisa
SRA000000000781	FTSE MIB INDEX		EUR
SRA000000000805	FTSE 100		GBP
SRA0000000013019	FTSE 250		GBP



La flessibilità dell'applicazione permette di gestire anche i benchmark, il loro rischio e le loro performance. Il confronto tra benchmark e portafoglio permette di individuare e di attribuire rischio e performance alle differenze tra la gestione e il mercato. Un'attenta analisi della performance attribution aiuta il management a capire da dove proviene la performance. Come i portafogli, i benchmark sono dinamici nel tempo e storicizzati, per conoscere in ogni momento cosa è successo nella storia passata della gestione.



Un'attenta analisi di performance, numerosi indicatori ex-post per presentare ai vostri clienti sempre il dato pulito e corretto



SCHEDA DI SINTESI - Portafoglio Demo - Bilanciato 50-50 - February 2018

Gestore: **Nome Cognome** Data di inizio del servizio: **01/09/2016**

Profilo dell'investitore: **PROFILO DI RISCHIO ALTO / MEDIO / BASSO** **ORIZZONTE TEMPORALE CORTO / MEDIO / LUNGO**

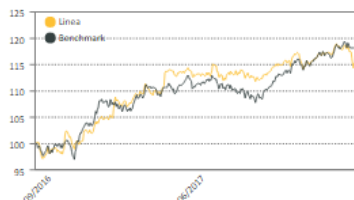
Politica d'investimento: Mercati, valuta, asset class, settori di investimento.

Benchmark: **30% MSCI EUROPE E, 20% JPM EMU GOVERNMENT ALL MATS. (E), 15% BARCLAYS EURO AGG CORPORATE (E), 15% MSCI USA, 10% BOFA ML US TRSY 1-3Y (5), 10% MSCI WORLD E**

Stile di gestione: **Cenni sulla strategia di investimento utilizzata.**

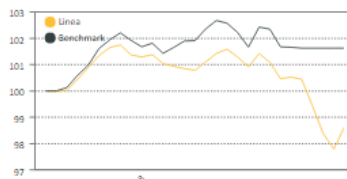
PERFORMANCE - Aggiornate al 07/02/2018

Performance Linea da stipula contratto



	1 mese	3 mesi	6 mesi	YTD	1 anno	3 anni	Inception
Linea	0.48 %	0.32 %	3.39 %	0.47 %	9.36 %	-	18.54 %
Benchmark	1.63 %	2.13 %	7.56 %	1.63 %	10.90 %	-	19.24 %

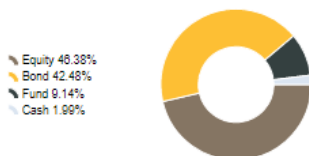
Performance Linea da inizio anno



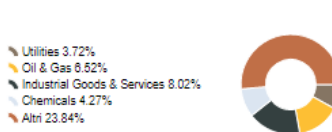
	Volatilità 1 anno	Duration
Linea	5.57 %	8.66
Benchmark	5.98 %	-

ALLOCATION - Aggiornata al 07/02/2018

Distribuzione portafoglio per tipologia titoli

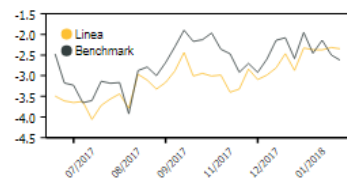


Distribuzione portafoglio per settore azioni



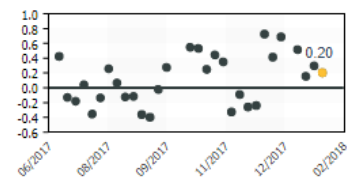
RISCHIO - Aggiornato al 01/02/2018

Grafico storico VaR 5% 1M portafoglio



Value at Risk 5% 1 mese: **-2.35 %**

Grafico rendimento / rischio storico (ultima osservazione in arancio)



Expected shortfall 5% 1 mese: **-3.36 %**

Questo documento ha natura meramente informativa e non costituisce una modalità di offerta o sollecitazione all'acquisto o alla vendita di strumenti finanziari e/o di servizi di investimento. Prima di sottoscrivere un contratto di gestione di portafogli, si prega di leggere attentamente l'Informativa Precontrattuale ed il Contratto di Gestione.

Powered by © SummaRisk 2018



Selezionare il Report che si vuole analizzare, impostare i parametri di generazione e premere il bottone 'REPORT'

Prospetti | Report | Grafici | Export

Risk Report
Report Allocation
Scheda Sintesi - Fondo
Scheda Sintesi - Performance

DATA DI RIFERIMENTO

PORTAFOGLIO

REPORT

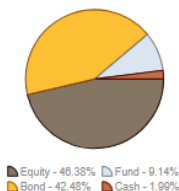


REPORT ALLOCATION - Portafoglio Demo - Bilanciato 50-50 - 07/02/2018

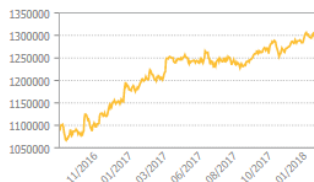
Aggiornato al 07/02/2018

NAV: \$1,266,618.46

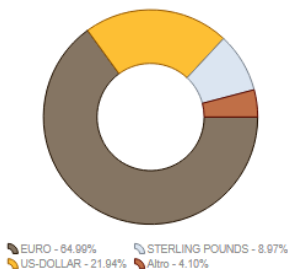
Scomposizione per asset class



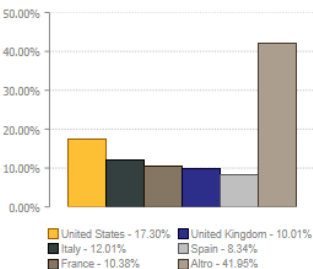
Andamento storico del NAV



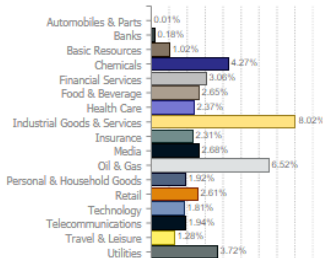
Scomposizione per valuta



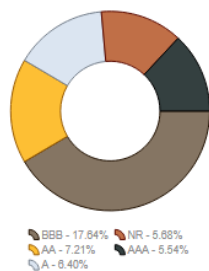
Scomposizione per paese



Azioni - scomposizione per settore



Obbligazioni - scomposizione per rating



Contatti

Innovation
Made in Italy



Manager

Radu Capatina

SummaRisk S.r.l.

t. 011 315 7478

m. 327 974 7879

r.capatina@summarisk.eu

Disponibile per :

- Approfondimenti su tutte le tematiche di rischio che SummaRisk può offrire.
- Demo del nostro prodotto e insight su come lavoriamo.
- Trovare altre soluzioni, anche integrative a un modello già esistente, fornendo insight e professionalità.

Non offriamo certezze, ma solide probabilità.



SummaRisk S.r.l.

SummaRisk è un'organizzazione di professionisti che aiuta i suoi clienti a gestire tutte le tematiche legate al rischio dei loro investimenti, fornendo insight e informazioni quantitative per assistere gli asset manager e le figure senior di alto livello presenti presso tutti gli intermediari finanziari.

I nostri professionisti costituiscono uno spettro ampio di formazione professionale nel ambito matematico-statistico, finanza quantitativa, informatico digitale e di finanza aziendale. Attraverso le nostre ricerche, analisi di rischio, modelli matematici e informatici, cerchiamo di essere una fonte attendibile per approfondimenti pertinenti, tempestivi e affidabili.



SummaRisk

A caccia di “cigni neri”

Tutti i dati/informazioni sono provenienti da SummaRisk © 2018. Questo documento commerciale è indirizzato ai clienti Professionisti. Se questo documento viene in Vostro possesso per errore, siete pregati di distruggerlo e comunicare la violazione direttamente a SummaRisk. Questa brochure non costituisce in nessun modo un'offerta promozionale per clienti interessati che risiedono in paese nei quali le autorità locali non abbiano reso legale tale tipo di attività. SummaRisk non sarà responsabile per qualsiasi perdita finanziaria o decisione presa o non presa in base all'informazione divulgata in questo documento. Questa brochure contiene informazioni generali e pubblicitarie del prodotto e dei servizi che SummaRisk può offrire. Questa brochure non è un servizio di consulenza, nè riflette in toto il nostro prodotto o i modelli quantitativi che usiamo per i nostri clienti. Questo documento è non-contrattuale e serve soltanto a scopo informativo. Questo documento è strettamente confidenziale e non può essere utilizzato per scopi diversi da quello per cui è stato concepito. Non può essere copiato, distribuito o comunicato a terzi, in tutto o in parte, senza il preventivo consenso scritto di SummaRisk.

La presente Presentazione non può essere utilizzata in alcune giurisdizioni in cui tali offerte o promozioni non sono state autorizzate dalle autorità competenti. Ogni investitore è tenuto ad assicurarsi di rispettare questi requisiti e divieti. Nessuna informazione contenuta in questo documento deve essere in nessun modo interpretata come contrattuale. Le informazioni contenute in questa brochure sono basate sugli attuali presupposti, secondo le circostanze attuali e possono subire successive modifiche. Nessun obbligo o responsabilità è accettato da SummaRisk verso nessun individuo fisico o giuridico per errori, inesattezze o omissioni in questa brochure, o riguardanti qualsiasi altro tipo di informazioni o prodotti, per l'adeguatezza, l'accuratezza, la complessità o la ragionevolezza di queste informazioni. Anche se le informazioni contenute in questa brochure sono considerate precise, SummaRisk nega espressamente tutte le responsabilità per ogni reclamo, espresso o implicito, rispetto a questa brochure o per ogni comunicazione scritta o orale da ogni parte interessata nel corso della preparazione delle informazioni riguardanti il prodotto. Prezzi, margini e commissioni sono ritenute esclusivamente indicative e possono essere soggette a modifiche in ogni momento in dipendenza, inter alia, delle condizioni del mercato.

SummaRisk si riserva il diritto di modificare ogni informazione contenuta in questo documento in ogni momento senza nessun preavviso. Più in generale, SummaRisk, i suoi soci, i suoi dipendenti, i suoi azionisti di riferimento, i suoi manager e direttori, i suoi partners, i suoi rappresentanti, i suoi agenti o le sue commissioni rilevanti non potranno essere ritenute responsabili delle informazioni contenute in questo documento, e dell'uso che una terza parte potrebbe fare di queste informazioni. Questo documento consiste in una brochure creata e preparata da SummaRisk basata su fonti considerate attendibili. In ogni modo, SummaRisk non garantisce l'accuratezza, l'adeguatezza o la completezza delle informazioni ottenute da fonti esterne contenute in questo documento. Copyrights: SummaRisk 2018.

