



## Charakterystyka

**Suncon Risk Manager** jest systemem – narzędziem do kontroli polityki zarządzania ryzykiem w towarzystwach funduszy inwestycyjnych. Aplikacja Suncon odpowiada wymaganiom wskazanym w Rozporządzeniu Ministra Finansów w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych z dnia 30 kwietnia 2013 (DZ. U. 8 maja 2013 Poz. 538) w zakresie zarządzania ryzykiem. Definiuje istotne ryzyka w polityce inwestycyjnej funduszu, prezentuje procesy oceny ryzyka, nakreśla procesy decyzyjne uwzględniające strategię i plany biznesowe.

Automatyzacja procesów pomiaru ryzyka, identyfikacja źródeł ryzyka, prezentacja wyników w przejrzystych raportach - to najistotniejsze elementy Risk Manager'a.

Wszystkie podstawowe i kluczowe funkcjonalności są dostępne z głównego menu. System umożliwia definiowanie własnych ustawień oraz ostrzega przed niepożądanym zagrożeniem.

## Cechy systemu

Przebieg procesu zarządzania ryzykiem:

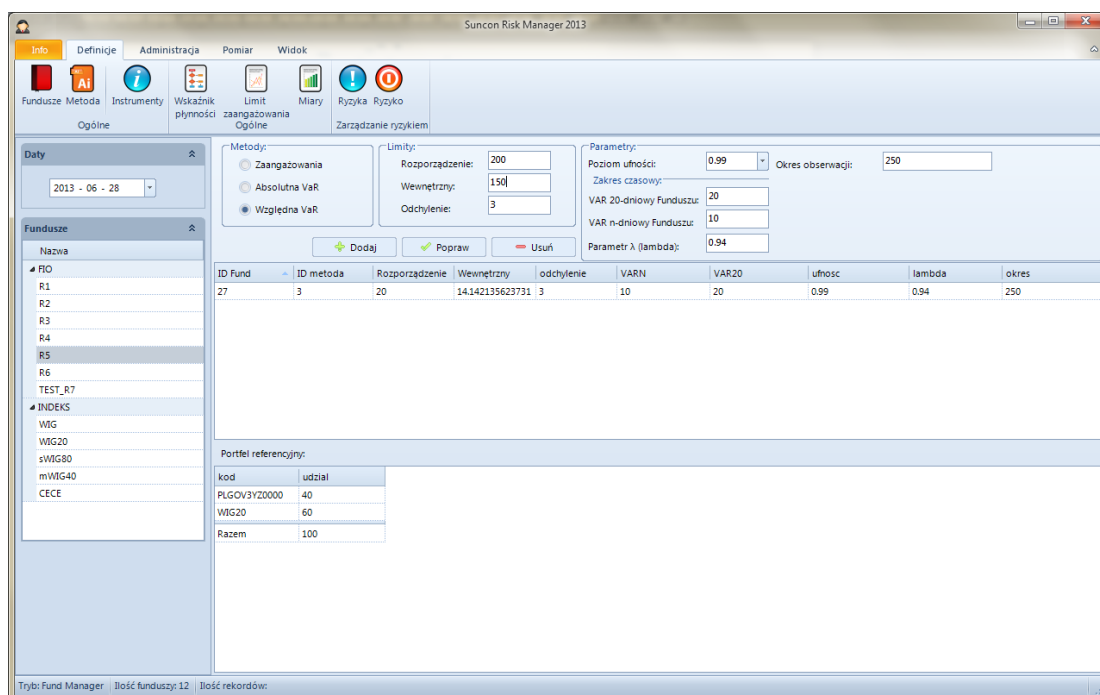
1. Identyfikacja ryzyka
2. Ocena poszczególnych ryzyk
3. Planowanie i zarządzanie ryzykiem (metody wyceny, zasady akceptacji, pomiar ryzyka, zarządzanie ryzykiem płynności, stress testy)

Funkcjonalności systemu:

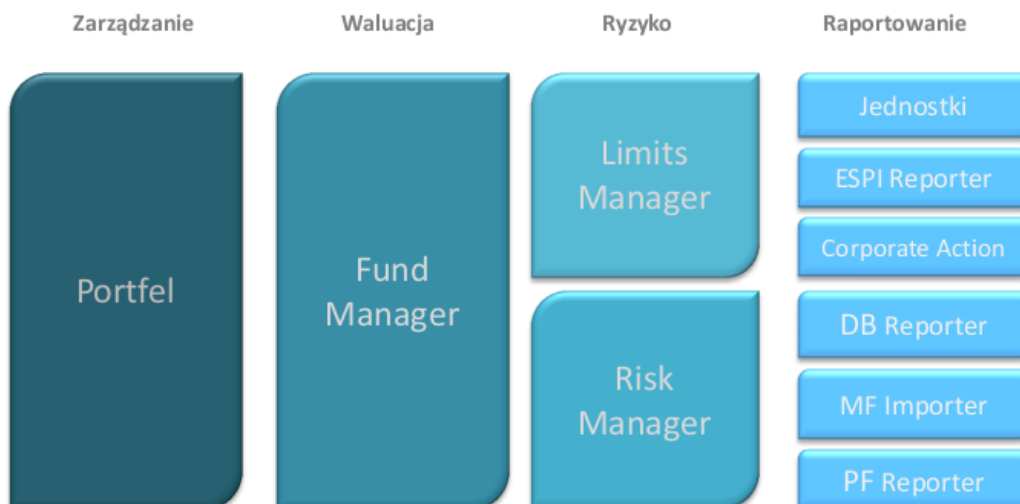
- Pomiar ryzyka wg metody wartości zagrożonej absolutnej i względnej (określanie poziomu ryzyka stopy procentowej (vertex-y dla instrumentów dłużnych), cen instrumentów kapitałowych, ryzyka walutowego, ryzyka instrumentów pochodnych)
- Określanie czynników ryzyka
- Zarządzanie płynnością
- Kontrola limitów zaangażowania
- Prezentacja aktualnego poziomu ryzyka
- Porównanie aktualnego poziomu ryzyka z ustalonym
- Testy warunków skrajnych
- Liczne raporty m.in. na potrzeby komitetu inwestycyjnego, poziomu ryzyka
- Ocena efektywności inwestycji w jednostki uczestnictwa funduszu w porównaniu do portfela referencyjnego

## Architektura

Okno główne systemu zawiera wszystkie elementy sterujące najważniejszymi funkcjami systemu.



## Suncon Portfolio



## Kontakt

**Suncon Sp. z o.o.**

ul. Domaniewska 37, 02-672 Warszawa

e-mail: [biuro@suncon.eu](mailto:biuro@suncon.eu)

tel. 22 370 21 21

[www.suncon.eu](http://www.suncon.eu)