



Notre produit : Scenarium

Scenarium calcule prix, sensibilités et scénarios de stress sur vos portefeuilles obligataires, avec des résultats transparents et auditables.

Ce que fait Scenarium

- ✓ Valorisation : prix clean/dirty, YTM, durations, convexités, key rates.
- ✓ Scénarios de stress : chocs de courbes de taux et spreads de crédit, scénarios multi-couches rejouables.
- ✓ Courbes : import CSV, courbes EIOPA/BCE, modèles Nelson-Siegel / Svensson.

Pour qui ?

Équipes ALM / IRRBB, risques de marché taux / crédit, trésorerie et actuariat des banques et assureurs.

3 bénéfices clés

- ✓ Moins d'Excel, plus d'analyse.
- ✓ Résultats traçables et justifiables.
- ✓ Un moteur unique plutôt que des macros dispersées.

Valuation - Portfolio ABCD - Scenario UP 31.12.2025

Overview Results Pivot KPI Rate Curves Spread Curves Export Excel Export PDF

100 TOTAL INSTRUMENTS **100.0%** SUCCESS RATE **82 454 209,41** MARKET VALUE

Run Information

NAME	Portfolio ABCD - Scenario UP 31.12.2025	STATUS	DONE
DATASET	Portfolio ABCD	AS OF DATE	31 Dec 2025
ASSIGNMENT GROUP	EIOPA currency	CREATED	03/12/2025 16:38

Configuration

Assignment Group: EIOPA currency

SET OF MAPPING RULES USED FOR THIS RUN
RULES: 5

FIELD	VALUE	CURVE	SPREAD
currency	EUR	EUR-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	-
currency	USD	USD-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	-
currency	GBP	GBP-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	-
currency	CHF	CHF-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	-
currency	JPY	JPY-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	-

Choc de 100bps sur la courbe EURO et 200bps sur les autres devises

Scenario Layers

TARGET	KEY	SHOCK TYPE	PARAMETERS
RATE	EUR-RFR-EIOPA-OIS-ZERO	PARALLEL_BP	a_bp: 100.0bp b_bp/year: 0.0bp
RATE	All	PARALLEL_BP	a_bp: 200.0bp b_bp/year: 0.0bp

Valorisation de portefeuilles obligataires — prix, sensibilités, métriques de risque.

© 2025 Quantora Technologies — quantoratechnologies.com



Cas d'usage de Scenarium

ALM / IRRBB & ORSA

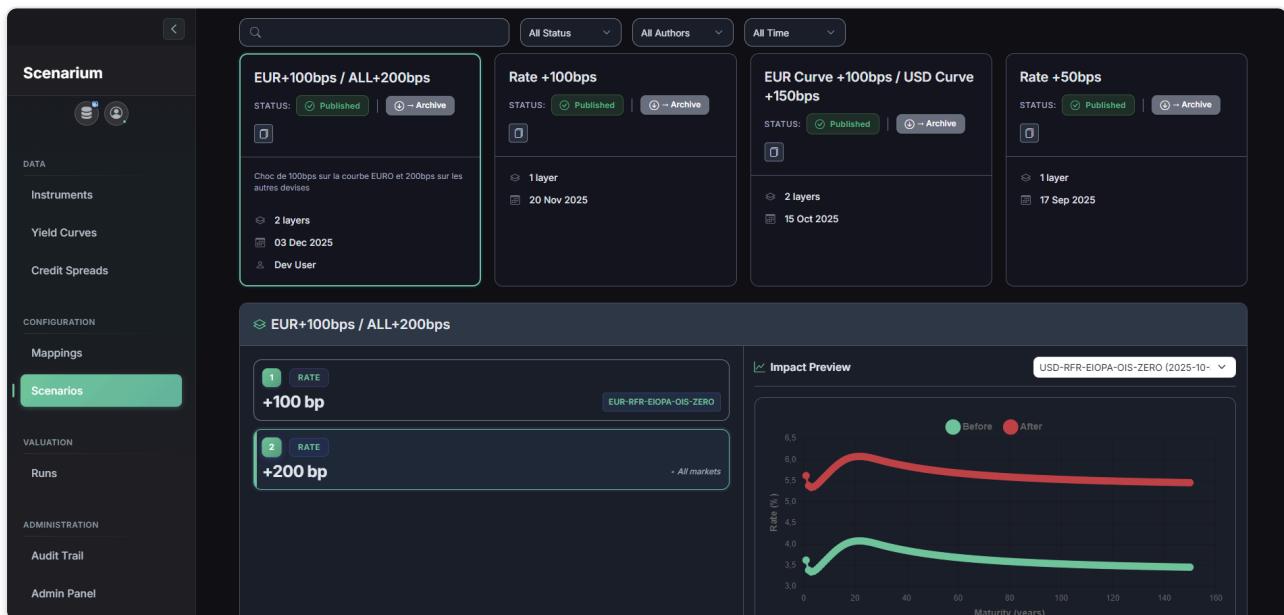
Valorisation et stress des portefeuilles obligataires utilisés dans les analyses ALM / IRRBB, en support aux exercices ORSA / ICAAP.

Risque de marché taux / crédit

Suivi du P&L et des sensibilités d'un portefeuille obligataire sous scénarios de taux et de crédit (analyses par émetteur, secteur, rating, devise).

Trésorerie & placements

Analyse de l'impact des mouvements de taux sur les portefeuilles de trésorerie pour le choix des maturités, des couvertures et le suivi des limites.



Construction de scénarios de stress multi-couches sur courbes de taux et spreads.

Prochaine étape

Pour une démo ou un échange sur vos portefeuilles :

contact@quantoratechnologies.com • quantoratechnologies.com