

## Три полезные «фишки» в ГАМА

# Фишка 1

## Стресс-тестинг по методике ЦБ РФ

## Ликвидность

Денежные потоки по активам

Доход от реинвестирования

Продажа активов

Займ активов

## Обязательства

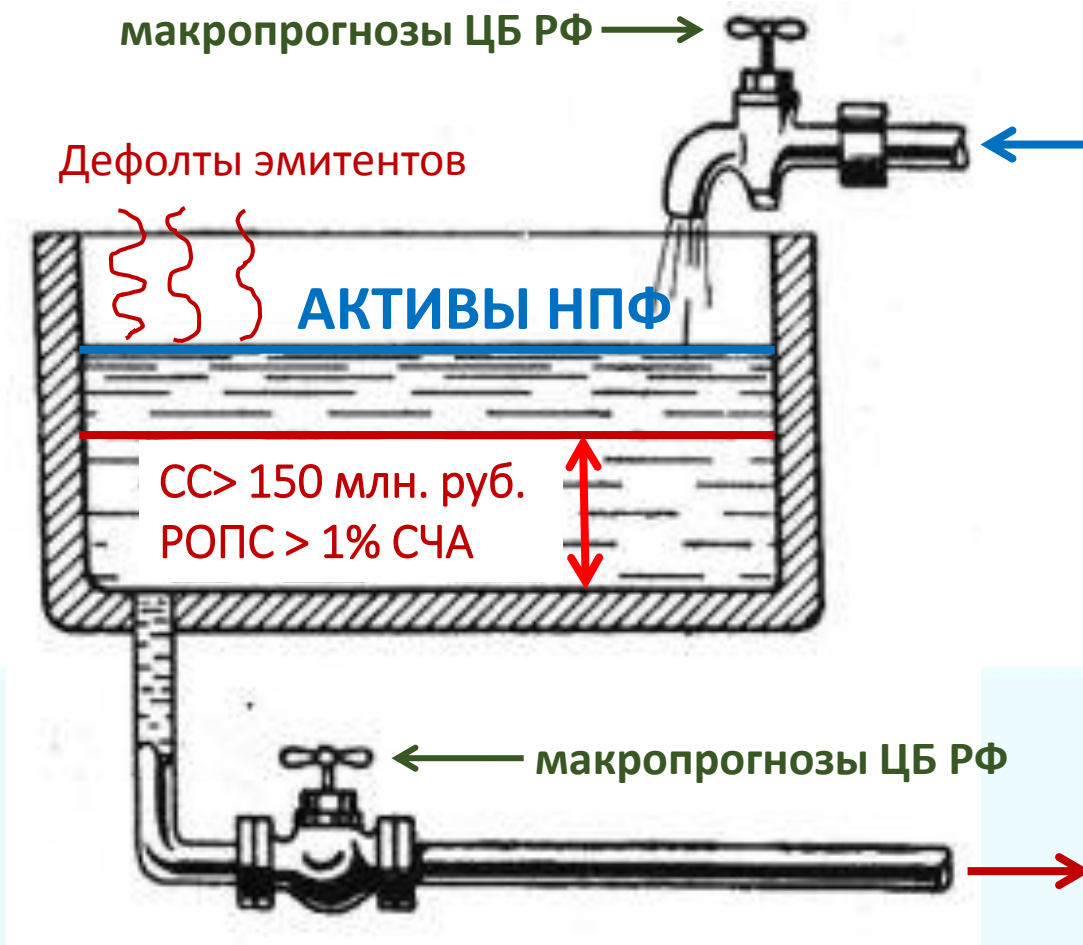
Пенсионные выплаты

Выплаты правопреемникам

Обеспечение перехода в другой НПФ

Сумма по последнему фиксингу

Расходы (комиссии, отчисления)



# Данные для стресс- тестирования Фондов

Позиции всех тестируемых портфелей

Денежные потоки по облигациям

Беты всех акций в портфелях

Среднедневной объем торгов по каждой бумаге за последние 30 торговых дней

Модель [Только для чтения] - Microsoft Excel

Файл Главная Вставка Разметка страницы Формулы Данные Рецензирование Вид

Вырезать Копировать Вставить Формат по образцу Буфер обмена

Calibri 11 A<sup>+</sup> A<sup>-</sup> Ж К Ч Шрифт

Перенос текста Объединить и поместить в центре Выравнивание

Общий Число

Условное форматирование Форматировать как таблицу Стили Ячейки

Вставить Удалить Формат

Σ Автосумма Заполнить Сортировка Найти и выделить Редактирование

B8 ПН

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
	Дата	Тип	НПФ	ИНН НПФ	Класс	Код	Наименование Актив	ИНН	Манжм. альн	Н	ИН	М	Количество	Рыночная стоимс	Цена	№	Валюта
4	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Акции	RU000A0ET7Y7	МОСК	5039065113	БВ				26400000	22915 200	0,87		
5	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Акции	RU000A0F5UN3	Энел ОПК-5	6671159423	БВ				35800000	35 69 2600	1		
6	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Депозиты	01/6/28.01/НПФ-ДП/ФТП	Банк Зенит	7729406872	БВ				1	8 666 695 73,1	8 666 695 73,1		
7	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Депозиты	29/01/15	МКБ	7734203860	БВ				1	304 637 536,9	304 637 536,9		
8	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Депозиты	41/2/14/16	МКБ	7734203860	БВ				1	177 607 716,2	177 607 716,2		
9	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации субординированные	RU000A0JNP74	Внешторгбанк	2740339 39	БВ				5741 27	3 936 914 47,2	633,34		
10	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM44	Внешф	274051552	БВ				160000	1 855 589 2,7	1034,88		
11	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ007	Внешэкономбанк	7708011796	БВ				320000	320 371 142	1000,85		
12	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ047	Внешэкономбанк	7708011796	БВ				174910	179 021 580	1023,51		
13	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JMN13	Внешэкономбанк	7708011796	БВ				160000	1 618 49 804	1011,69		
14	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JRP30	ГК Банк развития	7750004150	БВ				200001	205 801 792	1020		
15	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром Капитал	7729588547	БВ				37 6415	38 331 225,4	1018,34		
16	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром Капитал	7729588547	БВ				9 3077	9 622 403,54	1033,78		
17	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				400000	4048147 30,7	1012,04		
18	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				36	36 000 000	1000		
19	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				1790	179 000 000	1012,7		
20	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				100000	100 000 000	1027,34		
21	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				5	5 000 000	1000		
22	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				250000	250 000 000	1005,34		
23	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Газпром нефть	5504036333	БВ				207000	207 000 000	1019,3		
24	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	ЛЕНТА	7708011796	БВ				7	7 000 000	1019,3		
25	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	ЛЕНТА	7708011796	БВ				7	7 000 000	1019,3		
26	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	Мелфон	7708011796	БВ				7	7 000 000	1019,3		
27	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JTM71	МОСК	5039065113	БВ				155000	1 617 490 09,1	1043,54		
28	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	РКД	77085037 27	БВ				149910	155 489 506,1	1037,22		
29	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	РКД	77085037 27	БВ				39 29 66	409 59 2795,3	1042,31		
30	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	РКД	77085037 27	БВ				160000	170 858 289	1067,86		
31	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Росбанк	77300601 64	БВ				419000	432 083 31 23,3	1032,66		
32	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	НК "Роснефть"	7708011796	БВ				319900	325 851 351,7	1018,6		
33	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	НК "Роснефть"	7708011796	БВ				100000	101 85 2391,6	1018,52		
34	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	НК "Роснефть"	7708011796	БВ				409506	408 031 17 26,1	99 6,35		
35	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Россельхозбанк	7725114488	БВ				280000	28 644 0715,7	1068,72		
36	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Россельхозбанк	7725114488	БВ				528000	53 475 267,9	101 6,64		
37	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Россельхозбанк	7725114488	БВ				200000	206 77 3717,9	1048,87		
38	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Холдинг МРСК	7728 692 696	БВ				290000	295 531 981,1	1018,39		
39	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Роснефть	7707049 368	БВ				397000	411 419 236,1	1036,52		
40	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Роснефть	7707049 368	БВ				99500	100 510 041,2	1010,16		
41	31.01.2017	ПН	НПФ NAME	НПФ INN	Облигации корпоративные	RU000A0JQ0R9	Роснефть	7707049 368	БВ				395000	39 750 985,1	645,52		

Готово Параметры Данные OPS\_DYNAMICS БАЛАНС ПН Фиксинги Monte Carlo Кол-во и стоимость Риски Продажи Поток факт Result Seed

70%

## ПРЕДПИСАНИЕ БАНКА РОССИИ

В соответствии с подпунктом 8 пункта 3 статьи 34 Федерального закона от 07.05.1998 № 75-ФЗ «О негосударственных пенсионных фондах»,  
**Банк России ПРЕДПИСЫВАЕТ:**

Акционерному обществу

(далее – Фонд) в срок не позднее 5 (пяти) рабочих дней с даты получения настоящего предписания представить в адрес Банка России следующую информацию:

1. Лист «Данные» модели стресс-тестирования негосударственных пенсионных фондов, заполненный в соответствии с Методикой стресс-

## Экспорт данных в модель для стресс- тестирования Фондов

Данные для модели ЦБ

Дата: 01/01/17

Портфели:

УК ПН, УК ВР, УК СПВ, УК ПР, Менеджмент ПН, Менеджмент ПР, УК Серьезная ПН, УК Серьезн

Настройка

Биржа

Да

Выход

?

Инструменты...

## 8



# **Фишка 2**

## **ОСБУ на службе**

### **у инвестиционного анализа**

### **и риск-менеджмента**

**Данные стресс- тестирования по данным бухучета**

**Оценка эффективности управления по финрезу ОСБУ**

**Еще один полноценный срез аналитики**

# ПОРТФЕЛЬ ДУ

150 аналитических показателей

Оцениваемые по  
справедливой  
стоимости

Имеющиеся для  
продажи и через  
ОСД

Учитываемые по  
амортизированной  
стоимости

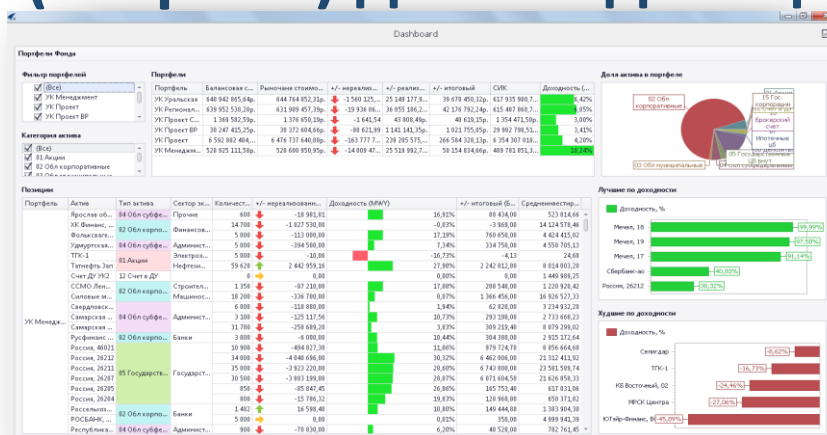
Удерживаемые  
до погашения

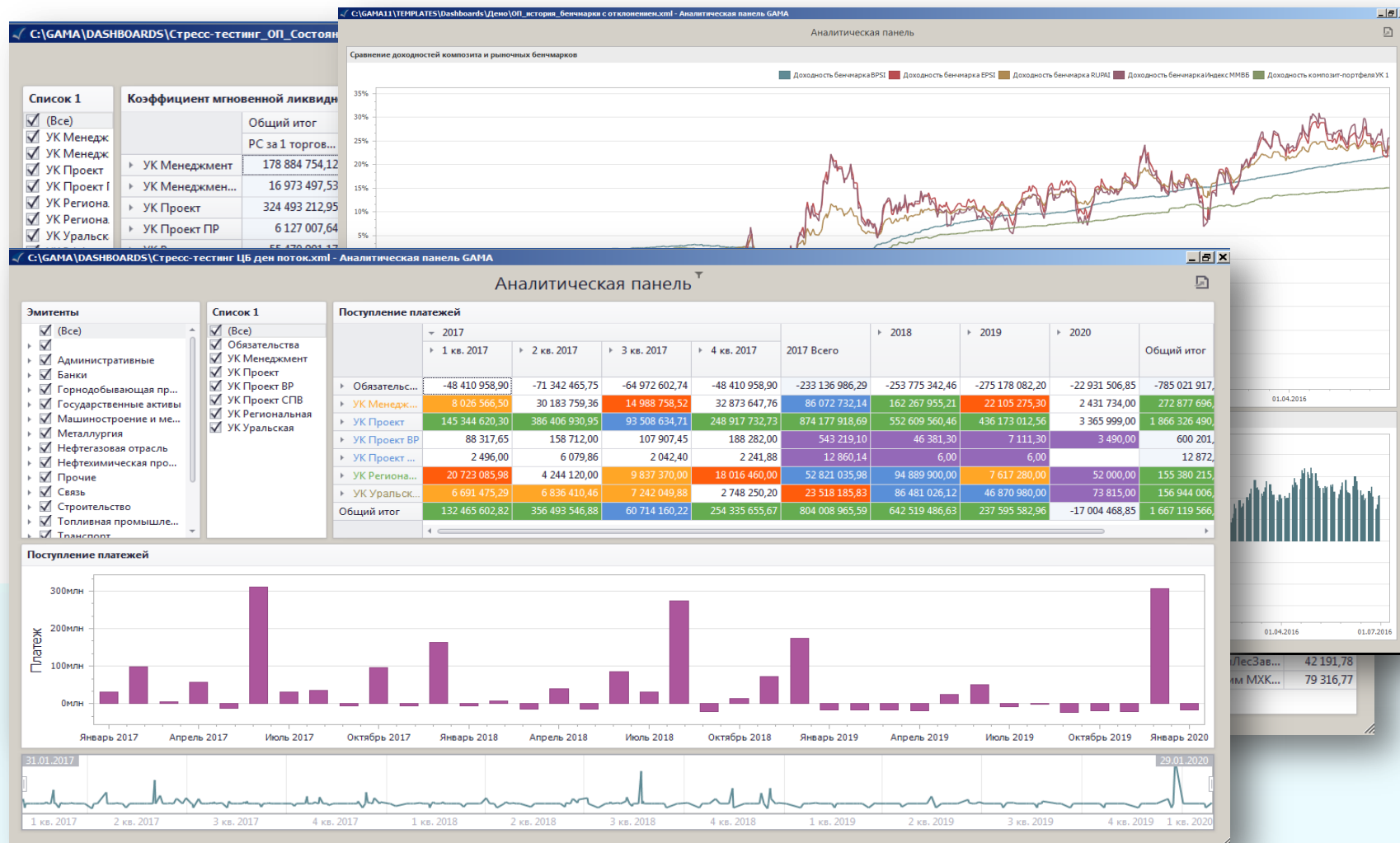
**АНАЛИТИКА по СУБПОРТФЕЛЯМ (СЕКЦИЯМ)**

## **Фишка 3**

# **Монитор контроля над несколькими компаниями**

# Монитор (витрина) для владельца бизнесов





## Стресс-тестинг по методике ЦБ РФ

ОСБУ на службе у риск-менеджмента и инвестиционного  
департамента

Монитор владельца бизнеса

# GAMES OVER