

# GAMA возможностей для управления портфелями

GAMA 2018

## Investfunds 2017



GAMA 2018

# Investfunds 2018



# Увеличение конкурентоспособности на рынке тех, кто использует GAMA

GAMA 2018

# Итоговое состояние портфеля

## Текущее состояние портфеля

- Справедливая стоимость
- Финансовый результат и его причины
- Оценка эффективности управления
- Контроль ограничений
- Ликвидность

## Прогнозное изменение портфеля

- Риски (рыночные, процентные, кредитные)
- «что если?»
- Альтернативные инструменты
- Стресс-тестинг

# ЗАМЕТКА 1 «ТЕКУЩАЯ»

GAMA 2018

## Критерии активности и цены

### Выбор

Да  
Выход  
?  
Инструменты...

- Кол-во сделок и Среднедневной Объем торгов >
- Кол-во сделок и Суммарный Объем торгов >
- Кол-во сделок и Ежедневн. Объем торгов>
- Кол-во сделок и Ежедневн. Объем торгов (ВСЕ РЕЖИМЫ)
- Кол-во сделок и Ежедневн. Объем торгов + VALUE>
- Суммарный Объем торгов пав >

### Выбор

Да  
Выход  
?  
Инструменты...

- Bid<>Ask
- Bid<>Ask + Объем торгов>
- Bid<>Ask с гранич.знач.>
- Min<>Max
- Кол-во котировок >
- Объем торгов >
- Анализ волатильности цен
- Анализ динамики индекса
- Отклонение цены от номинальной стоимости <
- Кол-во сделок >
- Кол-во сделок и PC выпуска> + Bid<>Ask
- Отклонения BID/OFFER и LOW/HIGH
- Расчет цены по G-кривой
- АС депозита
- Среднее между BID и OFFER с интервалом <
- Метод DCF - без спреда
- Метод DCF - спред по индексам
- Оценка депозитов
- Первичное размещение: Цена покупки в дату начала размещения
- Первичное размещение: Цена покупки до вторичного обращения
- Проверка рыночности депозитов
- Bid<>Ask (Mid price)

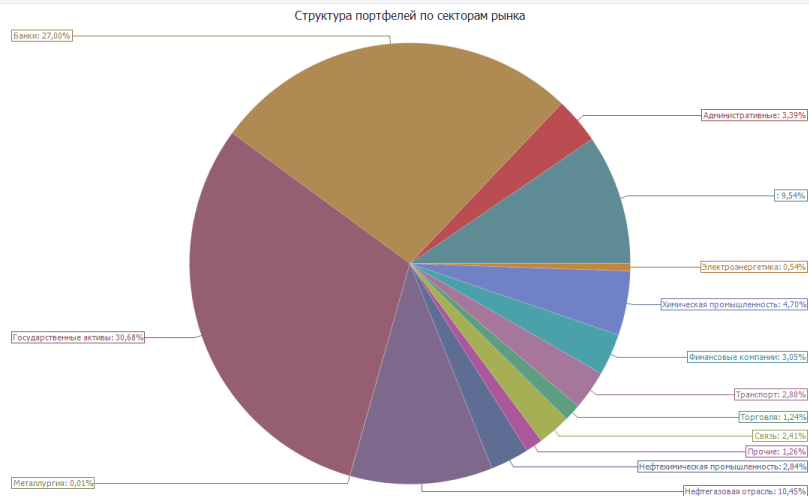
### Редактирование примечания

10/500000  
\*\*\*\*\*  
ВВОД ПАРАМЕТРОВ ДО ЗВЕЗДОЧЕК!  
  
Формат параметров:  
N/N/{T}/{N} N-число, T-текст, {}-необязат.  
  
Для всех рынков:  
Кол-во сделок> 10 и Суммарный Объем торгов> 500000

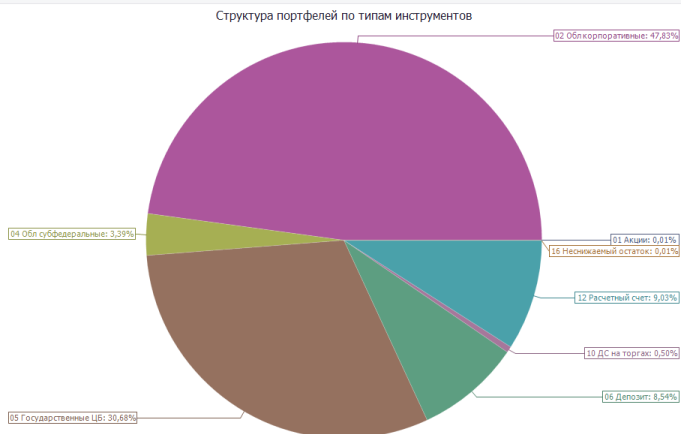
Да Отменить ☐ Перенос

## Аналитическая панель

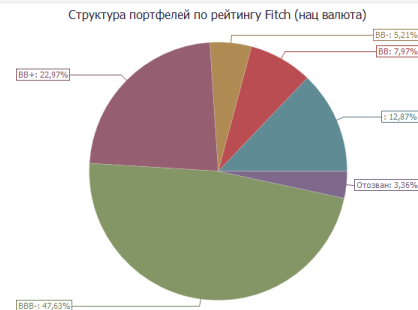
Структура портфелей по секторам рынка



Структура портфелей по типам инструментов



Структура портфелей по рейтингу Fitch (нац валюта)



Концентрация (доля эмитента/инструмента в портфеле)

Эмитент	Доля (%) в рыночной стоимости	Доля (%) в балансовой стоимости
Минфин РФ	92,42%	92,72%
Кредит Европа Банк	85,05%	84,01%
Россельхозбанк	53,77%	53,13%
ОАО НК "Роснефть"	48,73%	48,37%
ПАО "Акрон"	46,82%	46,07%
Альфа-Банк	39,26%	39,48%
Внешэкономбанк	37,86%	37,53%
Роснефть	30,11%	29,86%
Газпром нефть	28,45%	28,44%
Газпромбанк	24,49%	24,37%
Ростелеком	24,03%	23,76%
ФПК	20,66%	20,52%
ГТЛК	17,99%	17,91%
Волгоградская область	17,15%	17,25%
ВТБ	12,78%	12,86%
Буровая компания Евразия	12,62%	12,35%
Концерн Калашников	12,51%	12,66%
Транснефть	12,47%	12,43%
АНКК	12,40%	12,38%
ИКС 5 ФИНАНС	12,39%	12,37%
ДельтаКредит	10,52%	10,31%
Якутия (Саха)	8,20%	8,01%
РЖД	7,14%	7,20%
Администрация Волгоградской об	5,75%	5,76%
РусГидро	5,41%	5,46%
ТКС Банк	5,02%	5,10%
Ростелекомбанк	4,89%	4,96%
УМАО Югры	2,64%	2,70%
ОАО "Вертолеты России"	0,87%	0,88%
Форшлат	0,12%	0,00%
Омега Банк	0,12%	0,12%
Ачинский металлургический завод	0,08%	0,16%
Сбербанк России ПАО	0,01%	0,00%
Рыба Банк	0,00%	0,00%
Трансконтейнер	0,00%	0,00%
МегаФон	0,00%	0,00%
Башнефть	0,00%	-0,02%
КолоритБанк	-2,47%	-2,50%



Монитор руководителя Фонда

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конечную дату (БВ) (Сумма) к Стоимость общая балансовая на конечную дату (БВ) (Сумма)

Фонд

83 898 67...  
+1,2млн

▲ +1,45%

УК Эффект ПН СР...

94 187 69...  
+909тыс.

▲ +0,97%

УК МенеджментП...

4 504 341...  
+57,3тыс.

▲ +1,29%

УК Менеджмент ПР

226 304 2...  
+2,63млн

▲ +1,17%

УК Менеджмент...

20 788 71...  
+230тыс.

▲ +1,12%

УК Менеджмент...

5 480 86...  
+75,4млн

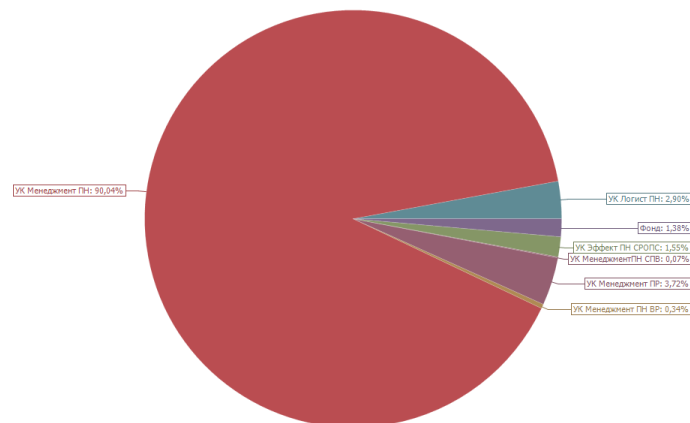
▲ +1,40%

УК Логист ПН

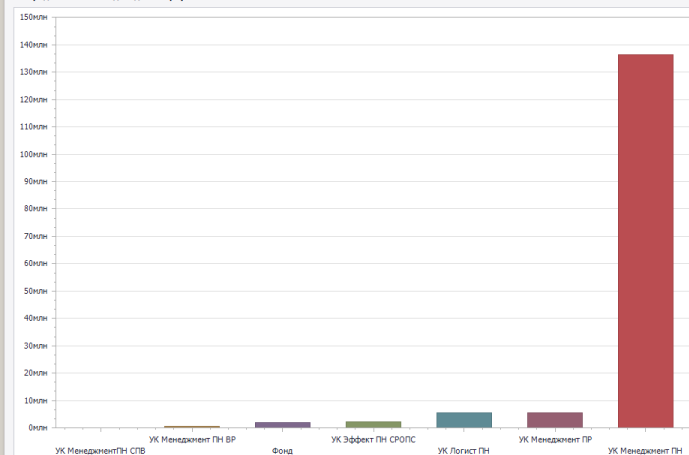
176 426 6...  
+3,93млн

▲ +2,28%

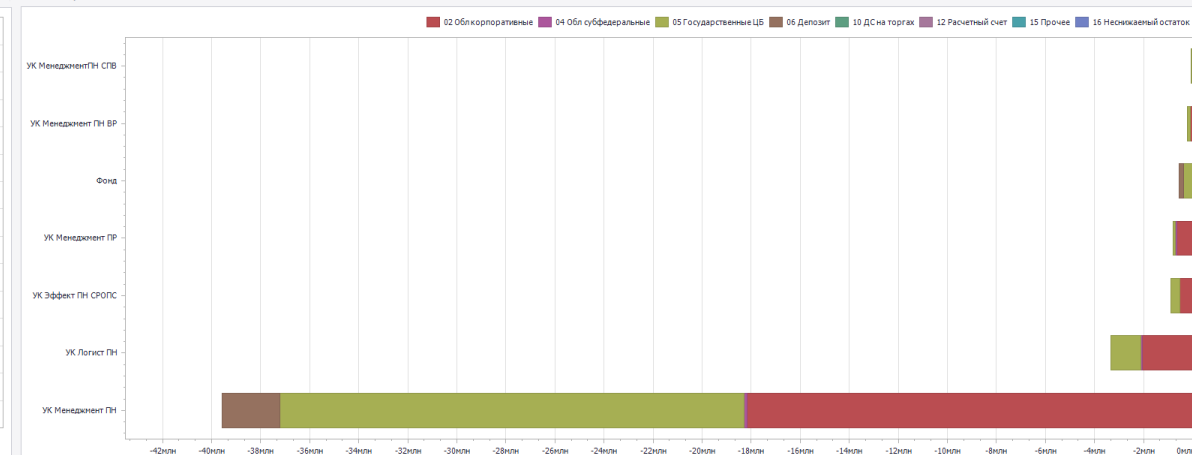
Доля портфелей в Фонде



Распределение инвестиционного дохода по портфелям

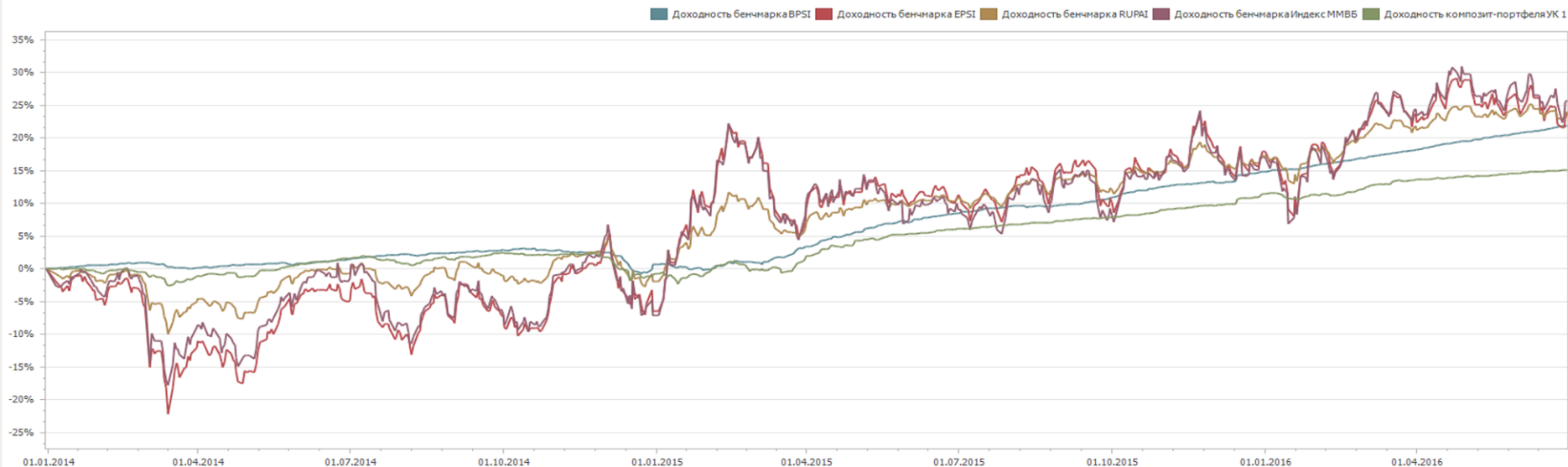


Риск (по дюрации)

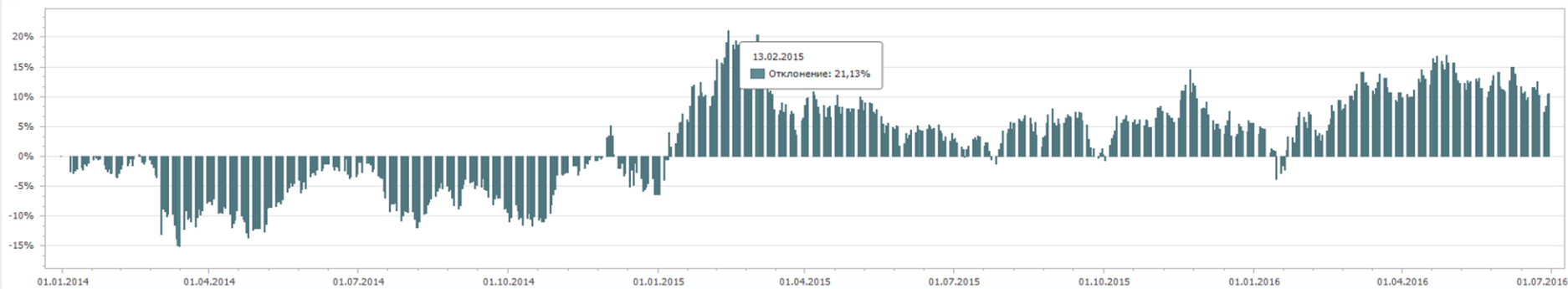


## Аналитическая панель

### Сравнение доходностей композита и рыночных бенчмарков



### Отклонение доходности композита от доходности индекса ММВБ



## Аналитическая панель

### Список 1

- ☒ (Все)
- ☒ УК Менедж
- ☒ УК Менедж
- ☒ УК Проект
- ☒ УК Проект I
- ☒ УК Региона
- ☒ УК Региона
- ☒ УК Уральск
- ☒ УК Эффект

### Коэффициент мгновенной ликвидности портфелей

	Общий итог		
	РС за 1 торгов...	Срок закрытия п...	Стои...
УК Менеджмент	178 884 754,12	650	641 9
УК Менеджмен...	16 973 497,53	38	106 8
УК Проект	324 493 212,95	24,9тыс.	7 326 5
УК Проект ПР	6 127 007,64	2,06тыс.	929 3
УК Региональная	55 470 901,17	727	760 0
УК Региональна...	5 498 252,29	2,42тыс.	997 7
УК Уральская	90 207 543,78	2,12тыс.	734 9
УК Эффект Всего	408 235 047,08	28,7тыс.	6 602 2
01 Акции	33 156 183,00	21,8тыс.	241 0
02 Обл кор...	183 181 072,00	6,66тыс.	4 846 2
03 Обл...	9 192 187 50	2	29 9

### Коэффициент мгновенной ликвидности портфелей



УК  
Менеджмен



УК  
Менеджмен  
ПР



УК Проект

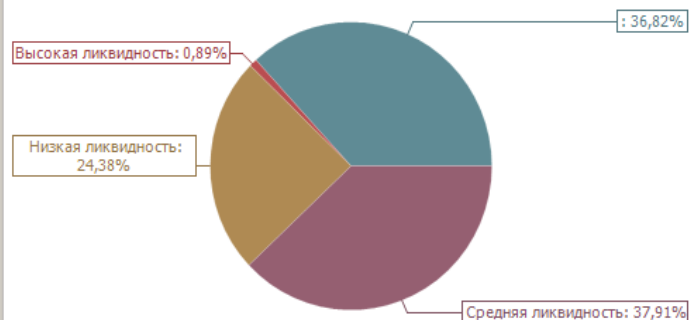


УК Проект  
ПР

### 5 худших по ликвидности активов

Название ...	Название ...	Сумма РС за...
УК Менед...	Россия, 2...	32 754 120,00
УК Менед...	Россия, 2...	30 352 820,00
УК Менед...	Россия, 2...	30 033 350,00
УК Менед...	МосковК...	9 685 450,00
УК Менед...	Сбербанк...	0,00
УК Менед...	Сбербанк...	1 558 883,00
УК Проект	Россия, 2...	50 707 031,70
УК Проект	Россия, 2...	31 406 095,00
УК Проект	Россия, 2...	28 639 134,00
УК Проект	Сбербанк...	10 668 878,70
УК Проект	МосковК...	9 685 450,00
УК Регион...	Сбербанк...	10 668 878,70
УК Регион...	Россия, 2...	0,00
УК Уральск...	Сбербанк...	10 123 998,10

### Структура ликвидности Фонда



### Структура ликвидности портфелей



### 5 лучших по ликвидности активов

Название п...	Название акт...	Сумма РС...
УК Менедж...	ВымпелКом-...	0,00
УК Проект	Селигдар	7 739,24
УК Проект	ЕвроХим МХК...	79 316,77
УК Проект ...	Мечел-15-о6	14 936,87
УК Проект ...	Селигдар	0,00
УК Региона...	ЕвроХим МХК...	60 621,79
УК Региона...	Мечел-15-о6	14 936,87
УК Региона...	Селигдар	7 729,47
УК Уральск...	ВымпелКом-...	360,87
УК Эффект	Селигдар	7 739,24
УК Эффект	ВымпелКом-...	360,87
УК Эффект	СоломЛесЗав...	42 191,78
УК Эффект	ЕвроХим МХК...	79 316,77

# ЗАМЕТКА 2 «ДИНАМИЧНАЯ»

GAMA 2018

Первый алгоритм

Категория балансового учета

02 Обл корпоративные 03 Обл муницип

Сектор экономики

Автомобильная промышленность Ба

Котировальный список

Уровень 1 Уровень 2 Уровень 3

Агрегированный рейтинг

Эшелон ликвидности

Обязательные поля

Цена

Средневзвешенная

Диапазон дюрации (дней)

180

Биржа

MMB5

Диапазон дюрации (лет)

0,4932

Второй алгоритм

☐ Второй алгоритм

☐ По КБУ

☐ По сектору экономики

☐ По котировальному списку

☐ По агрег.рейтингу

☐ По эшелону ликвидности

Сравнить с индексом

☐ Сравнить с индексом

Настройка индексов

Справедливая цена

☐ Справедливая цена

Правило 1

Правило

Дополнительно

Средняя цена за период (дней)

60

OK

Выход

Инструменты...

?

13

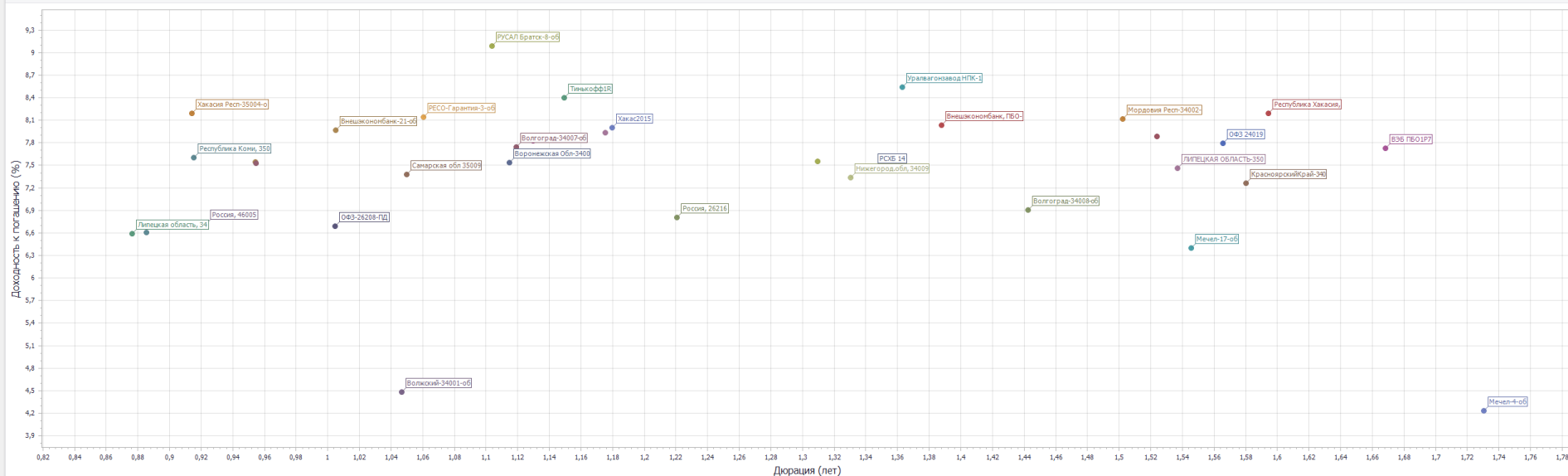
© Copyright InfoStroy Ltd., 2017

# ПОИСК ОБЪЕКТА ИНВЕСТИЦИЙ

www.infostroy.com

Альтернативные активы

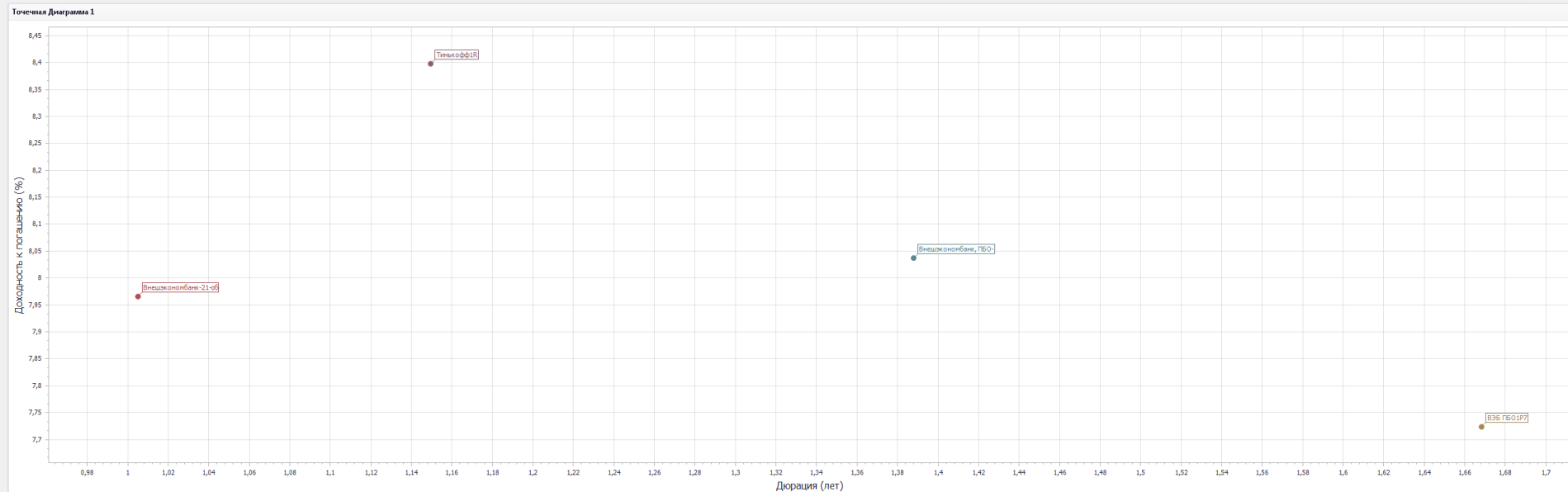
Точечная Диаграмма 1



Название ЦБ	Тип актива	Сектор экономики	Агрегированный ...	Цена закр...	Цена средняя за 60...	Рейтинг э...	Рейтинг эмитента Moo...	Рейтинг эмитента Fit...	Рейтинг выпуска Fit...	Рейтинг выпуска Mood...	Рейтинг выпуска SP...
БашкортостанРесп-340	04 Обл субфедеральные	Административные	1	104.39	104	BBB-	Ba1	BBB-			
Внешэкономбанк, ГЕО-	02 Обл корпоративные	Банки	1	103.06	102	BBB-	Ba1	BBB-			
Внешэкономбанк-21-об	02 Обл корпоративные	Банки	1	102.40	102	BBB-	Ba1	BBB-			
Волгоград-34007-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	105.35	105	Отозван	B2	BB-			
Волгоград-34009-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	110.29	110	Отозван	B2	BB-			
Волжский-34001-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	111.30	111						
Воронежская Обл-3400	03 Обл муниципальные	Административные	4	104.90	105	B1		BB-			
В36 ПБО17	02 Обл корпоративные	Банки	1	102.45	102	BBB-	Ba1	BBB-			
БирзХолдинг Финанс	02 Обл корпоративные	Финансовые компа...	4	107.05	107	BB-					
Красноярский край-340	02 Обл корпоративные	Административные	4	107.40	107						
Липецкая область, 34	04 Обл субфедеральные	Административные	3	103.59	104	Отозван		BB	BB		
ЛИПЕЦКАЯ ОБЛАСТЬ-350	04 Обл субфедеральные	Административные	2	100.35	100	Отозван		BB+	BB		
Мечел-17-об	02 Обл корпоративные	Металлургия	7	93.51	93.5	B-	B3	Отозван			
Мечел-4-об	02 Обл корпоративные	Металлургия	7	95.00	95	B-	B3	Отозван			
Мардовия Респ.-34002	04 Обл субфедеральные	Административные	3	108.80	109			B+			
Нижегород.обл. 34009	04 Обл субфедеральные	Административные	3	100.88	101	BB	B1	BB			
Нижегородская область	04 Обл субфедеральные	Административные	3	108.82	109	BB	B1	BB			
ОФЗ 24019	05 Государственные ЦБ	Государственные а...	1	102.27	102	BBB-	Ba1	BBB-	BBB-		
ОФЗ-26208-ГД	05 Государственные ЦБ	Государственные а...	1	100.90	101	BBB-	Ba1	BBB-	Ba1	BBB-	
РЕСО-Гарантия-3-об	02 Обл корпоративные	Финансовые компа...	1	104.00	104	BB	Ba1	BBB-			
Республика Коми, 350	04 Обл субфедеральные	Административные	1	103.31	103	BBB-	B1	BB			
Республика Хакасия	04 Обл субфедеральные	Административные	1	100.72	101	BBB-	Ba1	BB-			
Роснефть, БО-01	02 Обл корпоративные	Нефтегазовая от...	1	101.40	101	BB+	Ba3	BBB-			

Контрольный уровень	Тип актива	Агрегированный ре...	Сектор экономики
<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)
<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 1	<input checked="" type="checkbox"/> 02 Обл корпоративные	<input checked="" type="checkbox"/> 1	<input checked="" type="checkbox"/> Административные
<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 2	<input checked="" type="checkbox"/> 03 Обл муниципальные	<input checked="" type="checkbox"/> 2	<input checked="" type="checkbox"/> Банки
<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 3	<input checked="" type="checkbox"/> 04 Обл субфедеральные	<input checked="" type="checkbox"/> 3	<input checked="" type="checkbox"/> Государственные активы
	<input checked="" type="checkbox"/> 05 Государственные ЦБ	<input checked="" type="checkbox"/> 4	<input checked="" type="checkbox"/> Машиностроение и металлообработка
		<input checked="" type="checkbox"/> 7	<input checked="" type="checkbox"/> Металлургия
			<input checked="" type="checkbox"/> Нефтегазовая отрасль
			<input checked="" type="checkbox"/> Финансовые компании

## Альтернативные активы



**Таблица 1**

Название цб	Тип актива	Сектор экономики	Агрегированный р...	Цена закр...	Цена средняя за 60 ...	Рейтинг з...	Рейтинг эмитента Moo...	Рейтинг эмитента Fitch...	Рейтинг выпуска Fitch...	Рейтинг выпуска Mood...	Рейтинг выпуска S...
Внешнеэкономбанк_ПЕО-	02 Обл корпоративные	Банки	1	103,06	103	BBB-	Ba1	BBB-			
Внешнеэкономбанк-21-06	02 Обл корпоративные	Банки	1	102,40	102	BBB-	Ba1	BBB-			
B36 ПЕО1P7	02 Обл корпоративные	Банки	1	102,45	102	BBB-	Ba1	BBB-			
Тинькофф1R	02 Обл корпоративные	Банки	1	101,54	102	BBB-	B1	BB-	B1		

Контрольный уровень	Тип актива	Агрегированный ре...	Сектор экономики
<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)
<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 1	<input checked="" type="checkbox"/> 02 Обл корпоративные	<input checked="" type="checkbox"/> 1	<input checked="" type="checkbox"/> Административные
<input type="checkbox"/> Уровень 2	<input type="checkbox"/> 03 Обл муниципальные	<input type="checkbox"/> 2	<input checked="" type="checkbox"/> Банки
<input type="checkbox"/> Уровень 3	<input type="checkbox"/> 04 Обл субфедеральные	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> Государственные активы
	<input type="checkbox"/> 05 Государственные ЦБ	<input type="checkbox"/> 4	<input type="checkbox"/> Машиностроение и металлообработка
		<input type="checkbox"/> 7	<input type="checkbox"/> Металлургия
			<input type="checkbox"/> Нефтегазовая отрасль
			<input checked="" type="checkbox"/> Финансовые компании

## VAR облигации



Код А/Ц:  
4-21-00739-A RUR

Название: АИЖК-21-06  
Погашение: 15/02/20

Дата: 06/02/18 365(365)

Биржа: ММВБ

Цена: Закрытие

Уровень: 95,00

Наблюдения: 200 1 17

VAR(%): -1,4197

VAR (IB): (4,42)

Изм.УТМ (%): 1,100

Цена (%): 101,80000

НКД (%): 2,00110

1 ЦБ (ИБ): 311,40

Номинал (ИБ): 300,00

УТМ: 7,746

Дюрация: 1,410

Мод.Дюр.: 1,309

Выпуклость: 3,205

Цены

Код А/Ц:  
4B02-04-00004-T-00 RUR

Название: ВЭБ, ПБО-001P-04  
Погашение: 23/07/19

Дата: 06/02/18 365(365)

Биржа: ММВБ

Цена: Закрытие

Уровень: 95,00

Наблюдения: 200 1 63

VAR(%): -0,1840

VAR (IB): (1,91)

Изм.УТМ (%): 0,143

Цена (%): 103,35000

НКД (%): 0,38932

1 ЦБ (ИБ): 1.037,39

Номинал (ИБ): 1.000,00

УТМ: 7,820

Дюрация: 1,388

Мод.Дюр.: 1,287

Выпуклость: 2,897

Цены

Код ЦБ (А/Ц):  
4B020102673B001P RUR

Название: Тинькофф1R  
Погашение: 22/04/22

Дата: 06/02/18 365(365)

Биржа: ММВБ

Цена: Закрытие

Уровень: 95,00

Наблюдения: 200 1 182

VAR (%): -0,3377

VAR (IB): (3,52)

Изм. УТМ (%): 0,320

Цена (%): 101,54000

НКД (%): 2,69671

1 ЦБ (ИБ): 1.042,37

Номинал (ИБ): 1.000,00

УТМ: 8,444

Дюрация: 1,149

Мод.Дюр.: 1,060

Выпуклость: 2,145

Цены

Код ЦБ (А/Ц):  
4-06-00004-T RUR

Название: ВЭБ 06  
Погащ.: 13/10/20

Дата: 06/02/18 365(365)

Биржа: ММВБ

Цена: Закрытие

Уровень: 95,00

Наблюдения: 200 1 78

VAR (%): -0,2389

VAR (IB): (2,50)

Изм.УТМ (%): 0,107

Цена (%): 101,93000

НКД (%): 2,57140

1 ЦБ (ИБ): 1.045,01

Номинал (ИБ): 1.000,00

УТМ: 7,708

Дюрация: 2,404

Мод.Дюр.: 2,232

Выпуклость: 7,435

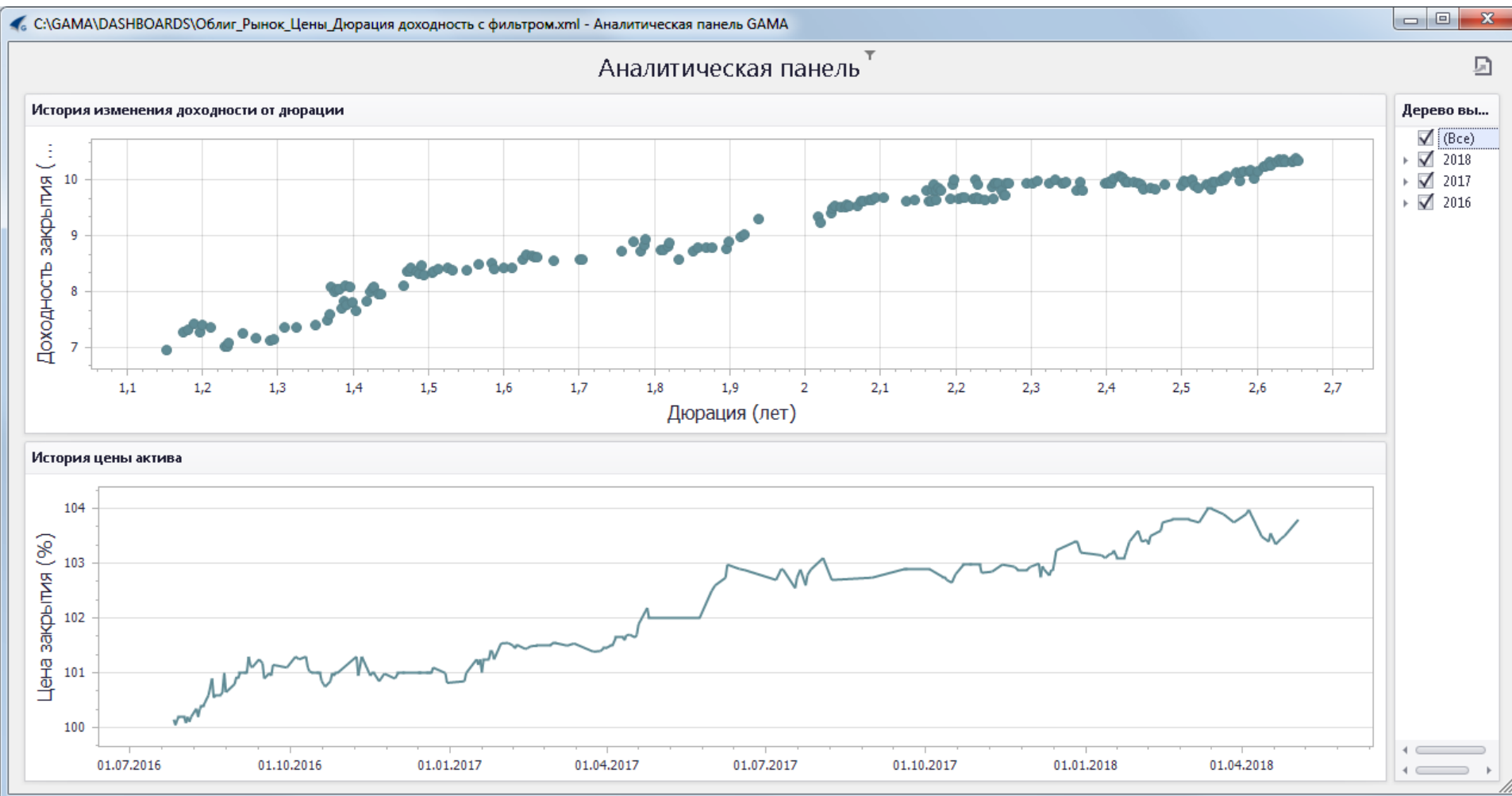
Цены

Выход

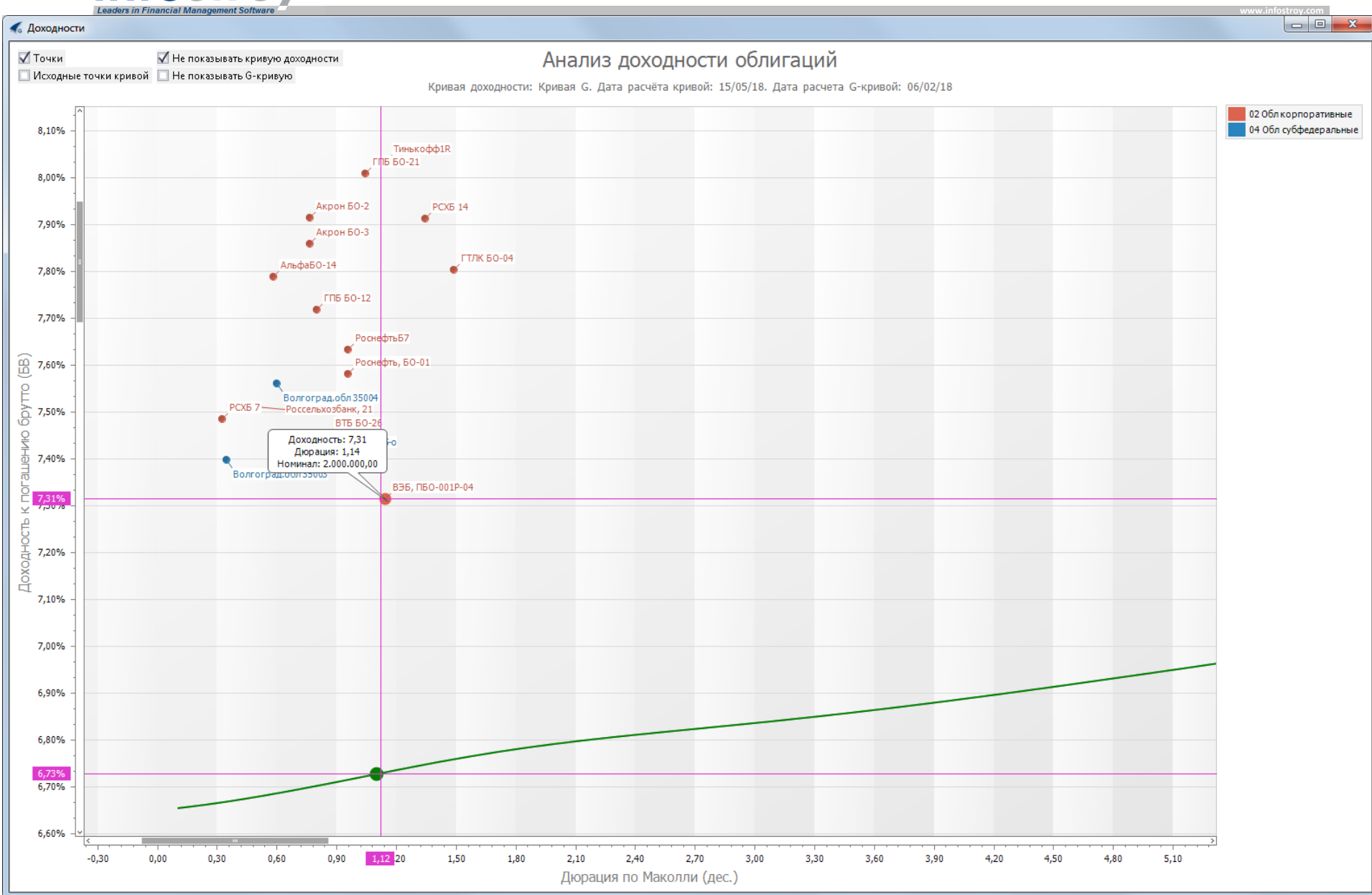
Инструменты...

?





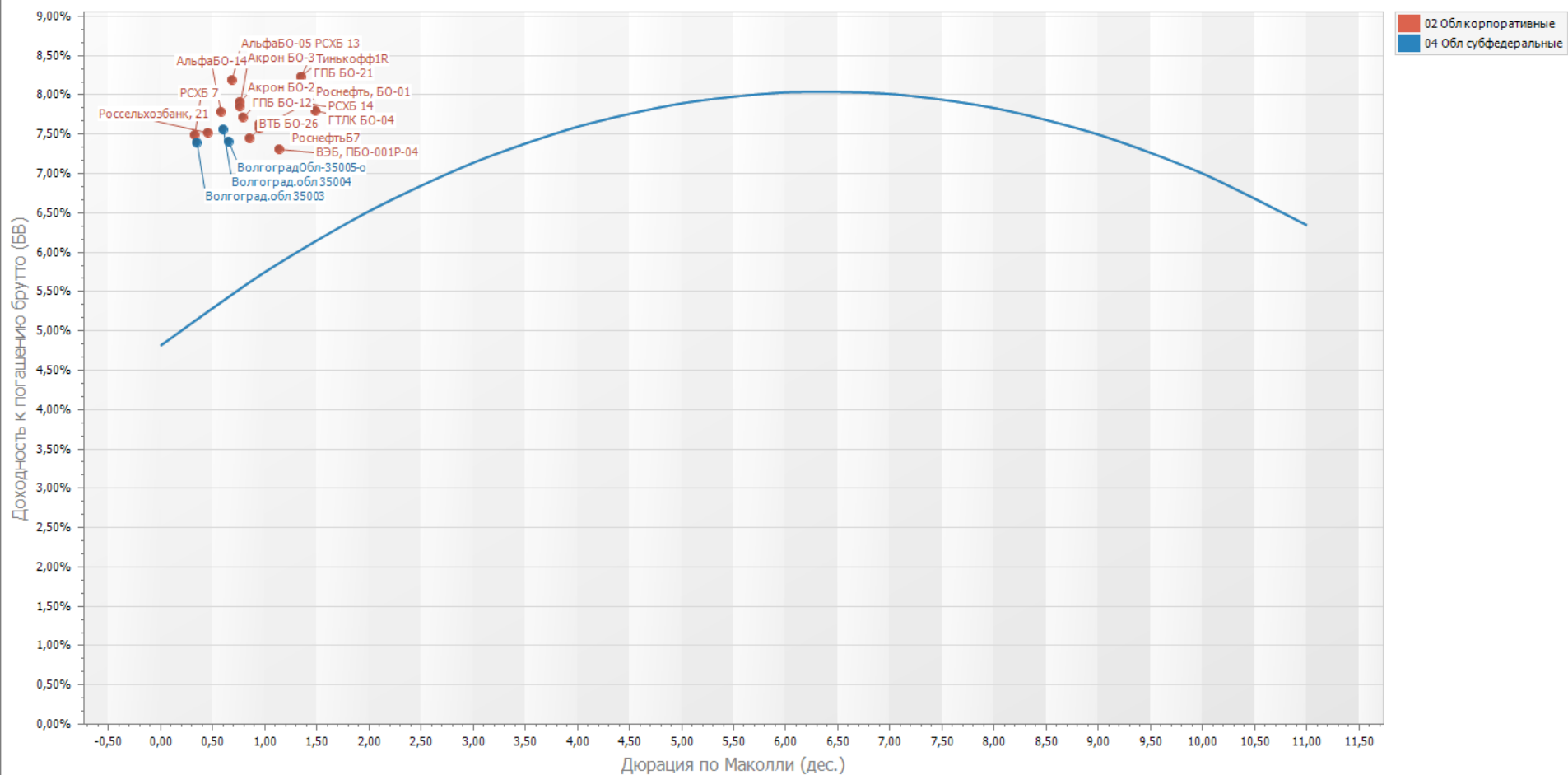
# ПОЛОЖЕНИЕ В РЕАЛЬНОМ ПОРТФЕЛЕ



- ☒ Точки ☐ Не показывать кривую доходности  
☐ Исходные точки кривой ☒ Не показывать G-кривую

## Анализ доходности облигаций

Кривая доходности: Кривая ОФЗ. Дата расчёта кривой: 27/03/18. Дата расчета G-кривой: 06/02/18



## Чувствительность портфеля

Общий результат

Композиция ЦБ

Анализ чувствительности

**Чувствительность**

Сценарий

Анализ горизонта

Кр ◀ ▶

Рыночная стоимость (ИБ) в тысячах: 113.050

Шаг (%):

5,00



Больше

Теор. стоимость (ИБ) в тысячах: 117.254

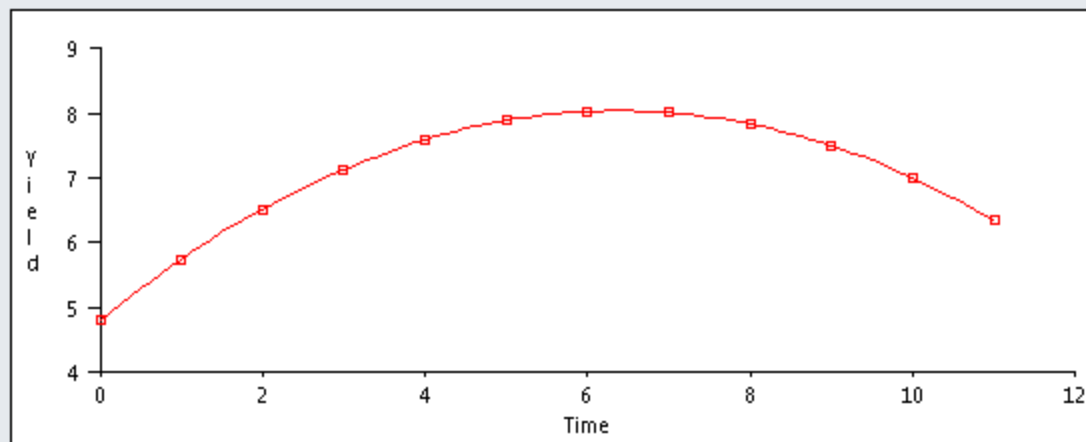
Шаг (БП):

10



Меньше

+/- (ИБ) в тысячах: 4.204



Да

Инструменты...

?

## Чувствительность портфеля

Общий результат

Композиция ЦБ

Анализ чувствительности

**Чувствительность**

Сценарий

Анализ горизонта

Кр ◀ ▶

Рыночная стоимость (ИБ) в тысячах: 113.050

Шаг (%): 5,00 ☒

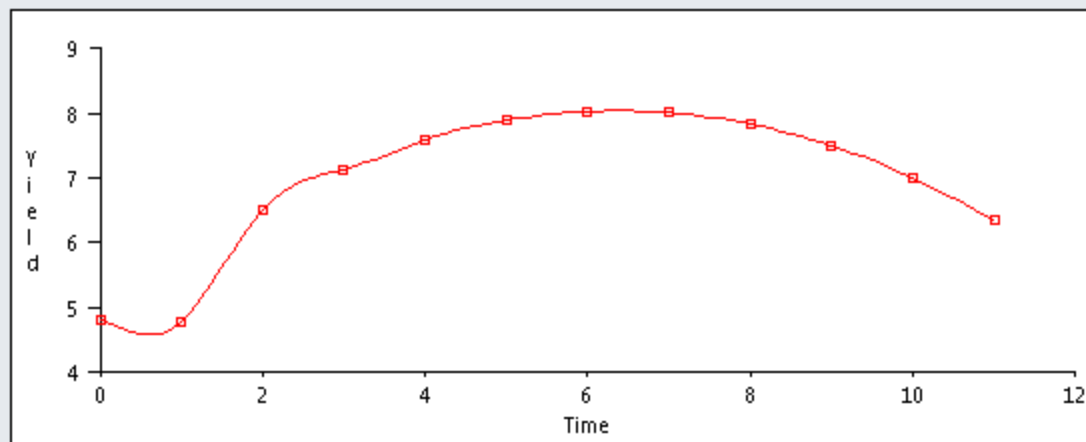
Больше

Теор. стоимость (ИБ) в тысячах: 118.026

Шаг (БП): 10 ☐

Меньше

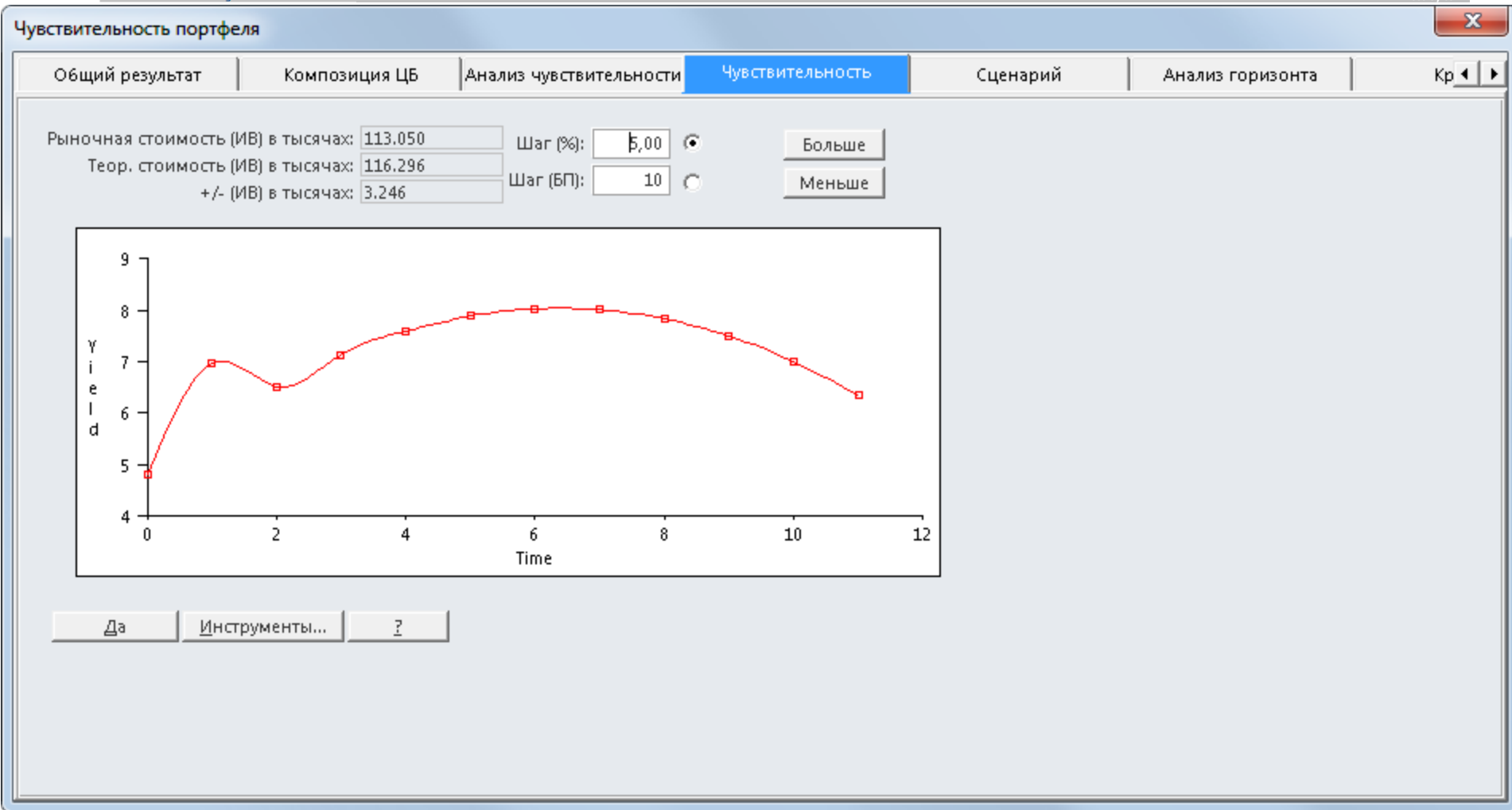
+/- (ИБ) в тысячах: 4.975



Да

Инструменты...

?

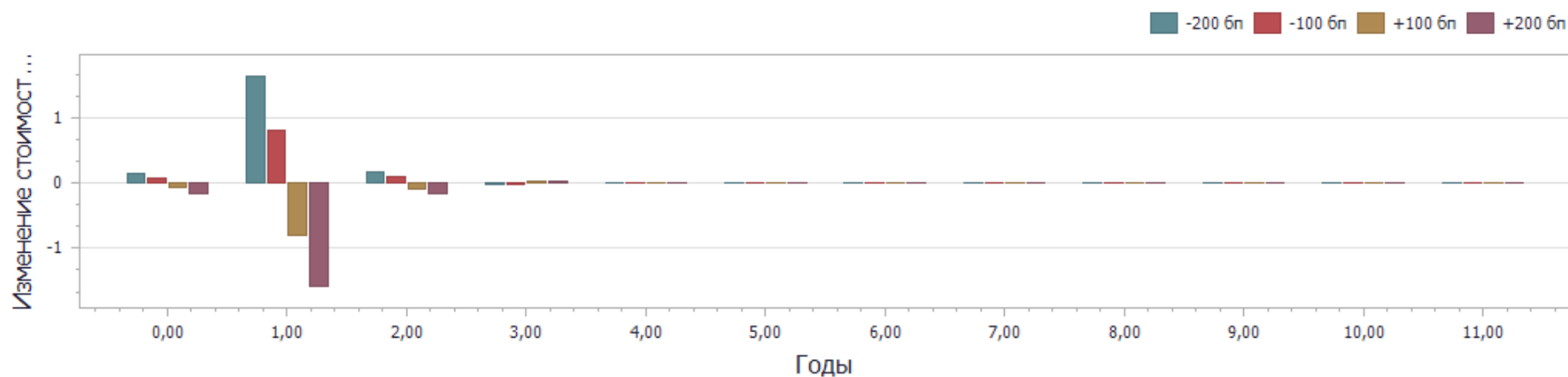


## Аналитическая панель

### Изменение стоимости портфеля при сдвиге кривой доходности

Годы	-2 шага	-1 шаг	+1 шаг	+2 шага
0	0,15	0,08	-0,08	-0,15
1	1,64	0,82	-0,80	-1,59
2	0,18	0,09	-0,09	-0,17
3	-0,03	-0,02	0,02	0,03
4	0,01	0,00	0,00	-0,01
5	0,00	0,00	0,00	0,00
6	0,00	0,00	0,00	0,00
7	0,00	0,00	0,00	0,00
8	0,00	0,00	0,00	0,00

### Чувствительность портфеля



# ЗАМЕТКА 3 «СТРЕССОВАЯ»

GAMA 2018

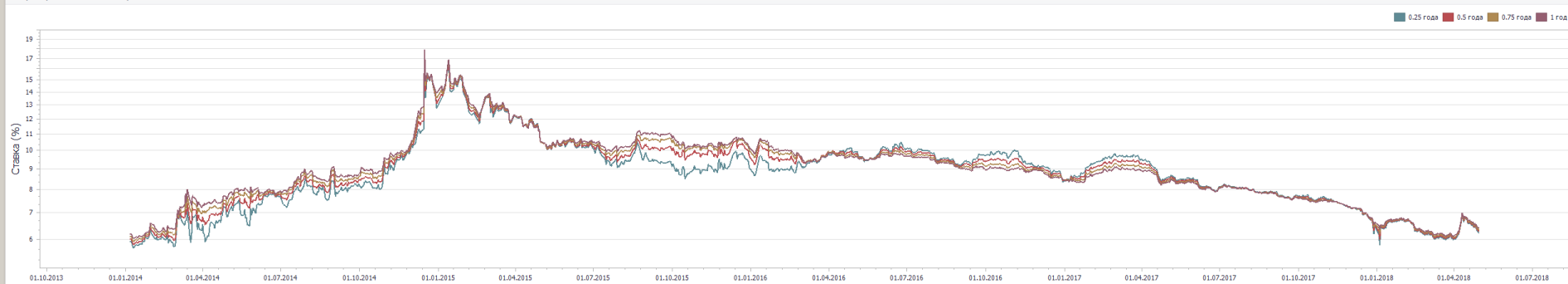


# История изменения процентных ставок G-кривой

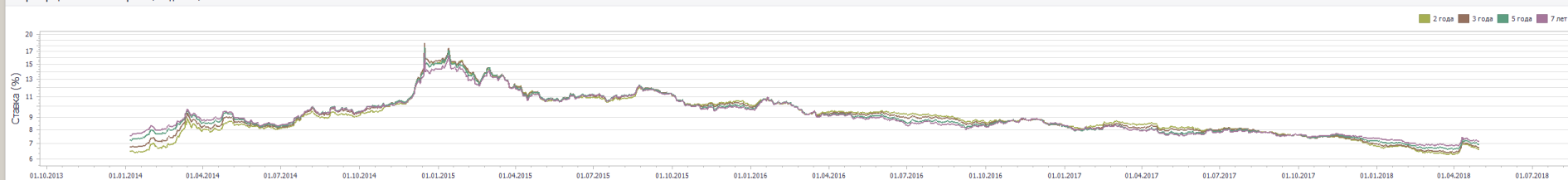
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



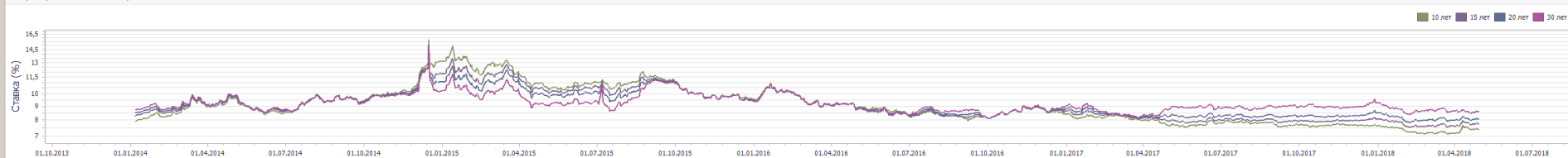
История процентных ставок G-кривой (от 0.25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Фильтр дат



C:\GAMA\DASHBOARDS\Demo\Стресс-тестинг ЦБ стресс портфели.xml - Аналитическая панель GAMA

## Аналитическая панель

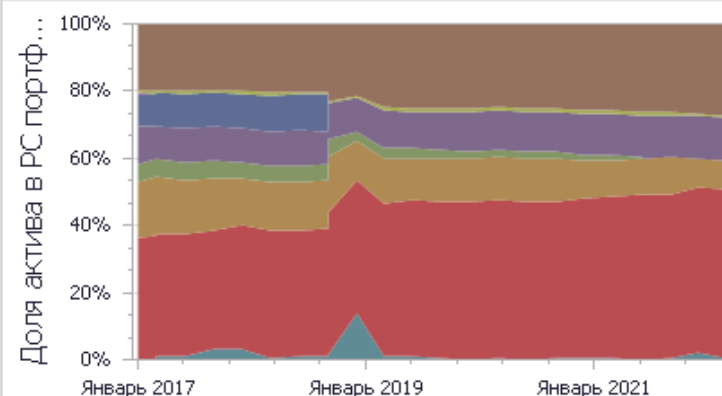
### Прогнозная стоимость портфелей

▼ 2018

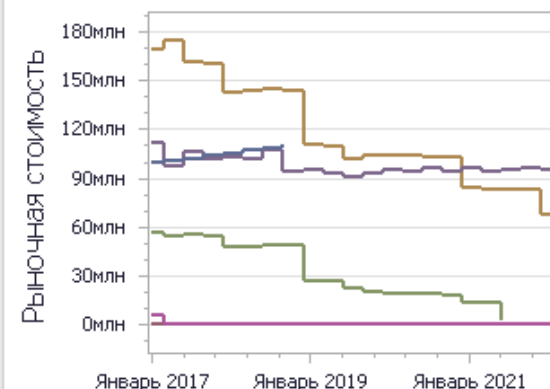
► 1 кв. 2018

	Рын стоимость	Доля в РС	Отклонение РС	
► УК Менедж...	433 807 803,05	43,75%	↓ -4,96%	
► УК Региона...	193 743 451,48	19,54%	↑ 0,70%	
► УК Эссет Ме...	317 444 296,45	32,02%	↑ 0,65%	
► УК Эффект	46 463 195,89	4,69%	↑ 1,81%	
Общий итог	991 458 746,87	100,00%	↓ -1,82%	1

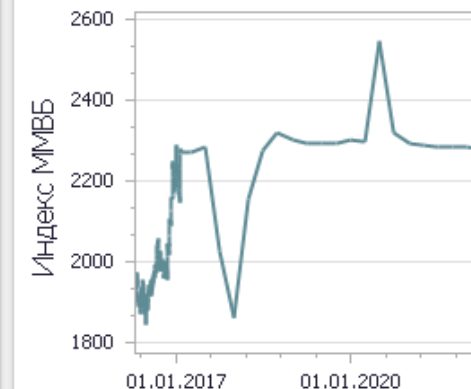
### Прогноз изменения структуры портфелей



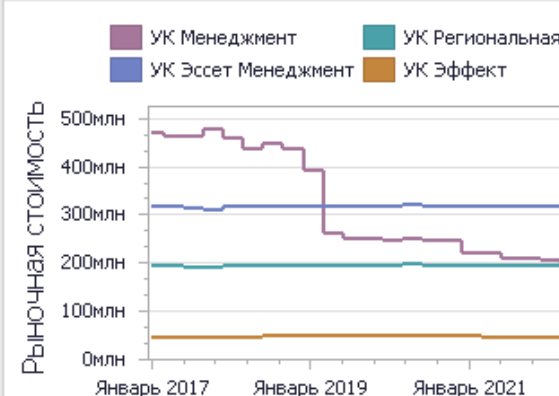
### График изменения стоимости облигаций с учетом ...



### Индекс ММВБ (история+прогноз)



### Изменение прогнозной стоимости портфелей



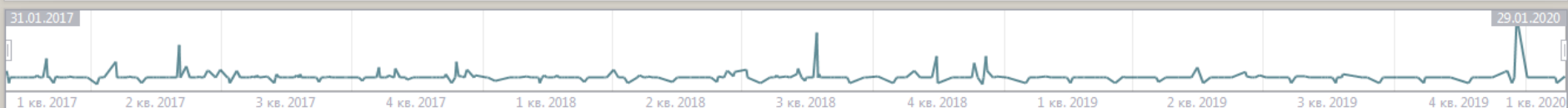
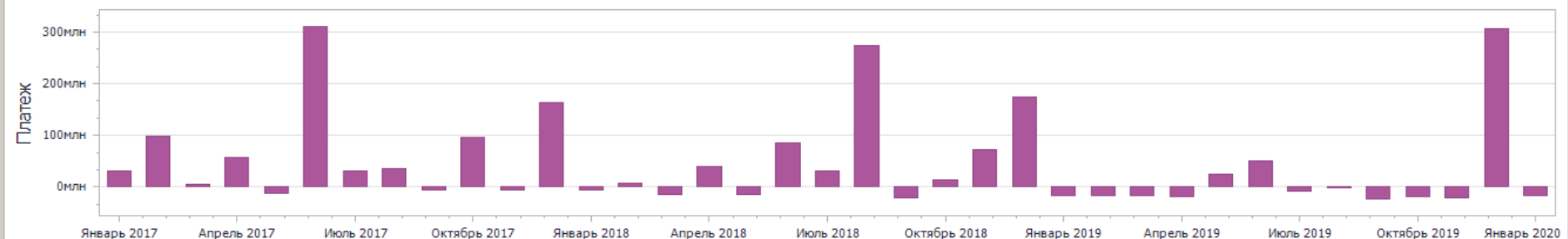
### График стоимости акций с учетом прогноз...



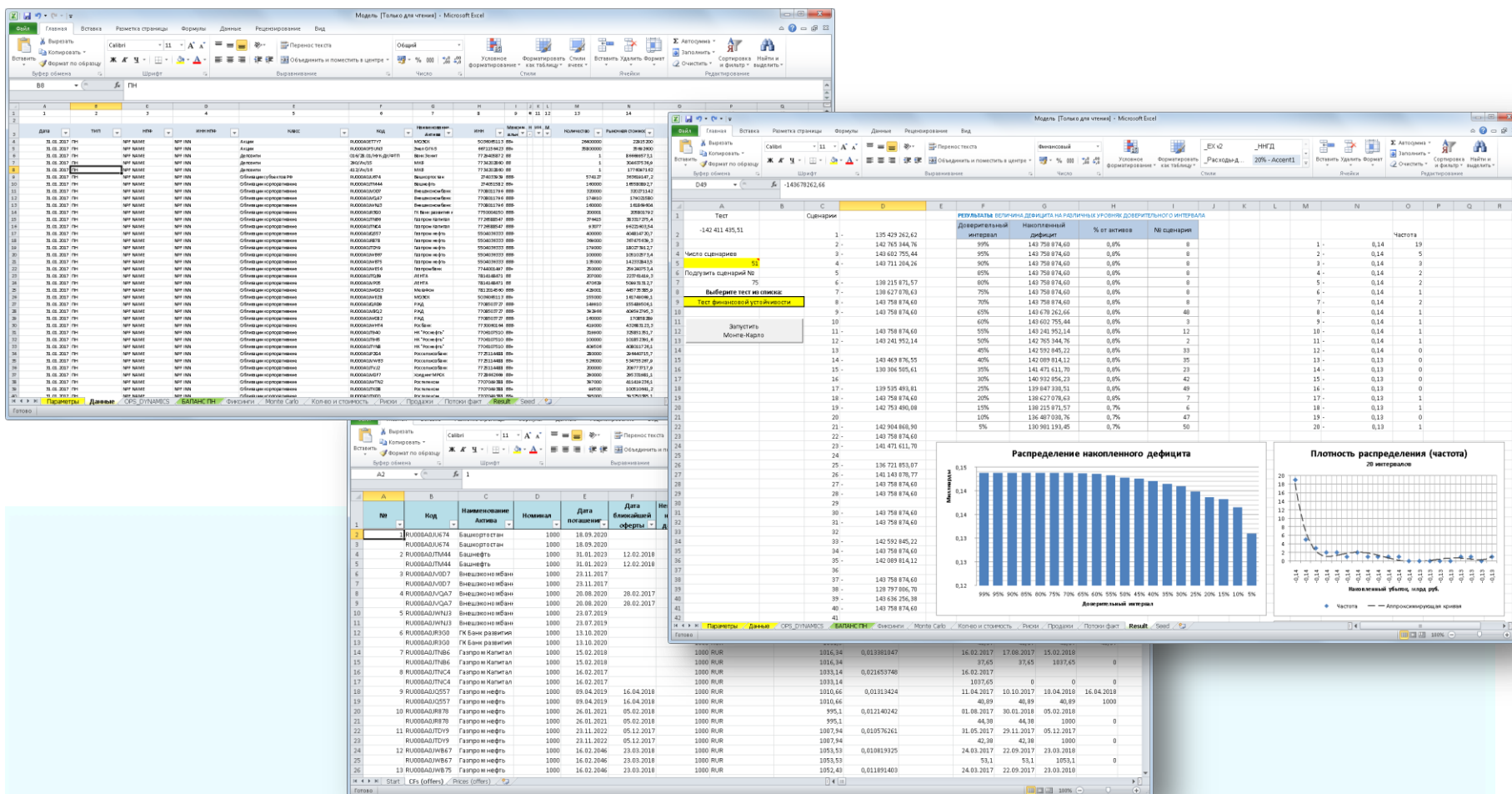
## Аналитическая панель

Эмитенты	Список 1	Поступление платежей									
<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<div>▼ 2017</div>						<div>► 2018</div>	<div>► 2019</div>	<div>► 2020</div>	
<input checked="" type="checkbox"/> Административные	<input checked="" type="checkbox"/> Обязательства	<div>► 1 кв. 2017</div>	<div>► 2 кв. 2017</div>	<div>► 3 кв. 2017</div>	<div>► 4 кв. 2017</div>	2017 Всего					Общий итог
<input checked="" type="checkbox"/> Банки	<input checked="" type="checkbox"/> УК Менеджмент	<div>► Обязательс...</div>	-48 410 958,90	-71 342 465,75	-64 972 602,74	-48 410 958,90	-233 136 986,29	-253 775 342,46	-275 178 082,20	-22 931 506,85	-785 021 917,
<input checked="" type="checkbox"/> Горнодобывающая пр...	<input checked="" type="checkbox"/> УК Проект	<div>► УК Менедж...</div>	8 026 566,50	30 183 759,36	14 988 758,52	32 873 647,76	86 072 732,14	162 267 955,21	22 105 275,30	2 431 734,00	272 877 696,
<input checked="" type="checkbox"/> Государственные активы	<input checked="" type="checkbox"/> УК Проект ВР	<div>► УК Проект</div>	145 344 620,30	386 406 930,95	93 508 634,71	248 917 732,73	874 177 918,69	552 609 560,46	436 173 012,56	3 365 999,00	1 866 326 490,
<input checked="" type="checkbox"/> Машиностроение и ме...	<input checked="" type="checkbox"/> УК Проект СПВ	<div>► УК Проект ВР</div>	88 317,65	158 712,00	107 907,45	188 282,00	543 219,10	46 381,30	7 111,30	3 490,00	600 201,
<input checked="" type="checkbox"/> Metallurgia	<input checked="" type="checkbox"/> УК Региональная	<div>► УК Проект ...</div>	2 496,00	6 079,86	2 042,40	2 241,88	12 860,14	6,00	6,00		12 872,
<input checked="" type="checkbox"/> Нефтегазовая отрасль	<input checked="" type="checkbox"/> УК Уральская	<div>► УК Региона...</div>	20 723 085,98	4 244 120,00	9 837 370,00	18 016 460,00	52 821 035,98	94 889 900,00	7 617 280,00	52 000,00	155 380 215,
<input checked="" type="checkbox"/> Нефтехимическая про...		<div>► УК Уральск...</div>	6 691 475,29	6 836 410,46	7 242 049,88	2 748 250,20	23 518 185,83	86 481 026,12	46 870 980,00	73 815,00	156 944 006,
<input checked="" type="checkbox"/> Прочие		<div>Общий итог</div>	132 465 602,82	356 493 546,88	60 714 160,22	254 335 655,67	804 008 965,59	642 519 486,63	237 595 582,96	-17 004 468,85	1 667 119 566,
<input checked="" type="checkbox"/> Связь											
<input checked="" type="checkbox"/> Строительство											
<input checked="" type="checkbox"/> Топливная промысле...											
<input checked="" type="checkbox"/> Транспорт											

### Поступление платежей



## Результаты экспорта в модель для стресс-тестирования Фондов



Данные для модели ЦБ

Дата: 02/04/18

Портфели:  
УК Менеджмент ПН, УК Менеджмент ПН ВР, УК МенеджментПН СПВ, УК Менеджмент П

Настройка

Активы
Биржа
Сценарии
Частота дефолтов
Обязательства и фиксинги

Контрагент для РЕПО:

Страна "Россия":  
<>  
Россия  
Российская Федерация  
РФ

Ставки переменных купонов
Сброс ставок

Настройка коэффициента бета

Биржа: ММВБ
Индекс: ММВБ

Цена: Средневзвешенная
Кол-во наблюдений: 36

Диапазон значений: от 0,80 до 1,50

☒ Рыночная стоимость
☐ Исключенные дни

Задолженности с просрочкой не более дней: 7

Да
Выход

?
Инструменты...

30

© Copyright InfoStroy Ltd., 2017

## Стресс-тестинг по 4636-У в GAMA

- ✓ Удобная навигация
- ✓ Скорость работы быстрее, а надежность выше, чем Excel
- ✓ Возможность визуальной работы с данными
- ✓ Это база для дальнейшего расширения Ваших возможностей в области риск-менеджмента (добавление сценариев, алгоритмов...)
- ✓ Поддерживается экспорт в Модель Excel

# ПОСЛЕЛОГ

## Схема работы GAMA





# GAMES OVER