

GAMA

КОГДА ДАННЫЕ ГОВОРЯТ...

Как заставить данные говорить?

Взгляд под другим углом

Разделяем на составные части

Объединяем разные источники данных

Сложные калькуляции

Как заставить данные говорить?

Взгляд под другим углом

Разделяем на составные части

Объединяем разные источники данных

Сложные калькуляции

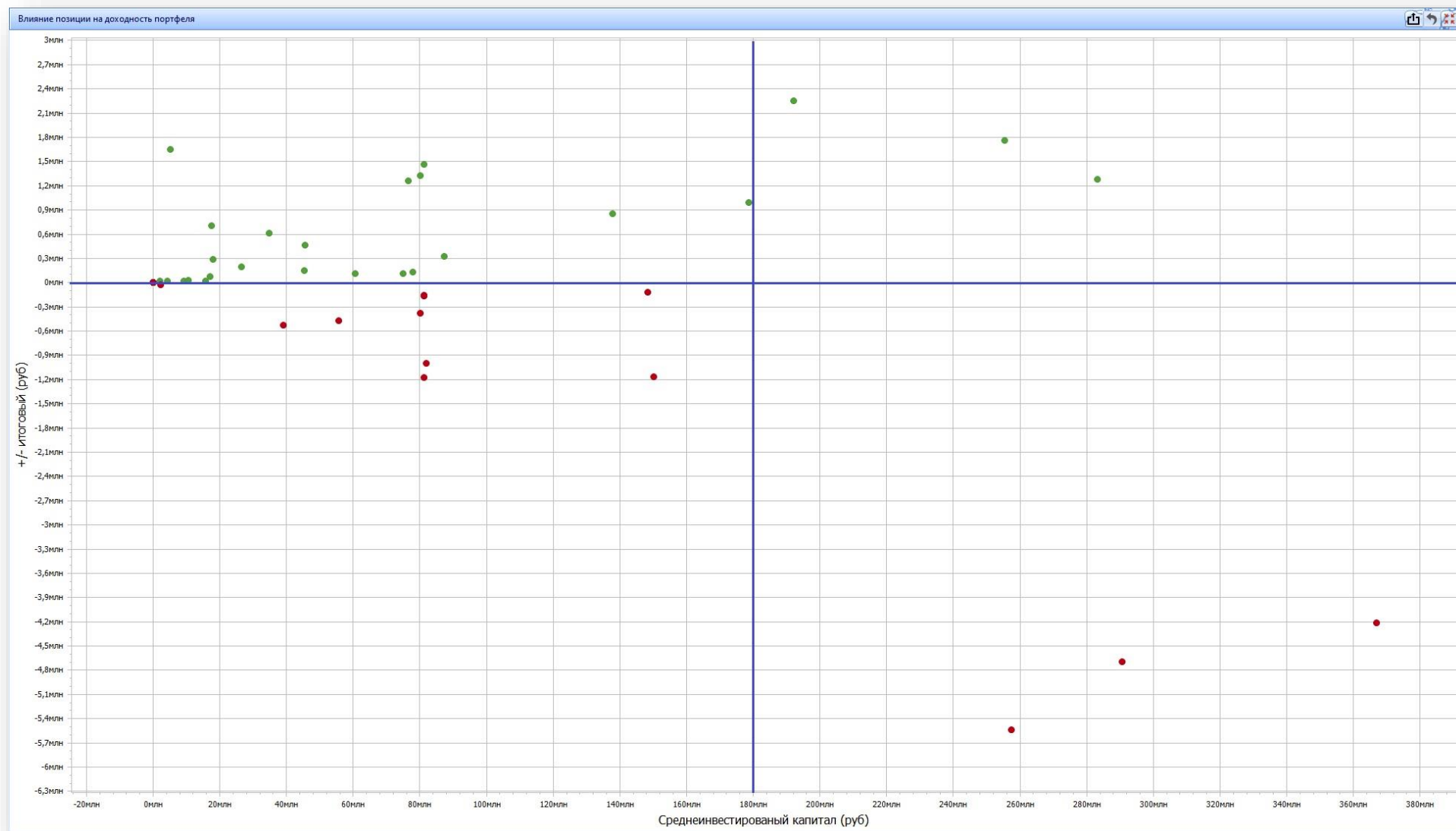
Как оценить влияние позиции на доходность портфеля?

Доходность портфеля * Доля позиции в портфеле = ?

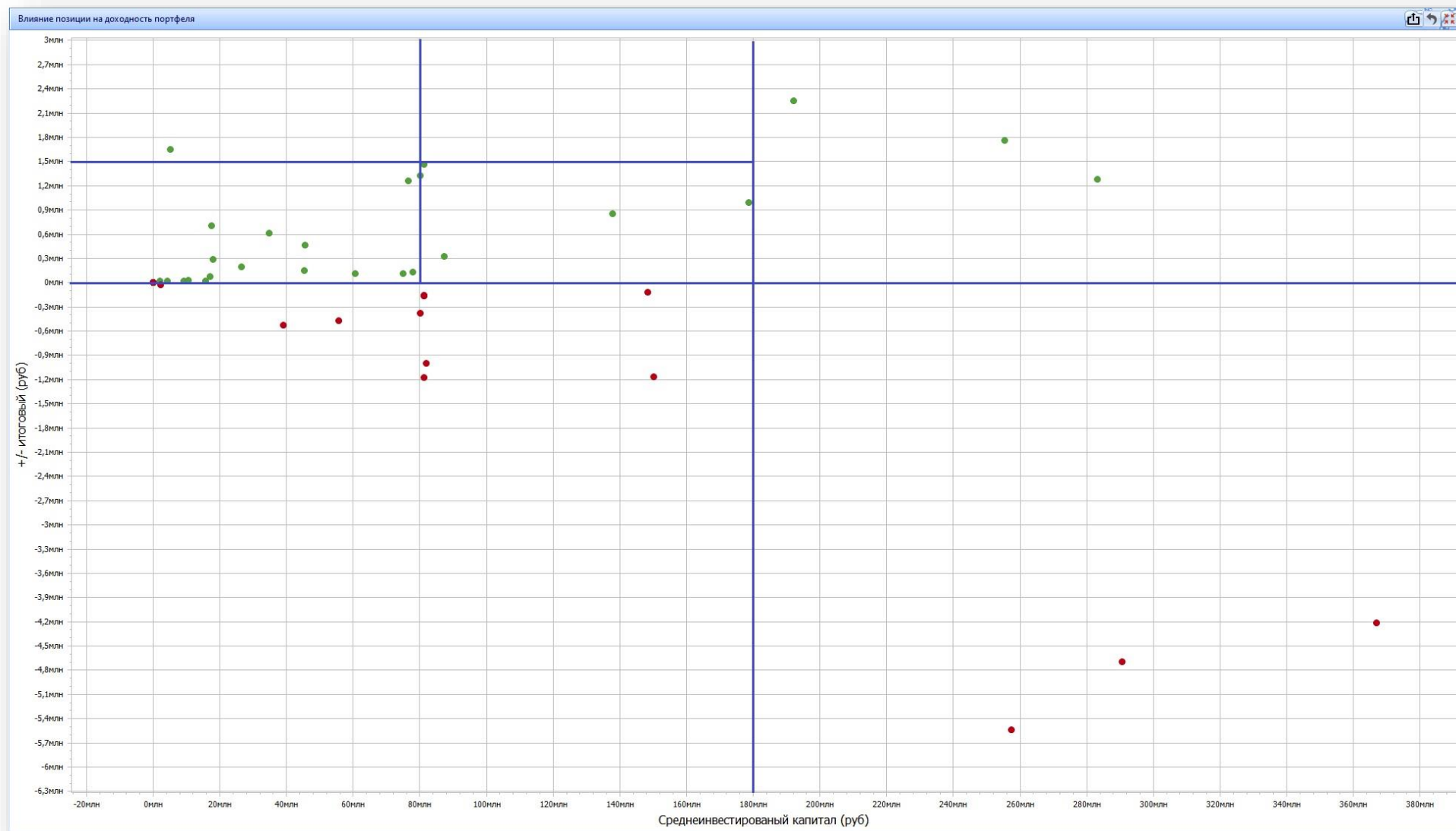
Доходность портфеля * Доля СИК позиции в портфеле = ?

Ранжирование финансового результата и ранжирование СИК позиции в портфеле = ?

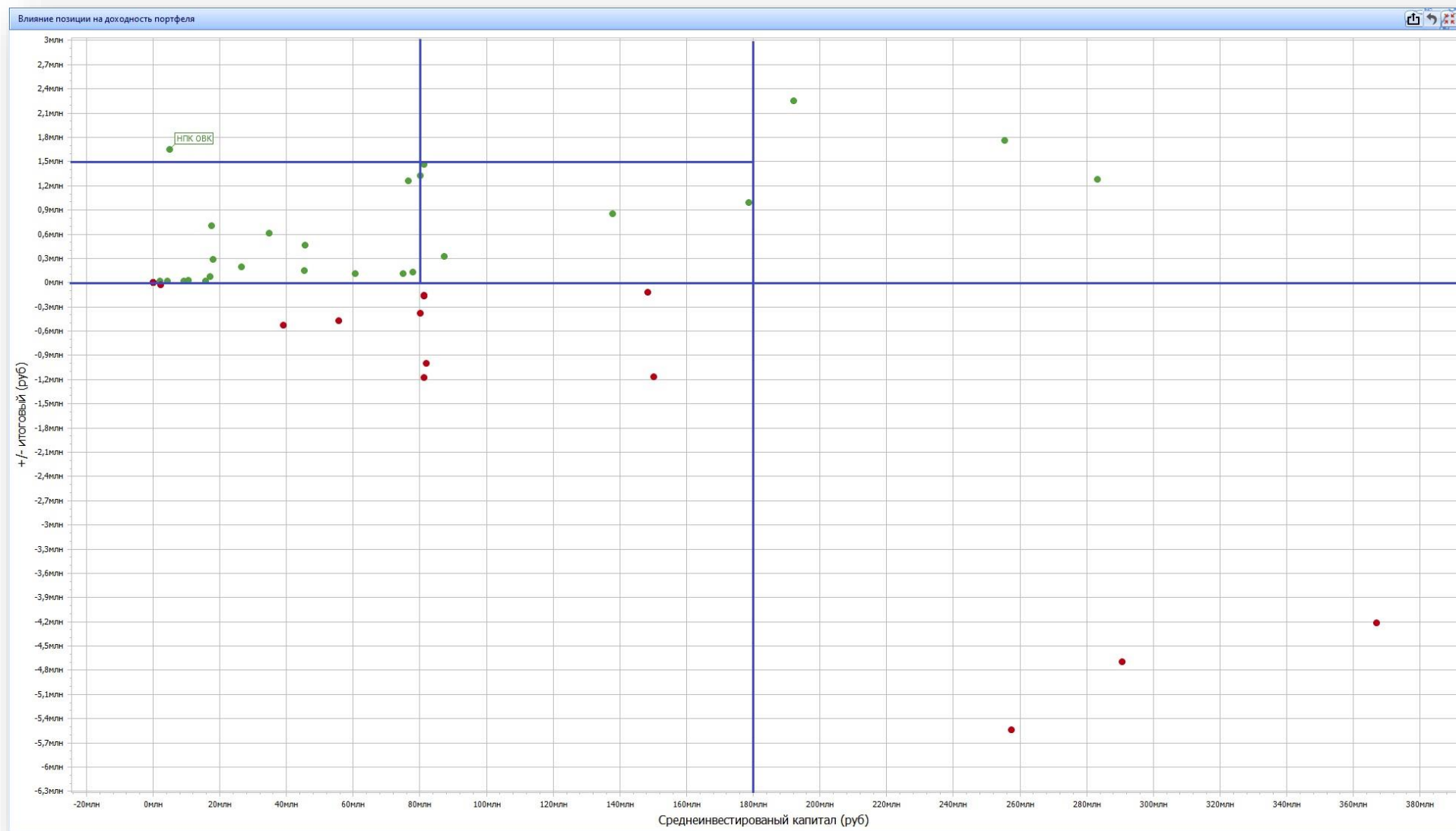
Влияние позиции на доходность портфеля



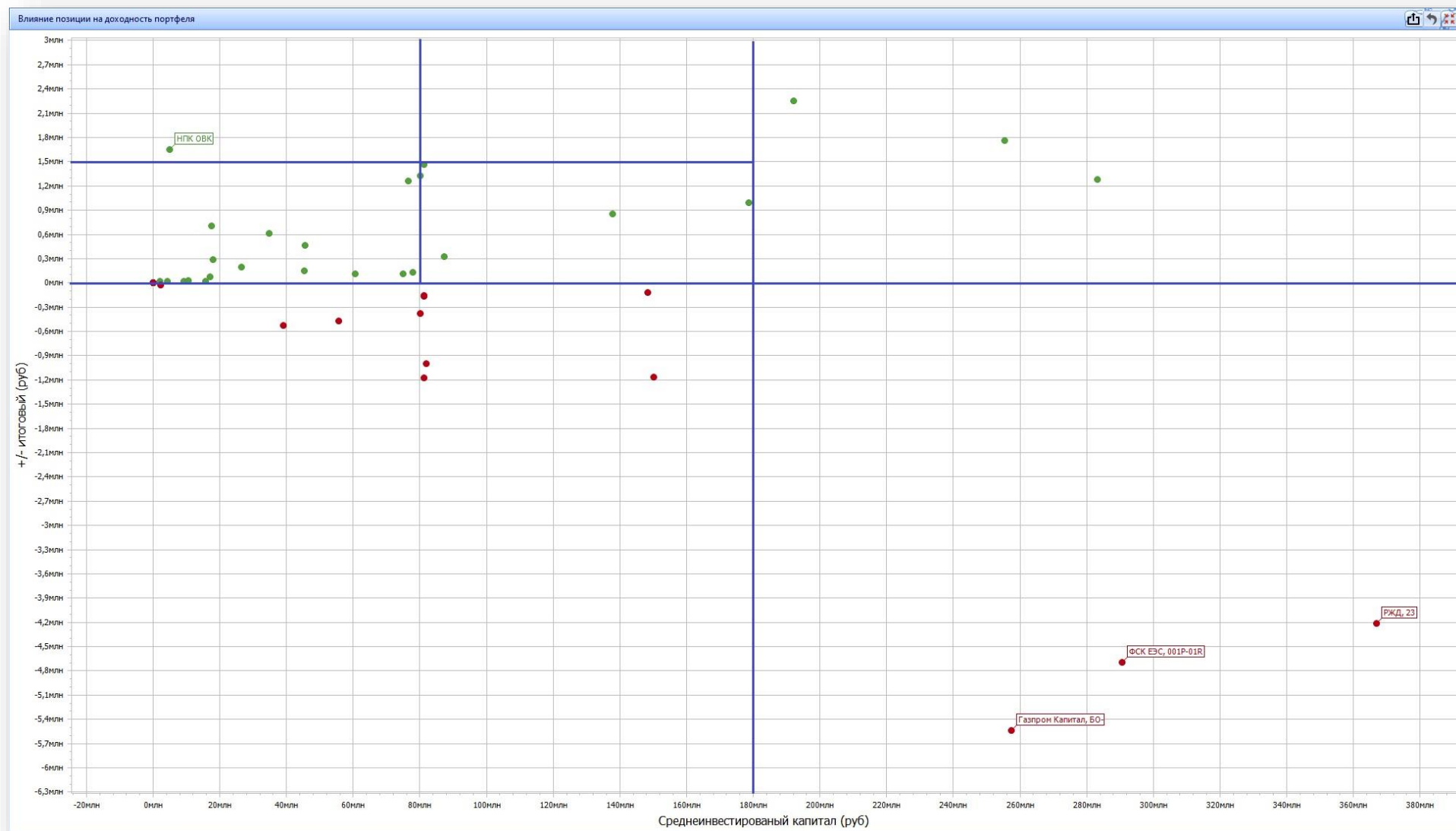
Влияние позиции на доходность портфеля



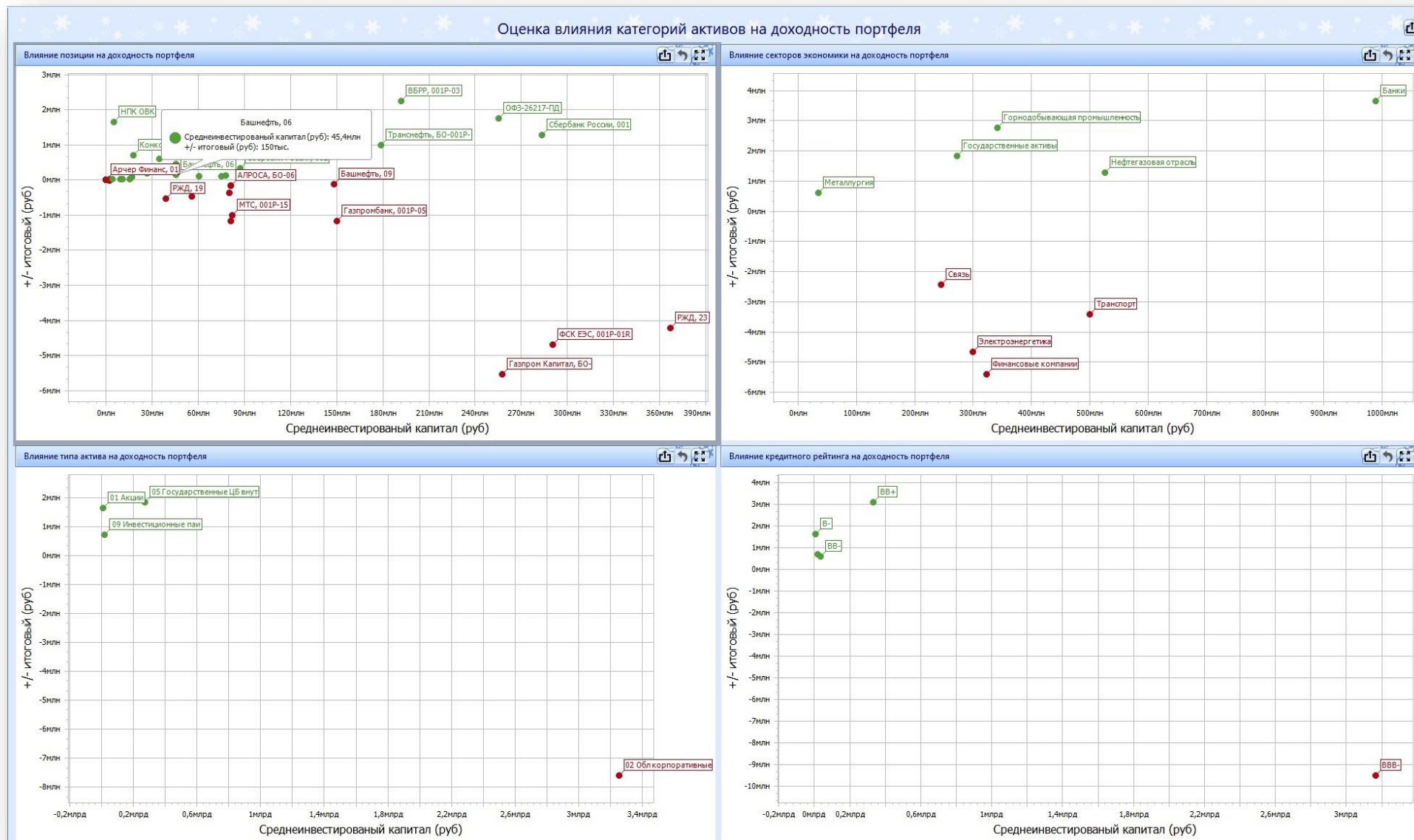
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние категорий активов на доходность портфеля



Как заставить данные говорить?

Взгляд под другим углом

Разделяем на составные части

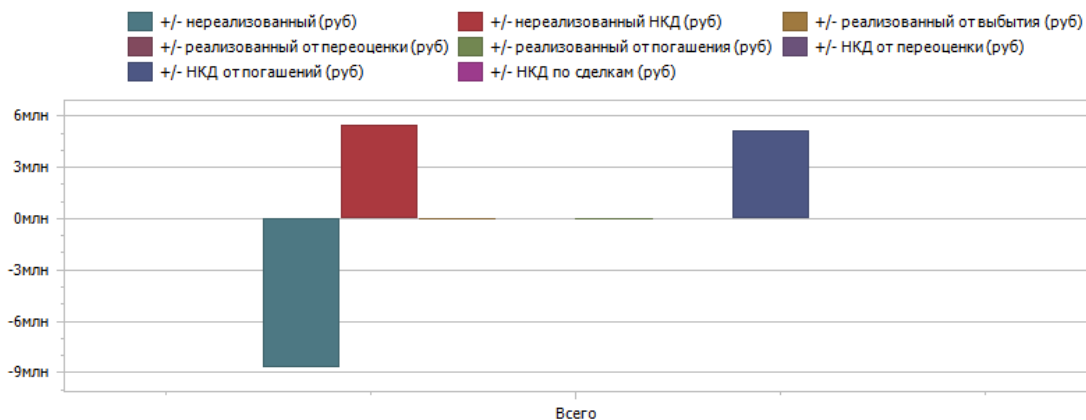
Объединяем разные источники данных

Сложные калькуляции

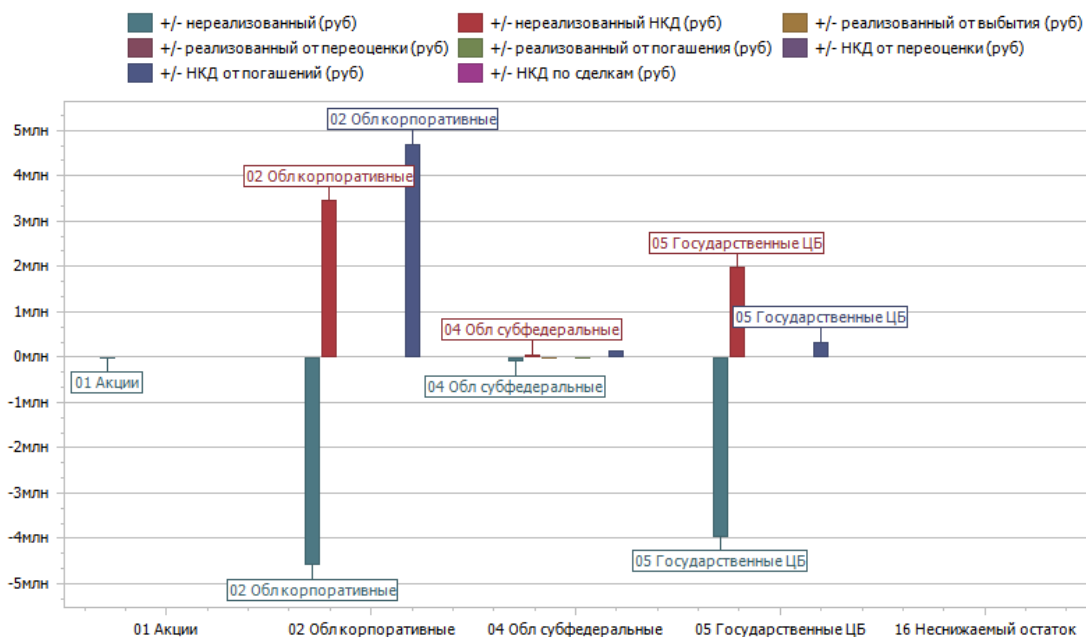
Факторный анализ

Источники финансового результата от управления активами

Составляющие финансового результата от управления активами



Составляющие финансового результата от управления активами



Источники финансового результата ВСЕГО

Реализованная прибыль/убыток

+/- реализованный от выбытия акт...	+/- реализованный от переоцен...	+/- реализованный от погашения акт...
-42 700,00	0	-42 700,00

Нереализованная прибыль/убыток

+/- нереализованный (руб)	+/- нереализованный НКД (руб)
-8 688 488,15	5 501 250,28

Прибыль/убыток от накопленного дохода (НКД)

+/- НКД от переоценки (руб)	+/- НКД от погашений (руб)	+/- НКД по сделкам (руб)
0,00	5 190 688,93	0,00

Источники финансового результата по группам активов

Реализованная прибыль/убыток

Категория баланс...	+/- реализованный от выб...	+/- реализованный от п...	+/- реализованный от погаш...
01 Акции	0,00	0	0,00
02 Обл корпорати...	0,00	0	0,00
04 Обл субфедера...	-42 700,00	0	-42 700,00
05 Государствен...	0,00	0	0,00

Нереализованная прибыль/убыток

Категория балансового учета	+/- нереализованный (руб)	+/- нереализованный НКД (руб)
01 Акции	-28 043,75	0,00
02 Обл корпоративные	-4 593 807,50	3 456 428,07
04 Обл субфедеральные	-97 952,21	59 114,20
05 Государственные ЦБ	-3 968 684,69	1 985 708,01
16 Неснижаемый остаток	0,00	0,00

Прибыль/убыток от накопленного дохода (НКД)

Категория балансового у...	+/- НКД от переоценки (р...	+/- НКД от погашений (р...	+/- НКД по сделкам (р...
01 Акции	0,00	0,00	0,00
02 Обл корпоративные	0,00	4 707 860,61	0,00
04 Обл субфедеральные	0,00	143 733,72	0,00
05 Государственные ЦБ	0,00	339 094,60	0,00
16 Неснижаемый остаток	0,00	0,00	0,00

Как заставить данные говорить?

Взгляд под другим углом

Разделяем на составные части

Объединяем разные источники данных

Сложные калькуляции

Доля кредитного и рыночного риска в стоимости активов

Распределение кредитного и рыночного риска по активам

Вкладка 1

Распределение кредитного и рыночного риска

Вкладка 3

Доля кредитного и рыночного риска в объеме позиции

Эмитент	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эмитента в стоимости порт...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
РСХБ	9 510 164,70	0,28%	-14,14%	-1 344 382,02	-1 222 239,94	-122 142,08
МТС	72 216 494,64	2,15%	-4,85%	-3 505 755,71	-369 853,56	-3 135 902,15
АЛРОСА	308 081 030,12	9,18%	-3,84%	-11 821 893,74	-1 201 141,04	-10 620 752,70
Россети	244 334 973,85	7,28%	-3,50%	-8 554 627,14	-773 569,88	-8 167 842,20
РЖД	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Ростелеком	48 359 001,24	1,44%	-3,40%	-1 643 327,44	-426 277,44	-1 217 050,00
Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69
Банк ГПБ	132 209 061,67	3,94%	-1,98%	-2 623 086,28	-522 210,10	-2 100 876,18
Транснефть	144 125 026,50	4,30%	-1,91%	-2 753 054,17	-1 133 787,83	-1 619 266,34
Роснефть НК	94 503 961,20	2,82%	-1,90%	-1 796 861,26	-164 701,40	-1 632 159,86

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портф...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Горнодобывающая промышлен...	308 081 030,12	9,18%	-3,84%	-11 821 893,74	-1 201 141,04	-10 620 752,70
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89
Банки	567 847 834,71	16,93%	-2,86%	-16 226 704,75	-4 830 715,10	-11 395 989,65
Нефтегазовая отрасль	480 473 465,74	14,32%	-1,82%	-8 757 456,19	-2 410 321,90	-6 347 134,29

Доля кредитного и рыночного риска в дюрации

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости порт...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41

Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15

Как заставить данные говорить?

Взгляд под другим углом

Разделяем на составные части

Объединяем разные источники данных

Сложные калькуляции

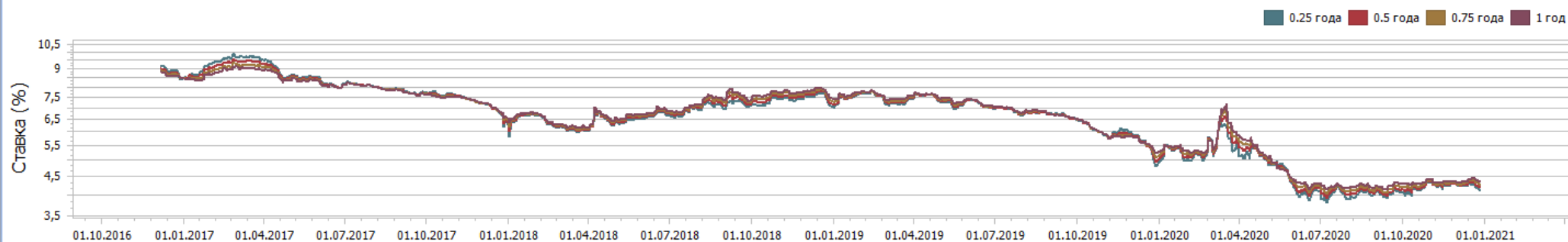
Оценка волатильности процентных ставок, индексов, бумаг

История изменения процентных ставок G-кривой

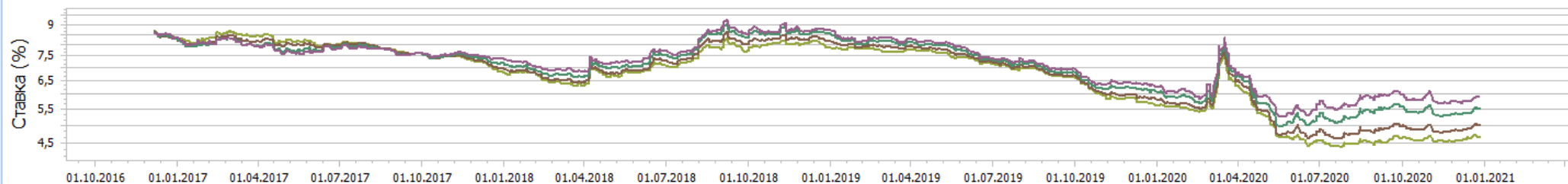
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0.25 года	0.5 года	0.75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837

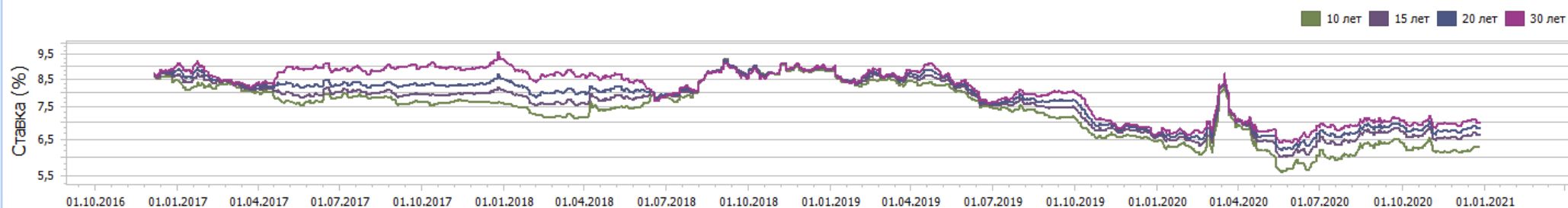
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



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



Моделирование в GAMA финансового рынка

Индекс акций:

$$s_k = s_{k-1} \exp\left\{\left(\mu - \frac{\sigma^2}{2}\right)\Delta t + \sigma_s \sqrt{\Delta t} \cdot (\rho \xi_{r,k} + \sqrt{1 - \rho^2} \xi_{s,k})\right\}$$

Процентная ставка

$$r_k = r_{k-1} + [\theta(t_k) - a \cdot r_{k-1}] \cdot \Delta t + \sigma \sqrt{\Delta t} \cdot z_k$$

$$\theta(t_k) = \frac{f(0, t_{k+1}) - f(0, t_k)}{\Delta t} + a f(0, t_k) + \frac{\sigma^2}{2a} \cdot (1 - e^{-2a t_k})$$

$$f(0, t_k) = t \cdot \frac{R(0, t_{k+1}) - R(0, t_k)}{\Delta t} + R(0, t_k)$$

Цены облигаций

$$P(t, T) = e^{-R(t, T)(T-t)} = A(t, T) e^{-B(t, T) \cdot r(t)}$$

$$B(t, T) = \frac{1 - e^{-a(T-t)}}{a}$$

$$\ln A(t, T) = \ln \left(\frac{P(0, T)}{P(0, t)} \right) - B(t, T) \cdot \frac{P(0, t + \Delta t) - P(0, t)}{\Delta t} - \frac{\sigma^2}{4a^3} (e^{-aT} - e^{-at})^2 \cdot (e^{2at} - 1)$$

Временная структура процентных ставок

$$R(t, T) = - \frac{\ln A(t, T) - B(t, T) \cdot r(t)}{T - t}$$

Корреляция между рынком акций и процентными ставками:

$$\rho = \text{Cov}(\rho \xi_{r,k} + \sqrt{1 - \rho^2} \xi_{s,k}, \sqrt{1 - \rho^2} \xi_{s,k})$$

• Калибровка модели Халла-Уайта при помощи метода обобщённых моментов (GMM)

$$x_{k+1} = r_{k+1} - f(0, t_{k+1}) - \frac{\sigma^2}{2a^2} (1 - e^{-a t_{k+1}})^2$$

$$u_{k+1} = x_{k+1} - e^{-a \Delta t} x_k$$

$$\rho^2 = \frac{\sigma^2}{2a} (1 - e^{-2a \Delta t})$$

• Предполагается, что величина u_{k+1} распределена нормально с математическим ожиданием 0 и дисперсией ρ^2 :

$$f_{1,k} = E\{u_{k+1}\} = 0 \quad f_{2,k} = E\{u_{k+1}^2 - \rho^2\} = 0$$

$$f_{3,k} = E\{u_{k+1} x_k\} = 0 \quad f_{4,k} = E\{(u_{k+1}^2 - \rho^2) x_k\} = 0$$

$$F_1 = \frac{1}{N} \sum_{k=1}^{N-1} f_{1,k} \quad F_2 = \frac{1}{N} \sum_{k=1}^{N-1} f_{2,k}$$

$$F_3 = \frac{1}{N} \sum_{k=1}^{N-1} f_{3,k} \quad F_4 = \frac{1}{N} \sum_{k=1}^{N-1} f_{4,k}$$

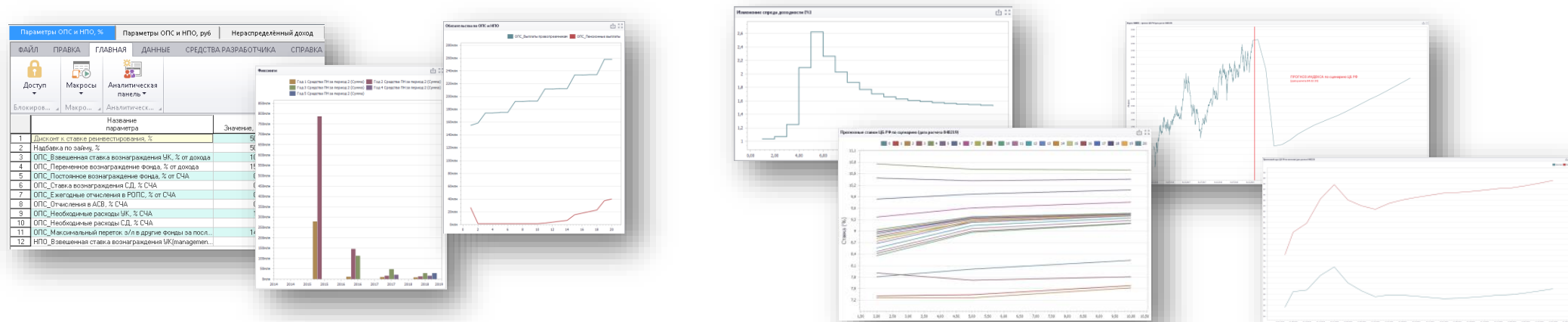
$$F = (F_1, F_2, F_3, F_4)^T$$

$$W = \left(\frac{1}{N} \sum_{t=1}^N \begin{bmatrix} f_{1,k} \\ f_{2,k} \\ f_{3,k} \\ f_{4,k} \end{bmatrix} [f_{1,k} \quad f_{2,k} \quad f_{3,k} \quad f_{4,k}] \right)^{-1}$$

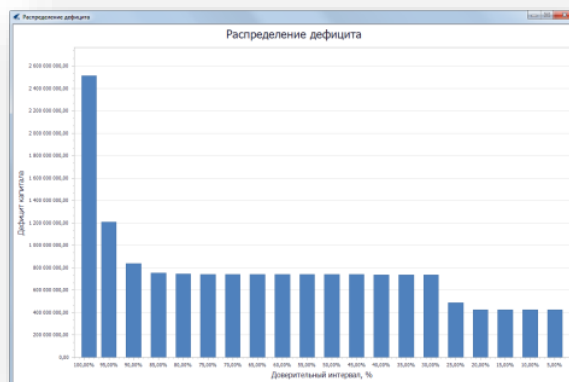
• Функционал ошибки:

$$J(a, \sigma) = \frac{1}{2} F^T W F$$

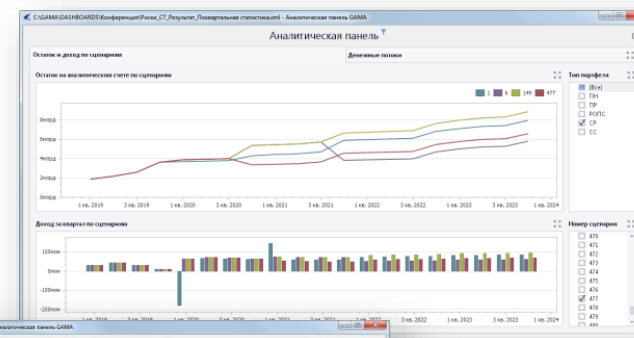
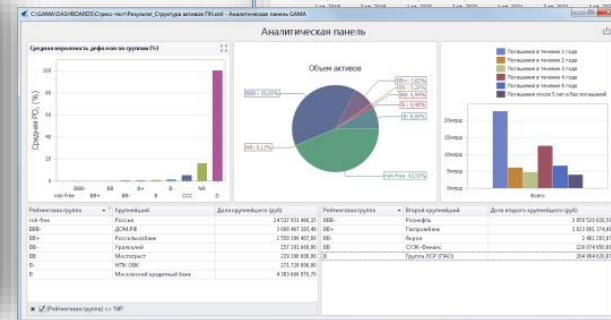
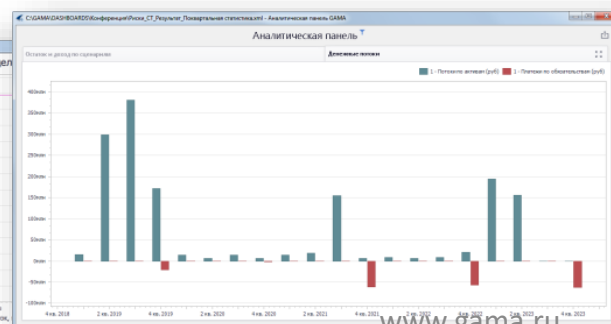
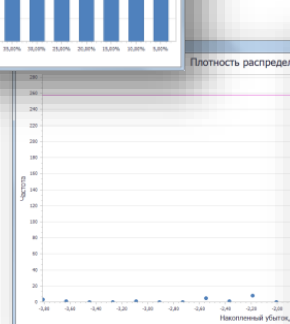
Стресс-тестирование НПФ



Сценарии ЦБ - Рыночные данные - Портфельный учет – Обязательства фонда

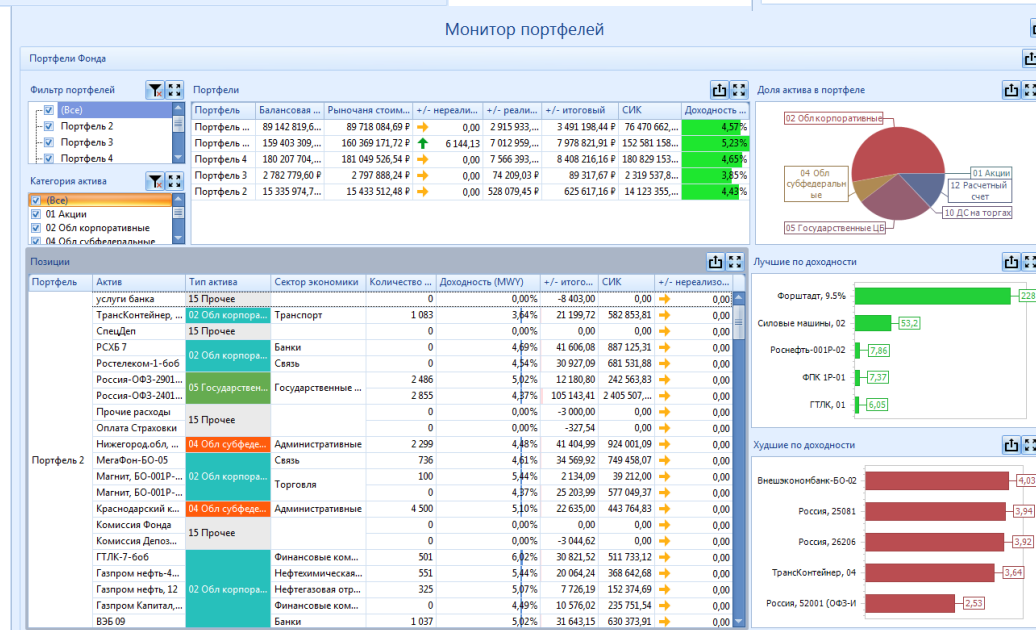
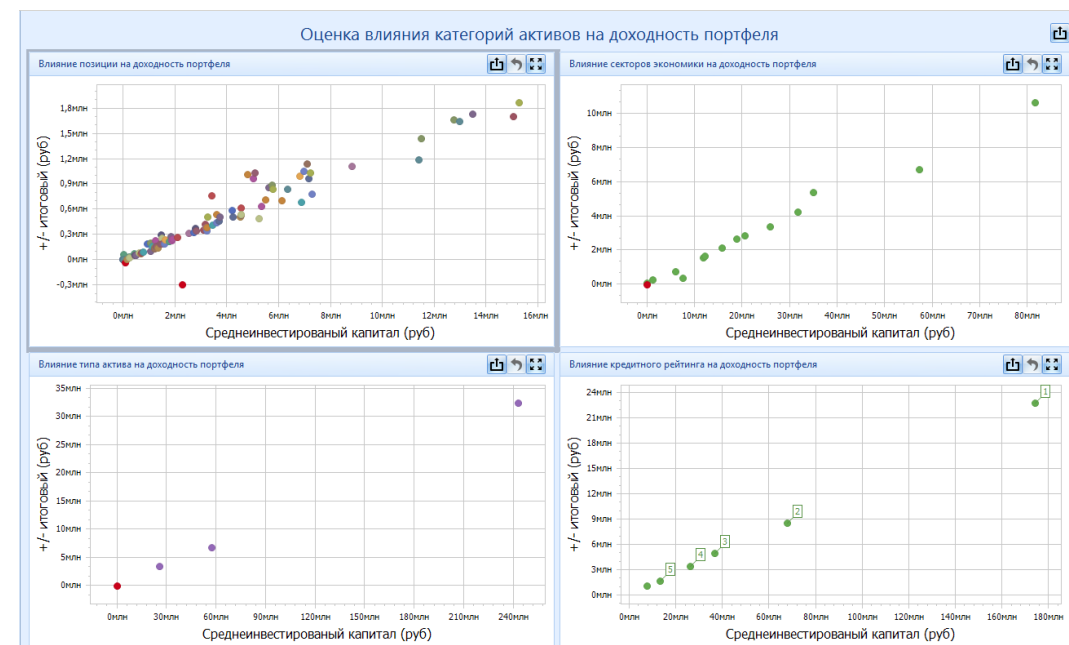
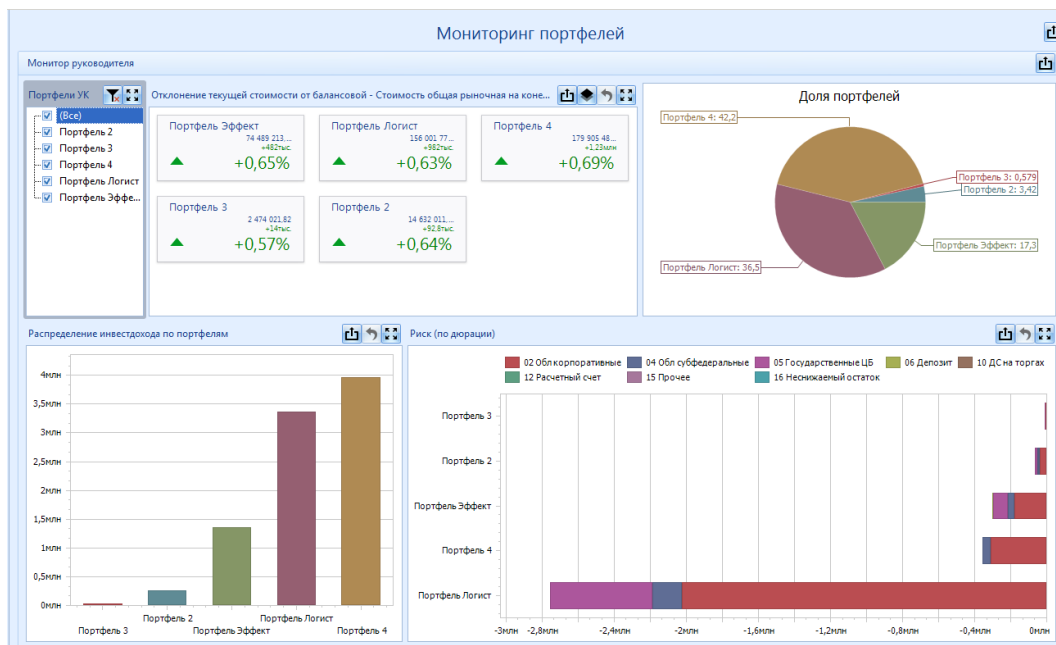


Будущие денежные потоки
Прогнозные балансы
Вероятности дефолтов

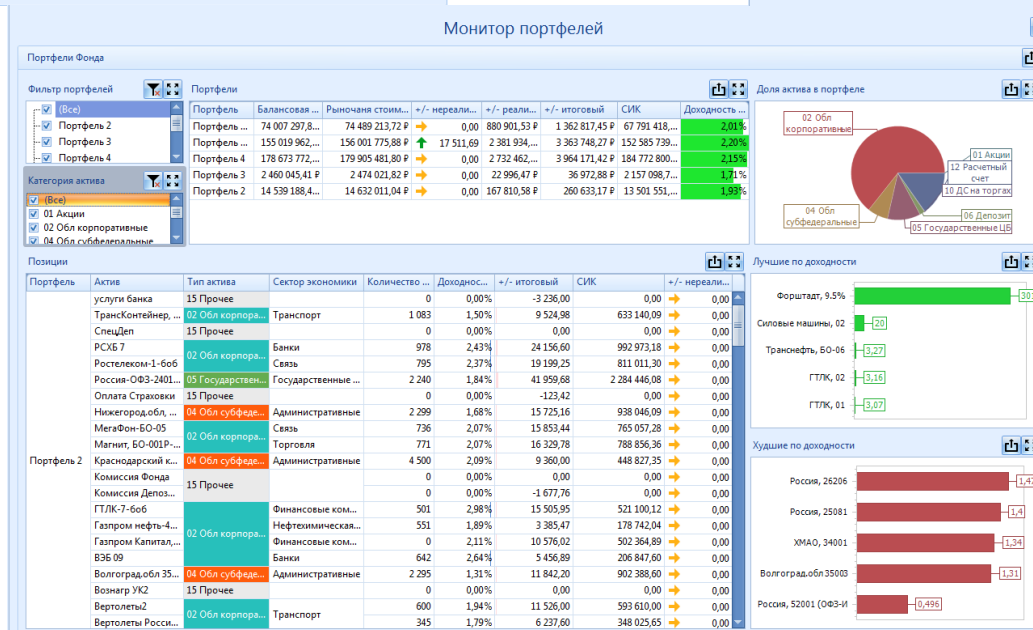
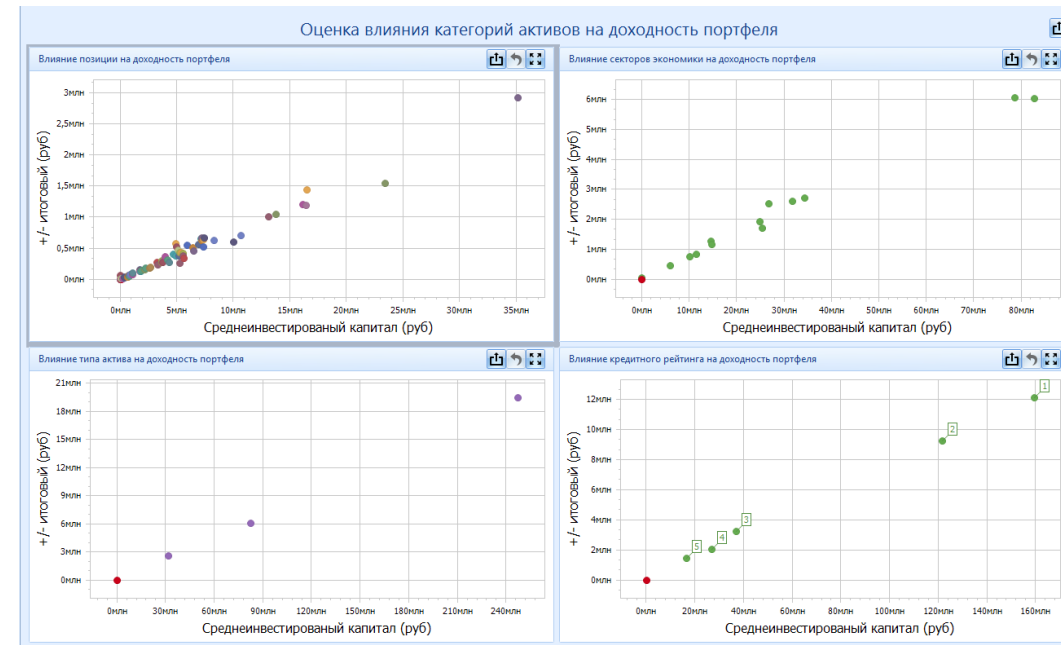
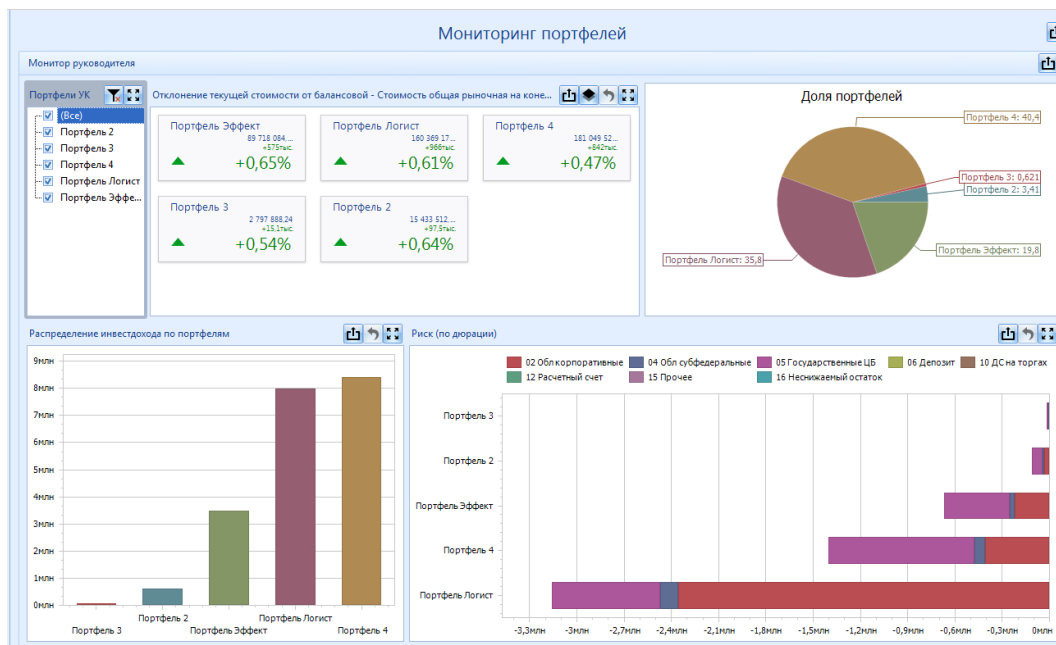


Данные говорят с Вами в реальном времени

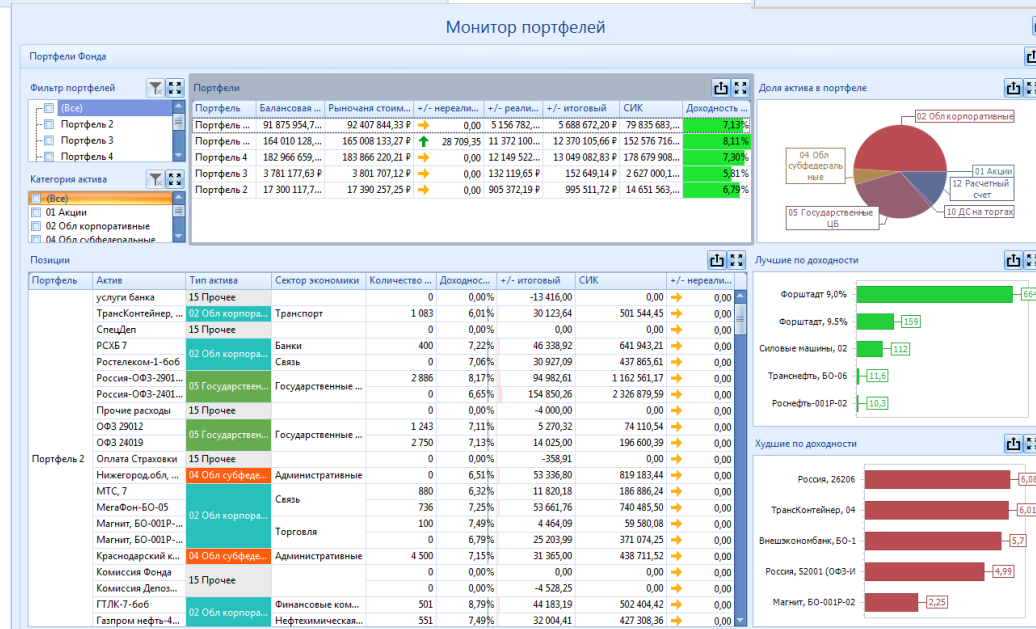
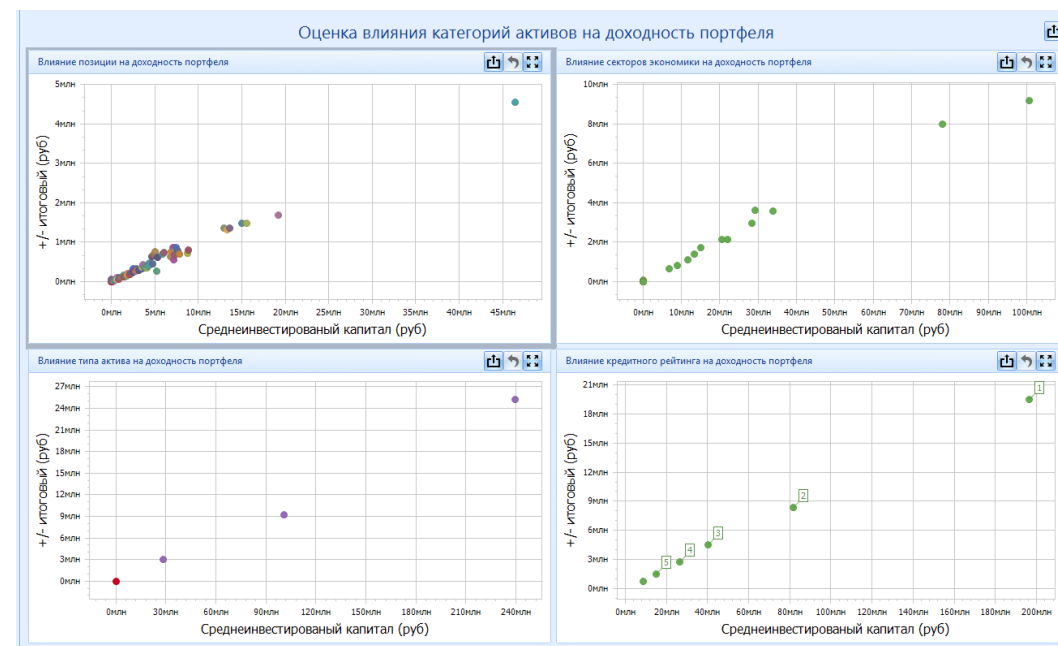
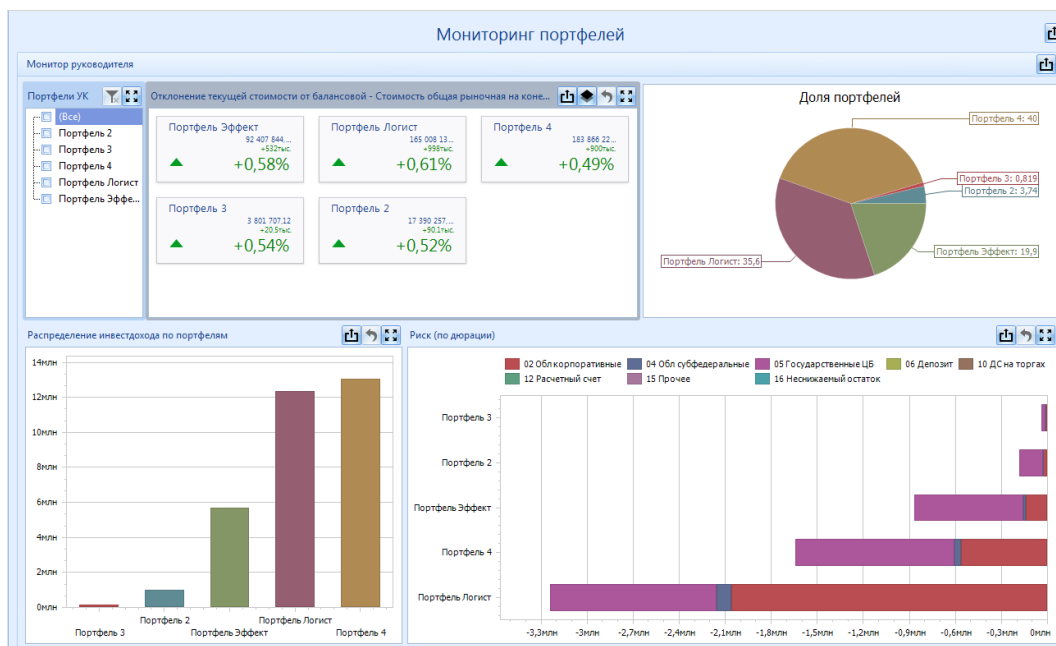
Мониторинг в реальном времени



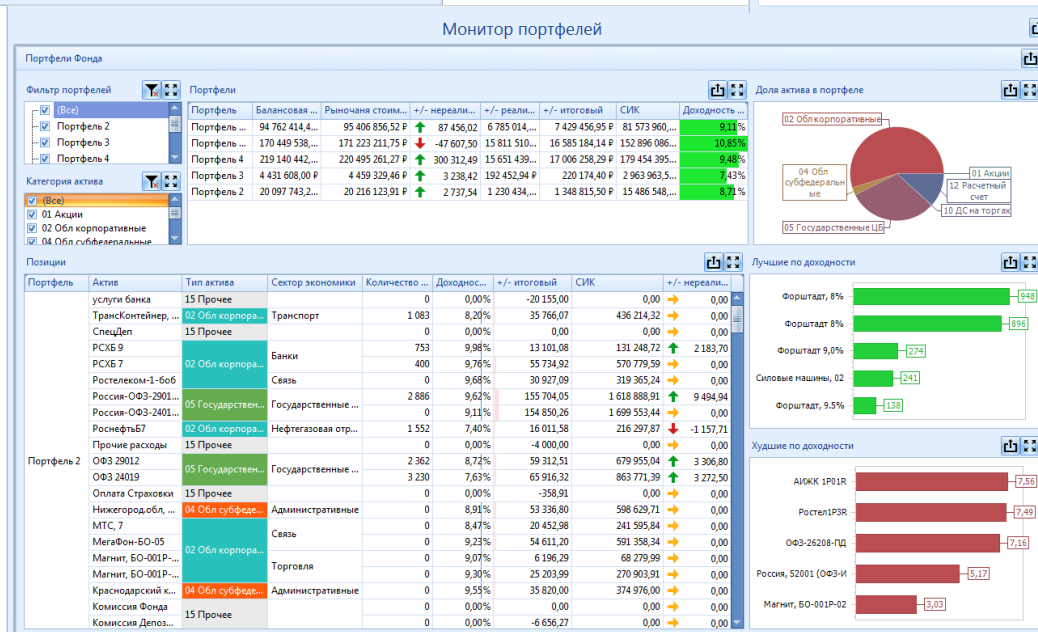
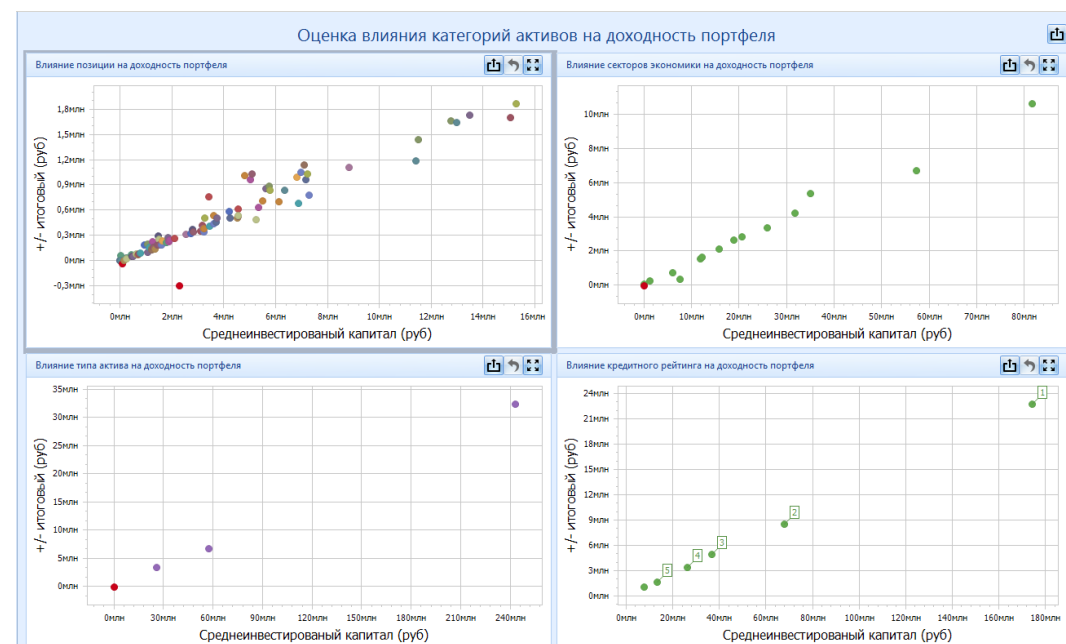
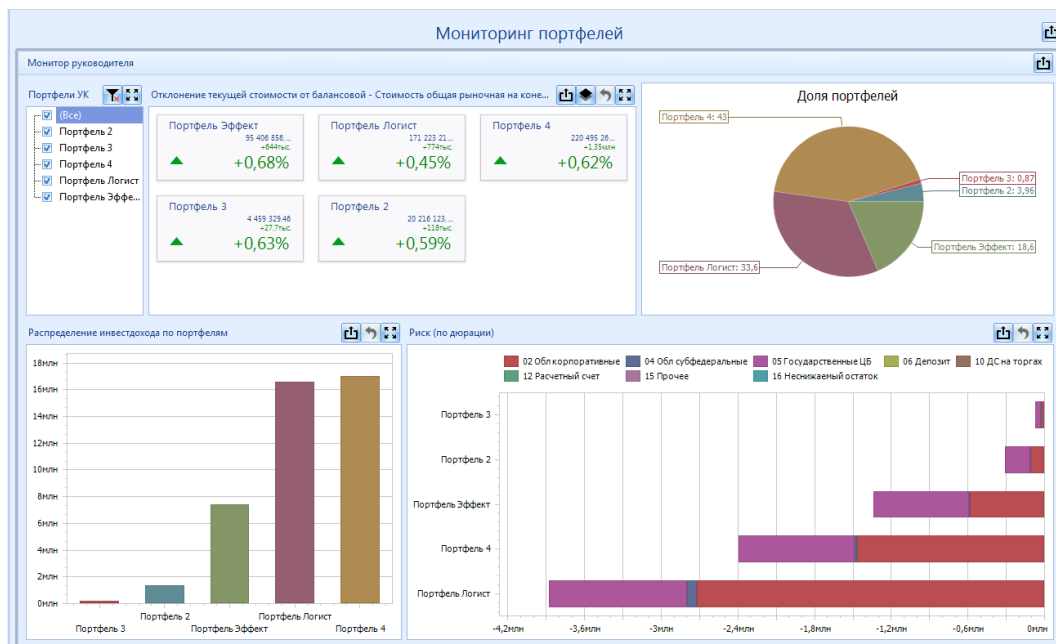
Мониторинг в реальном времени



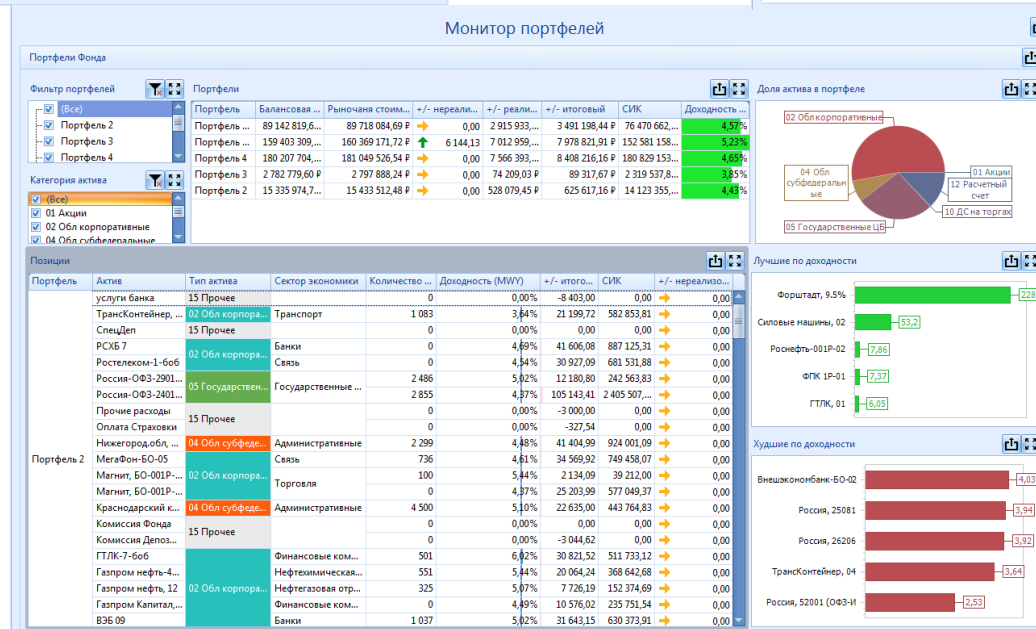
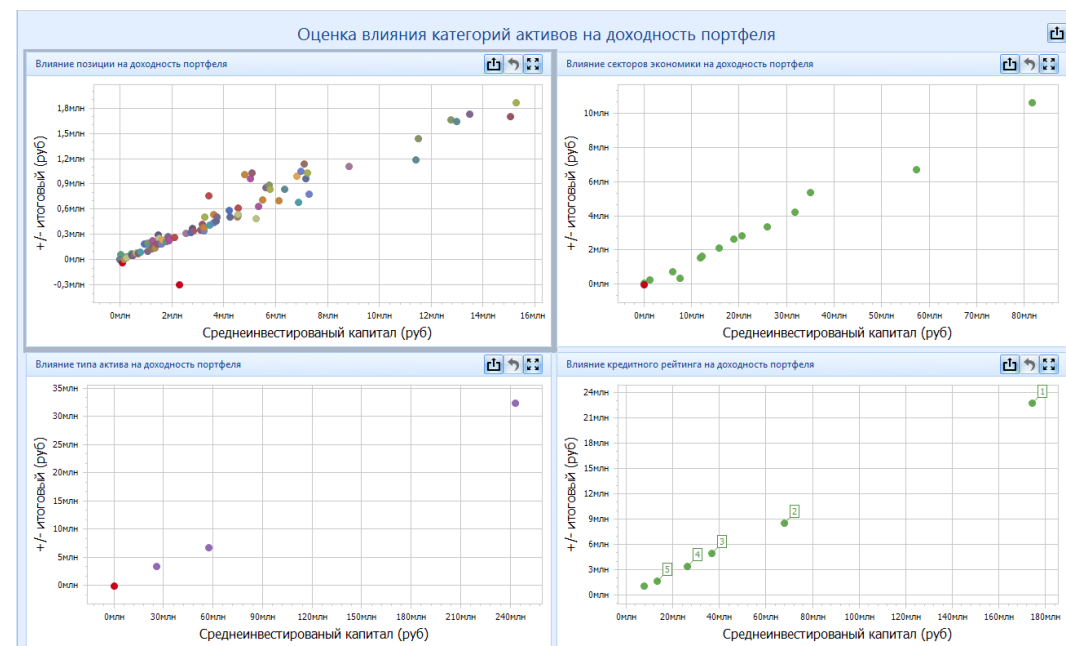
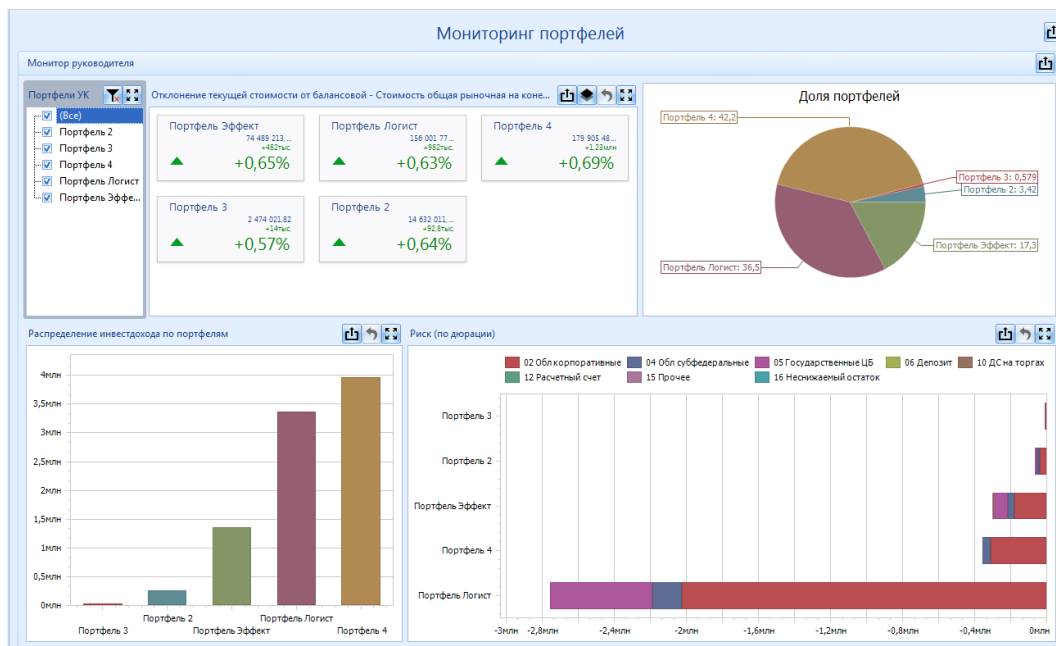
Мониторинг в реальном времени



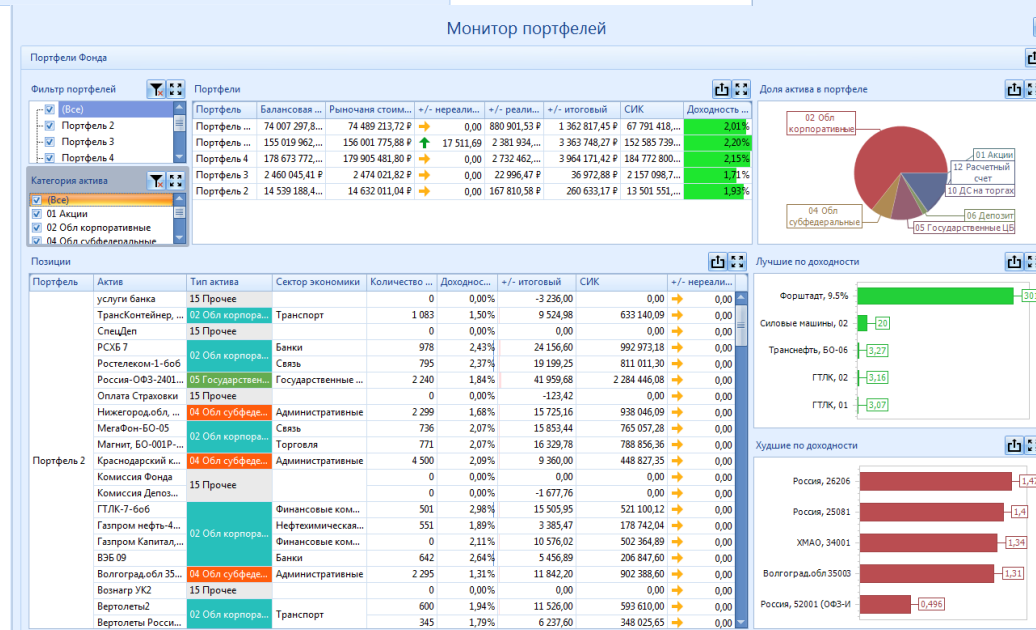
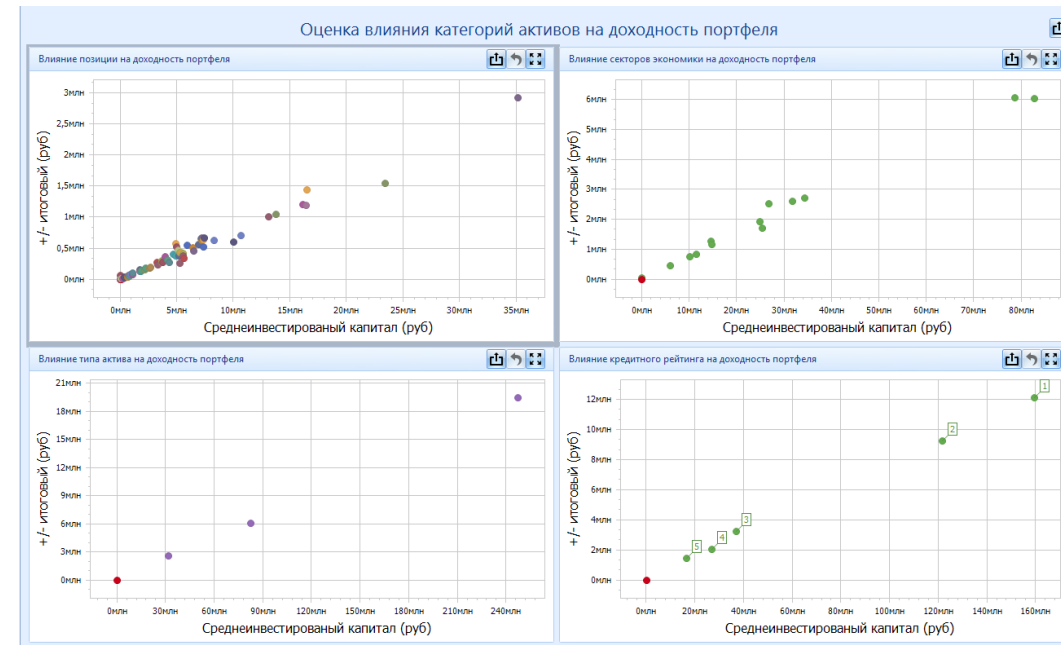
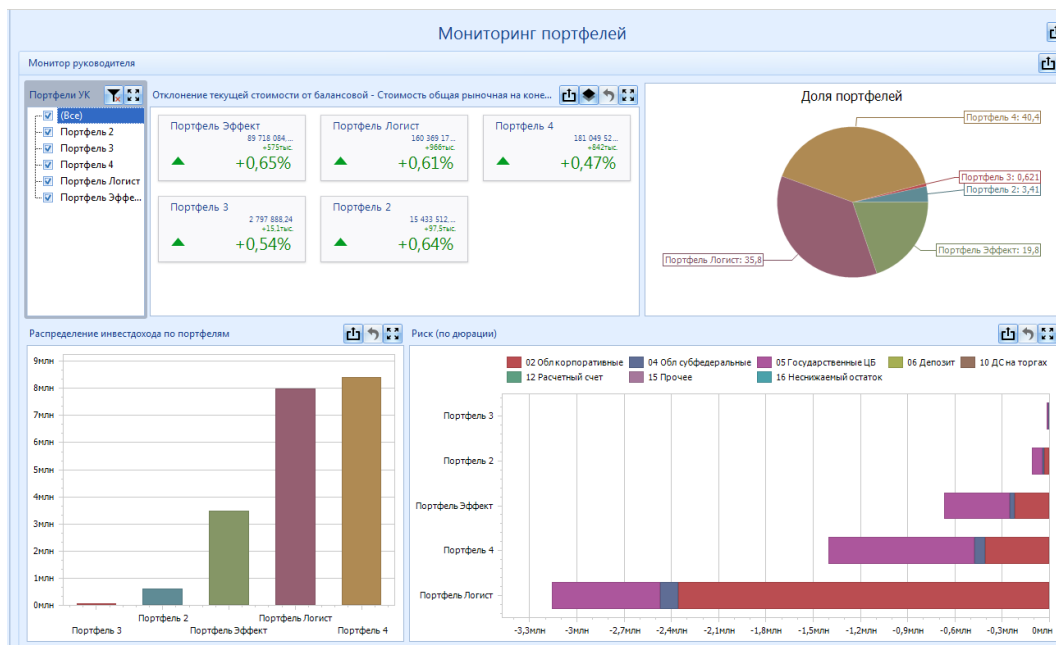
Мониторинг в реальном времени



Мониторинг в реальном времени



Мониторинг в реальном времени



EUR ↑ 1.0734 - .0006

BGN 1.0734 / 1.0735 BGN

At 17:27 Op 1.0735 Hi 1.0739 Lo 1.0722 Close 1.0741 Value 11/12/15

EUR BGN Curncy

Bloomberg Quote

EURUSD Spot Exchange Rate - Price of 1 EUR in USD

1) All Composite Quotes (ALLQ)

Time	Bid Src	Bid / Ask	Ask Src
------	---------	-----------	---------

Best Bid/Ask

17:27	ANON	1.0735 / 1.0735	ANON
-------	------	-----------------	------

Quote Recap

17:27	ZFXH	1.0733 / 1.0736	ZFXH
-------	------	-----------------	------

17:27	ALFN	1.0733 / 1.0736	ALFN
-------	------	-----------------	------

17:27	RZBM	1.0734 / 1.0735	RZBM
-------	------	-----------------	------

17:27	ZFXH	1.0733 / 1.0736	ZFXH
-------	------	-----------------	------

4) Open/High/Low/Close Graph (GPC)



3) Spot & Forward Rates (FRD)

	EUR/USD		EUR/JPY	
	Bid	Ask	Bid	Ask

SP	1.0735	1.0735	132.31	132.34
----	--------	--------	--------	--------

1M	4.38	4.61	1.82	2.59
----	------	------	------	------

2M	13.39	13.89	-5.20	-4.16
----	-------	-------	-------	-------

3M	21.10	21.70	-3.74	-2.47
----	-------	-------	-------	-------

6M	47.03	47.40	-9.37	-6.63
----	-------	-------	-------	-------

12M	117.35	118.35	-18.11	-14.73
-----	--------	--------	--------	--------

5) Intraday Price Graph (GIP)



6) FX News (CN)

BN 7:58 Cameron Warns EU Not to Ignore British Renegotiation Demands (1)

BFW 15:01 Portuguese Communists Reaffirm Socialist Party Can Form Govt

BFW 11:07 U.K. Passenger Plane Avoided Missile Above Egypt in August: Mail

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 2395 9000 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2015 Bloomberg Finance L.P.

SN 247141 EST GMT-5:00 G447-4722-0 08-Nov-2015 17:27:07

Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
- Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4

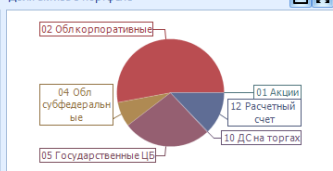
Категория актива

- (Все)
- 01 Акции
 - 02 Обл. корпоративные
 - 04 Обл. субфедеральные

Портфели

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	0,00	2 915 933...	3 491 196,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	6 144,13	7 012 959...	7 978 821,91 Р	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60 Р	2 797 888,24 Р	0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,43%

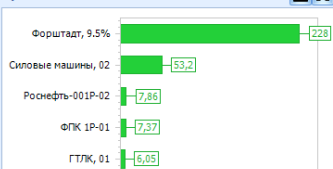
Доля актива в портфеле



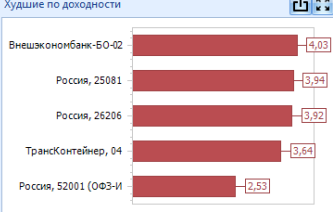
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итог...	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл. корп...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РСХБ 7	02 Обл. корп...	Банки	0	4,69%	41 606,08	887 125,31	0,00
	Ростелеком-1-606	02 Обл. корп...	Связь	0	4,54%	30 927,09	681 531,88	0,00
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государств...	Государственные ...	2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государств...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507...	0,00
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл. субфед...	Административные	2 299	4,48%	41 404,99	924 001,09	0,00
Портфель 2	МегФон-БО-05	02 Обл. корп...	Связь	736	4,61%	34 569,92	749 458,07	0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл. корп...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл. корп...	Торговля	0	4,37%	25 203,99	577 049,37	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл. субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Делоз...	15 Прочее		0	0,00%	-3 044,62	0,00	0,00
	ГТЛК-7-606	02 Обл. корп...	Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл. корп...	Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	0,00
	Газпром нефть, 12	02 Обл. корп...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	0,00
	Газпром Капитал...	02 Обл. корп...	Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	0,00
	В36 09	Банки		1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	0,00

Лучшие по доходности



Худшие по доходности

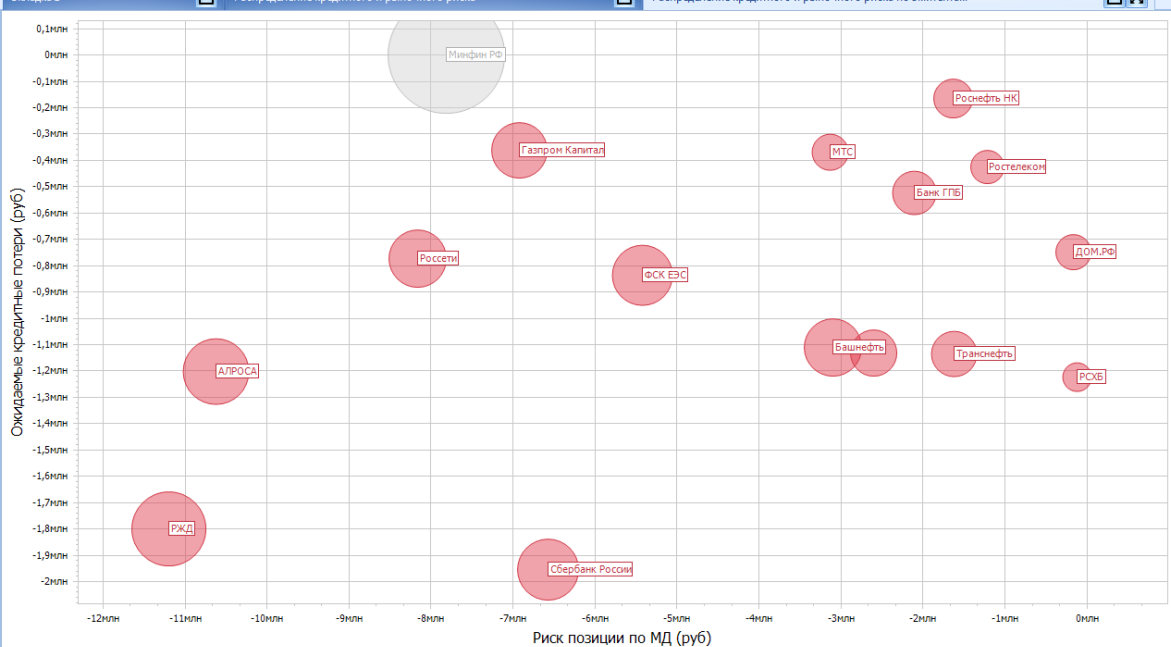


Распределение кредитного и рыночного риска по активам

Вкладка 1

Распределение кредитного и рыночного риска

Распределение кредитного и рыночного риска по эмитентам

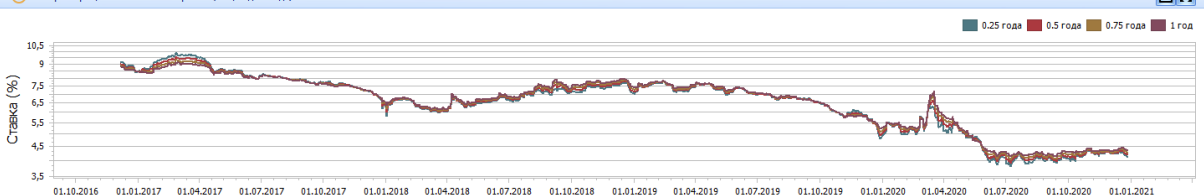


История изменения процентных ставок G-кривой

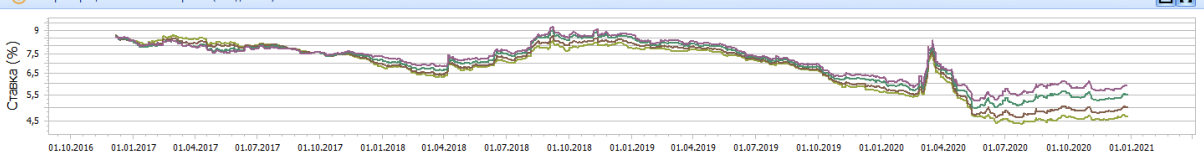
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837

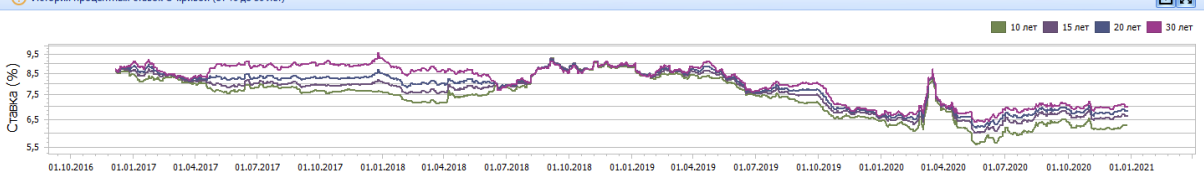
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



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



Распределение кредитного и рыночного риска по активам

Вкладка 1

Распределение кредитного и рыночного риска

Распределение кредитного и рыночного риска по эмитентам

Доля кредитного и рыночного риска в объеме позиции

Эмитент	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эмитента в стоимости порт...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные п...	Риск позиции по МД ...
РСХБ	9 510 164,70	0,28%	-14,14%	-1 344 382,02	-1 222 239,94	-122 142,08
МТС	72 216 494,64	2,15%	-4,85%	-3 505 755,71	-369 853,56	-3 135 902,15
АЛРОСА	308 081 030,12	9,18%	-3,84%	-11 821 893,74	-1 201 141,04	-10 620 752,70
Россети	244 334 973,85	7,28%	-3,50%	-8 554 627,14	-773 569,88	-8 167 842,20
РЖД	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Ростелеком	48 359 001,24	1,44%	-3,40%	-1 643 327,44	-426 277,44	-1 217 050,00
Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портф...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89

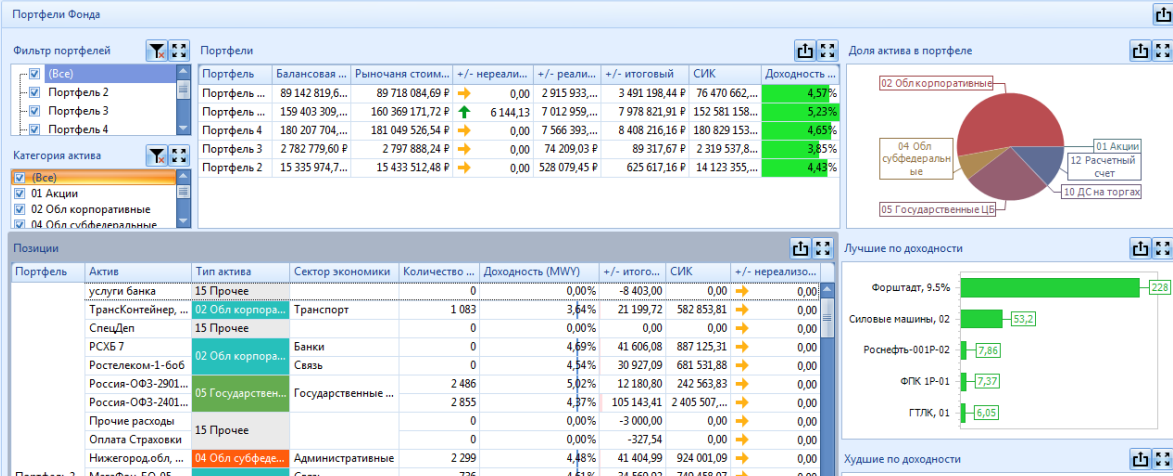
Доля кредитного и рыночного риска в дюрации

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости портф...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88

Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15

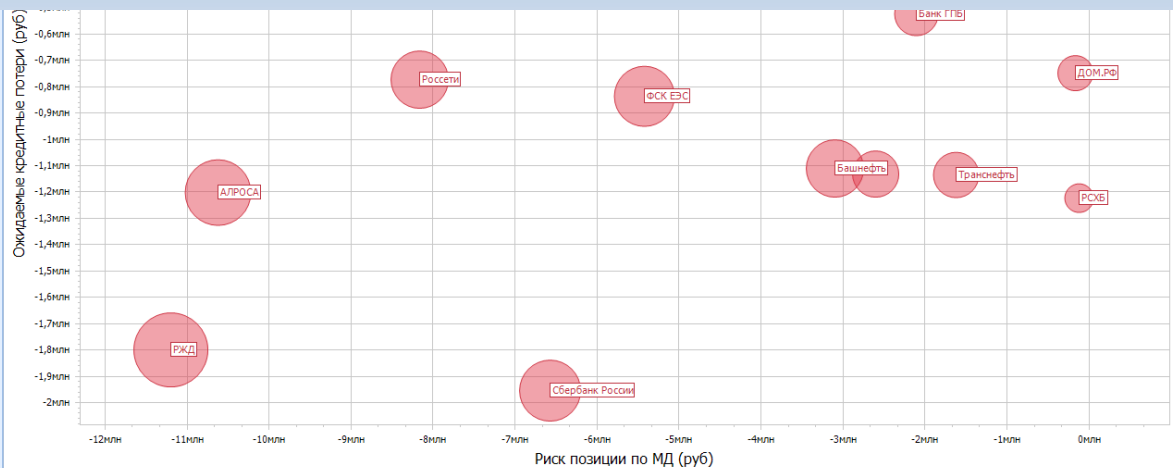
Монитор портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



GAMA Terminal



Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портф...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89

Доля кредитного и рыночного риска в дюрациях

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости портфеля	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88

Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15