

cloudfactory

Екатерина Фойт

Коммерческий директор ООО «Клаудфэктори»

Портфельная аналитика и расчет риска

Санкт-Петербург, 2025



Cloudfactory – кто мы?

cloudfactory

На рынке
с 2016 года
Большой опыт
работы

2016

Входит
в реестр ПО
Запись №18306
от 12.07.2023

№18306

30+
клиентов
Ведущие
компании
на рынке

30

58 готовых
опций
Конструктор
приложений

58

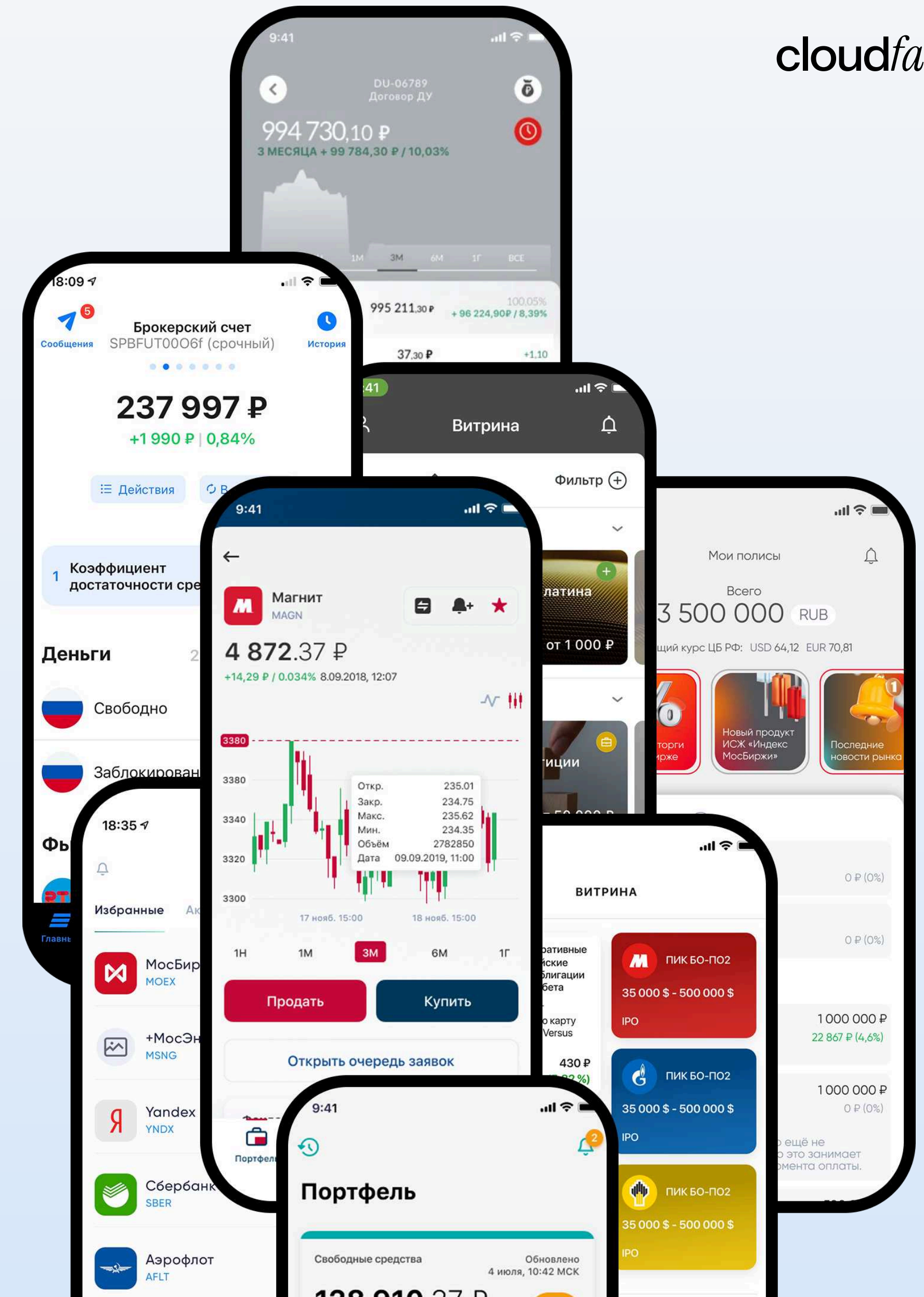
С 2021
года
Участник
Сколково

2021

Полная
кастомизация
Решение с вашим
фирменным
стилем

∞

ПО соответствует оценочному уровню доверия не ниже ОУД4,
а также ГОСТ Р 57580.1-2017 и ГОСТ Р 56939-2016



Что такое Effective Trade Position Keeping?

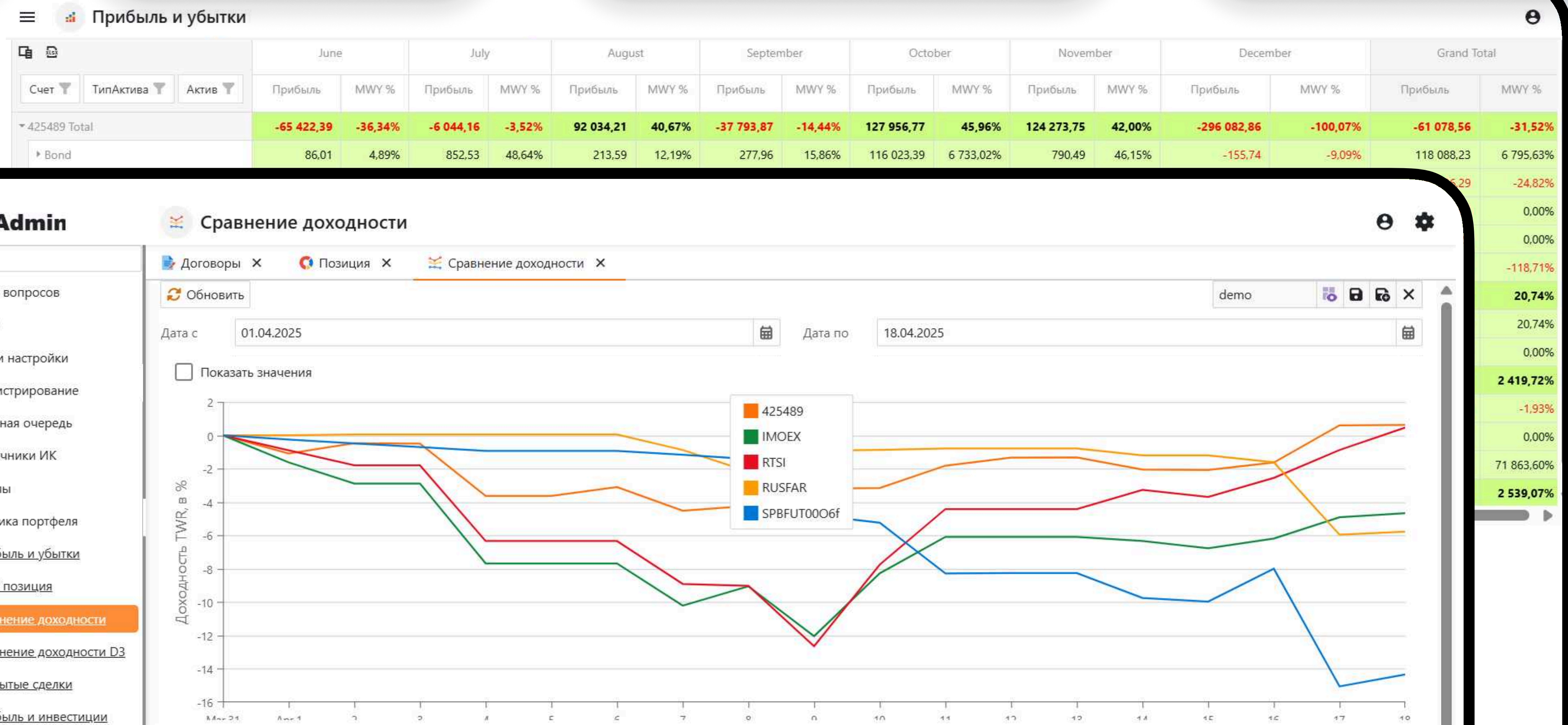
cloudfactory

Все сделки

Финансовые инструменты

Расчет финансовых показателей

Любой период и дата онлайн



Архитектура решения

cloudfactory

Поставщики финансовой информации

QUIK

Счета, котировки, портфели

RuData / CBonds

Купоны, дивиденды и т.д.

Back-Office

Неторговые операции: комиссии,
переводы, выводы, пополнения.
Внебиржевые сделки.

Position Keeping

PDF-файл

Приложение

Веб-кабинет

Дашбоард

Варианты использования

cloudfactory

ПАРАМЕТРЫ ПОРТФЕЛЯ ЗА ОТЧЕТНЫЙ ПЕРИОД

СТОИМОСТЬ	САЛДО ВВОДОВ / ВЫВОДОВ ²	ПРИБЫЛЬ ³
219 563,69	38 000,00	+1 097,51 0,55 %

ДОХОДНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ЗА ОТЧЕТНЫЙ ПЕРИОД¹

Период	Доходность	Доходность годовых
Месяц	1,0 %	11,3 %
3 месяца	6,6 %	26,4 %
С начала года	6,6 %	26,4 %
С начала инвестирования	25,5 %	30,5 %

ДОХОДНОСТЬ В РАЗРЕЗЕ ВАЛЮТ¹

Валюта	Доходность	Доходность годовых
RUB	0,3 %	4,5 %
USD	-	-
CNY	0,3 %	5,1 %

Позиция

Валюта: RUR | Клиенты: demo_client | Счета: demo_account

Актив	Вход. ост.	Цена. нач.	Вход. ст-ть	Тек. ост.	Ц. приобр.	Ст-ть приобр.	Рын. цена	Изм. %	Рын. ст-ть
			18 949 428,03			20 410 293,66			18 885 114,16
			11 459 689,49			12 346 955,12			11 395 375,62
	20 000,00	105,9995	2 403 150,00	20 000,00	132,0000	2 367 771,12	105,9995	0,00%	2 403 913,17

График доходности (% год)

Показать период: Сегодня

01.02.2019 22,50

Наименование	Доля	Количество	Стоимость	Цена	Тек. стоимость	Изменение
Фондовый рынок	60%		12 905 840,04 Р	12 905 840,04 Р	12 905 840,04 Р	↑ 657 060,335 (6%)
Акции	40%		12 905 840,04 Р	12 905 840,04 Р	12 905 840,04 Р	↑ 657 060,335 (6%)

Брокерский счет - 4211ACU

9:30

₽ 68 974,05

+165,35 (0,02 %) за сегодня

Пополнить | Вывести

Акции 39% 13 107,55 Р

- Сбербанк SBER** 3 956,60 Р (+5,00 (0,42 %))
Кол-во: 20 | Покупка: 192,83 Р | Рынок: 197,83 Р
- Газпром GAZP** 2 732,40 Р (+4,16 (1,82 %))
Кол-во: 30 | Покупка: 87,89 Р | Рынок: 91,08 Р
- Лукойл LUKOIL** 2 421,60 Р (-7,60 (1,82 %))
Кол-во: 20 | Покупка: 128,89 Р | Рынок: 121,08 Р

Показать все

Справочники данных

cloudfactory

Эмитенты

Секторы

Рейтинги

Внешние ссылки

Тарифы

Торговые счета

Торговые сессии

Торговые сессии инструментов

Выходные дни

Фондовые индикаторы

Конечные базовые активы опционов

Размещения 2.0

Уровень ликвидности облигаций

Отчет по модельным портфелям

Инвестиционные профили клиентов

История рекомендаций ИК

Сводный отчет по инвестрекомендациям

Тарифы по инструменту

Модельные портфели

Оценки пользователей

Идентификатор	Наименование	Код	Тип	Страна	Сектор
264	АФК Система	AFKS	Corp	Россия	Связь
265	Аэрофлот	AFLT	Corp	Россия	Транспорт
270	Акрон	AKRN	Corp	Россия	Химия
271	АК Транснефть	RU000A0JWK90	Corp	Россия	Нефть и газ
277	АК АЛРОСА	ALRS	Corp	Россия	Горное дело

Admin

Счета

Фильтр...

Общие справочники

Договоры

Счета

Торговые площадки

Режим торгов

Инструменты (main)

Купонное расписание

Котировки

Эмитенты

Секторы

Рейтинги

Внешние ссылки

Тарифы

Торговые счета

Контроль

Название: 41444/41444

Внешнее название: 41444/41444

Клиент: 41444

Метод: FIFO

Брокер: MC0003300000

Валюта: RUR

Тип цены: MidRate

Тип цены внутри дня: default_value

Стратегия:

Метод

FIFO

FIFO

LIFO

WA

Валюта

Инструменты, типы сделок, операции

cloudfactory

The screenshot shows a web application interface for managing financial instruments. The main title is "Инструменты". Below it, there are tabs for "Сравнение доходности" and "Инструменты". The "Инструменты" tab is active, showing a table of instruments. The table has columns for "Название", "Тип...", "Подти...", "Т...", "Полное название", "Лот", and "Вал.". The "Тип..." column is set to "Equity".

Overlaid on the screenshot are several callout boxes with blue text:

- РЕПО
- Equity
- Future
- Bond
- Option
- Index
- FX
- Money
- Precious Metal
- Ввод средств
- Вывод средств
- Купоны
- Дивиденды

<input type="checkbox"/>	Название	Тип ...	Подти...	Т... ↓	Полное название	Лот	Вал.
<input type="checkbox"/>	ЗВЕЗДА ао	Equity	Equity	ZVEZ	ЗВЕЗДА ПАО ао	100	RUR
<input type="checkbox"/>	ЗМЗ-ап	Equity	Equity	ZMZNP			
<input type="checkbox"/>	ЗМЗ-ао	Equity	Equity	ZMZN			
<input type="checkbox"/>	ЗИЛ ао	Equity	Equity	ZILL	Завод им. И.А.Лихачева ПАО ао		RUR
<input type="checkbox"/>	Займер ао	Equity	Equity	ZAYM	Займер ао	10	RUR
<input type="checkbox"/>	YUAN ETF	Equity	ETF	YUAN	БПИФ Облигации в юанях	1	RUR
<input type="checkbox"/>	ТНСэняр-п	Equity	Equity	YRSBP	ТНС энерго Ярославль ПАО ап	10	RUR
<input type="checkbox"/>	ТНСэняр	Equity	Equity	YRSB	ТНС энерго Ярославль ПАО ао	10	RUR
<input type="checkbox"/>	Yandex clA	Equity	Equity	YNDX	PLLC Yandex N.V. class A shs	1	RUR
<input type="checkbox"/>	Якутскэн-п	Equity	Equity	YKENP	АК "Якутскэнерго" (ПАО) ап	10 000	RUR
<input type="checkbox"/>	Якутскэнрг	Equity	Equity	YKEN	АК "Якутскэнерго" (ПАО) ао	10 000	RUR
<input type="checkbox"/>	ЯНДЕКС	Equity	Equity	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС		
<input type="checkbox"/>	ЯТЭК ао	Equity	Equity	YAKG	Якутская топл.-энерг. комп. ао		
<input type="checkbox"/>	ЗПИФ СМЛТ	Equity	PIFBond	XHOUSE	ЗПИФ Самолет Инвестиции в недв	1	RUR
<input type="checkbox"/>	КЦ ИКС 5	Equity	Equity	X5	Корпоративный центр ИКС 5	1	RUR
<input type="checkbox"/>	iVУШХолднг	Equity	Equity	WUSH	ВУШ Холдинг ао	1	RUR
<input type="checkbox"/>	ЦМТ ап	Equity	Equity	WTCMP	"Центр междун. торговли"ПАО ап	100	RUR
<input type="checkbox"/>	ЦМТ ао	Equity	Equity	WTCM	"Центр междун. торговли"ПАО ао	100	RUR
<input type="checkbox"/>	Возрожд-п	Equity	Equity	VZRZP	Банк "Возрождение" - ап	10	RUR

Отчет позиция

cloudfactory

☰
Позиция

Обновить

Валюта

Клиенты

Счета

		Вход. ост.	Цена. нач.	Вход. ст-ть	Тек. ост.	Ц. приобр.	Ст-ть приобр.	Рын. цена	Изм %	Рын. ст-ть	Доля %	Дн. прибыль	Переоценка	Комиссия
demo_account Total				18 949 428,03			20 410 293,66			18 885 114,16	100,00%	-64 313,87	-1 525 179,50	0,00
Bond Total				11 459 689,49			12 346 955,12			11 395 375,62	60,34%	-64 313,87	-951 579,50	0,00
RUS-28														
Автодор5P3														
ВТБ Б1-346														
ОФЗ 26241														
Полюс Б1P2														
Equity														
Money														

☰
Открытые сделки

Обновить

Валюта

Клиенты

Счета

		Дата сделки	Дата поставки	Кол-во	Цена сд.	Цена сд. с ком.	Ст-ть приобр.	Рын. цена	Рын. ст-ть	Переоценка	Переоценка с ком.	Изм %	Доля
ОФЗ 26241 Total				3 200 000,00	87,1250	87,1250	2 788 000,00		2 188 928,00	-599 072,00	-599 072,00		
1		03.01.2024	03.01.2024	2 100 000,00	88,0000	88,0000	1 848 000,00	68,3000	1 436 484,00	-411 516,00	-411 516,00	-22,27%	-24
2		20.01.2024	20.01.2024	500 000,00	86,0000	86,0000	430 000,00	68,3000	342 020,00	-87 980,00	-87 980,00	-20,46%	-23
3		06.02.2024	06.02.2024	600 000,00	85,0000	85,0000	510 000,00	68,3000	410 424,00	-99 576,00	-99 576,00	-19,52%	-23
Полюс Б1P2 Total				100 000,00	96,0000	96,0000	96 000,00		78 999,65	-17 000,35	-77 649,55		
1		03.01.2024	03.01.2024	100 000,00	96,0000	96,0000	96 000,00	78,0002	78 999,65	-17 000,35	-77 649,55	-17,71%	-1

Отчет прибыль и убытки

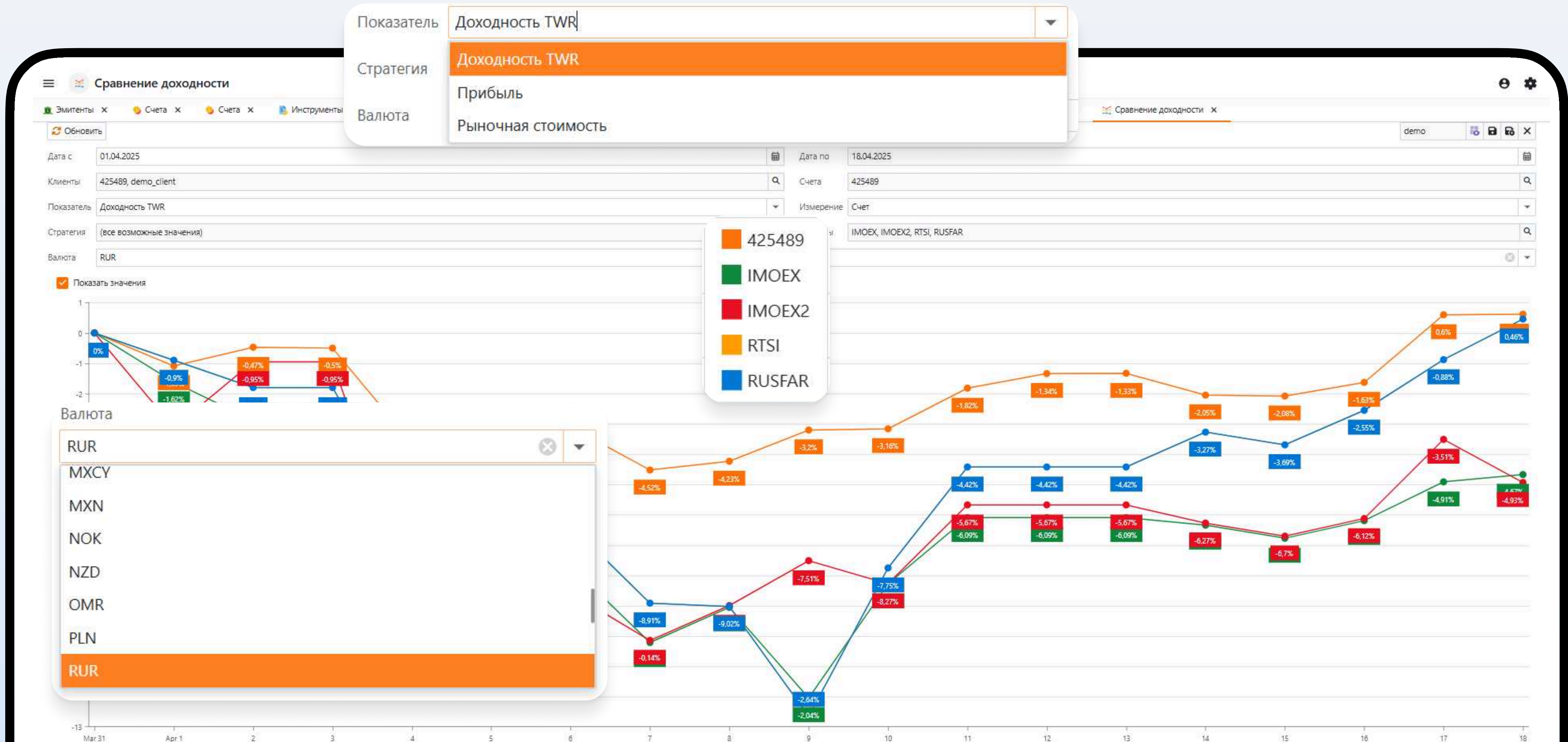
cloudfactory

Счет	Тип Актива	Актив	June		July		August		September		October		November		December		Grand Total	
			Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %	Прибыль	MWY %
425489 Total			-65 422,39	-36,34%	-6 044,16	-3,52%	92 034,21	40,67%	-37 793,87	-14,44%	127 956,77	45,96%	124 273,75	42,00%	-296 082,86	-100,07%	-61 078,56	-31,52%
Bond			86,01	4,89%	852,53	48,64%	213,59	12,19%	277,96	15,86%	116 023,39	6 733,02%	790,49	46,15%	-155,74	-9,09%	118 088,23	6 795,63%
Equity			-17 518,80	-9,64%	-7 249,61	-4,26%	54 157,76	38,48%	-54 450,50	-38,69%	56 516,74	36,43%	21 888,28	12,68%	-80 880,17	-46,86%	-27 536,29	-24,82%
FX			-50,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-50,00	0,00%
Money			-47 939,60	0,00%	352,92	0,00%	59 565,84	0,00%	17 852,65	0,00%	47 641,34	0,00%	117 936,81	0,00%	-204 840,19	0,00%	-9 430,22	0,00%
Option																		
425489(Внебирж.) Total			-325,00	-2,05%														
Equity			-325,00	-2,05%														
Money			0,00	0,00%														
SPBFUT0006f Total			-101 512,43	-2,34%														
Future			-161 331,98	-3,61%														
Money			0,00	0,00%														
Option			59 819,55	45,71%														

Счет	Тип Актива	Месяц	Актив	Grand Total							
				Об. продаж	Прибыль	TWR %	MWY %	Инвестиции	Инвест. приб.	Комиссия	Купон. приб.
425489 Total				203 612,24	-43 852,34	-0,35%	-22,37%	-202 572,78	-4 370,72	3 481,75	7 835,65
Bond Total				0,00	116 658,14	-3 837,68%	6 982,65%	-1 667,24	111 949,62	0,00	4 708,52
October				0,00	116 023,39	-6 729,68%	6 916,57%	-1 667,24	112 048,49	0,00	3 974,90
November				0,00	790,49	-48,62%	47,41%	-1 667,24	6,19	0,00	784,30

Прибыль и инвестиции																	
Клиент	Счет	Grand Total															
		Прибыль	Доход %	Доход год. %	Комиссия	Рын. ст-ть	Инвестиции	Зачислено	Списано	Взвеш. инвест.	Рын. ст-ть нач.	Дл. поз.	Дл.поз. %	Кор. поз.	Кор.поз. %	Об. покупок	Об продаж
425489 Total		14 932,29	0,38%	137,76%	0,00	16 052 155,8803	14 429 853,10	0,00	0,00	16 037 223,59	16 037 223,59	5 818 280,19	232,31%	825 679,14	3,27%	15 911,50	650,00
425489		7 470,79	0,06%	21,34%	0,00	12 784 095,6503	14 819 840,10	0,00	0,00	12 776 624,86	12 776 624,86	1 208 280,19	9,45%	744 469,14	5,82%	0,00	0,00
425489(Внебирж.)		0,00	0,00%	0,00%	0,00	1 283 640,0000	0,00	0,00	0,00	1 283 640,00	1 283 640,00	0,00	0,00%	16 360,00	1,27%	0,00	0,00
SPBFUT0006f		7 461,50	0,38%	137,76%	0,00	1 984 420,2300	-389 987,00	0,00	0,00	1 976 958,73	1 976 958,73	4 610 000,00	232,31%	64 850,00	3,27%	15 911,50	650,00

Сравнение доходности



Расчет рисков

cloudfactory

Волатильность

Parametric VaR

Индекс Шарпа

Дюрация год

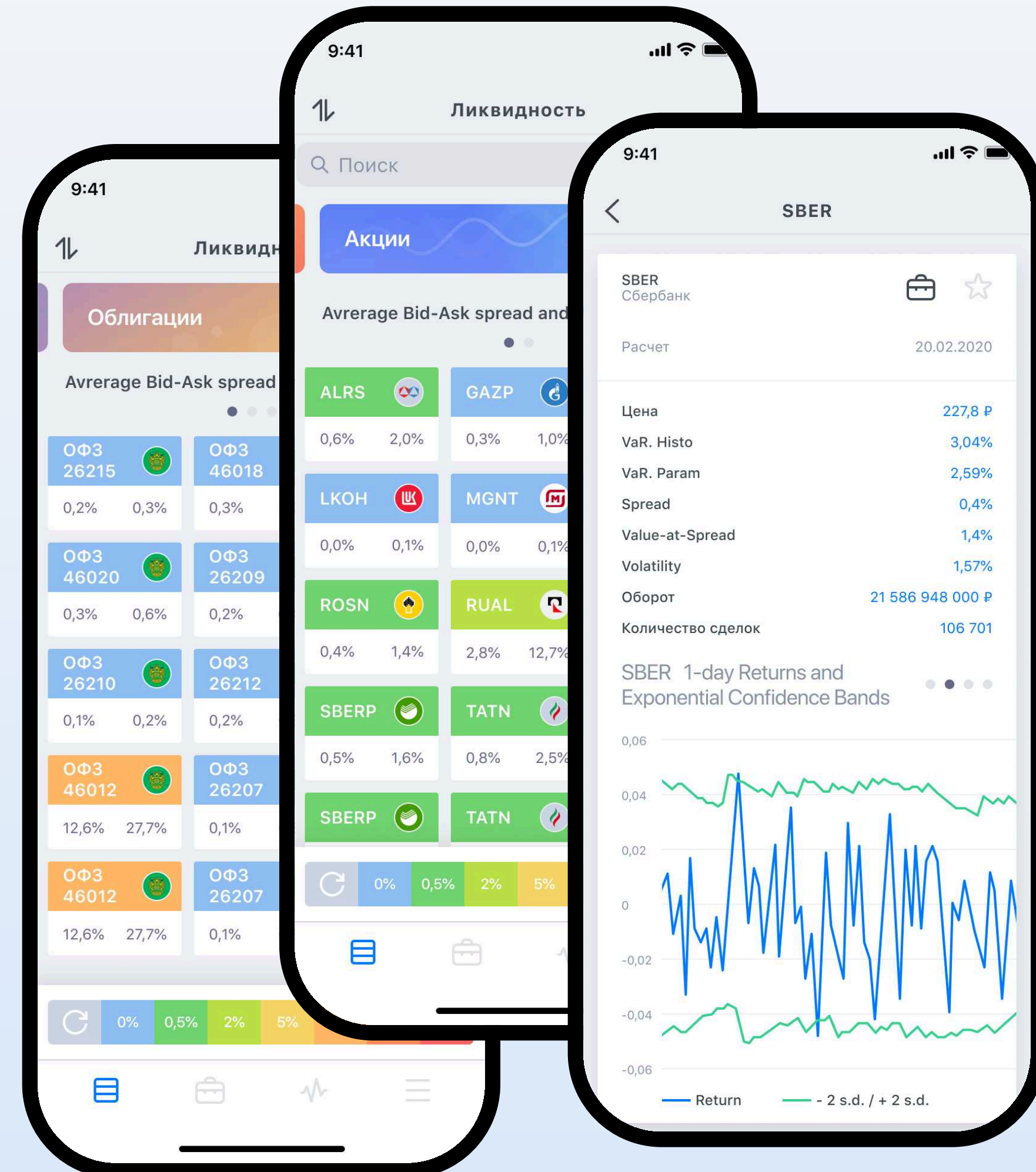
Parametric exponential VaR

Historical VaR

CFM VaR,

Доходность к погашению %

Волатильность CFM



Спасибо за внимание!



Екатерина Фойт

Коммерческий директор

Мобильный: 8 (927) 656-43-94

efoyt@cloudfactory.ru

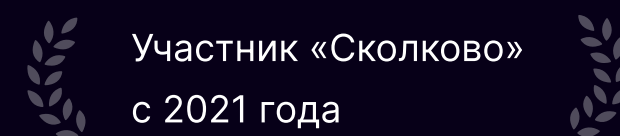
8 (800) 201-04-40

107564, г. Москва,

Краснобогатырская улица, д. 6, стр. 2

info@cloudfactory.ru

Аккредитованная IT-компания
Аккредитация №6130 Минцифры РФ



Участник «Сколково»
с 2021 года

cloudfactory.ru

