



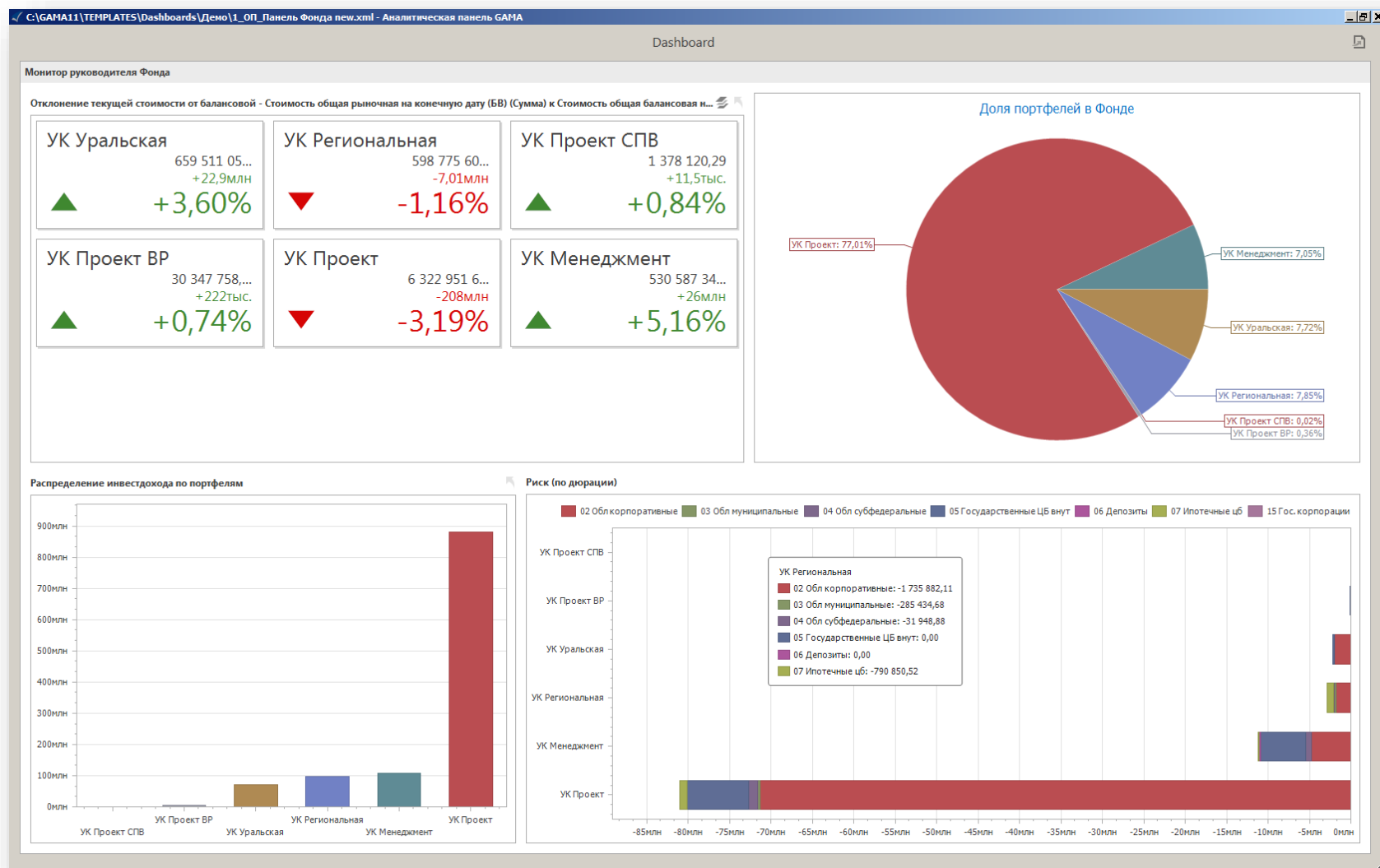
ПРИМЕРЫ АНАЛИТИЧЕСКИХ ОТЧЕТОВ В УПРАВЛЕНИИ АКТИВАМИ И РИСКАМИ

Концентрируйте внимание на анализе данных, а не их сборе

Данный документ демонстрирует возможности конструктора аналитических отчетов системы управления активами и рисками GAMA и не является полным перечнем ее возможностей

Текущее состояние портфелей

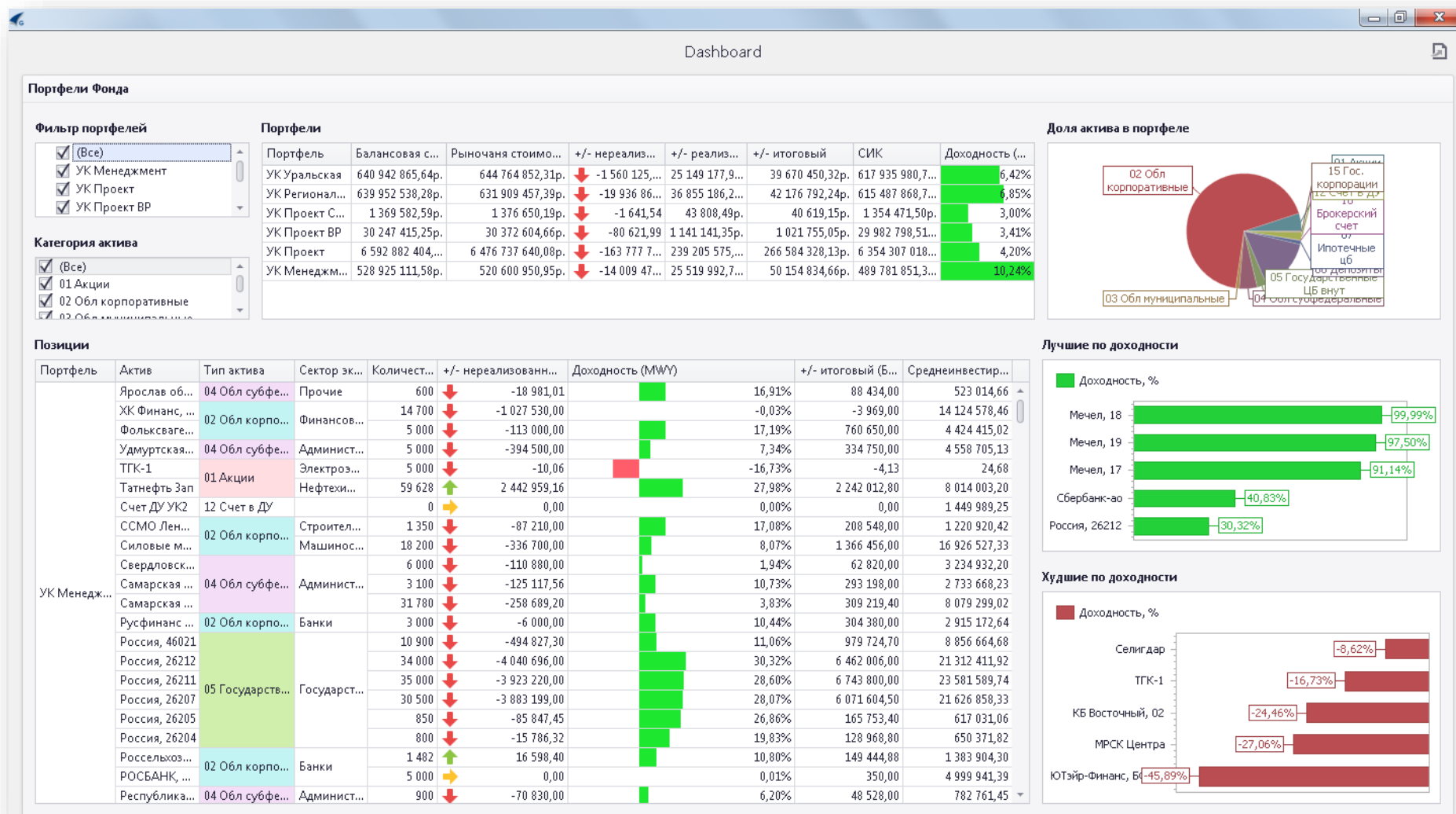
Отклонение текущей стоимости портфелей от балансовой; рыночная доля портфеля в активах; итоговая прибыль\убыток по портфелям; распределение риска (на основе модифицированной дюрации) по портфелям и по активам



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

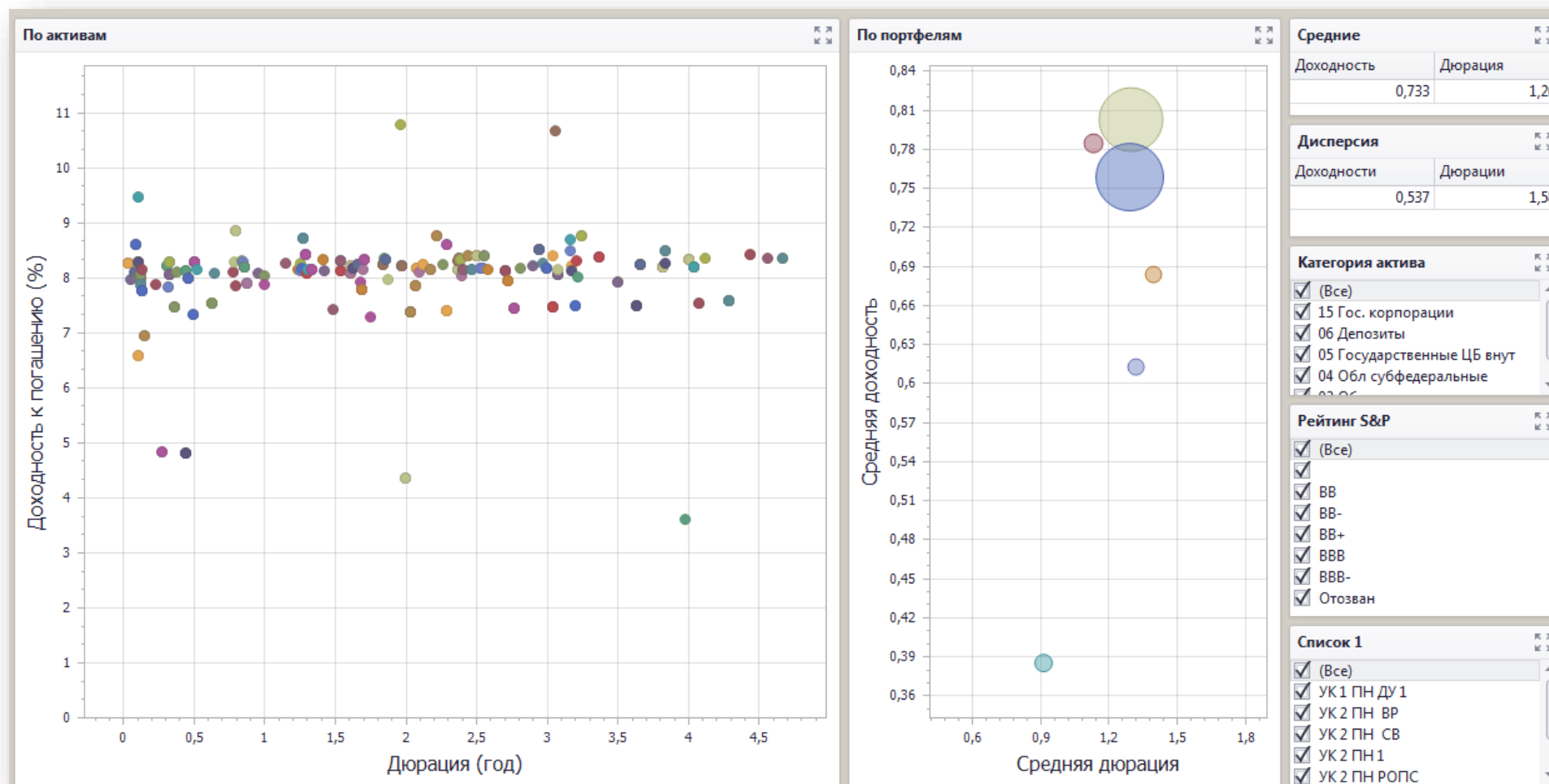
Детальная информация по текущему состоянию портфелей

Оценка эффективности управления по каждому активу, каждому портфелю, структура активов, лучшие\худшие по доходности (MWY) активы



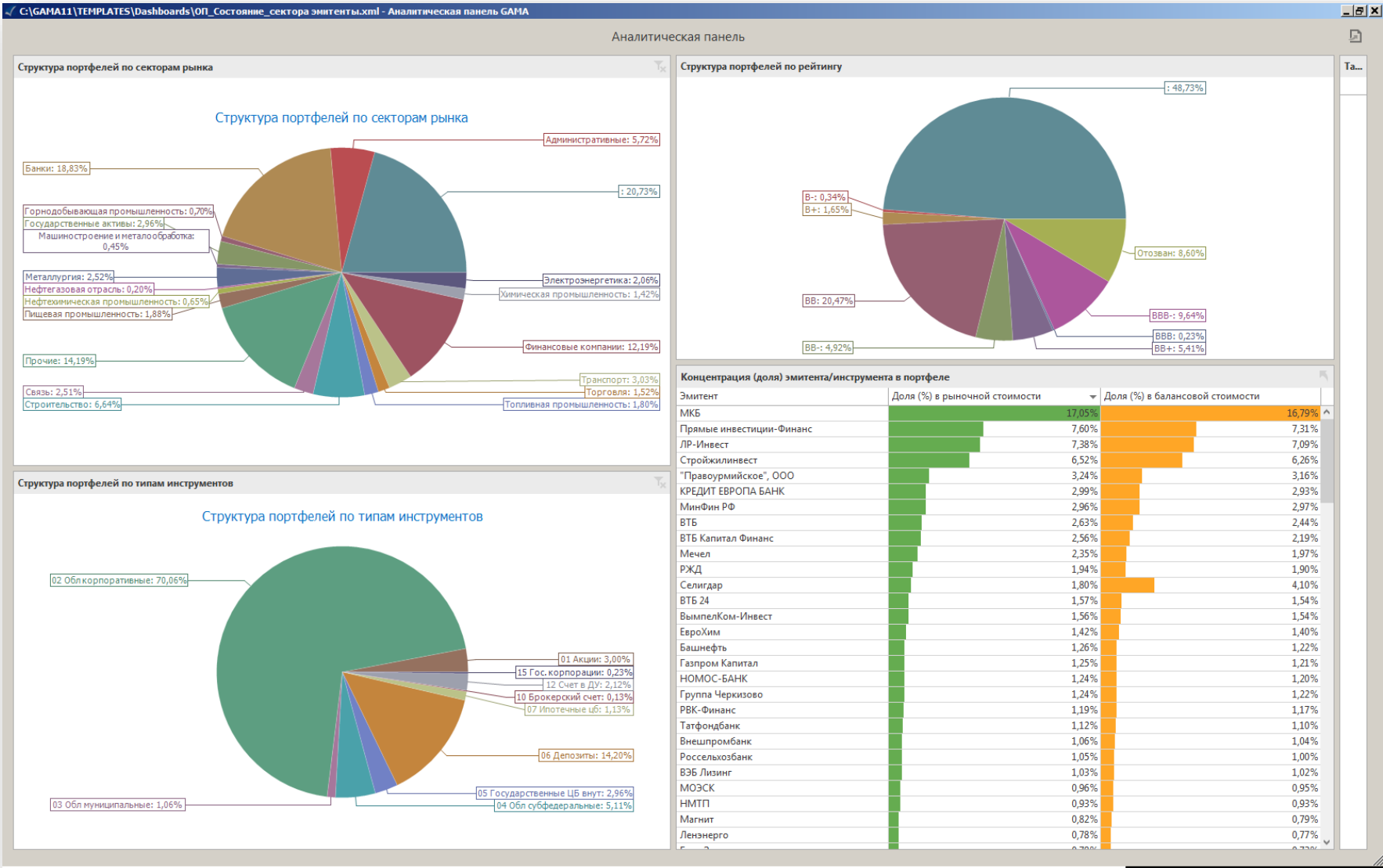
Доходность к погашению и дюрация

активов с различным кредитным рейтингом, дюрация и доходность к погашению портфелей, статистика



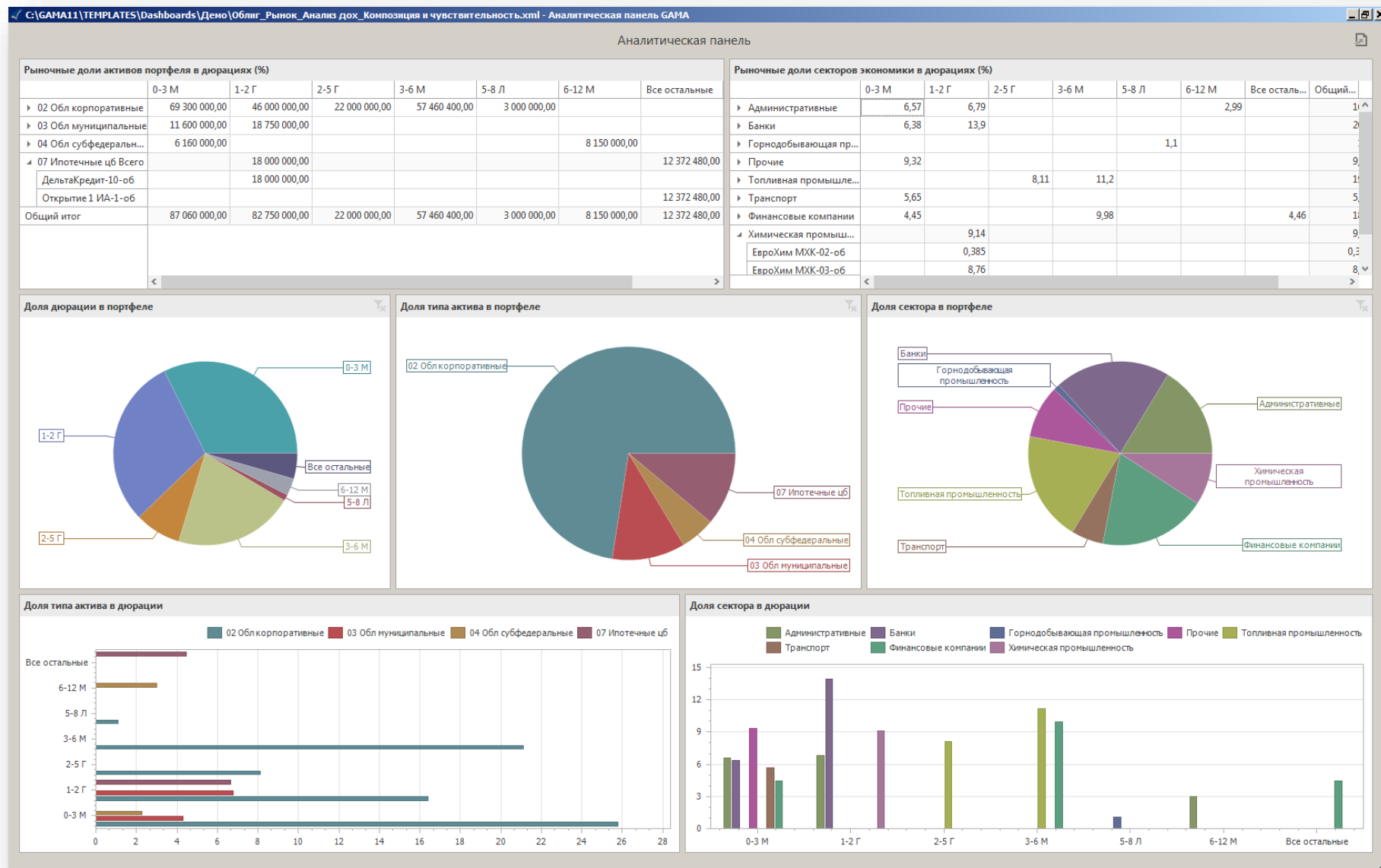
Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

Структура активов
по секторам рынка, по кредитным рейтингам, по финансовым инструментам. Концентрация активов в одном эмитенте и выпуске



Распределение активов портфелей

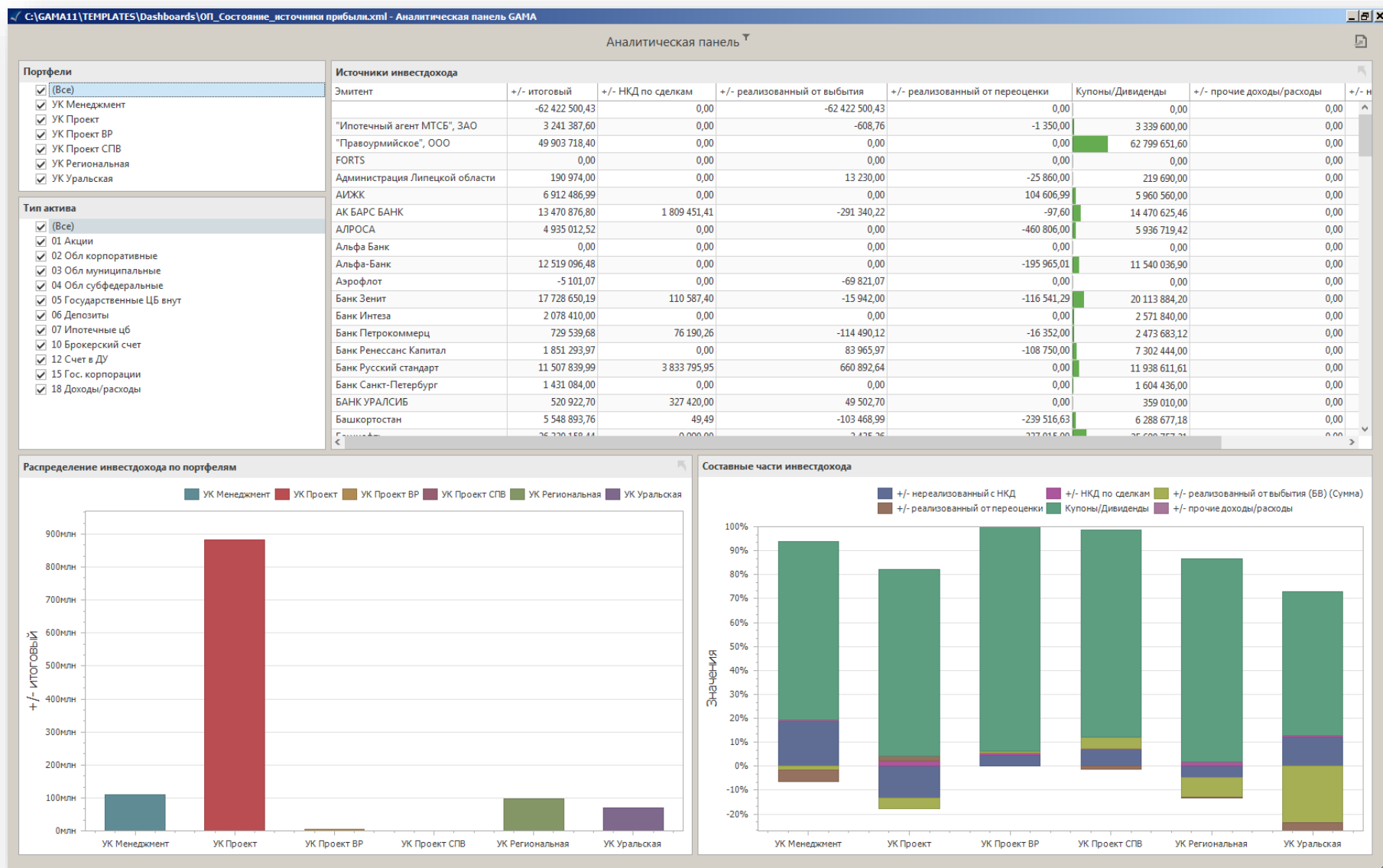
по категории дюрации, по типам инструментов, по секторам рынка



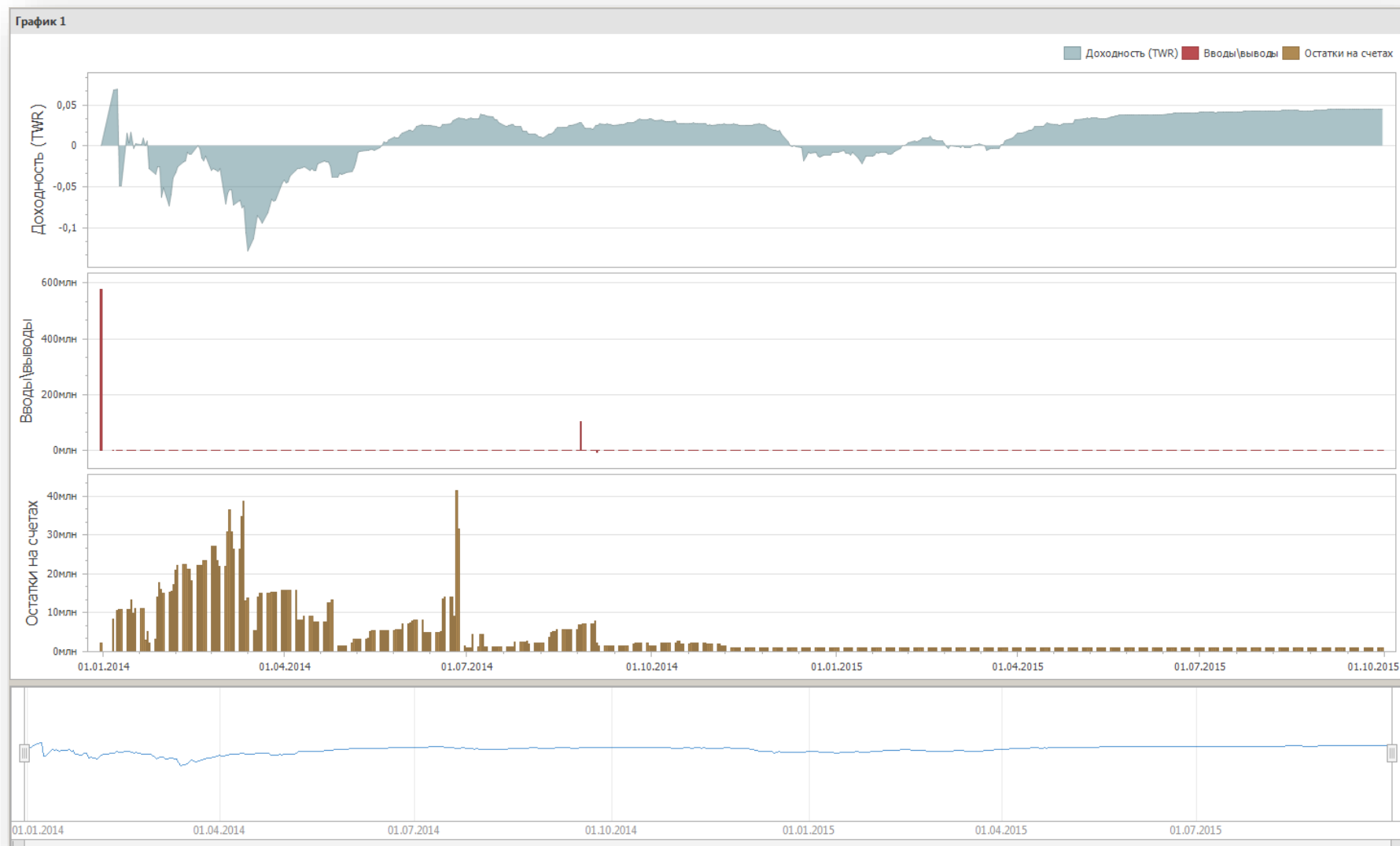
Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

Анализ источников прибыли\убытков

Что привело к полученному результату: движение рынка, сделки, бухгалтерская переоценка, выплата купонов\дивидендов\погашений и т.д.



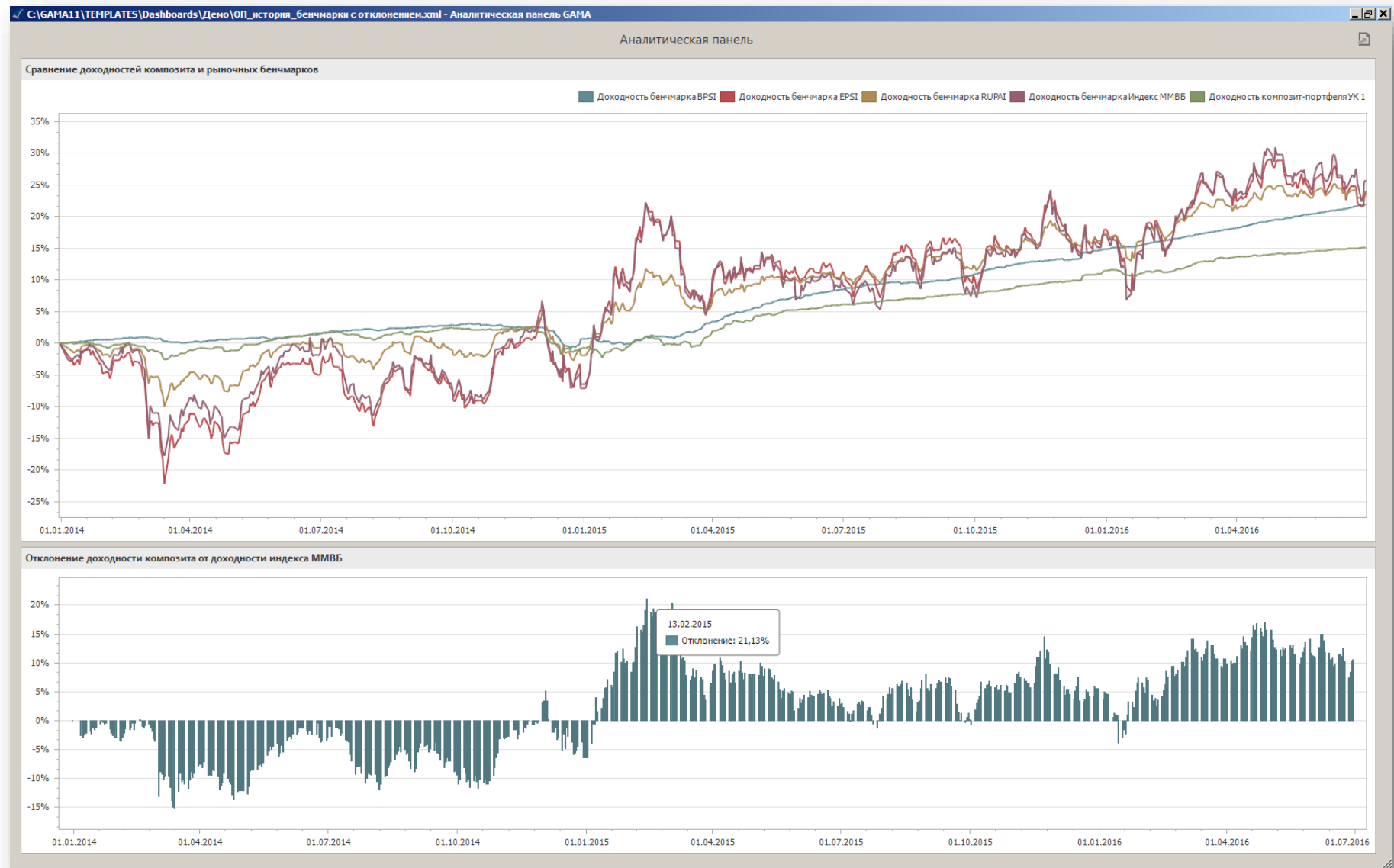
Распределение доходности (TWR), остатков на счетах, вводов\выводов во времени



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

Сравнительный анализ доходности (TWR)

рыночных индексов и доходности композит-портфеля. Статистические показатели индексов и портфелей



Кредитные риски

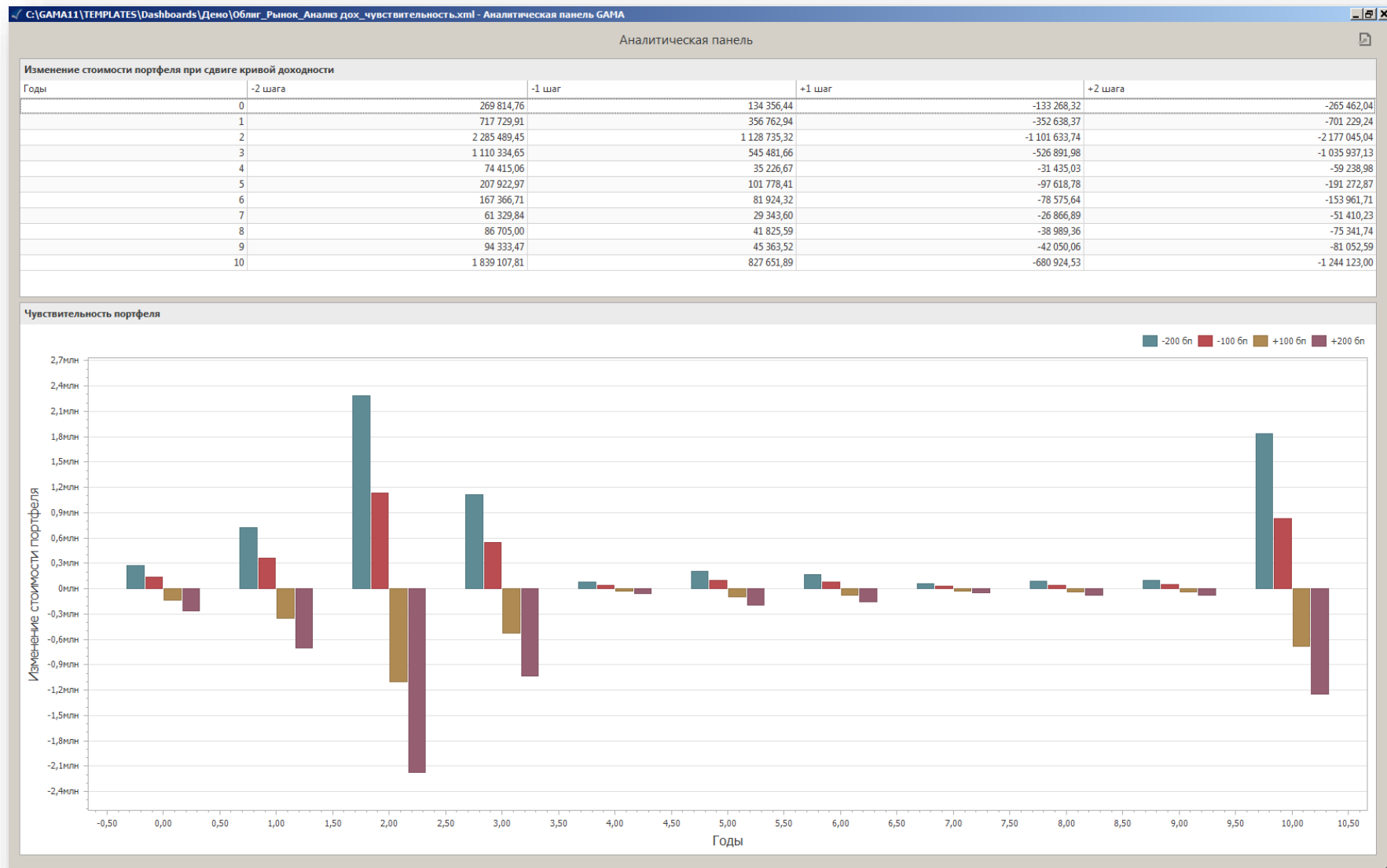
Структура активов по рейтингам, распределение процентного риска и доходности (MWY) по рейтингам



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

Чувствительность портфелей к изменению процентных ставок

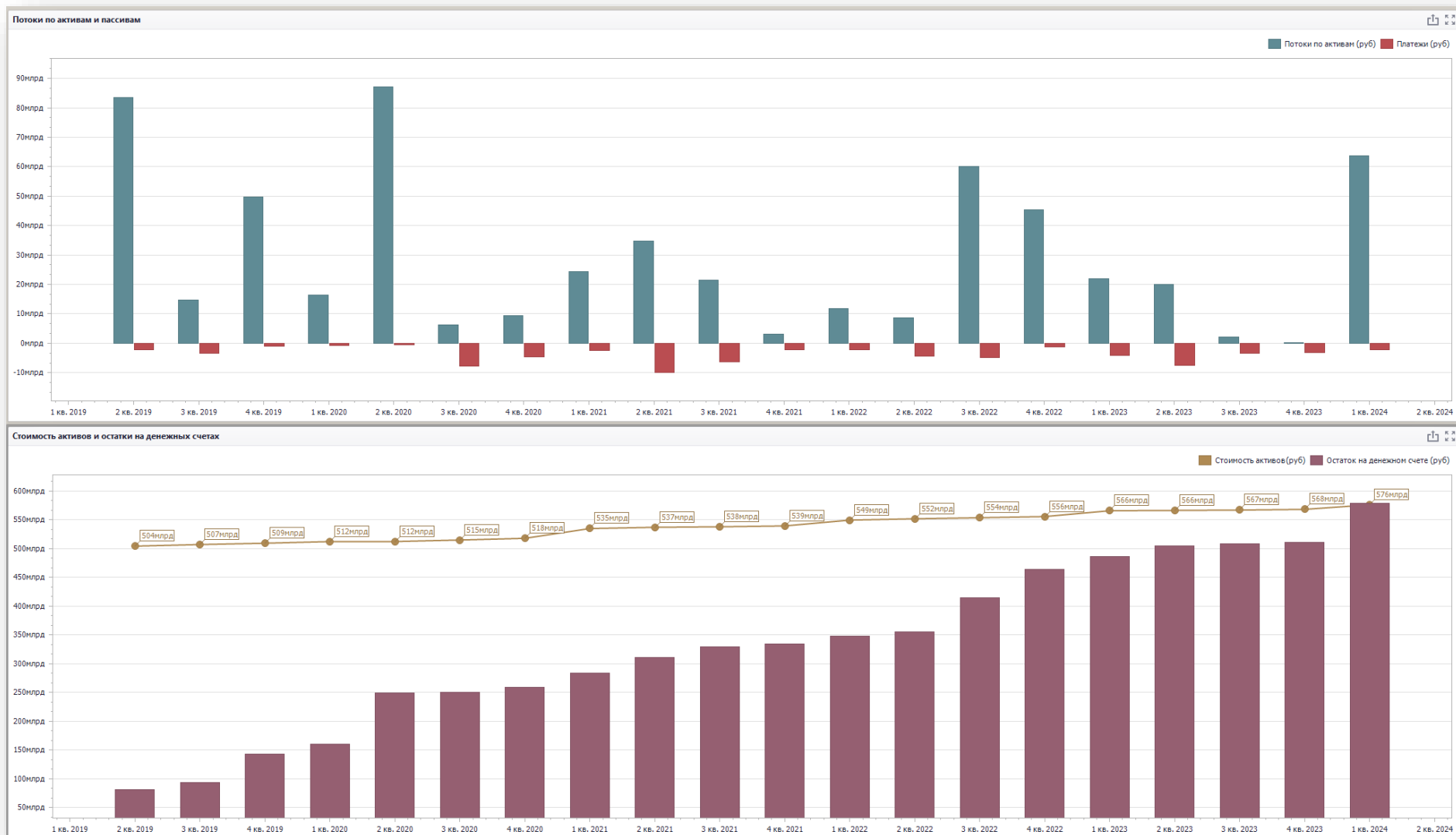
Изменение стоимости портфеля при изменении процентных ставок на рынке (сдвиг и изменение формы кривой доходности)



Стресс-тестинг НПФ по методике и сценариям ЦБ РФ

Прогнозирование баланса НПФ на основании данных по денежным потокам от активов и прогнозных платежей по обязательствам.

Определение вероятности дефолтов НПФ при заданных сценариях



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

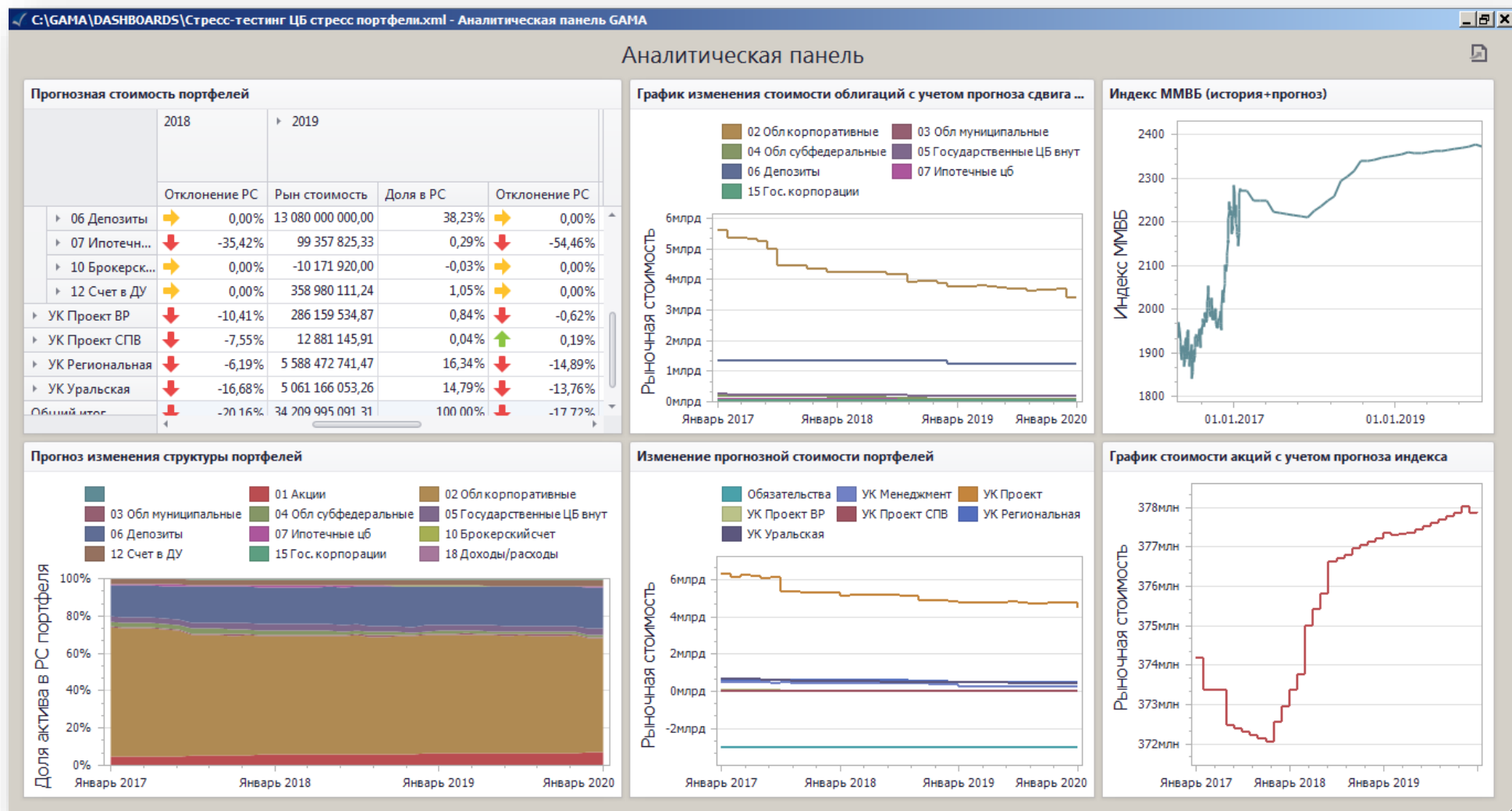
Управление активами\пассивами (ALM) страховой компании

Прогнозирование состояния пассивов, прогнозирование процентных ставок и индекса, определение вероятности дефолта страховой компании жизни при заданных параметрах управления

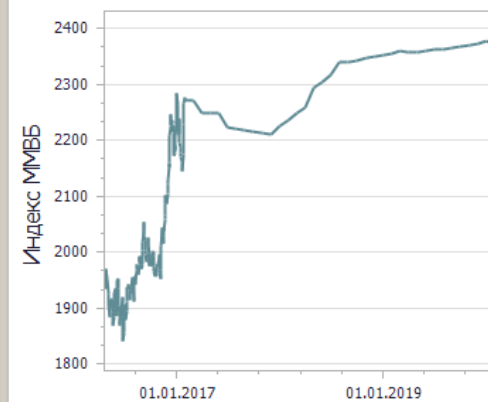


Сценарный анализ портфелей

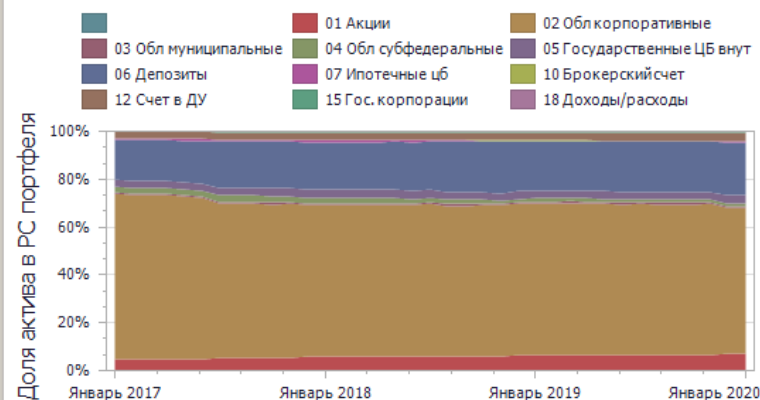
Изменение стоимости портфелей (по каждому активу) при прогнозном изменении индекса ММВБ и G-кривой на заданном горизонте.
Прогнозное изменение структуры активов



Индекс ММВБ (история+прогноз)



Прогноз изменения структуры портфелей



Изменение прогнозной стоимости портфелей

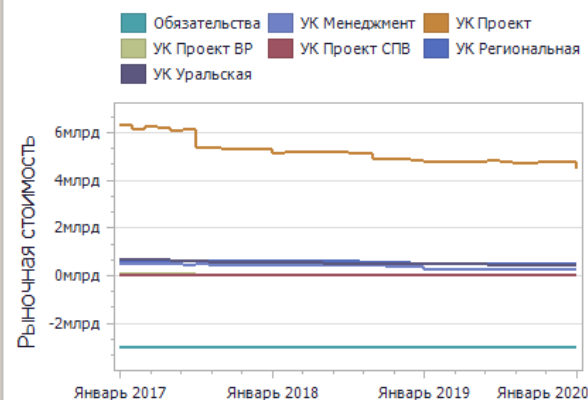
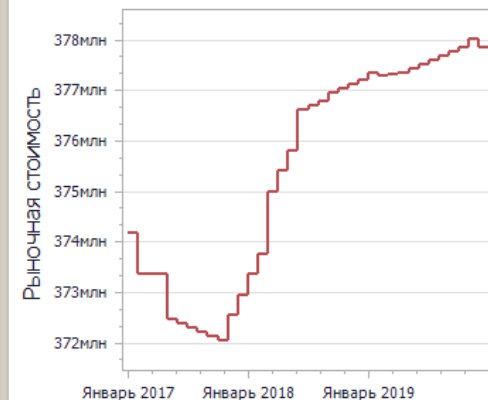
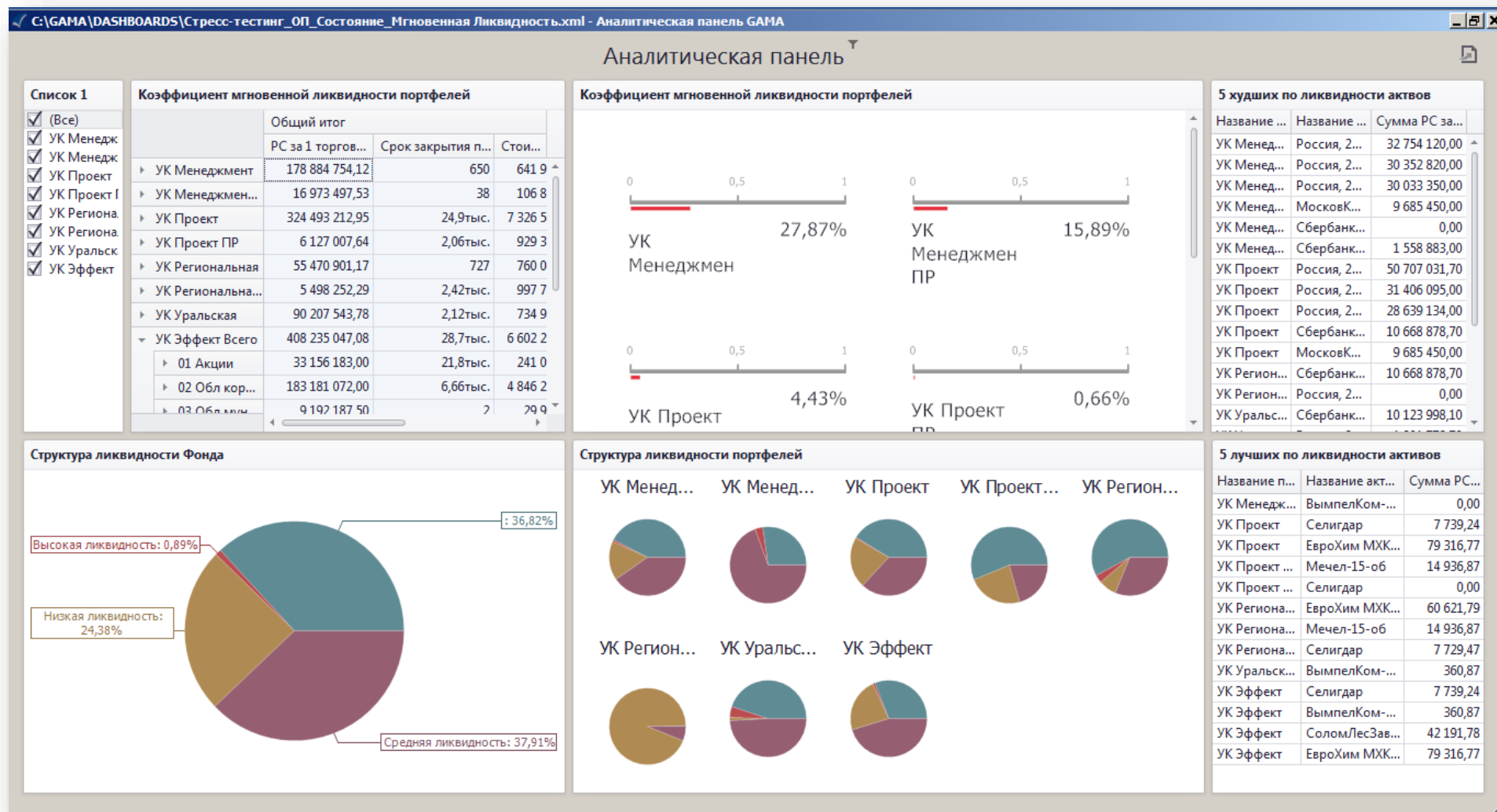


График стоимости акций с учетом прогноза индекса



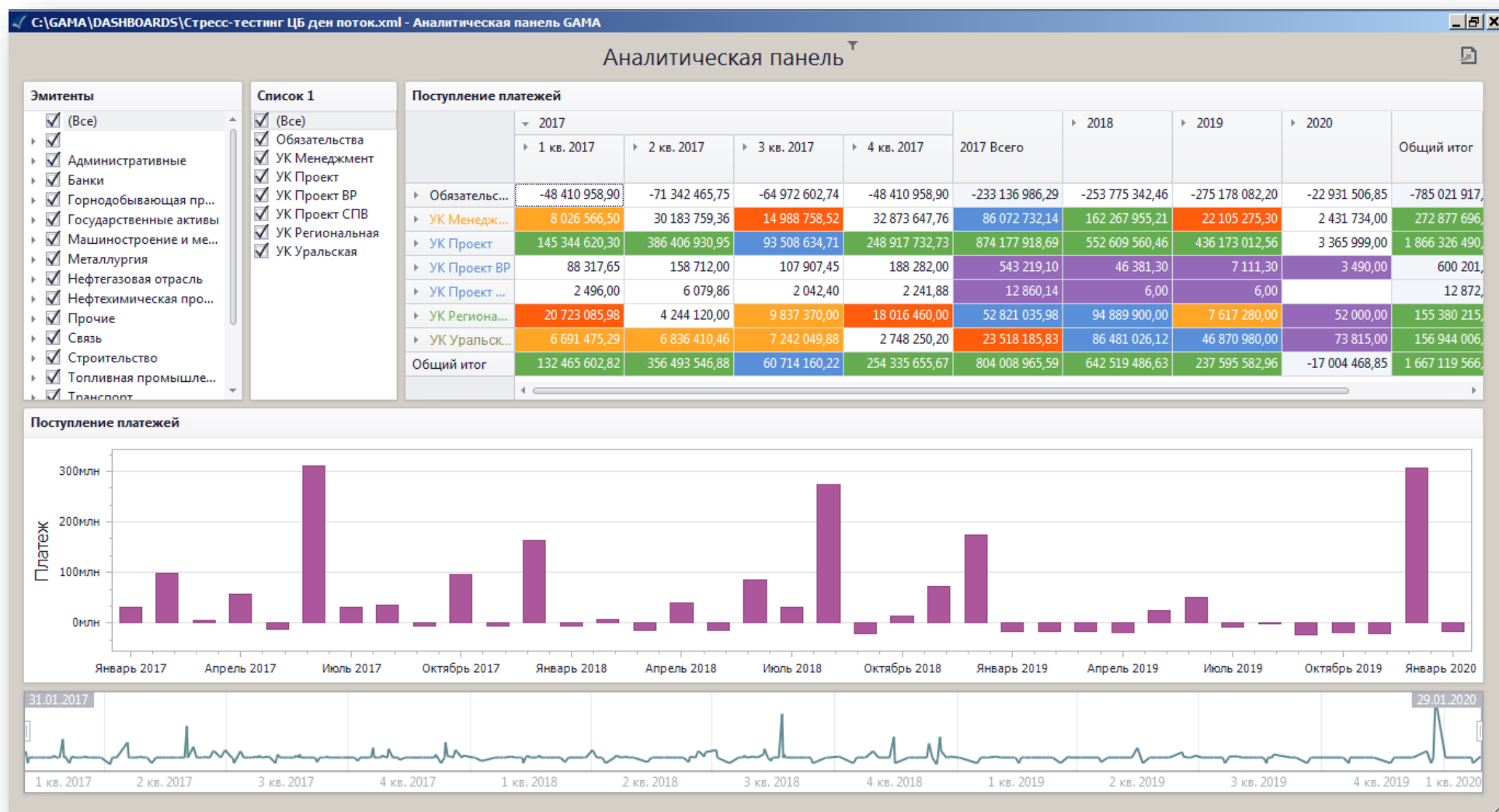
Определение ликвидности активов

срока закрытия позиции\портфеля, коэффициента мгновенной ликвидности. Структура портфелей по ликвидности



Денежный поток на заданном горизонте

Возможность моделировать изменение денежного потока при дефолте эмитентов, секторов рынка



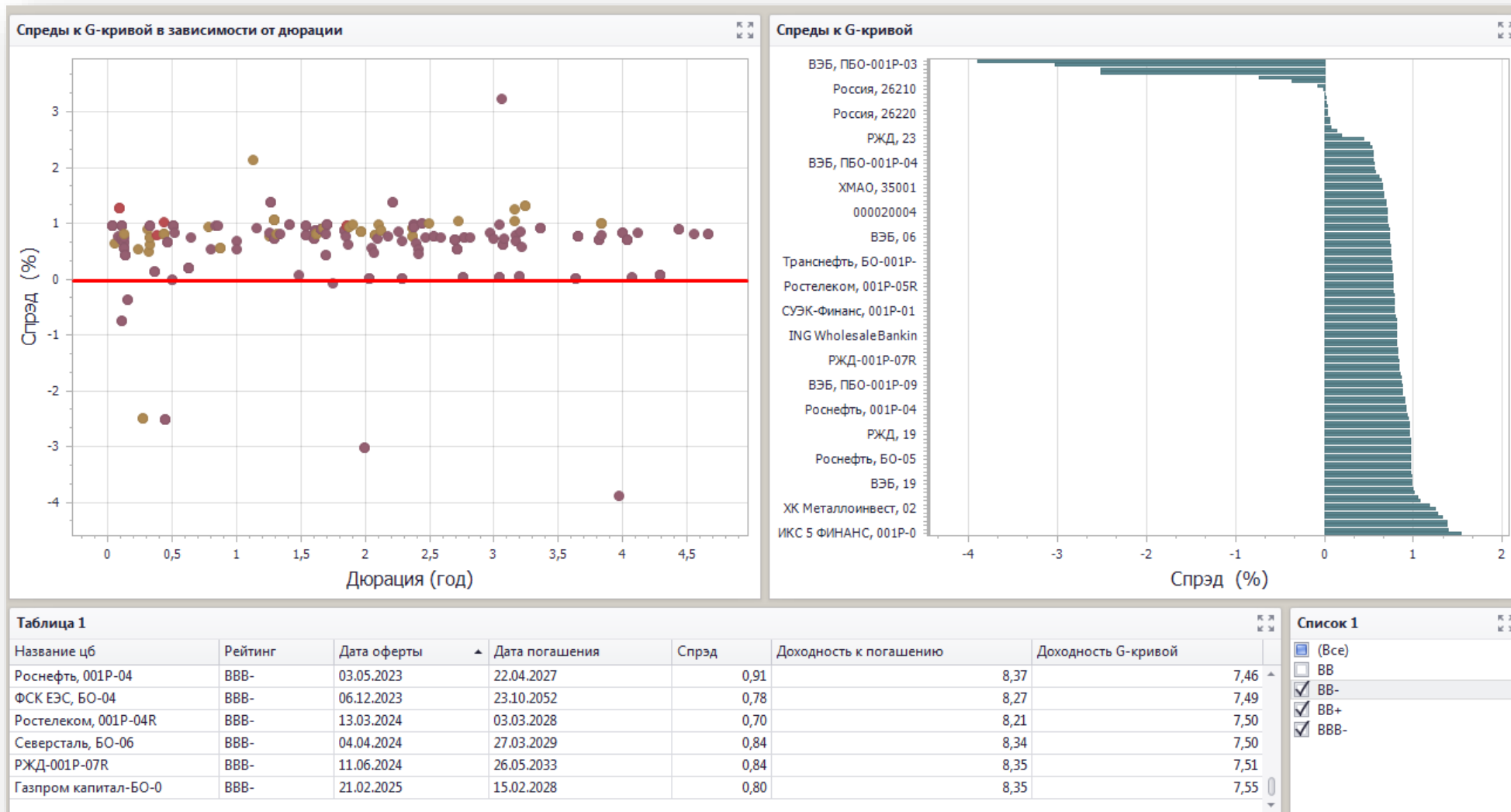
Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

и положение бумаг портфеля относительно этой кривой



Спреды бумаг в портфеле к G-кривой доходности

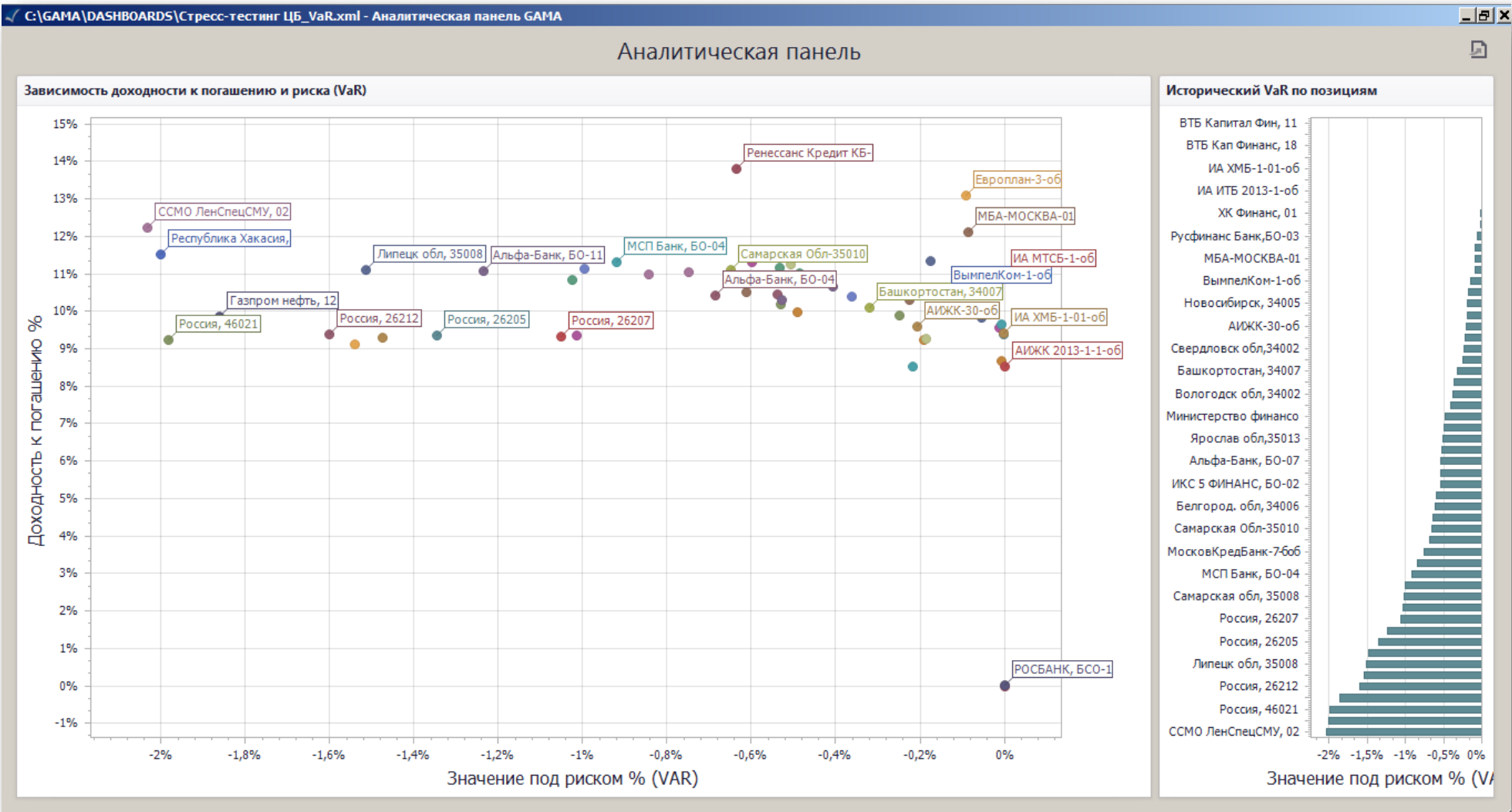
Спреды с учетом дюрации актива и без учета дюрации



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

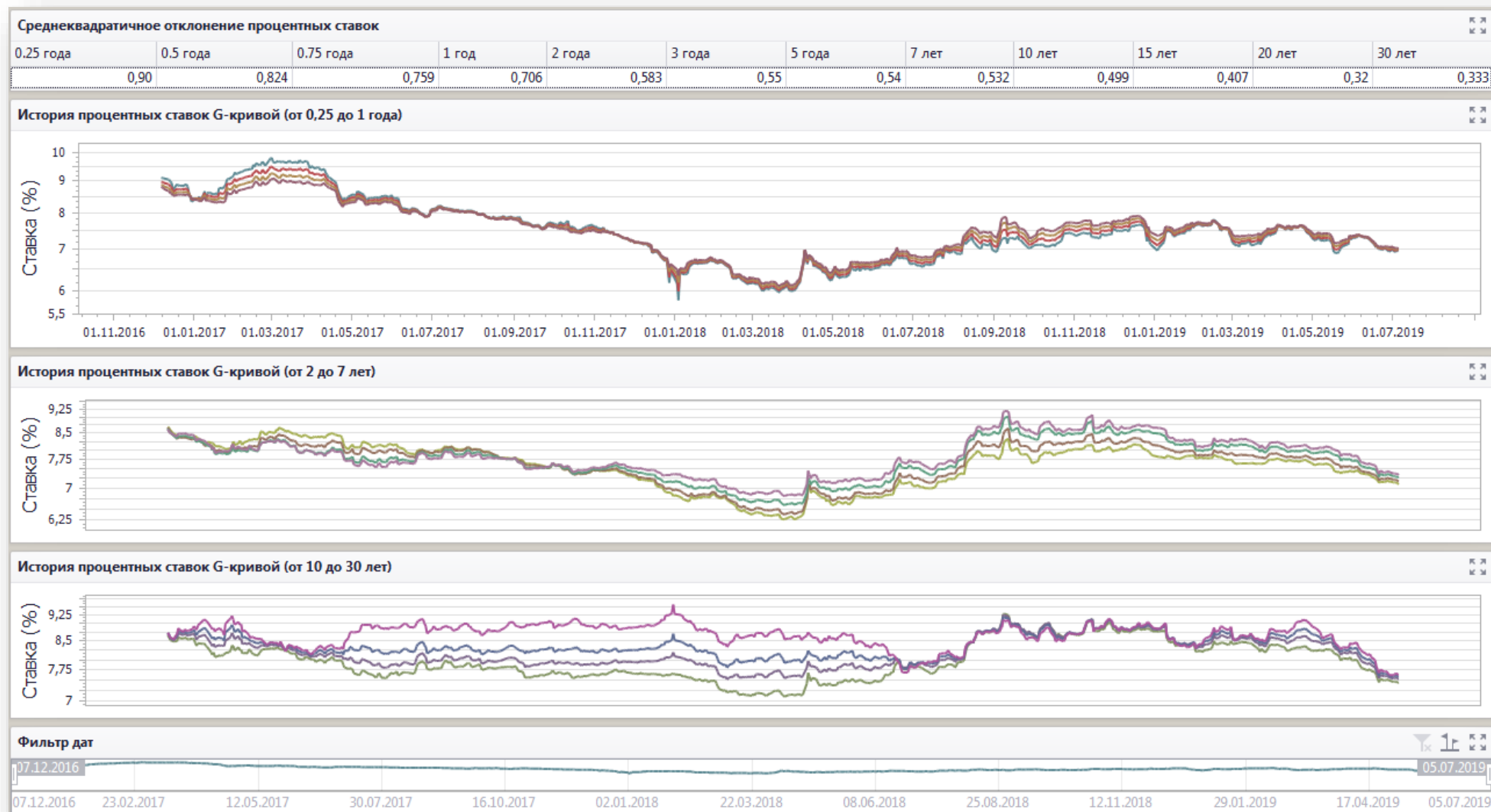
Зависимость доходности к погашению и риска по облигациям портфеля

Активы с максимальным VaR



История изменения процентных ставок на рынке

изменение во времени ставок на рынке, статистика



Если Вас заинтересовали возможности системы управления портфелями GAMA, свяжитесь с директором по маркетингу Дмитрием Романом по тел: +7 (921) 935-5122 или с офисом, телефон: +7 (812) 325-9093, эл. адреса: info@infostroy.com, Droman@infostroy.com. Сайт: www.gama.ru

История изменения формы G-кривой

