

# GAMA

возможностей в  
управлении  
портфелями

Портфельный анализ

Технический анализ

Фундаментальный анализ

# GAMA<sup>®</sup>

Portfolio Management Systems

Учет операций

Портфель/Результат

Оценка

Причина

**Параметры вычислений**

Общие Сринв. капитал Метод расчета Оценка цены и доходности

Балансовая стоимость: стандартный

База доходности: базовый год

Доходность на: Дата операции

Отсутствие котировки: Оценочная стоимость

Затраты в рын. стоимости: ☐ Баланс стоим. < истор. стоим.

Схема платежей: ☐ Опционы

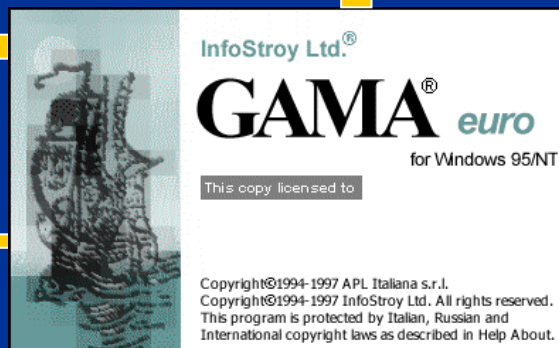
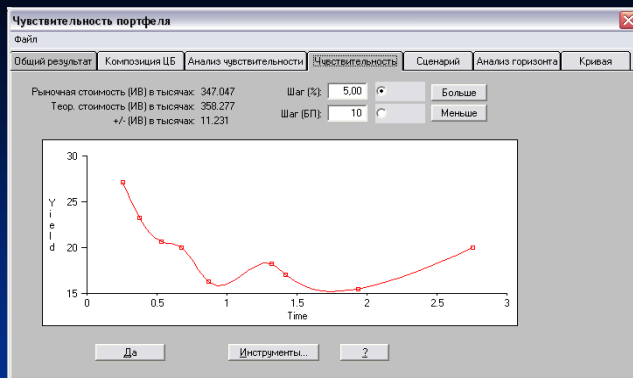
Ставка рефинансирования: ☐ Налоги

Методика оценки: По цене закрытия ☐ Затраты

☐ Единая методика оценки

Режим процентности: ☐ По выборке ☐ Без группировки ☐ Учет НКД в процентах

Да Инструменты... ?

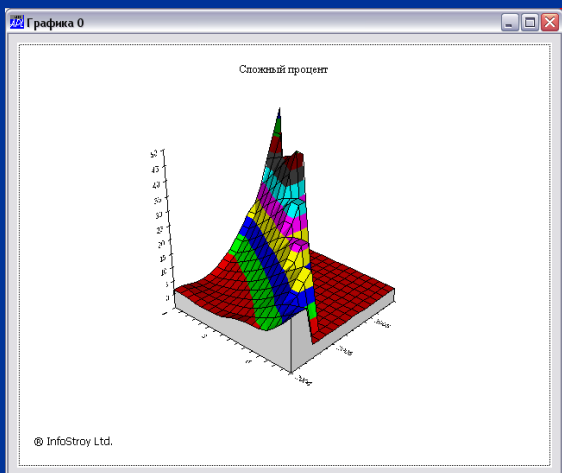


**Выбор века**

Итоговые

Выбор:

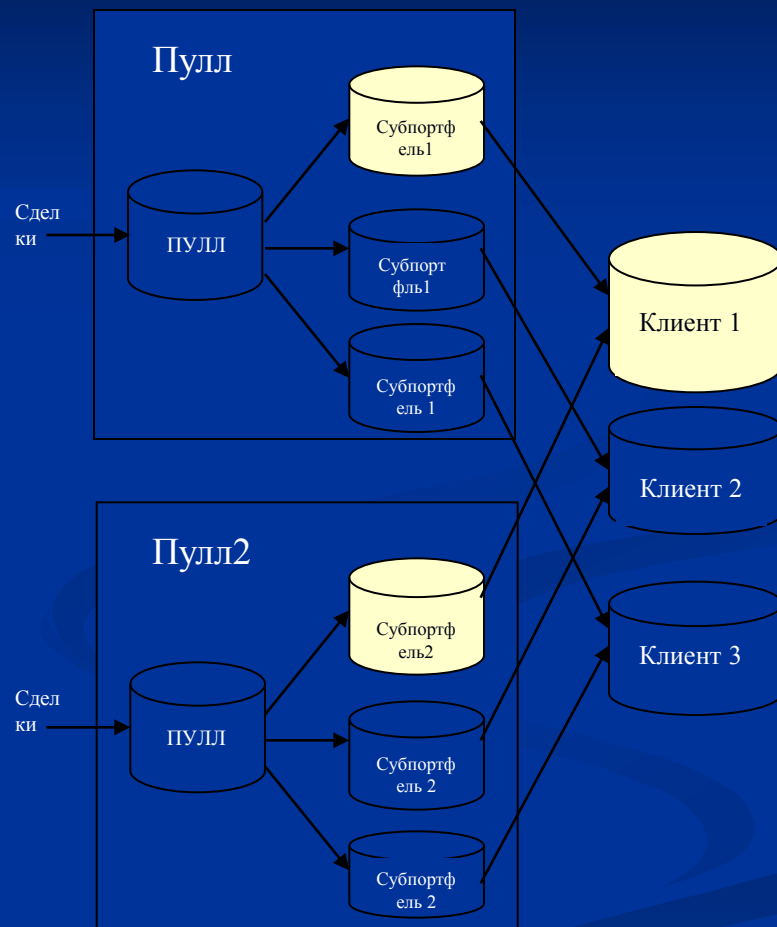
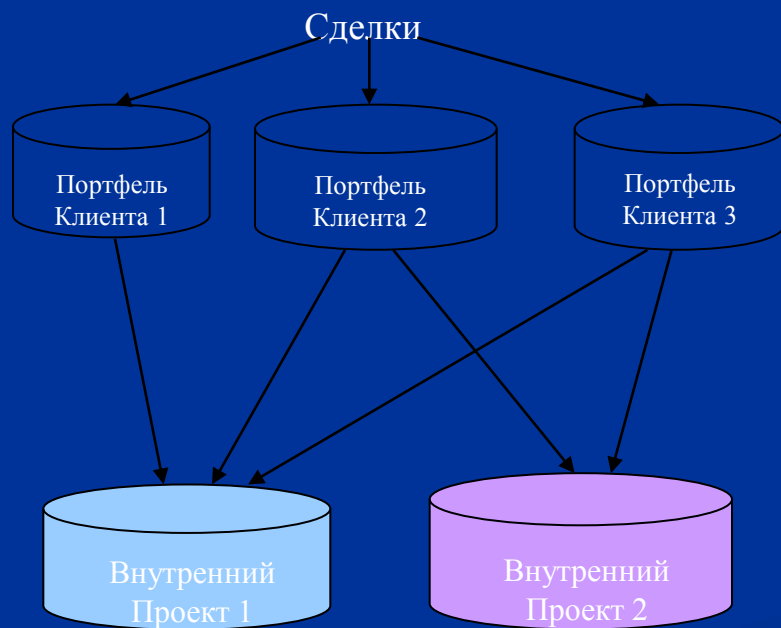
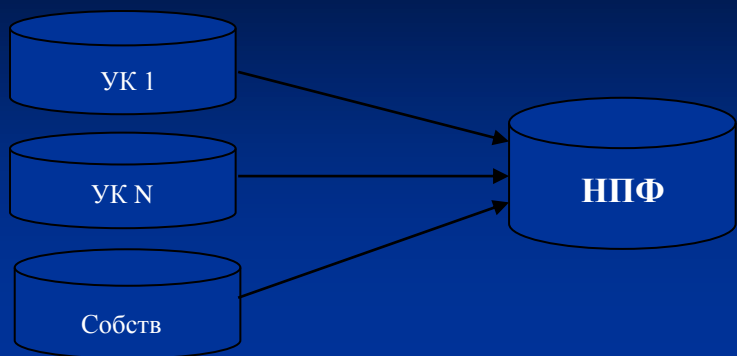
101 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B1)  
102 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B2)  
103 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B3)  
104 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B4)  
105 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B5)  
106 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B6)  
107 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B7)  
108 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B8)  
109 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B9)  
110 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B10)  
111 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B11)  
112 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B12)  
113 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B13)  
114 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B14)  
115 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B15)  
116 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B16)  
117 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B17)  
118 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B18)  
119 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B19)  
120 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B20)  
121 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B21)  
122 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B22)  
123 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B23)  
124 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B24)  
125 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B25)  
126 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B26)  
127 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B27)  
128 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B28)  
129 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B29)  
130 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B30)  
131 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B31)  
132 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B32)  
133 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B33)  
134 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B34)  
135 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B35)  
136 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B36)  
137 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B37)  
138 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B38)  
139 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B39)  
140 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B40)  
141 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B41)  
142 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B42)  
143 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B43)  
144 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B44)  
145 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B45)  
146 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B46)  
147 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B47)  
148 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B48)  
149 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B49)  
150 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B50)  
151 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B51)  
152 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B52)  
153 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B53)  
154 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B54)  
155 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B55)  
156 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B56)  
157 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B57)  
158 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B58)  
159 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B59)  
160 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B60)  
161 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B61)  
162 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B62)  
163 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B63)  
164 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B64)  
165 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B65)  
166 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B66)  
167 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B67)  
168 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B68)  
169 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B69)  
170 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B70)  
171 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B71)  
172 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B72)  
173 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B73)  
174 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B74)  
175 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B75)  
176 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B76)  
177 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B77)  
178 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B78)  
179 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B79)  
180 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B80)  
181 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B81)  
182 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B82)  
183 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B83)  
184 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B84)  
185 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B85)  
186 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B86)  
187 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B87)  
188 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B88)  
189 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B89)  
190 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B90)  
191 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B91)  
192 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B92)  
193 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B93)  
194 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B94)  
195 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B95)  
196 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B96)  
197 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B97)  
198 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B98)  
199 % в рыночной стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B99)  
200 % в балансовой стоимости портфеля от базиса на конкретную дату (B100)



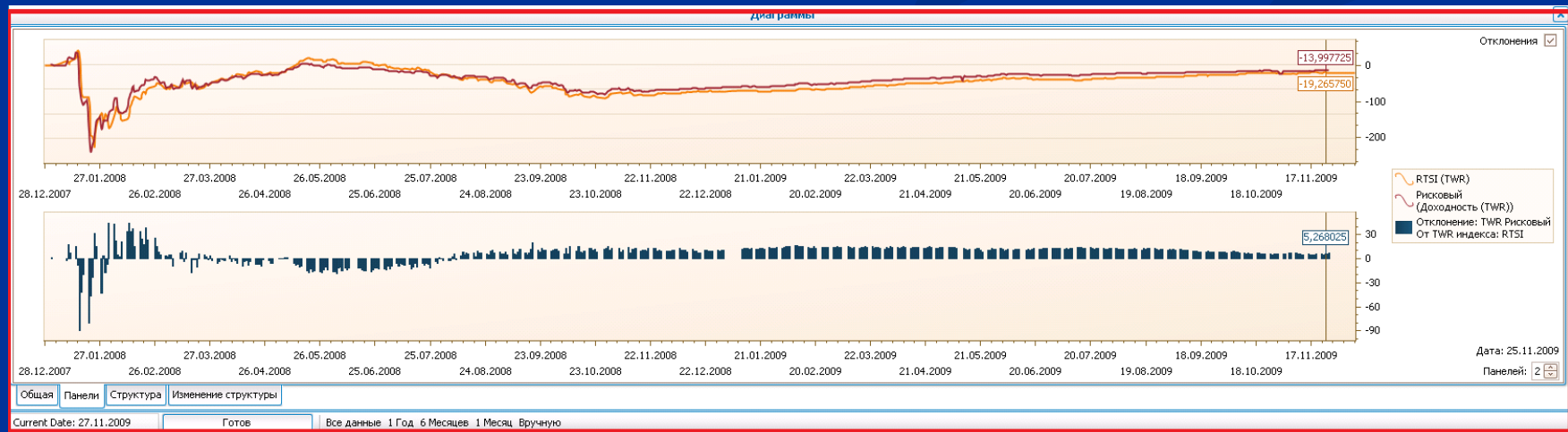
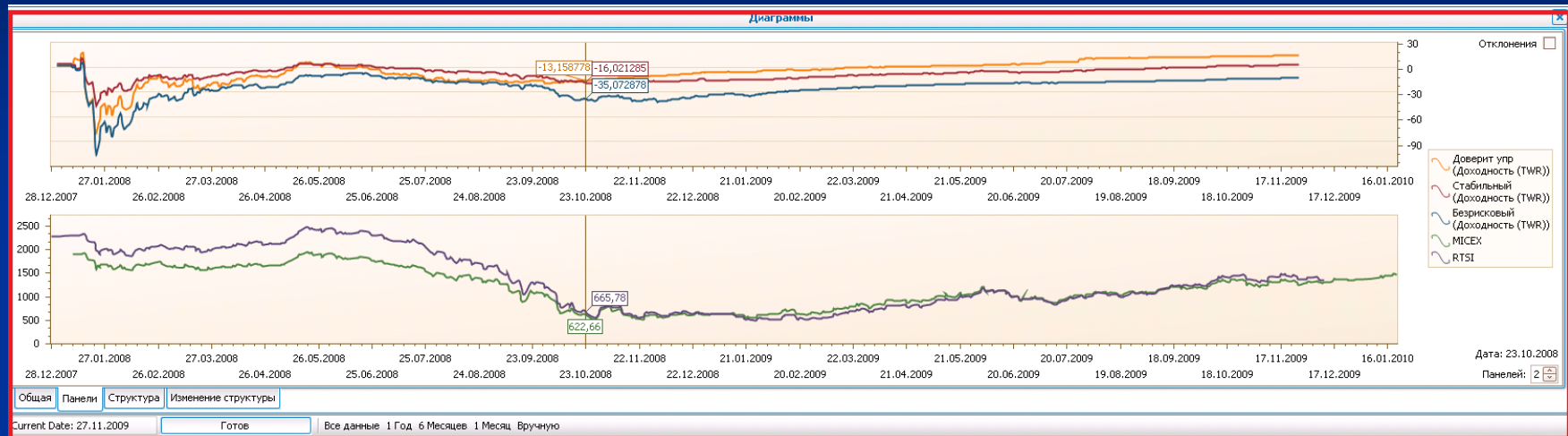
**Остатки покупок 01/01/05**

файл Правка Вставка Инструменты Данные ?

	Портфель	Название ЦБ (краткое)	Дата операции	Количество	Book Value (LC)	Фин. результат (ББ)	Чистый фин. результат (ББ)
1	ДВ в УК	ГМК Нор. Никель	02/10/03	30.000.00	38.832.189.80	254.633.090.20	254.633.090.20
2	ДВ в УК	ГМК Нор. Никель	21/06/03	176.010.00	284.311.298.97	1.476.281.688.59	1.476.281.688.59
3	ДВ в УК	ЛУКОЙЛ	22/01/04	99.00	2.970.000.00	(2.883.748.72)	(2.883.748.72)
4	ДВ в УК	Мосэнерго	21/06/03	300.000.00	638.723.23	163.720.90	163.720.90
5	ДВ в УК	Мосэнерго	01/07/03	820.000.00	100.678.723.23	(97.846.652.73)	(97.846.652.73)
6	ДВ в УК	ОАО Газпром ао	01/07/03	122.377.00	145.567.441.50	7.812.706.77	7.812.706.77
7	ДВ в УК	ОАО Газпром ао	30/09/03	90.000.00	250.114.447.50	8.253.711.00	8.253.711.00
8	ДВ в УК	РАО ЕЭС	21/06/03	361.565.00	3.700.060.55	(212.905.63)	(212.905.63)
9	НПФ	ОАОБашенфорксваз 4	05/09/02	5.000.000.00	569.270.178.64	(550.928.598.64)	(550.928.598.64)
10	НПФ	ОАОБашенфорксвазA01	05/09/02	10.000.00	22.213.33	14.469.93	14.469.93
11	НПФ	ОАОБашенфорксвазA01	08/07/03	1.450.000.00	88.472.213.33	(83.130.941.80)	(83.130.941.80)
12	НПФ	ОАО ГАЗ ао	21/06/03	700.000.00	620.980.920.00	168.624.099.00	168.624.099.00



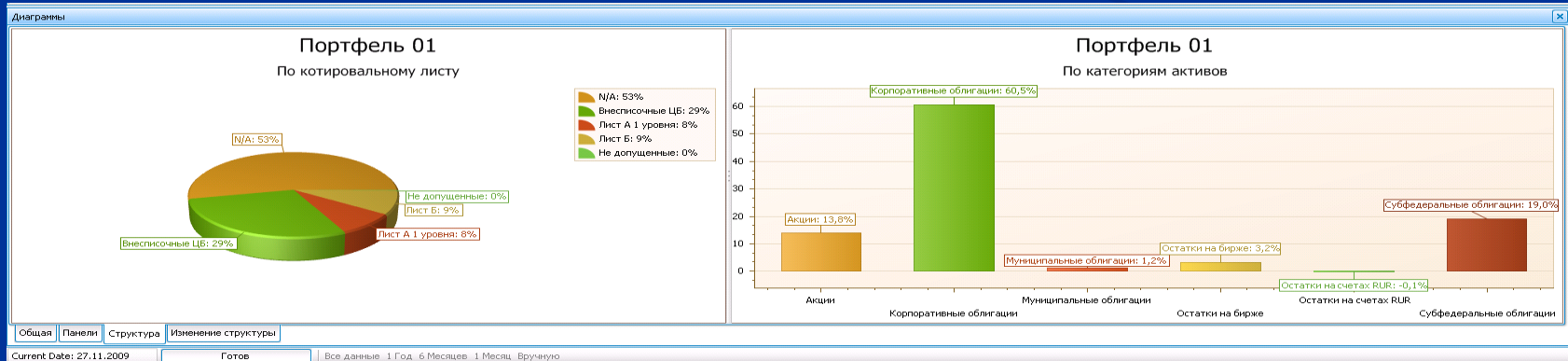
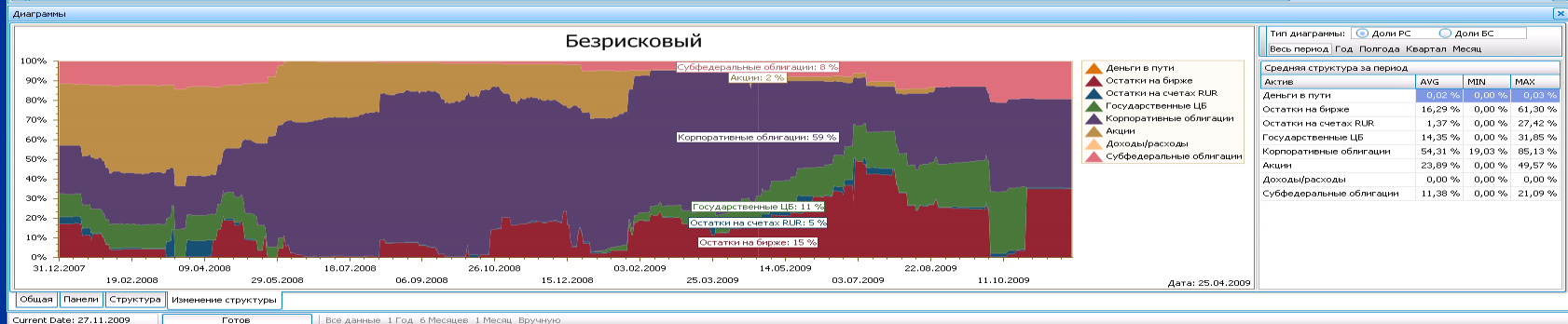
# GAMA +



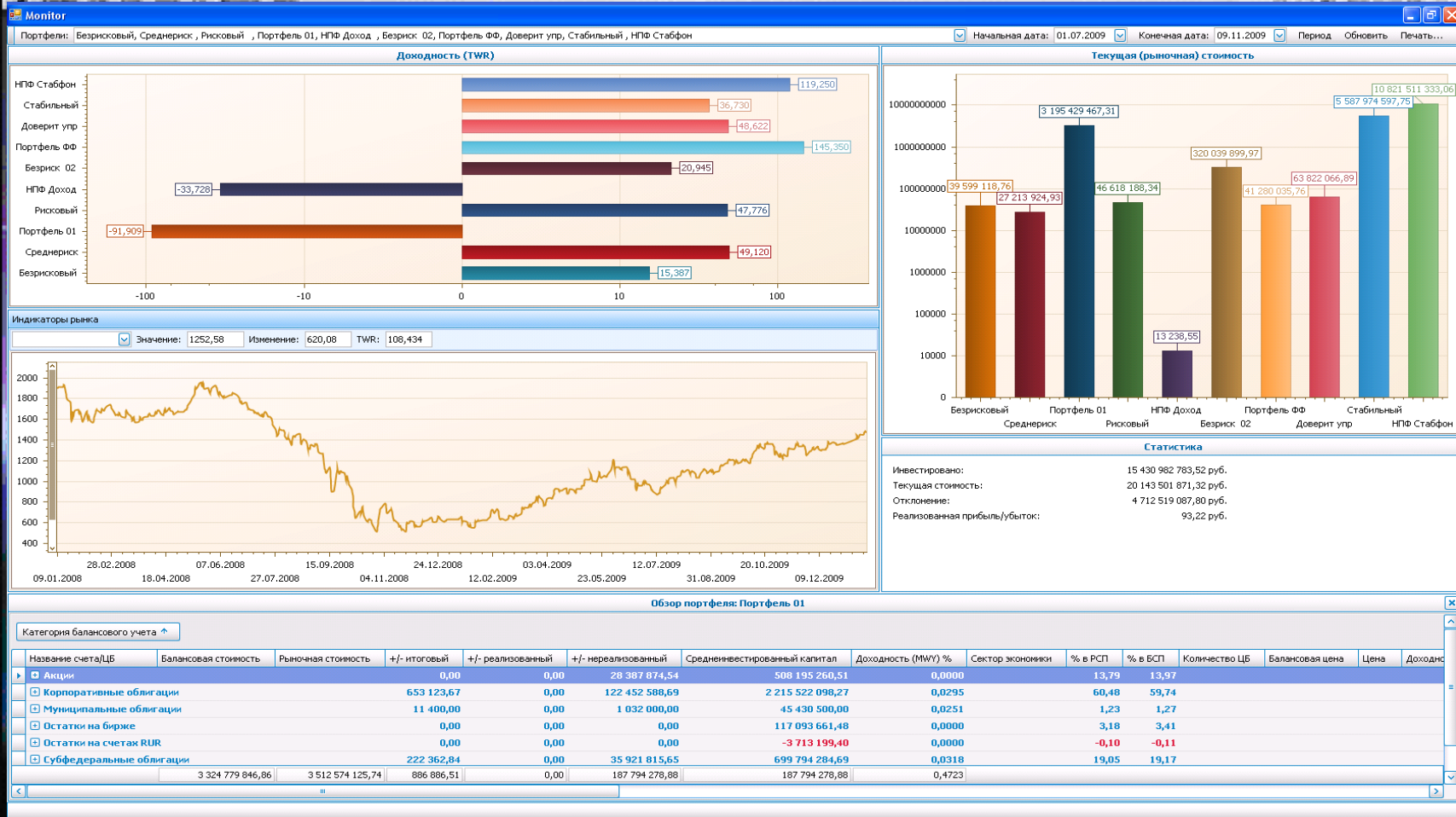
# GAMA +

Global Asset Management Assistant Workplace 1.0 Trial										
<div> <div>Файл Вид Портфели Групповые портфели Графики Индексы Настройки Справка</div> <div> <div>Список портфелей</div> <div>Модельные портфели</div> <div>Групповые портфели</div> <div>Графики</div> <div>Индексы</div> <div>Монитор</div> <div>Печать</div> <div>Справка</div> </div> </div> <div>Начальная дата: 01.01.2009 Конечная дата: 27.11.2009 Период</div>										
Портфели	Параметры									
Название портфеля	Балансовая стоимость	Балансовая стоимость	Рыночная стоимость	Рыночная стоимость	Доходность (TWR) %	+/- итоговый	+/- итоговый	+/- реализованный	+/- реализованный	+/- нереализованный
НПФ Доход	13 238,55	-2 479 187,41	13 238,55	-2 479 187,41	-90,9992	0,00	-163,50	0,00	0,00	0,00
Портфель 01	3 324 779 846,86	1 580 538 568,42	3 512 574 125,74	2 120 027 739,82	-18,2324	886 886,51	379 475,59	0,00	0,00	187 794 278,88
Безрисковый	38 977 767,91	10 442 613,91	39 668 042,71	11 132 888,71	16,5085	6 770,83	-403,04	0,00	-513,00	690 274,80
Безриск 02	318 877 237,51	137 542 416,89	323 036 719,00	141 701 898,38	18,6121	52 906,49	5 091,48	0,00	-2 994,30	4 159 481,49
Стабильный	5 485 644 748,98	3 037 364 566,98	5 627 490 939,35	3 179 210 757,35	29,9908	1 456 749,52	676 735,86	0,00	0,00	141 846 190,37
Доверит упр	60 477 194,55	-11 921 813,72	63 492 671,00	-8 906 337,27	38,4893	20 551,05	4 652,95	0,00	0,00	3 015 476,45
Среднериск	23 190 509,26	3 852 320,60	27 320 123,15	7 981 489,09	57,8680	5 980,80	3 435,44	0,00	-1 973,78	4 129 613,89
Портфель ФФ	28 228 584,67	1 289 367,12	42 172 407,00	15 233 189,45	70,3621	3 840,34	3 183,52	0,00	0,00	13 943 822,33
Рисковый	33 897 520,72	3 701 630,74	44 084 091,23	13 888 201,25	97,8908	2 595,00	2 595,00	0,00	0,00	10 186 570,51
Всего в 10 портфелях:	15 404 235 882,56		22 153 063 681,57			3 006 143,55		0,00		6 748 827 799,01

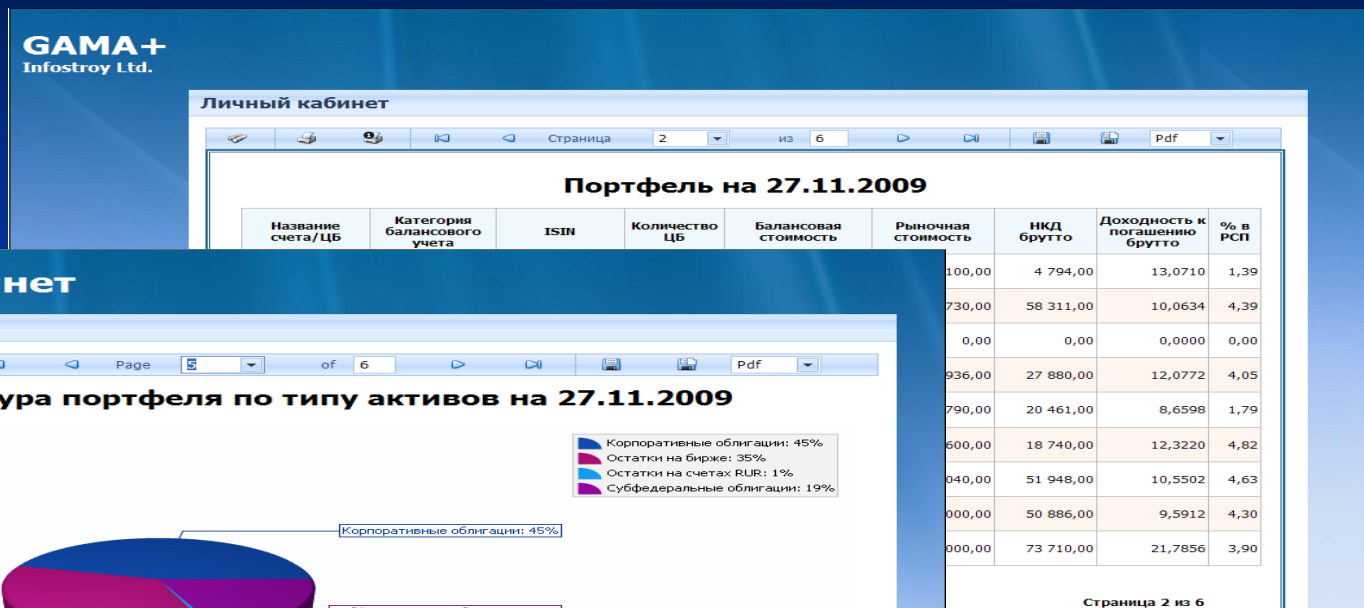
Групповые портфели										
Список групповых портфелей										
Название	Балансовая стоимость	Рыночная стоимость	Доходность (TWR) %	+/- итоговый	+/- реализованный	+/- нереализованный	Среднеинвестиционный капитал	Доходность (MWV) %	Кредиторская задолженность	Дебиторская задолженность
Портфель НПФ	6 147 237 263,53	12 544 615 538,22	213,2481	578 438,81	0,00	6 397 378 274,69	12 578 054 390,89	0,0045	0,00	38 862 795,25
Собственный	3 363 770 853,32	3 552 255 407,00	-17,5754	893 657,34	0,00	188 484 553,68	3 622 600 868,52	0,0246	-1 956,52	87 610 000,00
Доверительный	5 546 121 943,53	5 690 983 610,35	30,1100	1 477 300,57	0,00	144 861 666,82	5 793 933 501,43	0,0254	0,00	126 472 795,25







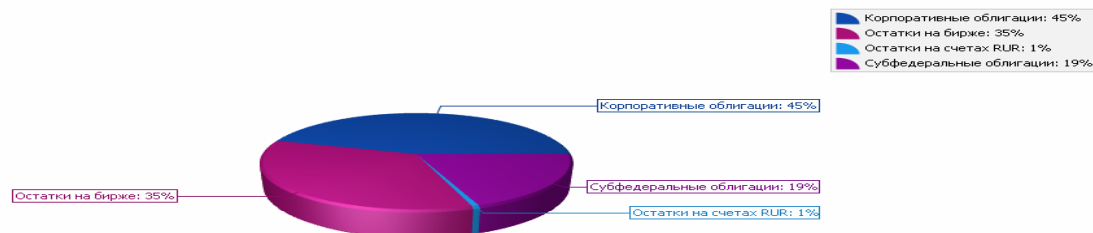
# Личный кабинет GAMA



## Личный кабинет

Gama+

### Структура портфеля по типу активов на 27.11.2009



## LogoCompany

Личный кабинет: НПФ Стабфон

### Рыночная стоимость портфеля на 27.11.2009



# 20 лет

разработок  
систем управления портфелями

**ДОВЕРИЕ КАПИТАЛ**  
УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ



**TROIKA DIALOG**  
FAMILY OFFICE



**ХАНТЫ-МАНСИЙСКИЙ**  
НЕГОСУДАРСТВЕННЫЙ ПЕНСИОННЫЙ ФОНД



Лицензия  
№234/2 выдана ФСФР 22 марта 2005 г

**GAMA®**  
Portfolio Management Systems



управляющая компания  
**ДОСТОЯНИЕ**  
основана в 1994 году

**ТелекомСоюз**  
негосударственный пенсионный фонд



**АРБАТ  
КАПИТАЛ**  
фонд инвест



**ИК РУСС-ИНВЕСТ**  
инвестиционная компания



**Капиталь**  
ИНВЕСТИЦИОННАЯ ГРУППА



**ПЕРВЫЙ**  
ДОХОДНЫЙ  
УПРАВЛЯЮЩИЙ



**TRUST**  
ИНВЕСТИЦИОННЫЙ БАНК ТРАСТ