

# Рабочее место GAMA+



## Цели

1. Предоставление руководителю компании агрегированных показателей состояния активов под управлением в графической форме
2. Предоставление руководителю инвестиционного подразделения, портфельному менеджеру, аналитику данных для выявления зависимости эффективности управления портфелями от:
  - внешних факторов: различных рыночных показателей
  - внутренних факторов: влияние позиций портфеля на его состояние в целом
3. Составление аналитических отчетов

## Задачи

1. Предоставление в графической форме данных о динамике изменения структуры портфелей под управлением, о динамике изменения эффективности управления этими инвестициями, сравнение эффективности управления портфелями с рыночными индикаторами
2. Предоставление исторической информации о состоянии позиций портфелей с возможностью удобного графического представления этой информации и расчетом различных аналитических позиционных и рыночных показателей
3. Подготовка набора отчетов по управлению портфелями



# Основная функциональность

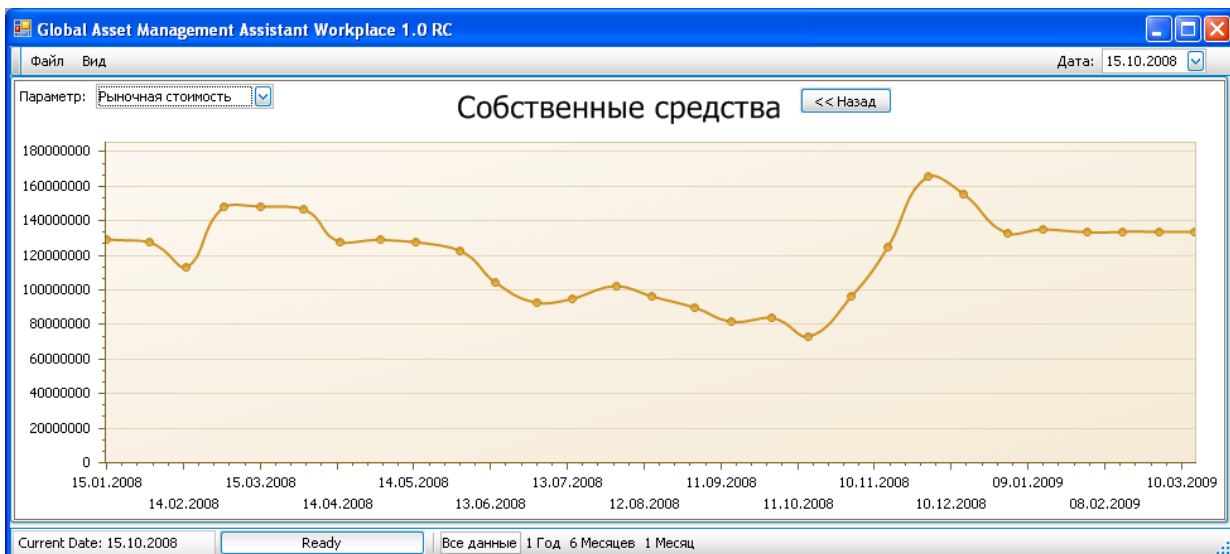
## Монитор Руководителя компании

Графическое и цифровое представление состояния портфелей и основных показателей эффективности управления инвестициями



## Монитор управляющего портфелями

- Таблица состояния портфелей с индикаторами изменения каждого портфельного показателя и возможностью построения графиков по истории заданного портфельного и позиционного показателя
- Таблица текущих рыночных показателей: рыночные индексы, курсы валют, цены на нефть (при наличии источника данных)...



Качественный анализ портфеля: сравнение доходности (TWR) портфеля с доходностью заданного индекса

Количественный анализ портфеля: выявление причины отклонения доходности портфеля от индекса

Создание модельных портфелей (доля финансового инструмента в портфеле). Расчет и графическое представление отклонения реального портфеля от модельного

The screenshot shows the 'Global Asset Management Assistant Workplace 1.0 RC' application window. The interface includes a menu bar with 'Файл' and 'Вид', a date field set to '15.10.2008', and a section for selecting portfolios. The 'Собственные средства' (Own Assets) dropdown is selected, and 'Модельный портфель для сравнения:' (Model Portfolio for Comparison) is set to 'Модель 1'. A 'Расчет' (Calculate) button is visible. Below this, there are tabs for 'Табличный вид' (Table View), 'Графический вид' (Graphical View), and 'Отклонения' (Differences). The main table displays the following data:

Категория балансового учета	% в РСП	Модель	+/-
▶ <b>Акции</b>	13,74 %	5,00 %	8,74 %
Векселя предпр. и банков	0,00 %	10,00 %	-10,00 %
Дебиторская задолженность	0,00 %	7,00 %	-7,00 %
Депозитные сертификаты	82,25 %	5,00 %	77,25 %
Корпоративные облигации	0,00 %	4,00 %	-4,00 %
Муниципальные облигации	0,00 %	10,00 %	-10,00 %
Остатки на бирже	0,00 %	4,00 %	-4,00 %
Остатки на счетах RUR	4,02 %	16,00 %	-11,98 %
Остатки на счетах USD	0,00 %	5,00 %	-5,00 %
Паи	0,00 %	13,00 %	-13,00 %
Субфедеральные облигации	0,00 %	21,00 %	-21,00 %

At the bottom of the window, the status bar shows 'Current Date: 15.10.2008', 'Ready', and 'Все данные 1 Год 6 Месяцев 1 Месяц'.

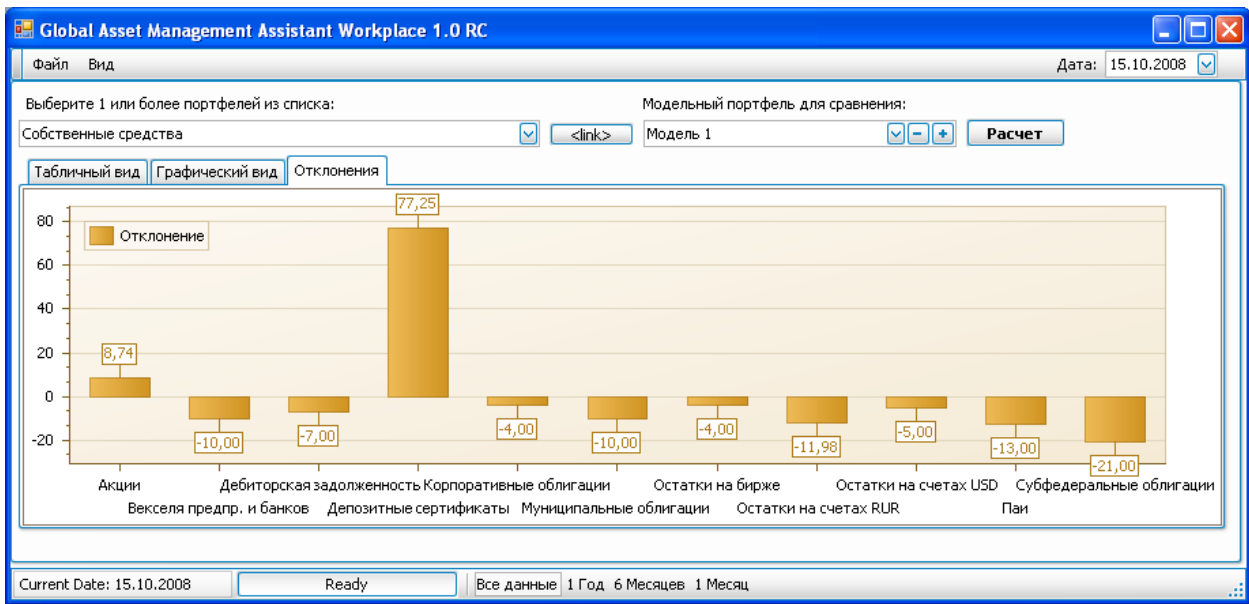
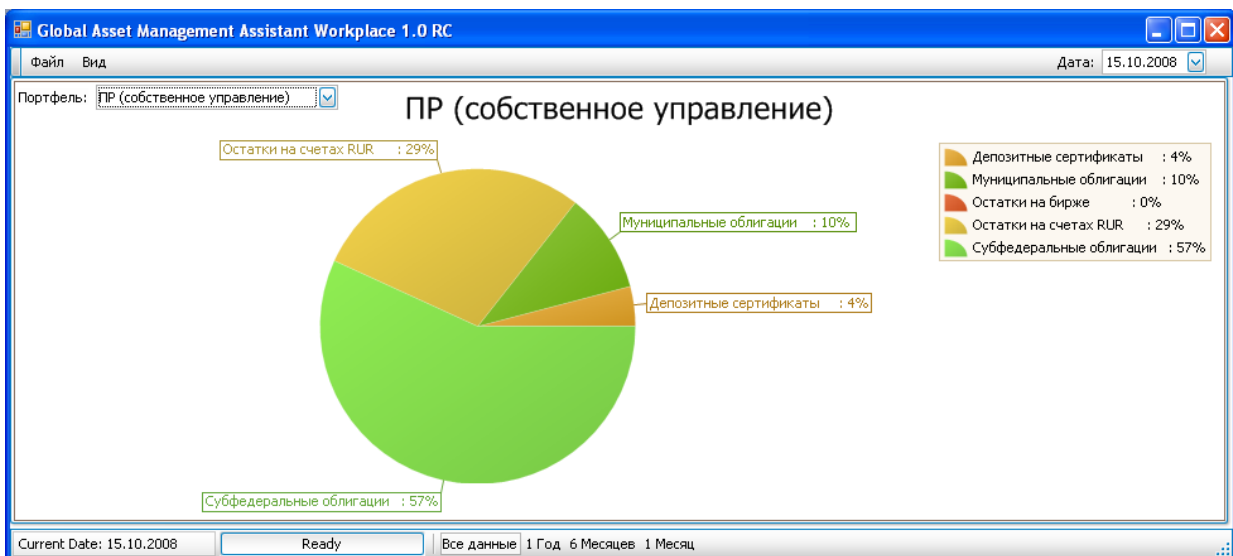


График ежемесячного изменения структуры портфеля: доля балансовой стоимости финансового инструмента в портфеле и доля рыночной стоимости финансового инструмента в портфеле



Расчет статистики по позициям, по портфелям, по секторам рынка

Global Asset Management Assistant Workplace 1.0 RC																
Доходность по портфелям													Дата: 15.10.2008			
Период	Максимальная				Минимальная				Максимальная				Минимальная			
	Портфель	Дата	Портфель	Дата	Портфель	Дата	Портфель	Дата	Портфель	Дата	Портфель	Дата	Портфель	Дата		
За последний год	0,1410 %				-10,4147 %				895,0396 %				-4 062,9774 %			
	Портфель 3 ...	15.03.2009	Портфель 7 ...	01.01.2009	Портфель 8 ...	Белгор. об...	01.01.2009	Портфель 6 ...	Кубань ЭСК...	01.01.2009	Финансовая деят	15.03.2009	Угольная пром.	15.01....		
За последний квартал	0,1410 %				-1,1520 %				105,9071 %				-532,3212 %			
	Портфель 3 ...	15.03.2009	Портфель 6 ...	01.03.2009	Портфель 9 ...	Уралсвязь...	01.03.2009	Портфель 2 ...	ЛЖКойл-во ...	15.03.2009	Финансовая деят	15.03.2009	Угольная пром.	01.03....		

## Технические требования

1. Серверное приложение GAMA-Agent
2. .Net Framework 3.5
3. MS SQL 2000 или выше

Более подробную информацию Вы можете получить по телефону: +7 (812) 325-9093 или по электронной почте: [gama@infostroy.ru](mailto:gama@infostroy.ru)