

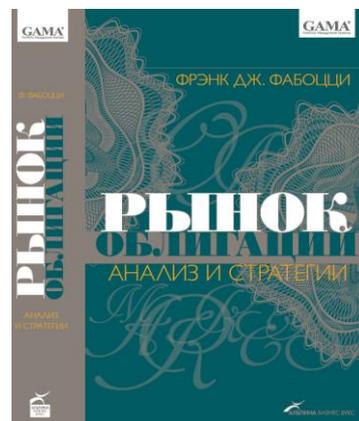


## Система управления портфелями активов и их рисками

# GAMA

## О компании

ООО «ИнфоСтрой» ([www.infostroy.ru](http://www.infostroy.ru)) занимается разработкой, внедрением и сопровождением систем программного обеспечения с 1991 года. С 1992 г. ИнфоСтрой специализируется на разработке систем управления портфелями активов (portfolio management systems) для российского и зарубежных фондовых рынков. ООО «ИнфоСтрой» - постоянный участник и партнер многих профессиональных конференций на фондовом рынке. Несколько раз выступала спонсором специализированных изданий. По результатам опроса Investfunds в 2017 году компания признана лучшим разработчиком программного обеспечения для институциональных инвесторов.



## О продукте

Global Asset Management Assistant (GAMA) — система управления портфелями финансовых активов. GAMA включена в ЕДИНЫЙ РЕЕСТР российских программ для электронных вычислительных машин и баз данных по Приказу Минкомсвязи РФ от 30.10.2020 №567, реестровый № 7153.

### Основные задачи:

- Построение и мониторинг портфелей на базе первичного учета операций с активами;
- Оценка портфелей, содержащих различные финансовые инструменты в разных валютах;
- Определение финансовых результатов управления и оценка эффективности инвестиций;
- Факторный анализ (определение источников эффективности операций);
- Контроль за состоянием и структурой портфелей;
- Детальный анализ активов в разрезе финансовых инструментов, групп активов, инвестиционных портфелей, субпортфелей, секторов экономики и других категорий инвестиций;
- Моделирование состояния портфелей;
- Управление сложной структурой портфелей, находящихся в различных юрисдикциях;
- Организация риск-менеджмента инвестиционных портфелей.

### Основные функции:

- Формирование инвестиционных портфелей и их мониторинг на регулярной основе (с возможностью мониторинга портфелей в реальном времени) – GAMA Terminal;
- Оперативный расчет эффективности инвестиций (доходности) и оценка эффективности;
- Получение обширной портфельной аналитики с разной степенью детализации (в разрезе активов, эмитентов, секторов экономики, категорий ликвидности, категорий дюрации, совокупных портфелей и пр.);
- Определение рыночных рисков финансовых инструментов различными методами (VaR историческим и параметрическим методом);
- Определение процентных рисков финансовых инструментов с фиксированной доходностью;
- Определение кредитных рисков;
- Определение ликвидности финансовых инструментов;
- Проведение сценарного анализа портфелей (проведение анализа портфелей при изменении рыночной ситуации);
- Проведение стресс-тестирования портфелей;
- Прогнозирование процентных ставок различными математическими методами;
- Автоматизация ввода рыночных данных – GAMA Market Agent;
- Автоматизация ввода данных об операциях с активами и других рутинных операций при управлении активами – GAMA Agent;
- Формирование аналитической и управленческой отчетности – генератор отчетов, генератор документов, аналитические панели (dashboards).

## Почему GAMA

В названии «GAMA» – Global Asset Management Assistant – отражена ее основная задача: быть незаменимым помощником в вопросе управления активами, в том числе, на международных финансовых рынках.

Вот уже более тридцати лет GAMA используется, как в России, так и за рубежом, крупными и средними инвесторами. Пенсионные фонды, управляющие компании, банки, страховые компании и компании «private banking», «wealth management», «family office» используют GAMA для управления своими активами, активами своих клиентов, либо для контроля за своими активами, переданными в доверительное управление.

Система управления активами GAMA – это:

- широчайший диапазон возможностей: учета, нетривиальной оценки активов, расчета прибыли\убытков от управления;
- уникальная аналитика по источникам финансового результата: всевозможные финансовые инструменты, учет в любом наборе валют, сложные структуры портфелей, автоматизация за счет импорта сделок, в том числе, в реальном времени – из торгового терминала, учет бухгалтерских операций;
- непревзойденный ассортимент аналитических функций: разнообразные инструменты оценки эффективности управления активами, прогнозирование состояния портфелей, встроенные инструменты визуализации данных, возможность расчета своих аналитических показателей, создание композитов портфелей (синтетический портфель) и бенчмарков (синтетический индекс);
- ресурсоемкие, но эффективные инструменты для оценки и контроля рисков: расчет кредитного риска, расчет VAR, определение ликвидности инструментов, стресс-тестирование и моделирование портфелей, сценарный анализ, стохастическое моделирование финансового рынка, контроль соблюдения лимитов в реальном времени;
- минимальный ручной труд при работе с начальными данными;
- богатый архив рыночной информации: автоматизированный импорт из десятков источников данных об описании активов, их котировках, индексах, курсах валют, процентных ставках и т.п.;
- уникальные средства интеграции с внешними системами: три канала формирования отчетов любой сложности, экспорт информации в любой формат внешней системы;
- уникальное положение на рынке: весь 30-летний опыт решения множества нестандартных задач клиентов, накопленный специалистами «ИнфоСтрой», нашел свое отражение в системе. Это позволило предусмотреть широчайшие возможности настройки системы под специфику той или иной компании;
- квалифицированная поддержка: в отличие от «специалистов технической поддержки» в традиционном понимании, сотрудники «ИнфоСтрой» владеют предметной областью, что позволяет значительно повысить эффективность оказываемых консультаций и расширить спектр вопросов, помощь в которых может оказать команда GAMA.

Позвоните мне, и я отвечу на интересующие Вас вопросы.

Директор по маркетингу проекта GAMA

**Дмитрий Роман**

раб. +7 (812) 325-9797

моб. +7 (921) 935-5122

[droman@infostroy.com](mailto:droman@infostroy.com)

[www.gama.ru](http://www.gama.ru)

