

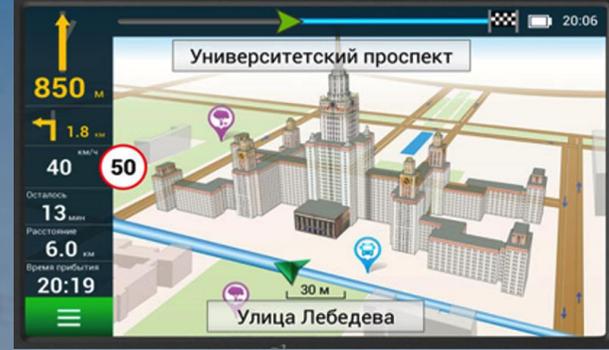
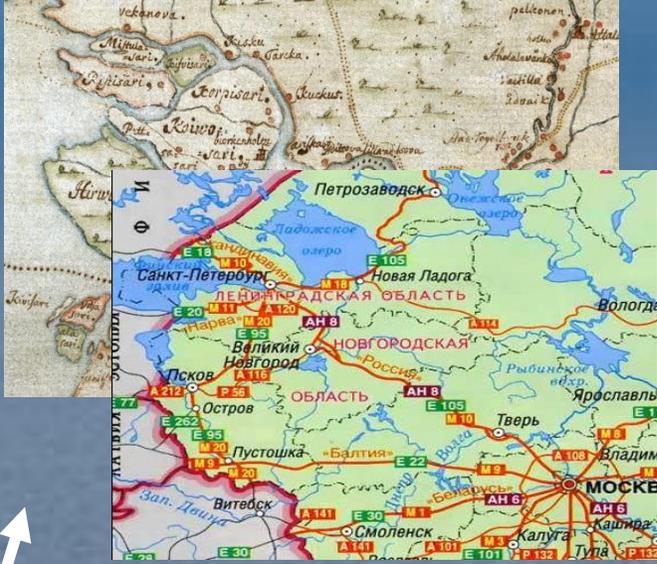
GAMA Terminal

еще шаг к построению эффективной
инфраструктуры
для управления активами

InfoStroy Ltd.



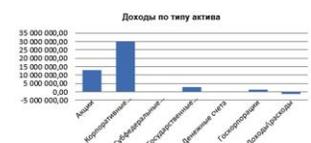




Структура доходов портфелей Фонда с 31.12.2020 по 17.10.2021

Название портфеля	+/- итоговый реализованный	текущий +/- итоговый нерезализованный	Прирост +/- итоговый нерезализованного	+/- итоговый
Портфель 1	63 474 034,13	3 407 455,61	-39 911 896,99	23 562 137,14
Портфель 3	16 395 379,36	-2 580 543,56	-10 064 131,41	6 331 247,95
Портфель 4	41 067 212,82	488 101,22	-20 650 384,22	15 016 966,60
Портфель 5	821 870,15	-8 711,50	-279 950,00	341 911,15
Общий итог	122 158 486,46	1 306 221,77	-76 906 291,62	45 252 204,84

Активы	14 069 162,91	4 447,26	-1 192 271,09	12 876 891,82
Акции	14 069 162,91	4 447,26	-1 192 271,09	12 876 891,82
Корпоративные облигации	81 632 809,22	8 529 266,27	-51 654 507,08	29 978 302,14
Суверенные облигации	1 364 209,08	-1 660 333,88	-1 649 238,47	-265 029,39
Государственные облигации	23 205 236,35	-6 508 836,56	-20 522 792,59	2 682 443,76
Денежные счета	3 281 172,48	941 678,78	-1 887 375,56	1 393 796,92
Госкорпорации	-1 394 204,39	-1 394 204,39	-1 394 204,39	-1 394 204,39
План	110,81	-106,83		3,98
Общий итог	122 158 486,46	1 306 221,77	-76 906 291,62	45 252 204,84



Структура портфелей по секторам рынка

Структура портфелей по типам инструментов

Фильтр портфелей по рейтингу Fitch (млн евро)

Портфель	Эмитент	Актив	Доля (%)	Эмитент	Инвестиция (руб)
Портфель 1	Лукойл	Лукойл	30,82	Башнефть	489 980,98
Портфель 6	Россия	Россия, 26209	30,28	ЛУКОЙЛ	491 062,90
Портфель 5	Россия	Россия, 26209	37,04	РН Банк	389 425,97
Портфель 1	Газпром Капитал	Газпром Капитал БО-1	24,38	ТМК	27 184,00
Портфель 6	Транснефть	Транснефть БО-001P-04	16,42	Газпром Капитал	311 386,80
Портфель 3	Транснефть	Транснефть БО-001P-04	16,42	ДОМ.РФ	152 436,00
Портфель 1	Транснефть	Транснефть БО-001P-04	16,42	Фольксваген Банк РУС	217 341,60
Портфель 1	НЛМК	НЛМК	15,40	Тойота Банк	194 842,20
Портфель 5	ИКС 5 ФИНАНС	ИКС 5 ФИНАНС_001P-10	13,76	РАСКО-Линия	184 006,29
Портфель 4	ИКС 5 ФИНАНС	ИКС 5 ФИНАНС_001P-10	13,76	Транснефть	163 136,00
Портфель 3	ИКС 5 ФИНАНС	ИКС 5 ФИНАНС_001P-10	13,76	Темкофф Банк	161 690,00
Портфель 5	ГЛК	ГЛК_001P-08	11,31	КТЖ Финанс ООДО	138 363,54
Портфель 6	ГЛК	ГЛК_001P-08	11,31	Банк России содовая комп.	137 754,50
Портфель 4	ГЛК	ГЛК_001P-08	11,31	РУСАЛ Банк	119 979,00
Портфель 3	ГЛК	ГЛК_001P-08	11,31	Малит	87 666,41
Портфель 4	ГЛК	ГЛК_001P-07	9,70	Россети	81 172,30



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

Портфели

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	6 144,13	7 012 959...	7 978 821,91 Р	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60...	2 797 888,24 Р	0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,43%

Доля актива в портфеле

Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWV)	+/- итогов...	СИК	+/- не реализо...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,69%	41 606,08	887 125,31	0,00
	Ростелеком-1-606	02 Обл корпора...	Связь	0	4,54%	30 927,09	681 531,88	0,00
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государств...	Государственные ...	2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государств...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507...	0,00
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Нижегород.обл, ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,48%	41 404,99	924 001,09	0,00

Лучшие по доходности

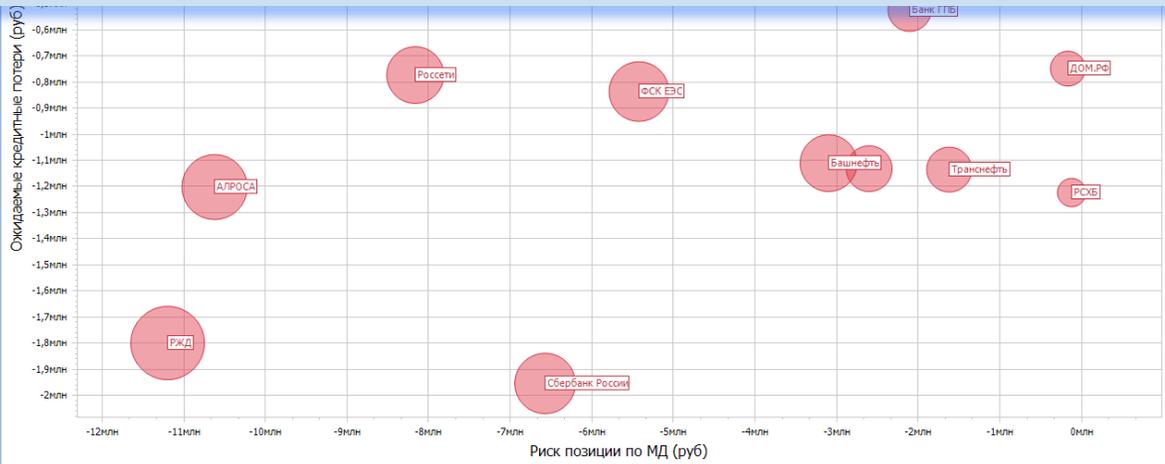
- Форштадт, 9,5%
- Силовые машины, 02
- Роснефть-001P-02
- ФПК 1P-01
- ГТЛК, 01

Худшие по доходности

- Внешэкономбанк-БО-02
- Россия, 25081
- Россия, 25081
- Россия, 25081
- Россия, 25081



ГАММА Terminal



Актив	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портфе...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (р...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портфе...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (р...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89

Доля кредитного и рыночного риска в дюрации

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости портфеля	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (р...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88

Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15

Мониторинг портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор руководителя



Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



Портфели УК

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...



0,25 года 1,53 0,5 года 1,48 0,75 года 1,44 1 год 1,41 2 года 1,29 3 года 1,2 5 года 1,06 7 лет 0,963 10 лет 0,869 15 лет 0,794 20 лет 0,777 30 лет 0,837

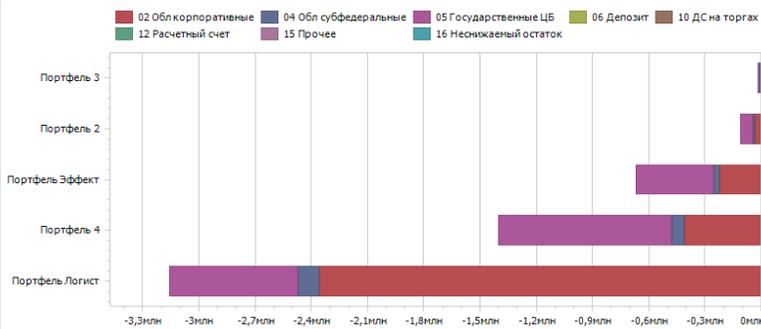
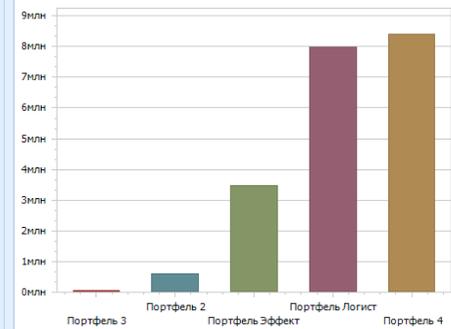
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффе...



Распределение инвестодохода по портфелям



Риск (по дорации)



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Портфели Фонда



Фильтр портфелей

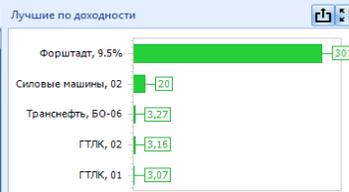
Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 Р	0,00	880 901,53 Р	1 362 817,45 Р	67 791 418...	2,01%
Портфель ...	155 019 962...	156 001 775,88 Р	17 511,69	2 381 934...	3 363 748,27 Р	152 585 739...	2,20%
Портфель 4	178 673 772...	179 905 481,80 Р	0,00	2 732 462...	3 964 171,42 Р	184 772 800...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 Р	2 474 021,82 Р	0,00	22 996,47 Р	36 972,88 Р	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 Р	0,00	167 810,58 Р	260 633,17 Р	13 501 551...	1,93%



Позиции

Лучшие по доходности

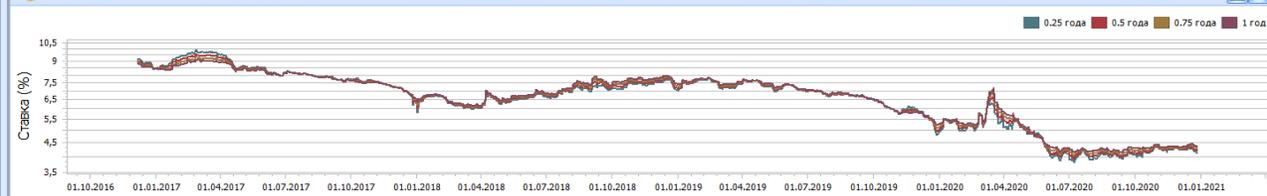
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	0,00
	Нижегород.обл...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	0,00
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00	
ВЭБ 09	04 Обл субфед...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	0,00	
Волгоград.обл 35...	04 Обл субфед...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	0,00	
Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00	
Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00	
Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00	



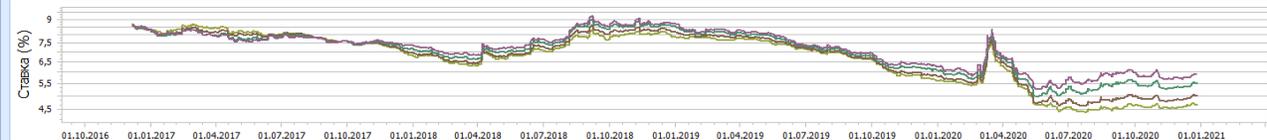
Худшие по доходности



История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



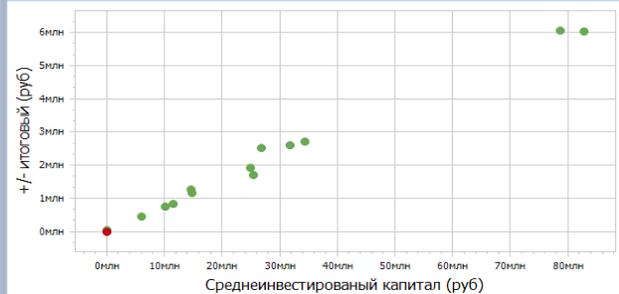
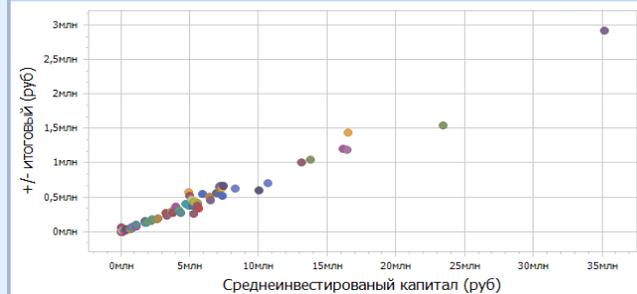
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Влияние позиции на доходность портфеля



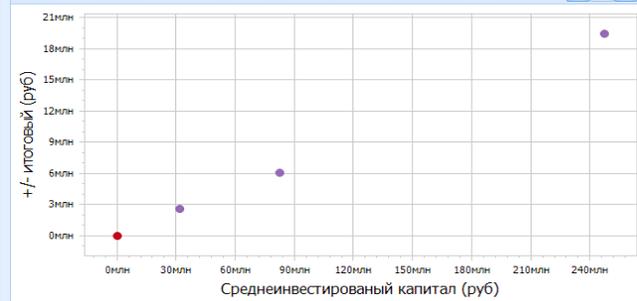
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



ПОЧЕМУ GAMA Terminal?

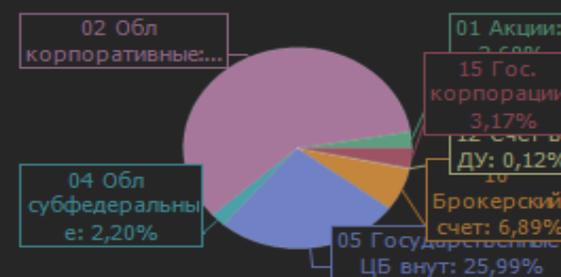


По типам актива

Изменение стоимости с начальной даты по типам активов и позициям (щелкнуть)



Структура по типу актива на конечную дату

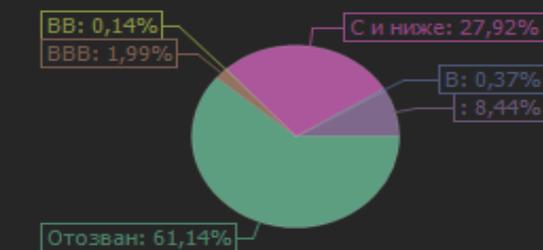


По агрегированному рейтингу

Изменение стоимости с начальной даты по агрегированному рейтингу и позициям (...)

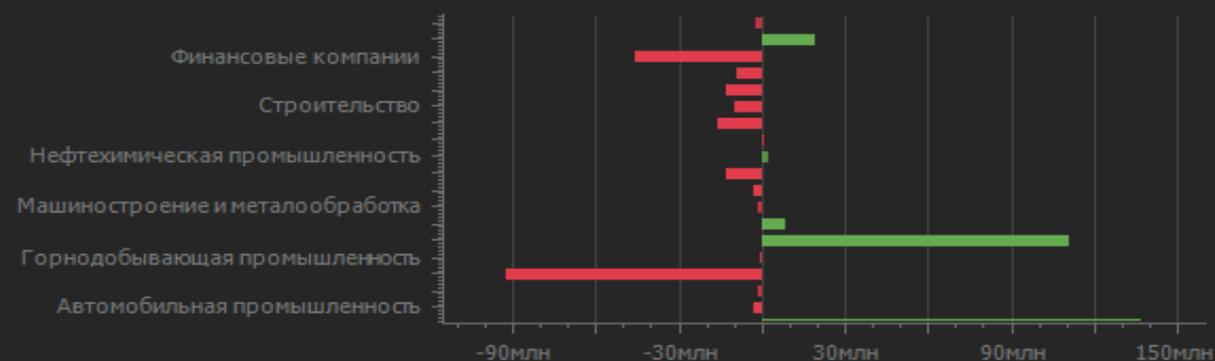


Структура по агрегированному рейтингу на конечную дату

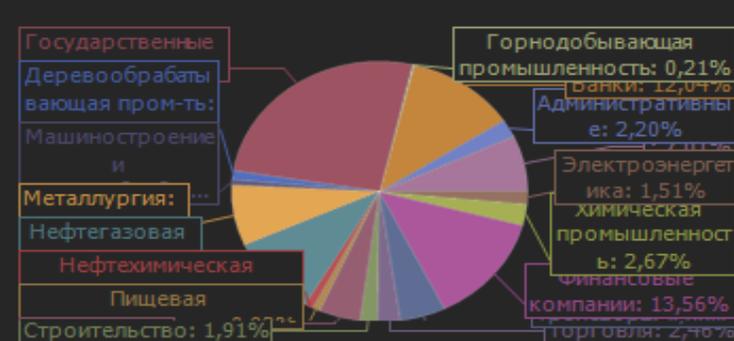


По секторам экономики

Изменение стоимости с начальной даты по секторам экономики и позициям (щелк...



Структура по сектору экономики на конечную дату





Корзина



Новая папка



GAMA



Terminal



Agent 1



Введите здесь текст для поиска



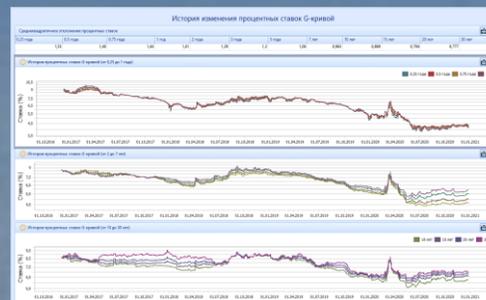
GAMA Terminal – это Мониторинг всей компании



Инвестиции



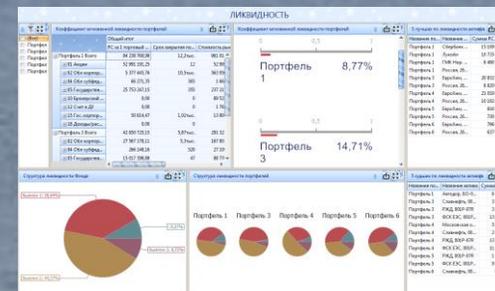
Риски



Актуарий



Бухгалтерия



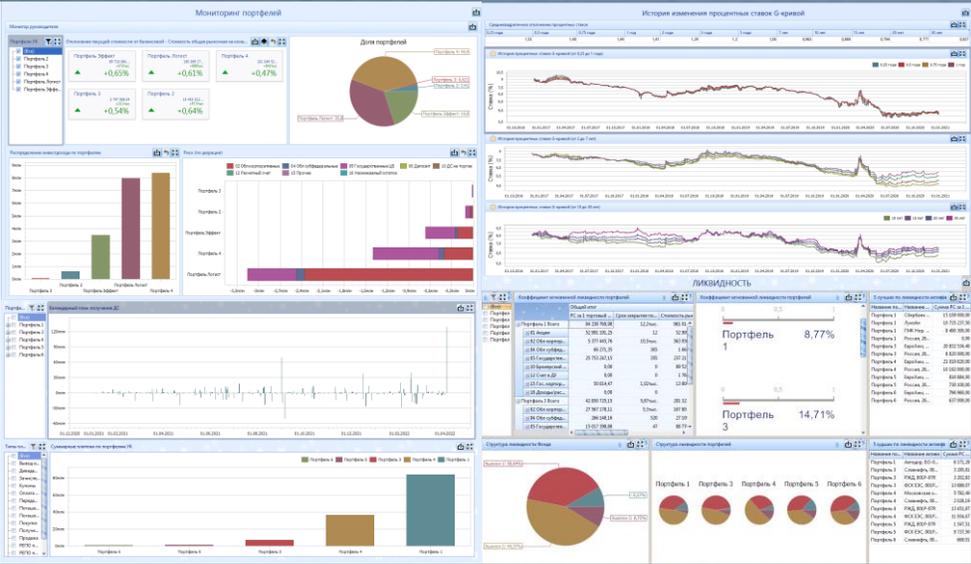
GAMA Terminal – это Мониторинг всей компании



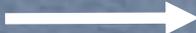
Инвестиции



Риски



Актуарий



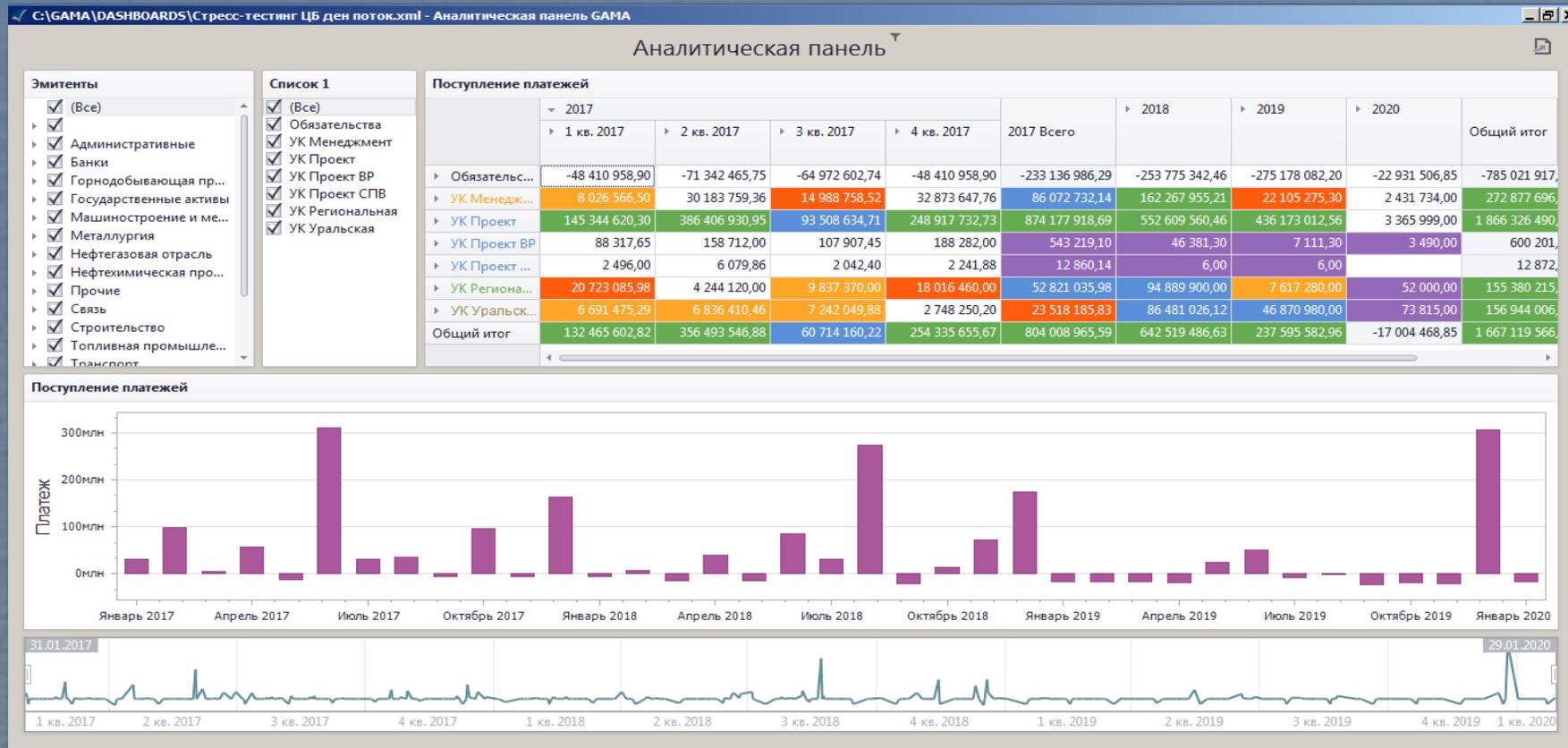
Бухгалтерия





Платежи от активов (от Управления активами)

Платежи по обязательствам (от Актуария)



GAMA Terminal – экономия средств

ФАЙЛ ПРАВКА ГЛАВНАЯ ДАННЫЕ СРЕДСТВА РАЗРАБОТЧИКА СПРАВКА

Доступ
Макросы
Макросы

Серверы аналитических панелей
Настройки Терминала
Приложение

Декларация: проверка
Декларация: проверка и запись

Изменение кредитного
Связанные компании -

Приложение

Новая аналитическая панель

Показать аналитическую панель

Загрузка данных таблицы

Параметры

Состояние на 07/04/22 (база 31/12/21)

	Счета/ЦБ (руб)	Категория балансового учета	Стоимость общая рыночная (ИВ) 07/04/22
1	Портфель 1	АЛРОСА	01 Акции 2.954.887,10
2	Портфель 1	ВТБ	01 Акции 2.057.750,00
3	Портфель 1	ГМК Нор. никель	01 Акции 8.490.300,00
4	Портфель 1	Лукойл	01 Акции 10.735.237,50
5	Портфель 1	Московская Биржа	01 Акции 411,96
6	Портфель 1	МТС	01 Акции 6.473.405,00

Акции
Облигации
Фьючерсы
Форекс
Общий портфель
Состояние
Состояние план
Транзакции
Состояние по депозитарии

GAMA Terminal – обширное применение



Инфраструктура управления активами

GAMA Terminal

отображение рынка и портфелей
в реальном времени

GAMA Market Agent

обновление рыночных данных

GAMA Agent

автоматизация
рутинных операций

GAMA

хранение данных и калькуляция портфелей

GAMA

Вы умеете инвестировать,
мы умеем считать.



www.infostroy.ru