
Руководство пользователя

СИСТЕМЫ

«Sym4.Treasury Solutions»

Этот документ является собственностью Разработчика и носит конфиденциальный характер. Содержание данного документа не может воспроизводиться целиком или по частям, либо передаваться третьим лицам, не являющимся сотрудниками Разработчика, без предварительного согласования с Представителем Руководства по качеству и Менеджером по качеству. Копии, переданные третьим лицам по согласованию с Представителем Руководства по качеству и Менеджером по качеству, должны быть обозначены как «НЕКОНТРОЛИРУЕМАЯ КОПИЯ».

Оглавление

1	Введение	3
1.1	Назначение системы	3
1.2	Область применения	3
1.3	Термины и сокращения	3
2	Вход в систему	5
3	Общее описание системы и интерфейса	6
3.1	Описание основных кнопок и элементов системы	6
3.2	Главная страница системы	12
3.3	Управление денежной позицией	14
3.3.1	Платежный календарь	14
3.3.2	Платежная позиция	15
3.3.3	Прогноз остатков	16
3.4	Управление активами и пассивами	17
3.4.1	Посделочный отчет за дату	17
3.4.2	Просмотр сделки и Cash flow	18
3.4.3	Сверочный отчет за дату	20
3.4.4	Отчет с группировкой	22
3.4.5	Расчет ЧПД	24
3.4.6	What-if анализ	25
3.4.7	Стресс-тестирование	29
3.4.8	Динамический баланс	31
3.5	Управление ликвидностью	32
3.5.1	Отчет по нормативам	32
3.5.2	Гэп-анализ	34
3.6	Рыночные данные	36
3.6.1	FX спот	36
3.6.2	Цены облигаций	36
3.6.3	Цены акций	37
3.6.4	Процентные ставки	37
3.7	Исторические данные	39
3.8	Конфигурация	40
3.8.1	Календари	40
3.8.2	Страны	41
3.8.3	Форекс	41
3.8.4	Портфели	42
3.8.5	Контрагенты	43
3.8.6	Облигации	44
3.8.7	Акции	45
3.8.8	Стресс-тестирование	46
3.8.9	Все справочники	46

1 Введение

Продукт «Sym4.Treasury Solutions» - программное обеспечение для управления финансовыми рисками, возникающими из-за несоответствия между активами и обязательствами в рамках инвестиционной стратегии в финансовом учете. Основная цель системы заключается в поддержке стратегического управления банком путем оптимизации финансовых показателей, минимизации рисков и улучшения общей эффективности управления ресурсами.

1.1 Назначение системы

Система предназначена для мониторинга, анализа и управления балансовыми позициями банка, оптимизации доходности и минимизации рисков, связанных с управлением активами и обязательствами.

Система позволяет эффективно контролировать финансовые потоки, оценивать риски и принимать обоснованные решения на основе актуальной рыночной информации.

Система обеспечивает выполнение следующих задач:

- Анализ текущего состояния активов и пассивов;
- Прогнозирование будущих денежных потоков;
- Управление ликвидностью и соблюдение нормативных требований;
- Оценка и минимизация финансовых рисков;
- Оптимизация доходности и расходов.

1.2 Область применения

Настоящая инструкция описывает функционал системы при работе пользователей.

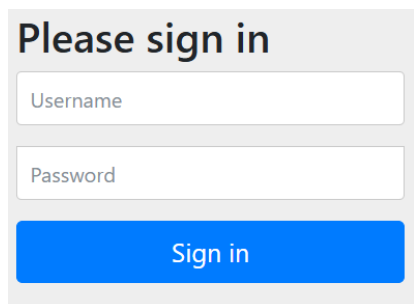
1.3 Термины и сокращения

Термин / Сокращение	Определение / Расшифровка
Операционный день	Дата для проведения расчетов в системе и для моделирования сценариев. Устанавливается в системе в рамках EOD (текущая календарная дата минус один день)

Термин / Сокращение	Определение / Расшифровка
End of Day (EoD)	Процедура закрытия операционного дня, в рамках которой происходит расчёт TS-метрик, CF, ПК, ПП и т.д.
Отчетная дата	Дата окончания отчётного периода, по состоянию на которую составляется отчётность
ЧПД	Чистый процентный доход
Денежный поток (Cash Flow, CF)	Совокупность распределённых во времени поступлений (притока) и выплат (оттока) денежных средств, генерируемых хозяйственной деятельностью предприятия, независимо от источника их образования. В рамках нашего проекта за единицу расчета CF берется сделка.
Управление денежной позицией (Cash Management, CM)	Сервис управления ПК, ПП, посделочным отчётом и сверочным отчётом за период
Платежная позиция (ПП)	Остаток средств на корреспондентских счетах с указанием сумм притока и/или оттока средств и их назначений в течение дня
Управление ликвидностью (Liquidity Risk Management, LRM)	Сервис оптимизации срочности, моделирования процентных ставок, аналитики процентного риска и т.д.
What-if анализ	Учёт влияния синтетических сделок на ПП, ПК, сверочный отчет, ликвидность и т.д.
Сценарный анализ	Учёт альтернативных сценариев процентных ставок, курсов валют и котировок финансовых инструментов

2 Вход в систему

Для входа в систему необходимо в адресной строке браузера ввести адрес:
(необходимо вставить ссылку)
На экране откроется форма авторизации:

A screenshot of a web form titled "Please sign in". It contains two input fields: "Username" and "Password". Below the fields is a blue button labeled "Sign in".

Please sign in

Username

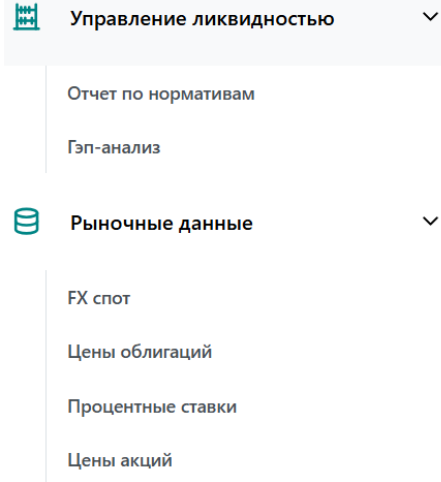
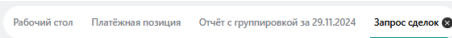
Password

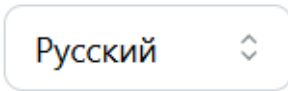
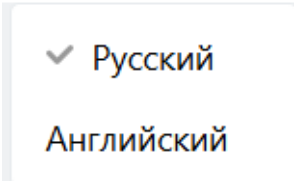
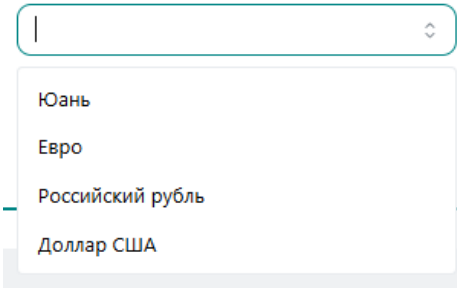
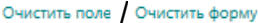
Sign in

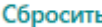
Для получения доступа к системе необходимо выполнить аутентификацию и авторизацию: ввести логин и пароль, затем нажать на кнопку "Sign in". После успешной аутентификации и авторизации откроется Главная страница системы.

3 Общее описание системы и интерфейса

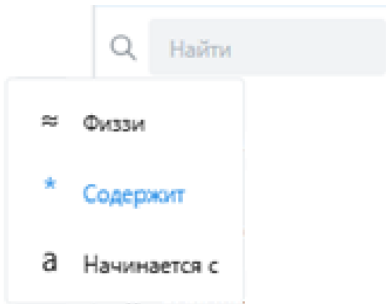
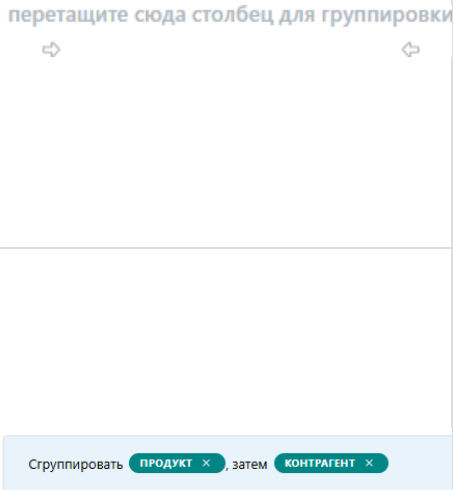
3.1 Описание основных кнопок и элементов системы

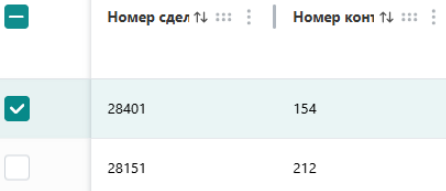
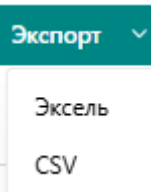
	Название кнопки/иконки	Визуальное представление	Описание
1	Элементы управления		
1.1	Меню системы		По нажатию на кнопку можно свернуть или отобразить меню системы.
1.2	Развернуть / свернуть раздел меню		По нажатию на название раздела открывается список подразделов:
1.3	Набор вкладок		Здесь в процессе работы в системе будут отражены разделы, которые открывались в текущей сессии. Закрыть вкладку можно по кнопке  рядом с названием вкладки.
1.4	Выход из системы		Выход из системы (разлогиниться)

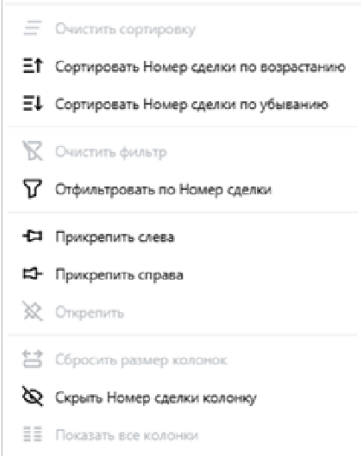
	Название кнопки/иконки	Визуальное представление	Описание
1.5	Темная/светлая тема	 или 	Переключение на светлую/темную тему
1.6	Выбор языка	 	Выпадающий список выбора языка системы
2	Заполнение форм		
2.1	Дата		Поле с датой По кнопке  выпадает календарь для выбора даты. В календаре для выбора доступны все даты, на которые были выполнены расчёты в рамках End of Day. Также в поле доступен ввод даты вручную
2.2	Выпадающий список	 	Выпадающий список для выбора значений
2.3	Очистить поле / очистить форму		Сбросить выбранные или введенные данные в поле/форме

	Название кнопки/иконки	Визуальное представление	Описание
2.4	Сбросить		Возвращает в поле значение по умолчанию
2.5	Сегодня		Заполняет поле текущей датой
2.6	Найти		Формирование отчета с выбранными параметрами
2.7	Отмена		Возврат к предыдущей странице
3	Работа с таблицами		
3.1	Двигать		Кнопка для управления положением столбца: столбец в отчете можно переместить, зажав данную кнопку в названии столбца
3.2	Изменить ширину столбца		Кнопка для управления шириной столбца: зажав данную кнопку на границе столбцов, можно изменить ширину столбца
3.3	Показать / скрыть фильтры		Открывает или скрывает поля в столбцах для фильтрации данных
3.4	Выпадающее меню		Данный фильтр дает возможность настройки представления таблицы

	Название кнопки/иконки	Визуальное представление	Описание
	"Показать/скрыть колонки"		
	Прикрепить слева / прикрепить справа		Закрепляет выбранный столбец в таблице (в начале или в конце)
	Скрыть / Показать столбец		Переключатель отображения столбца в таблице. В отключенном состоянии столбце будет скрыт в таблице.
3.5	Включить / выключить полноэкранный режим		Разворачивает таблицу в полноэкранный режим
3.6	Изменить плотность		Изменяет плотность отображения данных в таблице
3.7	Обновить		Обновляет данные

	Название кнопки/иконки	Визуальное представление	Описание
3.8	Найти		Поиск по данным в отчете По кнопке  в выпадающем списке можно выбрать способ поиска.
3.9	Группировка		Группировка настраивается добавлением/удалением нужных параметров в специальной области над таблицей. Для добавления группировки необходимо перетащить столбец в область над таблицей (с помощью элемента  в названии столбца). Для удаления группировки необходимо удалить (по кнопке ) название столбца из специальной области над таблицей.

3.10	Развернуть / свернуть элемент		По кнопке  /  в первом элементе каждой строки сгруппированного списка можно развернуть/свернуть список сгруппированных элементов.
3.11	Развернуть / свернуть все элементы		По кнопке  /  в названии первого столбца сгруппированного списка можно развернуть все сгруппированные элементы.
3.12	Чек-боксы для выбора элементов таблицы		В некоторых таблицах есть чек-боксы для выбора элемента (строки) таблицы. Чек-бкс в заголовке данного столбца выделяет/снимает выделение со всех строк в таблице
3.13	Развернуть / свернуть список		Знаки «+» и «-» позволяют развернуть список дат с помесечной разбивкой и свернуть обратно
3.14	Экспорт		Экспорт отчета в Эксель или CSV

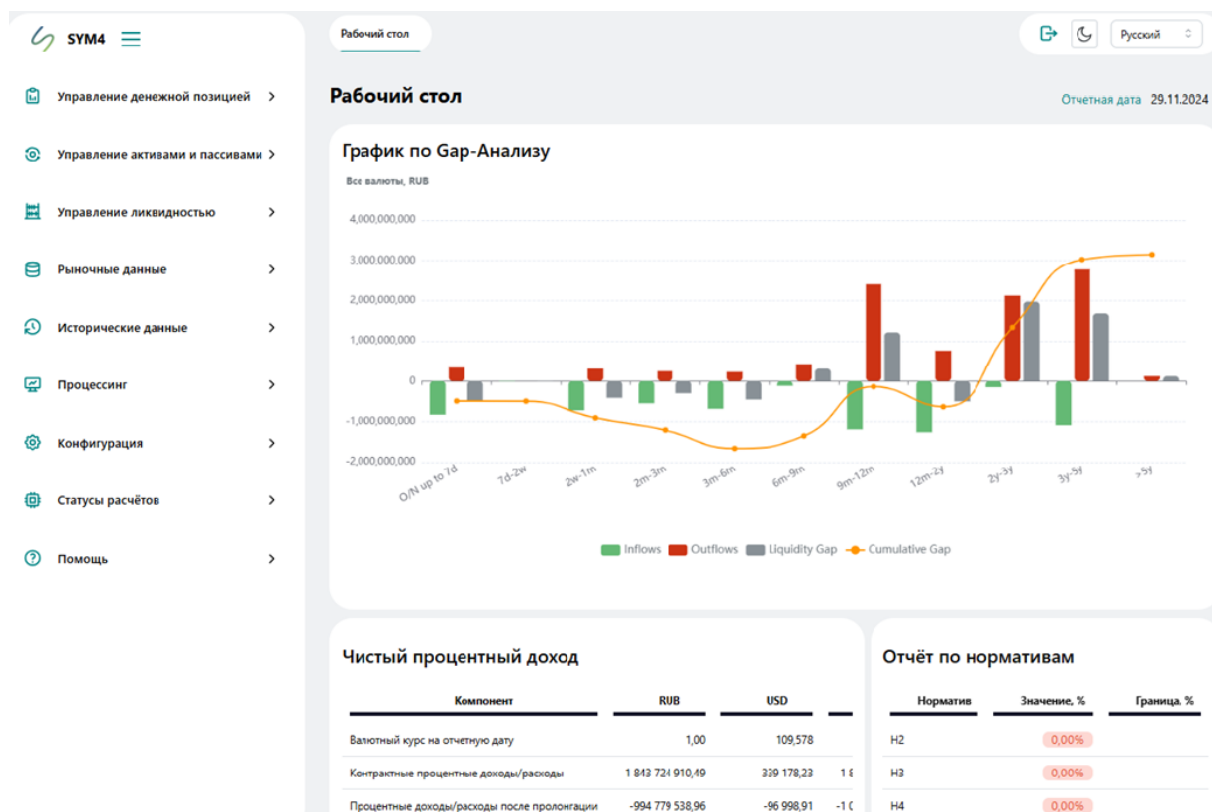
3.10	Развернуть / свернуть элемент		По кнопке  /  в первом элементе каждой строки сгруппированного списка можно развернуть/свернуть список сгруппированных элементов.
3.15	Настройки работы с таблицей/столбцом		Настройка представления таблицы отчета по кнопке в названии столбца

Также в системе предусмотрены информационные сообщения - подсказки. Подсказки позволяют ориентироваться на странице и сообщают пользователю о необходимом действии начала/продолжения работы в системе. Например:

 Выберите счёт	перетащите сюда столбец для группировки  
Не выбрана дата! ×	

3.2 Главная страница системы

После авторизации в системе откроется Главная страница, которая по умолчанию состоит из меню отчетов слева, меню общих настроек (описание см. в [Элементы управления](#)) и рабочего стола:



На рабочем столе отображаются дашборды "График по Гар-анализу", "Чистый процентный доход" и "Отчет по нормативам".

3.3 Управление денежной позицией

Состоит из двух инструментов платежный календарь и платежная позиция. Помогает контролировать и прогнозировать движение денежных средств.

3.3.1 Платежный календарь

Платежный календарь позволяет планировать и контролировать платежи банка.

Календарь строится по данным рассчитанного Cash flow и содержит все платежи за выбранный период, удовлетворяющие выбранным параметрам.

Для вывода данных необходимо заполнить форму:

Отчетный период

Дата начала выборки Сегодня [Очистить поле](#)

Дата завершения выборки Сегодня [Очистить поле](#)

Параметры

Внешний номер сделки [Очистить поле](#)

Название продукта [Очистить поле](#)

Контрагент [Очистить поле](#)

Тип платежа [Очистить поле](#)

Валюта [Очистить поле](#)

[Очистить форму](#) [Найти](#) [Отмена](#)

Для полей "Название продукта", "Контрагент", "Тип платежа" и "Валюта" доступен мультивыбор.

По нажатию кнопки **Найти** по умолчанию формируется отчет с группировкой по следующим параметрам:

- ✓ Валюта платежа;
- ✓ Дата;
- ✓ Продукт;
- ✓ Контрагент;
- ✓ Номер договора;
- ✓ Тип платежа

Рабочий стол

Платежный календарь за 26.09.2025-26.09.2025

Запрос сделок

Группировать

ВАЛЮТА ПЛАТЕЖА

затем

ДАТА

затем

ПРОДУКТ

затем

КОНТРАГЕНТ

затем

НОМЕР ДОГОВОРА/СДЕЛКИ

затем

ТИП ПЛАТЕЖА

Найти

Экспорт

Отчетная дата: 29.11.2024

Валюта платежа, Да	Поступление (План)	Поступление (дельта)	Выбытие (План)	Выбытие (дельта)
^ RUB (1)	Сумма "RUB": 131.856.16	Сумма "RUB": 0.00	Сумма "RUB": 0.00	Сумма "RUB": 0.00
^ 26.09.2025 (1)	Сумма "26.09.2025": 131.856.16	Сумма "26.09.2025": 0.00	Сумма "26.09.2025": 0.00	Сумма "26.09.2025": 0.00
^ CreditLine (1)	Сумма "CreditLine": 131.856.16	Сумма "CreditLine": 0.00	Сумма "CreditLine": 0.00	Сумма "CreditLine": 0.00
^ ООО Фомин (	Сумма "ООО Фомин": 131.856.16	Сумма "ООО Фомин": 0.00	Сумма "ООО Фомин": 0.00	Сумма "ООО Фомин": 0.00
^ 32451 (1)	Сумма "32451": 131.856.16	Сумма "32451": 0.00	Сумма "32451": 0.00	Сумма "32451": 0.00
^ Процент	Сумма "Процентный платеж": 131.856.16	Сумма "Процентный платеж": 0.00	Сумма "Процентный платеж": 0.00	Сумма "Процентный платеж": 0.00
>	131,856.16	0.00	0.00	0.00

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. "[Работа с таблицами](#)").

3.3.2 Платежная позиция

Платежная позиция отражает текущее состояние ликвидности банка на определённый момент времени. Рассчитывается как разница между ожидаемыми поступлениями и обязательствами на заданную дату, т.е. это остаток средств на корреспондентских счетах Банка с указанием сумм притока и/или оттока средств и их назначений в течение дня.

По умолчанию:

- ✓ для отчета установлена текущая дата;
- ✓ для отображения скрыты следующие столбцы:
 - продукт;
 - контрагент;
 - договор;
 - тип платежа
- ✓ установлена группировкой по следующим параметрам:
 - направление
 - тип счета

Управление денежной позицией / Платёжная позиция

Отчетная дата: 29.11.2024

Прогноз остатков

Платежная позиция

Группировать

НАПРАВЛЕНИЕ

затем

ТИП СЧЕТА

Найти

Экспорт

перетяните сюда столбцы для группировки

Направление, Тип с	Дата и время платежа	RUB (Факт)	RUB (План)	Отклонение (RUB)	Отклонение % (RUB)	USD (Факт)	USD (План)	Отклонение (USD)	Отклонение % (USD)	Прочие валюты (Факт)	Прочие валюты (План)
^ Поступление (2)		Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 9.0	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 1.1	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 0.0	Сумма "Поступление": 0.0
^ НОСТРО (3)		Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 133.81	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00	Сумма "НОСТРО": 0.00
>	29.11.2024	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	430.56	0.00	0.00	0.00	0.00
>	29.11.2024	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	430.56	0.00	0.00	0.00	0.00
>	29.11.2024	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	272.69	0.00	0.00	0.00	0.00
^ РКЦ (1)		Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 9,000,000.0	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00	Сумма "РКЦ": 0.00
^ Выбытие (1)		Сумма "Выбытие": -409.8	Сумма "Выбытие": -496.50	Сумма "Выбытие": 120.00	Сумма "Выбытие": -2.91	Сумма "Выбытие": 0.00	Сумма "Выбытие": 0.00	Сумма "Выбытие": 0.00	Сумма "Выбытие": 0.00	Сумма "Выбытие": 0.00	Сумма "Выбытие": 0.00
		Сумма RUB (Факт): -409 880 000.00	Сумма RUB (План): -497 500 000.00	Сумма Отклонение: 120 000.00		Сумма USD (Факт): 0.00	Сумма USD (План): 1 133.81	Сумма Отклонение: 0.00		Сумма (Факт): 0.00	Сумма (План): 0.00

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. "[Работа с таблицами](#)").

3.3.3 Прогноз остатков

Для расчета прогнозного значения остатка необходимо выбрать Дату окончания расчета.

По умолчанию Дата начала расчета и Дата окончания расчета равны текущей дате.

Для просмотра прогнозного значения остатка на корреспондентском счете необходимо выбрать счет.

Управление денежной позицией / Платёжная позиция

Отчетная дата 29.11.2024

Прогноз остатков

Платёжная позиция

Счета

Дата начала расчета 29.11.2024 Дата окончания расчета 29.11.2024

Найти

Триangles

Тип счета	Счет	Валюта
НОСТРО	30110504000000000225	USD
РКЦ	30103810400000000225	RUB

Прогнозные значения остатка

Дата	Входный остаток	Требования	Обязательства	Исходный остаток
29.11.2024	5 236 235 895,00	9 000 000,00	-416 380 000,00	4 828 855 895,00

3.4 Управление активами и пассивами

Функционал для возможности анализировать результаты деятельности банка.

3.4.1 Посделочный отчет за дату

Отчет содержит список всех сделок за выбранную дату и позволяет детально проанализировать каждую сделку, проведенную через систему.

При запуске отчета пользователю в новой вкладке браузера открывается форма для выбора параметров для построения отчета:

Инструмент

Отчетная дата: 29.11.2024

Название продукта: Bond Очистить поле

Типология продукта: IRDBOND Очистить поле

Информация о сделке

Внешний номер сделки: 0 Очистить поле

Контрагент: CPTY000001 Очистить поле

Портфель: BondDeals Очистить поле

Статус: Активная Очистить поле

Очистить форму

Найти Отмена

Для полей "Контрагент", "Портфель", и "Статус" доступен мультिवыбор.

По кнопке **Найти** строится посделочный отчет:

Отчетная дата: 29.11.2024

Экспорт > Сделки >

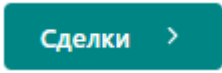
	Номер сд № : : : : : № : : : : : Внешний номер сделки № : : : : : Внешний номер контракта № : : : : : Номер кон № : : : : : Название п № : : : : : Типологи
☒	2840115410687301Облигация
☐	281512121127301Облигация
☐	3255115510697301Облигация
☐	3105115610707251Кредит
☐	2890115310677701Срочный депозит
☐	2925115210664801Срочный депозит
☐	3120114610604601Кредитная линия
☐	2860131150115651РЕПО облигация откупная

Строк на странице 50 < 1 2 >

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. "[Работа с таблицами](#)")

3.4.2 Просмотр сделки и Cash flow

Для просмотра деталей по сделке (параметры сделки, рассчитанный cash flow и др.)

- ✓ пользователь отмечает в чекбоксе сделку,
- ✓ сверху становится активной кнопка ,
- ✓ по нажатию на кнопку в выпадающем списке пользователь выбирает "Открыть",
- ✓ открывается модальное окно с формой сделки со всеми параметрами:

Сделка - Номер сделки: 28401 ×

Облигация

Внешний номер сделки	1068	Номер сделки	28401	Статус сделки	Активная	Типология		Отчетная дата	27.11.2024
Внешний номер контракта		Номер контракта	154	Источник сделки		Компания			

Финансовые параметры

Генератор		Свойства генератора		Параметры букирования	Другие параметры	
Направление сделки				Портфель	BondDeals	
Инструмент			Номинал	1 000	Контрагент	Российская Федерация
Чистая цена		НКД	0	/		
Грязная цена		Количество бумаг	0			
Сумма сделки	3 880 000		RUB			
Дата сделки	29.11.2024	Дата завершения	12.03.2036			

Нога #1 Потоки платежей

Параметры ноги		Рыночные данные	
Тип ставки			
Индекс		x	
Валюта платежей	RUB	Частота платежей	
Конвенция	ACT/365	Параметры расписания	
Ставка	0.12	1-ый фиксинг	
Спред	0.		

Форма сделки содержит всю подробную информации по сделке. Все данные доступны только для чтения.

По кнопке [Потоки платежей](#) открывается модальное окно с формой денежного потока (Cash flow).

Экспорт >

OK **Закреть**

(см. п. "[Работа с таблицами](#)").

3.4.3 Сверочный отчет за дату

Отчет отражает разницу между двумя расчетами cash flow за разные даты.

При запуске отчета пользователю открывается форма для выбора параметров для построения отчета:

Рабочий стол Сверочный отчет

Отчетный период

Дата начала выборки Очистить поле

Дата завершения выборки Очистить поле

Инструмент

Название продукта Очистить поле

Типология продукта Очистить поле

Информация о сделке

Внешний номер сделки Очистить поле

Контрагент Очистить поле

Портфель Очистить поле

Статус Очистить поле

Очистить форму

Для полей "Контрагент", "Портфель", и "Статус" доступен мультिवыбор.

По кнопке появляется модальное окно для выбора полей для группировки:

Поля для группировки

☐ Выбрать все

☐ Валюта

☐ Портфель

☐ Тип продукта

☐ Типология

☐ Инструмент

☐ Статус

Все поля опциональны.

По кнопке  открывается отчет с выбранной группировкой:

Рабочий стол Сверочный отчет Сверочный отчет за 27.11.2024-29.11.2024 

☐ Выбрать все ☐ Валюта ☐ Портфель ☐ Тип продукта ☐ Типология ☐ Инструмент ☐ Статус

Найти

Валюта платежа	Портфель	Тип продукта	Типология проду	Инструмент	Статус сделки	Номер сделки
RUB	BondDeals	Bond			Активная	28151
RUB	BondDeals	Bond			Активная	28401
RUB	BondDeals	Bond			Активная	30101
RUB	BondDeals	Bond			Активная	30151
RUB	BondDeals	Bond			Активная	30501
RUB	BondDeals	Bond			Активная	31351
RUB	BondDeals	Bond			Активная	31451
RUB	BondDeals	Bond			Активная	31751
RUB	BondDeals	Bond			Активная	32101

Группировка будет предустановлена согласно параметрам, выбранным на предыдущем шаге.

Для изменения группировки необходимо поставить/снять чек-бокс с нужного поля и нажать кнопку 

При выборе хотя бы одного параметра для группировки автоматически добавляется группировка по валюте для исключения суммирования данных в разных валютах.

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. "[Работа с таблицами](#)").

3.4.4 Отчет с группировкой

Другое представление посделочного отчета. При выборе отчета открывается форма для выбора атрибутов для построения посделочного отчета.

Для построения отчета необходимо выбрать хотя бы одно поле для отчета. Поля для группировки становятся доступны для выбора после выбора хотя бы двух полей для отчета.

Порядок группировки будет определяться порядком выбора полей для группировки.

Рабочий стол

Сверочный отчёт

Сверочный отчет за 27.11.2024-29.11.202

Отчёт с группировкой

Русский

Выберите поля для отчёта:

Отчетная дата

29.11.2024

Выбрать все

☐ ISIN

☐ Трейдер

☒ Плательщик

☐ Тип расчетов

☐ Дата расчетов

☐ Отчетная дата

☐ Мультипликатор

☐ Дата транзакции

☐ Частота платежей

☒ Типология продукта

☐ Дата начала действия

☐ Валюта базового актива

☐ Дата предпоследнего платежа

☐ Дата завершения льготного периода

☐ Конвенция корректировки рабочих дней

☐ Спред

☐ Портфель

☐ 1-й фиксинг

☐ Бизнес-центр

☐ Валютный курс

☐ Дата фиксинга

☐ Номер контракта

☒ Источник сделки

☐ Метод переоценки

☐ Целевое назначение

☐ Дата первого платежа

☐ Внешний номер контракта

☐ Плательщик фиксированной ставки

☐ Дата окончания начисления процентов

☐ Периодичность пересмотра процентной ставки

☐ Индекс

☐ Компания

☐ Номер сделки

☐ Пользователь

☐ Базовый актив

☐ Номинал сделки

☐ Покупка/Продажа

☒ Валюта платежей

☐ Номер контрагента

☐ Дата начала сделки

☒ Дата окончания сделки

☐ Конвенция подсчета дней

☐ Ставка

☐ Инструмент

☐ Сумма сделки

☐ Валюта сделки

☒ Статус сделки

☐ Название рынка

☐ Дата экспирации

☐ Платить/Получать

☐ Название продукта

☐ Внешний номер сделки

☐ Тип процентной ставки

Выберите поля для группировки:

☐ Плательщик

☒ Статус сделки

☐ Источник сделки

☐ Валюта платежей

☐ Типология продукта

☐ Дата окончания сделки

Сформировать

По кнопке **Сформировать** в текущем окне формируется отчет:

Отчетная дата: 29.11.2024

1 из 104 строк выбрано Очистить выбор

Найти **Сделки** > перетаскивайте сюда столбец для группировки

	Номер сделки	Номер контракта	Внешний номер сделки	Внешний номер контракта	Номер контрагента
☒	32551	155	1069		7301
☐	31051	156	1070		7251
☐	28151	212	112		7301
☐	28901	153	1067		7701
☐	28401	154	1068		7301
☐	31551	304	5004		5651
☐	30051	305	5005		5651
☐	30151	211	111		7301
☐	29251	152	1066		4801
☐	28601	311	5011		5651
☐	31201	146	1060		4601
☐	30901	210	110		4601
☐	33001	310	5010		5651
☐	30551	145	1059		7601
☐	32651	151	1065		6801
☐	31851	208	108		5901

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. ["Работа с таблицами"](#)).

А также просмотр [деталей по сделке](#).

3.4.5 Расчет ЧПД

Управление активами и пассивами / Чистый процентный доход

Отчетная дата29.11.2024

Горизонт расчёта ЧПД в годах5Сбросить

Конечная дата расчёта ЧПД29.11.2029

Рассчитать

Компонент	RUB	USD	Итого
Валютный курс на отчетную дату	1,00	109,578	
Контрактные процентные доходы/расходы	1 843 724 910,49	339 178,23	1 880 891 450,41
Процентные доходы/расходы после пролонгации	-994 779 538,96	-96 998,91	-1 005 408 504,39
Чистый Процентный Доход (ЧПД)	848 945 371,53	242 179,32	875 482 946,02

Горизонт расчета ЧПД в годах предустановлен по умолчанию равным 5. Доступно для изменения.

При изменении горизонта автоматически пересчитывается конечная дата расчёта ЧПД.

Есть возможность менять отчётную дату на любую историческую дату, на которую есть готовый End of Day расчёт:

Отчетная дата29.11.2024

<Ноябрь 2024>

Пн	Вт	Ср	Чт	Пт	Сб	Вс
28	29	30	31	1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	1

По кнопке

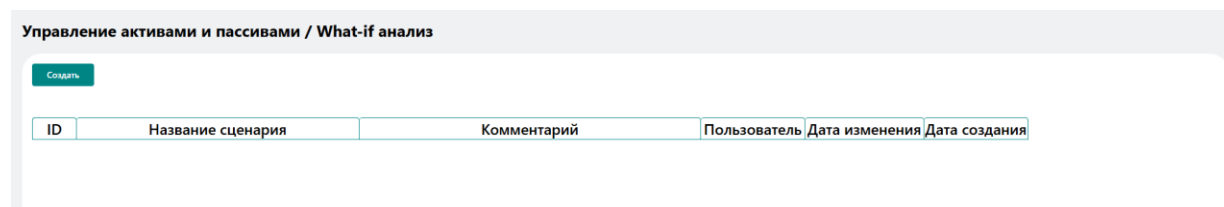
Рассчитать

 отчет пересчитывается с выбранными параметрами.

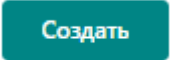
3.4.6 What-if анализ

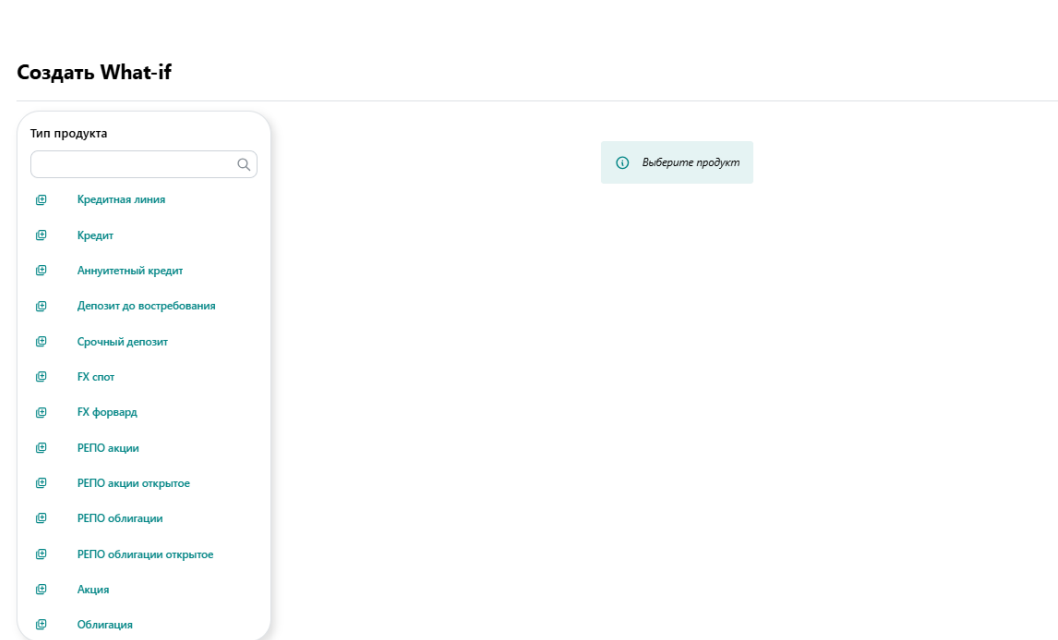
Учёт влияния синтетических сделок на денежную позицию, сверочный отчет, ликвидность и т.д.

При первом открытии страницы пользователь видит пустую таблицу



3.4.6.1 Создание what-if сценария

По нажатию кнопки  открывается модальное окно создания what-if сценария:



После выбора продукта становятся доступны поля для заполнения параметров сделки:

Отчетная дата

Название сценария

Комментарий

Тип продукта	Кредитная линия
Финансовые параметры +	
Валюта сделки	↕
Инструмент	
Валюта инструмента	
Направление	↕
Старт	📅
Завершение	📅
Сумма сделки	0 ↕
Количество бумаг	
ISIN	
Тип ставки	↕
Индекс	

Очистить форму

Сохранить
Отмена

При наведении курсора на заголовок столбца становятся доступны кнопки для копирования () и удаления () типа продукта:



После сохранения сценария пользователь возвращается на страницу, где в таблице будет отображаться созданный сценарий.

Управление активами и пассивами / What-if анализ

Создать

ID	Название сценария	Комментарий	Пользователь	Дата изменения	Дата создания	
1352	Портфель длинных депозитов 700 млн. руб.	Привлечение портфеля длинных депозитов	isherman-irb	10.09.2025	10.09.2025	...
1304	Проверка расчета по нормативам	Кредит + срочный депозит. Отчетная дата 29.11.2024	nvnosova-irb	01.09.2025	01.09.2025	...
1303	Портфель длинных депозитов	Привлечение портфеля длинных депозитов	isherman-irb	01.09.2025	01.09.2025	...

По кнопке  в строке сценария доступны следующие действия:



- Просмотр
- Изменить
- Сохранить как
- Удалить

Просмотр:
открывается модальное окно с параметрами сделок в выбранном сценарии

×

Сценарий: Портфель длинных депозитов 700 млн. руб.
Описание: Привлечение портфеля длинных депозитов

Номер сделки	Тип продукта	Валюта сделки	Инструмент	Валюта инструмента	Направление	Старт	Завершение
33052	TermDeposit	RUB			Receive	2024-11-29	2029-11-29

Заккрыть

Изменить:

открывается окно создания what-if сценария (см. [Создание what-if сценария](#)) с параметрами ранее созданных сделок.
В этом случае изменения вносятся в текущий сценарий.

Создать What-if

Тип продукта

Кредитная линия

Кредит

Амортизационный кредит

Депозит до востребования

Срочный депозит

FX спот

FX форвард

РЕПО акции

РЕПО акции открытое

РЕПО облигации

РЕПО облигации открытое

Акция

Облигация

Отчетная дата

29.11.2024

Название сценария

Портфель длинных депозитов 700 млн. руб.

Комментарий

Привлечение портфеля длинных депозитов

Тип продукта	Срочный депозит
Финансовые параметры	+
Валюта сделки	RUB
Инструмент	
Валюта инструмента	
Направление	Receive
Старт	29.11.2024
Завершение	29.11.2029
Сумма сделки	700 000 000
Количество бумаг	
ISIN	
Тип ставки	Фиксированная
Индекс	

Очистить форму

Сохранить

Отмена

Сохранить как:

открывается модальное окно создания what-if сценария (см. [Создание what-if сценария](#)) с параметрами всех сделок.
В этом случае создается новый сценарий.

Создать What-if

Тип продукта

Кредитная линия

Кредит

Амортизационный кредит

Депозит до востребования

Срочный депозит

FX спот

FX форвард

РЕПО акции

РЕПО акции открытое

РЕПО облигации

РЕПО облигации открытое

Акция

Облигация

Отчетная дата

29.11.2024

Название сценария

Портфель длинных депозитов 700 млн. руб.

Комментарий

Привлечение портфеля длинных депозитов

Тип продукта	Срочный депозит
Финансовые параметры	+
Валюта сделки	RUB
Инструмент	
Валюта инструмента	
Направление	Receive
Старт	29.11.2024
Завершение	29.11.2029
Сумма сделки	700 000 000
Количество бумаг	
ISIN	
Тип ставки	Фиксированная
Индекс	

Очистить форму

Сохранить

Отмена

Удалить

Происходит удаление сценария

3.4.6.2 Расчеты с What-if

В дальнейшем для добавления сценария к расчету необходимо:

- ✓ нажать кнопку

What-if >

 на странице раздела
- ✓ выбрать "Загрузить"
- ✓ в открывшемся модальном окне со списком сценариев на выбранном сценарии нажать

...

ID	Название сценария	Комментарий	Пользователь	Дата изменения	Дата создания	
1352	Портфель длинных депозитов 700 млн. руб.	Привлечение портфеля длинных депозитов	isherman-irb	10.09.2025	10.09.2025	...
1304	Проверка расчета по нормативам	Кредит + срочный депозит. Отчетная дата 29.11.2024	mlnosova-irb	01.09.2025	01.09.2025	...
1303	Портфель длинных депозитов	Привлечение портфеля длинных депозитов	isherman-irb	01.09.2025	01.09.2025	...

- ✓ далее выбрать «Загрузить»

3.4.7 Стресс-тестирование

Отчет позволяет оценить достаточность располагаемого и необходимого буфера ликвидности в случае реализации стрессового сценария.

Стрессовый сценарий и Контрактные погашения (Баланс)

Управление активами и пассивами / Стресс-тестирование

Отчетная дата 29.11.2024

Валюта: Все валюты (RUB) What-if >

Стресс-тестирование

Стресс: 195 148 134 108 63 16

Эквивалент: 100 100 100 100 100 100

Активы

	31.12.2024	31.01.2025	28.02.2025	31.03.2025	30.04.2025	31.05.2025
Bond	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00
Equities	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00
Interest Receivable	575 715,441	531 285,396	361 136,787	302 102,23	256 501,679	91 733,732
Loans	3 007 200,00	2 792 400,00	2 577 600,00	2 362 800,00	2 148 000,00	1 933 200,00
REPO rev	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total assets	4 742 016,441	4 482 786,396	4 097 837,787	3 824 003,23	3 563 802,679	3 184 034,732

Пассивы

	31.12.2024	31.01.2025	28.02.2025	31.03.2025	30.04.2025	31.05.2025
Deposit	2 609 006,40	1 898 332,80	1 525 305,60	1 525 305,60	1 525 305,60	1 525 305,60
Interest Payable	78 440,072	78 440,072	56 822,258	56 822,258	56 822,258	0,00
REPO dir	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total liabilities	2 687 446,472	1 976 772,872	1 582 127,858	1 582 127,858	1 582 127,858	1 525 305,60
Pledge	2 250 000,00	2 655 000,00	2 650 000,00	2 350 000,00	2 045 000,00	1 675 000,00

Баланс

Баланс Профиль

	30.11.2024	31.12.2024	31.01.2025	28.02.2025	31.03.2025	30.04.2025	31.05.2025
Активы							
Bond	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00
Equities	327 100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Interest Receivable	617 703,681	575 715,441	531 285,396	361 136,787	302 102,23	256 501,679	91 733,732
Loans	4 296 000,00	4 295 973,411	4 295 946,379	4 295 918,896	4 295 890,955	4 295 862,549	4 295 833,669
REPO rev	610 000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total assets	6 682 804,681						
Пассивы							
Deposit	4 368 000,00	3 640 000,00	3 640 000,00	3 120 000,00	3 120 000,00	3 120 000,00	2 496 000,00
Interest Payable	92 118,036	78 440,072	78 440,072	56 822,258	56 822,258	56 822,258	0,00
REPO dir	610 000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total liabilities	5 070 118,036						

Стрессовый сценарий и Профиль

Управление активами и пассивами / Стресс-тестирование

Валюта: Все валюты (RUB) What-if >

Стресс-тестирование

Стресс	195	148	134	108	63	16
Экшн	100	100	100	100	100	100

АКТИВЫ

	31.12.2024	31.01.2025	28.02.2025	31.03.2025	30.04.2025	31.05.2025
Bond	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00	832 001,00
Equities	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00	327 100,00
Interest Receivable	575 715,441	531 285,396	361 136,787	302 102,23	256 501,679	91 733,732
Loans	3 007 200,00	2 792 400,00	2 577 600,00	2 362 800,00	2 148 000,00	1 933 200,00
REPO rev	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total assets	4 742 016,441	4 482 786,396	4 097 837,787	3 824 003,23	3 563 602,679	3 184 034,732

ПАССИВЫ

	31.12.2024	31.01.2025	28.02.2025	31.03.2025	30.04.2025	31.05.2025
Deposit	2 609 006,40	1 896 332,80	1 525 305,60	1 525 305,60	1 525 305,60	1 525 305,60
Interest Payable	78 440,072	78 440,072	56 822,258	56 822,258	56 822,258	0,00
REPO dir	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total liabilities	2 687 446,472	1 974 772,872	1 582 127,858	1 582 127,858	1 582 127,858	1 525 305,60
Pledge	2 250 000,00	2 655 000,00	2 650 000,00	2 350 000,00	2 045 000,00	1 675 000,00

Профиль

Баланс Профиль

Профиль

	M1	M2	M3	M4	M5	M6
contractual						
flat						
contractual						
profile 2	70%	65%	60%	55%	50%	45%
contractual						

Профиль

	M1	M2	M3	M4	M5	M6
profile	59.73%	43.48%	34.92%	34.92%	34.92%	34.92%
contractual						
contractual						

В основной таблице отражены данные ежемесячно за 6 месяцев вперед, рассчитанные по cash flow.

По умолчанию стресс-тест рассчитывается в рамках End of Day расчетов.

Далее по кнопке **What-if >** можно создать новый what-if сценарий или добавить существующий к расчету (см. [Создание what-if сценария](#)). При добавлении what-if сценария происходит расчет данных, в меню слева добавляется новая вкладка с названием сценария

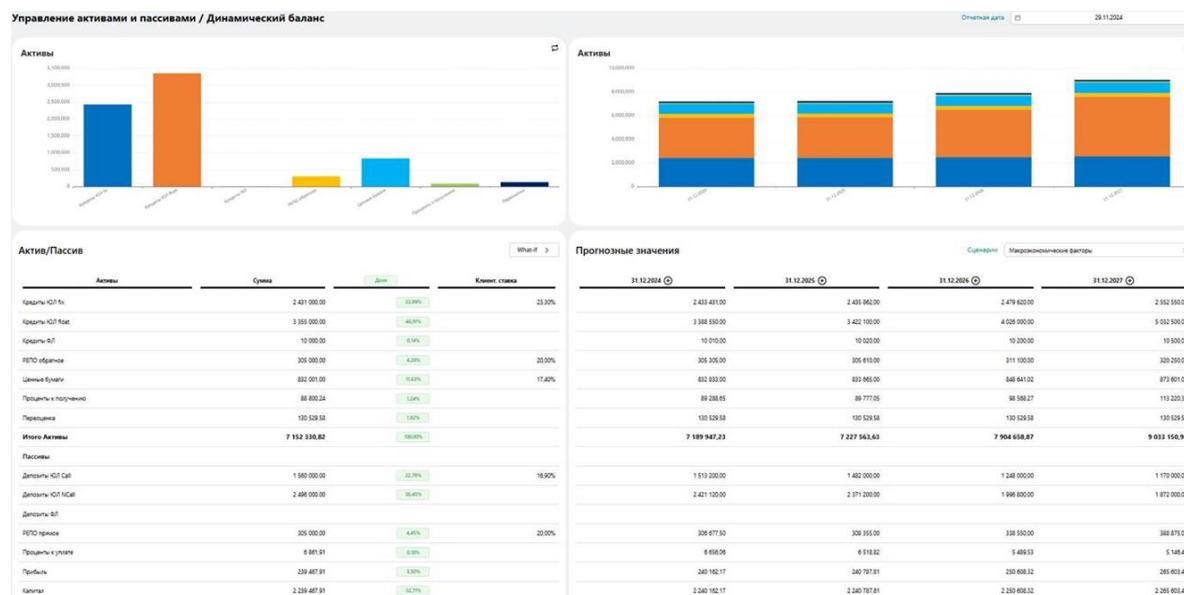
Значения, выделенные красным цветом, отражают необходимость принятия управленческих решений, для выравнивания баланса (увеличение пассивных или сокращение активных операций), при наступлении негативных сценариев.

Кнопка **Подробнее** сворачивает и разворачивает данные "Активы" и "Пассивы", а также данные "Профиль" и "Баланс".

Кнопки  и  позволяют свернуть и развернуть таблицы в разрезе продуктов.

3.4.8 Динамический баланс

Динамический баланс позволяет оценить объемы клиентских портфелей, средневзвешенную процентную ставку по продуктам привлечения и размещения, показатели рентабельности (левая часть экрана), а также динамику баланса на горизонте 3-х лет, с помесечной разбивкой (правая часть экрана)

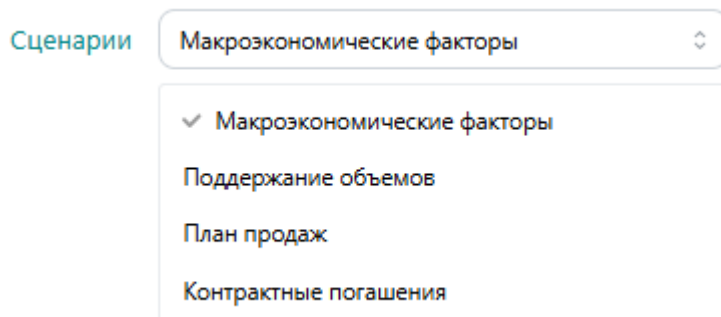


По кнопке  доступно переключение графического отображения "Активы"/"Пассивы".

По умолчанию Динамический баланс рассчитывается в рамках End of Day расчетов.

В разделе "Активы/Пассивы" по кнопке  можно создать новый what-if сценарий или добавить существующий к расчету (см. [Создание what-if сценария](#)). При добавлении what-if сценария происходит расчет данных, в меню слева добавляется новая вкладка с названием сценария

В разделе "Прогнозные значения" для выбора доступен ряд сценариев:



3.5 Управление ликвидностью

Сервис отражает расчёты нормативов ликвидности и TS-метрик согласно стандартам финансовых рынков и требований регулятора.

3.5.1 Отчет по нормативам

При выборе отчета открывается форма в текущем окне:

Управление ликвидностью / Отчет по нормативам

Отчет по нормативам

What-if

Фильтрация по имени

Нормативы

- ☐ H2
 - ☐ Лам
 - ☐ Счета без кода
 - ☐ 30210
 - ☐ 30235
 - ☐ 30413
 - ☐ 30416
 - ☐ 30417
 - + ☐ 8720
 - + ☐ 8742
 - + ☐ 8894
 - + ☐ 8921
 - + ☐ 8962
 - + ☐ 8967
 - + ☐ 8972
 - + ☐ Овм
 - + ☐ H3
 - + ☐ H4
 - + ☐ H26
 - + ☐ H28

Значения

Отчетная дата 29.11.2024

Найти

Норматив	Значение норматива, %	Граница, %
H2	115,31%	>= 15%
H3	93,54%	>= 50%
H4	150,67%	<= 120%
H26	124,64%	>= 100%
H28	110,91%	>= 100%

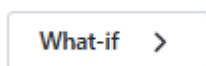
Пользователю доступна возможность выбрать отчетную дату в правом верхнем углу:

Отчетная дата 29.11.2024

Список нормативов разворачивается по кнопке +:

- ✓ на стартовом экране видны значения нормативов ликвидности, рассчитанные на отчетную дату
- ✓ далее раскрываются компоненты норматива (например, Лам/Овм)
- ✓ далее можно раскрыть сам компонент (например, Овм посмотреть суммы на кодах ЦБ РФ)
- ✓ на последнем уровне открывается отдельный код ЦБ, где можно посмотреть суммы на счетах 2ого порядка.

По умолчанию нормативы рассчитываются в рамках End of Day расчетов.



По кнопке можно создать новый what-if сценарий или добавить существующий к расчету (см. [Создание what-if сценария](#)).

При добавлении what-if сценария происходит расчет данных, в меню слева добавляется новая вкладка с названием сценария:

Управление ликвидностью / Отчет по нормативам

Отчет по нормативам

What-if >

1352 сценария

Нормативы

- H2
 - Лам
 - + счета без кода
 - 8720
 - 47408
 - 52601
 - + 8742
 - + 8894
 - + 8921
 - + 8962
 - + 8967
 - + 8972
 - + Овм
 - + H3
 - + H4
 - + H26
 - + H28

Значения

Отчетная дата 29.11.2024

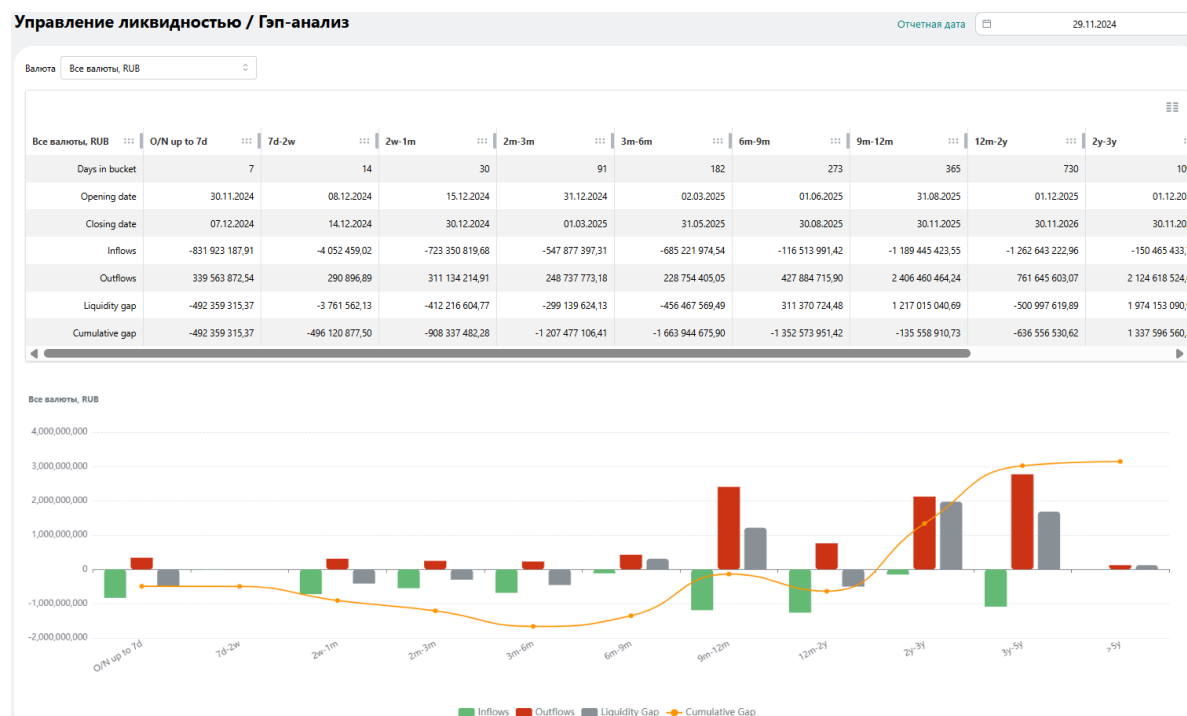
Найти

Части норматива	Сумма
Лам	1 626 839 182,88
Овм	1 550 824 725,83

В списке нормативов доступен поиск на уровне счетов.

В таблице "Значения" отражаются данные по выбранным слева нормативам. Для работы с таблицей доступны фильтры по столбцам и поиск по данным в таблице.

3.5.2 Гэп-анализ



Колонки, представленные в таблице:

- ✓ days in bucket - количество дней от отчетной даты до closing date (конечной даты временного интервала)
- ✓ opening date/closing date - начальная и конечная дата временного интервала
- ✓ inflows - притоки
- ✓ outflows - оттоки
- ✓ liquidity gap = притоки – оттоки
- ✓ cumulative gap - накопленная сумма по liquidity gap, в первом временном интервале liquidity gap = cumulative gap

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. ["Работа с таблицами"](#)).

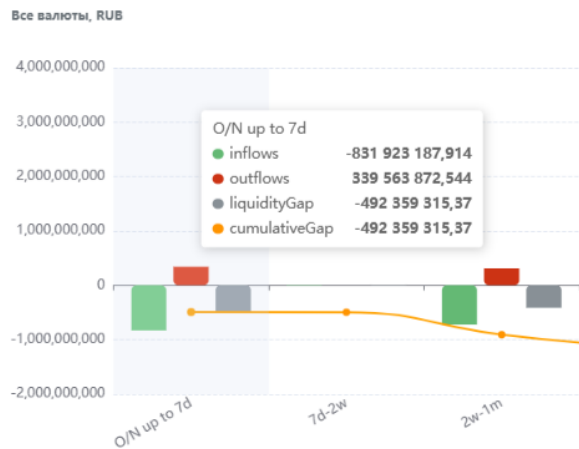
Расчёт гэпов ликвидности по временным бакета и отражение их на графике возможны как по всем валютам в сумме (в пересчёте по курсам ЦБ РФ на отчётную дату), так и в каждой валюте в отдельности.

За это отвечает переключатель сверху:

Валюта: Все валюты, RUB

- ✓ Все валюты, RUB
- Только долларовые сделки, USD
- Только рублевые сделки, RUB

При наведении курсора на график отображаются показатели выбранного периода:



Пользователю доступен выбор отчетной даты в правом верхнем углу:

Отчетная дата

< Ноябрь 2024 >

Пн	Вт	Ср	Чт	Пт	Сб	Вс
28	29	30	31	1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	1

3.6 Рыночные данные

В данном разделе отражены рыночные данные за текущий день.

3.6.1 FX спот

В этом разделе содержит информация об актуальных курсах обмена основных мировых валют.

Рыночные данные / FX-спот

Отчетная дата 29.11.2024

Валютные пары

Название валютной пары

Источник котировки

ATS/RUB

ITL/RUB

CHF/RUB

LVL/RUB

XEU/RUB

ZAR/RUB

VND/RUB

AUD/RUB

MDL/RUB

BOB/RUB

IDR/RUB

AMD/RUB

TRY/RUB

LBP/RUB

TJS/RUB

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

CBR FX Rate

Значения

Номинал

Значение

10

60.0409

Сохранить

Отмена

3.6.2 Цены облигаций

Актуальная информация о ценах по облигациям.

Рыночные данные / Цены облигаций

Отчетная дата 29.11.2024

Краткое наименование

Дата торгов

ISIN

Торговая площадь

Yield at Close, %

Yield to Last, %

Yield to Indicative, %

YTM, %

Y10, %

Duration, Years

Оффильтровать по Кра...

Оффильтровать по Дат...

Оффильтровать по ISIN

Оффильтровать по Тор...

Оффильтровать по Yiel...

Оффильтровать по Yiel...

Оффильтровать по Yiel...

Оффильтровать по YL...

Оффильтровать по Y10...

Оффильтровать по Dur...

RUS-29

29.11.2024

RU000A0ZYNN4

MOEX

0

ОФЗ 29014

29.11.2024

RU000A101N52

MOEX

0

ОФЗ 26207

29.11.2024

RU000A0IS3W6

MOEX

21.58

ОФЗ 29008

29.11.2024

RU000A0IV4P3

MOEX

18.2

RUS-35

29.11.2024

RU000A100659

MOEX

0

ОФЗ 29010

29.11.2024

RU000A0IV4Q1

MOEX

17.46

RUS-26

29.11.2024

RU000A0WHNA4

MOEX

15.22

ОФЗ 26246

29.11.2024

RU000A108EE1

MOEX

17.28

RUS-47

29.11.2024

RU000A0IXU14

MOEX

0

ОФЗ 29007

29.11.2024

RU000A0IV4M0

MOEX

17.84

ОФЗ 29009

29.11.2024

RU000A0IV4N8

MOEX

19.07

ОФЗ 26247

29.11.2024

RU000A108EF8

MOEX

17.39

ОФЗ 26245

29.11.2024

RU000A108EG6

MOEX

16.84

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. ["Работа с таблицами"](#)).

3.6.3 Цены акций

Актуальная информация о ценах по акциям и данные по дивидендам

Рыночные данные / Цены акций

Отчетная дата 29.11.2024

Цены акцийДивиденды

Найти

Наименование акций	Дата торгов	Страна	Торговая площадка	ISIN	Котировка покупателя	Котировка продавца	Последняя котировка	Цена открытия	Цена закрытия
Сбербанк России, акция O	29.11.2024	Россия	Московская биржа Т+ О:					236.49	0.00
									236.49

Строк на странице201

Для работы с данными доступны стандартные инструменты работы с таблицами (см. п. ["Работа с таблицами"](#)).

3.6.4 Процентные ставки

Раздел содержит информацию по Кривым рыночных ставок и Процентным индексам



Рыночные данные / процентные ставки

Отчетная дата: 29.11.2024

Кривые рыночных ставок

Процентные индексы

Процентные индексы

Найти

Название индекса	Валюта базового актива
CSRF Key Rate Swap Curve	RUB
SOFR	USD

Значения

Найти

Срок	Значение
29.11.2024	4.59

Сохранить

Отмена

3.7 Исторические данные

Рыночные данные за предыдущие периоды. Отчеты аналогичны разделу "Рыночные данные", но отражают исторические данные. Для отображения данных необходимо выбрать период отчета:

Дата начала
выборки

Дата окончания
выборки

3.8 Конфигурация

Система включает в себя несколько ключевых справочников, которые помогают эффективно управлять информацией и оптимизировать рабочие процессы.

3.8.1 Календари

Сервис "Календарь" предназначен для работы со всеми взаимодействиями системы с календарными датами.

Российский календарь отражает данные по производственному календарю РФ
Календарь США рассчитывается согласно правилам федеральных американских праздников.

Кроме использования фактических календарей с известными нерабочими /праздничными днями поддерживается также прогноз нерабочих /праздничных дней для будущих периодов.

Конфигурация / Календари

Список календарей

Найти

Название календаря	Описание
RUMO	Российский календарь
USNY	Календарь США

Свойства

Отчетная дата 29.11.2024

Название календаря RUMO

Описание Российский календарь

Страна Россия

Календарь

< Ноябрь 2024 >

Пн	Вт	Ср	Чт	Пт	Сб	Вс
28	29	30	31	1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	1

Выбранный день 29.11.2024

Рабочий день Да

В списке календарей доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

В календарях для редактирования доступен признак "Рабочий день" для выбранной даты:

Рабочий день

Да

✓ Да

Нет

Сохранить

После изменения признака необходимо нажать кнопку для сохранения изменения.

3.8.2 Страны

При выборе справочника отображается таблица со списком всех стран.

Конфигурация / Страны

Страны

Найти

Название страны

Евросоюз
Китай
Россия
США

Параметры

Отчетная дата 29.11.2024

Название страны: Евросоюз

Полное название страны: Европейский союз

Описание: -01

Справочник доступен только на просмотр. В списке стран доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

После выбора страны из списка, пользователю справа отображается детальная информация по выбранной стране.

3.8.3 Форекс

При выборе справочника отображается две вкладки с таблицами всех валют и валютных пар:

Конфигурация / Форекс

Валюты | Валютные пары

Отчетная дата 29.11.2024

Валюты

Найти

Название валюты

CNY
EUR
RUB
USD

Название валюты: CNY

Полное название валюты: Юань

Страна:

Календарь:

Спот-дата (шифт):

Справочник доступен только на просмотр. В списках валют и валютных пар доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

После выбора валюты/валютной пары из списка, пользователю справа отображается детальная информация по выбранной валюте/валютной паре.

3.8.4 Портфели

При выборе справочника отображается таблица со списком всех портфелей.

Конфигурация / Портфели

Портфели

Найти

Название портфеля	Активный	Комбо-портфель
BOND_OFZ	Да	Да
BondDeals	Нет	Нет
IRDLNBR	Нет	Нет
LNBR	Да	Да
LNBR_OPENTERM	Да	Нет
LNBR_TERM	Да	Нет
LNBPdeals	Нет	Нет

Параметры

Отчетная дата 29.11.2024

Активный

Да

Комбо-портфель

Да

Название портфеля

BOND_OFZ

Описание

Название портфеля (в источнике)

Название источника

Справочник доступен только на просмотр. В списке портфелей доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

После выбора портфеля из списка, пользователю справа отображается детальная информация по выбранному портфелю.

3.8.5 Контрагенты

Справочник контрагентов содержит полную информацию обо всех клиентах/контрагентах Банка. При выборе справочника отображается таблица со списком всех контрагентов.

После выбора контрагента из списка, пользователю справа отображаются четыре вкладки с детальной информацией по выбранному контрагенту:

- ✓ Общая информация
- ✓ Реквизиты
- ✓ Рейтинги
- ✓ Счета

Организация / Контрагенты

Контрагенты

Найти

ИНН	Категория контрагента	Родитель	Активный
7703647595	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000067	Кредитные организации		Да
7705110090	Кредитные организации		Да
0000000004	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000039	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000048	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000027	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000030	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000008	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000059	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000013	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000033	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000041	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000056	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000021	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000022	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000047	Негосударственные коммерческие организации		Да
0000000058	Негосударственные коммерческие организации		Да

Параметры Отчетная дата 29.11.2024

Общая Реквизиты Рейтинги Счета

Настройка

Активный Да

Категория контрагента Негосударственные коммерческие организации

Родитель Нет

Дочерняя компания / подразделение Нет Материнская компания

Наименование

Краткое наименование контрагента ЗАО СнабСбытСнаб

Полное наименование контрагента ЗАО СнабСбытСнаб, Environmental Services

Описание

Источник

Наименование контрагента в источнике СРТУ00000000605

Название источника Zabel

Справочник доступен только на просмотр. В списке контрагентов доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

3.8.6 Облигации

Справочник «Облигации» предоставляет доступ к исчерпывающим данным о рынке долговых ценных бумаг, включая общую информацию и условия выпуска.

Справочник содержит параметры выпущенных облигаций, включая номинальную стоимость, срок погашения, купонные выплаты и прочие условия.

При выборе справочника, пользователю отображается таблица с информацией обо всех выпущенных облигациях.

Облигации

Найти

Название облигации	Эмитент	ISIN	Ставка купона, %
RUS-29	Минфин РФ	RU000A0ZYNN4	0.04375
RUS-35	Минфин РФ	RU000A1006S9	0.051
RUS-47	Минфин РФ	RU000A0JXU14	0.0525
RUS-47	Минфин РФ	RU000A0JWH44	0.0475
ОФЗ 26207	Минфин РФ	RU000A0JS3W6	0.0815
ОФЗ 26245	Минфин РФ	RU000A108EG6	0.12
ОФЗ 26246	Минфин РФ	RU000A108EE1	0.12
ОФЗ 26247	Минфин РФ	RU000A108EF8	0.1225
ОФЗ 29007	Минфин РФ	RU000A0JV4M0	
ОФЗ 29008	Минфин РФ	RU000A0JV4P3	
ОФЗ 29009	Минфин РФ	RU000A0JV4N8	
ОФЗ 29010	Минфин РФ	RU000A0JV4Q1	
ОФЗ 29014	Минфин РФ	RU000A101N52	

Параметры

Отчетная дата 29.11.2024

Общая

Эмиссия

Идентификаторы

Тип облигации

Тип купона

Краткое наименование бумаги

RUS-35

Полное наименование бумаги

RUS-35

Описание

RUS-35 lotSize: null couponRate: 0.0510

Эмитент

Минфин РФ

Тип эмитента

Субординированная

Нет

Обеспеченная

Нет

Справочник доступен только на просмотр. В списке облигаций доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

После выбора облигации из списка, пользователю справа отображаются три вкладки с детальной информацией по выбранной бумаге.

3.8.7 Акции

При выборе справочника, пользователю отображается таблица с информацией обо всех акциях.

Акции

Найти

Название инструмента	Эмитент	ISIN	Тип акции
ГМК Норильский никель акция об.	ПАО "ГМК "Норильский никель"	RU0007288411	Обыкновенная
Газпром, акция об.	ПАО "Газпром"	RU0007661625	Обыкновенная
Лукойл, акция об.	ПАО "ЛУКОЙЛ"	RU0009024277	Обыкновенная
Сбербанк России, акция об.	ПАО СБЕРБАНК	RU0009029540	Обыкновенная
Татнефть, акция об.	ПАО "ТАТНЕФТЬ"	RU0009033591	Обыкновенная

Параметры

Отчетная дата 29.11.2024

Общая

Эмиссия

Идентификаторы

Метрики

Тип акции

Обыкновенная

Голубые фишки

Да

Краткое наименование
бумаги

ГМК Норильский никель, акция об.

Полное наименование
бумаги

ГМК Норильский никель, акция обыкновенная

Краткое наименование
(англ.)

NORILSK NICKEL

Полное наименование
бумаги (англ.)

Norilsk Nickel, ordinary share

Описание

NORILSK NICKEL

Источник

CBonds

Справочник доступен только на просмотр. В списке акций доступны поиск по данным справочника и фильтр по столбцам.

После выбора акции из списка, пользователю справа отображаются четыре вкладки с детальной информацией по выбранной бумаге.

3.8.8 Стресс-тестирование

При выборе конфигурации, пользователю отображается три вкладки с информацией.

Стресс-тестирование

Профиль

Маттинг

Ввод сумм

Разблокировать

Профиль	M1	M2	M3	M4	M5	M6	Действует с
renewal rate	27.9%	36.3%	43.9%	43.9%	43.9%	43.9%	01.11.2024
profile	59.73%	43.46%	34.92%	34.92%	34.92%	34.92%	01.11.2024
renewal rate 2	25.4%	33.8%	41.4%	41.4%	41.4%	41.4%	01.11.2024
profile 2	70%	65%	60%	55%	50%	45%	29.11.2024
profile 3	41.7%	32.1%	27.7%	25.7%	23.7%	21.7%	01.11.2024
contractual	0%	0%	0%	0%	0%	0%	01.11.2024
flat	0%	0%	0%	0%	0%	0%	01.11.2024
manual	0%	0%	0%	0%	0%	0%	01.11.2024
overnight	0%	0%	0%	0%	0%	0%	01.11.2024

Данные параметры используются в End-of-day расчетах.

Профили, МAPPING и Ввод сумм доступны для редактирования ограниченному кругу лиц с определенными правами доступа.

В разделе «Профиль» редактируются значения процентных ставок, применяемых в рамках модели к определенной статье баланса

В разделе «МAPPING» настраивается соответствие статьи баланса к определенному профилю:

- Contractual – контрактные погашения
- Flat – значение на отчетную дату
- Profile – модель процент от погашений
- Renewal rate – модель процент возобновления от погашений
- Overnight – погашение в отчетную дату.

В разделе «Ввод сумм» можно задать определенные значения суммы для «Pledge» - сумма, под залог кредитного портфеля в ЦБ РФ (стрессовый сценарий)

3.8.9 Все справочники

Раздел содержит все другие справочники, используемые системой.
Доступны только на просмотр.