

# Effective Trade

Расширенная портфельная  
аналитика: модуль  
EFTR.Position Keeping



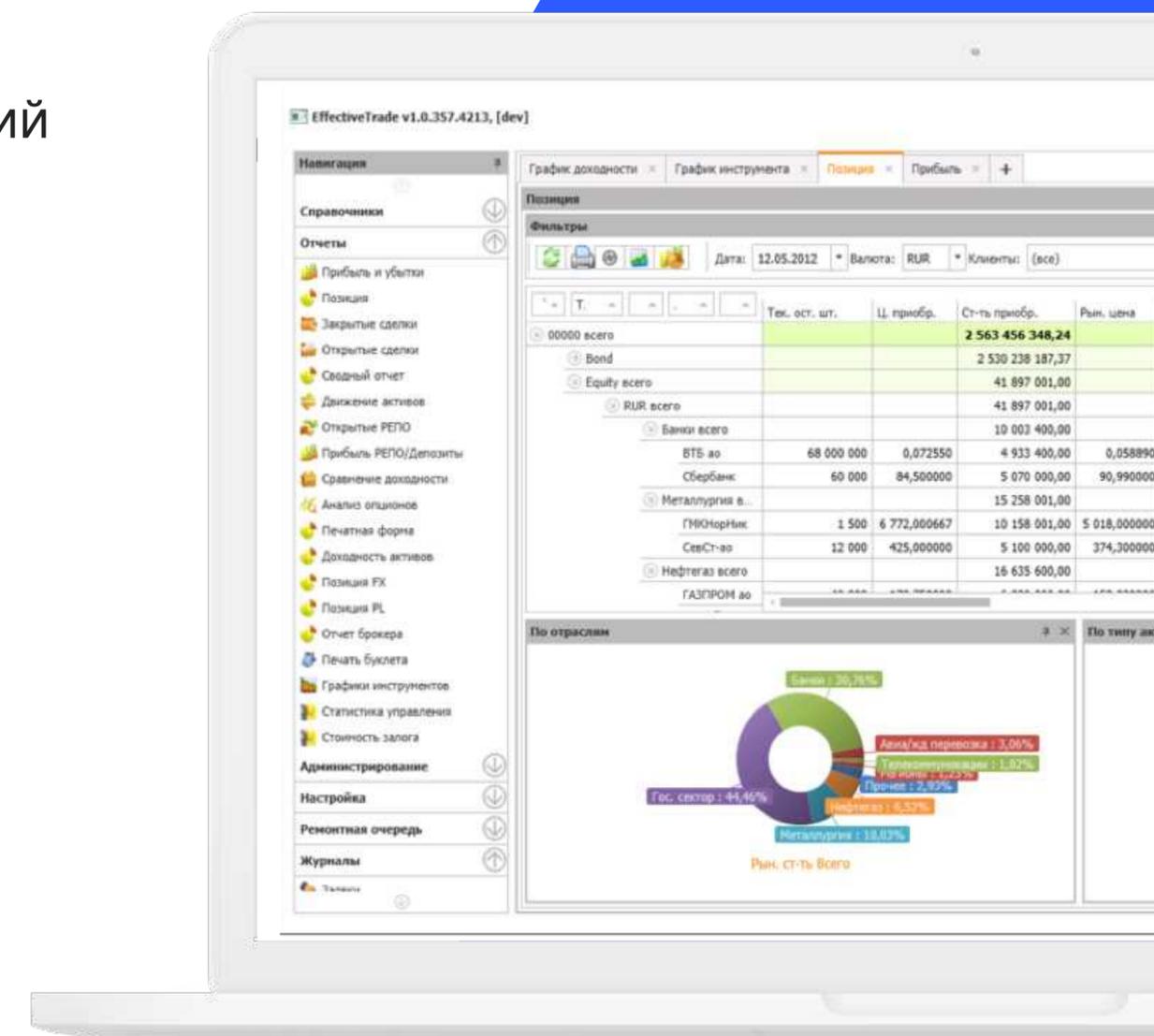
## Введение

# EffectiveTrade Position Keeping

Аналитическая база данных, предназначенная для обработки операций всех типов финансовых инструментов и всех видов сделок в режиме онлайн

## Какие задачи решает система Position Keeping:

- **Операционная эффективность.** Автоматизация процессов учета и отчетности снижает вероятность ошибок и повышает оперативность обработки данных.
- **Интеграция с другими системами.** Интегрируется с торговыми платформами, системами управления рисками и бухгалтерскими системами для обеспечения единого потока данных.
- **Отчетность и аналитика.** Предоставляет инструменты для создания отчетов и анализа данных, что помогает в принятии обоснованных инвестиционных решений.
- **Отслеживание позиций.** Позволяет в реальном времени отслеживать все открытые позиции по различным активам, включая акции, облигации, валюты и деривативы.



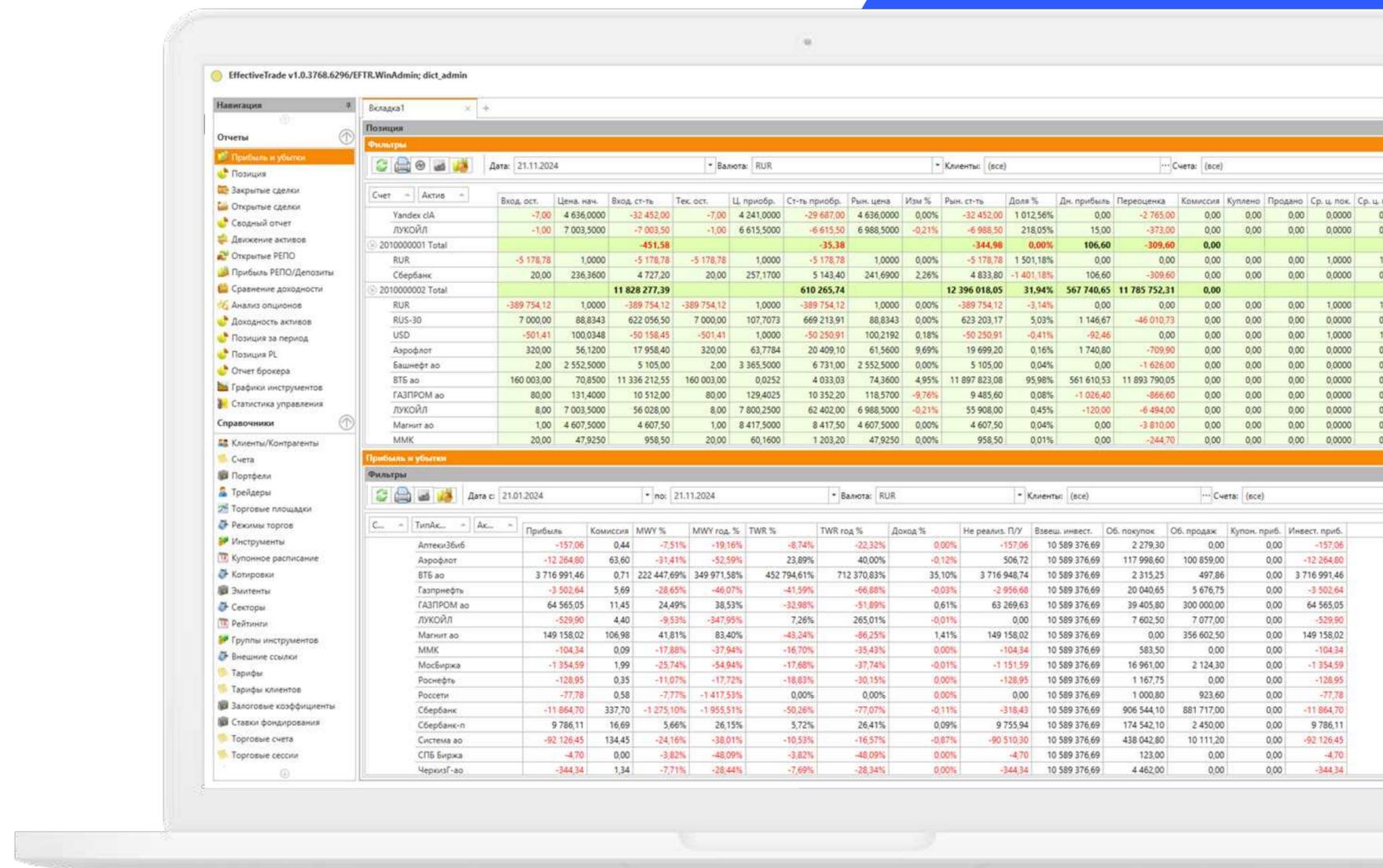
## Введение

# EffectiveTrade Position Keeping

Инструмент предоставляет широкий диапазон вариантов использования для решения повседневных задач специалистов самых разных профилей.

## Для кого:

- портфельные менеджеры
- трейдеры
- аналитики
- риск-менеджеры
- финансовые контролеры
- казначеи



## Введение

# Возможности и виды отчетов

### Возможности:

- Просмотр позиции на любую историческую дату
- Построение графика доходности, прибыли за любой период с возможностью сравнения с выбранными бенчмарками
- Построение отчета по прибыли с детализацией по счетам, типам активов
- Отображение всех типов комиссий и их детализация
- Отображение купонов, дивидендов, погашений
- Отображение пополнений и выводов
- Возможность построения единой истории операции, включающей все сделки и неторговые операции на одном экране
- Рабочее место для сотрудников с возможностью смотреть все перечисленные выше данные по любому клиенту

### Виды отчетов:

1. Отчет по позиции
2. Отчет Прибыли и убытки
3. Открытые сделки
4. Закрытые сделки
5. Доходность активов
6. Сравнение доходности
7. Открытые РЕПО
8. Сводный отчет
9. Журналы сделок и операций
10. Анализ опционов

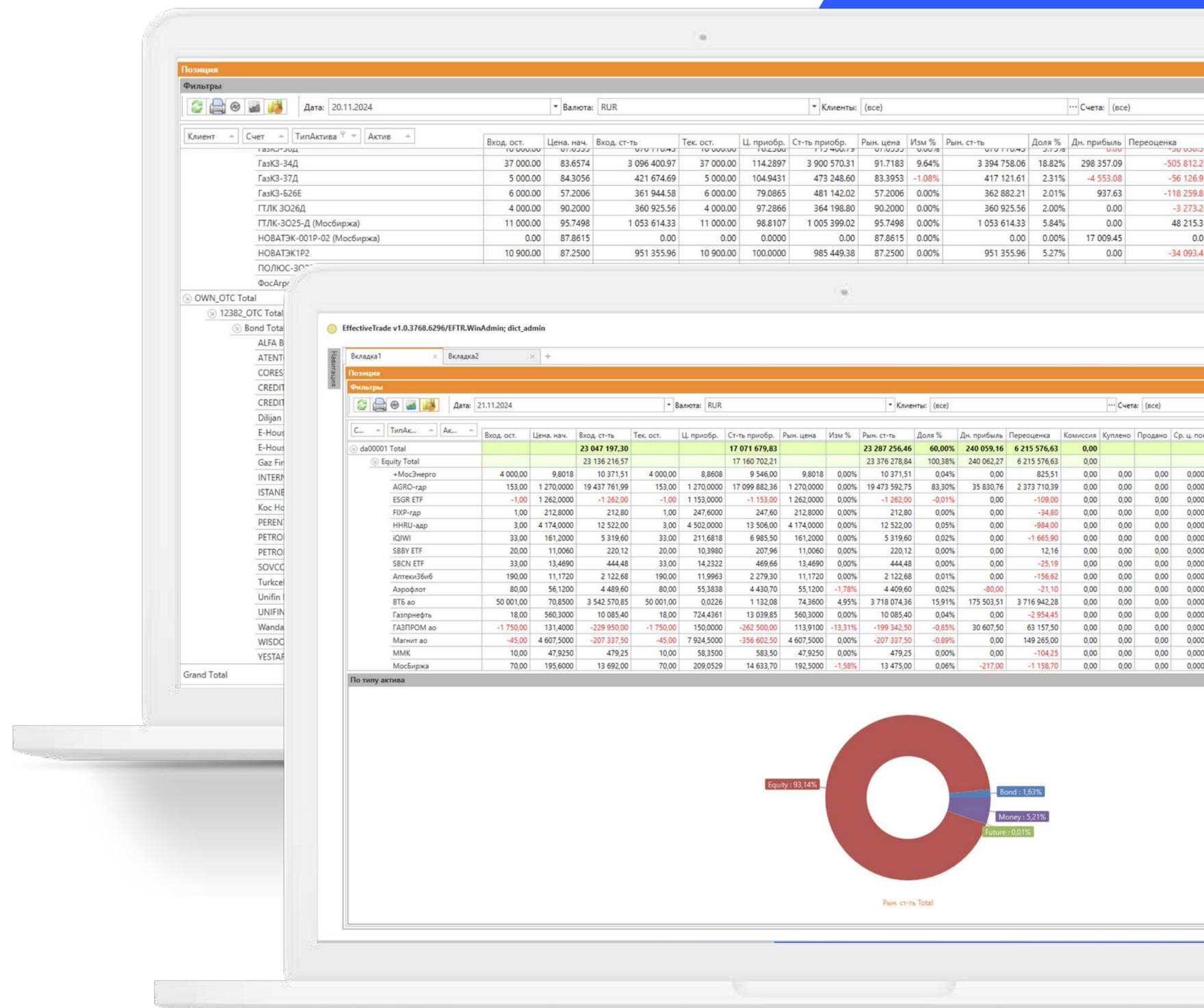
## Виды отчетов

Отчет **Позиция**

Позиционный отчет предназначен для отображения состава и структуры портфеля ценных бумаг, а также расчета различных аналитических показателей по портфелю.

Обновление отчета происходит автоматически раз в 10 секунд.

В качестве группировок отчета могут быть выбраны следующие параметры: **Счет**, **Группа счетов**, **Тип актива**, **Базовый актив**, **Актив**, **Тип операции**.



## Виды отчетов

# Отчет Прибыль и убытки

Предназначен для расчета финансового результата за заданный период.

Отчет позволяет анализировать финансовый результат в разрезах: **Счет, Группа счетов, Тип актива, Базовый актив, Актив, Тип операции.**

Гибкость отчета заключается в том, что легко и быстро можно посмотреть прибыль по дням в разрезе инструментов или наоборот, прибыль каждого инструмента в разрезе дат.

Счет	Тип Актива	Актив	Прибыль	Комиссия	MWY %	MWY год. %	TWR %	TWR год %	Об. покупок	Об.
<b>Прибыль и убытки</b>			<b>751 222 482.27</b>	<b>1 056 574.67</b>	<b>24 019.12%</b>	<b>28 650.26%</b>	<b>55 067.42%</b>	<b>65 685.00%</b>	<b>280 507 646.55</b>	<b>1</b>
Bond Total			753 003 297.94	179 667.35	1 951.78%	2 328.10%	192 404.59%	229 502.21%	28 163 552.58	
GAZ FINANCE PLC UNDT (Внебирж)			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
GAZ FINANCE PLC UNDT (Мосбиржа)			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
ГазКЗ-Б26Е			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
Норильский никель-ЗО26-Д (Мосбиржа)			752 990 776.90	31 084.45	311.52%	1 148.52%	200 197.15%	738 100.59%	0.00	
ОФЗ 26244			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
ОФЗ-26244-ПД (Мосбиржа)			-202 957.56	10 381.06	-2.00%	-3.99%	-1.22%	-2.43%	12 103 332.06	
ПИК-Корпорация-001Р-05 (Мосбиржа)			346 728.60	6 951.84	8.25%	97.16%	8.02%	94.37%	6 060 220.52	
Сбербанк КИБ-001S-05 (Мосбиржа)			-131 250.00	131 250.00	-1.30%	-17.51%	0.00%	0.00%	10 000 000.00	
ФосАгро ЗО25-Д (Мосбиржа)			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
Equity Total			-1 757 016.09	853 107.74	-17.34%	-21.90%	-6.15%	-7.76%	64 422 471.85	
iКаршеринг			1 864 558.39	819 968.06	29.89%	37.75%	28.37%	35.82%	34 135 824.25	
OZON-адр			56 447.48	6 052.52	1.88%	343.27%	0.00%	0.00%	2 995 000.00	
ГАЗПРОМ ао			-1 534 154.24	9 352.64	-20.55%	-174.41%	-14.68%	-124.57%	10 996 449.00	
ГМКНорНик			-1 062 154.78	8 211.58	-26.22%	-62.15%	-26.04%	-61.72%	6 813 258.60	
Левенгук			-1 081 712.94	9 522.94	-16.84%	-34.73%	-13.14%	-27.10%	9 481 940.00	
Money Total			-23 799.58	23 799.58	0.00%	0.00%	-15.61%	-18.62%	187 921 622.12	
RUR			-23 799.58	23 799.58	0.00%	0.00%	-15.61%	-18.62%	187 921 622.12	
USD			0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	

## Виды отчетов

# Отчет Открытые сделки

Предназначен для отображения всех открытых сделок на дату отчета.

Отчет позволяет детализировать итоговую позицию по активу, показываемую в позиционном отчете, до сделок образующих эту позицию с указанием даты и цены сделки.

Открытые сделки										
Фильтры										
		Дата: 21.11.2024					Клиенты: (все)			
И	Номер	Дата сделки	Дата поставки	Ко-во	Цена сд.	Цена сд. с ком.	Ст-ть приобр.	Комиссия	Ст-ть приобр. с к	
	2	0	18.11.2024	19.11.2024	10,00	257,1700	257,2470	2 571,70	0,77	2 572
	2010000002 Total									
	RUS-30 Total									
	1	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,8999	108,0779	1 079,92	1,78	1 081
	2	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,9001	108,0781	1 079,92	1,78	1 081
	3	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,3330	107,5110	1 074,25	1,78	1 076
	4	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,0181	107,0193	1 071,10	0,01	1 071
	5	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,9000	108,0780	1 079,92	1,78	1 081
	6	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,9000	108,0780	1 079,92	1,78	1 081
	7	0	28.05.2024	29.05.2024	1 000,00	107,9997	108,1777	1 080,92	1,78	1 082
	Аэрофлот Total									
	1	0	18.06.2024	19.06.2024	250,00	65,9200	65,9398	16 480,00	4,94	16 484
	2	0	27.08.2024	28.08.2024	10,00	50,7000	50,7150	507,00	0,15	507
	3	0	10.10.2024	11.10.2024	50,00	56,8200	56,8370	2 841,00	0,85	2 841
	4	0	14.10.2024	15.10.2024	10,00	58,1100	58,1270	581,10	0,17	581
	Башнефт ао Total									
	1	0	21.06.2024	24.06.2024	2,00	3 365,5000	3 366,5100	6 731,00	2,02	6 733
	ВТБ ао Total									
	1	0	26.04.2024	27.04.2024	10 000,00	0,0241	0,0241	241,35	0,07	241

## Виды отчетов

# Отчет **Закрытые сделки**

Предназначен для расчета арбитражного дохода, полученного за счет противоположных сделок покупок и продаж.

Отчет позволяет по любому измерению рассчитать величину дохода по всем закрытым сделкам.

The screenshot displays a software interface titled "Закрытые сделки" (Closed Transactions). It includes a filter section with a date range from 21.08.2024 to 21.11.2024 and a currency set to RUR. The main table lists transactions with columns for Date, Instrument, Income, Income %, Quantity, Date of Opening, Date of Closing, and Opening Price. The table is organized into groups by date, with "Total" rows for each date group.

С...	Дата	Инструмент	Сделки	Доход	Доход %	Кол-во	Дата открытия	Дата закрытия	Цена открытия	L
⊖	Сбербанк Total			-521,39	-7,05%	-30,00				
		1373403868654696246-353202464240139256		-172,40	-6,98%	-10,00	04.09.2024	17.10.2024	247,0000	
		1373403868654696246-905356057516595964		-166,59	-6,74%	-10,00	04.09.2024	17.10.2024	247,0000	
		1798245638822909617-1543656007782622481		-182,40	-7,41%	-10,00	04.09.2024	17.10.2024	246,0000	
⊖	21.10.2024 Total			-293,86	-5,95%					
⊖	Сбербанк Total			-293,86	-5,95%	-20,00				
		2196487118927847529-1014578922798132761		-147,38	-5,97%	-10,00	04.09.2024	18.10.2024	247,0000	
		2196487118927847529-2123533679536683078		-146,48	-5,93%	-10,00	04.09.2024	18.10.2024	247,0000	
⊖	22.10.2024 Total			-40,30	-1,63%					
⊖	Сбербанк Total			-40,30	-1,63%	-10,00				
		2196487118927847529-2087323710229689220		-40,30	-1,63%	-10,00	04.09.2024	21.10.2024	247,0000	
⊖	23.10.2024 Total			-223,29	-4,52%					
⊖	Сбербанк Total			-223,29	-4,52%	-20,00				
		2196487118927847529-1772483214687891440		-55,60	-2,25%	-10,00	04.09.2024	22.10.2024	247,0000	
		2196487118927847529-2196931945070961233		-167,69	-6,79%	-10,00	04.09.2024	22.10.2024	247,0000	
⊖	28.10.2024 Total			-114,17	-2,31%					
⊖	Сбербанк Total			-114,17	-2,31%	-20,00				
		2196487118927847529-141525913686516145		-106,97	-4,33%	-10,00	04.09.2024	25.10.2024	247,0000	
		2196487118927847529-215218989467897406		-7,20	-0,29%	-10,00	04.09.2024	25.10.2024	247,0000	

## Виды отчетов

## Отчет Доходность активов

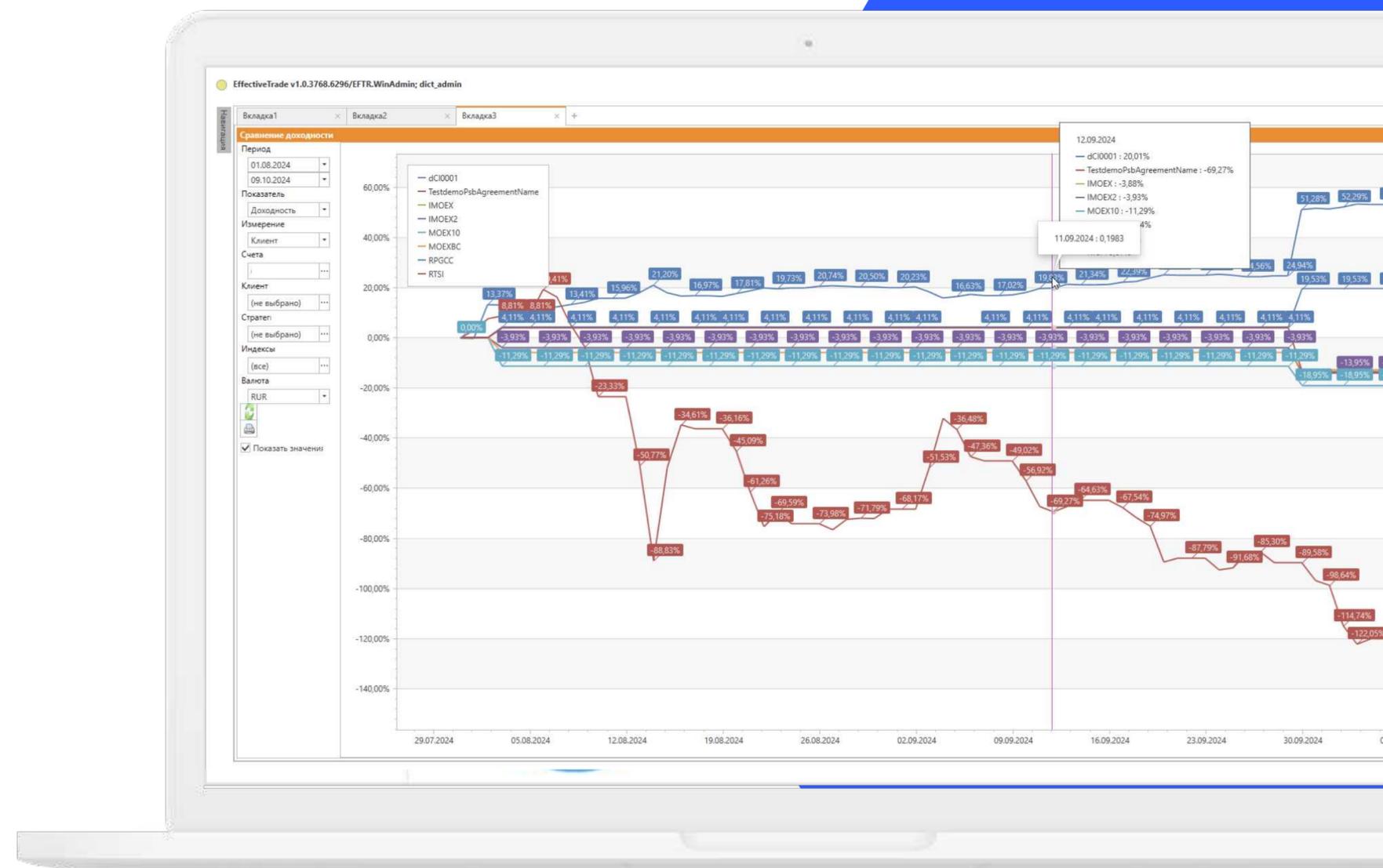
Рассчитывает собственную доходность каждого актива и внутреннюю доходность актива. Таким образом, отчет позволяет сравнить эффективность собственной стратегии, против стратегии "купил и держи".

Дата	Счет	Тип Актива	Актив	Прибыль	MWY %	MWY год. %	Доход-сть актива	Цена на начало	Цена на конец
Bond Total				33 586.92	0.65%	238.99%			
ГазКЗ-24Е				-319.38	-0.15%	-56.45%	-0.41%	97.9040	97.5000
ГазКЗ-25Е2				1 085.63	0.26%	94.55%	0.00%	99.3439	99.3439
ГазКЗ-26Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	95.7864	95.7864
ГазКЗ-26Е				937.79	0.26%	94.55%	0.00%	85.8154	85.8154
ГазКЗ-27Д				20 197.03	7.57%	2 764.41%	7.57%	88.8600	95.5900
ГазКЗ-27Д2				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	82.9890	82.9890
ГазКЗ-27Е				919.65	0.26%	94.55%	0.00%	84.1554	84.1554
ГазКЗ-28Е				10 766.21	3.60%	1 314.62%	3.33%	70.8606	73.2231
ГазКЗ-29Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	70.9178	70.9178
ГазКЗ-30Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	67.6535	67.6535
ГазКЗ-37Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	84.3056	84.3056
ГТЛК-3026Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	90.2000	90.2000
ГТЛК-3025-Д (Мосбиржа)				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	95.7498	95.7498
НОВАТЭК1Р2				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	87.2500	87.2500
ПОЛЮС-3028-Д (Мосбиржа)				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	77.9899	77.9899
ФосАгро-БО-П01-USD (Мосбиржа)				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	88.7939	88.7939
Bond Total				46 486.23	0.83%	301.74%			
ГазКЗ-24Е				-798.45	-0.15%	-56.45%	-0.41%	97.9040	97.5000
ГазКЗ-25Е2				1 357.04	0.26%	94.55%	0.00%	99.3439	99.3439
ГазКЗ-26Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	95.7864	95.7864
ГазКЗ-26Е				1 172.24	0.26%	94.55%	0.00%	85.8154	85.8154
ГазКЗ-27Д2				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	82.9890	82.9890
ГазКЗ-27Е				1 149.56	0.26%	94.55%	0.00%	84.1554	84.1554
ГазКЗ-28Е				13 457.76	3.60%	1 314.62%	3.33%	70.8606	73.2231
ГазКЗ-30Д				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	67.6535	67.6535
ГазКЗ-34Д				30 148.09	8.95%	3 266.72%	9.64%	83.6574	91.7183
ГТЛК-3025-Д (Мосбиржа)				0.00	0.00%	0.00%	0.00%	95.7498	95.7498

Виды отчетов

# Отчет Сравнение доходности

Отчет позволяет графически проиллюстрировать доходность собственной стратегии против различных индексов. Также возможно построение графиков изменения прибыли и стоимости чистых активов.



Виды отчетов

# Отчет Открытые РЕПО

Отчет отображает открытую позицию по сделкам РЕПО.

Параметры, отображающиеся в отчете: счет, обеспечение сделки, направление позиции (прямое или обратное), дата заключения и окончания сделки, дата выкупа по второй части сделки, количество бумаг переданное/полученное в залог, сумма сделки, ставка, величина накопленного процента, величина обратного выкупа, внутренний номер сделки.

Контрагент	Инструмент	Дата оплаты	Бумаги	Цена1	Платеж*	Срок РЕПО	Ставка	НКД1	НКД2	Дата выкупа	Цена2	Дисконт	Сумма выкупа*	Накопл. проц.*	Общий доход*	Брокер	Комм. брокера
					<b>-2 060 024 543.10</b>		<b>20.11%</b>						<b>2 061 156 464.44</b>	<b>0.00</b>	<b>1 131 921.34</b>		<b>0.00</b>
0	Сбербанк	29.10.2024	156 720.00	211.53	-33 151 138.32	1	19.83%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	33 169 099.72	0.00	17 961.40	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	1 406.00	5 500.80	-7 734 121.99	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	7 738 348.29	0.00	4 226.30	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	48.00	5 500.80	-264 038.30	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	264 182.58	0.00	144.28	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	2 101.00	5 500.80	-11 557 176.60	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	11 563 492.00	0.00	6 315.40	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	1 102.00	5 500.80	-6 061 879.40	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	6 065 191.90	0.00	3 312.50	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	2 902.00	5 500.80	-15 963 315.80	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	15 972 038.92	0.00	8 723.12	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	9 132.00	5 500.80	-50 233 287.34	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	50 260 737.22	0.00	27 449.88	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	68 487.00	5 500.80	-376 733 152.63	1	20.11%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.82	0	376 940 150.00	0.00	206 997.37	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	600.00	211.53	-126 918.60	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	126 987.95	0.00	69.35	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	12 690.00	211.53	-2 684 328.39	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	2 685 795.24	0.00	1 466.85	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	11 970.00	211.53	-2 532 026.07	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	2 533 409.69	0.00	1 383.62	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	920.00	211.53	-194 608.52	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	194 714.86	0.00	106.34	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	3 170.00	211.53	-670 553.27	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	670 919.69	0.00	366.42	0	0.00
0	Сбербанк	29.10.2024	3 230.00	211.53	-683 245.13	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	211.65	0	683 618.49	0.00	373.36	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	1 122.00	5 500.80	-6 171 895.36	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	6 175 267.98	0.00	3 372.62	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	500.00	5 500.80	-2 750 399.00	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	2 751 901.95	0.00	1 502.95	0	0.00
0	ЛУКОЙЛ	29.10.2024	1 050.00	5 500.80	-1 050 652.42	1	20.00%	0.00	0.00	30.10.2024	5 503.80	0	1 051 226.55	0.00	574.13	0	0.00

Виды отчетов

# Сводный отчет

Предназначен для просмотра общего финансового результата за заданный период.

Отчет позволяет анализировать финансовый результат в разрезах: **Клиент, Счет**.

В отчете быстро можно посмотреть прибыль, доходность, объем сделок за период по клиентам и счетам клиентов.

EffectiveTrade v1.0.3769.5878/EFTR.WinAdmin; admin

Вкладка1 x Вкладка2 x Вкладка3 x Вкладка4 x Вкладка5 x Вкладка6

**Сводный отчет**

Фильтры

Дата с: 01.01.2024 по: 20.11.2024 Валюта: RUR

Клиент	Счет	Прибыль	Доход %	Доход год. %	Взвеш. инвест.	TWR %	TWR год %	Ур. маржи	Реализ. П/У	Реализ.
Total		24 734 660 343.75	12 290.60%	13 803.28%	201 248 677.76	88 244.38%	99 105.23%	100.00%	1 242 936 865.75	1 235
FORTS		1 253 594 309.10	2 444.60%	2 745.47%	51 280 149.55	616.80%	692.71%	100.00%	1 253 094 377.89	1 253
FX		0.00	0.00%	0.00%	3.34	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	
MICEX		750 872 563.02	9 853.52%	11 066.26%	7 620 348.54	52 811.22%	59 311.07%	100.00%	-9 637 599.82	-9
OTC		22 730 193 471.62	15 968.03%	17 933.32%	142 348 176.32	19 325.33%	21 703.83%	100.00%	-519 912.32	-7
Total		22 587 807 232.90	16 973.62%	19 062.68%	133 075 964.90	26 592.29%	29 865.19%	99.90%	5 102 966.83	-3
MICEX		18 076 699.79	81.33%	91.34%	22 226 910.11	31.69%	35.59%	-291.65%	184 755.59	
OTC		22 569 730 533.11	20 360.78%	22 866.72%	110 849 054.79	32 112.60%	36 064.92%	100.00%	4 918 211.24	-3
Total		100 141.04	4.70%	5.28%	2 131 893.36	7.67%	8.61%	100.00%	-7 179.55	
FORTS		-5 943.84	-33.78%	-37.93%	17 597.48	-15.28%	-32.05%	100.00%	-5 943.84	
FX		-268.60	-5.17%	-5.80%	5 197.76	-0.10%	-0.22%	100.00%	-227.80	
MICEX		5 486.18	26.76%	30.05%	20 502.55	-9.78%	-10.98%	100.00%	4 427.13	
OTC		100 867.30	4.83%	5.42%	2 088 595.58	7.80%	8.76%	100.00%	-5 435.04	
Total		22 648 694.13	321.88%	361.50%	7 036 352.06	322.20%	361.85%	100.00%	0.00	
OTC		22 648 694.13	321.88%	361.50%	7 036 352.06	322.20%	361.85%	100.00%	0.00	
Grand Total		47 345 216 411.82	13 783.46%	15 479.89%	343 492 888.08	63 616.26%	71 445.96%	99.95%	1 248 032 653.03	1 232

Виды отчетов

## Журналы сделок и операций

Журналы предназначены для отображения истории совершенных сделок и неторговых операций за произвольный период.

**Журнал сделок** обеспечивает ведение полной истории всех совершенных сделок. Возможности журнала позволяют отображать сделки соответствующие заданным фильтрам, например: сделки с конкретным активом, в конкретных портфелях и т.д.

**Журнал проводок** предназначен для отображения истории движений ценных бумаг и денежных средств по каждой сделке, а также неторговых операции, таких как: зачисление/списание ценных бумаг и денежных средств; списание комиссий, ввода купонов и дивидендов.

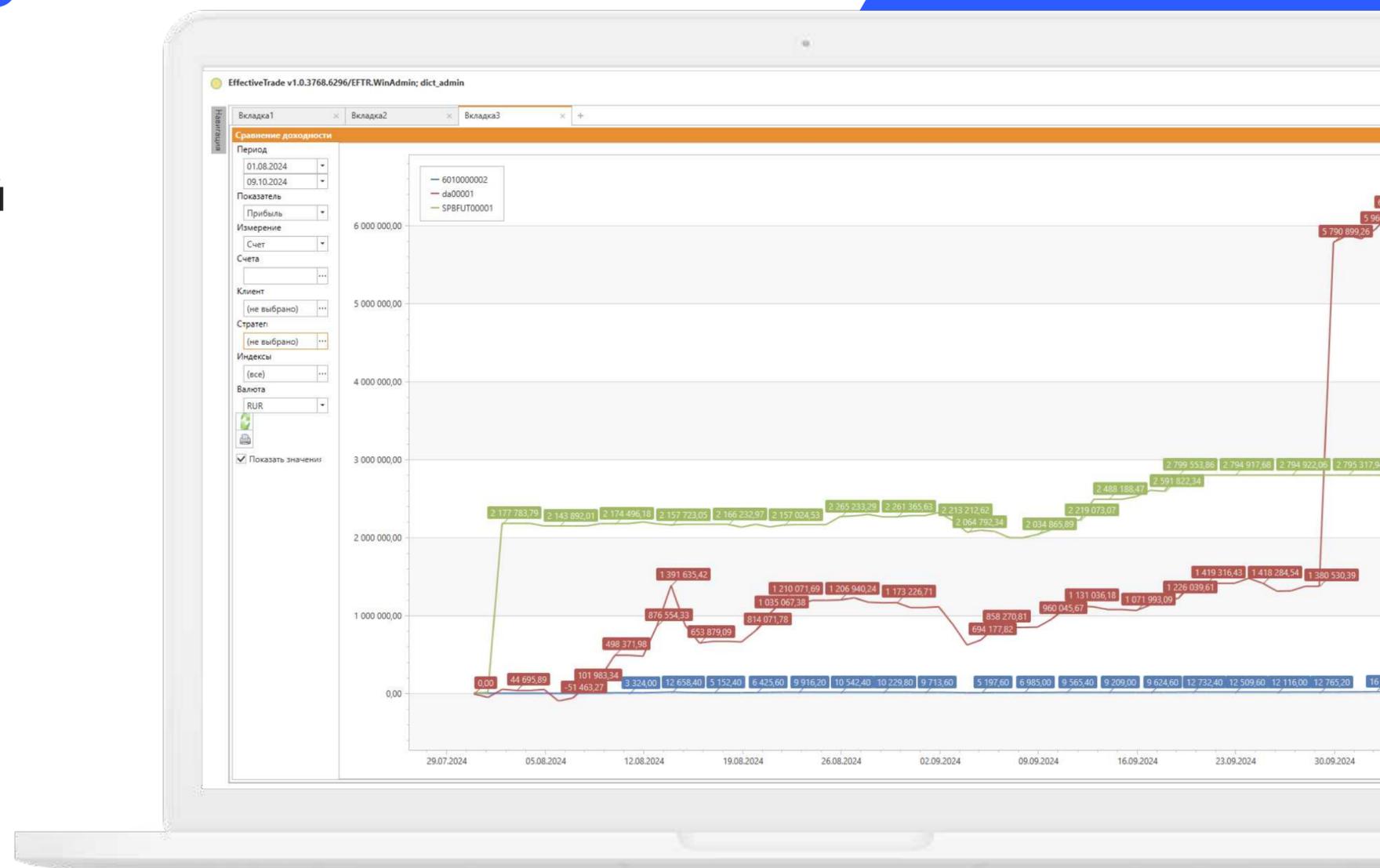
## Виды отчетов

# Анализ и моделирование

**Анализ опционов.** Модуль предназначен для моделирования опционных и фьючерсных позиций в зависимости от изменения рыночных данных.

### Основные возможности модуля:

- Моделирование собственной позиции по деривативам
- Создание виртуальных портфелей и их анализ. Этот функционал помогает в процессе принятия инвестиционного решения.
- Расчет аналитических показателей (греков) по каждой позиции и портфелю в целом
- Построение графиков на любую дату в пределах срока экспирации контракта
- Возможность моделирования ситуации при изменении волатильности
- Возможность построения графика доходности по всему портфелю и по каждой позиции.



# Спасибо за внимание!

cloud**factory**

**8 (800) 201-04-40**

107564, г. Москва,  
Краснобогатырская улица,  
дом 6, строение 2

[info@cloudfactory.ru](mailto:info@cloudfactory.ru)



[cloudfactory.ru](http://cloudfactory.ru)

