



## Инструкция по работе с сервисом



## Оглавление

1.	<b>НПФ</b> .....	4
<b>1.1.</b>	<b>Задачи Риск менеджер</b> .....	<b>4</b>
1.1.1.	оценка операционного риска .....	4
1.1.2.	оценка риска (финансовый риск) .....	5
1.1.3.	подбор актива .....	7
1.1.4.	нормативы.....	9
<b>1.2.</b>	<b>Задачи Управляющего активами</b> .....	<b>10</b>
1.2.1.	контроль изменений .....	10
1.2.2.	анализ потока выплат.....	10
1.2.3.	контроль ограничений.....	12
1.2.4.	подбор актива .....	13
<b>1.3.</b>	<b>Задачи Контролера</b> .....	<b>16</b>
1.3.1.	контроль ограничений.....	16
1.3.2.	ТСС .....	17
1.3.3.	формы.....	18
1.3.4.	Нормативы .....	19
2.	<b>СК</b> .....	21
<b>2.1.</b>	<b>Задачи Риск менеджер</b> .....	<b>21</b>
2.1.1.	оценка операционного риска .....	21
2.1.2.	оценка риска (финансовый риск) .....	22
2.1.3.	подбор актива .....	24
2.1.4.	нормативы.....	25
<b>2.2.</b>	<b>Задачи Управляющего активами</b> .....	<b>27</b>
2.2.1.	контроль изменений .....	27
2.2.2.	анализ потока выплат.....	27
2.2.3.	контроль ограничений.....	29
2.2.4.	подбор актива .....	30
<b>2.3.</b>	<b>Задачи Контролера</b> .....	<b>33</b>
2.3.1.	контроль ограничений.....	33
2.3.2.	ТСС .....	34
2.3.3.	формы.....	35
2.3.4.	Нормативы .....	36
3.	<b>ПУРЦБ</b> .....	38

<b>3.1.</b>	<b>Задачи Риск менеджер.....</b>	<b>38</b>
3.1.1.	оценка операционного риска.....	38
3.1.2.	оценка риска (финансовый риск).....	39
3.1.3.	подбор актива.....	41
3.1.4.	нормативы.....	42
<b>3.2.</b>	<b>Задачи Управляющего активами.....</b>	<b>44</b>
3.2.1.	контроль изменений.....	44
3.2.2.	анализ потока выплат.....	44
3.2.3.	контроль ограничений.....	46
3.2.4.	подбор актива.....	47
<b>3.3.</b>	<b>Задачи Контролера.....</b>	<b>49</b>
3.3.1.	контроль ограничений.....	49
3.3.2.	ТСС.....	50
3.3.3.	формы.....	51
3.3.4.	Нормативы.....	52

## 1. НПФ

### 1.1. Задачи Риск менеджер

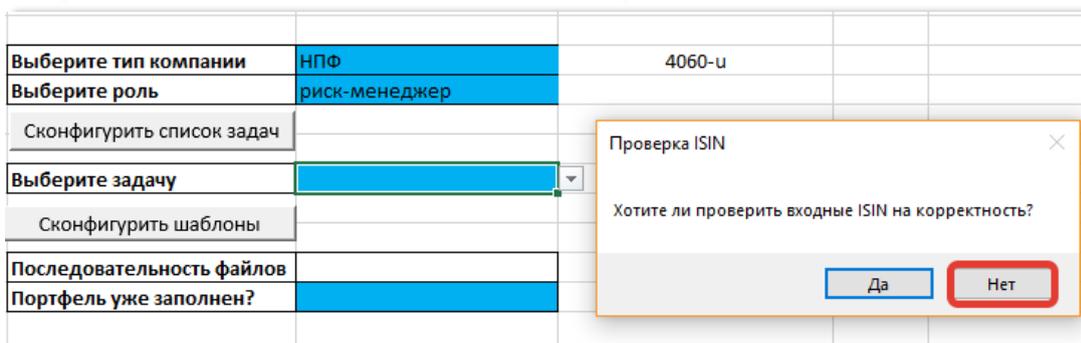
#### 1.1.1. оценка операционного риска

Описание задачи:

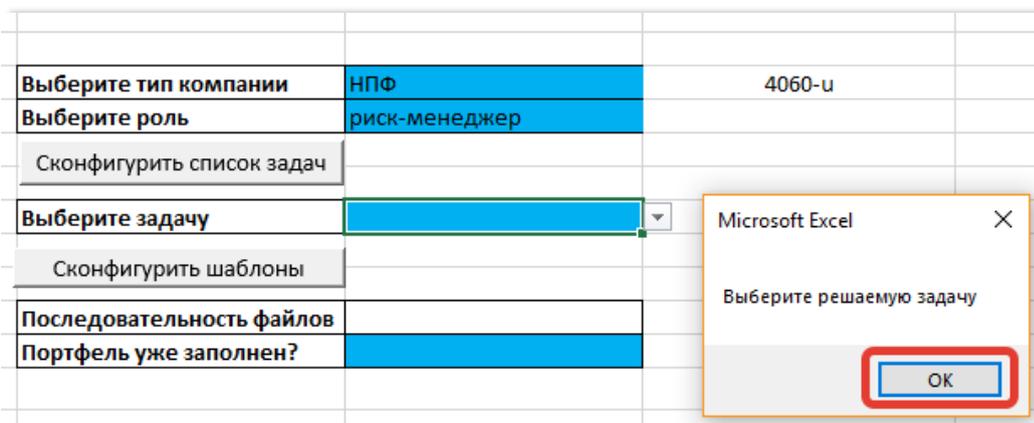
проведение качественной оценки операционного риска при помощи описания бизнес-процессов и построения матриц оценки вероятности и величины риска каждого этапа. Включена возможность настраивать матрицу свертки, внедрения своего классификатора рисков. Для описания бизнес-процессов и выделения критических точек в бизнес-процессах используется опросник.

Алгоритм действий:

- A. Открыть файл config;
- B. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку;  
«Сконфигурировать список задач»
- C. Выбрать нет на всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;



- D. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- E. Выбрать Задача = Оценить риски, нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;
- F. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Да»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	оценка риска	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

Выбор типа рисков

Необходимо оценить операционные риски?

Г. Открыть файл-шаблон «OR», в котором провести оценку риска в соответствии с инструкцией к этому шаблону;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	оценка риска	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		
	Опер. риски	Открыть OR

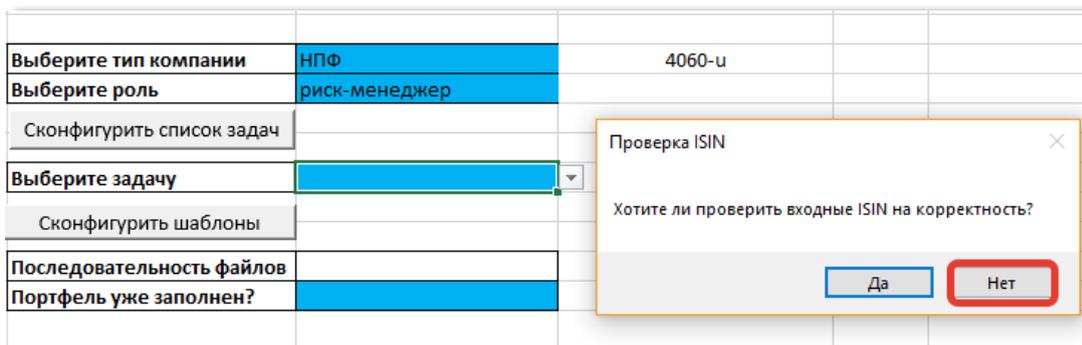
### 1.1.2. оценка риска (финансовый риск)

Описание задачи:

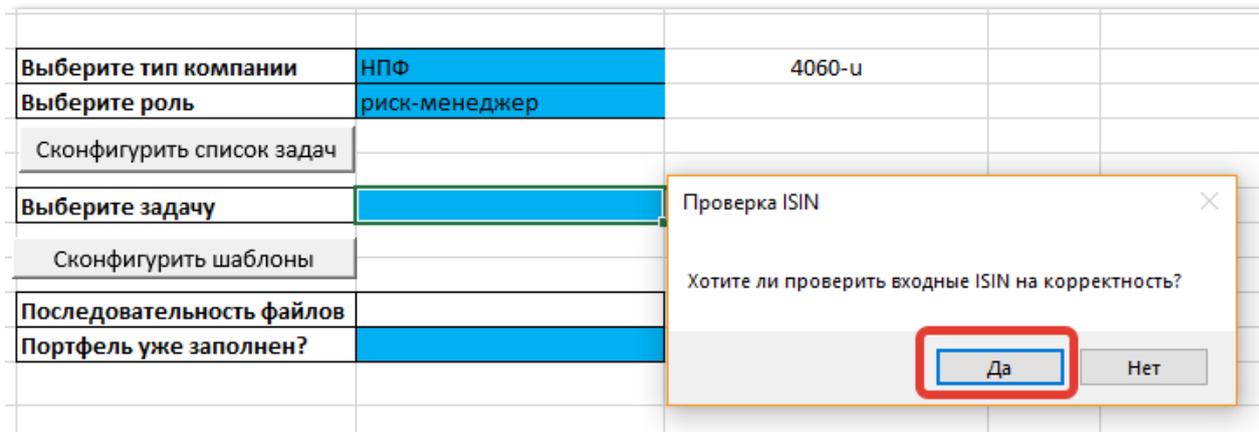
Подготовка данных для проведения стресс-тестирования согласно требованиям Банка России с использованием данных RU Data и шаблонов Банка России (Bonds и Модель). После заполнения всей последовательности шаблонов получается полный объем данных по справочной информации о портфеле, прогноз цен и потоков по сценариям Банка России.

Алгоритм действий:

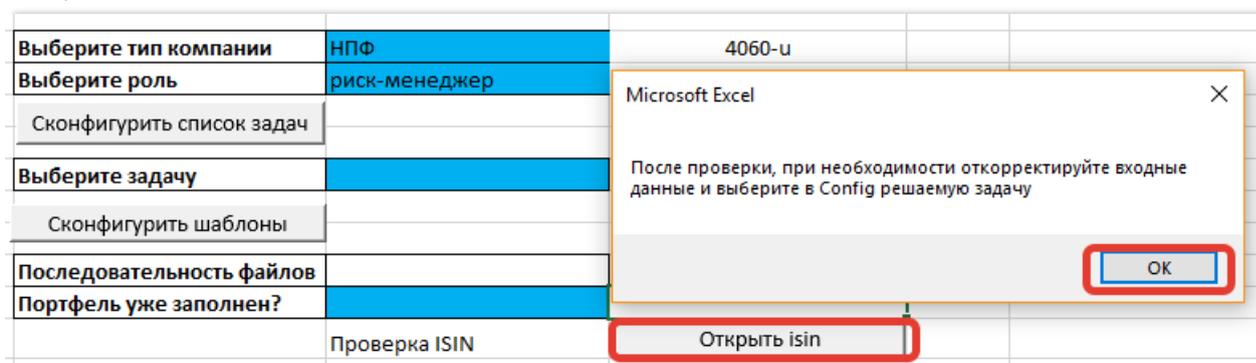
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации=НПФ, Роль = Риск менеджер, нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке:
  - ответ «Нет», если нет необходимости проверки корректности входных кодов (ISIN) бумаг



- ответ «Да», если нужна проверка корректности входных кодов (ISIN) бумаг (например, данные из непроверенного источника информации или не сверены);

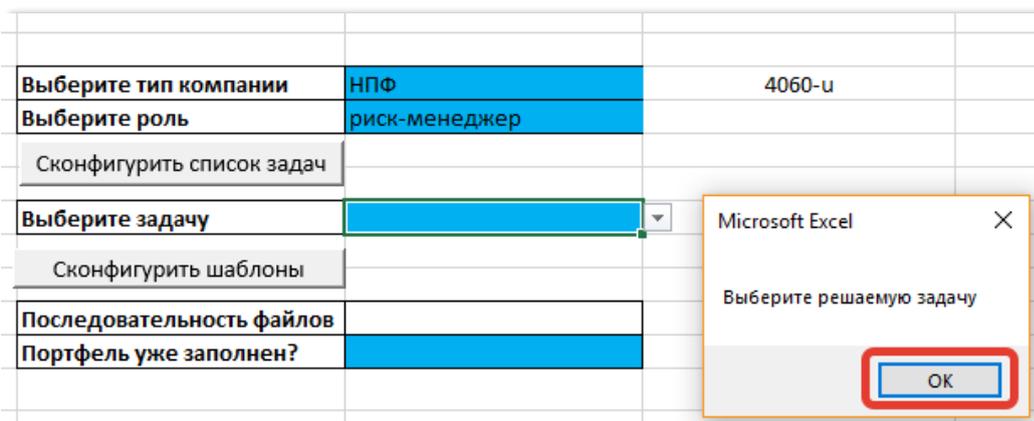


Затем нажать «ОК» (ознакомившись с текстом подсказки, что после проверки необходимо вернуться в Config и выбрать уже решаемую задачу без проверки ISIN);

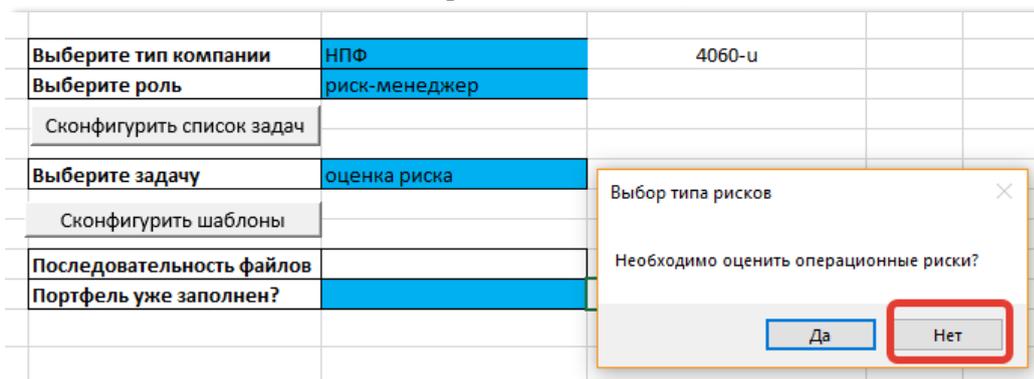


И нажать кнопку «Открыть isin» и выполнить проверку кода в соответствии с инструкцией к файлу- шаблону «isin».

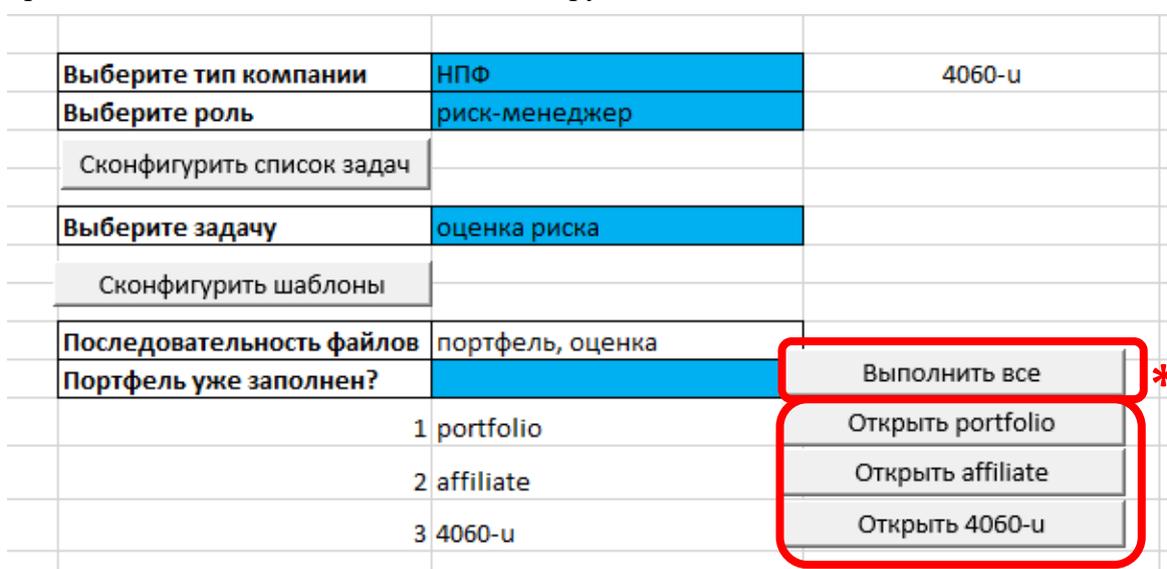
- Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- F. Выбрать Задача = Оценить риски, нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;  
 G. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;



- H. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, affiliate, 4060-и», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.



\*Если уже проводили тестирование по каждому шаблону и принимаете все действия, заведенные по умолчанию, то можете сразу запустить последовательное выполнение всех шаблонов, нажав кнопку «выполнить всё».

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 1.1.3. подбор актива

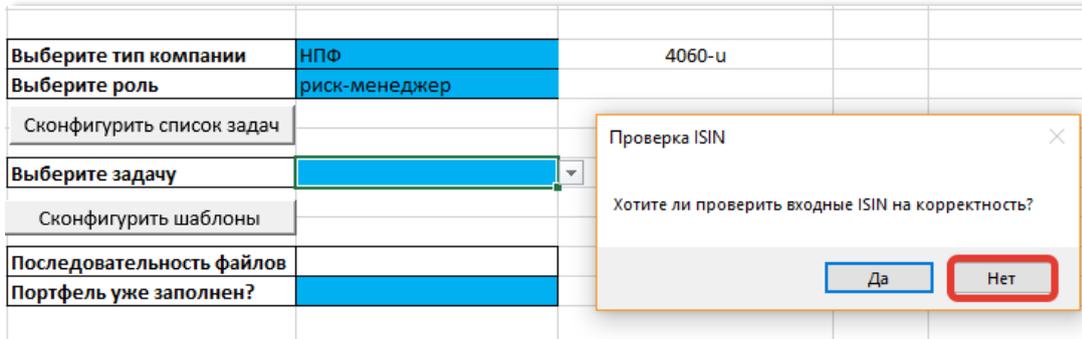
Описание задачи:

Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

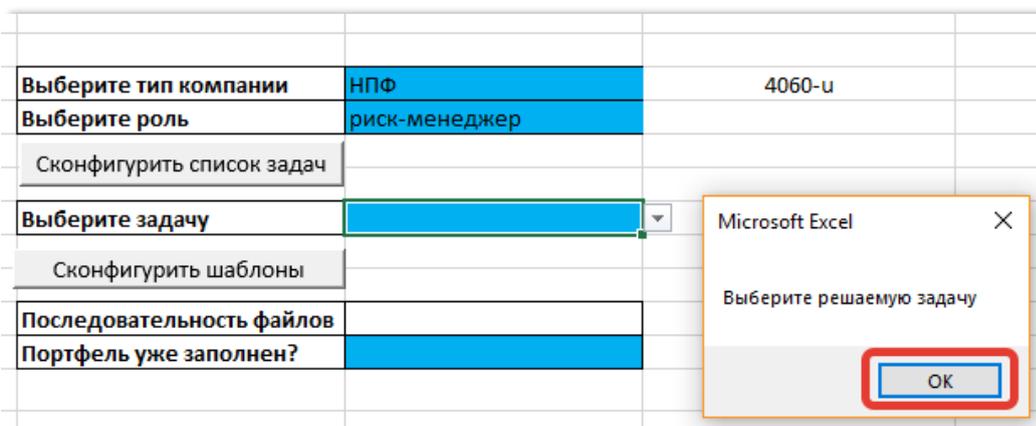
Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

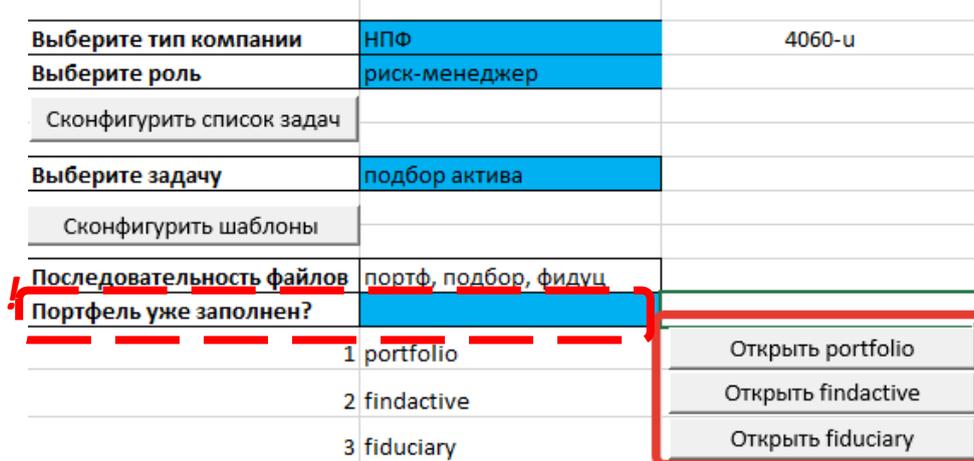
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- F. Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



- G. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 1.1.4. нормативы

Описание задачи:

Реализация расчета собственных средств НПФ по заполненному портфелю согласно требованиям Банка России .

Алгоритм действий:

- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	нормативы	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	нормативы	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?	да	

- F. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	нормативы	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф. БУФОРМЫ	
Портфель уже заполнен?	да	
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 forms	Открыть forms

- G. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, forms», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

## 1.2. Задачи Управляющего активами

### 1.2.1. контроль изменений

Описание задачи:

Отслеживание изменений по введенному списку инструментов (приближение даты оферты/погашения, изменение уровня листинга, изменений рейтинга (одного или нескольких по всему перечню).

Алгоритм действий:

- A. Открыть файл config;
- B. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- C. Выбрать ответ «Да» на всплывающей подсказке;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

Отслеживание изменений

Хотите настроить файл для отслеживания изменений по инструментам?

- D. Открыть файл-шаблон «wishlist», в котором выполнить действия в соответствии с инструкцией к этому шаблону;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		
	wishlist	<input checked="" type="button" value="Открыть wishlist"/>

### 1.2.2. анализ потока выплат

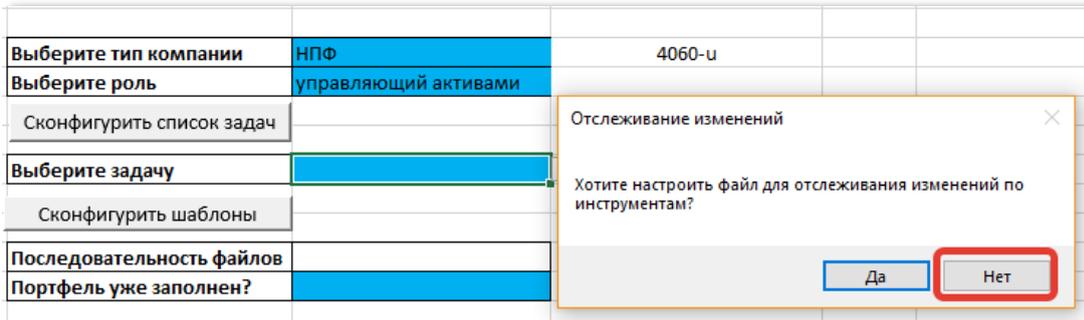
Описание задачи:

Расчет суммарных выплат по всему портфелю в дневной и годовой агрегации. Включена возможность учета дисконтирования к дате расчета с учетом бескупонной кривой МосБиржи соответствующей дюрации.

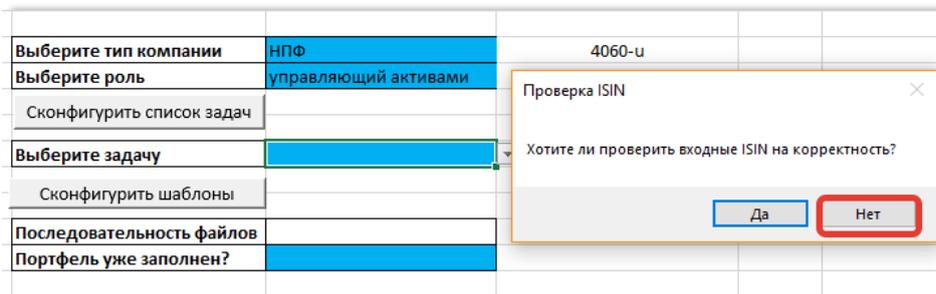
Алгоритм действий:

- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов Input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;

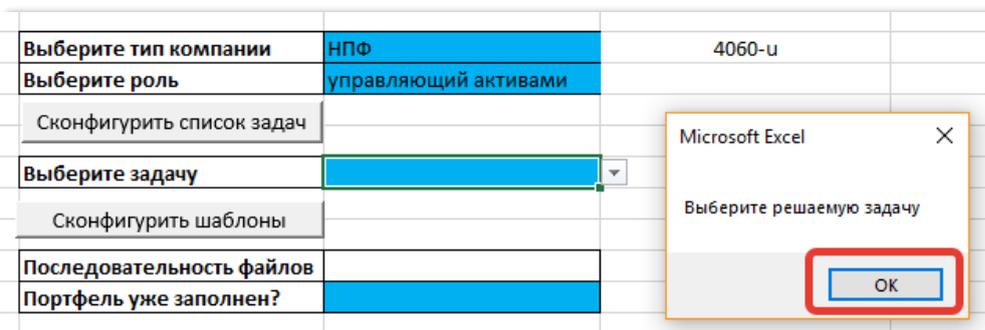
- C. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



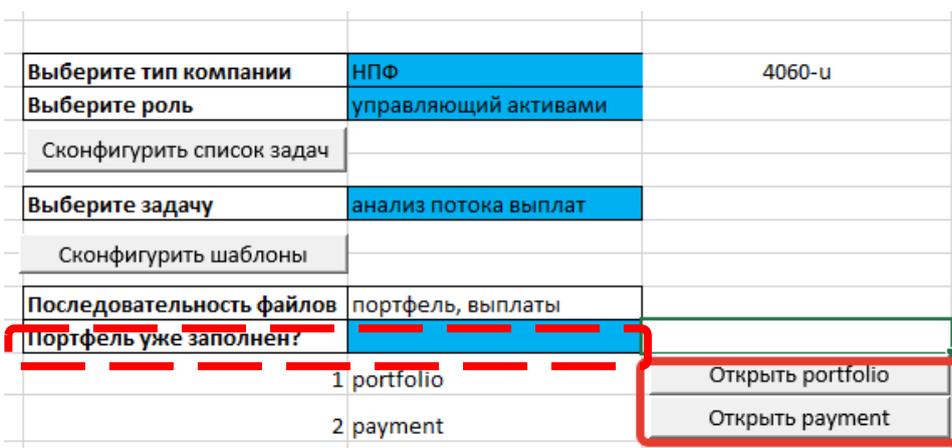
- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- G. Выбрать Задача = «анализ потока выплат», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, payment», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

**! Замечание:** если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

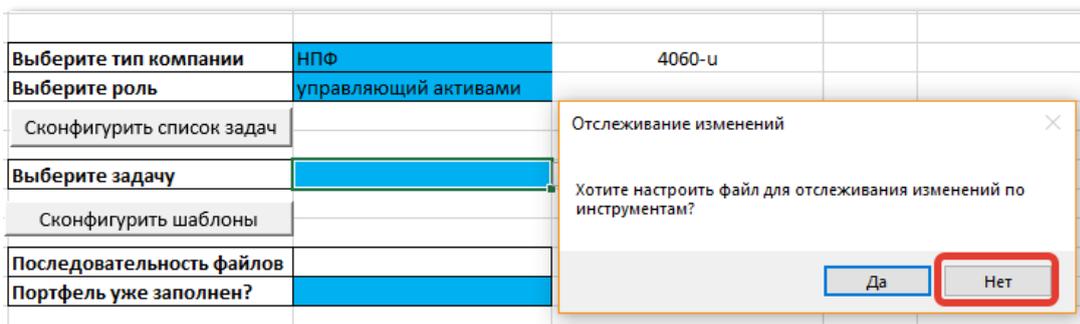
### 1.2.3. контроль ограничений

Описание задачи:

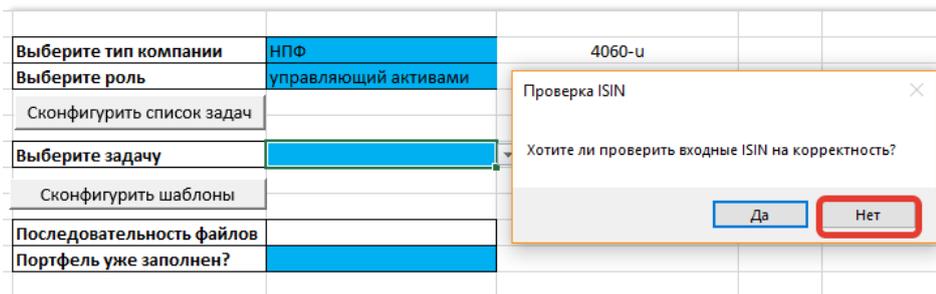
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

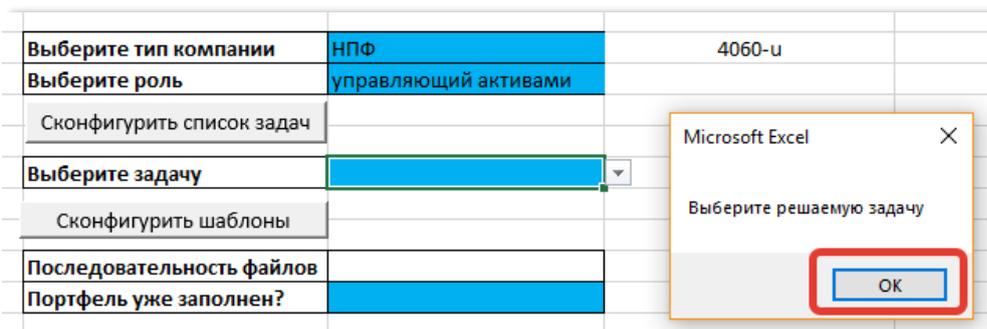
- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;
- С. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Д. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



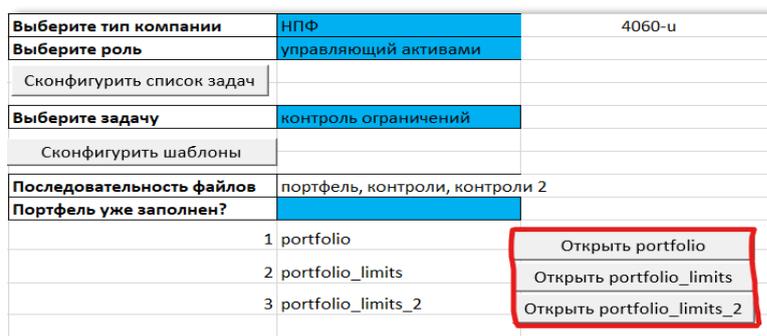
- Е. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



Ф. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, portfolio\_limits, portfolio\_limits\_2», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

#### 1.2.4. подбор актива

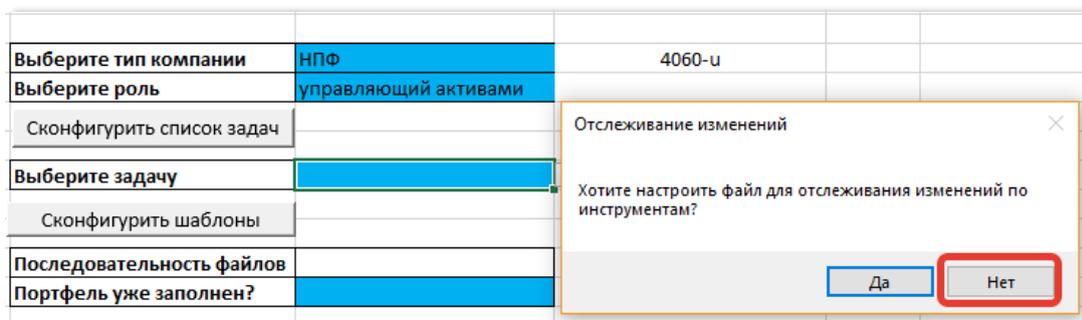
Описание задачи:

Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

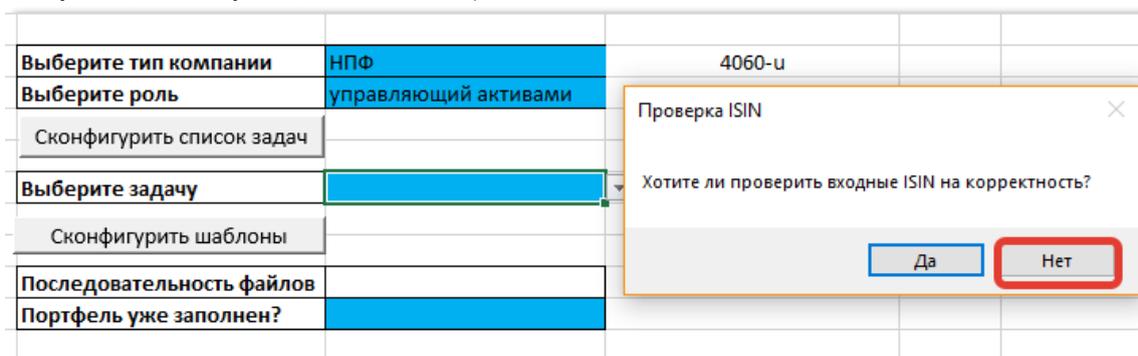
Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

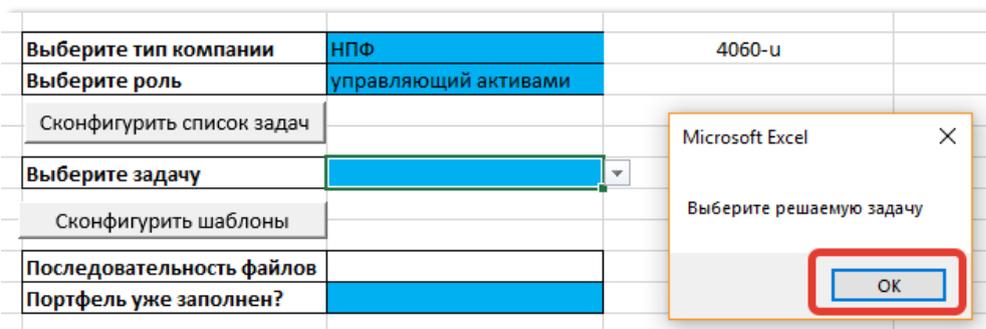
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	подбор актива	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф, подбор, филуц	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 findactive	Открыть findactive
	3 fiduciary	Открыть fiduciary

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 1.3. Задачи Контролера

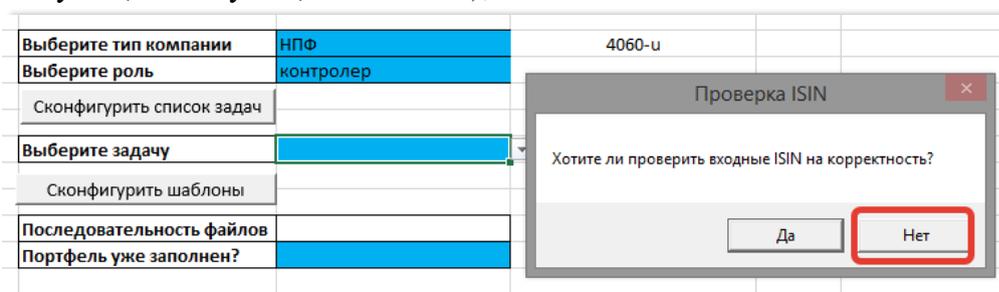
#### 1.3.1. контроль ограничений

Описание задачи:

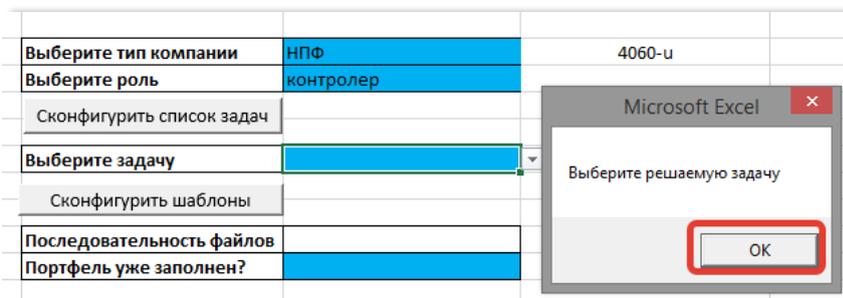
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

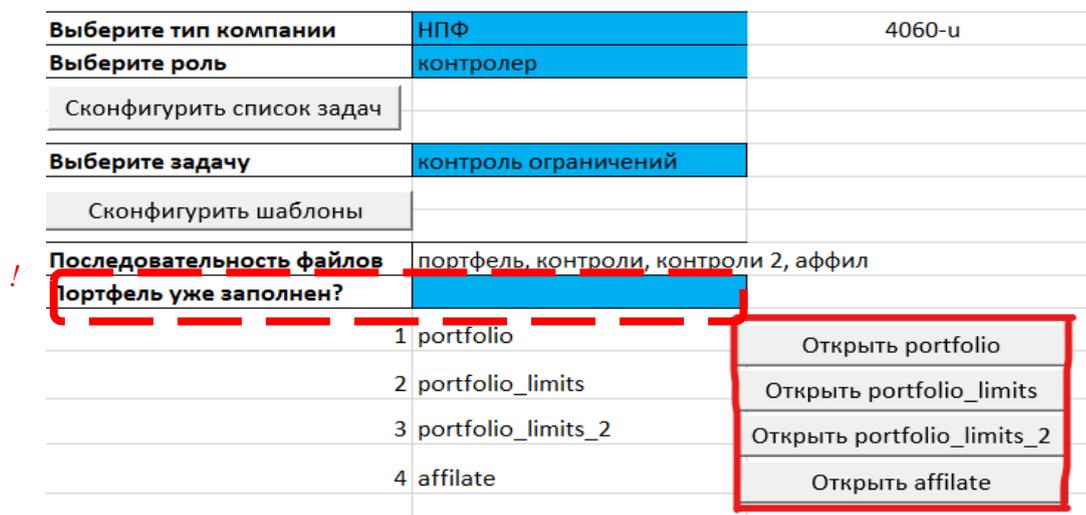
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Ф. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, portfolio\_limits, portfolio\_limits\_2, affiliate», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

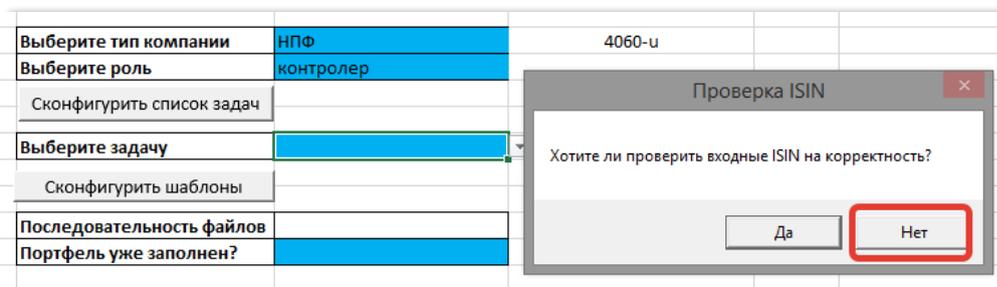
### 1.3.2. ТСС

Описание задачи:

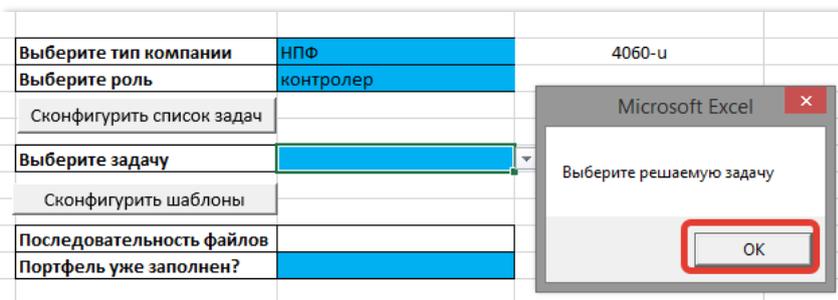
Контроль 1) корректности формирования бухгалтерского каскада согласно учетной политике (конструирование каскада и сопоставление с оценкой, внесенной в input) 2) для справедливой стоимости оценка попадания в доверительный интервал с указанием на сколько можно повысить/понизить оценку.

Алгоритм действий:

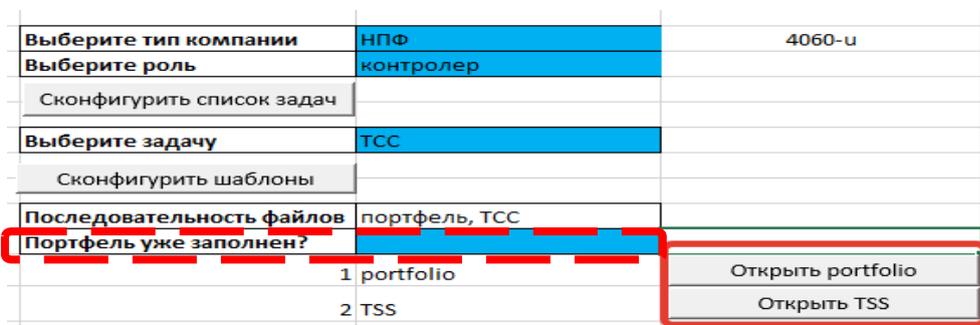
- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;
- С. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «ТСС», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, TSS», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

**! Замечание:** если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 1.3.3. формы

Описание задачи:

Создание шаблонов-примечаний по управлению рисками для финансовой отчетности компании по МСФО. Включают в себя формы: географическая разбивка активов, разбивка активов по валютам, разбивка активов по дюрации, разбивка активов по сроку погашения.

Опционально, шаблон может быть дополнен иными аналитическими формами, например, по раскрытию методики (параметров) и построению справедливой стоимости.

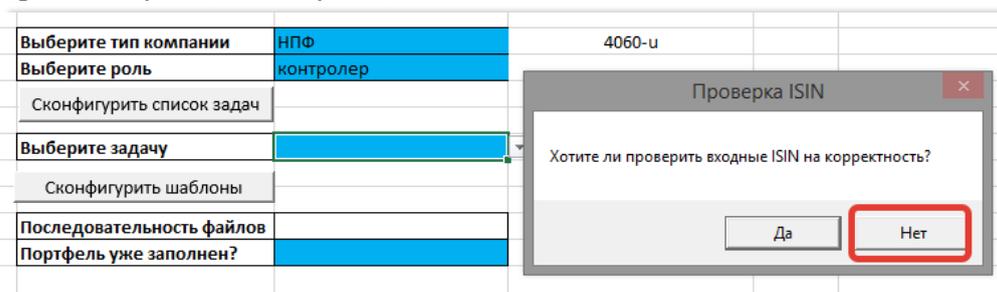
Алгоритм действий:

А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;

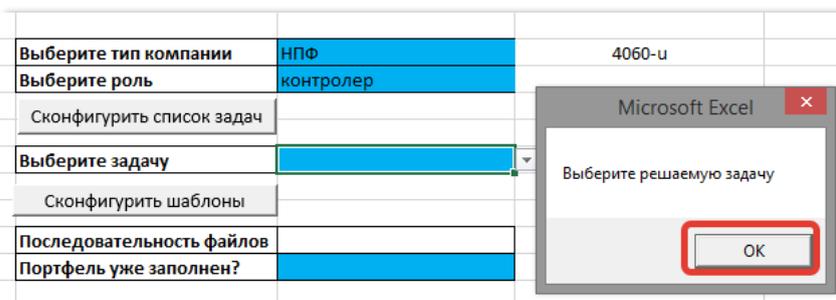
В. Открыть файл config;

С. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;

Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «формы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	формы	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф, formsRM	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	
	2 formsRM	

Открыть portfolio

Открыть formsRM

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, forms RM», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 1.3.4. Нормативы

Описание задачи:

Реализация расчета собственных средств НПФ по заполненному портфелю согласно требованиям Банка России.

Алгоритм действий:

- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;
- С. В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

Проверка ISIN

Хотите ли проверить входные ISIN на корректность?

Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

Microsoft Excel

Выберите решаемую задачу

Г. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	НПФ	4060-и
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	нормативы	
Сконфигурировать шаблоны		
! Последовательность файлов	портф, БУ ФОРМЫ	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 forms	Открыть forms

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, forms», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

## 2. СК

### 2.1. Задачи Риск менеджер

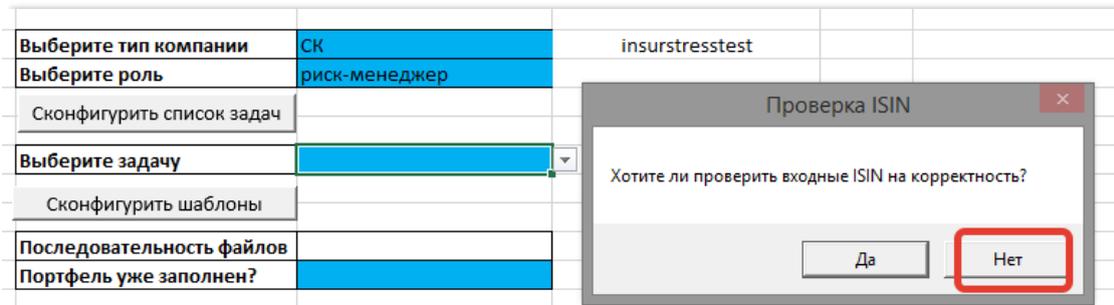
#### 2.1.1. оценка операционного риска

Описание задачи:

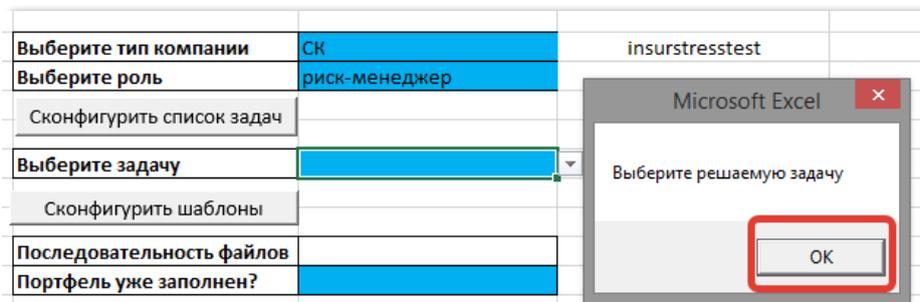
проведение качественной оценки операционного риска при помощи описания бизнес-процессов и построения матриц оценки вероятности и величины риска каждого этапа. Включена возможность настраивать матрицу свертки, внедрения своего классификатора рисков. Для описания бизнес-процессов и выделения критических точек в бизнес-процессах используется опросник.

Алгоритм действий:

- A. Открыть файл config;
- B. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- C. Выбрать нет на всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;

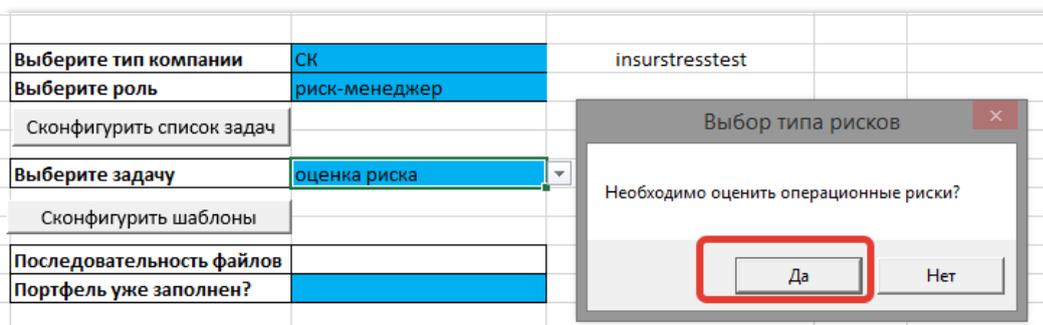


- D. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Выбрать Задача = «Оценить риски», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

- E. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Да»;



- F. Открыть файл-шаблон «OR», в котором провести оценку риска в соответствии с инструкцией к этому шаблону;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	оценка риска	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		
	Опер. риски	Открыть OR

## 2.1.2. оценка риска (финансовый риск)

Описание задачи:

Подготовка данных и проведение стресс-тестирования согласно требованиям Банка России с использованием данных RU Data. Также присутствует возможность классифицировать плохой-хороший актив, агрегировать рейтинги и настроить пороговые значения (по решению Совета Директоров). Опционально, шаблон может быть дополнен учетом справедливой стоимости, а также учетом рисков ПФИ (по согласованию методики с компанией).

Алгоритм действий:

- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файла input154) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации=СК, Роль = Риск менеджер, нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке:
  - ответ «Нет», если нет необходимости проверки корректности входных кодов (ISIN) бумаг;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

**Проверка ISIN**

Хотите ли проверить входные ISIN на корректность?

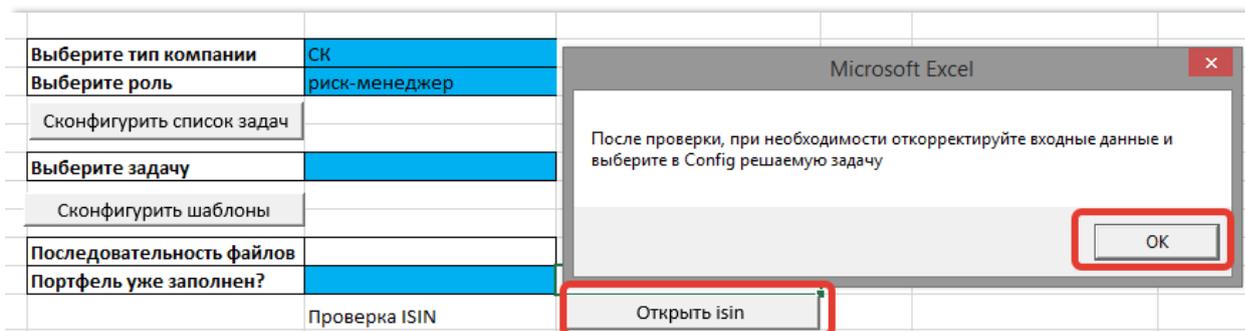
- ответ «Да», если нужна проверка корректности входных кодов (ISIN) бумаг (например, данные из непроверенного источника информации или не сверены);

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

**Проверка ISIN**

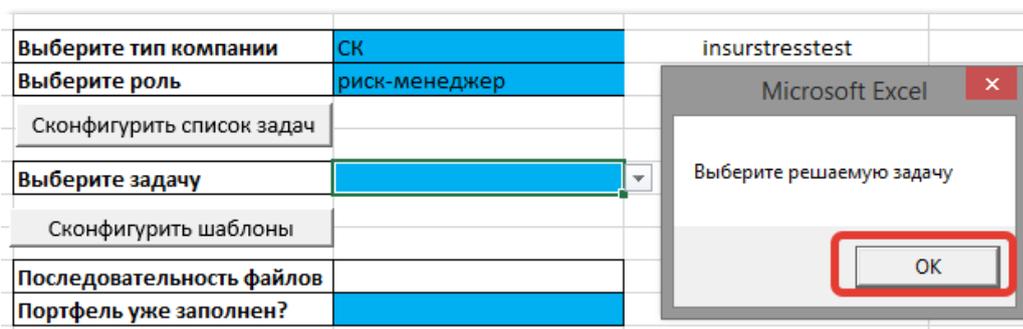
Хотите ли проверить входные ISIN на корректность?

Затем нажать «ОК» (ознакомившись с текстом подсказки, что после проверки необходимо вернуться в Config и выбрать уже решаемую задачу без проверки ISIN);



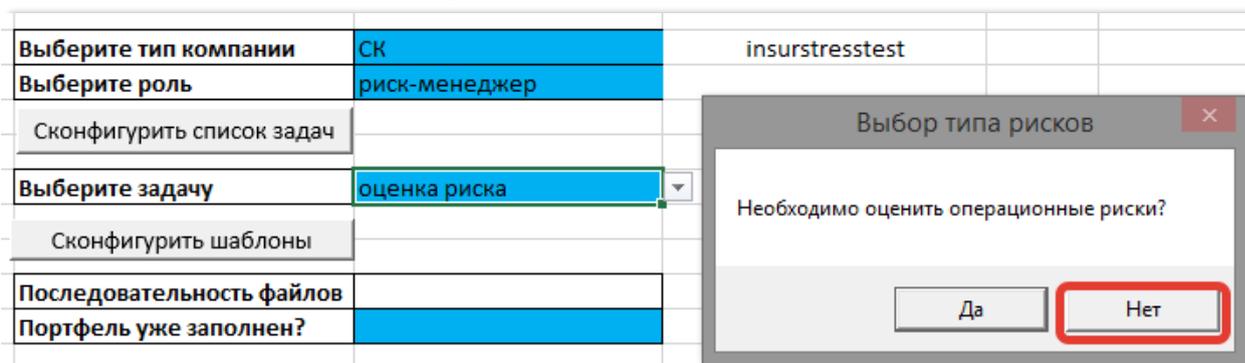
И нажать кнопку «Открыть isin» и выполнить проверку кода в соответствии с инструкцией к файлу- шаблону «isin»;

Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;

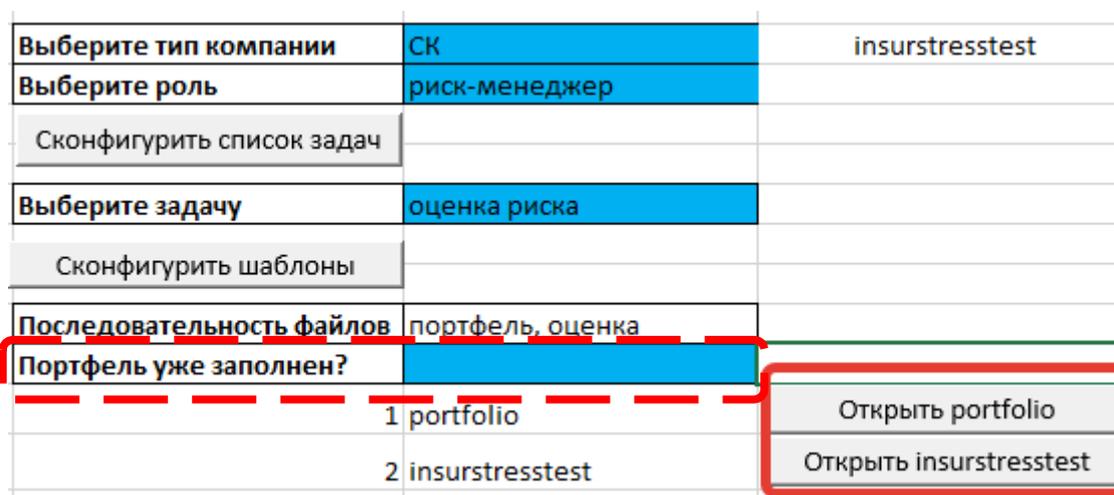


Ф. Выбрать Задача = «Оценить риски», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Г. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, insurstresstest», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.



**! Замечание:** если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 2.1.3. подбор актива

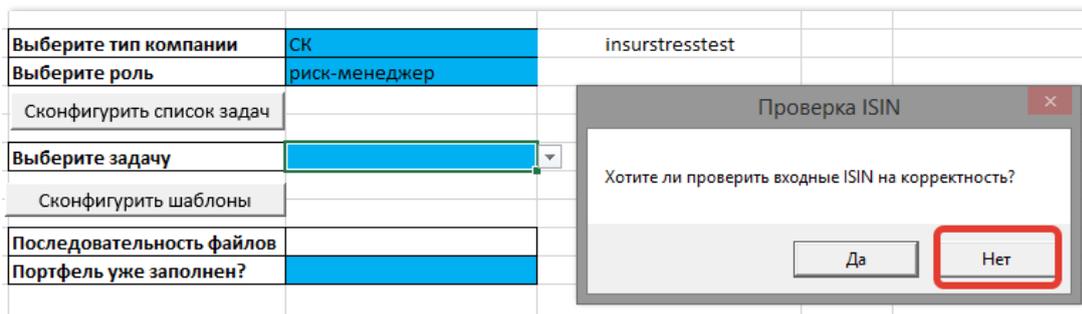
Описание задачи:

Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

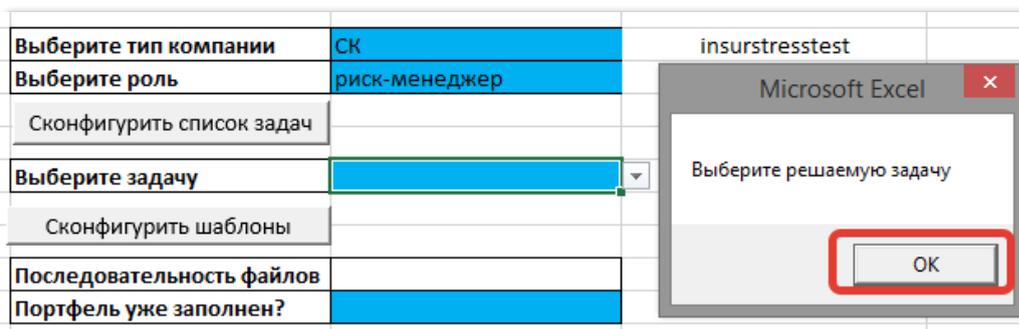
Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- F. Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	подбор актива	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф, подбор, фидуц	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 findactive	Открыть findactive
	3 fiduciary	Открыть fiduciary

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

**! Замечание:** если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

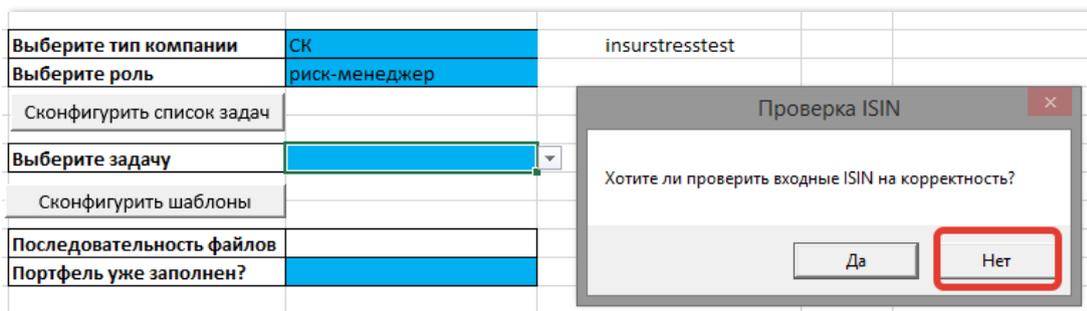
#### 2.1.4. нормативы

Описание задачи:

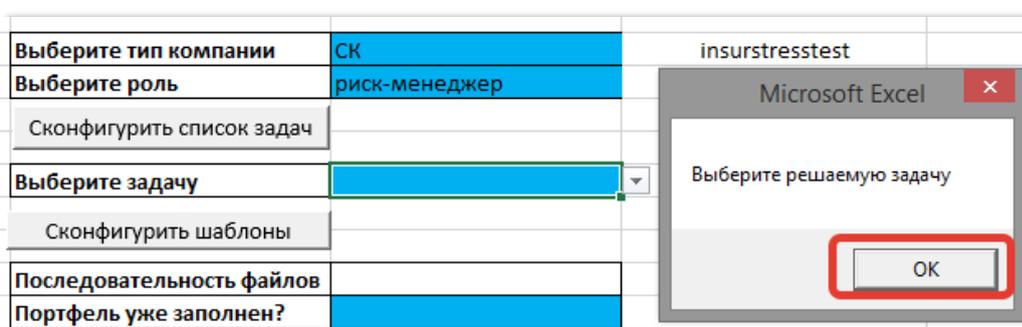
Реализация расчета (оценки) ликвидности активов (выделение высоколиквидных) по заполненному портфелю (за основу взяты стандарты Basel). Опционально в шаблон может быть добавлена оценка текущей ликвидности.

Алгоритм действий:

- Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- Открыть файл config;
- В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



F. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	нормативы	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф. БУФОРМЫ	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 VLA	Открыть VLA

G. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, VLA», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

## 2.2. Задачи Управляющего активами

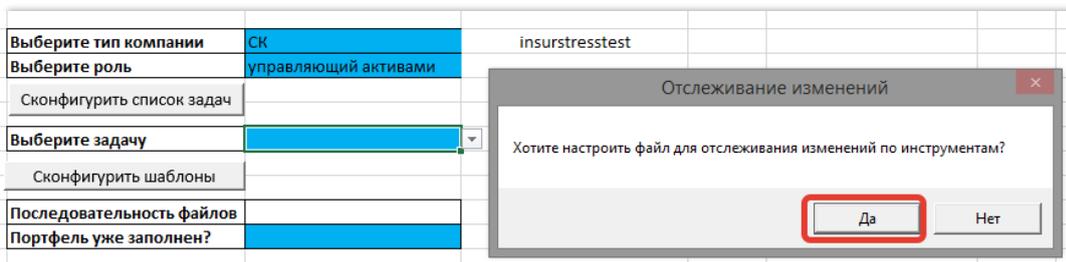
### 2.2.1. контроль изменений

Описание задачи:

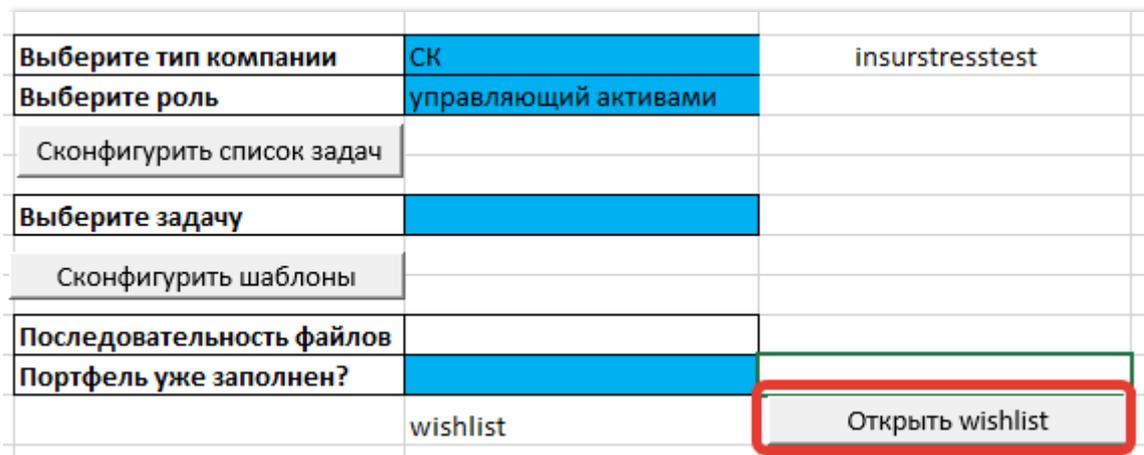
Отслеживание изменений по введенному списку инструментов (приближение даты оферты/погашения, изменение уровня листинга, изменений рейтинга (одного или нескольких по всему перечню)).

Алгоритм действий:

- A. Открыть файл config;
- B. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- C. Выбрать ответ «Да» на всплывающей подсказке;



- D. Открыть файл-шаблон «wishlist», в котором выполнить действия в соответствии с инструкцией к этому шаблону.



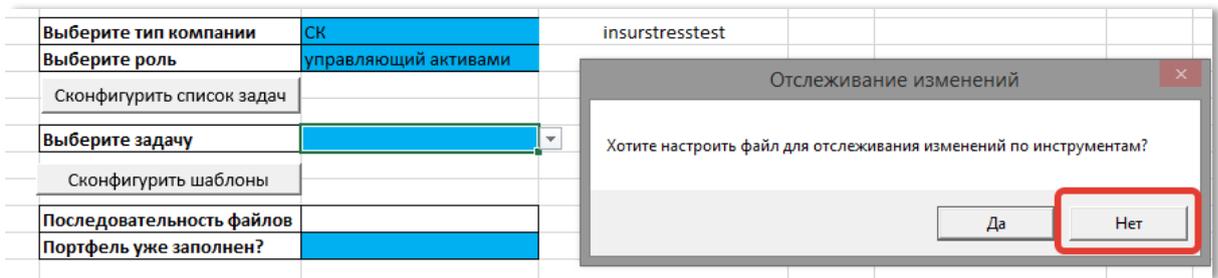
### 2.2.2. анализ потока выплат

Описание задачи:

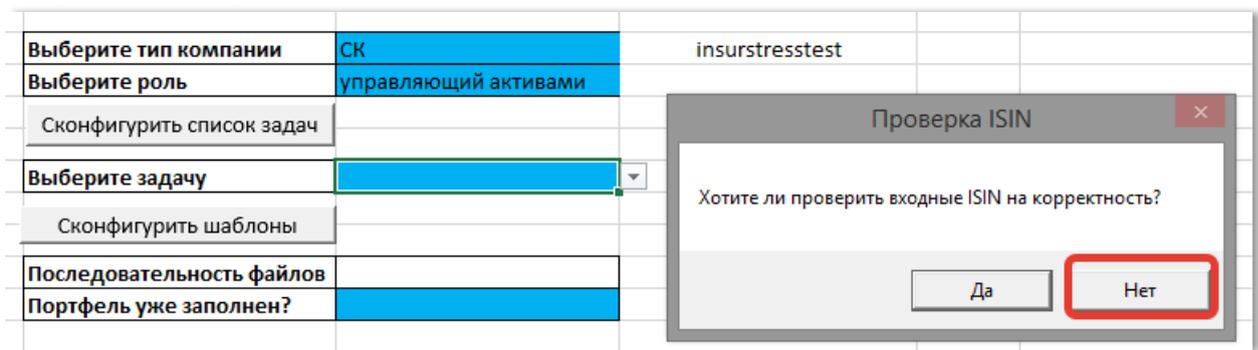
Расчет суммарных выплат по всему портфелю в дневной и годовой агрегации. Включена возможность учета дисконтирования к дате расчета с учетом бескупонной кривой МосБиржи соответствующей дюрации.

Алгоритм действий:

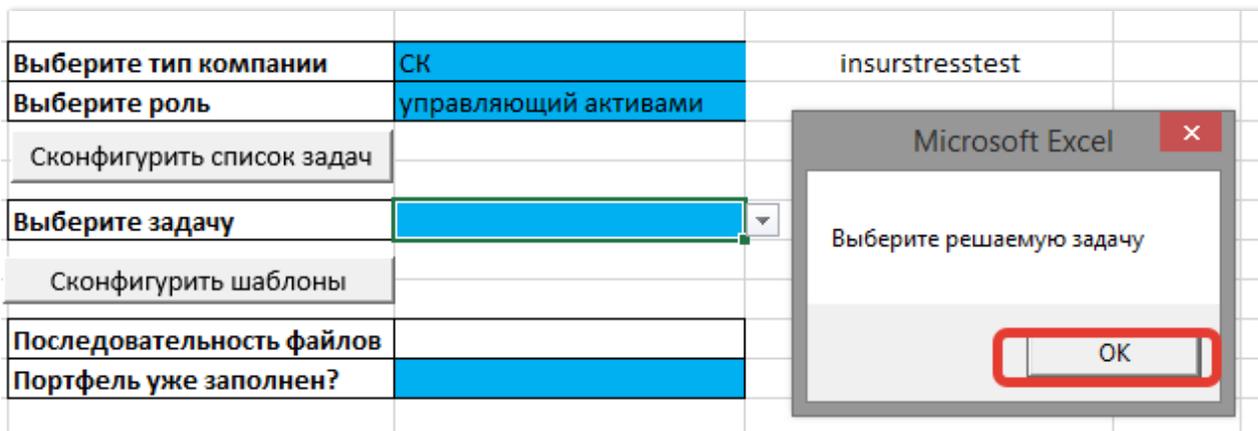
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- G. Выбрать Задача = «анализ потока выплат», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	анализ потока выплат	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портфель, выплаты	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 payment	Открыть payment

Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, payment», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

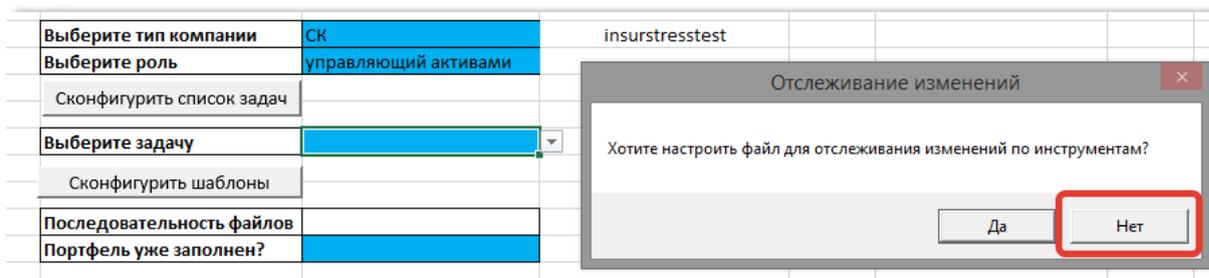
### 2.2.3. контроль ограничений

Описание задачи:

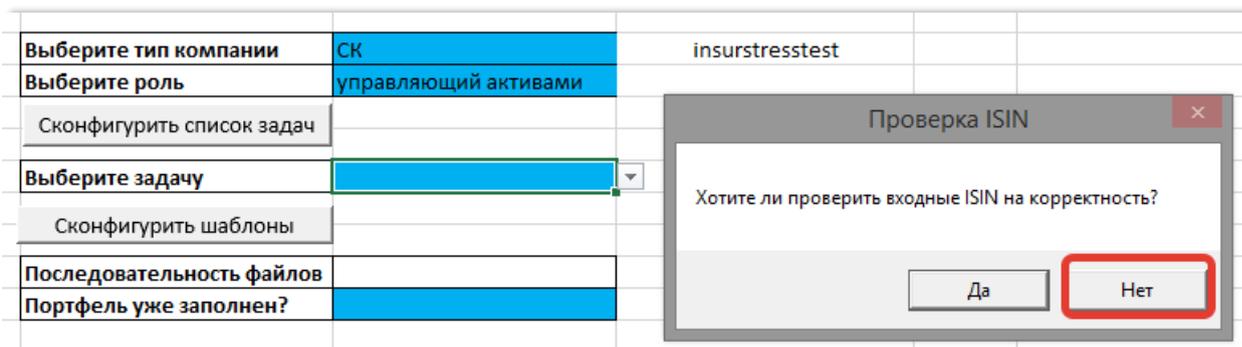
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

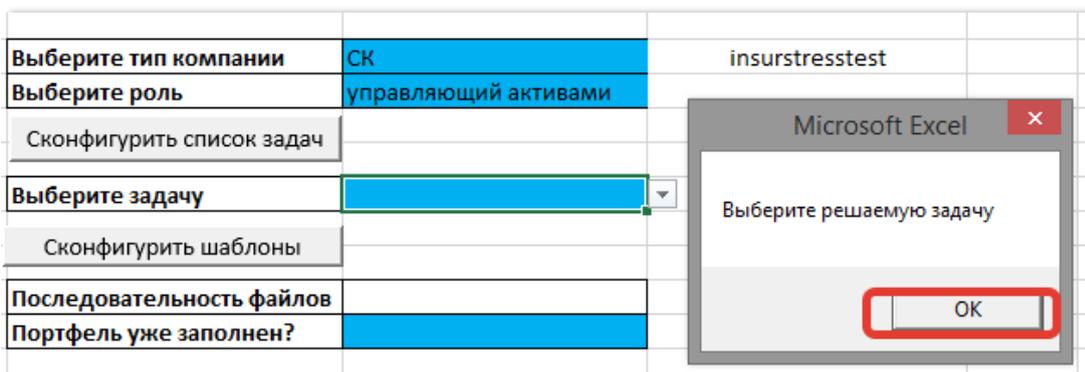
- Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- Открыть файл config;
- В файле выбрать Тип организации= «НПФ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



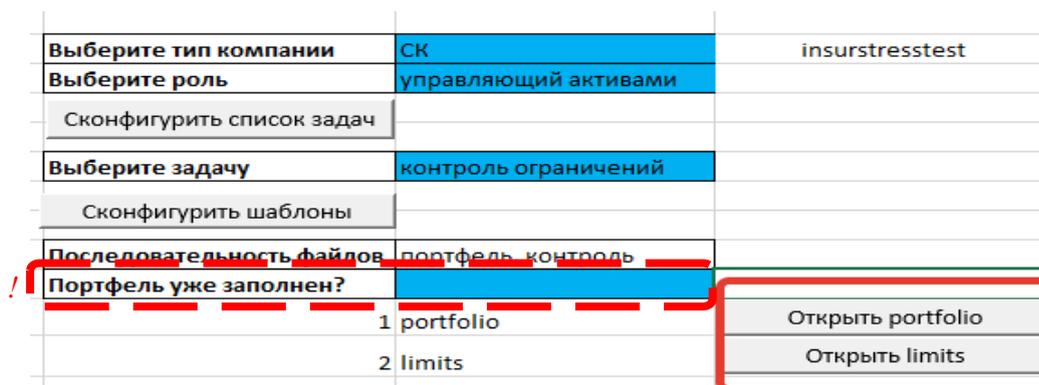
Е. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



Ф. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, limits, affilate», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

#### 2.2.4. подбор актива

Описание задачи:

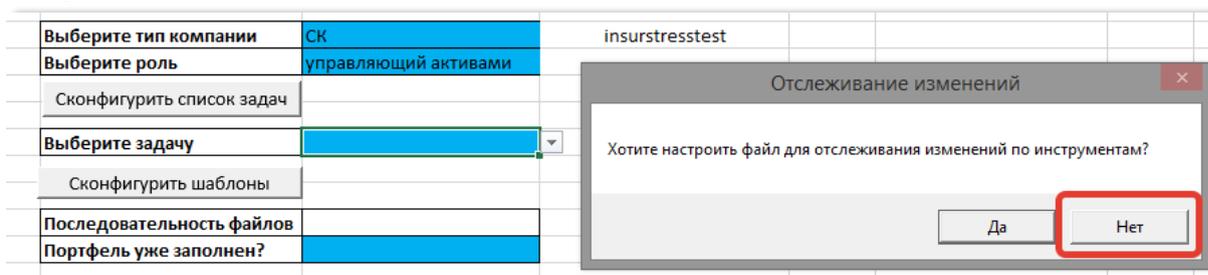
Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также

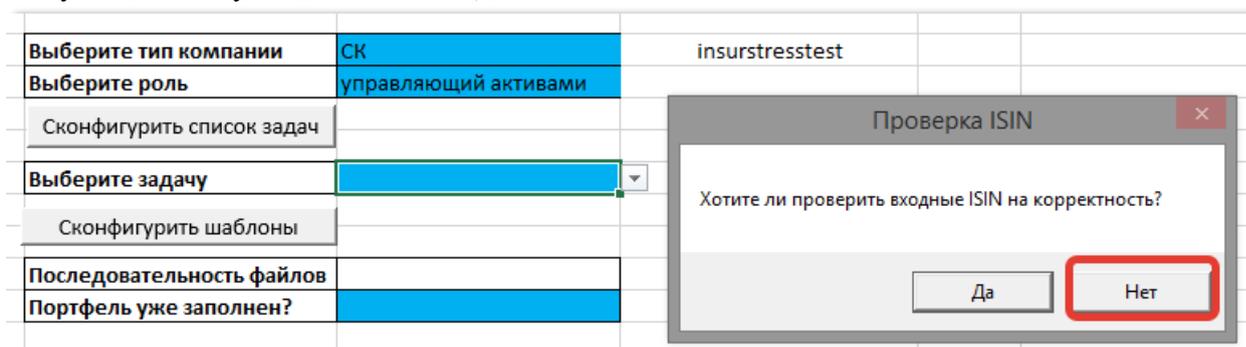
есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

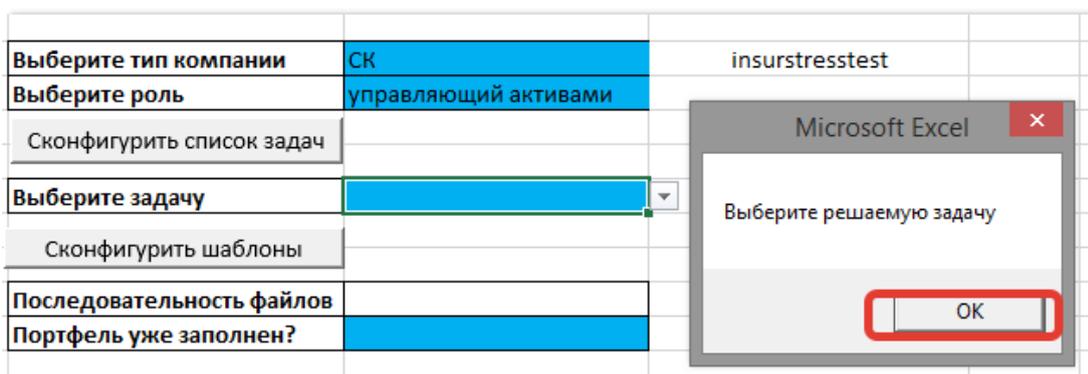
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 1.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- G. Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	подбор актива	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портф. подбор. фидуц.	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 findactive	Открыть findactive
	3 fiduciary	Открыть fiduciary

Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

## 2.3. Задачи Контролера

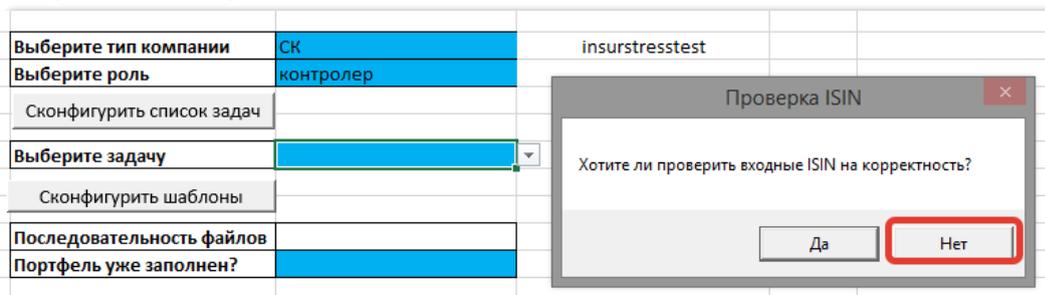
### 2.3.1. контроль ограничений

Описание задачи:

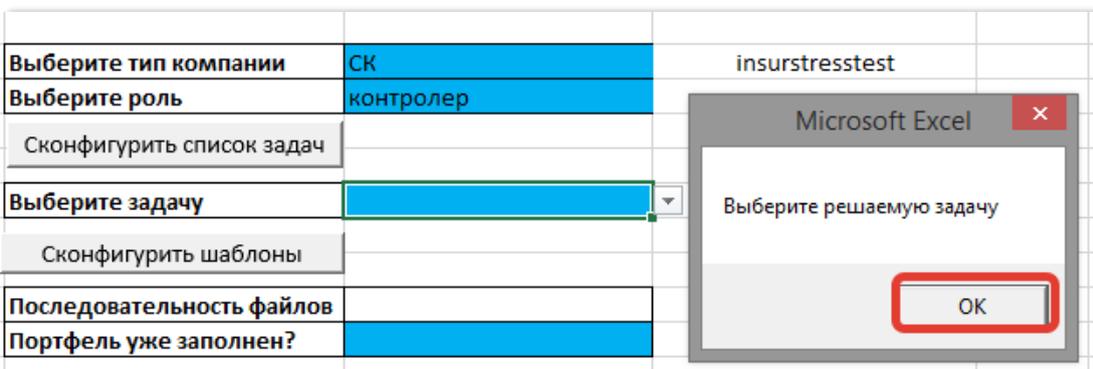
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

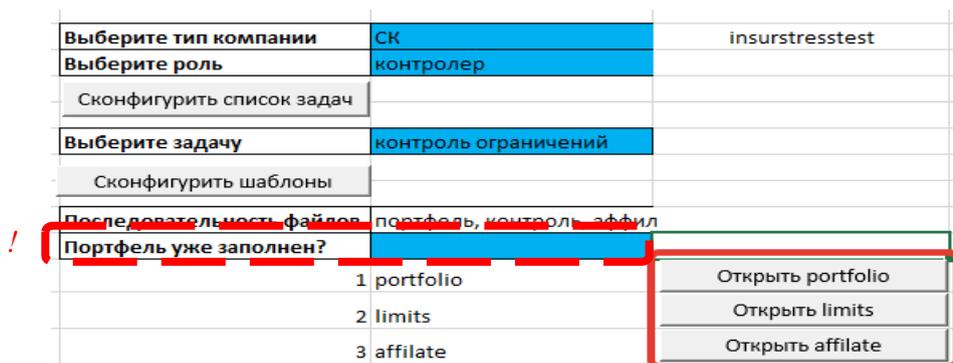
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- F. Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, limits, affiliate», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

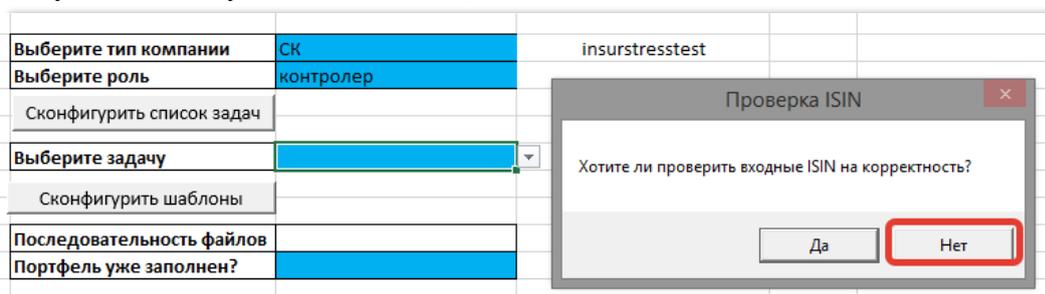
### 2.3.2. ТСС

Описание задачи:

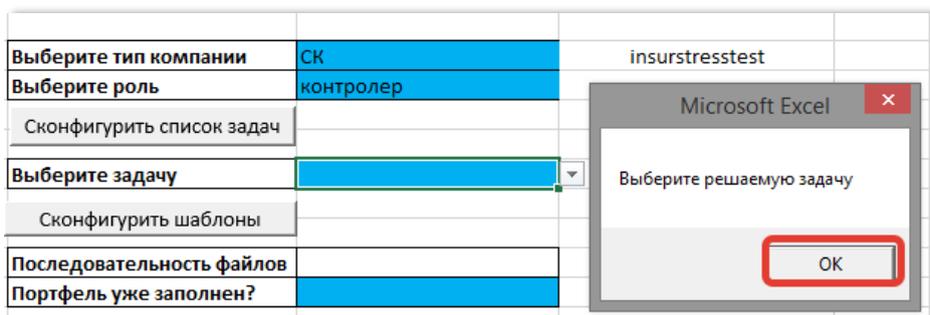
Контроль 1) корректности формирования бухгалтерского каскада согласно учетной политике (конструирование каскада и сопоставление с оценкой, внесенной в input) 2) для справедливой стоимости оценка попадания в доверительный интервал с указанием на сколько можно повысить/понизить оценку.

Алгоритм действий:

- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;
- С. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «ТСС», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	ТСС	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портфель, ТСС	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 TSS	Открыть TSS

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, TSS», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

### 2.3.3. формы

Описание задачи:

Создание шаблонов-примечаний по управлению рисками для финансовой отчетности компании по МСФО. Включают в себя формы: географическая разбивка активов, разбивка активов по валютам, разбивка активов по дюрации, разбивка активов по сроку погашения.

Опционально, шаблон может быть дополнен иными аналитическими формами, например, по раскрытию методики (параметров) и построению справедливой стоимости.

Алгоритм действий:

А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария);

В. Открыть файл config;

С. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;

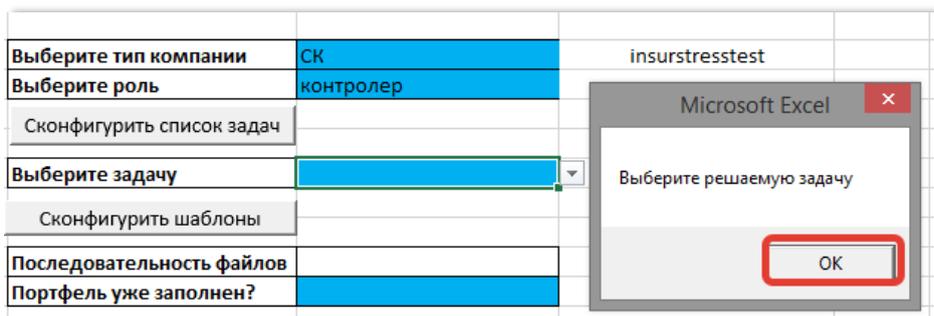
Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);

Выберите тип компании	СК	insurstresstest
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

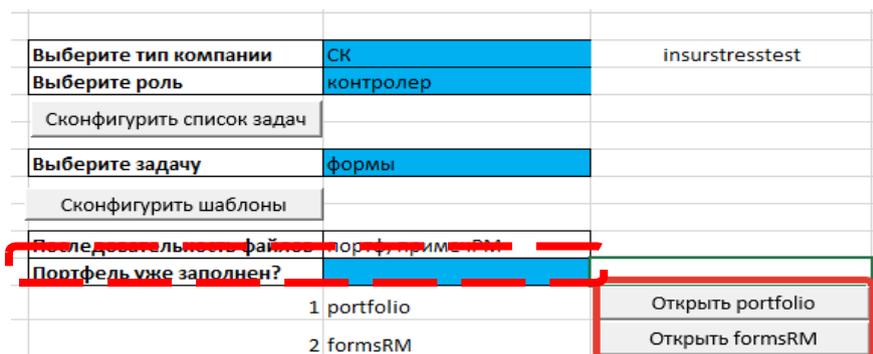
Проверка ISIN

Хотите ли проверить входные ISIN на корректность?

Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «формы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, forms RM», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

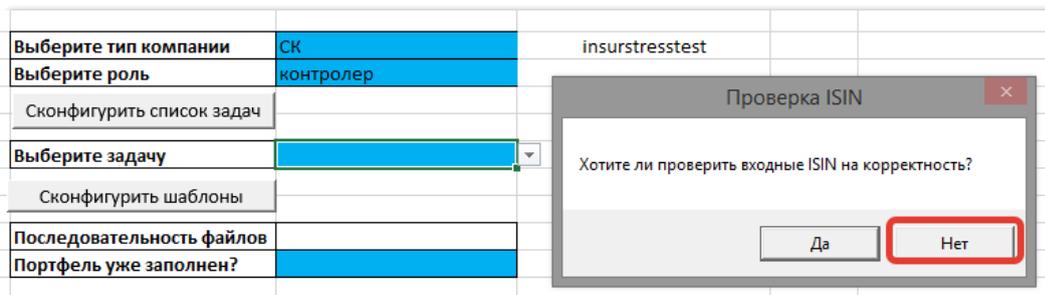
#### 2.3.4. Нормативы

Описание задачи:

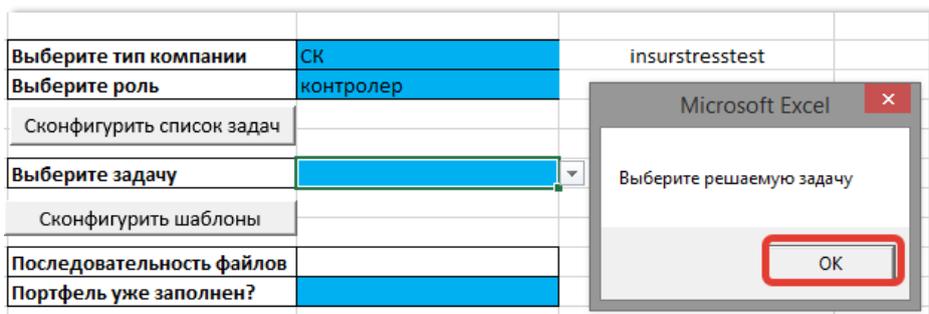
Реализация расчета (оценки) ликвидности активов (выделение высоколиквидных) по заполненному портфелю (за основу взяты стандарты Basel). Опционально в шаблон может быть добавлена оценка текущей ликвидности.

Алгоритм действий:

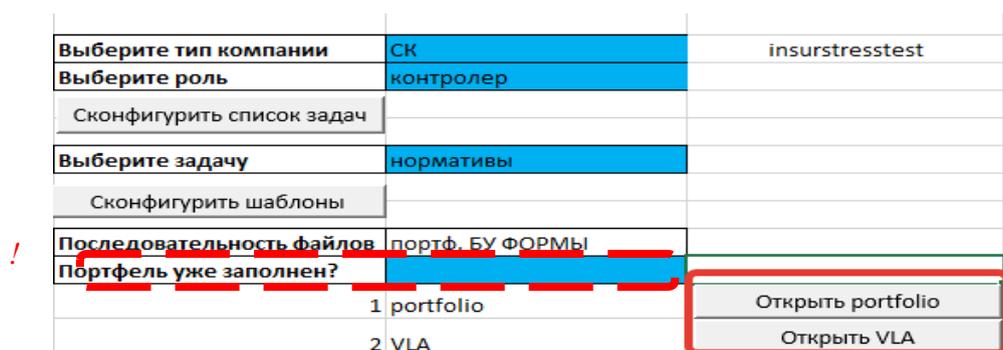
- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;
- С. В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, VLA», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

### 3. ПУРЦБ

#### 3.1. Задачи Риск менеджер

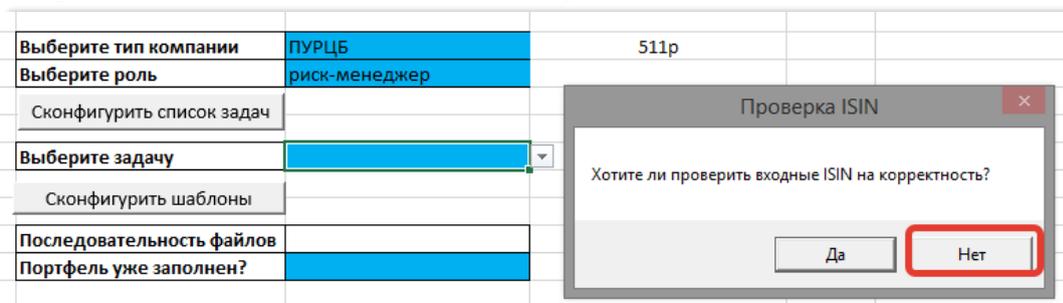
##### 3.1.1. оценка операционного риска

Описание задачи:

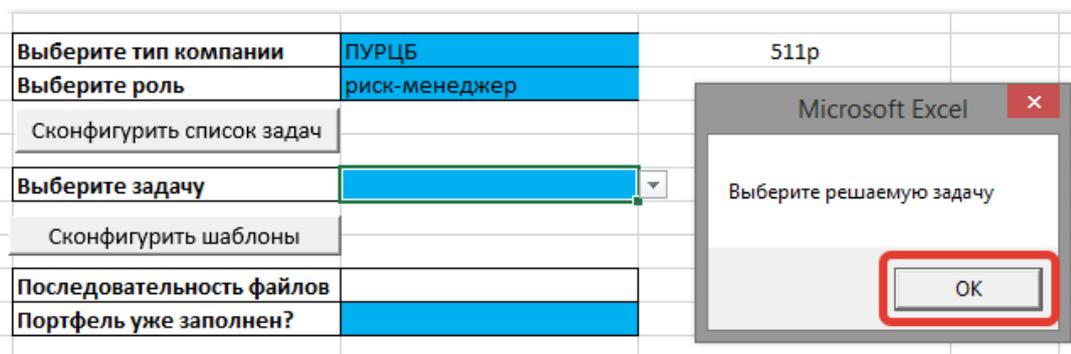
проведение качественной оценки операционного риска при помощи описания бизнес-процессов и построения матриц оценки вероятности и величины риска каждого этапа. Включена возможность настраивать матрицу свертки, внедрения своего классификатора рисков. Для описания бизнес-процессов и выделения критических точек в бизнес-процессах используется опросник.

Алгоритм действий:

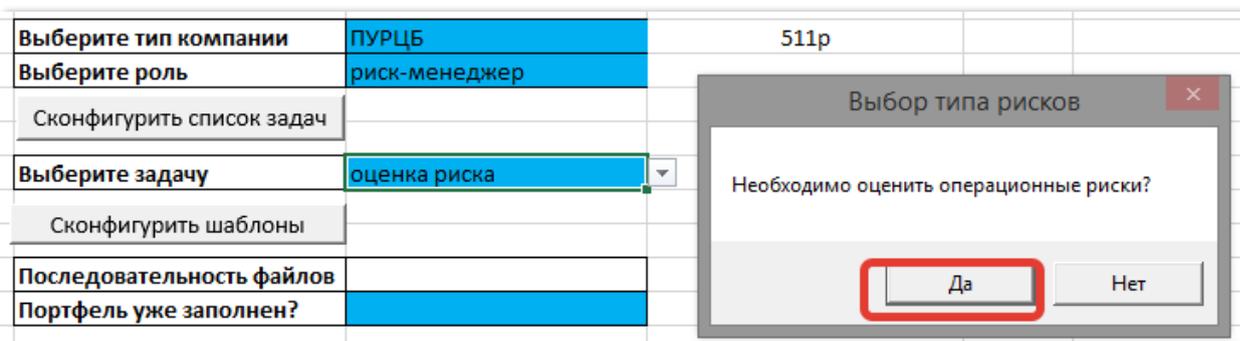
- A. Открыть файл config;
- B. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- C. Выбрать на всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;



- D. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- E. Выбрать Задача = «Оценить риски», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;
- F. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Да»;



G. Открыть файл-шаблон «OR», в котором провести оценку риска в соответствии с инструкцией к этому шаблону;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	оценка риска	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		
	Опер. риски	Открыть OR

### 3.1.2. оценка риска (финансовый риск)

Описание задачи:

Подготовка данных, проведение оценки рисков согласно Basel 3. Также можно воспользоваться шаблонами для НПФ и СК (выбрав соответствующие роли – см п 1.1.2 и 2.1.2).

Алгоритм действий:

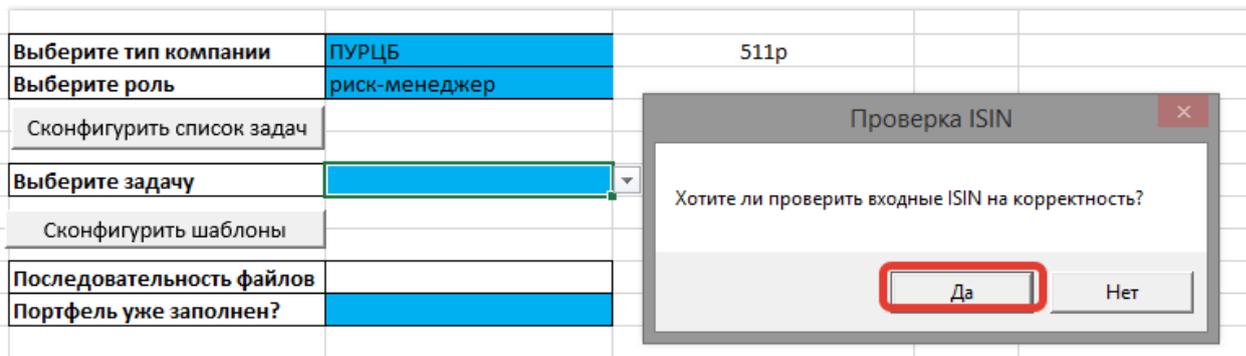
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации=ПУРЦБ, Роль = Риск менеджер, нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке:
  - ответ «Нет», если нет необходимости проверки корректности входных кодов (ISIN) бумаг;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

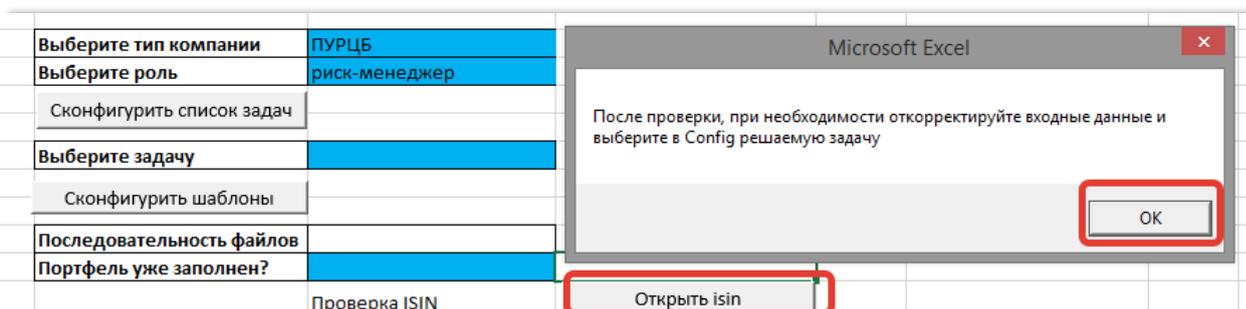
Проверка ISIN

Хотите ли проверить входные ISIN на корректность?

- ответ «Да», если нужна проверка корректности входных кодов (ISIN) бумаг (например, данные из непроверенного источника информации или не сверены);

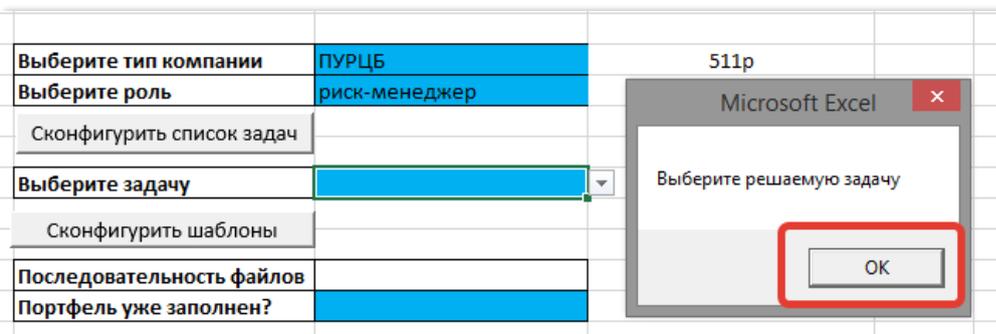


Затем нажать «ОК» (ознакомившись с текстом подсказки, что после проверки необходимо вернуться в Config и выбрать уже решаемую задачу без проверки ISIN);



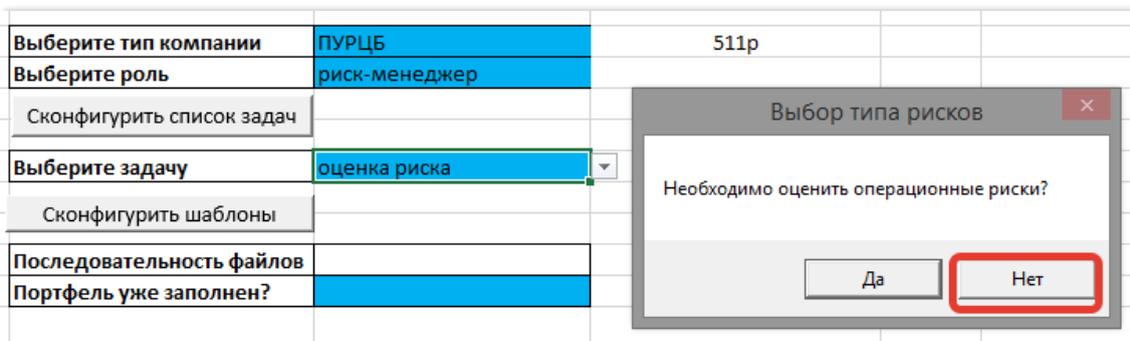
И нажать кнопку «Открыть isin» и выполнить проверку кода в соответствии с инструкцией к файлу- шаблону «isin».

Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «Оценить риски», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Г. На всплывающей подсказке выбрать ответ «Нет»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, affiliate, 4060-u», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	риск-менеджер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	оценка риска	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портфель, оценка	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 511p	Открыть 511p

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 3.1.3. подбор актива

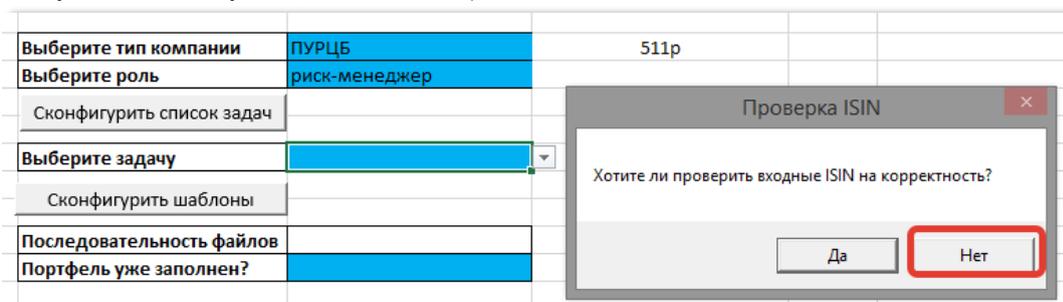
Описание задачи:

Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

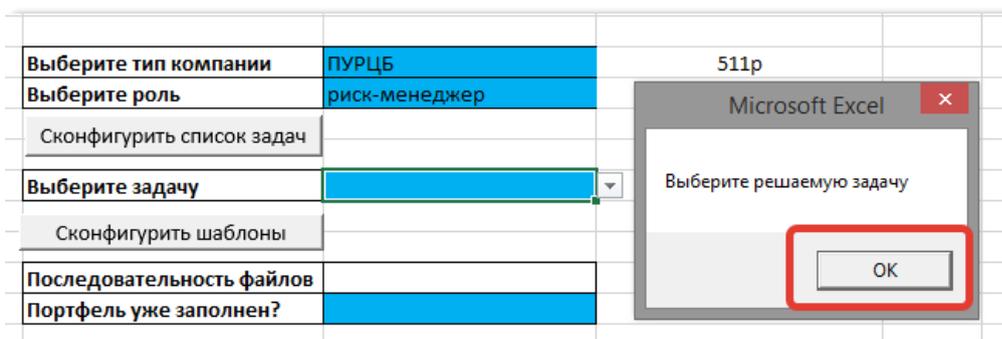
Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

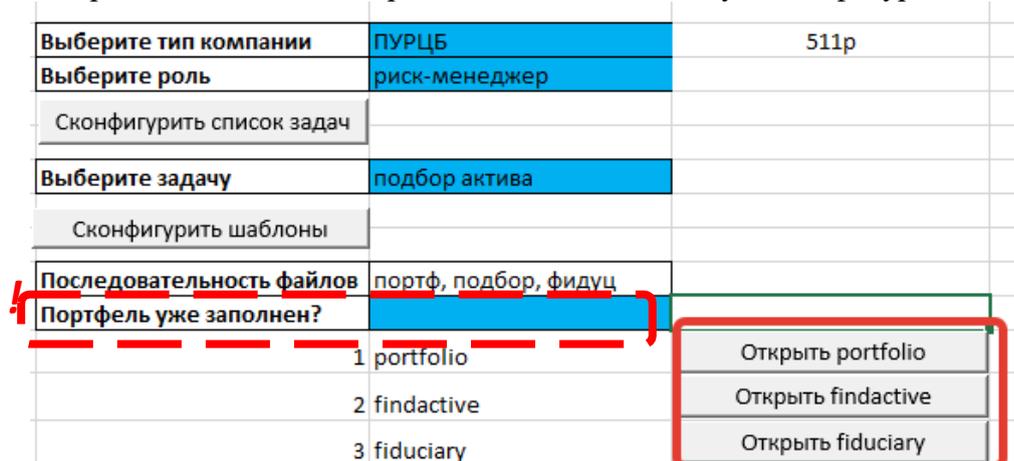
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

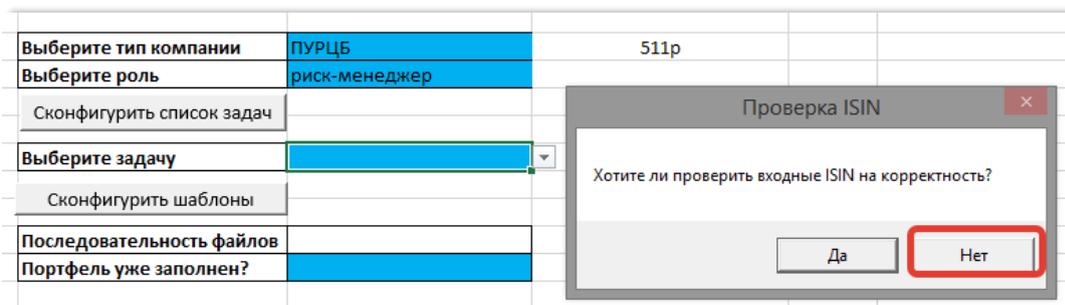
### 3.1.4. нормативы

Описание задачи:

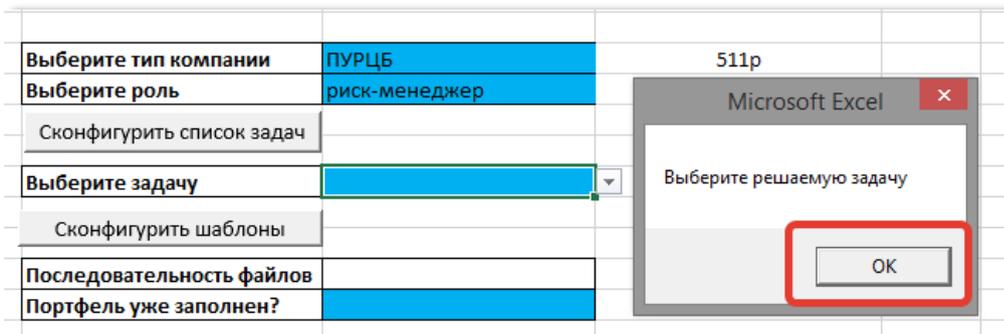
Реализация расчета (оценки) ликвидности активов (выделение высоколиквидных) по заполненному портфелю (за основу взяты стандарты Basel) согласно требованиям Банка России для брокеров. Опционально в шаблон может быть добавлена оценка текущей ликвидности.

Алгоритм действий:

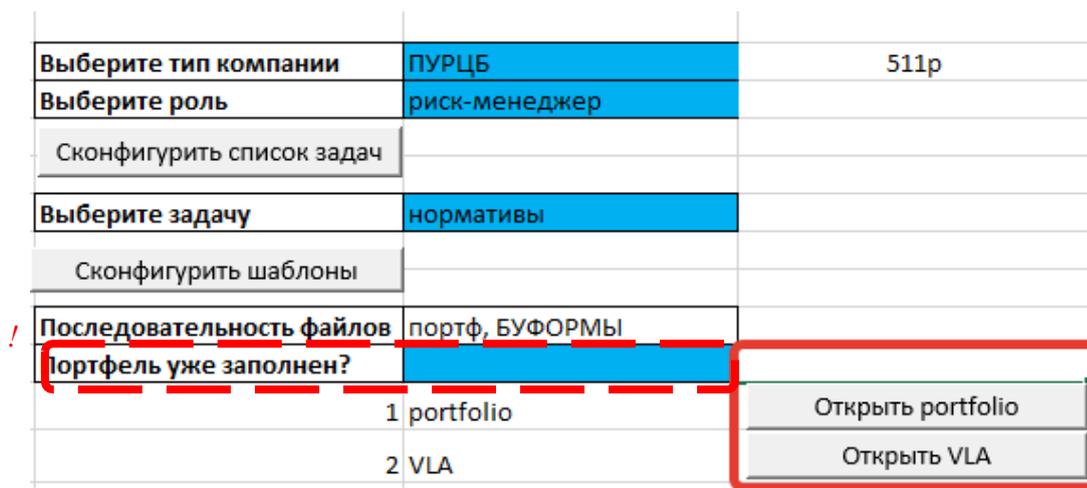
- Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- Открыть файл config;
- В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, VLA», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

## 3.2. Задачи Управляющего активами

### 3.2.1. контроль изменений

Описание задачи:

Отслеживание изменений по введенному списку инструментов (приближение даты оферты/погашения, изменение уровня листинга, изменений рейтинга (одного или нескольких по всему перечню)).

Алгоритм действий:

- А. Открыть файл config;
- В. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- С. Выбрать ответ «Да» на всплывающей подсказке;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		

Отслеживание изменений

Хотите настроить файл для отслеживания изменений по инструментам?

- Д. Открыть файл-шаблон «wishlist», в котором выполнить действия в соответствии с инструкцией к этому шаблону;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу		
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов		
Портфель уже заполнен?		
	wishlist	<input type="button" value="Открыть wishlist"/>

### 3.2.2. анализ потока выплат

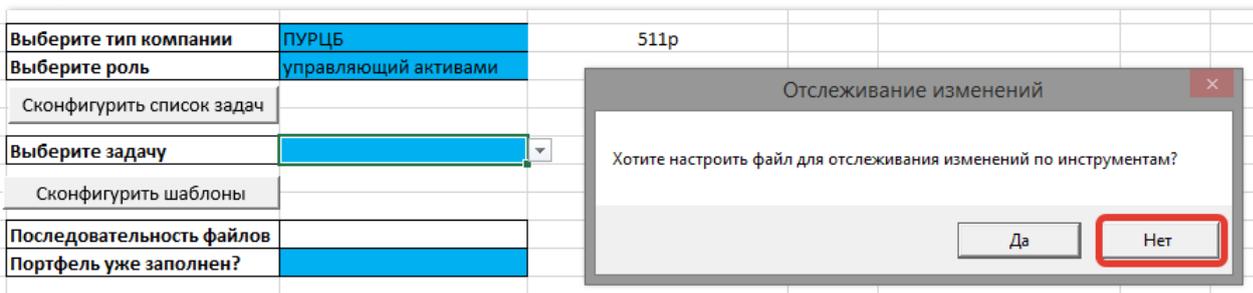
Описание задачи:

Расчет суммарных выплат по всему портфелю в дневной и годовой агрегации. Включена возможность учета дисконтирования к дате расчета с учетом бескупонной кривой МосБиржи соответствующей дюрации.

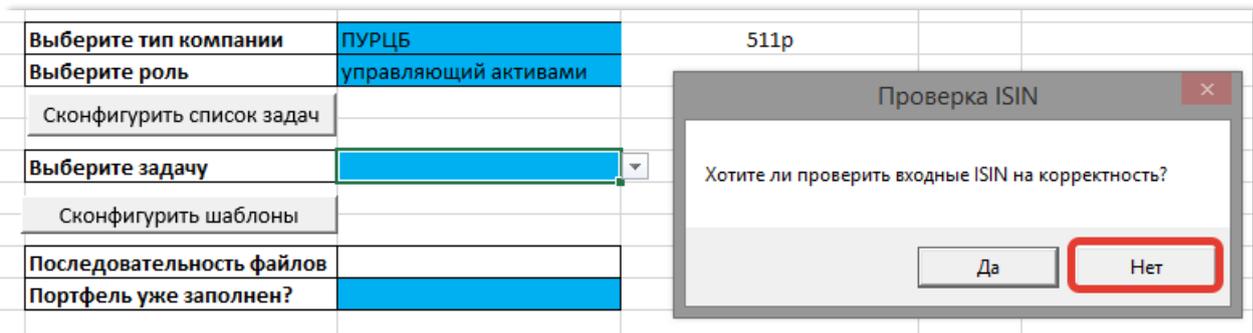
Алгоритм действий:

- А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- В. Открыть файл config;

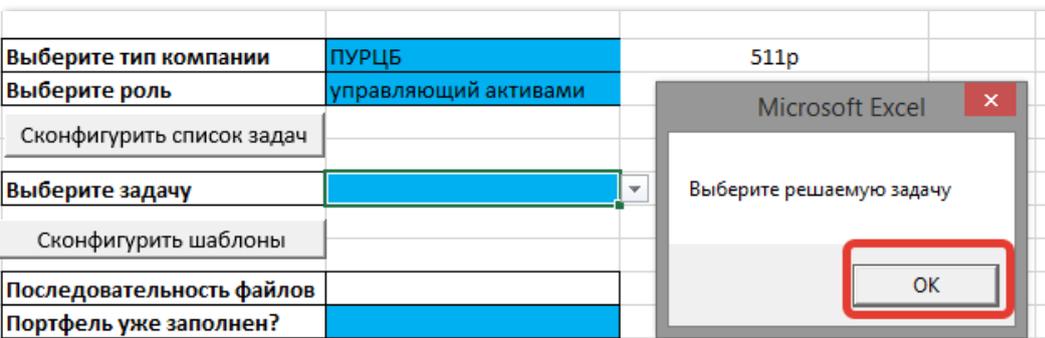
- C. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



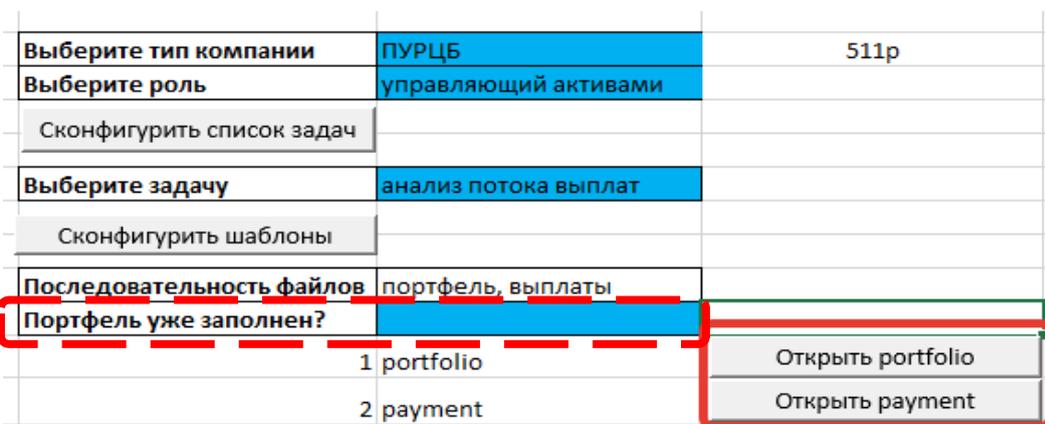
- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- G. Выбрать Задача = «анализ потока выплат», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



- H. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, payment», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда*

при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

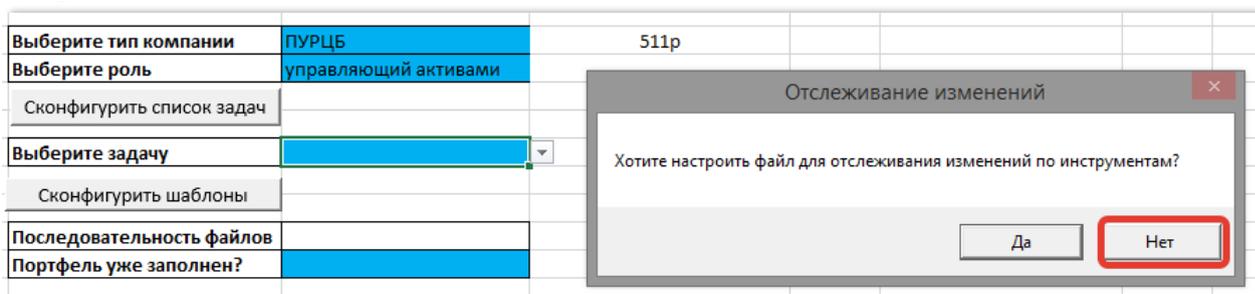
### 3.2.3. контроль ограничений

Описание задачи:

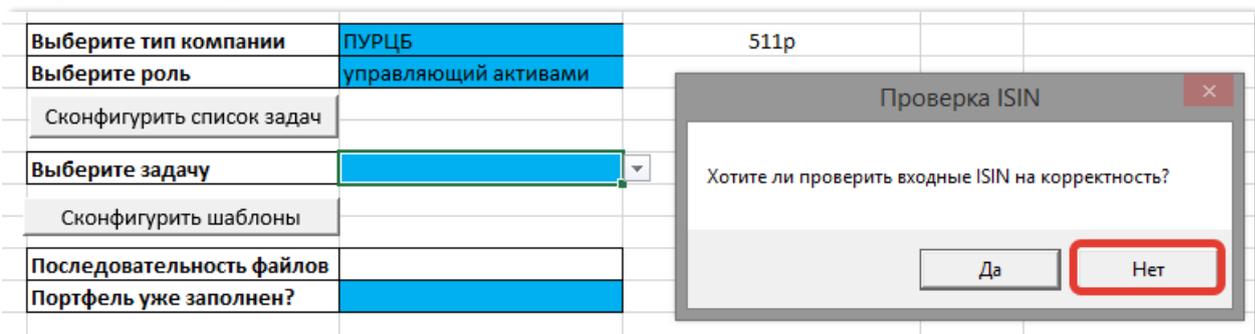
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

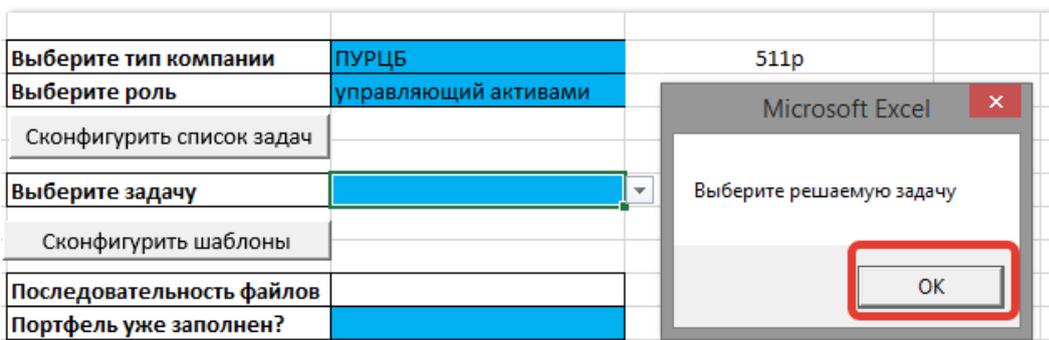
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Управляющий активами», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



- E. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



- F. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- G. Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	управляющий активами	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	контроль ограничений	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портфель, контроль	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 limits	Открыть limits

Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, limits, affiliate», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

### 3.2.4. подбор актива

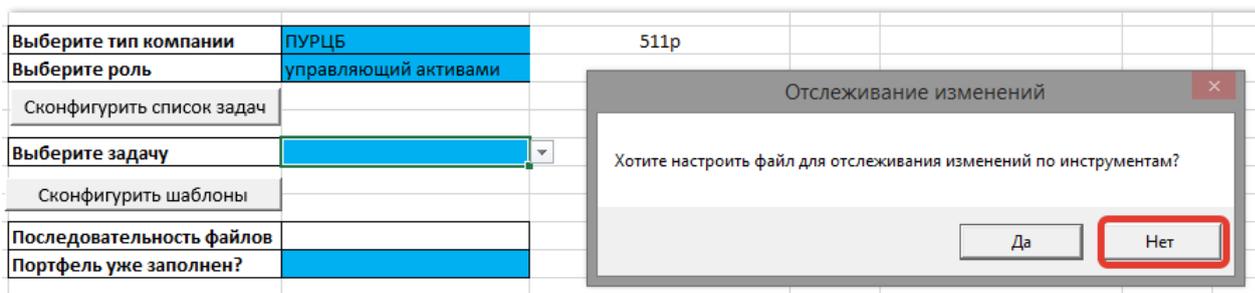
Описание задачи:

Опционально – анализ портфеля на сопоставление с инвест-стратегий (при заполнении соответствующего листа «ИС» в portfolio). Можно пропустить этот шаг.

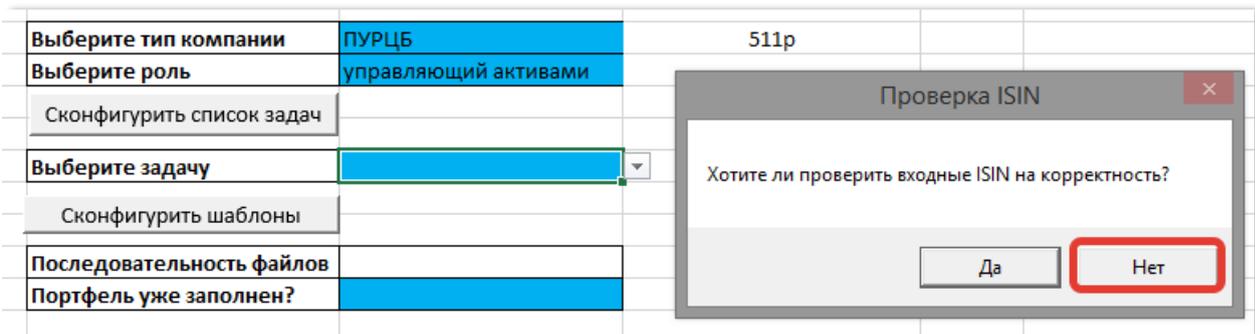
Подбор среди торгуемых на дату инструментов аналогов по задаваемым критериям, а затем оценивание фидуциарной ответственности согласно проекту Банка России (также есть возможность дополнительно проверить на соответствие требований о фидуциарной ответственности уже купленные инструменты по списку).

Алгоритм действий:

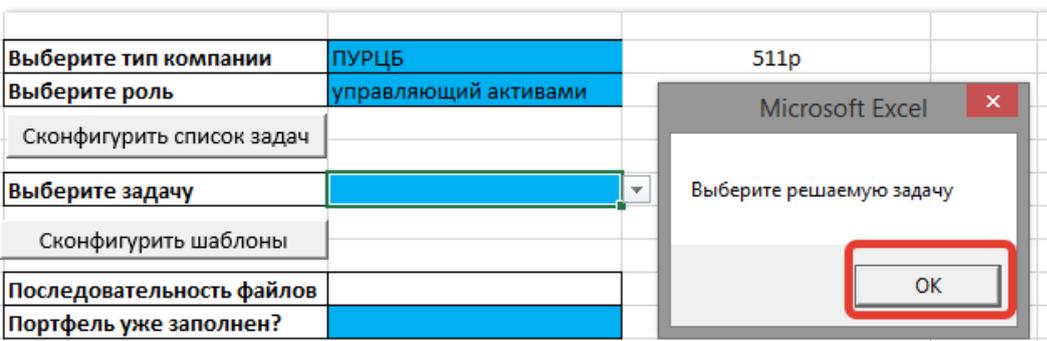
- Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- Открыть файл config;
- В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Риск менеджер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Выбрать ответ «Нет» на всплывающей подсказке;



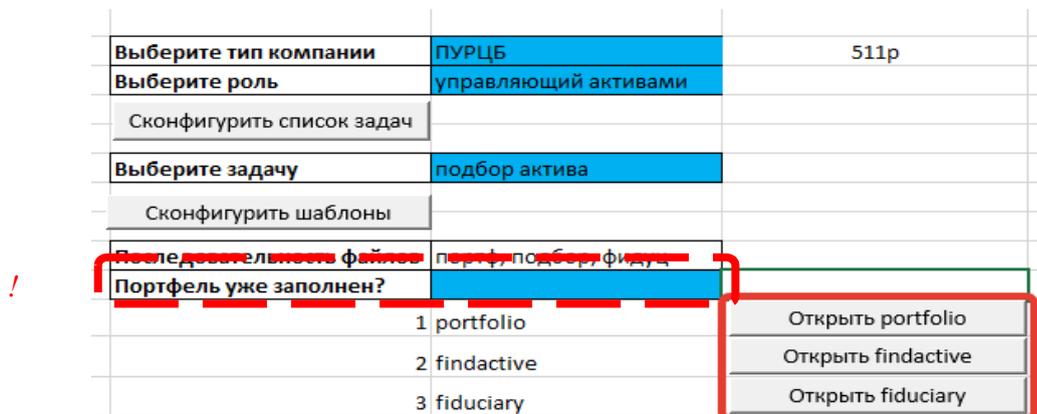
Е. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



Ф. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Г. Выбрать Задача = «Подбор актива», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Н. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, findactive, fiduciary», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

### 3.3. Задачи Контролера

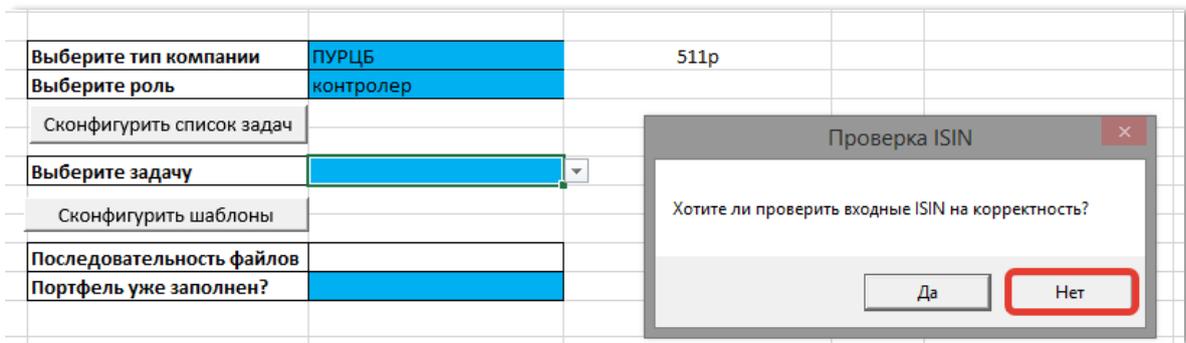
#### 3.3.1. контроль ограничений

Описание задачи:

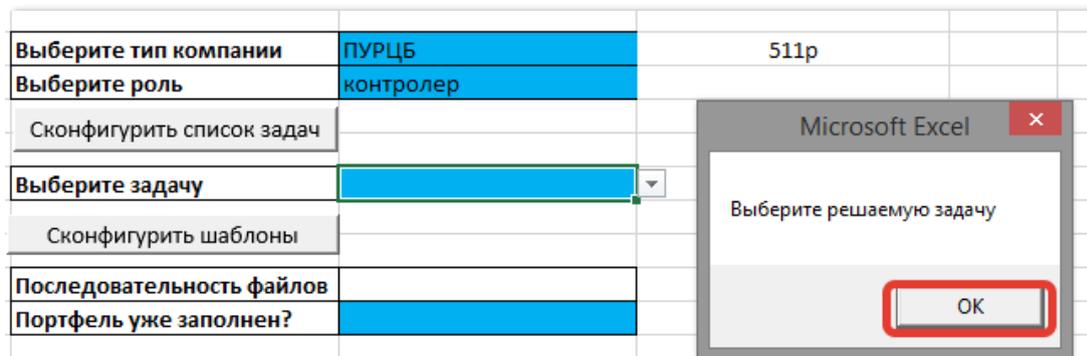
Реализация контроля ограничений по портфелям с возможностью настройки контроля регуляторных ограничений, ограничений по инвестиционным декларациям и любые другие лимиты.

Алгоритм действий:

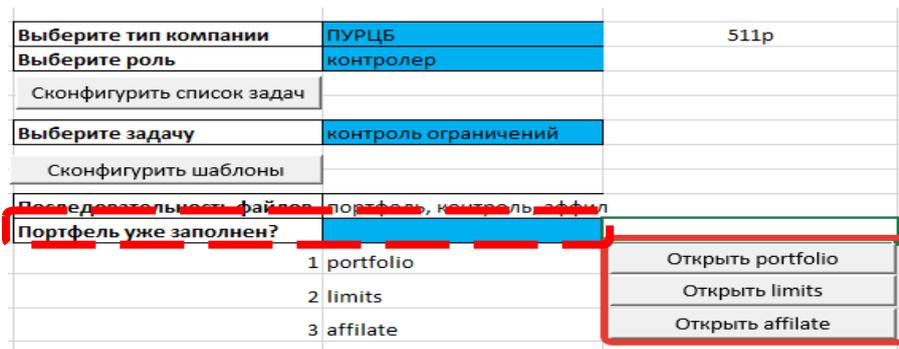
- A. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- B. Открыть файл config;
- C. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- D. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



- E. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



- F. Выбрать Задача = «контроль ограничений», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, limits, affiliate», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание: если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.*

### 3.3.2. ТСС

Описание задачи:

Контроль 1) корректности формирования бухгалтерского каскада согласно учетной политике (конструирование каскада и сопоставление с оценкой, внесенной в input) 2) для справедливой стоимости оценка попадания в доверительный интервал с указанием на сколько можно повысить/понизить оценку.

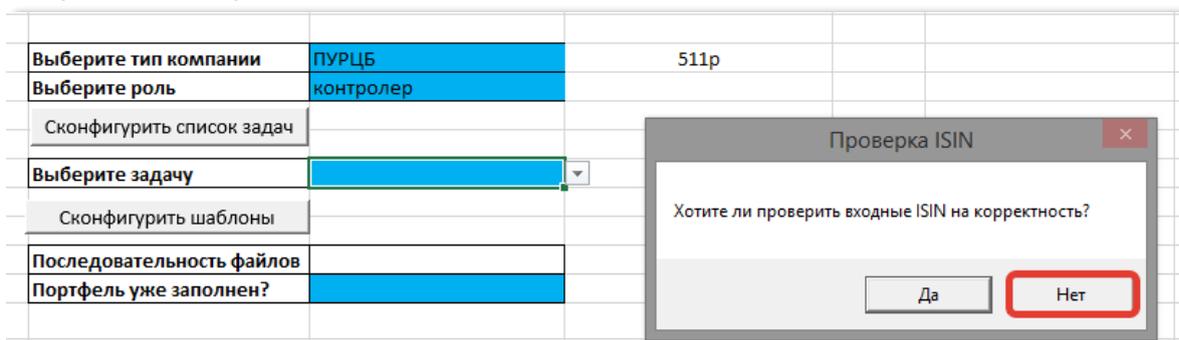
Алгоритм действий:

А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;

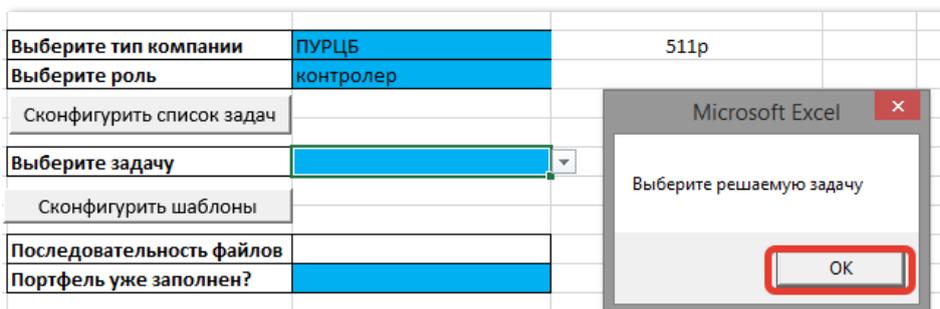
В. Открыть файл config;

С. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;

Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Выбрать Задача = «ТСС», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;

Выберите тип компании	ПУРЦБ	511p
Выберите роль	контролер	
Сконфигурировать список задач		
Выберите задачу	ТСС	
Сконфигурировать шаблоны		
Последовательность файлов	портфель, ТСС	
Портфель уже заполнен?		
	1 portfolio	Открыть portfolio
	2 TSS	Открыть TSS

Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, TSS», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 3.3.3. формы

Описание задачи:

Создание шаблонов-примечаний по управлению рисками для финансовой отчетности компании по МСФО. Включают в себя формы: географическая разбивка активов, разбивка активов по валютам, разбивка активов по дюрации, разбивка активов по дюрации.

Опционально, шаблон может быть дополнен иными аналитическими формами, например, по раскрытию методики (параметров) и построению справедливой стоимости.

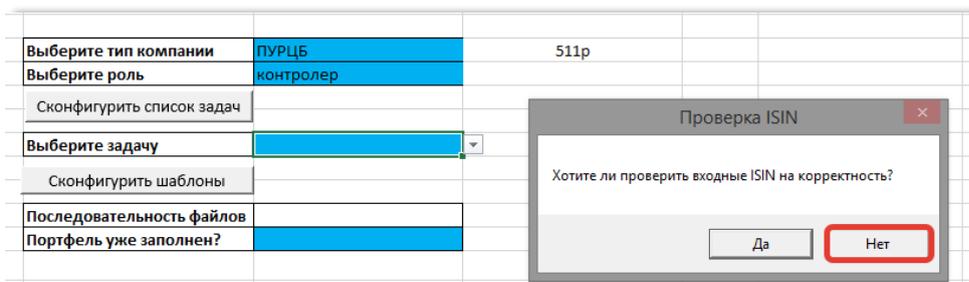
Алгоритм действий:

А. Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;

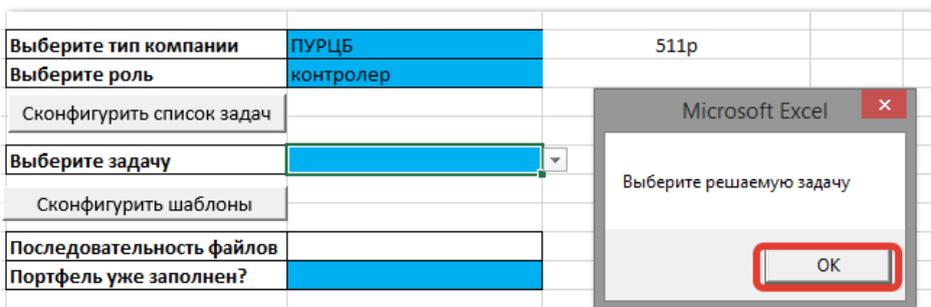
В. Открыть файл config;

С. В файле выбрать Тип организации= «ПУРЦБ», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;

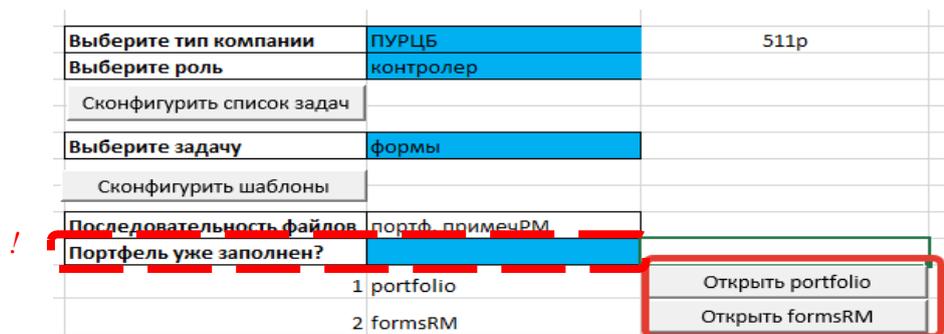
Д. Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля не нужна, если нужна, см. п. 3.1.2.);



С. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Д. Выбрать Задача = «формы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Е. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, forms RM», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

**! Замечание:** если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

### 3.3.4. Нормативы

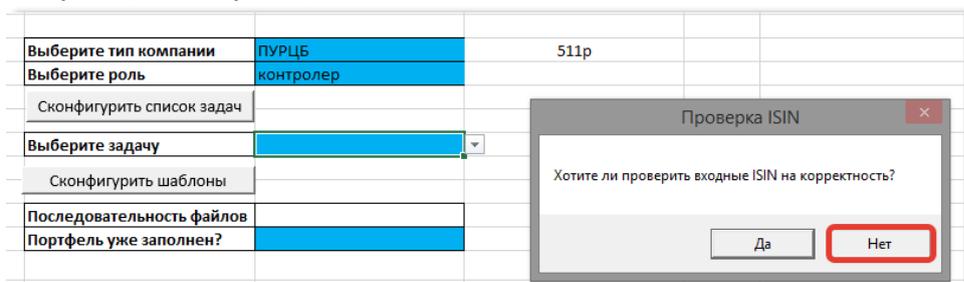
Описание задачи:

Реализация расчета (оценки) ликвидности активов (выделение высоколиквидных) по заполненному портфелю (за основу взяты стандарты Basel). Опционально в шаблон может быть добавлена оценка текущей ликвидности.

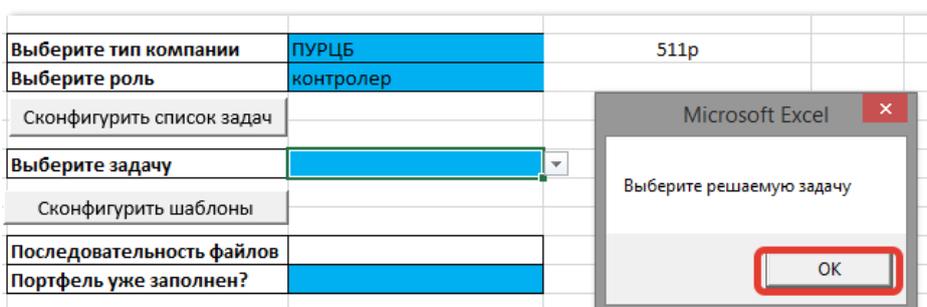
Алгоритм действий:

- Подготовить входные данные (см инструкцию по подготовке файлов input, input2, файлы от спец. депозитария) – если планируется заполнение файла с портфелем – portfolio;
- Открыть файл config;
- В файле выбрать Тип организации= «СК», Роль = «Контролер», нажать кнопку «Сконфигурировать список задач»;
- Выбрать на всплывающей подсказке ответ «Нет» (если проверка ISIN текущего портфеля

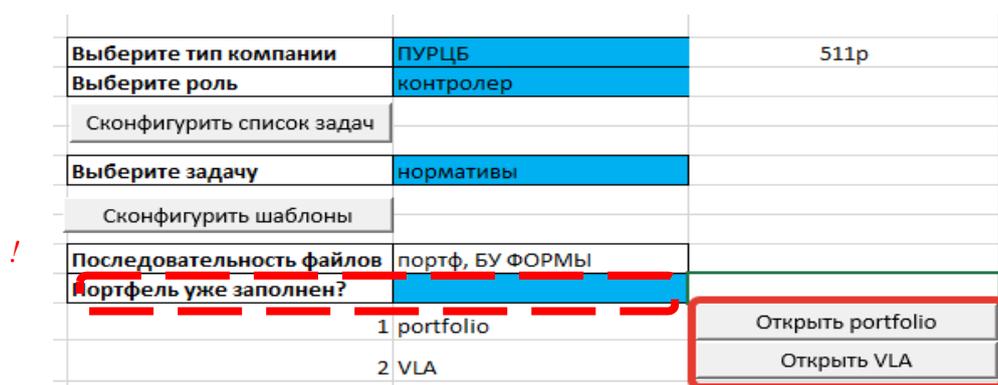
не нужна, если нужна, см. п. 2.1.2.);



Е. На всплывающей подсказке нажать «ОК»;



Ф. Выбрать Задача = «нормативы», нажать кнопку «Сконфигурировать шаблоны»;



Г. Открывать последовательно файлы-шаблоны «portfolio, VLA», в которых провести действия в соответствии с инструкцией к этим шаблонам.

*! Замечание:* если файл «portfolio» уже заполнен, то можно его не перезаполнять, а выбрать вариант «да» в поле вопроса «Портфель уже заполнен» в файле Config. Тогда при нажатии на кнопку «Открыть portfolio» файл portfolio откроется и можно будет сразу без его повторного заполнения перейти к следующей кнопке.

---

СЛУЖБА ПОДДЕРЖКИ RUData

+7 495 357 2077

help@ rdata.info

- ответит на вопросы по работе с сервисами;
- проведет обучение для пользователей;
- настроит индивидуальную выгрузку данных под Ваши потребности;
- расскажет обо всех обновлениях системы.