

ГАМА Версия 9.0. Список изменений.

Импорты:

- Реализован импорт спецификаций акций с сайта Украинской Биржи;
- Реализован импорт курсов валют с сайта Национального Банка Украины;
- Реализован импорт транзакций с файлов ФБ «Перспектива»;
- Реализован импорт спецификаций облигаций с сайта ФИНАМ.
- Реализован Импорт спецификаций облигаций с сайта RUSBONDS.
- Реализован Импорт оферт в импорте спецификаций с CBONDS.
- Реализован импорт рейтингов с сайта CBONDS, а также хранение истории рейтингов и контроль лимитов по ним;
- Реализован Импорт цен ММВБ Паи квалифицированных инвесторов;
- Произведено повышение устойчивости online импорта сделок и котировок из Quik ;
- Реализована сверка импортированных данных из Quik с отчетами брокера;
- Реализован импорт цен 1 ЦБ с FINANCE.YAHOO.

Аналитические возможности:

- Разработан новый метод расчета СИК по исторической стоимости для депозитов, а также возможность указания метода расчета СИК на спецификации ЦБ;
- Добавлен переключатель метода расчета СИК в фильтр экрана позиций Общего Портфеля, благодаря чему можно одновременно с разных рабочих станций рассчитывать СИК без пересчета базы данных;
- Разработан расчет аналитических показателей портфеля, композита, бенчмарка:
 - Доходность TWR с группировкой по произвольному набору активов;
 - Коэффициенты Шарпа, Сортино, Трейнора, Информационный;
 - Статистические показатели: ковариация, корреляция, альфа, бета, детерминация и пр.;
- Добавлены в Общий портфель - Состояние новые показатели:
 - «+/- реализованный от погашений БВ» (12629);
 - «+/- реализованный от погашений ИВ» (12630);
 - «Средняя цена по покупкам» (12633);
 - «Средняя цена по продажам» (12634);
- Реализована возможность укрупнения сделок по одной позиции, дате и типу операции;

Функционал учета:

- Реализован учет баланса НКД депозитов как дебиторской задолженности;
- Добавлена возможность расчета баланса счета по плановым датам оплаты;
- Форекс. Реализован новый метод расчета прибыли по свопу;
- Форекс. Платежи:
 - Добавлена «дата оплаты (план)»;
 - Открыты на модификацию поля дат оплаты (план/факт), поля номер/название счета;
- Реализована возможность расчета средней стоимости активов в модуле комиссия УК по рабочим дням.

Прочее:

- Возможность учета процента в капитализации эмитента;
- Реализована возможность выбирать конфигурацию переключателей общего портфеля – состояние, отвечающих за расчет показателей доходности;
- Новый Dialog 13.0;
- Новые стилистические элементы пользовательского интерфейса.

Отчетность. Обновлено/разработаны следующие отчеты:

- Рыночная стоимость активов, формат excel и xml (структура ОДК), ;
- Стоимость чистых активов, формат excel и xml (структура ОДК);
- Отчет брокера формат xml (структура ОДК);
- Отчет о доходах от инвестирования (пост. 06-48);
- Отчет об инвестировании средств (пост. 06-48);
- Подтверждение «рыночности» сделок;
- Отчет клиенту (пост. 07-37);
- Отчетность по 32-33 постановлению для проф. участников;
- Отчетность по форме 1100;
- Отчетность по форме 020.