

*EffectiveTrade*

---

***EffectiveTrade*** — профессиональное решение  
для учета и анализа инвестиций

Для брокеров



принципиально новый  
личный кабинет  
пользователя,  
предоставляющий  
разнообразную  
аналитическую информацию  
по портфелю клиента в  
режиме реального времени.

Для управляющих и  
инвестиционных компаний



полноценное, готовое  
фронт-мидл офисное  
решение, позволяющее  
вести и контролировать  
счета клиентов, вести учет и  
анализировать результаты  
работы трейдеров,  
инвестиционных стратегий

## Установка EffectiveTrade позволит брокерам

предоставлять клиентам разнообразные отчеты по портфелю в режиме реального времени

улучшить уровень обслуживания клиентов и их лояльность

сэкономить собственные средства и время, затрачиваемые на разработку отчетов для клиентов

организовать работу консультантов, позволяя им анализировать состояние портфеля клиентов, его динамику и давать взвешенные рекомендации

вести учет собственных портфелей и внутренних структур компании

## Установка EffectiveTrade позволит управляющим и инвестиционным компаниям

- вести полноценный управленческий учет операций собственных портфелей и портфелей своих клиентов
- смотреть позицию, финансовый результат, эффективность управления по каждому клиенту, трейдеру, счету
- проводить глубокий анализ совершенных операций и портфелей, анализировать риски портфелей с деривативами (фьючерсами и опционами)
- рассчитывая доходность управления трейдеров и сравнивая ее с бенчмарками, считать бонусы трейдеров
- опираясь на показатели доходности и прибыли по каждому клиенту, сравнивая их с индексами, рассчитывать вознаграждение за управление и вознаграждения за успех компании
- предоставлять клиентскую часть программы своим клиентам для просмотра отчетов по их счетам
- подготавливать ежедневные отчеты для руководства компании

Программный продукт EffectiveTrade позволяет вести операции на российском и **западном** рынках со **следующими типами инструментов**

- акции
- облигации
- фьючерсы (включая фьючерсы на индексы)
- опционы на фьючерсы, в том числе маржируемые

## Поддерживаются следующие типы операций

- сделки купли/продажи
- сделки РЕПО
- операции ввода/вывода средств (денег и ценных бумаг)
- выплаты эмитента — купоны, амортизация
- прочие расходы — комиссия и сборы, налоги

В системе *EffectiveTrade* реализованы различные аналитические отчеты, позволяющие в режиме реального времени контролировать состав и структуру портфеля, отслеживать финансовые показатели портфеля, контролировать уровень доходности и риска и т.д.

Отчеты могут быть построены за любой исторический период или дату. **Основные отчеты:**

- позиция на дату
- прибыль и убытки за период
- анализ портфеля
- анализ активов
- анализ опционов
- сводный отчет
- открытые сделки
- закрытые сделки
- открытые сделки РЕПО

Отчет предназначен для отображения состава и структуры портфеля ценных бумаг на текущую или историческую дату и позволяет отображать как детализированную информацию по каждому активу в портфеле, так и сводную по всем портфелям. Основные показатели отчета:

- позиция на начало дня
- текущая позиция
- оборот покупок/продаж
- рыночная стоимость
- стоимость приобретения
- дневная прибыль
- переоценка

Position

Дата: 28.06.2010 Счет: (Все)  Автообновление Шаблон

Счет	Grand Total						
	Тек. ост.	Цена. прио...	Ст-ть приобр.	Рын. цена.	Рын. ст-ть.	Дн. Прибыль	Переоценка
Грошева_ММББ Т...			248 981,66		257 429,56	1 804,73	8 447,90
RUR	54 199,06	0,0000	54 199,06	1,0000	54 199,06	0,00	0,00
Акрон	30,00	855,0000	25 650,00	816,8900	24 506,70	296,70	-1 143,30
Дорогбж ап	2 500,00	11,8080	29 520,00	9,9650	24 912,50	-235,00	-4 607,50
ИнтерРАОао	303 000,00	0,0490	14 847,00	0,0471	14 271,30	0,00	-575,70
Проекти ао	4 500,00	6,6120	29 754,00	7,0000	31 500,00	1 743,03	1 746,00
ЦМТ ао	10 000,00	9,5012	95 011,60	10,8040	108 040,00	0,00	13 028,40



Отчет предназначен для расчета финансового результата за произвольный период. Показатели отчета рассчитываются по каждому активу в портфеле, суммарно по портфелю, суммарно по владельцу.

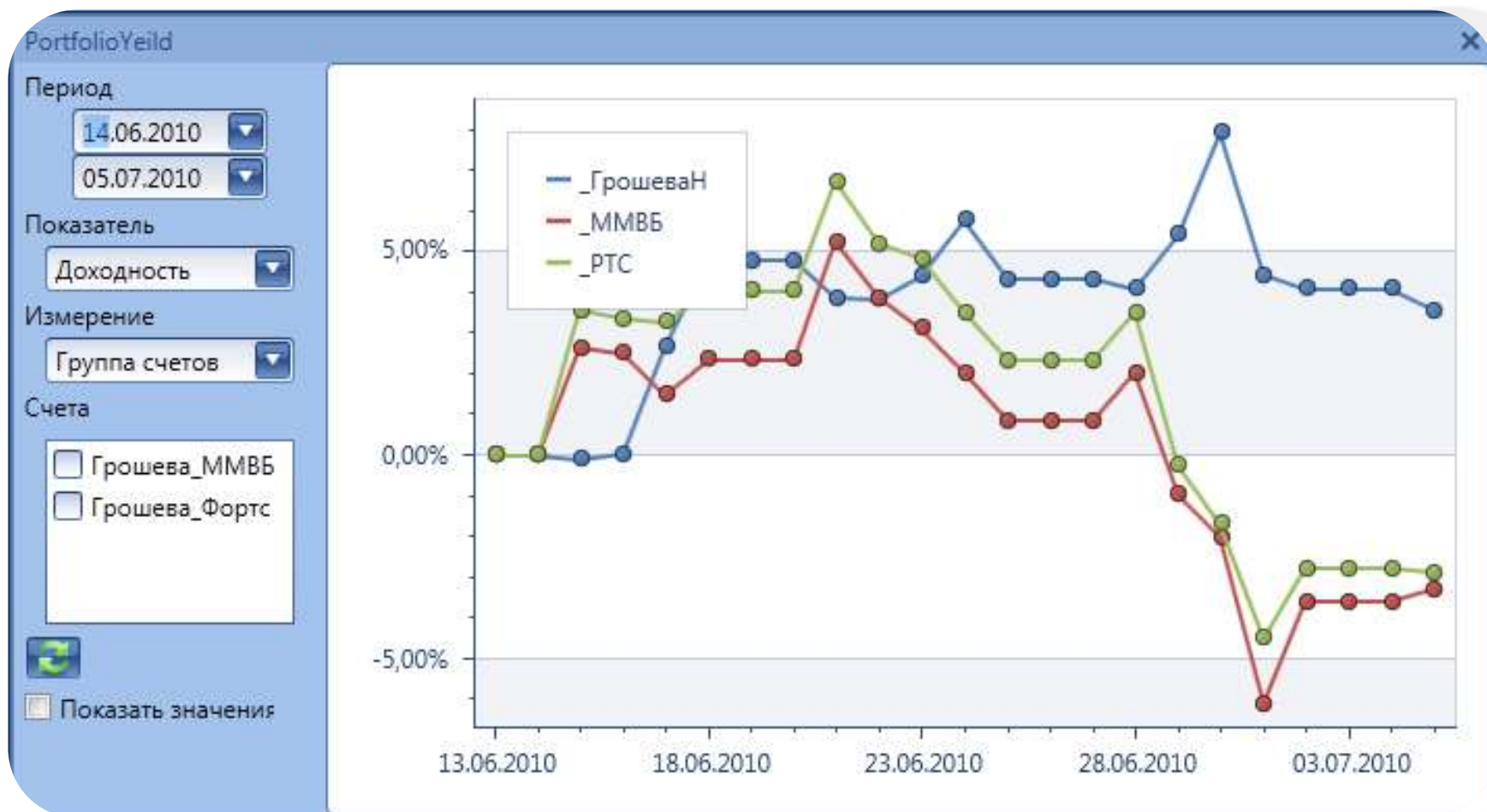
Показатели отчета:

- общая прибыль за период.
- реализованный доход
- нереализованный доход
- обороты за период, доходность (%)
- годовая доходность (%)
- уплаченная комиссия

Счет	Актив	Дата	Grand Total				Оборот...	Оборот...
			Прибыль	Комиссия	Дох-сть	Дох-сть г...		
Грошева_ММВБ Total			<b>8 352,61</b>	<b>11,49</b>	<b>2,43%</b>	<b>23,31%</b>	<b>69 577,80</b>	<b>93 888,84</b>
	АвиастрК ао		1 090,75	1,25	0,32%	3,04%	0,00	12 516,00
	Акрон		-56,10	0,00	-0,02%	-0,16%	0,00	0,00
	ГАЗПРОМ ао		889,91	3,29	0,26%	2,48%	0,00	32 942,84
	Дорогбж ап		-1 790,00	0,00	-0,52%	-5,00%	0,00	0,00
	ИнтерРАОао		-1 333,20	0,00	-0,39%	-3,72%	0,00	0,00
	ПроектИ ао		8 041,25	6,95	2,34%	22,44%	69 577,80	48 430,00
	ЦМТ ао		1 510,00	0,00	0,44%	4,21%	0,00	0,00
Грошева_Фортс Total			<b>-19 344,60</b>	<b>334,00</b>	<b>-5,62%</b>	<b>-53,99%</b>	<b>10 689 8...</b>	<b>10 545 3...</b>
	GAZR-6.10M090610PA 16000		-1 324,00	4,00	-0,38%	-3,70%	1 320,00	0,00

## Модуль позволяет графически отразить результаты управления портфелем, а именно

- сравнить график доходности одного или нескольких собственных портфелей друг против друга или с доходностью индексов
- показать динамику изменения прибыли за период. На графике можно увидеть максимальные просадки и максимальную прибыль
- показать динамику изменения стоимости чистых активов



Сравнение доходности

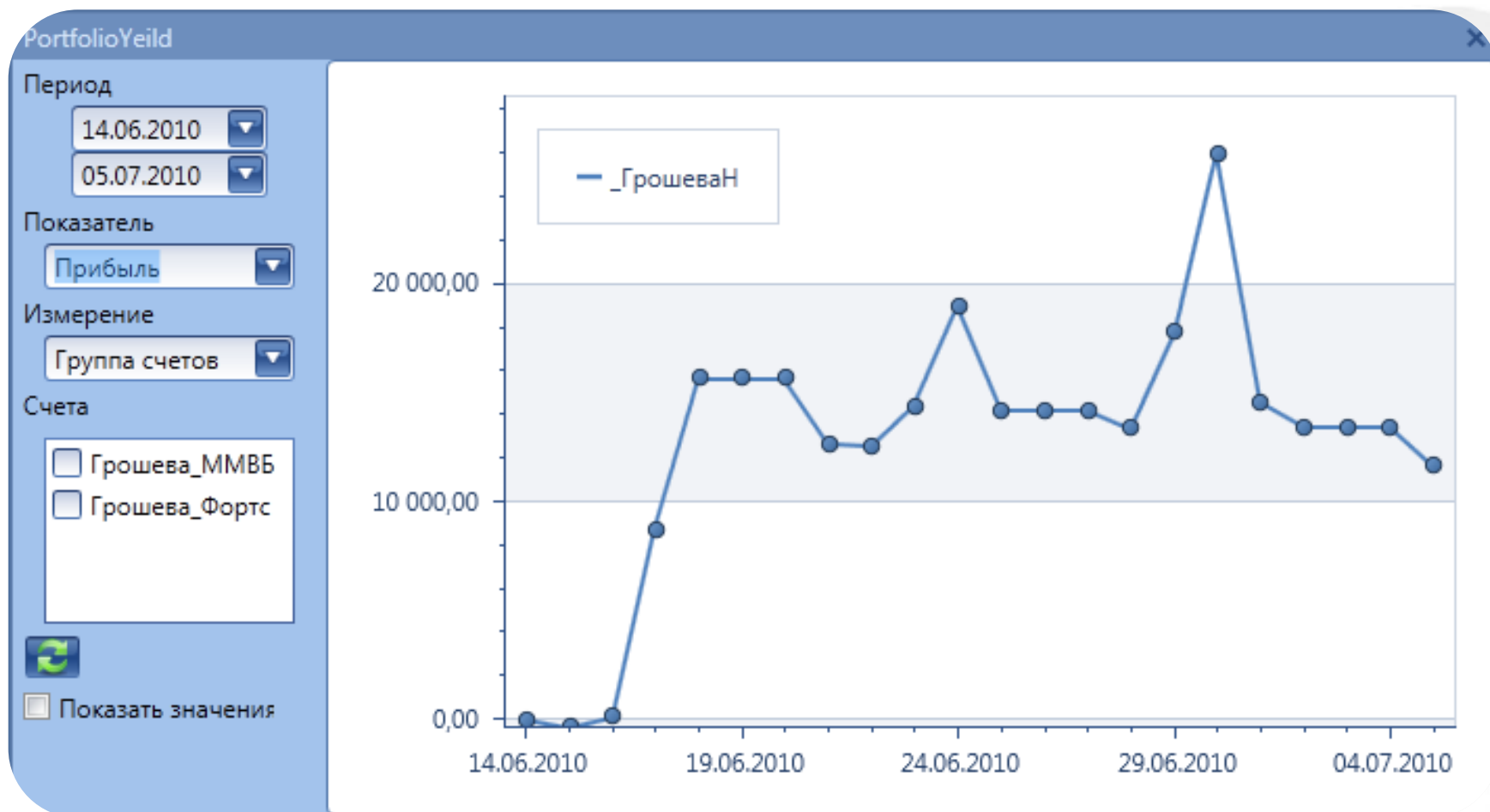


График прибыли

Отчет рассчитывает собственную доходность каждого актива и внутреннюю доходность актива. Под собственной доходностью понимается доходность, которую получил инвестор в результате сделок с этим активом. Под внутренней доходностью - изменение цены актива за период. Таким образом, отчет позволяет сравнить эффективность собственной стратегии против стратегии «купил и держи».

Grand Total						
Ак...	Да...	Прибыль	Собств. доход...	Доходность ак...	Цена на начало	Цена на конец
+		-686,10	-0,27%	-2,68%	807,0000	784,1300
+		0,00	0,00%	-4,87%	3 030,3000	2 877,7700
+		0,00	0,00%	1,24%	0,0770	0,0776
+		0,00	0,00%	0,48%	152,0000	152,3800
+		0,00	0,00%	-0,93%	4 800,0400	4 739,9000
+		0,00	0,00%	0,00%	16,6800	16,6800
-		-1 677,50	-0,66%	-6,65%	10,0590	9,3880
		-235,00	-0,09%	-0,93%	10,0590	9,9650
		-1 242,50	-0,49%	-4,99%	9,9650	9,4680
		-77,50	-0,03%	-0,33%	9,4680	9,4370
		-965,00	-0,38%	-4,09%	9,4370	9,0510
		270,00	0,11%	1,19%	9,0510	9,1590
		0,00	0,00%	0,00%	9,1590	9,1590
		0,00	0,00%	0,00%	9,1590	9,1590
		0,00	0,00%	0,00%	9,1590	9,1590
		572,50	0,22%	2,50%	9,1590	9,3880
		0,00	0,00%	0,00%	9,3880	9,3880
+		-818,10	-0,32%	-5,60%	0,0471	0,0444
+		0,00	0,00%	0,00%	11,0360	11,0360

Модуль предназначен для моделирования опционных и фьючерсных позиций в зависимости от изменения рыночных данных. **Основные возможности модуля:**

- анализ собственной позиции и предполагаемой
- расчет аналитических показателей (греков) по каждой позиции и сводных по базовому активу
- построение графиков на любую дату в пределах срока экспирации опциона
- возможность моделирования изменения волатильности

OptionAnalysis

Опционы Дата: 31.05.2010 Актив: RTS-6.10 Владелец: шева\_Фортс Портфель: Основной В рублях Цена фьючерса:

Тип	Тиг	Страйк	Кол-во	Цена	Ц.приобр	Переоценка	В деньгах	При погаш.	IV	Vola	Delta	Ve
Fut...		0,00	-2.00	137 210,00	135 072,50	-2,640.44	0.00	0.00	0,00%	0,00%	-2.00	
Op...	Put	100 000,00	4.00	45,00	160,00	-284.12	0.00	-111.18	76,59...	76,59%	-0.03	11,7%
Op...	Call	145 000,00	2.00	1 300,00	3 940,00	-3,261.17	0.00	-1,605.88	41,57...	41,57%	0.47	89,9%
Op...	Put	135 000,00	2.00	3 230,00	5 000,00	-2,186.47	0.00	-3,989.99	45,03...	45,03%	-0.81	113,8%

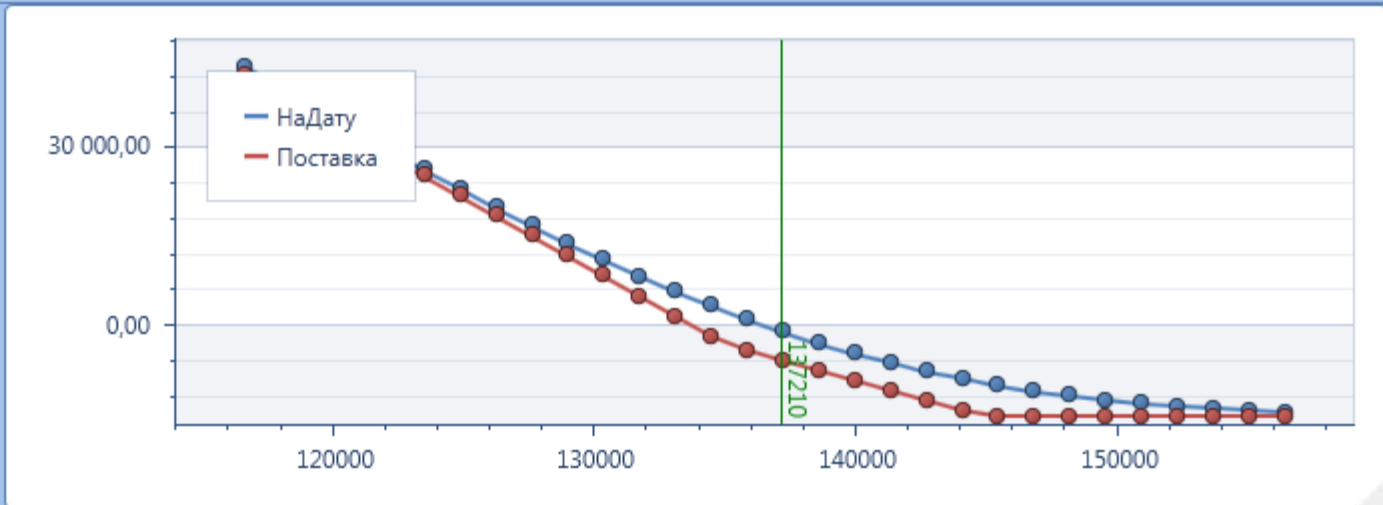
-8 372,20      0,00      -5 707,05      -2,37      215,64

Дата: 02.06.2010

Показатель: Прибыль

Диапазон цен: 15

Показать значения



Анализ опционов

Система позволяет получить список сделок и неторговых операций за любой период времени.

trades

Дата: 03.05.2010 07.07.2010 Счет: (Все) Шаблон: Скин:

Ном	Внеш. номер	Дата	BS	Владелец	Инструмент	Тип актива	Количе	Цена	Брокер	Платеж
-1116	844983034	14.05.2010	Buy	Грошева_ММ...	ГАЗПРОМ ао	Equity	185,00	162,1800	0,00	-30 003,30
-1135	845215959	14.05.2010	Buy	Грошева_ММ...	ГАЗПРОМ ао	Equity	18,00	159,5100	0,00	-2 871,18
-1192	846739205	17.05.2010	Buy	Грошева_ММ...	Сбербанк	Equity	390,00	76,6500	0,00	-29 893,50
-1183	846456727	17.05.2010	Sell	Грошева_ММ...	АВТОВАЗ ап	Equity	-400,00	3,1300	0,00	1 252,00
-1193	846742064	17.05.2010	Sell	Грошева_ММ...	АВТОВАЗ ап	Equity	-9 600,00	3,2080	0,00	30 796,80
-1225	848404827	18.05.2010	Buy	Грошева_ММ...	Ахрон	Equity	30,00	855,0000	12,11	-25 650,00
-1351	867666755	04.06.2010	Buy	Грошева_ММ...	Проекти ао	Equity	100,00	7,0380	0,00	-703,80

transactions

Дата: 31.05.2010 07.07.2010 Счет: (Все) Шаблон: Скин:

Номер	Сделка	Дата	Тип акти	Тип движения	Актив	Портфель	Счет	Количест
8901	-1332	02.06.2010	Бумаги	Приход (сделка)	GAZR-6.10M090610...	Основной	Грошева_Фортс	4,00
8902	-1332	02.06.2010	Деньги	Комиссии и расхо...	RUR	Основной	Грошева_Фортс	-4,00
9727	-1407	09.06.2010	Бумаги	Расход (сделка)	GAZR-6.10M090610...	Основной	Грошева_Фортс	-4,00
15728	-1740	15.06.2010	Бумаги	Расход (сделка)	GOLD-6.10	Основной	Грошева_Фортс	-4,00
9725	-1406	09.06.2010	Бумаги	Приход (сделка)	GOLD-9.10	Основной	Грошева_Фортс	4,00
9726	-1406	09.06.2010	Деньги	Комиссии и расхо...	RUR	Основной	Грошева_Фортс	-4,00
8494	-1268	01.06.2010	Бумаги	Приход (сделка)	RTS-6.10	Основной	Грошева_Фортс	2,00



## В программе реализованы следующие интерфейсы:

- с системами интернет-трейдинга: QUIK, NetInvestor, AlfaDirect, Transaq. Из этих систем в программу в режиме реального времени загружаются сделки и котировки. Одновременно могут быть подключено несколько систем интернет-трейдинга
- с бэк-офисной системой QORT
- с ФОРТС: загрузка опционных и фьючерсных контрактов, загрузка расчетных цен в конце дня (требуется для расчета вариационной маржи)
- загрузка котировок валют с сайта Центробанка ([www.cbr.ru](http://www.cbr.ru))
- загрузка данных из Excel-файлов

Система адаптирована для real-time вычислений при больших объемах данных. Быстродействие обеспечивается за счет использования концепции предрасчета данных. **EffectiveTrade** состоит из двух компонент: модуль real-time вычислений и клиентская часть, назначение которой — отображение данных.

Далее приведены результаты нагрузочного тестирования системы **EffectiveTrade**, проведенные на сервере следующей конфигурации:

Параметр	Значение
Процессор	4 x Intel Xeon 3.2 ГГц
Память	8 Гб
Жесткий диск	SCSI Ultra320
СУБД	Microsoft SQL Server 2005 Developer Edition

## Исходные данные:

Параметр	Значение
Количество сгенерированных клиентов	1 000
Количество закаченных инструментов (акции, облигации, фьючерсы, опционы)	1 175
Среднее число сделок в день	~30 000
Общее количество сделок на момент окончания тестирования	4 631 222
Среднее число открытых позиций одного клиента (в разных активах)	30

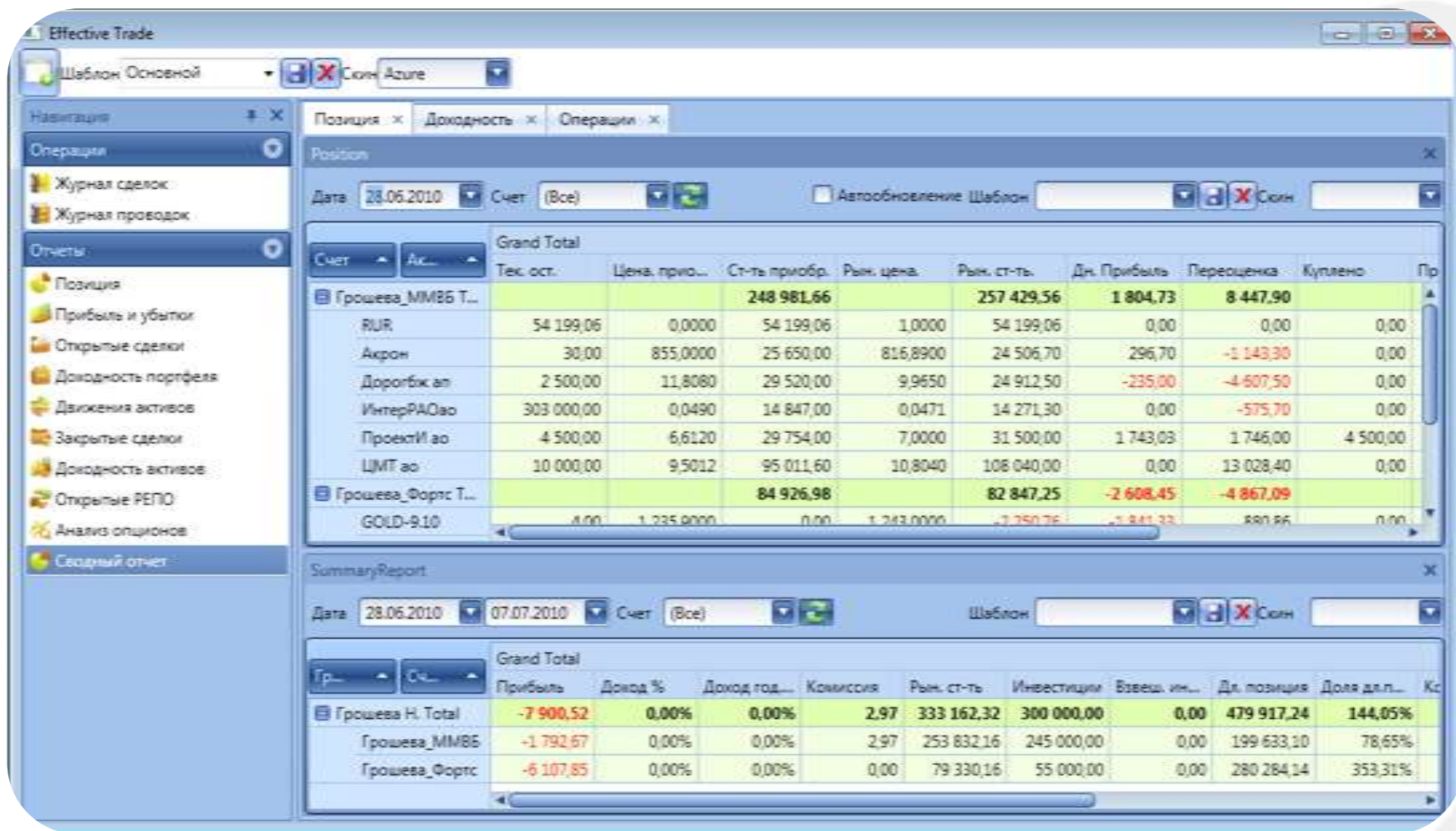
## Результаты тестирования:

Параметр	Значение
Актуализация позиций всех клиентов (выполняется автоматически)	1-2 сек
Количество запросов на обновление Позиционного отчета за 1 секунду	50
Время выполнения одного запроса на обновление отчета «Позиция на дату»	30-50 мсек
Построение отчета «Прибыль и убытки» за период с 01.01.2008 по 31.08.2008	4 сек

Клиентская часть программы открывается в интернет-браузере, но при этом обладает богатой функциональностью windows приложения. Такая функциональность обеспечивается использованием технологии Windows Presentation Foundation (WPF).

## Основные особенности:

- возможность открывать несколько окон и управлять их расположением
- создание нескольких вкладок, в которых открываются отчеты и функциональные модули программы
- возможность сохранять несколько конфигураций рабочего стола



The screenshot displays the EffectiveTrade client application interface. The main window is titled 'Effective Trade' and shows a 'Position' window with the following data:

Счет	Ак...	Grand Total	Тек. ост.	Цена, прио...	Ст-ть приобр.	Рын. цена	Рын. ст-ть	Дн. Прибыль	Переоценка	Куплено	Пр
Грошева_MM85 T...					248 981,66		257 429,56	1 804,73	8 447,90		
RUR			54 199,06	0,0000	54 199,06	1,0000	54 199,06	0,00	0,00	0,00	
Акрон			30,00	855,0000	25 650,00	816,8900	24 506,70	296,70	-1 143,30	0,00	
Дорогбж ап			2 500,00	11,8080	29 520,00	9,9650	24 912,50	-235,00	-4 607,50	0,00	
ИнтерРАОао			303 000,00	0,0490	14 847,00	0,0471	14 271,30	0,00	-575,70	0,00	
ПроектИ ао			4 500,00	6,6120	29 754,00	7,0000	31 500,00	1 743,03	1 746,00	4 500,00	
ЦМТ ао			10 000,00	9,5012	95 011,60	10,8040	108 040,00	0,00	13 028,40	0,00	
Грошева_Фортс T...					84 926,98		82 847,25	-2 608,45	-4 867,09		
GOLD-9.10			1,00	1 235,0000	0,00	1 243,0000	-7 750,76	-1 841,33	890,86	0,00	

Below the 'Position' window is the 'Summary Report' window, which provides a detailed overview of the portfolio performance:

Гр...	С...	Grand Total	Прибыль	Доход %	Доход год...	Комиссия	Рын. ст-ть	Инвестиции	Взвеш. ин...	Дл. позиция	Доля дл...	Кс
Грошева Н. Total			-7 900,52	0,00%	0,00%	2,97	333 162,32	300 000,00	0,00	479 917,24	144,05%	
Грошева_MM85			-1 792,67	0,00%	0,00%	2,97	253 832,16	245 000,00	0,00	199 633,10	78,65%	
Грошева_Фортс			-6 107,85	0,00%	0,00%	0,00	79 330,16	55 000,00	0,00	280 284,14	353,31%	

Клиентское приложение