

## Winport

### Per il monitoraggio e il controllo di gestione del Portafoglio Titoli di Proprietà

**CONTROLLO  
di GESTIONE**

**RENDIMENTI  
e RISCHI**

WINPORT e' l'applicativo software di SKIPPER Informatica che fornisce al gestore del portafoglio titoli di proprietà un completo monitoraggio sia sotto il profilo operativo che fiscale (IFRS9).

**STATISTICHE**

**SIMULAZIONI**

Consente di ottenere le sintesi, i controlli gestionali e le simulazioni necessarie per una efficace strategia di gestione nel rispetto delle politiche di bilancio: il tutto con puntuale verifica della redditività e dei rischi.

WINPORT è rivolto in particolare agli istituti bancari quale complemento e arricchimento della procedura host tradizionale.

Avvalendosi dei prezzi di mercato e, per i titoli non quotati, dei prezzi generati dalle diverse metodologie di *PRICING (IRR, Asset-Swap, Z-Spread)*, WINPORT produce elaborati puntuali e dettagliati in termini sia di parametri reddituali (*rendimenti, duration, modified duration*) che di *utili operativi, plusvalenze, interessi e performance* per gli intervalli temporali desiderati.

E' presente il calcolo del Value at Risk (*Price VaR e Rate VaR*), sia di portafoglio che dei singoli titoli, utilizzando la confidenza e l'orizzonte temporale desiderato.

Nel portafoglio IFRS9 è inoltre possibile gestire le operazioni sui *derivati di copertura*.

Il "Test SPPI" (Solely Payments of Principal and Interests) consente di analizzare le caratteristiche dell'obbligazione per la determinazione della classificazione dello strumento finanziario.

I portafogli possono essere suddivisi in comparti in base al criterio più utile per l'utente. Le elaborazioni consentono di operare di volta in volta su tutto il portafoglio o solo sui comparti scelti.

## FUNZIONI OPERATIVE

WINPORT permette di seguire finanziariamente il portafoglio istituzionale. Utilizzando i prezzi di mercato consente di ottenere evidenze sui risultati di portafoglio, sia riepilogativi che di dettaglio, in termini di *utili operativi, plusvalenze e interessi di periodo*.

### RENDIMENTI e CASH FLOW

La rendicontazione presenta *l'analisi dei parametri reddituali* quali rendimenti, duration, modified duration. Inoltre, funzioni di *Cash-Flow* producono analisi sui flussi di cassa storici e consentono il monitoraraggio delle cedole e dei rimborsi futuri.

### PERFORMANCE

Le *Performance* forniscono una sintesi dei risultati di periodo dei portafogli con l'indicazione degli elementi iniziali, di periodo e finali che hanno concorso al risultato e il dettaglio di ciascun titolo. E' possibile tenere conto anche della liquidità reinvestita sulla base di una tabella di tassi giornalieri.

### RISCHI

La funzione di *analisi del rischio tasso* consente di ipotizzare scenari futuri di tassi per ottenere indicazioni, dettagliate per singolo titolo e sintetiche per tipologia, dell'impatto sui controvalori dei titoli a fronte di una variazione futura dei tassi in Euro o in altre divise.

### STATISTICHE

Sono disponibili funzioni *statistiche* sulla base di diverse classificazioni parametriche.

### VaR - Value at Risk

Il VaR dei singoli titoli e del portafoglio può essere calcolato utilizzando le curve tassi di riferimento (Rate VaR) oppure le serie storiche dei prezzi (Price VaR) e considerando il grado di confidenza e l'orizzonte temporale desiderato.

## FUNZIONI FISCALI

WINPORT permette di ottenere analisi e valutazioni nel rispetto della contabilità civilistica e IFRS9. Queste rendicontazioni forniscono un quadro completo della situazione fiscale dei titoli in portafoglio per il periodo di osservazione considerato.

### SIMULAZIONI

Sono presenti funzioni per *simulare l'operatività* di acquisto o di vendita di un titolo in portafoglio al fine di valutarne dinamicamente l'impatto sugli utili e sulle riserve. E' inoltre possibile simulare gli stacchi futuri di cedole e rimborsi per valutare fiscalmente i risultati di portafoglio a chiusura d'esercizio o a una data futura.

### REPORTISTICA

Funzioni di analisi ai prezzi fiscali consentono di ottenere report dettagliati con evidenze degli *utili fiscali*, delle *plusvalenze* e del *ricavo interessi* nonché di avere riepiloghi sugli utili realizzati in Euro o nella divisa originaria.

Per i portafogli con tipologia "AFS - Available for Sales (IAS39) - Fair Value to OCI (IFRS9)" sono riportati nel riepilogo fiscale anche i dati relativi agli ammortamenti e alle riserve AFS. E' disponibile una funzione di dettaglio dell'operatività in titoli con l'indicazione del tasso di ammortamento di ciascuna operazione.

Sulla base dei prezzi di bilancio, è possibile produrre report con la valorizzazione dei portafogli a corsi secchi o tel quel e le valutazioni in termini di rendimenti, duration e modified duration.

### PERFORMANCE

In modo analogo alle funzioni operative, è possibile effettuare *Analisi di Performance ai prezzi fiscali* con le evidenze di tutte le componenti (*utili, plusvalenze, interessi di competenza*) sia in divisa che in euro.