ЭФИР Add-In

Модуль по расчету рыночного риска ЭФИР Add-In (Блок RD Risk)

Краткое руководство пользователя. Обзор функционала.

Загрузите шаблоны, нажав на кнопку «Управление шаблонами»/ «Загрузить шаблоны с сервера»:

Файл	Главная	Вставка	Разметка страницы	Формулы	Данные	Рецензирование	: Вид	INTERFAX	♀ что	вы хотите	сделать?		
				٩	٩	٩				fx	fx	fx	fx
Открыть	Управление шаблонами •	регуляторны риск т	ый Справки, выгрузки, расчеты *	Справочники классификатор	и Итогито ы⊤ ириск	ргов Поиски и⊤ фильтрыт	События •	ВыгрузкииИ сервисы∗	1тоги бирж и ЦЦ ₹	RU Data *	Рейтинги •	ЭФИР т	Риски *
RU Data	Загрузит	ь шаблоны	с сервера	Спр	авочники и п	оиск	4	данные RU Da	ita		Функц	ии	
НЗ		X V	f _x										

Вызовете файл расчета из меню надстройки INTERFAX Add-In, нажав на кнопку «Регуляторный риск», и перенесите в него свои данные:

Файл	Главная	Вставка Ра	азметка страницы	Формулы Данные	Рецензирование	Вид INTERFAX	(🖓 Чтовых	отите сделать?			Д Общий достуг
[рата] Открыть	Управление шаблонами	Регуляторный	Справки, выгрузки, расчеты *	Справочники и Итоги классификаторы и ри	оргов Поиски (События Выгрузки и	Итоги бирж RU	fx fx Data Рейтинги Э	<i>fx fx</i> ФИР Риски Оп	ерации Надстро	йка
RU Data		БАНК РО	ссии 🕨	Справочники и	поиск	Данные RU D	ata	Функции			
Δ1		БАНКИ И	IHΦO ▶ 511-	П Мультибанк							
AI			511-								
			Зап	рос ЦБ РФ (2018)							
1			3an	рос ЦБ РФ	Строка формул						+
2			Пар	аметры риска портфеля							
A	В		С Пол	іный отчет	F	G	н	l. I	J	к	AX AY
1	_										дополнительные вал
2	сводн	ЫЙ ОТЧЕТ О ВЕ	ЕЛИЧИНЕ РЫНОЧ	НОГО РИСКА	Πα	ложения ЦБ РФ:	511-П/мар19	199-И/янв20	421-П/окт19		
3		24.02.0000	Duferen ren		Замо	розка рейтингов:	Да				
4	Дата	: 31.03.2020	выорать дату		Размерность ис	ходных данных:	руб		Полныи	1 расчет	
5					корректировка	на ликвидность:	не вычислять				
7	Howen	Национовани	IA BUOPA		периодли	квидации, днеи.	Passian nuces				
8	п/п	Hanstenoballi	ie prieka	Итого	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD
9		1 Процентный	риск (ПР)	0.0	0						
10		2 общий	/	0,	00						
11		3 специальны	й	0,	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
12		4 гамма и вег	a	0,	X 00	x	Х	Х	Х	Х	Х
14		5 Фонтовый п	HCE (DP)	0.0	0						
15		6 общий	aca (21)	0.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
16		7 специальны	й	0,	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
17		8 гамма и вег	a	0,	X 00	x	Х	Х	Х	Х	Х
19		9 Валютный в	HCK (BP)	0.0	0 3	x	X	X	X	X	X
20		0 PBA по OBI	п	0.	00 X	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
21		1 гамма и вег	a	0,	X 00	X	X	X	X	X	x
23		2 Товарный ри	ск (ТР)	0,0	0						
24		3 общий		0,	0,00	X	X	X	Х	Х	Х
25		4 дополнител	ьный	0,	0,00) X	X	X	X	Х	X
26		5 гамма и вег	a	0,	00 X	x x	Х	X	Х	Х	X
28		6 Рыночный р	нск (РР)		0 X	x	X	X	Х	Х	х
29											

В меню «Регуляторный риск» INTERFAX можно также выбрать тип соответствующего отчета:



1. «**511-П Мультибанк**»: для расчета рисков для группы банков

2. **«511-П»:** для расчета рыночного риска по Положению 511-П

3. **«Полный отчет»:** для расчета рисков по Положению 511-П, а также по Инструкции 180-И, 421-П и стресс-тест

4. «Запрос ЦБ РФ»: заполнение формы от Банка России

Для произведения расчета:

1. На первом листе «Сводный отчет» задайте *дату* расчета и *все пункты, отмеченные красным*. Черным шрифтом отображаются расчетные данные, получаемые после нажатия на кнопку «Полный расчет»:

В	С	D	F	G	н	I.	J	К	AX
									лополнительны
сводныі	Й ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНО	ОГО РИСКА	По	ложения ЦБ РФ:	511-П/мар19	199-И/янв20	421-П/окт19		
			Замо	розка рейтингов:	Да				
Дата:	27.04.2020 Выбрать дату		Размерность ис	ходных данных:	руб		Полный	і расчет	
			Корректировка	на ликвидность:	рассчитать				
			Период ли	квидации, дней:	10				
Номер	Наименование риска				Размер риска				
п/п		Итого	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD
1	Процентный риск (ПР)	454 160 715,33							
2	общий	28 158 720,56	27 758 720,56	400 000,00					
3	специальный	426 001 994,77	414 001 994,77	12 000 000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
4	гамма и вега	0,00	Х	X	X	Х	Х	X	Х
4	Фондовый виск (ФР)	12 436 924.50						1	
	бобщий	6 218 462.25	6 218 462.25	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1	7 специальный	6 218 462.25	6 218 462.25	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
8	8 гамма и вега	0,00	X	x	X	X	X	X	X
ç	Валютный риск (ВР)	10 122 321,17	х	X	Х	х	Х	X	X
10	0 РВА по ОВП	10 122 321,17	х	9 729 691,76	-7 831 429,86	193 734,30	0,00	0,00	-191 149,98
11	1 гамма и вега	0,00	х	Х	Х	Х	Х	Х	Х
12	2 Товарный риск (ТР)	115 808,44							
13	3 общий	96 507,03	96 507,03	Х	X	x	Х	X	X
14	4 дополнительный	19 301,41	19 301,41	Х	X	х	Х	X	X
15	5 гамма и вега	0,00	х	Х	Х	Х	Х	Х	Х
16	б Рыночный риск (РР)	4 340 557 057	Х	Х	Х	Х	Х	X	Х
		4 004 455 00							
капитал	ванка, тыс руо	4 081 455,00							
Валюты		Добавить валюту	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD
Коэффиц	циенты фондирования	X	1	0	0	0	0	0	0
Открыта	я валютная позиция, тыс руб	X	X	121621,147	-97892,8732	2421,6788	0	0	-2389,3747

Чтобы рассчитать Валютный риск (ВР):

- 1. На лист *Сводный отчет* импортировать из ф.634 **ОВП по валютам и драгметаллам** (в строку 34) и **Капитал банка** (в строку 30)
 - либо вручную, либо по кнопке Импорт ф.634
 - для клиентов ЦФТ используется кнопка Импорт ЦФТ:

30	\rightarrow	 Капитал Банка, тыс руб 	0,00							
32		Валюты	Добавить валюту	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD
33		Коэффициенты фондирования	X	1	0	0	0	0	0	0
34	\rightarrow	• Открытая валютная позиция, тыс руб	X	x	0	0	0	0	0	0
35										
36		НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ			Murgant Otua		aucront a da			
37		Достаточность базового капитала H1.1	8,3%		импортотче	пцвгφ	экспорт в фа	ил для кіко		
38		Достаточность капитала H1.0	12,8%							
39		Рентабельность капитала (ROE)	15,0%		Mugonz d	624	-			
41		Ставка фондирования	5,0%		импорт ф	.034				
42		Аллокация операционных расходов	0,5%							
43		Норма налогообложения	24,0%		14	IAT	20000			
45		Расчет нагрузки на капитал	Да		импорт с	μΦT	Экспо	лцФі		



2. Добавляется расчет Гамма-Вега риска (ГВР) по опционам на валютные пары и золото, для этого:

2.1. импортировать внебиржевые опционы из формы *Запрос ЦБ РФ* (предварительно нужно завести их в этой форме)



2.2. завести опционы на валютные пары с Мосбиржи на лист *Биржевые ПФИ* (можно завести и через *Запрос ЦБ РФ*)

Внимание! Важен именно указанный выше порядок действий.

3. Нажать на кнопку Полный расчет.

✓ Для выгрузки результатов расчетов для отчетности в ЦБ, на листе «Сводный отчет» есть кнопка «Экспорт в текстовый файл для Kliko».

✓ Значок «+» в правом верхнем углу страницы раскрывает дополнительный список валют.

✓ Есть возможность произвести расчет как с учетом, так и <u>без учета заморозки</u> <u>рейтингов.</u>

Также на листе «Сводный отчет» Вы можете рассчитать корректировку на ликвидность или не вычислять ее:

Howen	Нанменование	BUCES				Passien nucesa				
				Период ли	квидации, дней:	не вычислять				
				Корректировка	на ликвидность:	рассчитать	•			
Дата:	27.04.2020	Выбрать дату		Размерность ис	ходных данных:	руб		Полный	і расчет	
				Замо	оозка рейтингов:	Да				
сводны	Й ОТЧЕТ О ВЕЛ	ЛИЧИНЕ РЫНОЧН	ОГО РИСКА	По	ложения ЦБ РФ:	511-П/мар19	199-И/янв20	421-П/окт19		
										допол

На листе «Состав портфеля» Вы увидите результаты корректировки:



+7 495 357 2077 help@rudata.info www.rudata.info

Дата: 27.04.2020	Заведение стоим	ости позиции	производится в ру	ſδ		Рассчитать	Ликвидность	инструмента
ISIN	Позиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора	Секьюри К-т риска ВКр по п.5-6 647-П	тизация Обеспеченная доля, %ном	Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод)	Корректировка на ликвидность, руб	Корректировка на ликвидность, %	Рейтинг ликвидности
RU000A0JRTS1	100 000 000				99 100	2217194,835	2,217194835	L7
RU000A0JRTT9	100 000 000				100 859	982694,6889	0,982694689	L5
RU000A0JVD41	100 000 000				98 405	823030,6218	0,823030622	L7
RU000A0JVD66	100 000 000				101 207			
RU000A0JWM49	100 000 000				99 778	1026567,055	1,026567055	L2
RU000A0JWA92	100 000 000				99 437			
RU000A0JWF71	100 000 000				108 115	1796357,873	1,796357873	L6
RU000A0JX009	100 000 000				99 645	21228,09502	0,021228095	L1
RU000A0JXQ51	100 000 000				96 382	1018572,315	1,018572315	L2
RU000A0ZYC31	100 000 000				94 255	815482,227	0,815482227	L2
RU000A0ZYH02	100 000 000				97 194	1251852,854	1,251852854	L6

Подробнее о методике расчета корректировки на ликвидность Вы можете посмотреть здесь.

Расчет опционов и фьючерсов. Для расчета необходимо открыть шаблон «Запрос ЦБ РФ (2018)»:

Файл	Главная	Вставка Р	азметка страницы	Формулы	Данные	Рецензировани	не Вид	INTERFAX	♀что	вы хотите	сделать?		
		<u>e</u>		٩		<u>२</u>				fx	fx	fx	fx
Открыть	Управление	Регуляторный	і Справки, выгрузки,	Справочник	кии Итоги	торгов Поиск и	События	а Выгрузки и	Итоги бирж	RU Data	Рейтинги	ЭФИР	Риски (
	шаблонами	риск 🕶	расчеты *	классификато	оры∗ ири	ски∗ фильтры∘	· · ·	сервисы *	иЦЦ ≖	*	*	*	*
RU Data		БАНК РС	оссии 🕨	Сп	равочники и	поиск		Данные RU D	ata		Функц	ии	
A1	• :	БАНКИ І	1 HΦO → 511- 511- 3an	П Мультибанк П рос ЦБ РФ (2018									
4	В	с	D 3an	рос ЦБ РФ		н	J	к	L	м	N	0	5
1			Пар	аметры риска п	ортфеля								
2			Пол	ный отчет									
3													

У Вас откроется отчет в виде большой таблицы. Все поля, помеченные красным как обязательные, необходимо заполнить:

_								
	∎ 5·∂·\$				Запрос ЦБ РФ	(2018)1 - Excel		
Φ	айл Банк Росс	ии 511-П Гла	вная Вставка Разметка страницы	Формулы Данные	Рецензирование Вид	Разработчик INTERFAX Power	Pivot 🛛 🖓 Что вы хотите сделать	? Юлия Онищук
Пр	▶ Следук Ф Преды Отче	ощее замечание дущее замечани	 Информация Комментарии по заполнению Образец заполнения Справка 					
A2		× ✓	<i>f</i> x Порядковый № строки					
1								
	А	В	С	D	E	F	G	н
1								
2	Порядковый № строки	Дата, на которую приводится информация об остатке на счете	Номер Л/С с длянной/короткой позицией для бумаг (собственный портфель и прямое РЕПО_БППр), товаров (драг.мет и/или залоги); ви.бал треб/обяз для ПФИ и обратного РЕПО_БПр	Название л/с в АБС	Сумма входящего остатка на дату в рублевом эквиваленте	Сумма входящего остатка на дату в валюте счета	Номер л/с по УКД	Название л/с в АБС
3	1	2	3	4	5	6	7	8
4		_						
5								
6								
7								
8								
9								



Примеры по заполнению можно получить в файле из меню:

6	5- <i>2</i> -\$	• ÷							
Фа	айл Банк Росси	и 511-П	вная	Вставка	Разметка страницы	Фор	мулы	Данные	Реце
Про	 Следую Предыд Отчет 	щее замечание дущее замечани	е <u>Қом</u> Обр	Информац іментарии разец запо. Спр	ия по заполнению лнения равка				
A2	-	× 🗸 .	f _x Пo	казывает	пример заполнения О	гчета			
1				Запрос Ц Дополни	БРФ (2018)1 гельные сведения				
	А	В			С			D	
1	Порядковый № строки	Дата, на которую приводится информация об остатке на счете	Номер позици портфо товаро вн.бал РЕПО_	о Л/С с дли ией для бу ель и прям ов (драг.ма треб/обя: БПр	инной/короткой /маг (собственный лое РЕПО_БППр), ет и/или залоги); з для ПФИ и обратного	Назва	ание л/	/с в АБС	
2	1				2			4	
4					5			4	
5									
6									

Типы инструментов, примеры по которым есть в таблице, указаны в первых четырех колонках. Нужно начинать заполнять данные в Вашем отчете с первой колонки. У каждой строки отчета должен быть обязательно указан порядковый номер, без номеров строк собрать позиции будет невозможно.



										hel	<u>p@rudata</u>	.info
										W	ww.rudata	info
				-		-	-					
-	A	В	C	D	E	F	G	H	-	,	K	
					Поряд-	Дата, на которую	Номер Л/С с длиннои/короткои	Название л/с в АБС	Сумма входящего остатка на	Сумма входящего остатка	номер л/с по укд	Название л/с в АБС
					CTDOKIA	приводится	Собственный портфель и		дату в руслевом эквиваленте	на дату в валюте счета		
					cipolin	остатке на счете	IDDAMOR PERO, 5000), TOBADOB					
							(драг.мет и/или залоги); вн.бал					
							треб/обяз для ПФИ и обратного					
							РЕПО_БПр					
		сибтип	Pug EA	Пориция	п							
T.	-	ст	54	поз	16	2	3	4	5	6	7	
Ť.					V	-	-		-		,	
					· ·	01.04.17	0221020200000000000	Сделка с ПФИ №38 с АО ЮНИКРЕДИТ БАНК со сроком	2 504 424 000 00	C 000 000 000 00		
				позиция в БА	1	01.04.17	9551059200000500456	исполнения от 31 до 90 дней	5 584 424 000,00	8 000 000 000,00		
- 10	ΦИ	форварл	валютный									
				поставка ДС	2	01.04.17	9631081000000300456	Сделка с ПФИ №38 с АО ЮНИКРЕДИТ БАНК со сроком	3 191 489 361,70	3 191 489 361,70		
								исполнения от 31 до 90 дней		· · ·		
-	•		•									
				позиция в БА	3	01.04.17	9331039200000300556	Сделка с ПФИ со сроком исполнения от 31 до 90 дней	1 194 808 000,00	2 000 000 000,00		
	ÞИ	форвард	товарный						4 050 000 707 00	4 000 000 707 00		
				поставка дс	4	01.04.17	9631081000000300556	сделка с пфи со сроком исполнения от 31 до 90 дней	1 063 829 787,23	1 063 829 /87,23		
- 14	ъи	форвард	акции	.05иц. Е 1	5	01.04.17	96504810500008801102	Форвард на акции	2 134 000 135,00	2 134 000 135,00		
		4 ob oo by		поставка ДС	6	01.04.17	93504810500008800000	Форвард на акции	2 017 000 740,00	2 017 000 740,00		
			•									
				позиция в БА	7	01.04.17	9331039200000300003	Сделка с ПФИ CCS № 11 RENAULT FINANCE S.A. со сроком	4 181 828 000,00	7 000 000 000,00		
								исполнения от 91 дня и более от нерезидентов				
п	ÞИ	своп	валютный				+					
								CREAKE C BOM CCS NO 11 RENAULT FINANCES & CO CROKOM				
				поставка ДС	8	01.04.17	9631081000000300003	исполнения от 91 дня и более от нерезидентов	2 750 491 159,14	2 750 491 159,14		
	ъи	ORUMON	RECHTHE	позиция в БА	9	01.04.17	9331084000000300741	Опцион пут1	1 450 000 000,00	26 000 000,00		
		onquon	basilonitalii	поставка ДС	10	01.04.17	9631081000000300741	Опцион пут1	1 482 000 000,00	1 482 000 000,00		
	ъи	опцион	валютный	Deanque e EA	11	01.04.17	9331084000000300541	Опцион колл1	1 430 000 000,00	26 000 000,00		
1				посточка дс	12	01.04.17	9631081000000300541	Опцион колл1	1 502 000 000,00	1 502 000 000,00		
ц	6.	акция	обыкн.		13	01.04.17	5060681030000011542	Вложения в акции	1 978 774 883,13	1 978 774 883,13		
Ц.	6.	облигация	корп.		14	01.04.17	50208810300108080123	ВЭБЛиз 13 06/11/2018_RU000A0JU9T5	336 565,03	336 565,03	50208810200208080123	ВЭБЛиз 13 ПКД

Поля для ПФИ и для опционов, заполненные в примере, надо заполнять обязательно, иначе не получится выполнить расчёт.

После заполнения формы «Запрос ЦБ РФ» надо нажать в меню кнопку «Проверить», и, если все заполнено правильно, появится сообщение:

6	- ب ا	¢ -	& -	÷								
Фа	айл Ба	анк Ро	оссии 51	1-П	Главна	ая	Вставка	Разм	иетка стран	ицы	Формулы	Даннь
Γ		Сле,	дующее	замеч	ание	0	Информац	ия				
Ino	Reputh	Пре	едыдуще	е заме	чание	Ком	иментарии	по заг	олнению			
ipo	веритв					Обр	разец запо.	лнения	4			
		0	тчет				Спр	равка				
		-	+ >	< •	f_x		Порядков	ый №	строки			
1												
2												
		Е				F				G		
1												
	Сумма в	кодя.	цего Ту в	Суми	на входя в валют	ящег сис	о остатка н ото	la	Номер л/	с по УКД	4	Назва
	рублево	м	y B	дату	B Barlio	e che	51a					
	эквивале	нте	Отчет l	цб рф						×		
			Í	Отч	ет соотв	етств	ует требова	ниям р	егулятора			
2												
3		5							OK	7		
4						_						
6												

Если что-то заполнено неправильно, появится сообщение об ошибке, и неправильно заполненные ячейки будут подсвечены красным:



+7 495 357 2077

А	В		C	D		E
Порядковый № строки	Дата, на которую приводится информация об остатке на счете	Номер Л/С (позицией д. портфель и товаров (др. вн.бал треб РЕПО_БПр	с длинной/короткой ля бумаг (собственный прямое РЕПО_БППр), аг.мет и/или залоги); /обяз для ПФИ и обратного	Название л/с в АБС	Сумм остат рубле эквив	а входящего ка на дату в звом аленте
			Отчет ЦБ РФ		×	
1	2		Отчет имеет ошибк	(M		5
	42826	9331039200	(см. примечания к я	ячейкам, выделенным красным фоно	M)	358442400
2	42826	9631081000				319148936
3	42826	9331039200			_	119480800
4	42826	9631081000		OK		106382978
5	42826	9650481050				213400013
6	42826	9350481050	00008800000	Форвард на акции		201700074
7	42826	9331039200	0000300003	Сделка с ПФИ ССЅ № 11 RENAU	л	418182800
8	42826	9631081000	0000300003	Сделка с ПФИ ССЅ № 11 RENAU	Л	275049115
9	42826	9331084000	00000300741	Опцион пут1		14500000
10	42826	9631081000	00000300741	Опцион пут1		148200000
11	42826	9331084000	00000300541	Опцион колл1		14300000
12	42826	9631081000	00000300541	Опцион колл1		150200000

У Вас появится еще один лист с описанием критических ошибок, которые необходимо исправить:

3	4	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
4	5	1	высокая	Порядковый № должен быть заполнен и идти по порядку, без г
5	5	2	высокая	Обязательное поле с датой
6	5	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
7	6	2	высокая	Обязательное поле с датой
8	6	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
9	7	2	высокая	Обязательное поле с датой
10	7	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
11	8	2	высокая	Обязательное поле с датой
12	8	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
13	9	2	высокая	Обязательное поле с датой
14	9	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
15	10	2	высокая	Обязательное поле с датой
16	10	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
17	11	2	высокая	Обязательное поле с датой
18	11	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
19	12	2	высокая	Обязательное поле с датой
20	12	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
21	13	2	высокая	Обязательное поле с датой
22	13	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
23	14	2	высокая	Обязательное поле с датой
24	14	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
25	15	2	высокая	Обязательное поле с датой
26	15	50	высокая	Формат - ДАТА (обязательная колонка для ПФИ)
<	Форм	а отчета	Отчет об	ошибках Информация Образец заполнения 🕘 🕀



Если отчет заполнен правильно, тогда его можно сохранить и открыть обычный расчетный шаблон:

Файл	Главная	Вставка Ра	азметка страницы	Формулы	Данные	Реце	ензирование	Вид	INTERFAX	<u> </u> Что в	вы хотите	сделать?		
	2	R	R	٩		۹.	Q				fx	fx	fx	fx
Открыть	Управление	Регуляторный	Справки, выгрузки,	Справочник	ии Итоги	торгов	Поиск и	События	Выгрузки и И	1тоги бирж	RU Data	Рейтинги	ЭФИР	Риски
	шаблонами	риск 🔻	расчеты *	классификато	ры∗ ири	ски т	фильтры 👻	*	сервисы *	иЦЦ -	*	*	*	*
RU Data		БАНК РО	ссии 🕨	Спр	авочники и	1 поиск		4	Данные RU Da	ta		Функці	ии	
A1	•	БАНКИ И	HOU 511-1 511-1 3anp	П Мультибанк П юс ЦБ РФ (2018)										
A	В	С	D Sanp	ос ЦБ РФ		н	1 I	J	К	L	М	N	0)
1			Пара	метры риска по	ртфеля									
2			Пол	ный отчет										
3				1										

И загрузить туда «Запрос ЦБ РФ»:

/	специальныи	0,00	0,00	ν,υυ	0,00	0,00	0,00	
8	гамма и вега	0,00	Х	Х	Х	Х	Х	
9	Валютный риск (ВР)	0,00	X	X	x	x	х	
10	РВА по ОВП	0,00	Х	0,00	0,00	0,00	0,00	
11	гамма и вега	0,00	Х	Х	X	х	X	
12	Товарный риск (ТР)	0,00						
13	общий	0,00	0,00	Х	Х	х	х	
14	дополнительный	0,00	0,00	Х	X	х	Х	
15	гамма и вега	0,00	Х	Х	Х	х	Х	
16	Рыночный риск (РР)	0	X	X	x	x	Х	
Капитал Ба	анка, тыс руб	0,00						
Валюты		Добавить валюту	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY
Коэффици	енты фондирования	X	1	0	0	0	0	0
Открытая	валютная позиция, тыс руб	X	X	0	0	0	0	0
				Импорт Отче		Экспорт в фай	л для KliKO	
			L		. 49. 1			
			L	Импорт ф	.634			

При загрузке появятся следующие сообщения, на которые Вам необходимо ответить в зависимости от задачи:

Выбор источника данных по опционам	×
Из какого источника брать данные по опционам (дельта, вмененная волатильность) и рассчитывать греки (гамма, вега): Мосбиржа или Запрос Ц	Б РФ?
Мосбиржа Запрос	ЦБ Р⊄



Позиция по опционам		×
В колонке 27 (и/или 28) позиция по опци Дельта?	онам вводилась, умножен	ная на коэффициент
	Да	Нет

После импорта отчета необходимо будет внести ОВП по валютам, коэф. фондирования. Далее нужно перейти на «Состав портфеля», там должны будут появиться Ваши позиции по фьючерсам и опционам:

	A	В	С	D	E	G	Н
1	Дата: 31.03.2017	Заведение стоим	ости позиции	производится в	руб		Очистить
2		Позиция	Дата	Секьюри	тизация	Размер позиции,	Корректировка
3	ISIN	(стоимость), руб	срока договора	К-т риска ВКр по п.5-6 647-П	Обеспеченная доля, %ном	шт. (оценка или ручной ввод)	ликвидность, (не вычисляе:
5	JPY	3 584 424 000	03.11.17				
6	RUB	-3 191 489 362	03.11.17				
7	BRO	1 194 808 000					
8	RUB	-1 063 829 787	13.12.17				
9	RU0009029540	-2 134 000 135					
10	RUB	2 017 000 740	15.06.18				
11	JPY	4 181 828 000	01.11.17				
12	RUB	-2 750 491 159	01.11.17				
13	USD	14 500 000 000	03.11.17				
14	USD	14 300 000 000	03.11.17				
15	RUB	-15 020 000 000	03.11.17				
16	SLV	0					
17	SLV	0					
18	PLT	0					
19	PLT	0					
20	PLD	0					
21	PLD	0					
22							
23							
24							

Страница «Греки» также заполнится данными.

	Α	В	С	D	E	Н	Q	R	S	т	AB	AE	AF	AG	AH	AI
1	Дата: 31.03.2017															
		Контракты	Comežiu	Тип	Дата	Passan	Persona users	Delte	Commo	Vere	A	Коэфф.	ИБА для 1	Farmer Burer	Ress Duey	Burn FRD
2	краткий код ПФИ	(шт.)	Страик	опциона	экспирации	Балюта	волатильноств	Delta	Gamma	Vega	ARTUB	Лота	контракта	Гамма Риск	рега Риск	видтве
5	RUB	-26000000	56	Put	03.11.17	USD	3,5	0	7,75	2383,7	RU	0	4,4616	-1,13067E+11	-3,05733E+12	BP
5	RUB	26000000	55	Call	03.11.17	USD	3,5	1	7,71	2262,2	RU	0	4,4616	1,12483E+11	2,90149E+12	BP
7																

После внесения опционов и фьючерсов на «Состав портфеля» можно занести остальные инструменты портфеля – ценнные бумаги и позиции по ним.

По окончании добавления надо будет вернуться на страницу «Сводный отчет» и нажать кнопку «Полный расчет».

По окончании расчета появится сообщение:



А	В		С	D	F	G	Н	1	J	К	L	М	Ν
	сводный	ОТЧЕТ О ВЕЛ	ИЧИНЕ РЫНОЧНОГ	О РИСКА		Положения ЦБ РФ:	4969-У	180-И/2018	421- Π				
					3:	аморозка рейтингов:	Да						
	Дата:	31.03.17	Выбрать дату		Размернос	ть исходных данных:	руб		Полный	і расчет			
					Корректиро	овка на ликвидность:	не вычислять						
					Перит		10						
	Номер	Наименовани	ие риска			EfirAddin		×					
	п/п			Итого	RUB				CHF	JPY	AED	AMD	AUD
	1	Процентный	риск (ПР)	395 016 930,61									
	2	общий		395 016 930,61	139 053 10	Полный расчет	завершен. Время ра	счета Ом бс.		54 363 764,00			
	3	специальный		0,00					0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	4	гамма и вега		0,00					X	X	X	X	Х
							1	OK					
	5	Фондовый ри	іск (ФР)	341 440 021,60				UK					
	6	общий		170 720 010,80	170 720 0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	7	специальный		170 720 010,80	170 720 010	0,80 0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	8	гамма и вега		0,00		X X	X	Х	X	X	X	X	X
	9	Валютный ри	іск (ВР)	156 636 264 245,44		X X	X	X	X	X	X	X	X
	10	РВА по ОВП	I	217 130 677,15		X 0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	21 907 907,17	194 345 712,84
	11	гамма и вега		156 419 133 568 20		x x	x	x	x	x	x	x	x

Интеграция с ЦФТ. Для загрузки данных по внебиржевым сделкам ПФИ и сделкам РЕПО из АБС-системы банка (ЦФТ) в наш модуль, необходимо нажать кнопку **«Новый отчет»,** перейти на страницу **«Сводный отчет»,** нажать кнопку **«Импорт ЦФТ».** Данные подтянутся на страницу **«Состав портфеля»** автоматически. Останется только нажать кнопку **«Рассчитать»:**

Капитал Банка, тыс руб	4 081 455,00							
Валюты	Добавить валюту	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	AED
Коэффициенты фондирования	X	1	0	0	0	0	0	0
Открытая валютная позиция, тыс руб	X	X	121621,147	-97892,8732	2421,6788	0	0	0
НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ								
Достаточность базового капитала Н1.1	8,9%			Murgant O			2	
Достаточность капитала H1.0	13,3%			импорт О	иет ць РФ		Экспорт в тен	стовыи фаил
Рентабельность капитала (ROE)	0,0%						для к	IIKO
Ставка фондирования	0,0%			Mugan	- + 624			
Аллокация операционных расходов	0,0%			импор	ι φ.634			
Норма налогообложения	0,0%							
Расчет нагрузки на капитал	Да			Импол	τμφτ			
				VIMITO,	л ц+т			

- 1. Приготовьте файлы выгрузки в модуле ЦФТ (максимум 4 файла):
 - по ценным бумагам
 - по ПФИ
 - по РЕПО
 - ф.634

И скопируете их в директорию

- 2. Для импорта в INTERFAX Add-In нажмите на листе «Сводный отчет» кнопку Импорт ф.634
 - кнопку «Импорт ЦФТ»:

Капитал Банка, тыс руб	10 000 000,00									
Валюты	Добавить валюту	RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD	1	
Коэффициенты фондирования	X	1	0	0	0	0	0	0		
Открытая валютная позиция, тыс руб	X	x	70000	50000	20000	15000	15000	30000		
НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ			Magont Onv		avenont n da	ŭa nas KliKO				
Достаточность базового капитала Н1.1	8,3%		viviliop1 0146	пцвгφ	экспорт в фа	илдля кіко				
Достаточность капитала H1.0	12,8%									
Рентабельность капитала (ROE)	15,0%		Manoord	624						
Ставка фондирования	5,0%		vimilopi q	p.034						
Аллокация операционных расходов	0,5%									
Норма налогообложения	24,0%		Mugonz	UDT	Экспо	Thur				
Расчет нагрузки на капитал	Да		импорт	цФТ	JKCHO	ріцфі				
										_
Сводный отчет Состав портфеля	Биржевые ПФИ Грен	ки ГВР ОГ	∎ ⊕ : .							Þ
Вычислить 🔠							III II II		+ 1	00%
	Капитал Банка, тыс руб Валюты Козффициенты фондирования Открытая валютная позиция, тыс руб НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ Достаточность базовсю капитала H1.1 Достаточность базовсю капитала (ROE) Ставка фондирования Долокация операционных расходов Норма налогообложения Расчет нагрузки на капитал Сводный отчет Состав портфеля	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту Козффициенты фондирования Х Открытая валютная позиция, тыс руб Х НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ГЛАРАМЕТРЫ Достаточность базовсю капитала H1.1 8,3% Достаточность базовсю капитала H1.1 8,3% Достаточность капитала H1.0 12,8% Рентабельность капитала H1.0 12,8% Ставка фондирования 5,0% Аллокация операционных расходов 0,5% Аллокация операционных расходов 0,5% Аллокация операционных расходов 0,5% Расчет нагрузки на капитал Да Сводный отчет Состав портфеля Бирхевые ГЛ6И Гре	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту RUB Козфициенты фондирования X 1 Открытая валютная позиция, тыс руб X X НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ГЛАРАМЕТРЫ Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Достаточность капитала H1.0 12,8% Рентабельность капитала H1.0 15,0% Ставка фондирования 5,0% Аллокация операционных расходов 0,5% Норма налогообложения 5,0% Расчет нагрузки на капитал Да Сводный отчет Состав портфеля Бирхевые ГКМ Греки ГВР ОТ Вычисить	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту RUB USD Козффициенты фондирования X 1 0 Открытая валютная позиция, тыс руб X X 70000 НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ Достаточность базового капитала H1.1 8,3% Достаточность базового капитала H1.1 8,3% Достаточность капитала H1.0 11,2,8% Рентабельность капитала H1.0 15,0% Ставка фондирования 6(0E) 15,0% Ставка фондирования 5,0% Аллокация операционных расходов 0,5% Норма налогообложения 22,40% Расчет натрузки на капитал Да Импорт Стависть состав портфеля Биржевые ПФИ Греол ТВР ОП • : с	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту RUB USD EUR Козффициенты фондирования X 1 0 0 Открытая валютия позиция, тыс руб X X 70000 50000 НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПЛИРАМЕТРЫ Асстаточность базового капитала H1.1 8,3% Импорт Отчет ЦБ РФ Достаточность базового капитала H1.1 12,8% Рентабельность капитала H1.0 12,8% Ставка фондирования 5,0% Импорт ф.634 Алокация операционных расходов 0,5% Расчет нагрузки на капитал Да Сводный отчет Состав портфеля Биржевые ПОИ Греки ГВР ОП € 1	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,0 Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP Козффициенты фондирования X 1 0 0 0 0 Открытая валютия позиция, тыс руб X X 70000 50000 20000 НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПЛИРАМЕТРЫ Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Импорт Отчет ЦБ РФ Экспорт в фа Достаточность базовско капитала H1.1 12,8% 9 Экспорт в фа Достаточность базовско капитала H1.0 12,8% 9 Экспорт в фа Достаточность капитала H1.0 12,8% 9 Экспорт ф.634 Алокация операционных расходов 0,5% Импорт ф.634 Норма налогооблокения 24,0% Импорт ЦФТ Экспо Экспо Расчет нагрузки на капитал Да <td< td=""><td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF Козффициенты фондирования X 1 0 0 0 0 0 Открытая валютная позиция, тыс руб X X 70000 50000 20000 15000 НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Импорт Orver ЦБ РФ Экспорт в файл для КШКО Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Импорт Ф.634 Экспорт в файл для КШКО Достаточность базовско капитала H1.0 12,8% Экспорт ф.634 Экспорт ф.634 Дологачочность капитала H1.0 5,0% Импорт ф.634 Экспорт ЦФТ Алокация операционных расходов 0,5% Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Расчет натрузки на капитал Да Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Расчет натрузки на капитал Да Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Вычиситы Состав портфеля Биржевые ПФИ Греки ГВР ОП : 1 <td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 USD EUR GBP CHF JPY Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY Коэффициенты фондирования X 1 0<td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Икоффициенты фондирования X 1 0 <t< td=""><td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Коэффициенты фондирования X 1 0 <td< td=""></td<></td></t<></td></td></td></td<>	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF Козффициенты фондирования X 1 0 0 0 0 0 Открытая валютная позиция, тыс руб X X 70000 50000 20000 15000 НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Импорт Orver ЦБ РФ Экспорт в файл для КШКО Достаточность базовско капитала H1.1 8,3% Импорт Ф.634 Экспорт в файл для КШКО Достаточность базовско капитала H1.0 12,8% Экспорт ф.634 Экспорт ф.634 Дологачочность капитала H1.0 5,0% Импорт ф.634 Экспорт ЦФТ Алокация операционных расходов 0,5% Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Расчет натрузки на капитал Да Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Расчет натрузки на капитал Да Импорт ЦФТ Экспорт ЦФТ Вычиситы Состав портфеля Биржевые ПФИ Греки ГВР ОП : 1 <td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 USD EUR GBP CHF JPY Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY Коэффициенты фондирования X 1 0<td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Икоффициенты фондирования X 1 0 <t< td=""><td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Коэффициенты фондирования X 1 0 <td< td=""></td<></td></t<></td></td>	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 USD EUR GBP CHF JPY Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY Коэффициенты фондирования X 1 0 <td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Икоффициенты фондирования X 1 0 <t< td=""><td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Коэффициенты фондирования X 1 0 <td< td=""></td<></td></t<></td>	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Икоффициенты фондирования X 1 0 <t< td=""><td>Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Коэффициенты фондирования X 1 0 <td< td=""></td<></td></t<>	Капитал Банка, тыс руб 10 000 000,00 RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Валюты Добавить валюту RUB USD EUR GBP CHF JPY GLD Коэффициенты фондирования X 1 0 <td< td=""></td<>

В появившейся форме выбираете файлы:



						+7 495 357 2
						<u>help@rudata.i</u>
						www.rudata.
🗴 Импорт Отчет ЦБ РФ						×
$\leftarrow \rightarrow \cdot \cdot \uparrow$ — « Windows	(C:) > Яндекс.Ди	ск > _RU DATA > Проекты > ЦФТ > Тест	ٽ ~	Поиск: Тест	,	٥
Упорядочить 🔻 Новая папк	a			8=	- 💷 (0
o	^	Имени	Дата изменения	Тип	Размера	
JWORK		🛃 Bug	01.03.2019 15:14	Сжатая ZIP-папка	236 KE	
👩 Outlook		FIR_ECB_20190118	01.03.2019 15:08	Лист Microsoft Ex	13 KE	
outlook2016		EFIR_F_634_svod_20180618	29.01.2019 13:22	Лист Microsoft Ex	11 КБ	
PSBQuik		EFIR_PFI_20190101	25.02.2019 12:00	Лист Microsoft Ex	62 KB	
Загрузки		🔄 EFIR_PFI_20190101_опцион	21.02.2019 17:45	Лист Microsoft Ex	62 KE	
Почта 28102014		💽 EFIR_PFI_20190118_эфир	01.03.2019 15:13	Лист Microsoft Ex	181 KE	
		EFIR_REPO_20190118	29.01.2019 13:17	Лист Microsoft Ex	66 KB	
🔄 Файлы Outlook	- 1	выгрузка.rar	28.02.2019 17:05	Файл "RAR"	230 KE	
💻 Этот компьютер	~					
Имя файла:	"EFIR_REPO_20190	0118" "EFIR_ECB_20190118" "EFIR_PFI_20190101"		∨ Все файлы	```	~
			Сервис	• Открыть	Отмена	

- 3. Заведите недостающие коэффициенты фондирования и нажмите Полный расчет
- 4. Для передачи результатов по ф.135 в ЦФТ, нажмите кнопку Экспорт ЦФТ и укажите путь к файлу:

Munor On of LIE Do Avenue to bain and Kiko	
11.1 8,3% Skilopi B (800, 20, 20, 20, 20, 20, 20, 20, 20, 20,	
12,8%	
15,0% Munor & 624	
5,0% Piwitopi 0.034	
8 0,5%	
24,0% Divergent LICT	
Да импортцот экспортцот	
ля Биржевые ПФИ Греки ГВР ОПГ 🕁 : 📢	Þ
	+ 100%
ля Биржевые ПФИ Греки ГВР ОП 🛞 : [1]	1

2. На втором листе – «Состав портфеля» – заполните первые три колонки: «*ISIN»*, «Позиция (стоимость), руб», «Дата истечения срока договора» (для срочных контрактов). Сюда нужно заносить все позиции для автоматического расчета, кроме ПФИ (эти показатели заносятся отдельно на лист «Биржевые ПФИ»):

Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции
ISIN	Позиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора
SLV	643 380	
RU000A0JXTS9	842 754 301	
RU000A0JWHA4	1 180 910 190	
RU000A0D0G29	80 727 268	
RU000A0JXU48	181 760 570	

По такому же принципу заносятся данные на листы «Инвест портфель», «ПКЛ ВЛА», «ТСС».

Далее нажмите кнопку «Заполнить формулы» и «Рассчитать»:

F	G	н	I		к	L	м	N	0	Р	0	
Очистить	Ликвидность инструмента			Рассчитать	Р	асчет "н	агрузки"	на капитал	Для стр	есс-теста	Заполнить формулы 🗸	
Корректировка на ликвидность, руб (не вычисляется)	Корректировка на ликвидность, % (не вычисляется)	Рейтинг ликвидности (не вычисляется)	Скорректиров анная позиция, руб	Рыночный риск	Норма риска	Коэфф. риска (180-И)	Норма капитала	Целевая доходность	Модифицир ованная дюрация	Модифициро ванная выпуклость	Тип инструмента	

Если после заполнения формул и выполнения расчета бумага подсвечивается красным, необходимо обратиться в службу поддержки проекта RU Data, чтобы Вам подключили недостающие параметры рисков.



После того, как данные по расчету загрузятся, перейдите на лист «Сводный отчет» и запустите «Полный расчет». После этого произойдет корректный расчет рыночного риска:

	l								дополнител
_	сводныі	й отчет о вел	ИЧИНЕ РЫНОЧН	ОГО РИСКА	Положения ЦБ Р	Ф: 511-П/мар19	199-И/янв20	421-П/окт19	
					Заморозка рейтинго	в: Да			
	Дата:	24.04.2020	Выбрать дату		Размерность исходных данны	іх: руб		Полный расчет	
					Корректировка на ликвидност	гь: не вычислять			
					Период ликвидации, дне	й: 10			

Все необходимые данные подгружаются с наших серверов, а колонки, окрашенные серым, заполняются автоматически:

A	Б	с	D	E	F	G	н	1.1	J.	к	L	M N		0
Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции	производится	в руб	Рассчитать		Рассчитать	F	асчет "н	агрузки"	на капитал	Для стр	есс-теста	Заполнить формулы 🔱
ISIN	Повиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора	Дата открытия позиции (180-И)	Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод)	Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых заявок)	Скорректиров аннал позиция, руб	Рыночный риск	Норма риска	Коэфф. риска (180-И)	Норма капитала	Целевая доходность	Модифицир ованная дюрация	Модифициро ваннал выпуклость	Тип инструмента
XS0833264335	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	100%	0%	5,50%			Корпоративные еврооблигации (Выпус
XS0562354182	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	100%	0%	5,50%			Корпоративные еврооблигации (Выпус
RU000A0JPLE2	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKL9	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%	50%		Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JQZW2	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%	50%		Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKV8	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%	50%		Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKW6	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKN5	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKQ8	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%			Государственные облигации
RU000A0JPKP0	100 000 000			100 000		100 000 000	21 875 000	22%	0%	3%	5,86%			Государственные облигации
RU000A0JPL07	100 000 000			100 000		100 000 000	28 125 000	28%	0%	4%	5,96%			Государственные облигации
RU000A0JPKK1	100 000 000			100 000		100 000 000	34 375 000	34%	0%	4%	6,06%			Государственные облигации
RU000A0JPLB8	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPLC6	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPKU0	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%			Государственные облигации (Выпуск По
RU000A0JPL80	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%			Государственные облигации
RU000A0JPL15	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%			Государственные облигации
RU000A0JPL72	Биржевой ПФИ:	MXZ9		100 000		100 000 000	21 875 000	22%	0%	3%	5,86%			Государственные облигации
RU000A0JP7K5				0		-249 759	-187 319	-75%	0%	-10%	-0,72%			Фондовый индекс
RUB		2.2019		0		14 989 000	1 311 538	9%	0%	1%	5,64%			Поставка денежных средств
RU0009046510				10 000		10 120 000	19 740 482	195%	0%	25%	8,68%			Акция Обыкновенная
RUB	-2 560 000	20:05.2019		0		-2 560 000	-38 400	-2%	0%	0%	0,48%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	15 845 414			0		15 845 414	-11 884 061	-75%	0%	-10%	4,28%			Фондовый индекс
USD	-193 498	19 12 2019		0		-193 498	-10 159	-5%	0%	-1%	0 41%			Поставка денежных средств

✓ В «Состав портфеля» автоматически попадают позиции, соответствующие базовому активу биржевых ПФИ и поставке денежных средств. Эти позиции окрашиваются зеленым.

3. Биржевые ПФИ заносятся на лист «Биржевые ПФИ» в виде краткого кода контракта, как указано на бирже (например, BR-3.16, GDH6, LK27500BB6). Их количество, котировки, вся остальная информация подгружается автоматически с наших серверов:

A	В	с	н	I.	J	к	L	м	N	
Дата: 26.03.2019			Рассчитать позиции				Тип цень	ы для активов МБ:	Market	
					Характеристики позиции					
Краткий код ПФИ	(шт.)	контракта	Тип инструмента	ISIN базового актива	Краткое наименование базового актива	Валюта	Дата экспирации	Позиция в базовом активе	Поставка денежных средств	
MXZ9	-100	149890	Фьючерс на фондовый индекс	RU000A0JP7K5	Индекс МосБиржи	RUB	19.12.2019	-249 759	14 989 000	
CHM9	100	25600	Фьючерс на акции	RU0009046510	"Северсталь", ПАО, акции обыкновенные именные безд	RUB	20.06.2019	10 120 000	-2 560 000	
RIZ9	100	1500	Фьючерс на фондовый индекс	RU000A0JPEB3	Индекс РТС	USD	19.12.2019	15 845 414	-193 498	
RIM9	-100	400	Фьючерс на фондовый индекс	RU000A0JPEB3	Индекс РТС	USD	20.06.2019	-15 845 414	51 599	
OXM9	200	9000	Фьючерс на корзину облигаций	RU000A0ZYUA9	МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянн	RUB	05.06.2019	1 882 360	-1 551 147	
GDM9	150	400	Фьючерс на драгметалл	GLD		USD	20.06.2019	12 764 573	-3 869 958	
MPM9	-230	3100	Фьючерс на кредитную ставку	RUB		RUB	17.06.2019	-230 000 000	230 000 000	
SIM9	300	1000	Фьючерс на валютную пару	USD		RUB	20.06.2019	19 349 790	-300 000	
RI182500BU9	-100	27500	Опцион Put	RU000A0JPEB3	Индекс РТС	USD	19.09.2019	-15 679 829	23 296 228	
DMM9	100	10	Фьючерс на акции	DE0007100000	Акции обыкновенные именные бездокументарные Dair	EUR	21.06.2019	37 052 125	-729 229	
RI150000BI9	-100	12	Опцион Call	RU000A0JPEB3	Индекс РТС	USD	19.09.2019	-1 143 564	1 396 474	
RI167500BU9	100	454	Опцион Put	RU000A0JPEB3	Индекс РТС	USD	19.09.2019	15 490 794	-21 123 695	
GZ21250BU9	-100	2000	Опцион Put	RU0007661625	"Газпром", ПАО, акции обыкновенные именные бездоку	RUB	18.09.2019	-1 479 290	2 072 449	
LK57500B19	100	1230	Опцион СаП	RU0009024277	"Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ", ПАО, акции обыкновен	RUB	18.09.2019	3 355 142	-3 353 975	

✓ Если Вы внесли позицию, а расчет по ней не производится, скопируйте только формулы на несколько новых строк и занесите свою позицию. Нажмите кнопку **«Рассчитать»**.



4. Внебиржевые ПФИ заносятся на лист «Состав портфеля». Для этого каждый ПФИ раскладывается на две позиции: *базовый актив* и *поставка денежных средств*. Для позиции *поставки денежных средств* указывается валюта поставки, ее размер, а также дата истечения договора (3-я колонка) которая равна дате экспирации фьючерса.

Для *базового актива* указывается ISIN бумаги или индекса, либо код драг. металла (для фьючерсов на драг. металлы для базового актива обязательно указывается дата истечения срока, которая равна дате экспирации фьючерса), размер позиции (со знаком «+» или «-» в зависимости от того короткая или длинная позиция). Остальные данные загружаются автоматически.

A	В	С	D	E	F	G	н	H I J K L		L	M	N	0	
Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции	производится	в руб	Рассчитать		Рассчитать	F	асчет "н	агрузки"	на капитал	Для стр	есс-теста	Заполнить формулы 🗸
ISIN	Повиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора	Дата открытия позиции (180-И)	Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод)	Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых заявок)	Скорректиров аннал позиция, руб	Рыночный риск	Норма риска	Коэфф. риска (180-И)	Норма капитала	Целевая доходность	Модифицир ованная дюрация	Модифициро ванная выпуклость	Тип инструмента
RU000A0JP7K5	-249 759			0		-249 759	-187 319	-75%	0%	-10%	-0,72%			Фондовый индекс
RUB	14 989 000	19.12.2019		0		14 989 000	1 311 538	9%	0%	1%	5,64%			Поставка денежных средств
RU0009046510	10 120 000			10 000		10 120 000	20 240 000	200%	0%	26%	8,76%			Акция Обыкновенная
RUB	-2 560 000	20.06.2019		0		-2 560 000	-38 400	-2%	0%	0%	0,48%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	15 845 414			0		15 845 414	-11 884 061	-75%	0%	-10%	4,28%			Фондовый индекс
USD	-193 498	19.12.2019		0		-193 498	-10 159	-5%	0%	-1%	0,41%	1%		Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	-15 845 414			0		-15 845 414	-9 218 862	-58%	0%	-7%	-0,45%	45%		Фондовый индекс
USD	51 599	20.06.2019		0		51 599	1 290	2%	0%	0%	5,54%			Поставка денежных средств
RU000A0ZYUA9	1 882 360			2 004		1 882 360	1 058 827	56%	0%	7%	6,42%	6,64	61,01	Государственные облигации
RUB	-1 551 147	05.06.2019		0		-1 551 147	-23 267	-2%	0%	0%	0,48%			Поставка денежных средств
RUB	-230 000 000	26.06.2019		0		-230 000 000	-5 141 916	-2%	0%	0%	0,46%			Поставка денежных средств
RUB	230 000 000	17.06.2019		0		230 000 000	4 025 000	2%	0%	0%	5,53%			Поставка денежных средств
GLD	12 764 573	20.06.2019		0		12 764 573	319 114	2%	0%	0%	5,54%			Поставка денежных средств
USD	-3 869 958	20.06.2019		0		-3 869 958	-87 074	-2%	0%	0%	0,46%			Поставка денежных средств
USD	19 349 790	20.06.2019		0		19 349 790	455 107	2%	0%	0%	5,54%			Поставка денежных средств
RUB	-300 000	20.06.2019		0		-300 000	-4 500	-2%	0%	0%	0,48%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	-15 679 829			0		-15 679 829	-9 094 673	-58%	0%	-7%	-0,45%			Фондовый индекс
USD	23 296 228	19.09.2019		0		23 296 228	-115 107	0%	0%	0%	5,49%			Поставка денежных средств
DE0007100000	37 052 125			0		37 052 125	74 104 251	200%	0%	26%	8,76%			Акция Обыкновенная
EUR	-729 229	21.06.2019		0		-729 229	18 231	2%	0%	0%	0,54%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	-1 143 564			0		-1 143 564	1 429 454	125%	0%	16%	2,54%			Фондовый индекс
USD	1 396 474	19.09.2019		0		1 396 474	69 824	5%	0%	1%	5,58%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	15 490 794			0		15 490 794	-11 618 095	-75%	0%	-10%	4,28%			Фондовый индекс
USD	-21 123 695	19.09.2019		0		-21 123 695	-950 566	-5%	0%	-1%	0,43%			Поставка денежных средств
RU0007661625	-1 479 290			-9 753		-1 479 290	0	0%	0%	0%	0,50%			Акция Обыкновенная
RUB	2 072 449	18.09.2019		0		2 072 449	72 536	3%	0%	0%	5.56%			Поставка денежных средств
RU0009024277	3 355 142			583		3 355 142	6 710 283	200%	0%	26%	8.76%			Акция Обыкновенная
RUB	-3 353 975	18.09.2019		0		-3 353 975	-131 706	-4%	0%	-1%	0,44%			Поставка денежных средств

✓ Если в портфеле присутствуют биржевые опционы, они так же заносятся на лист «Биржевые ПФИ», аналогично фьючерсам. Расчет по опционам, в том числе по гамма и вега рискам, Вы сможете увидеть на листах «Греки» и «ГВР»:

A	В	с	D	E	н	Q	R	S	т	AA	AE	AF	AG	AH	AI
Дата: 26.03.2019															
Краткий код ПФИ	Контракты (шт.)	Страйк	Тип опциона	Дата экспирации	Валюта	Волатильность	Delta	Gamma	Vega	Актив	Коэфф. Лота	ИБА для 1 контракта	Гамма Риск	Вега Риск	Вид ГВР
RI182500BU9	-100	182500	Put	19.09.2019	USD	0,2552666	-0,98955	1,2883E-06	2258,324711	RI	100	0	0	-929555,6408	не ГВ
RI150000BI9	-100	150000	Call	19.09.2019	USD	0,2159382	0,07217	7,63009E-06	11314,45077	RI	100	0	0	-3939652,933	не ГВ
RI167500BU9	100	167500	Put	19.09.2019	USD	0,2343573	-0,97762	2,70774E-06	4357,729245	RI	100	1,965344	3,372947587	1646773,004	ΦΡ
GZ21250BU9	-100	21250	Put	18.09.2019	RUB	0,24493	-0,97527	2,24601E-05	595,2466955	GZ	1	1213,44	-1653,553302	-3644,844328	ΦP
LK57500B19	100	57500	Call	18.09.2019	RUB	0,2349629	0,5833	4,07269E-05	15911,15716	LK	1	4601,6	43119,00432	93463,29069	ФР
1			π	,	_			-							<u> </u>
 Сводный от 	чет Состав	портфеля	Бирже	вые ПФИ	Греки	ГВР ОГ	1P TP	(+) i (

5. «Стресс-тест» показывает чувствительность стоимости портфеля к изменению факторов риска и оценки снижения достаточности капитала банка для каждого из стресс-сценариев.

Сервис понимает и рассчитывает пользовательские сценарии. Для его реализации достаточно с новой строки заполнить первые 4 поля и нажать кнопку «**Рассчитать**»:



														he	lp@ri	<u>udata</u>	a.info
														w	ww.ru	udata	a.info
Α	В	с	D	E	F	G	н	1	J	K	L	М	N	0	Р	Q	R
			Рассчи	тать													
	Onv	исание сце	енариев			Стресс-тест				Пер	реоценка (%)						
Ne	Сценарий	Рост д сходностей гособлигаций	Рост доходностей корпоративных облигаций	Обесценение национальной валюты	Падение фондовых индексов	Снижение достаточности капитала (п.п.)	Государственные облигации	Государственны е еврооблигации	Корпоративные облигации	Корпоративные еврооблигации	Мүниципальные облигации	Мүниципальные еврооблигации	Акция Обыкновенная	Акция Привилегированная	ИТОГО без үч ега ПФИ	ИТОГО с үч етом ПФИ	Государственные облигации
																	701 882 360,0
1	Умеренный	2%	5%	-20%	-30%	-4,55%	-0,03%						-24,82%		-4,21%	-4,21%	-226 613,7
	Консервативный	3,50%	10%	-30%	-50%	-7,74%	-0,05%						-42,22%		-7,16%	-7,16%	-366 462,5
	1998	10%	20%	-250%	-40%	4,43%	-0,10%						24,80%		4,10%	4,10%	-674 226,9
4	2004	1,50%	2,50%	-2%	-30%	-5,39%	-0,02%						-29,48%		-4,99%	-4,99%	-174 261,9
	2008	6%	14%	-50%	-70%	-10,46%	-0,08%						-57,04%		-9,68%	-9,68%	-542 188,6
6	февраль 2014	4%	1,30%	-20%	-20%	-2,75%	-0,06%						-14,82%		-2,55%	-2,55%	-407 343,2
	мои	2%	3%	5%	6%	0,83%	-0,03%						4,70%		0,77%	0,77%	-226 613,7

6. На листе «Состав портфеля» присутствует два поля: *модифицированная дюрация* и *модифицированная выпуклость*. Это ключевые коэффициенты для оценки влияния стресссценариев на переоценку портфеля. Функция позволяет оценить степень подверженности процентному риску каждой отдельной облигации в портфеле:

Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции і	производится	в руб	Рассчитать		Рассчитать	P	асчет "н	агрузки"	на капитал	Для стр	есс-теста	Заполнить формулы 🗸
ISIN	Повиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора	Дата открытия позиции (180-И)	Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод)	Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых заявок)	Скорректиров анная позиция, руб	Рыночный риск	Норма риска риска (180-И) Козфф. Норма Целевая 1 доходность 77 Ссу ОУ 79 С.479		Модифицир ованная дюрация	Модифициро ванная выпуклость	Тип инструмента		
RU000A0ZYUA9	1 882 360			2 004		1 882 360	1 058 827	56%	0%	7%	6,42%	6,64	61,01	Государственные облигации
RUB	-1 551 147	05.06.2019		0		-1 551 147	-23 267	-2%	0%	0%	0,48%	6		Поставка денежных средств
RUB	-230 000 000	26.06.2019		0		-230 000 000	-5 141 916	-2%	0%	0%	0,46%			Поставка денежных средств
RUB	230 000 000	17.06.2019		0		230 000 000	4 025 000	2%	0%	0%	5,53%			Поставка денежных средств
GLD	12 764 573	20.06.2019		0		12 764 573	319 114	2%	0%	0%	5,54%			Поставка денежных средств
USD	-3 869 958	20.06.2019		0		-3 869 958	-87 074	-2%	0%	0%	0,46%			Поставка денежных средств
USD	19 349 790	20.06.2019		0		19 349 790	455 107	2%	0%	0%	5,54%			Поставка денежных средств
RUB	-300 000	20.06.2019		0		-300 000	-4 500	-2%	0%	0%	0,48%			Поставка денежных средств
RU000A0JPEB3	-15 679 829			0		-15 679 829	-9 094 673	-58%	0%	-7%	-0,45%			Фондовый индекс
USD	23 296 228	19.09.2019		0		23 296 228	-115 107	0%	0%	0%	5,49%			Поставка денежных средств
DE0007100000	37 052 125			0		37 052 125	74 104 251	200%	0%	26%	8,76%			Акция Обыкновенная
EUR	-729 229	21.06.2019		0		-729 229	18 231	18 231 2% 0% 0% 0,54%				Поставка денежных средств		

7. Лист **«Инвест портфель»** содержит оценку кредитного риска для облигаций портфеля по инструкции 180-И:

А	В	с	D	E	F	G	н	1	J	к	L
Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции прои	зводится в руб				Заполн	ить формулы 🗸			
											Гарантия
ISIN	Позиция (стоимость), руб	Дата открытия позиции	Тип инструмента	Краткое наименование инструмента	Эмитент	Валюта номинала	Коэф-т риска	Риск итого	Доля покрытия гарантией (%)	Группа риска 1	Обоснование группы риска 1 (Инструкция №139/180-И)
RU000A0JT940	1 000 000		Корпоративные облигации	Роснефть-4-об	Роснефть НК	RUB	100%	1 000 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JTR98	2 000		Корпоративные облигации (Вы	МегаФон-Финанс-6-об	МегаФон Финанс	RUB	150%	3 000	100	пк	код 8815
RU000A0JSEU7	1 000		Корпоративные облигации (Вы	Артуг-3-об	МАЛАХИТ	RUB	150%	1 500	0	пк	код 8815
RUCOCACJSYNO	3 000		Закрытый ПИФ	Альбатрос ПИФ	Альбатрос ПИФ	RUB	0%	0	0	нет кред.риска	нет кред.риска
RU000A0JS7L0	2 400		Корпоративные облигации (Вы	НМТП-2-боб	нмтп	RUB	150%	3 600	0	пк	код 8815
RU000A0ZYFV6	20		Закрытый ПИФ	ТЕТИС-ЗаречьеПИФ	ТЕТИС-ЗаречьеПИФ	RUB	0%	0	0	нет кред.риска	нет кред.риска
RU000A0JTKD8	10 000		Корпоративные облигации (Вы	Ростелеком-15-об	Ростелеком	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JT7T2	10 000		Корпоративные облигации	ФСК ЕЭС-21-об	ФСК ЕЭС	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JSQ58	10 000		Корпоративные облигации	ФСК ЕЭС-22-об	ΦCK E9C	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JTYJ6	10 000		Корпоративные облигации	ФСК ЕЭС-23-об	ФСК ЕЭС	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JTKA4	10 000		Корпоративные облигации	ФСК ЕЭС-24-об	ФСК ЕЭС	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
RU000A0JT2K2	10 000		Корпоративные облигации	ФСК ЕЭС-25-об	ΦCK E9C	RUB	100%	10 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
XS0783242877	1 000		Корпоративные еврооблигации	СистемаАФК-2019-евро	Sistema Intern. Funding	USD	100%	1 000	0	4	п.2.3.4, абз. 2
XS0767469827	100 000		Государственные еврооблигаци	Россия-2017	Минфин РФ	USD	100%	100 000	0	1	п.2.3.1, абз. 9
XS0767472458	100 000		Государственные еврооблигаци	Россия-2022	Минфин РФ	USD	100%	100 000	0	1	n.2.3.1, абз. 9



+7 495 357 2077

Также для Вашего удобства на отдельный лист вынесены коды 180-И:

Код	Сумма	Сумма, взвешенная с учетом риска
8747.0	0	0
8749	0	0
8801.0	0	0
8801.1	0	0
8801.2	0	0
8815	5 400	8 100
8903.0	0	0
8900	0	0
8901	0	0

8. На листе «Состав портфеля» Вы сможете сравнить величины рыночного риска (Положение ЦБ РФ №387-П) торгового портфеля и кредитного риска (Инструкция ЦБ РФ №180-И) инвестиционного портфеля, что позволит снизить нагрузку на капитал банка за счет оптимального отнесения ценных бумаг в инвестиционный или торговый портфель:

Дата: 26.03.2019	Заведение стоим	ости позиции	производится	в руб	Рассчитать		Рассчитать	Расчет "нагрузки" и			на капитал
ISIN	Позиция (стоимость), руб	Дата истечения срока договора	Дата открытия позиции (180-И)	Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод)	Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых заявок)	Скорректиров анная позиция, руб	Рыночный риск	Норма риска	Коэфф. риска (180-И)	Норма капитала	Целевая доходность
RU000A0JPKQ8	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%
RU000A0JPKP0	100 000 000			100 000		100 000 000	21 875 000	22%	0%	3%	5,86%
RU000A0JPL07	100 000 000			100 000		100 000 000	28 125 000	28%	0%	4%	5,96%
RU000A0JPKK1	100 000 000			100 000		100 000 000	34 375 000	34%	0%	4%	6,06%
RU000A0JPLB8	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%
RU000A0JPLC6	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%
RU000A0JPKU0	100 000 000			0		100 000 000	0	0%	0%	0%	5,50%
RU000A0JPL80	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%
RU000A0JPL15	100 000 000			100 000		100 000 000	8 750 000	9%	0%	1%	5,64%
RU000A0JPL72	100 000 000			100 000		100 000 000	21 875 000	22%	0%	3%	5,86%

9. Функционал листа для расчета **ТСС** (текущих справедливых стоимостей) позиций портфеля ценных бумаг учитывает все нюансы требований Регулятора и реализован на основе пожеланий пользователей системы.

Для реализации функционала заполните колонки «**ISIN**» и «Кол-во», выберите метод определения ТСС и нажмите кнопу «Заполнить формулы». Позиции рассчитаются автоматически, подгружая данные ТСС с наших серверов:

А	В	С	D	E	F	G	н	I		K I	м
Дата: 26.03.2019	6.03.2019 Учет дат фиксации списков:										1
	База цены: Средневзвешенная		ная	🔄 Ценовой Центр НРД		Собственная оценка		Зап			
ISIN	Кол-во	тсс, руб.	тсс, %	Позиция,руб	ТСС, руб.	Позиция,руб	тсс, руб.	Позиция,руб			<u> </u>
RU000A0JT940	100	1012,88	101,355	101288	1012,88	101288					
XS0935311240	100	66513,89	103,1	6651389	66457,36	6645736					

10. На листе «ПКЛ ВЛА» весь портфель автоматически рассчитывается в соответствии с требованиями 421-П:



	A	в	с	D	E	F	G	н	1.1	J.	к	L	М	N	0	Р
Дата	a: 26.03.2019			Заполнить формулы \downarrow												
	ISIN	Позиция	Код страны участника банк.группы	Тип инструмента	Краткое наименование инструмента	Зиллент	Валюта номинал а	Группа ВЛА	Группа ВЛИ (Т - 30)	Число дней с момента исключения из гр. ВЛА	Дисконт	вла	Максимальное обесценение в течение последовательных 30 дней	Максимально допустимое обесценение в течение последовательных 30 дней	Обоснование	Строка формы 122
XS01	114288789	1000		Государственные еврооблигации	Россия-2030-11т	Минфин РФ	USD	ВЛА-1	ВЛА-1		0	1 000	10,4%		2.5.3.a63.6	1.1.8
RUO	00A0JQRD9	1000		Корпоративные облигации	РЖД-23-об	РЖД	RUB	ВЛА-25	ВЛА-25		0,5	500	9,0%	<= 20%	2.7.2.	1.3.2
XS01	114288789	1000		Государственные еврооблигации	Россия-2030-11т	Минфин РФ	USD	ВЛА-1	ВЛА-1		0	1 000	10,4%		2.5.3.a63.6	1.1.8
XS01	114288789	1000		Государственные еврооблигации	Россия-2030-11т	Минфин РФ	USD	ВЛА-1	ВЛА-1		0	1 000	10,4%		2.5.3.a63.6	1.1.8
RUO	00A0JQRD9	1000		Корпоративные облигации	РЖД-23-об	РЖД	RUB	ВЛА-25	ВЛА-25		0,5	500	9,0%	<= 20%	2.7.2.	1.3.2
RUO	00A0JQRD9	1000		Корпоративные облигации	РЖД-23-об	РЖД	RUB	ВЛА-25	ВЛА-25		0,5	500	9,0%	<= 20%	2.7.2.	1.3.2

Для Вашего удобства на отдельный лист вынесено соответствие результатов расчетов 122 форме отчетности:

	A	B	C	D	E
1	Номер строки	Наименование показателя	Величина требований (обязательств)	Весовой коэффициент	Взвешенная величина требований (обязательств)
	1	2	3	4	5
	1	Высоколиквидные активы, скорректированные с	— X	х	
ЬÎ	1.1	ВЛА-1, итого, в том числе:	32 000	Х	32 000
	1.1.1	наличная валюта и чеки (в том числе дорожные чеки)	0	1	0
	1.1.2	средства на счетах кредитных организаций (филиалов)	0	1	0
	1.1.3	средства в Банке России и в уполномоченных органах	0	1	0
	1.1.4	средства на депозитных счетах в Банке России с	0	1	0
	1.1.5	долговые ценные бумаги, выпущенные	0	1	0
)	1.1.6	долговые ценные бумаги, выпущенные организациями,	0	1	0
1	1.1.7	долговые ценные бумаги, номинированные в рублях,	30 000	1	30 000

✓ На листе «Сводный отчет» автоматически формируется отчет о ВЛА:

СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ ВЫСОКОЛИКВИДНЫХ АКТИВОВ										
вла	4 500,00									
ВЛА-1	3 000,00									
ВЛА-2А	0,00									
ВЛА-2Б	1 500,00									
Сводн	ый отчет	Состав портфеля	Биржевые ПФИ	Греки						

11. На листе «Параметры рисков» Вы можете получить все параметры бумаг, участвующие в расчетах, *задав ISIN и дату*. Вам доступны, в том числе, актуальные, «замороженные» и «размороженные» рейтинги. Замените ISIN, и загрузится информация по любой бумаге:

A	В	С	D	E	F	G	Н	1	J	К	L	M	N
Instrument	№ положения,	Группа	Код ц.б.		Учет "зал	лорозки"	Позиция (стоимость)		Nu				
Date	инструкции ЦБ	парам-в	Дата расчета	26.03.2019	не банки	банки	Размер позиции, шт.						
FinToolNum	Bce	Эмиссия	Код ц.б.				Уникальный номер финансового инструмента (IS	IN, регист	рационнь	ій номер	бумаги, др	угой иден	тификатор)
CalcDate	Bce	Эмиссия	Дата расчета				Дата, на которую определяется расчет группы риска						
isMatched	Bce	Эмиссия	Сверено?				Признак сверки данных Интерфакс и НРД (1-ДА; г	юка бума	га не свер	ена, не за	ведены к	лючевые п	араметры для
Status	Bce	Эмиссия	Статус				Статус ценной бумаги						
FinToolType	Bce	Эмиссия	Тип ц.б.				Тип финансового инструмента - облигация, приве	лигирова	нная акци	я, конвер	тирумая ц	енная бум	ага, другой фи
FinToolShortNameRus	Bce	Эмиссия	Краткое рус.имя				Краткое наименование инструмента на русском я	зыке					
FinToolShortNameEng	Bce	Эмиссия	Краткое англ.имя ц.б.				Краткое наименование инструмента на английск	ом языке					
FinToolFullNameRus	Bce	Эмиссия	Полное рус.имя ц.б.				Полное наименование инструмента на русском я	зыке					
FinToolFullNameEng	Bce	Эмиссия	Полное англ.имя ц.б.				Полное наименование инструмента на английско	м языке					
BegCirculationDate	Bce	Эмиссия	Дата нач.обращения				Дата начала обращения ценной бумаги						
IssueCur	Bce	Эмиссия	Вал.эмиссии				Валюта эмиссии						
Seniority	139/180-И	Эмиссия	Старшинство				Старшинство облигаций (в целях определения порядка выплат при банкротстве)						
IsSubordinated	511-N	Эмиссия	Субординир.обл.?				Субординированные облигации						
IssueSec	511-N	Эмиссия	Секьюритизация?				Признак наличия обеспечение ценными бумагам	и					
RiskGroupF0	511-N	Эмиссия	Гр.риска без фондир-я				Группа риска (от 0 до 6) при отсутствии фондиров	ания					
RiskGroupF1	511-N	Эмиссия	Гр.риска с фондир-ем				Группа риска (от 0 до 6) при наличии фондирован	ия					
IssueConvDate1	511-N	Эмиссия	Дней до конверсии 1				Число дней до первой даты, когда может быть ос	уществле	на конвер	сия в дол	евые бума	аги для кон	вертируемых
IssueConvDate2	511-N	Эмиссия	Дней до конверсии 2				Число дней до второй даты, когда может быть ос	уществле	на конвер	сия в дол	евые бума	ги, если пе	ервая дата уже
IssueConvYield	511-N	Эмиссия	Дох-ть при конверсии				Доходность (доходность рассчитывается как выр	аженная в	процента	ах от теку	щей (спра	ведливой)	стоимости ба:
T_Min	511-N	Эмиссия	Дата группы срочности				Дата, по которой вычиляется группа срочности						
IssueMty	511-N	Эмиссия	Дата погашения				Дата погашения						
IssueMty	511-N	Эмиссия	Срок до погашения				Срок до погашения (в днях)						
IssueOffer	511-N	Эмиссия	Срок до досрочн.погаш.				Срок до досрочного погашения (в днях)						
IssueRate	511-N	Эмиссия	Срок до пересм.%ставки				Срок до пересмотра процентной ставки (в днях)						
IssueDivid	511-N	Эмиссия	Срок до дивиденда (П)				Срок до выплаты дивидендов для неконвертируе	мых при	вилегиров	анных ак	ций (в дня	x)	
ExpirationDate	511-N	Эмиссия	Дата экспирации				Дата экспирации (только для фьючерсов)						
FullGuarant	все	Эмиссия	Полная гарантия?				Признак полной гарантии (0,1)						
		~					m Minut						

✓ После заполнения «Состава портфеля» не забудьте нажать «Полный расчет» на листе «Сводный отчет», чтобы данные автоматически рассчитались на всех листах.



✓ Информационная безопасность. Интерфакс является партнером Microsoft. Используемая нами надстройка Add-In подписана сертификатом, удостоверяющим безопасность. Все расчеты с использованием размеров позиций по финансовым инструментам производятся в компьютере пользователя и не передаются за пределы банка.

✓ Идентификация бумаг в том числе по регистрационному номеру инструмента. Появилась дополнительная возможность использовать не только ISIN, но и RegCode:



12. Добавление произвольных инструментов при расчете риска (акции).

Данная опция необходима для ввода бумаг без ISIN или без рег. номера. Речь идет об очень редких инструментах, которые невозможно идентифицировать. Функционал реализован в отдельном файле. Его можно скачать по <u>ссылке</u>.

13. Описание расчета товарного риска можно посмотреть здесь.

Мы будем ждать Ваших вопросов и комментариев. Если у Вас возникнут несовпадения в расчетах, обязательно пишите, будем обсуждать и искать верный вариант.

+7 495 357 2077 | <u>help@rudata.info</u>

Новости проекта смотрите на сайте

www.rudata.info

Вы также можете принять участие в обучающих мероприятиях Учебного центра Интерфакса. Подробнее на <u>event.interfax.ru</u>

