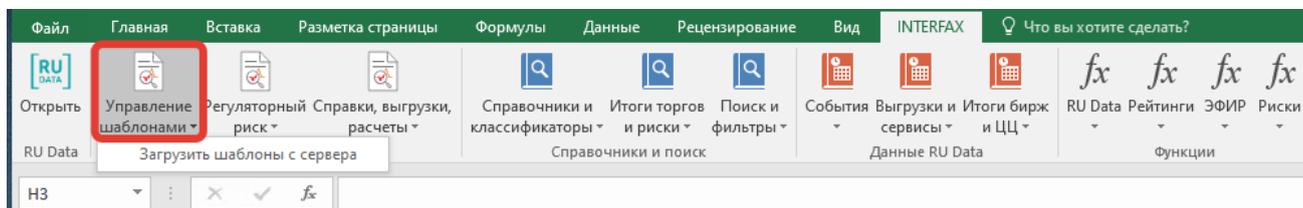


ЭФИР Add-In

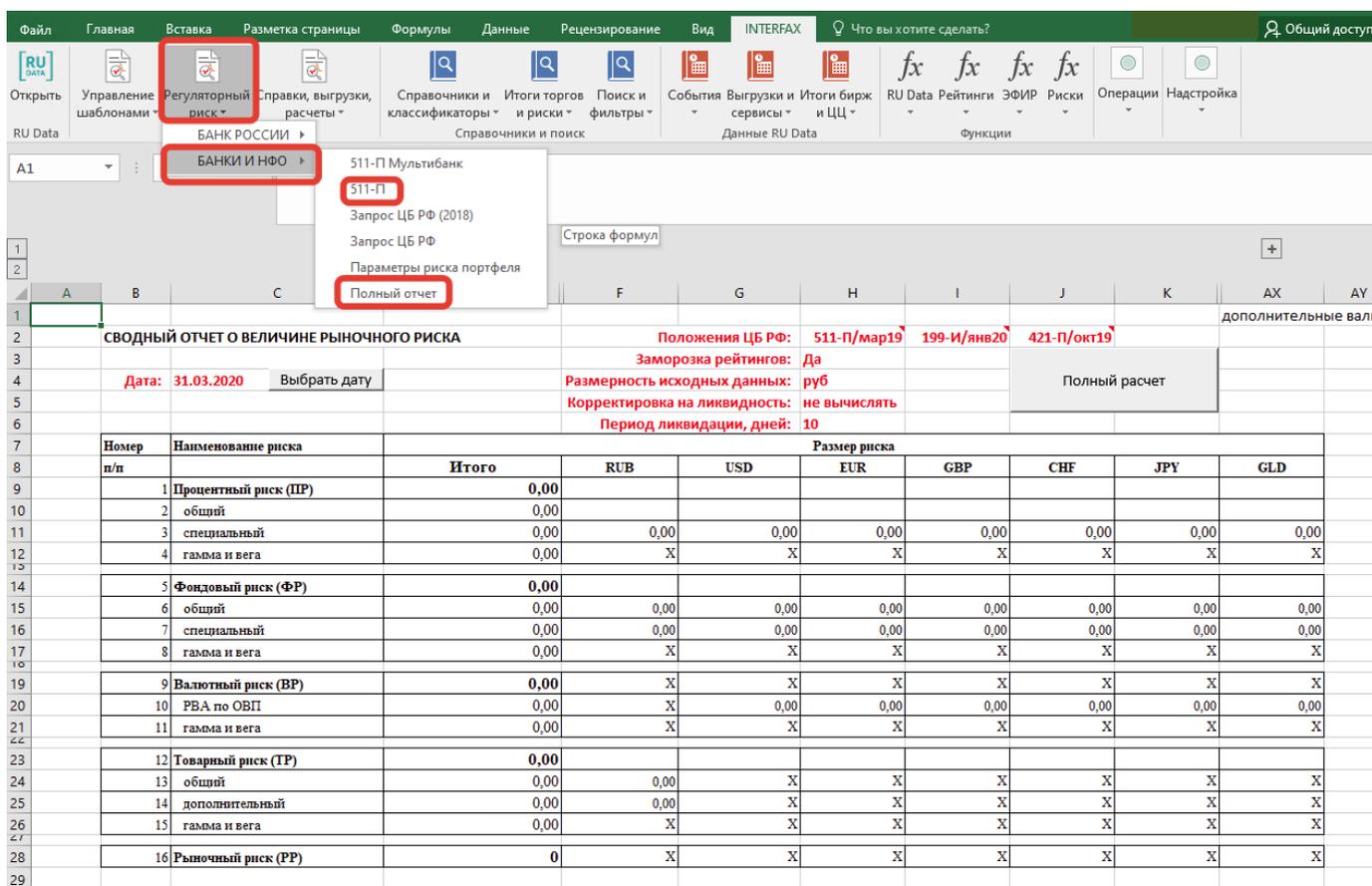
Модуль по расчету рыночного риска ЭФИР Add-In (Блок RD Risk)

Краткое руководство пользователя. Обзор функционала.

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



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



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»:

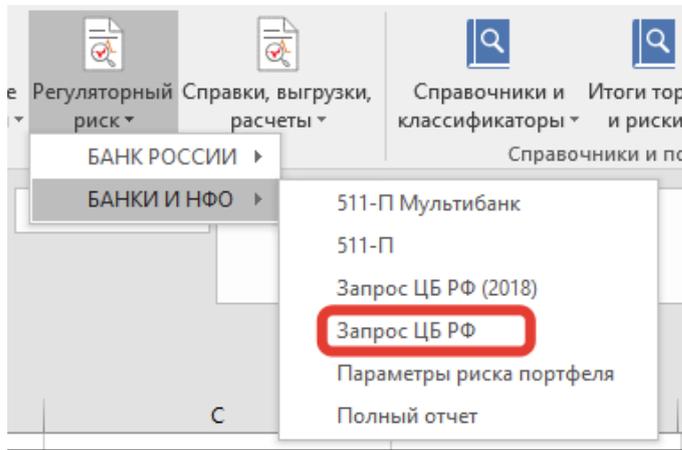
| А | В | С | Д | Е | Г | Н | И | К | АХ | АУ | |
|--|----------------------|--|----------------|--|-----------------------------|------------|-------------------------|------|-------------|---------------|--|
| СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА | | | | | | | | | | | |
| Дата: 27.04.2020 | | Выбрать дату | | Положения ЦБ РФ: 511-П/мар19 199-И/янв20 421-П/окт19 | | | Заморозка рейтингов: Да | | | Полный расчет | |
| Размерность исходных данных: руб | | Корректировка на ликвидность: рассчитать | | | Период ликвидации, дней: 10 | | | | | | |
| Номер п/п | Наименование риска | 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 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 5 | Фондовый риск (ФР) | 12 436 924,50 | | | | | | | | | |
| 6 | общий | 6 218 462,25 | 6 218 462,25 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| 7 | специальный | 6 218 462,25 | 6 218 462,25 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| 8 | гамма и вега | 0,00 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 9 | Валютный риск (ВР) | 10 122 321,17 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 10 | РВА по ОВП | 10 122 321,17 | X | 9 729 691,76 | -7 831 429,86 | 195 734,30 | 0,00 | 0,00 | -191 149,98 | | |
| 11 | гамма и вега | 0,00 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 12 | Товарный риск (ТР) | 115 808,44 | | | | | | | | | |
| 13 | общий | 96 507,03 | 96 507,03 | X | X | X | X | X | X | X | |
| 14 | дополнительный | 19 301,41 | 19 301,41 | X | X | X | X | X | X | X | |
| 15 | гамма и вега | 0,00 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 16 | Рыночный риск (РР) | 4 340 557 057 | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| Капитал Банка, тыс руб | | 4 081 455,00 | | | | | | | | | |
| Валюты | | Добавить валюту | RUB | USD | EUR | GBP | CHF | JPY | GLD | | |
| 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 | -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 | Капитал Банка, тыс руб | 0,00 | | | | | | | | |
| 31 | Валюты | Добавить валюту | RUB | USD | EUR | GBP | CHF | JPY | GLD | |
| 32 | Коэффициенты фондирования | X | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 33 | Открытая валютная позиция, тыс руб | X | X | 121621,147 | -97892,8732 | 2421,6788 | 0 | 0 | -2389,3747 | |
| 34 | НЕОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ ПАРАМЕТРЫ | | | | | | | | | |
| 35 | Достаточность базового капитала Н1.1 | 8,3% | | | | | | | | |
| 36 | Достаточность капитала Н1.0 | 12,8% | | | | | | | | |
| 37 | Рентабельность капитала (ROE) | 15,0% | | | | | | | | |
| 38 | Ставка фондирования | 5,0% | | | | | | | | |
| 39 | Аллокация операционных расходов | 0,5% | | | | | | | | |
| 40 | Норма налогообложения | 24,0% | | | | | | | | |
| 41 | Расчет нагрузки на капитал | Да | | | | | | | | |
| 42 | | | | | | | | | | |
| 43 | | | | | | | | | | |
| 44 | | | | | | | | | | |
| 45 | | | | | | | | | | |

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 без учета заморозки рейтингов.

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

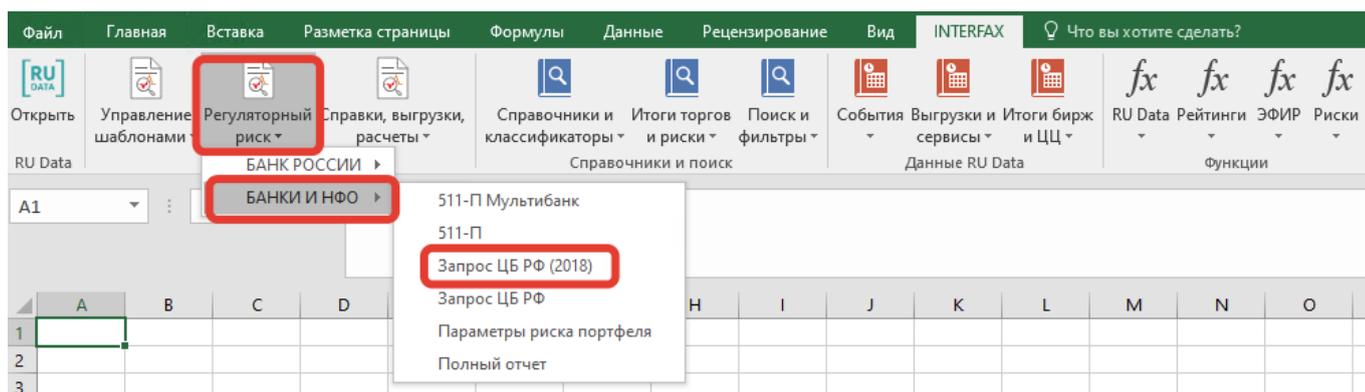
| | | | | | | |
|--|--------------|-------------------------------|--------------|---------------|-------------|---------------|
| СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА | | Положения ЦБ РФ: | 511-П/мар19 | 199-И/январ20 | 421-П/окт19 | допол |
| Дата: 27.04.2020 | Выбрать дату | Заморозка рейтингов: | Да | | | Полный расчет |
| | | Размерность исходных данных: | руб | | | |
| | | Корректировка на ликвидность: | рассчитать | | | |
| | | Период ликвидации, дней: | не вычислять | | | |

На листе «Состав портфеля» Вы увидите результаты корректировки:

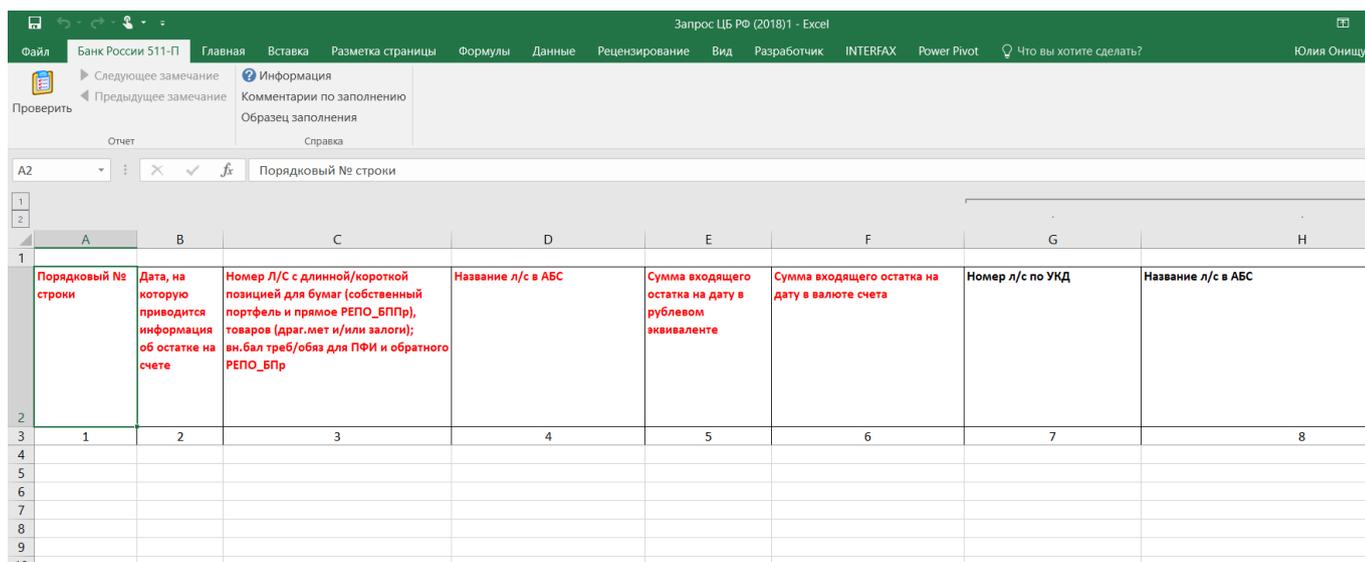
| Дата: 27.04.2020 | | Заведение стоимости позиции производится в руб | | | Рассчитать | | Ликвидность инструмента | |
|------------------|--------------------------|--|-------------------------------|-------------------------|--|-----------------------------------|---------------------------------|---------------------|
| ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата истечения срока договора | Секьюритизация | | Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод) | Корректировка на ликвидность, руб | Корректировка на ликвидность, % | Рейтинг ликвидности |
| | | | К-т риска ВКр по п. 5-6 647-П | Обеспеченная доля, %ном | | | | |
| 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)»:



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



Примеры по заполнению можно получить в файле из меню:

The screenshot shows the application interface for 'Банк России 511-П'. The 'Файл' (File) menu is open, and the 'Образец заполнения' (Fill-in example) option is highlighted. A tooltip for 'Запрос ЦБ РФ (2018)1' is visible. Below the menu, a table displays the structure of the report:

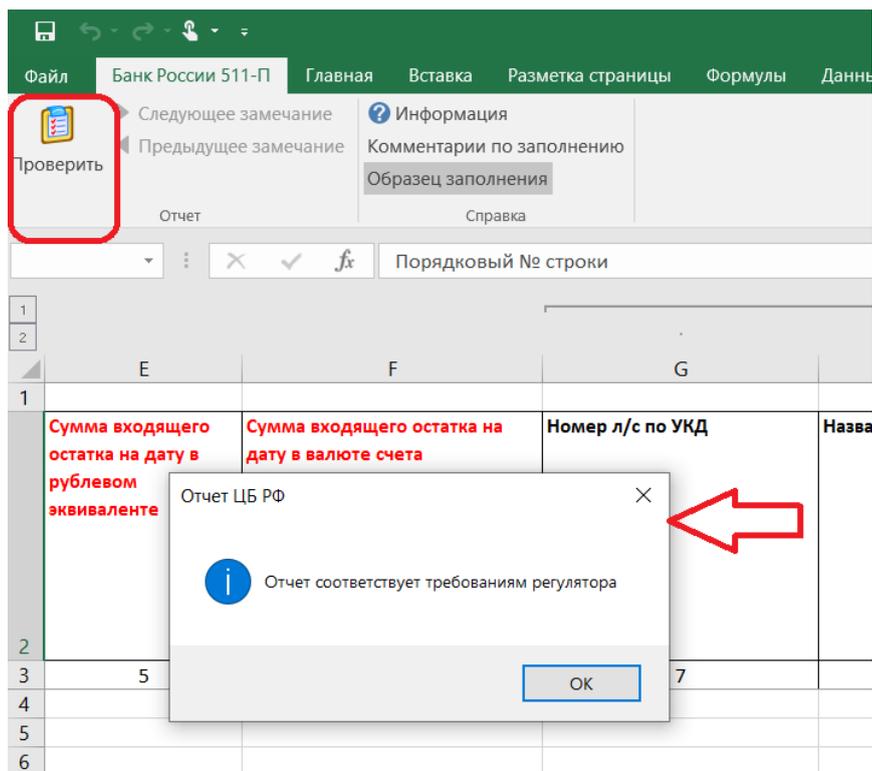
| Порядковый № строки | Дата, на которую приводится информация об остатке на счете | Номер Л/С с длинной/короткой позицией для бумаг (собственный портфель и прямое РЕПО_БППр), товаров (драг.мет и/или залого); вн.бал треб/обяз для ПФИ и обратного РЕПО_БПР | Название л/с в АБС |
|---------------------|--|---|--------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 2 | | | |
| 3 | | | |
| 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.

| A | B | C | D | E | F | G | H | I | J | K | L |
|-----|-----------|----------|--------------|---------------------|--|--|---|--|--|----------------------|--------------------|
| Тип | субтип | Вид БА | Позиция | Порядковый № строки | Дата, на которую приводится информация об остатке на счете | Номер л/с с длинной/короткой позицией для бумаг (собственный портфель и прямое РЕПО_БПр), товаров (драг мет и/или залого); вл.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 |
| T | СТ | БА | ПОЗ | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | | |
| ПФИ | форвард | валютный | позиция в БА | 1 | 01.04.17 | 9331039200000300456 | Сделка с ПФИ №38 с АО ЮНИКРЕДИТ БАНК со сроком исполнения от 31 до 90 дней | 3 584 424 000,00 | 6 000 000 000,00 | | |
| | | | поставка ДС | 2 | 01.04.17 | 9631081000000300456 | Сделка с ПФИ №38 с АО ЮНИКРЕДИТ БАНК со сроком исполнения от 31 до 90 дней | 3 191 489 361,70 | 3 191 489 361,70 | | |
| ПФИ | форвард | товарный | 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 | | |
| | | | поставка ДС | 4 | 01.04.17 | 9631081000000300556 | Сделка с ПФИ со сроком исполнения от 31 до 90 дней | 1 063 829 787,23 | 1 063 829 787,23 | | |
| ПФИ | форвард | акции | позиция в БА | 5 | 01.04.17 | 96504810500008801102 | Форвард на акции | 2 134 000 135,00 | 2 134 000 135,00 | | |
| | | | поставка ДС | 6 | 01.04.17 | 93504810500008800000 | Форвард на акции | 2 017 000 740,00 | 2 017 000 740,00 | | |
| ПФИ | своп | валютный | позиция в БА | 7 | 01.04.17 | 9331039200000300003 | Сделка с ПФИ CCS № 11 RENAULT FINANCE S.A. со сроком исполнения от 91 дня и более от нерезидентов | 4 181 828 000,00 | 7 000 000 000,00 | | |
| | | | поставка ДС | 8 | 01.04.17 | 9631081000000300003 | Сделка с ПФИ CCS № 11 RENAULT FINANCE S.A. со сроком исполнения от 91 дня и более от нерезидентов | 2 750 491 159,14 | 2 750 491 159,14 | | |
| ПФИ | опцион | валютный | позиция в БА | 9 | 01.04.17 | 9331084000000300741 | Опцион лут1 | 1 450 000 000,00 | 26 000 000,00 | | |
| | | | поставка ДС | 10 | 01.04.17 | 9631081000000300741 | Опцион лут1 | 1 482 000 000,00 | 1 482 000 000,00 | | |
| ПФИ | опцион | валютный | позиция в БА | 11 | 01.04.17 | 9331084000000300541 | Опцион колл1 | 1 430 000 000,00 | 26 000 000,00 | | |
| | | | поставка ДС | 12 | 01.04.17 | 9631081000000300541 | Опцион колл1 | 1 502 000 000,00 | 1 502 000 000,00 | | |
| ЦБ | акция | облгн. | | 13 | 01.04.17 | 50606810300000011542 | Вложение в акции | 1 978 774 883,13 | 1 978 774 883,13 | | |
| ЦБ | облигация | корп. | | 14 | 01.04.17 | 50208810300108080123 | В35/Лиз 13 06/11/2018_RU000A0JY9T5 | 336 565,03 | 336 565,03 | 50208810200208080123 | В35/Лиз 13 ПКД |

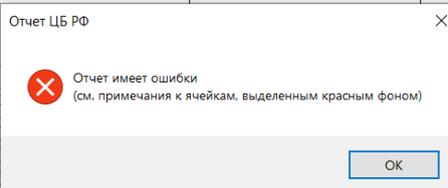
Поля для ПФИ и для опционов, заполненные в примере, надо заполнять обязательно, иначе не получится выполнить расчёт.

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



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

| A | B | C | D | E |
|---------------------|--|--|------------------------------|--|
| Порядковый № строки | Дата, на которую приводится информация об остатке на счете | Номер Л/С с длинной/короткой позицией для бумаг (собственный портфель и прямое РЕПО_БПр), товаров (драг.мет и/или залого); вн.бал треб/обяз для ПФИ и обратного РЕПО_БПр | Название л/с в АБС | Сумма входящего остатка на дату в рублевом эквиваленте |
| 1 | 2 | | | 5 |
| 2 | 42826 | 9331039200 | | 358442400 |
| 3 | 42826 | 9631081000 | | 319148930 |
| 4 | 42826 | 9331039200 | | 119480800 |
| 5 | 42826 | 9631081000 | | 106382970 |
| 6 | 42826 | 9650481050 | | 213400010 |
| 7 | 42826 | 93504810500008800000 | Форвард на акции | 201700070 |
| 8 | 42826 | 93310392000000300003 | Сделка с ПФИ CCS № 11 RENAUL | 418182800 |
| 9 | 42826 | 9631081000000300003 | Сделка с ПФИ CCS № 11 RENAUL | 275049110 |
| 10 | 42826 | 9331084000000300741 | Опцион пут1 | 145000000 |
| 11 | 42826 | 9631081000000300741 | Опцион пут1 | 148200000 |
| 12 | 42826 | 9331084000000300541 | Опцион колл1 | 143000000 |
| 13 | 42826 | 9631081000000300541 | 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) |

Форма отчета

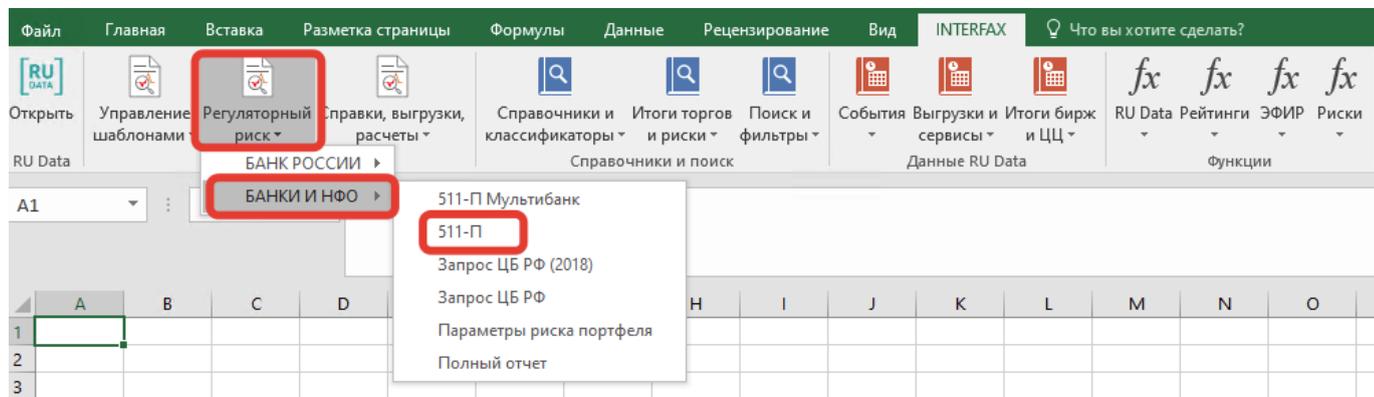
Отчет об ошибках

Информация

Образец заполнения



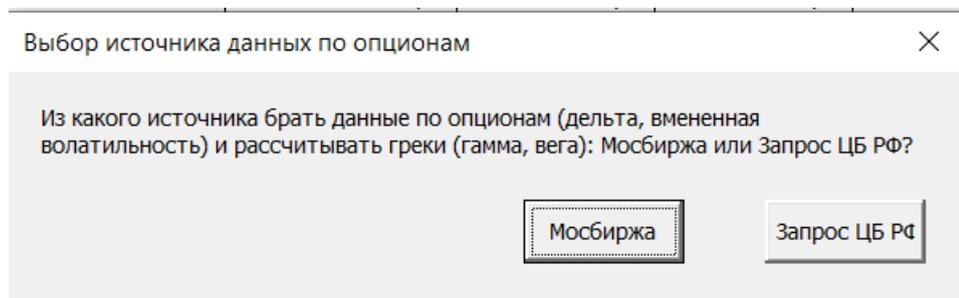
Если отчет заполнен правильно, тогда его можно сохранить и открыть обычный расчетный шаблон:



И загрузить туда «Запрос ЦБ РФ»:

| | | | | | | | | | |
|---|---------------------------|------|-----------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 7 | специальный | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| 8 | гамма и вега | | 0,00 | X | X | X | X | X | |
| 9 | Валютный риск (ВР) | | 0,00 | X | X | X | X | X | |
| 10 | РВА по ОВП | | 0,00 | X | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| 11 | гамма и вега | | 0,00 | X | X | X | X | X | |
| 12 | Товарный риск (ТР) | | 0,00 | | | | | | |
| 13 | общий | 0,00 | 0,00 | | X | X | X | X | |
| 14 | дополнительный | 0,00 | 0,00 | | X | X | X | X | |
| 15 | гамма и вега | 0,00 | 0,00 | X | X | X | X | X | |
| 16 | Рыночный риск (РР) | | 0 | X | X | X | X | X | |
| Капитал Банка, тыс руб | | | 0,00 | | | | | | |
| Валюты | | | Добавить валюту | RUB | USD | EUR | GBP | CHF | JPY |
| Коэффициенты фондирования | | | X | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Открытая валютная позиция, тыс руб | | | X | X | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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



Позиция по опционам ✕

В колонке 27 (и/или 28) позиция по опционам вводилась, умноженная на коэффициент Дельта?

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 | B | C | D | E | G | H | |
|----|------------------|--|-------------------------------|------------------------------|-------------------------|--|---|----------|
| 1 | Дата: 31.03.2017 | Заведение стоимости позиции производится в руб | | | | | | Очистить |
| 2 | ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата истечения срока договора | Секьюритизация | | Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод) | Корректировка ликвидности, (не вычисляе | |
| 3 | | | | К-т риска ВКр по п.5-6 647-П | Обеспеченная доля, %ном | | | |
| 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.

| | A | B | C | D | E | H | Q | R | S | T | AB | AE | AF | AG | AH | AI |
|---|------------------|-----------------|--------|-------------|-----------------|--------|---------------|-------|-------|--------|-------|------------|---------------------|--------------|--------------|---------|
| 1 | Дата: 31.03.2017 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | Краткий код ПФИ | Контракты (шт.) | Страйк | Тип опциона | Дата экспирации | Валюта | Волатильность | Delta | Gamma | Vega | Актив | Кэфф. Лота | ИБА для 1 контракта | Гамма Риск | Вега Риск | Вид GBP |
| 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 – ценные 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 | Д | Е | Г | Н | И | К | Л | М | Н | |
|---|----------------------|--------------------|----------------|--|------|------|----------------------------------|-------|---------------|------|----------------|--|
| СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА | | | | Положения ЦБ РФ: 4969-У | | | 180-И/2018 | 421-П | | | | |
| Дата: 31.03.17 | | Выбрать дату | | Заморозка рейтингов: Да | | | Размерность исходных данных: руб | | Полный расчет | | | |
| | | | | Корректировка на ликвидность: не вычислять | | | | | | | | |
| | | | | Период: с 01.01.17 по 31.03.17 | | | | | | | | |
| Номер | Наименование риска | Итого | RUB | | | | | | | | | |
| 1 | Процентный риск (ПР) | 395 016 930,61 | | | | | | | | | | |
| 2 | общий | 395 016 930,61 | 139 053 1 | | | | | | | | | |
| 3 | специальный | 0,00 | | | | | | | | | | |
| 4 | гамма и вега | 0,00 | | | | | | | | | | |
| 5 | Фондовый риск (ФР) | 341 440 021,60 | | | | | | | | | | |
| 6 | общий | 170 720 010,80 | 170 720 0 | | | | | | | | | |
| 7 | специальный | 170 720 010,80 | 170 720 010,80 | 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 | X | X | X | X | X | |
| 9 | Валютный риск (ВР) | 156 636 264 245,44 | | X | X | X | X | X | X | X | X | |
| 10 | РВА по ОВП | 217 130 677,15 | | X | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21 907 907,17 | |
| 11 | гамма и вега | 156 410 133 568 70 | | X | X | X | X | X | X | X | 194 345 712,84 | |

EfirAddIn

Полный расчет завершен. Время расчета 0м 6с.

OK

| | CHF | JPY | AED | AMD | AUD |
|--|------|---------------|------|------|------|
| | | 54 363 764,00 | | | |
| | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | X | X | X | X | X |
| | | | | | |
| | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 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 N1.1 | 8,9% | | | | | | | | |
| Достаточность капитала N1.0 | 13,3% | | | | | | | | |
| Рентабельность капитала (ROE) | 0,0% | | | | | | | | |
| Ставка фондирования | 0,0% | | | | | | | | |
| Аллокация операционных расходов | 0,0% | | | | | | | | |
| Норма налогообложения | 0,0% | | | | | | | | |
| Расчет нагрузки на капитал | Да | | | | | | | | |

Импорт Отчет ЦБ РФ

Импорт ф.634

Импорт ЦФТ

Экспорт в текстовый файл для КИКО...

Экспорт ЦФТ

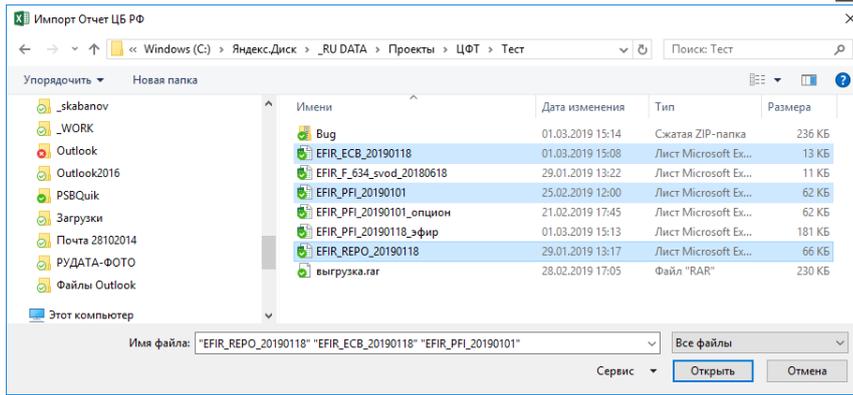
1. Приготовьте файлы выгрузки в модуле ЦФТ (максимум 4 файла):
 - по ценным бумагам
 - по ПФИ
 - по РЕПО
 - ф.634

И скопируете их в директорию

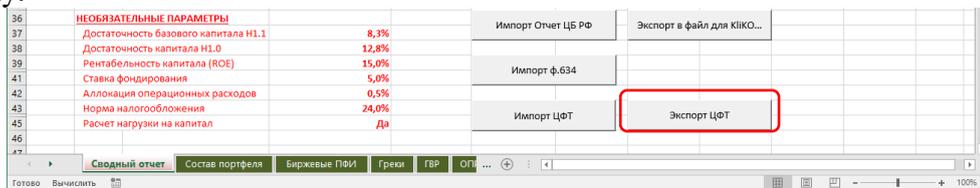
2. Для импорта в INTERFAX Add-In нажмите на листе «Сводный отчет»
 - кнопку Импорт ф.634
 - кнопку «Импорт ЦФТ»:

| | | | | | | | | | |
|--------------------------------------|-----------------|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--|
| Капитал Банка, тыс руб | 10 000 000,00 | | | | | | | | |
| Валюты | Добавить валюту | RUB | USD | EUR | GBP | CHF | JPY | GLD | |
| 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 | | | | | | | | | |
| Достаточность базового капитала N1.1 | 8,3% | | | | | | | | |
| Достаточность капитала N1.0 | 12,8% | | | | | | | | |
| Рентабельность капитала (ROE) | 15,0% | | | | | | | | |
| Ставка фондирования | 5,0% | | | | | | | | |
| Аллокация операционных расходов | 0,5% | | | | | | | | |
| Норма налогообложения | 24,0% | | | | | | | | |
| Расчет нагрузки на капитал | Да | | | | | | | | |

В появившейся форме выбираете файлы:



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



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 стоимости позиции | |
|------------------|--------------------------|-------------------------------|--|
| ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата истечения срока договора | |
| SLV | 643 380 | | |
| RU000A0JXTS9 | 842 754 301 | | |
| RU000A0JWNA4 | 1 180 910 190 | | |
| RU000A0DOG29 | 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 | H | I | J | K | L | M | N | O | P | Q |
|--|--|--------------------------------------|--------------------------------|---------------|------------------------------|----------------------|----------------|--------------------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Очистить | Ликвидность инструмента | | | Рассчитать | Расчет "нагрузки" на капитал | | | Для стресс-теста | | | Заполнить формулы ↓ |
| Корректировка на ликвидность, руб (не вычисляется) | Корректировка на ликвидность, % (не вычисляется) | Рейтинг ликвидности (не вычисляется) | Скорректированная позиция, руб | Рыночный риск | Норма риска | Коэфф. риска (180-И) | Норма капитала | Целевая доходность | Модифицированная длительность | Модифицированная 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:

| | | | | | |
|--|--------------|--|---------------|-------------|------------|
| Сводный отчет о величине рыночного риска | | Положения ЦБ РФ: 511-П/мар19 | 199-И/явн20 | 421-П/окт19 | дополнител |
| Дата: 24.04.2020 | Выбрать дату | Заморозка рейтингов: Да | Полный расчет | | |
| | | Размерность исходных данных: руб | | | |
| | | Корректировка на ликвидность: не вычислять | | | |
| | | Период ликвидации, дней: 10 | | | |

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

| A | B | C | D | E | F | G | H | I | J | K | L | M | N | O |
|------------------|--|-------------------------------|-------------------------------|--|---|----------------------------------|---------------|------------------------------|---------------------|----------------|--------------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| Дата: 26.03.2019 | Заведение стоимости позиции производится в руб | | | | Рассчитать | Рассчитать | | Расчет "нагрузки" на капитал | | | | Для стресс-теста | | Заполнить формулы ↓ |
| ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата истечения срока договора | Дата опирания позиции (180-И) | Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод) | Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых залов) | Скорректиров. акция позиция, руб | Рыночный риск | Норма риска | Кэфф. риска (180-И) | Норма капитала | Целевая доходность | Модифицир. сванная дедрация | Модифицир. важная зашумленость | Тип инструмента |
| XS083264335 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 100% | 0% | 5,50% | | | Корпоративные еврооблигации (Выпуск |
| XS0562354182 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 100% | 0% | 5,50% | | | Корпоративные еврооблигации (Выпуск |
| RU000ADJPLE2 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKL9 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJQWZ2 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKV8 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKW6 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKN5 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKQ8 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 8 750 000 | 9% | 0% | 1% | 5,64% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPKP0 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 21 875 000 | 22% | 0% | 3% | 5,86% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPL07 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 28 125 000 | 28% | 0% | 4% | 5,96% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPKK1 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 34 375 000 | 34% | 0% | 4% | 6,06% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPLB8 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPLC6 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPKU0 | 100 000 000 | | | 0 | | 100 000 000 | 0 | 0% | 0% | 0% | 5,50% | | | Государственные облигации (Выпуск Пг |
| RU000ADJPLB0 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 8 750 000 | 9% | 0% | 1% | 5,64% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPL15 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 8 750 000 | 9% | 0% | 1% | 5,64% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPL72 | 100 000 000 | | | 100 000 | | 100 000 000 | 21 875 000 | 22% | 0% | 3% | 5,86% | | | Государственные облигации |
| RU000ADJPK75 | 0 | Биржевой ПФИ: MXZ9 | | 0 | | -249 759 | -187 319 | -75% | 0% | -10% | -0,72% | | | Фондовый индекс |
| RUB | 0 | | 2019 | 0 | | 14 989 000 | 1 311 538 | 9% | 0% | 1% | 5,64% | | | Поставка денежных средств |
| RU0009046510 | 0 | | | 10 000 | | 10 120 000 | 19 740 482 | 195% | 0% | 25% | 8,68% | | | Акции Обыкновенная |
| RUB | -2 560 000 | 20.06.2019 | | 0 | | -2 560 000 | -38 400 | -2% | 0% | 0% | 0,48% | | | Поставка денежных средств |
| RU000ADJPEB3 | 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, GDN6, LK27500BB6). Их количество, котировки, вся остальная информация подгружается автоматически с наших серверов:

| A | B | C | D | E | F | G | H | I | J | K | L | M | N |
|------------------|-----------------|---------------------|------------------------------|----------------------|--|------------|-----------------|--------------------------|---------------------------|---|---|---|---|
| Дата: 26.03.2019 | | | Рассчитать позиции | | Тип цены для активов МБ: Market | | | | | | | | |
| Краткий код ПФИ | Контракты (шт.) | Котировка контракта | Характеристики позиции | | | | | | | | | | |
| | | | 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 | RU000ADJPK75 | 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 | RU000ADJPEB3 | Индекс РТС | USD | 19.12.2019 | 15 845 414 | -193 498 | | | | |
| RIM9 | -100 | 400 | Фьючерс на фондовый индекс | RU000ADJPEB3 | 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 | RU000ADJPEB3 | 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 | RU000ADJPEB3 | Индекс РТС | USD | 19.09.2019 | -1 143 564 | 1 396 474 | | | | |
| RI167500BU9 | 100 | 454 | Опцион Put | RU000ADJPEB3 | 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 | | | | |
| LK57500BI9 | 100 | 1230 | Опцион Call | RU0009024277 | "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ", ПАО, акции обыкновенн | 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.

| Дата: 26.03.2019 | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|--|--------------------------------|---------------|-------------|----------------------|----------------|--------------------|------------------------------|---------------------------|------------------|---------------------------|---------------------|
| Заведение стоимости позиции производится в руб | | | | | Рассчитать | | Рассчитать | | | | | Расчет "нагрузки" на капитал | | Для стресс-теста | | Заполнить формулы ↓ |
| 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) | Скорректированная позиция, руб | Рыночный риск | Норма риска | Коефф. риска (180-И) | Норма капитала | Целевая доходность | Модифицированная дельта | Модифицированная важность | Тип инструмента | | |
| RU00A0JPF7K5 | -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% | | | | Поставка денежных средств | |
| RU000A0JPEB3 | -15 845 414 | | | 0 | | -15 845 414 | -9 218 862 | -58% | 0% | -7% | -0,45% | | | | Фондовый индекс | |
| USD | 51 599 | 20.06.2019 | | 0 | | 51 599 | 1 290 | 2% | 0% | 0% | 5,54% | | | | Поставка денежных средств | |
| RU00A0ZUYA9 | 1 882 360 | | | 2 004 | | 1 882 360 | 1 058 627 | 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% | | | | Поставка денежных средств | |
| USD | 1 396 474 | 19.09.2019 | | 0 | | 1 396 474 | 69 824 | 5% | 0% | 1% | 5,58% | | | | Фондовый индекс | |
| 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»:

| Дата: 26.03.2019 | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|-----------------|--------|-------------|-----------------|--------|---------------|----------|-------------|-------------|-------|-------------|---------------------|--------------|--------------|---------|
| Краткий код ПФИ | Контракты (шт.) | Страйк | Тип опциона | Дата экспирации | Валюта | Волатильность | Delta | Gamma | Vega | Актив | Коефф. Лота | ИБА для 1 контракта | Гамма Риск | Вега Риск | Вид ГВР |
| RI182500B09 | -100 | 182500 | Put | 19.09.2019 | USD | 0,2552666 | -0,98955 | 1,2883E-06 | 2258,324711 | RI | 100 | 0 | 0 | -929555,6408 | не ГВ |
| RI150000B09 | -100 | 150000 | Call | 19.09.2019 | USD | 0,2159382 | 0,07217 | 7,63009E-06 | 11314,45077 | RI | 100 | 0 | 0 | -3939652,933 | не ГВ |
| RI167500B09 | 100 | 167500 | Put | 19.09.2019 | USD | 0,2343573 | -0,97762 | 2,70774E-06 | 4357,729245 | RI | 100 | 1,965344 | 3,372947587 | 1646773,004 | ФР |
| G221250B09 | -100 | 21250 | Put | 18.09.2019 | RUB | 0,24493 | -0,97527 | 2,42601E-05 | 595,2466955 | GZ | 1 | 1213,44 | -1653,553302 | -3644,844328 | ФР |
| LK57500B09 | 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 |

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»:

| Описание сценариев | | Стресс-тест | | | | | Переоценка (%) | | | | | | | | | | |
|--------------------|----------------|-------------------------------|--|---------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------------------|--------------------|-------------------------|---------------------|--------------------|---------------------------|
| № | Сценарий | Рост доходностей гособлигаций | Рост доходностей корпоративных облигаций | Обесценение национальной валюты | Падение фондовых индексов | Снижение доходности капитала (п.п.) | Государственные облигации | Государственные еврооблигации | Корпоративные облигации | Корпоративные еврооблигации | Муниципальные облигации | Муниципальные еврооблигации | Акция Обыкновенная | Акция Привилегированная | ИТОГО без учета ПФИ | ИТОГО с учетом ПФИ | Государственные облигации |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | 701 882 360,0 |
| 1 | Умеренный | 2% | 5% | -20% | -30% | -4,55% | -0,03% | | | | | | | | | | -226 613,7 |
| 2 | Консервативный | 3,50% | 10% | -30% | -50% | -7,74% | -0,05% | | | | | | | | | | -366 462,5 |
| 3 | 1998 | 10% | 20% | -250% | -40% | 4,43% | -0,10% | | | | | | | | | | -674 226,9 |
| 4 | 2004 | 1,50% | 2,50% | -2% | -30% | -5,39% | -0,02% | | | | | | | | | | -174 261,9 |
| 5 | 2008 | 6% | 14% | -50% | -70% | -10,46% | -0,08% | | | | | | | | | | -542 188,6 |
| 6 | февраль 2014 | 4% | 1,30% | -20% | -20% | -2,75% | -0,06% | | | | | | | | | | -407 343,2 |
| 7 | мой | 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 стресс-сценариев на переоценку портфеля. Функция позволяет оценить степень подверженности процентному риску каждой отдельной облигации в портфеле:

| Заведение стоимости позиции производится в руб | | | | | Расчитать | | Расчитать | | Расчет "нагрузки" на капитал | | | | Для стресс-теста | | Заполнить формулы ↓ |
|--|--------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--|--|--------------------------------|---------------|-------------|------------------------------|----------------|--------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------------|
| ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата исполнения срока договора | Дата открытия позиции (180-И) | Размер позиции, шт. (оценка или ручной ввод) | Корректировка на ликвидность, руб (по очереди торговых заявок) | Скорректированная позиция, руб | Рыночный риск | Норма риска | Кэфф-риска (180-И) | Норма капитала | Целевая доходность | Модифицированная дюрация | Модифицированная выпуклость | Тип инструмента | |
| RU000A0ZYU49 | 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 | |
| RU000A0PEB3 | -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 | |

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

| Заведение стоимости позиции производится в руб | | | | | Заполнить формулы ↓ | | | | | | | | | |
|--|--------------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------|------------|------------|----------------------------|----------------|--|--|--|--|
| ISIN | Позиция (стоимость), руб | Дата открытия позиции | Тип инструмента | Краткое наименование инструмента | Эмитент | Валюта номинала | Кэфф-риска | Риск итого | Доля покрытия гарантий (%) | Группа риска 1 | Обоснование группы риска 1 (Инструкция #139/180-И) | | | |
| RU000A0IT940 | 1 000 000 | | Корпоративные облигации | Роснефть-4-об | Роснефть НК | RUB | 100% | 1 000 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0IT988 | 2 000 | | Корпоративные облигации | МегаФон-Финанс-6-об | МегаФон Финанс | RUB | 150% | 3 000 | 100 | ПК | код 8815 | | | |
| RU000A0ISEU7 | 1 000 | | Корпоративные облигации | Выг Аргун-3-об | МАЛАХИТ | RUB | 150% | 1 500 | 0 | ПК | код 8815 | | | |
| RU000A0ISYNO | 3 000 | | Закртый ПФИ | Альбатрос ПФИ | Альбатрос ПФИ | RUB | 0% | 0 | 0 | нет кредита | нет кредита | | | |
| RU000A0IS7LO | 2 400 | | Корпоративные облигации | Выг НМТП-2-6об | НМТП | RUB | 150% | 3 600 | 0 | ПК | код 8815 | | | |
| RU000A0ZYFV6 | 20 | | Закртый ПФИ | ТЕТИС-ЗарежьеПФИ | ТЕТИС-ЗарежьеПФИ | RUB | 0% | 0 | 0 | нет кредита | нет кредита | | | |
| RU000A0ITKD8 | 10 000 | | Корпоративные облигации | Выг Ростелеком-15-об | Ростелеком | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0IT7T2 | 10 000 | | Корпоративные облигации | ФСК ЭЭС-21-об | ФСК ЭЭС | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0ISQ58 | 10 000 | | Корпоративные облигации | ФСК ЭЭС-22-об | ФСК ЭЭС | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0ITJY6 | 10 000 | | Корпоративные облигации | ФСК ЭЭС-23-об | ФСК ЭЭС | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0ITKA4 | 10 000 | | Корпоративные облигации | ФСК ЭЭС-24-об | ФСК ЭЭС | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| RU000A0IT2K2 | 10 000 | | Корпоративные облигации | ФСК ЭЭС-25-об | ФСК ЭЭС | RUB | 100% | 10 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| X50783242877 | 1 000 | | Корпоративные еврооблигации | СистемаФК-2019-евро | Sistema Intern. Funding | USD | 100% | 1 000 | 0 | 4 | п.2.3.4, абз. 2 | | | |
| X50767469827 | 100 000 | | Государственные еврооблигации | Россия-2017 | Минфин РФ | USD | 100% | 100 000 | 0 | 1 | п.2.3.1, абз. 9 | | | |
| X50767472458 | 100 000 | | Государственные еврооблигации | Россия-2022 | Минфин РФ | USD | 100% | 100 000 | 0 | 1 | п.2.3.1, абз. 9 | | | |

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 стоимости позиции производится в руб | | | | Рассчитать | | Рассчитать | | Расчет "нагрузки" 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) | Скорректированная позиция, руб | Рыночный риск | Норма риска | Кэфф. 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 кнопку «Заполнить формулы». Позиции рассчитаются автоматически, подгружая данные ТСС с наших серверов:

| Дата: 26.03.2019 | Учет дат фиксации списков: | | | | 0 | | Собственная оценка | |
|------------------|----------------------------|-----------|---------|--------------|-----------|--------------|--------------------|--------------|
| ISIN | Кол-во | ТСС, руб. | ТСС, % | Позиция, руб | ТСС, руб. | Позиция, руб | ТСС, руб. | Позиция, руб |
| 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 | B | C | D | E | F | G | H | I | J | K | L | M | N | O | P |
|---------------------|---------|------------------------------------|-------------------------------|----------------------------------|-----------|----------------|------------|---------------------|--|------------|-----|--|--|-------------|-----------------|
| Дата: 26.03.2019 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Заполнить формулы ↓ | | | | | | | | | | | | | | | |
| ISIN | Позиция | Код страны уполномоч. банк. группы | Тип инструмента | Краткое наименование инструмента | Эмитент | Валюта копейка | Группа ВЛА | Группа ВЛА (Т - 30) | Число дней с момента исключения из гр. ВЛА | Фиксирован | ВЛА | Максимальное обещание в течение последовательных 30 дней | Максимально допустимое обещание в течение последовательных 30 дней | Обоснование | Срока форм. 112 |
| XS0114288789 | 1000 | | Государственные еврооблигации | Россия-2030-11т | Минфин РФ | USD | ВЛА-1 | ВЛА-1 | | | 0 | 1000 | 10,4% | | 1,18 |
| RU000A0QR09 | 1000 | | Корпоративные облигации | РЖД-23-06 | РЖД | RUB | ВЛА-2Б | ВЛА-2Б | | | 0,5 | 500 | 9,0% | <= 20% | 1,32 |
| XS0114288789 | 1000 | | Государственные еврооблигации | Россия-2030-11т | Минфин РФ | USD | ВЛА-1 | ВЛА-1 | | | 0 | 1000 | 10,4% | | 1,18 |
| XS0114288789 | 1000 | | Государственные еврооблигации | Россия-2030-11т | Минфин РФ | USD | ВЛА-1 | ВЛА-1 | | | 0 | 1000 | 10,4% | | 1,18 |
| RU000A0QR09 | 1000 | | Корпоративные облигации | РЖД-23-06 | РЖД | RUB | ВЛА-2Б | ВЛА-2Б | | | 0,5 | 500 | 9,0% | <= 20% | 1,32 |
| RU000A0QR09 | 1000 | | Корпоративные облигации | РЖД-23-06 | РЖД | RUB | ВЛА-2Б | ВЛА-2Б | | | 0,5 | 500 | 9,0% | <= 20% | 1,32 |

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

| А | В | С | Д | Е |
|-------|---|------------------------------------|---------------------|---|
| 1 | Наименование показателя | Величина требований (обязательств) | Весовой коэффициент | Взвешенная величина требований (обязательств) |
| 1 | Высоколиквидные активы, скорректированные с | Х | Х | |
| 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 |
| 1.1.7 | 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 |

Сводный 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 | B | C | D | E | F | G | H | I | J | K | L | M | N |
|---------------------|---------------------------------|----------------|------------------------|------------|---------------------------|-------|--|---|----|---|---|---|---|
| Instrument | № положения, Date инструкции ЦБ | Группа парам-в | Код ц.б., Дата расчета | 26.03.2019 | Учет "заморозки" не банки | банки | Позиция (стоимость) Размер позиции, шт. | | Nu | | | | |
| FinToolNum | Все | Эмиссия | Код ц.б. | | | | Уникальный номер финансового инструмента (ISIN, регистрационный номер бумаги, другой идентификатор) | | | | | | |
| CalcDate | Все | Эмиссия | Дата расчета | | | | Дата, на которую определяется расчет группы риска | | | | | | |
| isMatched | Все | Эмиссия | Сверено? | | | | Признак сверки данных Интерфакс и НРД (1-ДА); пока бумага не сверена, не заведены ключевые параметры для | | | | | | |
| Status | Все | Эмиссия | Статус | | | | Статус ценной бумаги | | | | | | |
| FinToolType | Все | Эмиссия | Тип ц.б. | | | | Тип финансового инструмента - облигация, привилегированная акция, конвертируемая ценная бумага, другой фи | | | | | | |
| FinToolShortNameRus | Все | Эмиссия | Краткое рус.имя | | | | Краткое наименование инструмента на русском языке | | | | | | |
| FinToolShortNameEng | Все | Эмиссия | Краткое англ.имя ц.б. | | | | Краткое наименование инструмента на английском языке | | | | | | |
| FinToolFullNameRus | Все | Эмиссия | Полное рус.имя ц.б. | | | | Полное наименование инструмента на русском языке | | | | | | |
| FinToolFullNameEng | Все | Эмиссия | Полное англ.имя ц.б. | | | | Полное наименование инструмента на английском языке | | | | | | |
| BegCirculationDate | Все | Эмиссия | Дата нач. обращения | | | | Дата начала обращения ценной бумаги | | | | | | |
| IssueCur | Все | Эмиссия | Вал. эмиссии | | | | Валюта эмиссии | | | | | | |
| Seniority | 139/180-И | Эмиссия | Старшинство | | | | Старшинство облигации (в целях определения порядка выплат при банкротстве) | | | | | | |
| ISubordinated | 511-П | Эмиссия | Субординир. обл.? | | | | Субординированные облигации | | | | | | |
| IssueSec | 511-П | Эмиссия | Секьюритизация? | | | | Признак наличия обеспечения ценными бумагами | | | | | | |
| RiskGroupF0 | 511-П | Эмиссия | Гр. риска без фондир-я | | | | Группа риска (от 0 до 6) при отсутствии фондирования | | | | | | |
| RiskGroupF1 | 511-П | Эмиссия | Гр. риска с фондир-ем | | | | Группа риска (от 0 до 6) при наличии фондирования | | | | | | |
| IssueConvDate1 | 511-П | Эмиссия | Дней до конверсии 1 | | | | Число дней до первой даты, когда может быть осуществлена конверсия в долговые бумаги для конвертируемых | | | | | | |
| IssueConvDate2 | 511-П | Эмиссия | Дней до конверсии 2 | | | | Число дней до второй даты, когда может быть осуществлена конверсия в долговые бумаги, если первая дата уже | | | | | | |
| IssueConvYield | 511-П | Эмиссия | Дох-ть при конверсии | | | | Доходность (доходность рассчитывается как выраженная в процентах от текущей (справедливой) стоимости ба: | | | | | | |
| T_Min | 511-П | Эмиссия | Дата группы срочности | | | | Дата, по которой вычлняется группа срочности | | | | | | |
| IssueMty | 511-П | Эмиссия | Дата погашения | | | | Дата погашения | | | | | | |
| IssueMty | 511-П | Эмиссия | Срок до погашения | | | | Срок до погашения (в днях) | | | | | | |
| IssueOffer | 511-П | Эмиссия | Срок до досрочн.погаш. | | | | Срок до досрочного погашения (в днях) | | | | | | |
| IssueRate | 511-П | Эмиссия | Срок до перем.%ставки | | | | Срок до пересмотра процентной ставки (в днях) | | | | | | |
| IssueDivid | 511-П | Эмиссия | Срок до дивиденда (П) | | | | Срок до выплаты дивидендов для неконвертируемых привилегированных акций (в днях) | | | | | | |
| ExpirationDate | 511-П | Эмиссия | Дата экспирации | | | | Дата экспирации (только для фьючерсов) | | | | | | |
| FullGuarant | все | Эмиссия | Полная гарантия? | | | | Признак полной гарантии (0,1) | | | | | | |

✓ 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:

| | A | B |
|---|------------|--------------|
| 1 | Instrument | 4-02-36102-R |
| 2 | Date | 26.03.2019 |
| 3 | FinToolNum | Все |
| 4 | CalcDate | Все |

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 [ссылке](#).

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 | help@rudata.info

Новости проекта смотрите на сайте

www.rudata.info

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