

# ЭФИР Add-In

## Расчет товарного риска по различным товарам

Модуль по расчету рыночного риска **ЭФИР Add In** (RU Data Risk) позволяет подсчитать товарный риск для товаров, являющихся базовым активом ПФИ, торгуемых на Московской Бирже.

Для расчета необходимо на листе «**Биржевые ПФИ**» завести краткий или полный торговый код соответствующего фьючерса или опциона, количество позиций (при продаже задается со знаком "минус"), и среднюю цену сделки.

Затем, на листе «**Сводный отчет**» следует задать дату расчета РР и нажать кнопку «**Полный расчет**».

Система сама получит необходимую информацию по параметрам расчета и ценам, разложит каждый ПФИ на **Позицию в базовом активе** (по которой будет подсчитан Товарный риск) и **Поставку денежных средств** (по которой будет подсчитан Процентный риск).

Каждый из товаров, являющихся базовым активом ПФИ, имеет свой идентификатор, например:

- ✓ **BRO** нефть сорта Brent
- ✓ **SLV** серебро
- ✓ **SRG** сахар-сырец и т.п.

Поэтому модуль уже поддерживает идентификацию товаров, являющихся базовым активом ПФИ.

Если Вам необходимо подсчитать Товарный риск по спот-позиции в товаре или товаре, находящемся в залоге, то можно использовать данные идентификаторы. Надо ввести идентификатор товара и размер стоимости позиции в товаре.

Для тех случаев, когда необходимо рассчитать товарный риск по другому виду товара, следует использовать вспомогательный файл **CustomShares**.

Во вспомогательном файле **CustomShares** Вам следует заполнить три первых поля таблицы:

- ✓ **ISIN** краткий идентификатор инструмента (обязательно)
- ✓ **FinToolType** тип инструмента (обязательно, выбор из заданного списка)
- ✓ **ShortName** краткое наименование (не обязательно)

В поле **ISIN** надо заполнить код, который потом Вы будете использовать на листе «**Состав портфеля**» для описания товара. В поле **FinToolType** заполняете «**Товар**», чтобы при расчете для данного инструмента рассчитывался исключительно Товарный риск.

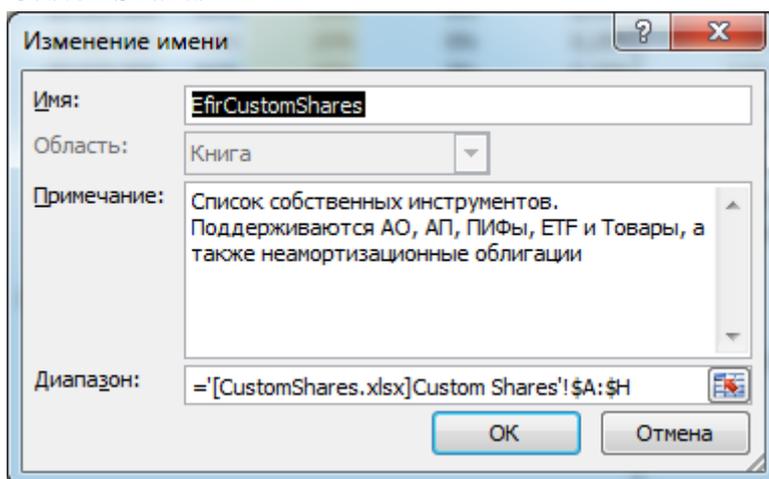
Название, которое Вы заполните в поле **ShortName**, отобразится на листе «**Состав портфеля**» в поле «Краткое наименование инструмента». В расчете оно не участвует, но делает проще визуальное восприятие таблицы.

## Пример заполнения товаров:

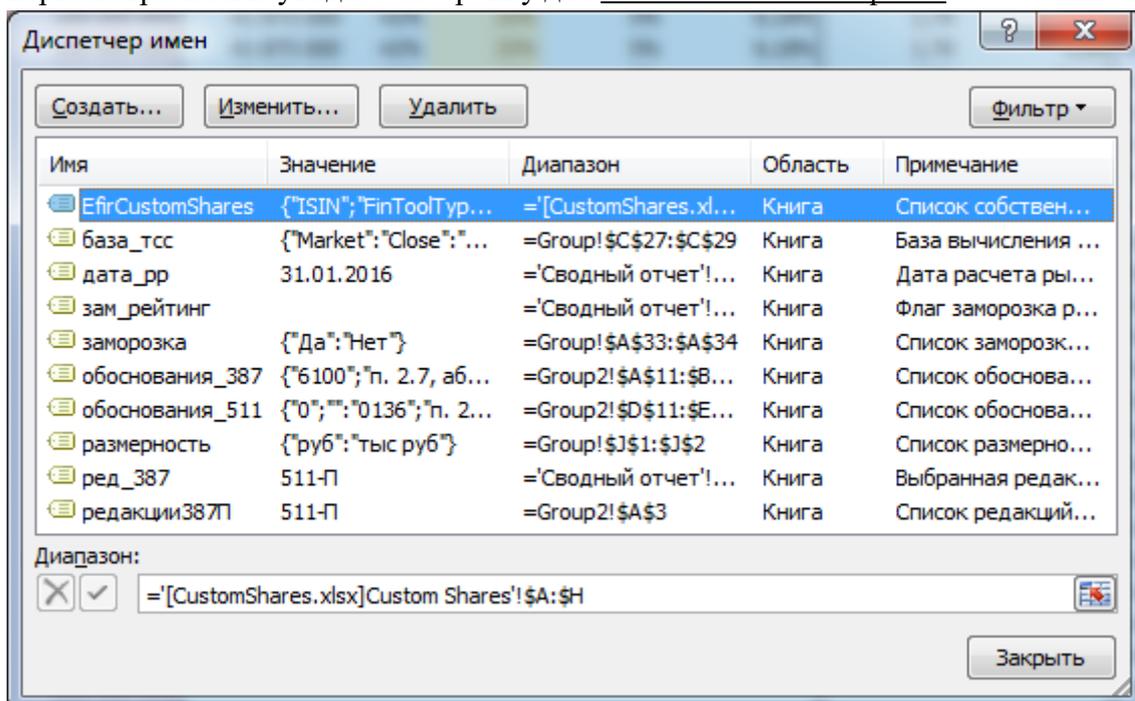
ISIN	FinToolType	ShortName
WTI	Товар	Нефть (custom)
FO380	Товар	Singapore Fuel Oil 380cst

Для того, чтобы данные из вспомогательного файла были использованы при расчете, следует задать путь к вспомогательному файлу и диапазон полей в настройках модуля. Для этого:

1. В главном меню Excel выбираем раздел **«Формулы»** и далее **«Диспетчер имен»**.
2. В открывшейся форме **«Диспетчер имен»** нажимаем кнопку **«Создать»**.
3. Далее в новом окне **«Создание имени»** задаем параметры вспомогательного файла **CustomShares**



- в поле **«Имя»** задаем *EfirCustomShares*
  - для задания поля **«Диапазон»** предварительно необходимо, чтобы был открыт файл CustomShares. Надо нажать кнопку справа поля **«Диапазон»**, перейти в файл CustomShares и выбрать диапазон столбцов **А:Н**.
4. Далее нажимаем **«ОК»** и возвращаемся в форму **«Диспетчер имен»**, в котором в первой строчке Вы увидите настройку для Вспомогательного файла



5. Нажимаем кнопку **«Закреть»** и далее на листе **«Состав портфеля»** можно задавать товары, которые Вы указали во Вспомогательном файле.