



# Инструкция по работе с сервисом



## Оглавление

| 1.    | Замечания и предупреждения                          | 3  |
|-------|---|----|
| 2.    | Подготовка входных данных («input», «input2», файлы |    |
| специ | ального депозитария, «input_sd», «input_154»)       | 3  |
| 3.    | Файл-шаблон «portfolio»                             | 6  |
| 4.    | Файл-шаблон «4060-и»                                | 7  |
| 5.    | Файл-шаблон «affiliate»                             | 13 |
| 6.    | Файл-шаблон «findactive»                            | 14 |
| 7.    | Файл-шаблон «fiduciary»                             | 18 |
| 8.    | Файл-шаблон «TSS»                                   | 21 |
| 9.    | Файл-шаблон «insurstresstest»                       | 23 |
| 10.   | Файл-шаблон «limits»                                | 28 |
| 11.   | Файл-шаблон «wishlist»                              | 30 |
| 12.   | Файл-шаблон «payment»                               | 31 |
| 13.   | Файл-шаблон «forms»                                 | 32 |
| 14.   | Файл-шаблон «formsRM»                               | 33 |
| 15.   | Файл-шаблон «isins»                                 | 34 |
| 16.   | Файл-шаблон «OR»                                    | 35 |
| 17.   | Файл-шаблон «VLA»                                   | 37 |
| 18.   | Файл-шаблон «portfolio_limits»                      | 38 |
| 19.   | Файл-шаблон «portfolio _limits_2»                   | 41 |
| 20.   | Файл-шаблон «input_154»                             | 44 |
| 21.   | Файл-шаблон «511р»                                  | 49 |

### 1. Замечания и предупреждения

#### Перед началом работы внимательно прочтите инструкцию.

#### Обязательные условия работы с шаблонами:

- В предложенных шаблонах не переименовывать страницы, не добавлять столбцы и не менять их местами;
- Не изменять имена предложенных шаблонов;
- Хранить все шаблоны в одной папке (наименование и расположение папки может быть любым).
- 2. Подготовка входных данных («input», «input2», файлы специального депозитария, «input\_sd», «input\_154»)

Для работы с продуктом нужно заполнить входными данными один из файлов:

- А. «input» внесение данных в ручном режиме;
- В. «input2» заполнение данных по отчетной форме (мэтчинг полей отчетной формы и входных данных, необходимых для шаблонов RU Data), а также заполнение данных по ПИФ (если они не входят в отчетную форму);
- С. Файлы специального депозитария подготовка данных в установленном формате (опционально продукт может быть настроен под другие форматы данных);
- D. «input\_154» (только для страховых организаций) заполнение данных по отчетной форме (мэтчинг полей отчетной формы и входных данных, необходимых для шаблонов RU Data);
- E. «input\_sd» (только для клиентов, с которыми настраивали работу в данном файле) заполнение данных по отчетной форме спец. депозитария (мэтчинг полей отчетной формы и входных данных, необходимых для шаблонов RU Data), а также заполнение данных по ПИФ (если они не входят в отчетную форму). Инструкция по работе описывается на листе «Порядок работы».

Замечание: «input», «input2» рекомендуем использовать для НПФ и ПУРЦБ для всех задач и ролей, для страховых организаций для всех задач, кроме оценки фин. рисков. «input\_154» рекомендуется использовать для страховых организаций для оценки финансовых рисков и формирования отчетных форм по активам с учетом рисков.

#### А.1. Открываем файл «input» и заполняем листы:

- «Общий» внести Дату, ИНН компании, наименование, тип компании;
   Замечание: Тип компании влияет на классификатор типа актива: для СК выведен свой
- *справочник, для НПФ свой.* • «ЦБ» – внести данные по ценным бумагам: ISIN, количество, стоимость бумаг по бухгалтерскому учету компании, тип учета (FV – справедливая стоимость, AC –
- бухгалтерскому учету компании, тип учета (FV справедливая стоимость, AC амортизированная стоимость), портфель (наименование или кодовый номер портфеля), ПИФ (код фонда, в который входит актив, если актив является частью ПИФ);
- «банковские+ДЗ+КЗ» внести данные по «нерыночным» вложениям (депозиты, наличные, задолженности, имущество): код (любой уникальный идентификатор актива, позволяющий отличить один актив от другого), количество и стоимость бумаг по бухгалтерскому учету компании, тип учета (FV – справедливая стоимость, AC – амортизированная стоимость), дата погашения (дата завершения договора – важна для заполнения, например, стресс-тестов), ИНН банка или иного контрагента, выбрать тип

инструмента по классификации (см. выпадающий список в примере- голубая ячейка после выбора типа на листе «Общий»), портфель (наименование или кодовый номер портфеля), ПИФ (код фонда, в который входит актив, если актив является частью ПИФ), дата покупки/открытия (дата влияющая на заморозку рейтингов (до 17.02.22 применяется заморозка)).

| М     | N         |      | 0         | P        | Q        | R     | S          | Т        | U           | V           | W          | Х        | Y        | Z        | AA      |      | AB      | AC      | AD          | AE      | AF        | AG       | AH           | AI         | AJ        |
|-------|-----------|------|-----------|----------|----------|-------|------------|----------|-------------|-------------|------------|----------|----------|----------|---------|------|---------|---------|-------------|---------|-----------|----------|--------------|------------|-----------|
| Эмите | нт Дата о | откр | Ставка де | Сумма от | н Страна | OLDH  | ID контраг | ID актив | а Доля в РЗ | Процентна ( | тоимость / | доходнос | Рубледни | Мод. дюр | Условия | д Да | та поку | Задолже | ен Суброгац | ци R2 ( | сумма отн | Курс к р | ублю на дату | открытия,  | цепозита  |
| _     |           |      |           |          |          |       |            | _        |             |             |            |          |          |          |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            | _         |
| 4     | Α         |      | В         |          | C        |       | D          |          | KON.        |             | VO7        | RO       | 0        | тоим     |         |      | AC/5    | V I     | Doordo      |         | ПИФ       |          |              | / <b>₼</b> |           |
| 0     | іязат     | Да   | та расче  | ета      | 30.04    | .2019 |            |          | код         |             | NUI        | -60      |          |          | JUID    |      | AC/F    | · v     | τορτφε      | UD.     | ΠΛΙΨ      | ,        | типтол       | Ψληνι      |           |
| н     | обязат    | ИН   | н         |          | 77077    | 77077 |            |          | RU000A      | 101Y18      |            |          | 1        |          | 10      | 000  | FV      |         | пн          |         |           |          | юл           |            |           |
| н     | обязат    | На   | именов    | ание Н   | ПФ Хоро  | оший  |            |          | RU000A      | 100436      |            |          | 1        |          | 10      | 000  | FV      | 1       | пн          |         |           |          | ЮЛ           |            |           |
| 0     | іязат     | Тиг  | 1         | H        | ΙΠΦ      |       |            |          | RU000A      | 100YW8      | 3          |          | 1        |          | 10      | 000  | FV      |         | пн          |         |           |          | юл           |            |           |
| -     |           |      |           |          |          |       |            |          | RU000A      | OZYDQ       | L          |          | 1        |          | 2321    | 133  | FV      | 1       | пн          |         |           |          | юл           |            |           |
|       |           |      |           |          |          |       |            |          | RU0004      | A100DZ      | 5          |          | 1        |          | 10      | 000  | FV      |         | пн          |         |           |          | юл           |            |           |
|       |           |      |           |          |          |       |            |          |             |             |            |          |          |          |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            |           |
| 4     | Þ         |      | Общий     | і ба     | нковские | +ДЗ+К | з ЦБ       |          |             |             |            |          |          |          |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            |           |
| код   |           |      | B         | алюта    | кол-во   | стои  | мость      | AC/FV    | ДАТА П      | огашени     | я и        | инн      | тип      | Порт     | фель Г  | ηυφ  | C       | рок дос | рочного р   | растор  | жения д   | іля депо | озита (дней  | і) Ти      | т ЮЛ/ФЛ/И |
| Депо  | зит       |      | R         | UB       | 1        | 1 1   | 1202274,82 | FV       |             |             | 7744       | 001497   | Депозит  | ы ПН     |         |      |         |         |             |         |           |          |              | 5 Ю        | 1         |
|       |           |      |           |          |          |       |            |          |             |             |            |          |          | •        |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            |           |
|       |           |      |           |          |          |       |            |          |             |             |            |          |          |          |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            |           |
|       |           |      |           |          |          |       |            |          |             |             |            |          |          |          |         |      |         |         |             |         |           |          |              |            |           |

Поле «Портфель» используется для стресс-тестирования (оценка рисков) НПФ и для контроля инвестиционных ограничений для всех организаций.

#### А. 2. Сохраняем и закрываем файл «input».

#### **В. 1.** Открываем файл «input2» и:

- 1. На лист «Общий» занести дату (ячейка С1), параметры организации в ячейках С2-С4 (обязательно только для НПФ);
- 2. Провести сопоставление полей отчетности или выгрузки из GAMA с «input2», а именно:
  - наименования столбцов для нерыночных инструментов F2-O2;
  - наименования столбцов для рыночных инструментов F5-K5;
  - имя листа, из которого копируем F7;
  - номер значащей строки и столбца F9 и F10.
- 3. Заполнить лист «ПИФ» (если есть ПИФы в портфеле), раскрыв информацию о составе:
  - заполнить A-I;

• Ј выбрать из выпадающего списка.

Замечание: для рыночных инструментов не заполнять столбцы В, F, G, H. Макрос по столбцу Н различает рыночный инструмент или нет

- 4. Нажать кнопку «Сформировать данные»;
- 5. Нажать кнопку «Разнести ПИФ» (если есть ПИФы в портфеле и заполнялся лист «ПИФ»).

#### В. 2. Сохраняем и закрываем файл «input2»;

### С.1. Используем подготовленный файл специального депозитария в следующем формате:

| Л | ист   | «Банков               | ские+)                           | <b>ЦЗ+КЗ</b> | \$≫ 3                                 | аполн      | яетс   | Я         | В    | сле                | дующ                        | ем формате:                            |
|---|---|-----------------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|------------|--------|-----------|------|--------------------|-----------------------------|--|
| 4 | A   | в                     | с                                | D            | E                                     | F          | G      | н         | I.   | J                  | к                           | L                                      |
| 1 | Наименование кредитной<br>организации (Брокерс 🔻  | Номер банковокого очк | Сумма денежных<br>оредоть (руб 🔝 | Количеотво   | Краткое наименование<br>организации 🗸 | код 🖵      | ВАЛЮТ. | стоимост  | ACIF | ДАТА<br>ПОГАШЕНИ 👻 | ИНН Банка<br>(контрагента 🛩 | Класс активов                          |
| 2 | 1   | 2                     | 3                                | 4            | 5                                     | 6          | 7      | 8         | 9    | 10                 | 11                          | 12                                     |
| 3 | Общество с<br>ограниченной<br>ответственностью<br>"Инвестиционная<br>компания "Гелиус<br>Капитал" | 171204/1              | 57 128,63                        | 4<br>83 1    | ООО "ИК "Гелиус<br>Капитал"           | 7707583536 | RUR    | 57 128,63 | FV   |                    | 7707583536                  | Денежные средства на брокерских очетах |

• Лист «ЦБ», ячейки «В2»-«В5»: наименование фонда, ИНН, Тип портфеля (Резервы, Накопления, РОПС, СР), столбцы «А»-«К»:

| Данные фонда для стресс-тестирования (4060-У) |   |  |                                      |                          |      |                        |               |         |                             |       |  |  |
|---|---|--|--------------------------------------|--------------------------|------|------------------------|---------------|---------|-----------------------------|-------|--|--|
| Фонд  | ΗΠΦ   |  |                                      |                          |      |                        |               |         |                             |       |  |  |
| ИНН НПФ                                       | 7728329636                                    |  |                                      |                          |      |                        |               |         |                             |       |  |  |
| Тип портфеля                                  | Резервы                                       |  |                                      |                          |      |                        |               |         |                             |       |  |  |
| Дата расчета                                  | 30.06.2019                                    |  |                                      |                          |      |                        |               |         |                             |       |  |  |
| Краткое<br>наименовани<br>е класса            | Полное наименование класса<br>актива          | Наименование<br>эмитента ценных<br>бумаг | Гос. рег. номер<br>(ОГРН) выпуска ЦБ | Категория<br>(тип) акции | Вал. | Рыночная цена<br>(руб) | ISIN          | Кол-во  | Рыночная<br>стоимость (руб) | AC/FV |  |  |
| 1   | 2   | 3  | 4                                    | 5                        | 6    | 7                      | 8             | 9       | 10                          | 11    |  |  |
| Облигации<br>корпоративные                    | Облигации российских<br>хозяйственных обществ | Сбербанк ПАО                             | 4B020301481B001P                     |                          | RUR  | 1 010,0000             | RU000A0ZYBS1  | 200 000 | 205 464 000,00              | FV    |  |  |
| FIIE Pro                                      | Государственные ШБ                            | Минфин России                            | 26205RMES                            |                          | RUR  | 1 007 8300             | R11000401RE07 | 220 250 | 225 368 610 00              | FV/   |  |  |
| L 🕨   | ЦБ Банк+Д3+К3 Коммен                          | гарий 🕘                                  |                                      |                          |      | E                      |               |         |                             |       |  |  |

#### C.2. Сохраняем данный файл. При запуске «config» и шаблонов он должен быть закрыт.

#### D.1. Открываем файл «input\_154» и:

Проходим полный набор шагов согласно инструкции к шаблону, либо подготавливаем «укороченный» input (для оценки рисков без формирования отчетности):

- На лист «Общий» занести дату (ячейка C1), параметры организации в ячейках C2-C4 (не обязательно);
- Заполнить лист «ЦБ»;
- Заполнить лист «банковские+ДЗ+КЗ»;
- D.2. Сохраняем данный файл. Если работаете с «config», то этот файл должен быть закрыт.

## 3. Файл-шаблон «portfolio»

Файл «**portfolio**» применяется для импорта входных данных, создания общего портфеля и выгрузки информации из базы данных RU Data. Данный шаблон является первым шаблоном при выполнении любой цепочки задач.

Если **«portfolio»** уже заполнен, его можно не заполнять повторно. В этом случае файле **«config»** нужно указать «Да» в поле «Портфель уже заполнен?» и нажать кнопку «Открыть portfolio».

a) Нажать кнопку «Import» и выбрать файл с входными данными («input», «input2», файлы спец. депозитария, input154 – см п. «Подготовка входных данных»). После этого будет загружен и агрегирован портфель из файла «input» и выгружена информация по ценным бумагам и контрагентам. Этот портфель отразится на листе «Portf»:

| A<br>Import | 8      | c         |            |
|-------------|--------|-----------|------------|
| код         | кол-во | стоимость | <b>A</b> 1 |
|             |        |           |            |
| <           | Portf  | ИС        | ÷          |

**б) В следующем окне нажать «нет»,** если данные загружаются не из файла Спец. депозитария установленного образца – см п. «Подготовка входных данных». Иначе – нажать «да»;

| Определите тип входного файла                               | × |
|---|---|
| Данные загружаются из стандартизированного файла спец депа? |   |
| Да Нет  |   |

**в)** На листе «Portf» реализуется предварительный контроль портфеля – в поле «Дата погашения» (столбец «AA») красной заливкой будут помечены инструменты, дата погашения которых раньше даты расчета. Кроме того, в столбце «В» пустые или нулевые ячейки также будут закрашены красным цветом (предполагаем, что количество не должно быть нулевым). Оба контроля несут информационный характер;

**г) На листе** «**ИС**» можно отслеживать структуру текущего портфеля и сопоставлять его со структурой по инвестиционной стратегии компании. Для этого в строки «B30»-«B53» необходимо внести данные стратегии;

Если данные при обновлении листа с портфелем не обновились, то нажмите «F9». Если первая загрузка, то нажать кнопку «обновить».

Замечание: Если необходимо отслеживать данные в разбивке по портфелям, то нужно воспользоваться ролью «управляющий активами» и работать с шаблоном «limits» или «portfolio\_limits» и «portfolio\_limit2» в зависимости от типа Вашей организации. д) На листе «Анализ» можно произвести сопоставление текущего Portfolio с рассчитанным ранее или с тестовым портфелем;

Замечание: Остальные вкладки шаблона носят служебный характер.

#### 4. Файл-шаблон «4060-и»

Шаблон для подготовки данных для заполнения файлов стресс-тестирования НПФ от Банка России согласно указанию 4060-У.

После завершения загрузки будут доступны следующие данные на листах:

«Input data» – данные для копирования в файл «Bonds» (модель стресс-теста Банка России) на аналогичный лист.

«InpFlows» – данные для копирования в файл «Bonds» (модель стресс-теста Банка России) на аналогичный лист, а данные для бумаг с индексируемым номиналом и флоутеров – для загрузки на лист «Floaters» (модель стресс-теста Банка России).

«Assets» – данные для копирования в файл «Модель» (модель стресс-теста Банка России) на аналогичный лист.

а) На листе «Portf» нажать «Заполнить»:



После нажатия кнопки синхронизируются данные из ранее заполненного файла «**portfolio**» и подгружаются дополнительные данные.

б) На листе «Исключенные (погашенные)» отобразятся погашенные на дату расчета инструменты (они исключены из расчета данных для стресс-теста);

в) **На листе «Номера выпусков»** нажать «Заполнить» для идентификации выпусков, имеющихся в портфеле:



#### г) Далее на листе «Input data» нажать «Заполнить»:

| Α          | B            | С                   | D                   | E   | F      | G       | н          | 1            | J              | к                     | L                | м                                     | N    |           |
|------------|--------------|---------------------|---------------------|-----|--------|---------|------------|--------------|----------------|-----------------------|------------------|---------------------------------------|------|-----------|
| ID Эмиссии | Код          | Гос. Регистрационны | Наименование Актива | ИНН | Валюта | Номинал | Непогашени | Периодичност | Дата погашения | Дата ближайшей оферты | Плавающая ставка | До погашения 0, по справ. Стоимости 1 | Цена | 1         |
|            |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      | Заполнить |
|            |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      |           |
|            |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      | _         |
|            |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      |           |
|            |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      |           |
| ()         |              |                     |                     |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      |           |
| 1 D        | Portf Homepa | выпусков Input data | InpFlows (+)        |     |        |         |            |              |                |                       |                  |                                       |      | 4         |

Данные портфеля перестроятся в формате файла стресс-теста от Банка России.

#### Также существует возможность выбрать в ячейке U1, какой вид оферты будет учитываться.

| Заполнить | Оферта | Любая |  |  | 0     | О - оферта с возможностью дальнейшего обращения облигаций по требованию владельцев |
|-----------|--------|-------|--|--|-------|--|
|           |        |       |  |  | Любая | М - досрочное погашение облигаций по праву эмитента                                |
|           |        |       |  |  |       | N - досрочное погашение облигаций по требованию владельцев                         |
|           |        |       |  |  |       | А - досрочный выкуп облигаций по соглашению с их владельцами                       |
|           |        |       |  |  |       | К - выкуп РЕПО   |
|           |        |       |  |  |       | V - досрочное погашение ковенант   |
|           |        |       |  |  |       | L - Саll опцион на период  |
|           |        |       |  |  |       | С - Call-опцион  |

#### д) Далее на листе «InpFlows» нажать «GetTimeTable»:

| в              | с   | D     | E            | F                  |
|----------------|---|-------|--------------|--------------------|
|                | KOД, RU0007252813, RU0007775219, RU000A0DQZE3, RU00       |       |              |                    |
|                | 0A0JNYN1, RU000A0JQ7Z2, RU000A0JQAL8, RU000A0JQK64,       |       |              |                    |
| ISINs:         | RU000A0JQK72,RU000A0JQRD9,RU000A0JRHF3,RU000A0J           |       |              |                    |
|                | RVN8, RU000A0JS6M0, RU000A0JSGV0, RU000A0JSMA2, RU        |       |              |                    |
|                | 000A0ISO58 PU000A0IT2K2 PU000A0IT682 PU000A0IT94          |       |              |                    |
| Event types:   | CPN, MTY  |       |              |                    |
| Fields:        | EventDate, ID, Value, EventType, TypeOperation, Pay1Bond, |       |              |                    |
| rielus.        | FaceFTName  |       | GetTimeTable |                    |
| Show Defaults: | ложь  |       |              |                    |
| Start date:    | 30.04.2019  |       |              |                    |
| End date:      |   |       |              |                    |
|                |   |       |              |                    |
| EventDate .    | ID _1   | Value | EventType    | TypeOperation 💌 Pa |
| 11.05.201      | RU000A0JNYN1  |       | 6 CPN        | Фиксированный      |
| 11.12.201      | RU000A0JNYN1  |       | 6 CPN        | Фиксированный      |
| 1              |   | ~     |              | ×                  |
| і 🔰 Номера вы  | пусков Input data InpFlows                                | (+)   |              |                    |

(календари событий по портфельным инструментам загрузятся из базы данных RU Data)

| I.        | J | К         | 0       | P    | Q       | R            | S         | т     |
|-----------|---|-----------|---------|------|---------|--------------|-----------|-------|
|           |   |           | ID      | ISIN | Эмитент | Дата выплаты | Ставка    | Сумм  |
|           |   |           | Эмиссии |      |         |              | купона, % | купон |
|           |   | Заполнить |         |      |         |              | годовых   |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
|           |   |           |         |      |         |              |           |       |
| _         |   |           |         |      |         |              |           |       |
| Payment A |   |           |         |      |         |              |           |       |
| 29,92     |   |           |         |      |         |              |           |       |
| 30,08     |   |           |         |      |         |              |           |       |

#### И затем нажать «Заполнить»:

Данные портфеля перестроятся в формате файла стресс-теста от Банка России.

Замечание: Для флоутеров (поле «Плавающая ставка» =1) выгружается комментарий, от чего зависит изменяющийся показатель и номер текущего купона.

| 0       | P              | Q               | R            | S         | т      | U         | v     | W          | X      | Y              | Z   | AA                                   | AB       | 0  |
|---------|----------------|-----------------|--------------|-----------|--------|-----------|-------|------------|--------|----------------|---|--------------------------------------|----------|----|
| D       | ISIN           | Эмитент         | Дата выплаты | Ставка    | Сумма  | Погашение | Итого | Код потока | 1      |                |   |                                      |          | П  |
| эмиссии |                |                 |              | купона, % | купона | номинала  | поток |            | Плавак |                |   |                                      | номер    | 11 |
|         |                |                 |              | годовых   |        |           |       |            | щая    | Индекс номинал | Выпуск  | От чего зависит флоутер              | текущего | n  |
|         |                |                 |              |           |        |           |       |            | ставка |                |   |                                      | купона   | ٩  |
| -       | -              |                 | · •          | -         | -      | -         | -     |            | · •    | 5              | , and a second se | ſ                                    |          | E  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 17.05.2019   | 0,085     | 42,38  | 0         | 42,38 | 46-43633   | 1      |                | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            | 11       |    |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 16.12.2019   | 0,085     | 43,63  | 0         | 43,63 | 46-43815   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | Π  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 15.06.2020   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-43997   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | Π  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 14.12.2020   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-44179   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | Π  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 14.05.2021   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-44361   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | Π  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 13.12.2021   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-44543   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | Π  |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 13.06.2022   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-44725   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          |    |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 12.12.2022   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-44907   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          |    |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 12.06.2023   | 0         | 0      | 0         | 0     | 46-45089   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          |    |
| 46      | RU000A0JUCR3   | Роснефть НК     | 11.12.2023   | 0         | 0      | 1000      | 1000  | 46-45271   | 1      | 0              | Роснефть-6-боб  | Ставку определяет эмитент            |          |    |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 17.05.2019   | 0,085     | 42,38  | 0         | 42,38 | 45-43633   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            | 11       | Π  |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 16.12.2019   | 0,085     | 43,63  | 0         | 43,63 | 45-43815   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | П  |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 15.06.2020   | 0         | 0      | 0         | 0     | 45-43997   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | П  |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 14.12.2020   | 0         | 0      | 0         | 0     | 45-44179   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | П  |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 14.05.2021   | 0         | 0      | 0         | 0     | 45-44361   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | П  |
| 45      | RU000A0JUCS1   | Роснефть НК     | 13.12.2021   | 0         | 0      | 0         | 0     | 45-44543   | 1      | 0              | Роснефть-5-боб  | Ставку определяет эмитент            |          | П  |
|         | 00000000000000 | Description 100 | 42.05.2022   |           |        |           |       | 45 44775   |        |                | Designed and C. C. C.   | Contract of the second second second |          | н  |

Для бумаг с индексируемым номиналом введен признак «Индекс номинал». Выстраивание потоков по флоутерам в зависимости от сценария Банка России ведется в **файле «Bonds**» с моделью стресс-теста Банка России. В столбце «АА» показано, от чего зависит ставка.

Замечание: если по каким-то флоутерам не найдена информация о зависимости ставки (признак «Н/Д»), то ее необходимо найти в эмиссионных документах при помощи web-портала rudata.info, наведя курсор на код инструмента и нажав кнопку «RU Data» в меню надстройки «INTERFAX»:

| B   | ставка Ра              | змет | гка с   | траницы 🛛     | Формулы 🗼     | Данные    | Реценз | вировани | e Bi | д Разработч | чик На  | адстройки  | INTERFA  | Х Команда  | ♀ Помощн       | Елена Ма | <b>Д</b> Общий доступ |
|-----|------------------------|------|---------|---------------|---------------|-----------|--------|----------|------|-------------|---------|------------|----------|------------|----------------|----------|-----------------------|
|     |                        |      |         | ٩             |               | 9         |        |          |      | fx fx       | : f.    | fx fx      | fx       | =          | 2              |          |                       |
| нал | Рыночны                | ый   | Сг      | правочники    | и Событи:     | я Выгрузи | сии М  | OEX RL   | )-   | Риски Рейти | нги ЭФ  | ИР RU Data | а Другие | Надстройки | Операции       | Открыть  |                       |
|     | риск *                 |      | клас    | ссификатор    | ы≁ т          | анали     | 3 *    | * Pric   | e *  | * *         |         | · •        | *        | Ŧ          | Ť              |          |                       |
|     | Шаблон                 | ы    |         |               | Дан           | ные       |        |          |      |             | Функі   | ции        |          | Надстройки |                | RU Data  |                       |
|     |                        |      |         |               |               |           |        |          |      |             |         |            |          |            |                |          |                       |
|     | X                      | /    | $f_{x}$ | =Refer        | enceParan     | ns(P24;"i | sincod | e")      |      |             |         |            |          |            |                |          |                       |
|     |                        |      |         |               |               |           |        |          |      |             |         |            |          |            |                |          |                       |
|     | K                      | 0    |         | P             | Q             | R         |        | S        | т    | U           | V       | W          | X        | Y          | Z              |          | AA                    |
| RU  | DOOAODOG29             |      | 35 F    | RU000A0D0G29  | Минфин РФ     | 26.0      | 8.2020 | 0,065    | 11,3 | 4 0         | 11,34   | 35-44069   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DOOAODOG29             |      | 35 F    | RU000A0D0G29  | Минфин РФ     | 27.0      | 5.2020 | 0,065    | 11,3 | 4 0         | 11,34   | 35-43978   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DOOAODOG29             |      | 35 F    | RU000A0D0G29  | Минфин РФ     | 26.0      | 2.2020 | 0,065    | 11,3 | 4 0         | 11,34   | 35-43887   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DOOAODOG29             |      | 35 F    | RU000A0D0G29  | Минфин РФ     | 27.1      | 1.2019 | 6,500%   | 16,2 | 1 300       | 316,21  | 35-43796   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DODAOJREQ7             |      | 31 6    | RU000A0JREQ7  | Минфин РФ     | 14.0      | 4.2021 | 7,600%   | 37,  | 9 1000      | 1037,9  | 31-44300   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DODAOJREQ7             |      | 31 6    | RU000A0JREQ7  | Минфин РФ     | 14.1      | 0.2020 | 7,600%   | 37,  | 9 0         | 37,9    | 31-44118   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DODAOJREQ7             |      | 31 6    | RU000A0JREQ7  | Минфин РФ     | 15.0      | 4.2020 | 7,600%   | 37,  | 9 0         | 37,9    | 31-43936   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DODAOJREQ7             |      | 31 6    | RU000A0JREQ7  | Минфин РФ     | 16.1      | 0.2019 | 7,600%   | 37,  | 9 0         | 37,9    | 31-43754   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DOOAOJRK22             |      | 55 F    | RU000A0JRK22  | Нефтегазхолди | кнг 04.0  | 6.2021 | 0,000%   |      | 0 700       | 700     | 55-44351   | 1        |            | 0 Нефтегазхоли | цинг     | #н/д                  |
| RU  | DOUAUJRK22             |      | 55 1    | RUUUUAUJRK22  | нефтегазхолди | (HF 04.1  | 2.2020 | 0,000%   |      | 0 100       | 100     | 55-44169   | 1        |            | 0 нефтегазхолд | цинг     | #н/д                  |
| RU  | DOUAUJRK22             |      | 55 1    | RUUUUAUJRK22  | нефтегазхолди | (HF 05.0  | 5.2020 | 0,000%   |      | 0 100       | 100     | 55-43987   | 1        |            | 0 нефтегазхолд | цинг     | #н/д                  |
| RU  | DOUAUJRK22             |      | 55 1    | RUUUUAUJRK22  | нефтегазхолди | (HF 06.1  | 2.2019 | /0,000%  | 49,8 | 5 100       | 149,86  | 55-43805   | 1        |            | 0 нефтегазхолд | цинг     | #н/д                  |
| RU  | DODADJRVNB             |      | 41 1    | RUUUUAUJRVNB  | PCXB          | 26.1      | 0.2021 | 10,000%  | 49,8 | 6 1000      | 1049,86 | 41-44495   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | DODAUJKVNS             |      | 41 1    | RUUUUUAUJRVNB | PCXB          | 27.0      | 4.2021 | 10,000%  | 49,8 | 6 U         | 49,85   | 41-44515   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | ODAOJKVNS<br>ODAOJDVNS |      | 41 1    | RUUUUUAUJRVNB | PCAD          | 27.1      | 4.2020 | 20,000%  | 49,8 |             | 49,86   | 41-44151   | 0        |            | 0              |          |                       |
| RU  | UUAUKVNS               | _    | 41 1    | RUUUUUAUJRVNB | PCAD          | 28.0      | 4.2020 | 8,000%   | 39,8 | 9 U         | 39,89   | 41-45949   | 0        |            | 0              |          |                       |
| No. | DODADIE OER            |      | 41 1    | RUUUUUAUIRVNB | PCAD<br>CAD   | 29.1      | 7 2027 | 0,000%   | 39,8 | 9 1000      | 39,89   | 41-45/6/   |          |            | 0 000 530      |          |                       |
| RU  | DOUAUISQ58             |      | 52 1    |               | CK EBC        | 21.0      | 1.2027 | 0,000%   |      | 1000        | 1000    | 52-40389   | 1        |            |                |          | #R/A                  |
| -   | 0000015058             | -    | 52 0    |               | CK EBC        | 20.0      | 7 2025 | 0.000%   |      | 0 0         |         | 52-46725   | 1        |            | 0 0000 EBC     |          | #H/A                  |

Предварительно необходимо пройти на портале авторизацию: в правом верхнем углу страницы нужно ввести логин и пароль (по кнопке «Личный кабинет»). Чтобы посмотреть необходимые показатели инструментов, достаточно ввести в строку поиска (в верхнем правом углу) любой идентификатор инструмента.

e) Далее на листе «Assets» нажать «Загрузить» и выбрать заполненный файл affiliate:

(Если заполненный файл affiliate открыт в этот момент на компьютере, то выбирать не надо файл и информация автоматически подтянется на лист «Assets»).

| Α         |    | В     | с               | D                |         | E                |     | F             | G         |           | н      |
|-----------|----|-------|-----------------|------------------|---------|------------------|-----|---------------|-----------|-----------|--------|
|           | 1  | 2     | 3               | 4                |         | Загрузить        | 5   | Открыть Bonds |           | 7         |        |
| -         |    |       |                 |                  |         |                  | _   |               |           |           |        |
| Дата      |    | тип   | нпф             | инн нпф          | Класс   |                  | код | н             | аименован | ие Актива | инн    |
|           | -  | -     | <b>T</b>        | <b>.</b>         |         | *                |     | <b>v</b>      |           | Ŧ         | -      |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           |    | 1     |                 |                  |         | 1                |     | 1             | Π         |           |        |
| - →       |    | F     | Portf Исклн     | оченные (погашен | ные)    | Номера выпус     | ков | Input data    | Inpf      | lows      | Assets |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| × ↑       | 1  | × Pa  | бочий стол > Н  | ПФ > НПФ тестова | я загру | зка 🗸            | Ö   | Лоиск:        | НПФ тес   | товая за  | гру    |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| чить 🔻    |    | Нова  | я папка         |                  |         |                  |     |               |           |           | •      |
| Drive - 0 | ^  | И     | мя              | ^                |         | Дата изменения   |     | Тип           |           | Размер    |        |
|           |    | ×     | Bonds_v.2.8 IF> | 4_2              |         | 12.07.2022 11:14 |     | Двоичный ли   | ист М     | 3 68      | 3 КБ   |
| компь     |    | x     | 🕆 4060-u        |                  |         | 12.07.2022 11:24 |     | Лист Microso  | ft Ex     | 8 50      | 5 КБ   |
| део       |    | X     | affiliate       |                  |         | 12.07.2022 11:13 |     | Лист Microso  | ft Ex     | 17        | 4 КБ   |
| кументь   |    | ×     | 🖥 input2        |                  |         | 06.07.2022 18:12 |     | Лист Microso  | ft Ex     | 1 96      | 6 КБ   |
| грузки    | а. | x     | portfolio       |                  |         | 11.07.2022 17:17 |     | Лист Microso  | ft Ex     | 33        | 3 КБ   |
| ображе    |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| зыка      |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| ъемные    |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| бочий с   |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| кальны    |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
| ,         |    | /     |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           | Ŧ  |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |
|           | ИN | ія фа | йла: affiliate  |                  |         |                  | ~   | Все файлы     |           |           | $\sim$ |
|           |    |       |                 |                  |         | Серви            | •   | Открыть       |           | Отмена    |        |
|           |    |       |                 |                  |         |                  |     |               |           |           |        |

ж) Для получения потоков данных нужно загрузить данные в файл «Bonds»:

|      | A  | В   | С          |        | D           |       | E           |     | F             | G                   | н      |
|------|----|-----|------------|--------|-------------|-------|-------------|-----|---------------|---------------------|--------|
|      | 1  | 2   |            | 3      | 4           |       |             | 5   |               | 7                   |        |
|      |    |     |            |        |             |       | Загрузить   |     | Открыть Bonds |                     |        |
| Дата |    | тип | ΗΠΦ        | инн нг | 1Φ          | класс |             | Ko  | од            | наименование Актива | инн    |
|      | Ψ. | Ŧ   |            | ¥      | ¥           |       |             | Ŧ   | -             | -                   | •      |
|      |    |     |            |        |             |       |             |     |               |                     |        |
|      |    |     |            |        |             |       |             | _   |               |                     |        |
|      |    |     |            |        |             |       |             |     |               |                     |        |
|      |    |     |            | _      |             |       |             |     |               |                     |        |
| -    | F. |     | Portf //Cr | люченн | ые (погашен | ные)  | Номера выпу | ско | в Input data  | a InpFlows          | Assets |

Открываем «Bonds» через нажатие кнопки «Открыть Bonds» (нужно выбрать последнюю версию файла «Bonds»).

з) В открывшемся **файле «Bonds»** в первую очередь нажать кнопку «Обновить сценарии по дате расчёта», а затем уже нажать кнопку «Копировать из RU Data»:

| Обновит<br>дат | бновить сценарии по<br>дате расчета |              | Копировать из RU Data |                          |                            |                              |                              | Обн<br>(1        | овит<br>посл |
|----------------|-------------------------------------|--------------|-----------------------|--------------------------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------|--------------|
| A              | В                                   | с            | D                     | E                        | F                          | G                            | н                            | I                |              |
|                | Копировате                          | из RU Data   | (                     | Обновить да<br>(после об | нные вкладк<br>новления на | и CF (offers)<br>жмите F9 дл | и протянуть<br>ія расчета фо | формулы<br>рмул) |              |
|                | Заполните яче                       | ики с желтой | заливкой              |                          |                            |                              |                              |                  |              |
|                | Номер кварта.                       | n: 1         | 2                     | 3                        | 4                          | 5                            | 6                            | 1.1              | 7            |
|                | Дата расчета                        | Даты для по  | олучения про          | гноза                    |                            |                              |                              |                  |              |
|                | 29.02.202                           | 0 31.03.2020 | 30.06.2020            | 30.09.2020               | 31.12.2020                 | 31.03.2021                   | 30.06.2021                   | 30.09.202        | 1 31.:       |
| 0043           | 5,719                               | 6 5,60%      | 5,39%                 | 5,37%                    | 6,88%                      | 7,09%                        | 7,36%                        | 7,359            | 6            |
| 043            | 6,119                               | 6,08%        | 5,86%                 | 5,83%                    | 7,69%                      | 8,12%                        | 8,63%                        | 8,70             | 6            |
| Y OΦ3          | 6,609                               | 6,75%        | 6,55%                 | 6,51%                    | 8,38%                      | 8,84%                        | 9,35%                        | 9,419            | 6            |
| USD            | 2,529                               | 6 2,29%      | 2,41%                 | 2,29%                    | 2,16%                      | 2,07%                        | 1,99%                        | 1,949            | 6            |
| USD            | 2,529                               | 6 2,29%      | 2,43%                 | 2,29%                    | 2,19%                      | 2,16%                        | 2,13%                        | 2,119            | 6            |
| DY USD         | 2,739                               | 6 2,55%      | 2,70%                 | 2,52%                    | 2,44%                      | 2,36%                        | 2,32%                        | 2,28             | 6            |
| •              | Start Inc                           | out data     | Input fl              | ows                      | Floaters                   | CEs EV                       | CEs /                        | AC P             | rices        |

и) После загрузки данных либо проверить, что все флоутеры (это и бумаги с индексируемым номиналом, и бумаги с плавающей ставкой) уже занесены на лист «Floaters» при прошлом расчете и пересчитаны к текущему сценарию (по F9), либо в ручном режиме скопировать из «4060-и» (лист «InputFlows») потоки на лист «Floaters» и в ручном режиме проставить формулы – зависимости от сценария и указанной.

Замечание: Примеры на все типовые прогнозы ставки и индексируемого номинала предоставляются Службой поддержки по запросу.

к) внести текущие данные сценария – голубые поля в столбце В (по ссылкам доступны источники данных, курсы подтягиваются автоматически по дате), дату расчета («Вб») и нажать кнопку «Обновить данные вкладки CF (offers) и протянуть формулы …» для расчета цены и потока:

| A       |   | 6       | В        | с            |             | -                  | -                            | -                                |                              |                   |            |     |
|---------|---|---------|----------|--------------|-------------|--------------------|------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------|------------|-----|
|         |   | Копи    | ровать   | из RU Data   | . (         | Обновить<br>(после | данные вкла,<br>обновления к | цки CF (offers)<br>кажмите F9 д/ | и протянуть<br>ля расчета фо | формулы<br>ормул) |            |     |
|         |   | Заполни | ите ячей | іки с желтой | заливкои    | 1                  |                              |                                  |                              |                   |            |     |
|         |   | Номер н | квартала | 1            | 2           |                    | 3                            | 4 5                              | 6                            | 7                 | 8          |     |
|         |   | Дата ра | счета    | Даты для по  | лучения про | гноза              |                              |                                  |                              |                   |            |     |
|         |   | 29.     | 02.2020  | 31.03.2020   | 30.06.2020  | 30.09.20           | 31.12.202                    | 0 31.03.2021                     | 30.06.2021                   | 30.09.2021        | 31,12,2021 | 31. |
| 2Y OΦ3  |   |         | 5,71%    | 5,60%        | 5,39%       | 5,3                | 7% 6,88                      | 6 7,09%                          | 7,36%                        | 7,35%             | 7,15%      |     |
| 5Y OΦ3  |   |         | 6,11%    | 6,08%        | 5,86%       | 5,8                | 3% 7,69                      | 6 8,12%                          | 8,63%                        | 8,70%             | 8,49%      |     |
| 10Y OΦ3 |   |         | 6,60%    | 6,75%        | 6,55%       | 6,5                | 1% 8,38                      | 6 8,84%                          | 9,35%                        | 9,41%             | 9,19%      |     |
| F       | S | tart    | Inpl     | ut data      | Input fl    | ows                | Floaters                     | CFs F\                           | / CFs                        | AC Pr             | ices FV    | Р   |

л) после расчета потоков и цены по сценарию Банка России **сохранить и закрыть файл «Bonds**» (если на вкладке потоков данные равны 0, нужно нажать «F9»).

м) в файле «4060-u» на листе «Assets» нажать кнопку «Загрузить из Bonds» и выбрать заполненный только что файл:

| 32 | AG<br>33  | <u>АН</u><br>34 | A1<br>33               | AJ<br>36  | Загрузить из Вагрузить из Воnds Gama | AL 38 |
|----|-----------|-----------------|------------------------|-----------|--------------------------------------|-------|
| -  | Pese<br>V | Pesep<br>•      | Входит в ПИФ? Название | Beta<br>T | Ţ                                    | 1     |
|    | t de      |                 | InpElows               | Accets    |                                      |       |

| S                           | Выбирете файл для импорта                           |  |
|-----------------------------|---|--|
| 🛞 🌛 👻 🕆 🔳 Рабочий стол →    | <ul> <li>Поиск: Рабочий стол</li> </ul>             | р<br>Вид Разработчик Справ   |
| Упорядочить 🔻 Создать папку | 8== - 🔟 (   | Условное форматирование ~  |
| Microsoft Excel             | Имя   | Стили ячеек ~  |
| 🔺 🚖 Избранное               | CneDrive<br>Вндекс Диск                             | Стили  |
| Рабочий стол Недавние места | 🜏 Домашняя группа                                   | •  |
| Имя файла:                  | <ul> <li>✓ &lt;</li> <li>Все файлы (*.*)</li> </ul> | <ul> <li>36 Barpysens to Barpysens to Garna</li> <li>37</li> </ul> |
|                             | Сервис - Открыть Отмена                             |  |
| 6<br>7                      |   |  |
| 2                           |   |  |
| Portf Исключенн             | ые (погашенные) Номера выпусков Input data InpFlow  | Assets для акции FV  |

н) после загрузки данных система выдаст сообщение «Для нерыночных инструментов рассчитать упрощенным методом?»



выбрать:

- «Да», если цена по нерыночным инструментам считается одной и той же до даты погашения, а после 0 (или до конца дат стресс-теста, если даты погашения нет);
- «Нет», если моделирование цены реализуется по своим методикам, например, в среде Gama (если выбран этот вариант, то затем нажимаем «Загрузить из Gama» для загрузки оценки цены для каждого квартала из Gama).

Замечание: Остальные вкладки шаблона носят служебный характер. Описание файла "Bonds" необходимо смотреть в инструкции к модели стресс-тестирования от Банка России.

## 5. Файл-шаблон «affiliate»

Шаблон для подготовки данных по связанным компаниям (группам компаний). Может быть использован для заполнения файлов стресс-тестирования от Банка России, а также для выстраивания лимитов на вложение в связаные структуры.

1)ОПЦИЯ: **на листе «Params»** можно задать включение одной группы в другую или выделение ветки из группы в самостоятельную группу. Это необходимо, если Ваша методология построения групп связанных лиц отличается от подхода, реализованного в продукте.

Для этого задается Текущий ИНН группы (слева) и новый ИНН (код) группы (справа) – то есть переопределяем группу и головную структуру.



2)Нажать «Заполнить» на вкладке «Portf»:

| А   | В      | С     | D        | E       | F       | G          | н | 1 | J        | К |
|-----|--------|-------|----------|---------|---------|------------|---|---|----------|---|
| инн | Группа | Имя   | Компания | Рейтинг | Рейтинг | ИНН Группы |   |   | Заполнит | ь |
|     |        |       |          |         |         |            |   |   |          |   |
|     |        |       |          |         |         |            |   |   |          |   |
| •   | Portf  | ( + ) |          |         |         |            |   |   |          |   |

В файле отобразятся наименования групп, признак головной компании (1), а также рейтинг материнской компании группы.

### 6. Файл-шаблон «findactive»

Шаблон для поиска альтернативных вложений и подготовки информации о приобретаемом активе.

a) Обновить дату таблицы с торговыми данными по Облигациям, нажав «Редактировать таблицу» на листе «Облигации»:



и установить требуемую дату (на которую осуществляется подбор):

| Поля официалы  | ных итогов МБ                              | $\times$ |
|----------------|--|----------|
| Торг. система: | (stock) Фондовый рынок и рынок депозитов   | ~        |
| Рынок:         | (shares) Рынок акций                       | ~        |
| Фильтр Поля    |  |          |
| Дата с: 🗹 20   | .05.2019                                   |          |
| Торг. режимы:  |  |          |
|                | Основной режим: А1-Акции и паи - безадрес. | ^        |

Замечание: Шаблон не поддерживает диапазон дат (результаты смешаются и могут задвоиться бумаги), необходимо выбрать «Дата с» равной «Дата по».

**в)** Для начала подбора **на листе** «**Критерии**» нужно указать стоимость размещения (ячейка C2), цену, на которую ориентируемся для расчета доходности (ячейка C3), а также отметить, считаем ли 100% цену от номинала, если выбранной для сопоставления цены нет на текущую дату по итогам текущих торгов:

|    | в                          | С            | D | E | F   | G   |
|----|----------------------------|--------------|---|---|---|-----|
| 1  | Дата                       | 14.10.2019   |   |   |   |     |
| 2  | Сумма для вложения, руб    | 2 000 000,00 | Π | - |   | . ~ |
| з  | Вид цены для сопоставления | Close        |   |   | Если нет выбранной цены, то 100% от<br>номинала | x   |
| 4  | Вид облигации              | ×            |   |   | Отрасль   |     |
| 5  | exchange_bond              |              |   |   | Автомобили и запчасти                           | X   |
| 6  | ofz_bond                   |              | - |   | Банки   | ×   |
| 7  | corporate_bond             |              |   |   | Горнодобыча                                     |     |
| 8  | subfederal_bond            | X            |   |   | Государственные                                 |     |
| 9  | ifi_bond                   |              |   |   | жкх   |     |
| 10 | cb_bond                    |              |   |   | Леспром, бумага                                 |     |
| 11 | municipal_bond             |              |   |   | Машиностроение                                  |     |
|    |                            |              |   |   | ]   |     |

Далее задать критерии подбора, выбрав из выпадающего меню «Х» для тех критериев, которые необходимо включить в подбор («отсев» облигаций):

|    | A   E               | 1       | C            | D | Е | F   | G |
|----|---------------------|---------|--------------|---|---|---|---|
| 1  | Дата                |         | 14.10.2019   |   |   |   |   |
| 2  | Сумма для вложения  | , руб   | 2 000 000,00 |   |   |   |   |
| 3  | Вид цены для сопост | авления | Close        |   |   | Если нет выбранной цены, то 100% от<br>номинала | x |
| 4  | Вид облигации       |         | х            |   |   | Отрасль   |   |
| 5  | exchange_bond       |         |              |   |   | Автомобили и запчасти                           | X |
| 6  | ofz_bond            |         | ,            | - |   | Банки   | X |
| 7  | corporate_bond      |         |              |   |   | Горнодобыча                                     |   |
| 8  | subfederal_bond     |         | A            |   |   | Государственные                                 |   |
| 9  | ifi_bond            |         |              |   |   | жкх   |   |
| 10 | cb_bond             |         |              |   |   | Леспром, бумага                                 |   |
| 11 | municipal_bond      |         |              |   |   | Машиностроение                                  |   |

В рейтингах можно выбирать вариант агрегации рейтингов (мин/макс и по шкале AGG\_N10 – для стресс-тестирования, AGG\_N26 – для более детального подбора). Для смены шкалы нужно нажать кнопку «Загрузить шкалу».

г) На листе «Порядок работы» указан порядок работы с файлом. При выполнении каждого пункта системой указывается число оставшихся после отбора бумаг, а идентификатором «Х» помечается пройденный этап:

Замечание: Хотя бы 1 критерий в каждой группе критериев должен быть указан.

|   | Порядок работы                                 |           |                 |                        |   |
|---|--|-----------|-----------------|------------------------|---|
|   |  |           | Кол-во<br>бумаг | Виды<br>проверок       |   |
| 1 | Обновить таблицу (дата) на листе               | Облигации | 1479            |                        |   |
| 2 | Задать критерии подбора на листе               | Критерии  |                 |                        |   |
| 3 | Выполнить первичный отбор и загрузить рейтинги | Подбор    | 133             | вид,<br>листинг,валюта | x |
| 4 | Загрузить цены                                 | Загрузка  | 62              | рейтинг                | x |
| 5 | Рассчитать доходность и дюрацию                | Расчет    | 17              | купон, отрасль         | х |
| 6 | Выполнить вторичный отбор                      | Результат | 4               | дюрация                | ノ |

## Для старта первичного подбора активов нужно нажать «Подбор»:

|   | Порядок работы                                 |           |                 |                        |   |
|---|--|-----------|-----------------|------------------------|---|
|   |  |           | Кол-во<br>бумаг | Виды<br>проверок       |   |
| 1 | Обновить таблицу (дата) на листе               | Облигации | 1479            |                        |   |
| 2 | Задать критерии подбора на листе               | Критерии  |                 |                        |   |
| 3 | Выполнить первичный отбор и загрузить рейтинги | Подбор    | 133             | вид,<br>листинг,валюта | x |
| 4 | Загрузить цены                                 | Загрузка  | 62              | рейтинг                | x |
| 5 | Рассчитать доходность и дюрацию                | Расчет    | 17              | купон, отрасль         | x |
| 6 | Выполнить вторичный отбор                      | Результат | 4               | дюрация                |   |

### д) Затем нажать «Загрузка» для продолжения фильтрации для подбора и выгрузки цены:

|   | Порядок работы                                 |           |                 |                        |   |  |
|---|--|-----------|-----------------|------------------------|---|--|
|   |  |           | Кол-во<br>бумаг | Виды<br>проверок       |   |  |
| 1 | Обновить таблицу (дата) на листе               | Облигации | 1479            |                        |   |  |
| 2 | Задать критерии подбора на листе               | Критерии  |                 |                        |   |  |
| 3 | Выполнить первичный отбор и загрузить рейтинги | Подбор    | 133             | вид,<br>листинг,валюта | x |  |
| 4 | Загрузить цены                                 | Загрузка  | 62              | рейтинг                | × |  |
| 5 | Рассчитать доходность и дюрацию                | Расчет    | 17              | купон, отрасль         | × |  |
| 6 | Выполнить вторичный отбор                      | Результат | 4               | дюрация                |   |  |

### е) нажать «Расчет» для проведения расчета дюрации и доходности:

|   | Порядок работы                                 |           |                 |                        |   |
|---|--|-----------|-----------------|------------------------|---|
|   |  |           | Кол-во<br>бумаг | Виды<br>проверок       |   |
| 1 | Обновить таблицу (дата) на листе               | Облигации | 1479            |                        |   |
| 2 | Задать критерии подбора на листе               | Критерии  |                 |                        |   |
| 3 | Выполнить первичный отбор и загрузить рейтинги | Подбор    | 133             | вид,<br>листинг,валюта | × |
|   |  |           |                 |                        |   |
| 4 | Загрузить цены                                 | Загрузка  | 62              | рейтинг                | x |
|   |  |           |                 |                        |   |
| 5 | Рассчитать доходность и дюрацию                | Расчет    | 17              | купон, отрасль         | × |
|   |  |           |                 |                        |   |
| 6 | Выполнить вторичный отбор                      | Результат | 4               | дюрация                |   |

ж) нажать «Результат» для выгрузки результата на лист «Итого»:

|   | Порядок работы                                 |           |                 |                        |   |
|---|--|-----------|-----------------|------------------------|---|
|   |  |           | Кол-во<br>бумаг | Виды<br>проверок       |   |
| 1 | Обновить таблицу (дата) на листе               | Облигации | 1479            |                        |   |
| 2 | Задать критерии подбора на листе               | Критерии  |                 |                        |   |
| 3 | Выполнить первичный отбор и загрузить рейтинги | Подбор    | 133             | вид,<br>листинг,валюта | x |
| 1 | Загрузить цены                                 | Загрузка  | 62              | рейтинг                | x |
| 5 | Рассчитать доходность и дюрацию                | Расчет    | 17              | купон, отрасль         | x |
| 6 | Выполнить вторичный отбор                      | Результат | 4               | дюрация                |   |

На листе «Итого» отобразятся подобранные альтернативы и индексы, по которым нужно проводить сопоставление доходности в файле «fiduciary» по проекту Банка России и фидуциарной ответственности.

На листе «Порядок работы» в таблице «Сводный результат» отобразятся бумаги с минимальной модифицированной дюрацией – верхняя строка (как простая мера риска), а также максимальной доходностью – нижняя строка. Если выборка альтернатив такова, что такие бумаги равны, то это теоретически оптимальный для данной выборки инструмент и при наличии необходимых объемов на рынке лучше приобрести его.

| Сводный результат          |          |            |              |
|----------------------------|----------|------------|--------------|
|                            | дюрация  | доходность | isin         |
| минимизация<br>дюрация     | 389,00   | 8,61       | RU000A0JUBA1 |
| максимизация<br>доходность | 1 566,00 | 12,65      | RU000A0JVWL2 |
| ср. значение               | 920, 75  | 8,79       |              |
|                            |          |            |              |

## 7. Файл-шаблон «fiduciary»

Шаблон для сопоставления доходности подобранных альтернатив с доходностью соответствующего индекса Московской Биржи (согласно проекту Банка России).

Шаблон применяется для подобранных альтернатив и для бумаг, уже находящихся в портфеле компании, а также для контроля цен сделки по вносимым в ручном режиме бумагам.

Опционально шаблон может быть дополнен обоснованиями экономической целесообразности удержания инструментов в портфеле (для получения подробной информации обратитесь в службу поддержки RU Data).

#### Контроль подобранных альтернатив (полученных в «findactive»)

а) Для анализа попадания доходности альтернатив, подобранных при помощи шаблона «findactive», в диапазон порогового спреда, необходимо скопировать данные со страницы «Итого» файла «findactive» (содержимое всех столбцов без шапок), на вкладку «Уровень 2 (T0)» в столбцы «А»-«AI».

И далее внести полную цену сделки с учетом всех комиссий:



Выбрать дату (как и в «findactive»), направление сделки, которую анализируем: покупка или продажа («C2»), а также выбрать коэффициент k;

| 1  | Дата                    | Ручной веса                 | 30.08.2019   | n          |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               |  |           |             |        |         |                                 | 1   |
|----|-------------------------|-----------------------------|--------------|------------|--------------|-------|--------------------------|---------|----------|----------------|----------------------------|-----------|----------------------------|---|---------------------|------------------------|-------------|---------------|--|-----------|-------------|--------|---------|---------------------------------|---|
| 2  | Сделка                  | Выбор на списка, ручной вес | Понутка      |            |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               |  |           |             |        |         |                                 |   |
| 3  | Метивированное сужление | Аучной явол                 |              |            |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               | (                                      |           |             |        |         |                                 |   |
| 4  | коэфф к                 | 3                           | n            |            |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               | Эчной зво                              | Расч дох  |             |        |         | После ввода нажать F9           |   |
| 5  |                         |                             |              |            |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               |  |           |             |        |         |                                 |   |
| 6  | Код ІЗІЛ                | Тип бумаги                  | ИНН Эмитента | Код режима | Кратн. ванм. | курс  | Нолинал<br>(текущий<br>) | Отрасль | Купон    | Инструм<br>ент | Рейтинг<br>кнструмо<br>нта | в Эмигент | Рейт и<br>инг и<br>эмит ру | ай Рейл<br>нг инг<br>нсг инст<br>ум рум<br>нта ента | итог<br>Дюраци<br>я | ИТОГ<br>докоднос<br>ть | Корп индек: | Гос<br>индекс | Полная<br>цена в<br>валюте<br>номинала | сходность | дох гос Бим | мин пс | MAKC FC | Выпод                           | Соответствует<br>нанаучшем<br>доступным<br>условиям |
| 7  | RU000A0.UW23            | corporate_bond              | 7730060164   | EQ08       | Росбн15ИП    | 1     | 1000                     | Банки   | Постояни | Pot6H15V       | 40                         | POCEAHN   | 1                          | 1 1   | 957                 | 7,1017                 | RUCB TR8883 | Y RUGBICP1    | 1000                                   | 13,1651   | 6,75        | 0,58   | 0,68    | Внутри интервала                | Coorsetctsyet                                       |
| 8  | RU000A0.UJG1            | corporate bond              | 7730060164   | EQOB       | Росбн14ИП    | 1     | 900                      | Банки   | Постояни | Pot6H14P       | 1                          | POCEAHN   | 1                          | 1 3   | 760                 | 6,8644                 | RUCB TR8883 | Y RUGBICP11   | :000                                   | 7,8:67    | 6.75        | 0.58   | 0.68    | Вне интервала порогового спреда | He coorserctayer                                    |
| 9  | RU000A02YWZ2            | corporate_bond              | 4401116480   | EQ0B       | Совком 283   | 65,03 | 100                      | Банки   | Постояни | Совком 2       | 2 1                        | Совномб   | 3                          | 1 5   | 1101                | 7,9818                 | RUCB TRBB51 | RUGBICPSY     | 1000                                   | -46,1685  | 6,82        | 1,08   | 1.08    | Вне интервала порогового спреда | He ccorpercayer                                     |
| 10 | RU000A0.UBA1            | corporate_bond              | 7750004150   | EQ0B       | 835.P#31     | 1     | 1000                     | Банки   | Постояни | 835.PΦ 3       | 1                          | 1 B35.PΦ  | 1                          | 1 8   | 396                 | 8,6111                 | RUCB TRB3Y  | RUGBICP31     | 1000                                   | 8,6784    | 6,8         | 1,81   | 1,81    | Внутри интервала                | Coorsetctsyet                                       |
| 11 | RU000A0.VWL2            | corporate_bond              | 7707083893   | EQ0B       | (6ep5 of 1   | 1     | 1000                     | Банки   | Постояни | C6ep5 of       | 51                         | Сбербан   | 1                          | 1 10  | 1573                | 12,645                 | RUCB TRB3Y  | RUGBICP31     | 1000                                   | 13,6588   | 6,8         | 1,81   | 1.81    | Внутри интервала                | Coorsetctsyet                                       |
| 12 | KUUUUAU.UBA1            | corporate_pond              | //50004150   | ROOR       | 835.PØ 31    | 1     | 1000                     | ранки   | ПОСТОЯНИ | 5:35.20 3      | 1                          | 1 836.PØ  | 1                          | 1 8   | 396                 | 8,6111                 | RUCE INBST  | RUGBICP31     | 1000                                   | 8,6/84    | 6,8         | 1,81   | 1,81    | внутри интервала                | COOTBETCTEVET                                       |
| 13 | RU000A0.VWL2            | corporate_bond              | 7707083893   | EQOB       | (őep5 of 1   | 1     | 1000                     | Банки   | Постояни | C6ep5 of       | 51                         | Сбербан   | 1                          | 1 10  | 1573                | 12,645                 | RUCB TRB3Y  | RUGBICP31     | 1000                                   | 13,6588   | 6,8         | 1,81   | 1.81    | Внітри интервала                | Соогветствует                                       |
| 14 |                         |                             |              |            |              |       |                          |         |          |                |                            |           |                            |   |                     |                        |             |               |  |           |             |        |         |                                 |   |

б) Рассчитать доходность сделки, нажав кнопку «Расч дох» на вкладке «Уровень 2 (Т0)»:

в) В столбцах «АО»-«АР» отобразится итоговая оценка (находится ли внутри спреда или нет). Если данные не обновляются после расчетов, то необходимо нажать «F9».

#### Контроль цены сделки для набора бумаг (на разные даты сделки):

a) Заполнить вкладку «ISIN» – внести в поля, залитые синим цветом, данные по ISIN, дате покупки, цене (анализируем и покупку, и продажу);

Также есть возможность загрузить форму в формате xml вместо внесения данных в ручном режиме. На листе "ISIN" нажать кнопку "Загрузка Xml" - выбираем файл "F522.xml". Далее – нажать кнопку "Загрузка isin".

| D                              | E  | F   | G   | Н                                      | 1             | J                    | K N           | 1 N O  | P Q            |
|--------------------------------|--|---|---|--|---------------|----------------------|---------------|--------|----------------|
| Вывод                          | Соответствует<br>наилучшим доступным<br>условиям | Минимальное<br>значение порогового<br>спреда, % годовых | Максимально<br>е значение<br>порогового<br>спреда, %<br>годовых | Величина<br>порогового<br>спреда, б.п. | Тип<br>сделки | Рег номер            | Загрузка Xml  | Расчет | Экспортировать |
| Вне интервала порогового спред | Не соответствует                                 | -0,360825878  | 0,500825878   | 0,07                                   | Продажа       | 4B02-04-16643-A-002P | Sarnyaka Isin |        |                |
| Внутри интервала               | Соответствует                                    | -0,360825878  | 0,500825878   | 0,07                                   | Продажа       | 4B02-06-55038-E-001P | Sarpyska isin |        |                |
|                                |  |   |   |  |               |                      |               |        |                |

**б**) Нажать «Расчет». После выполнения расчета отобразится результат в столбцах «D»-«Н» (находится ли внутри спреда или нет):

| код          | дата       | цена покупки | Вывод                           | Соответствуе<br>т наилучшим<br>доступным<br>условиям | Минимальное значение<br>порогового спреда, %<br>годовых | Максимальное<br>значение<br>порогового<br>спреда, %<br>годовых | Величина<br>порогового<br>спреда, б.п. | Покупка |           | Расчет |
|--------------|------------|--------------|---------------------------------|--|---|--|--|---------|-----------|--------|
| RU000A0ZYAP9 | 30.08.2019 | 918,046642   | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         | · · · · · |        |
| RU000A100GH2 | 31.08.2019 | 1003,514091  | Вне интервала порогового спреда | Пе соответству                                       | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0JXY44 | 15.04.2018 | 1079,2       | Вне интервала порогового спреда | Не соответству                                       | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0ZZ1M2 | 30.08.2019 | 1004,49      | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0ZZXL7 | 30.06.2019 | 1019,470039  | Вне интервала порогового спреда | Не соответству                                       | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A1008Q9 | 30.08.2019 | 1007,085781  | Вне интервала порогового спреда | Не соответству                                       | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0ZYG52 | 28.09.2019 | 1053,4       | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0ZYBT9 | 30.08.2019 | 1061,58      | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A100KX5 | 30.08.2019 | 1025,91      | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0ZZXS2 | 30.08.2019 | 1012,533926  | Вне интервала порогового спреда | Не соответств  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0JRU20 | 30.08.2019 | 1000,06      | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0JRU46 | 13.03.2020 | 1000,06      | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0JV3T7 | 30.08.2019 | 1089,4       | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |
| RU000A0JV3U5 | 30.08.2019 | 1089,4       | Внутри интервала                | Соответствует  | 0,675566335   | 0,924433665  | 0,8                                    |         |           |        |

#### Контроль цены сделки конкретной бумаги:

**а) Заполнить вкладку «Уровень 1 (Т-1)»** (внести данные в поля, залитые синим цветом, в столбце «С»), выбрать в ячейке «С2» «Покупка/Продажа», если мы анализируем покупку/продажу актива.

|        | A  | В                            | C                | D                          | E                      | F                     | G                       |
|--------|--|------------------------------|------------------|----------------------------|------------------------|-----------------------|-------------------------|
| 1      | Δατα   | Ручной ввод                  | 30.08.2019       |                            |                        |                       |                         |
| 2      | Сделка   | Покупка/Продажа              | Покупка          | 1. Пересчитать             |                        |                       |                         |
| 3      | ISIN (или рег. номер)                                      | Ручной ввод                  | RU000A0.V3U5     |                            |                        |                       |                         |
|        | Соотвествует законодательным требованиям инвестирования    |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 4      | средств пенсионных резервов                                | Выбор из списка, ручной ввод | Соогветствует    |                            |                        |                       |                         |
| 5<br>6 | Рейтинговая группа ( Агрегат, MIN)                         | Автоматический расчет        | Итог<br>NR       | Выпуск<br>БКЗ финанс-01-об | Рейтинги эмиссии<br>NR | Эмитент<br>БКЗ финанс | Рейтинги эмитента<br>NR |
| 7      |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 8      | Текущий номинал  | Автоматический расчет        | 1000             |                            | AV8 C                  | правки                |                         |
| 9      | Полкая цена, в валюте номинала                             | Ручной ввод                  | 1089,4           |                            | к погашению            | к оферте              |                         |
| 10     | Ожидаемая доходность по сделке, % годовых                  | Автоматический расчет        | 3,6719           |                            | 9,5606                 | 3,6719                |                         |
| 11     | Дюрация, дисй  | Автоматический расчет        | 1320             | 2 33501/31/75              | 2702                   | 1320                  |                         |
| 12     | Наименование корпоративного индекса                        | Автоматический расчет        | RUC3ITREBB5Y     | 2. Jai pysirib             |                        |                       |                         |
| 13     | Доходность индекса государственных ценных бумаг, % годовых | Автоматлческий расчет        | 6,82             |                            |                        |                       |                         |
| 14     |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 15     |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
|        | Спред между ожидаемой доходностью по сделке и доходностью  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 16     | Индекса государственных ценных бумаг, б.п.                 | См вкладку Итого             |                  |                            |                        |                       |                         |
| 17     | Минимальное значение порогового спреда, % годовых          | Автоматический расчет        | 0,6756           |                            |                        |                       |                         |
| 18     | Максимальное значение порогового спреда, % годовых         | Автоматический расчет        | 0,9244           |                            |                        |                       |                         |
| 19     | Величина порогового спреда, б.п.                           | Автоматический расчет        | 0.8000           |                            |                        |                       |                         |
| 20     | k  | Ручной ввод                  | 3                |                            |                        |                       |                         |
| 21     | Вывод  | Автоматический расчет        | Внутри интервала |                            |                        |                       |                         |
| 22     | Соответствует наилучшим доступным условиям                 | Автоматический расчет        | CoorBetctByet    |                            | 1                      |                       |                         |
| 23     |  |                              |                  |                            | -                      |                       |                         |

б) Нажать кнопку «1. Пересчитать» на вкладке «Уровень 1 (Т-1)» для проведения расчета доходности, дюрации, рейтингов и загрузки данных:

| 1  | A  | В                            | c                | D                | E                | F          | G                 |
|----|--|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|-------------------|
| 1  | <b>Δατα</b>  | Ручной ввод                  | 30.08.2019       |                  |                  |            |                   |
| 2  | Сделка   | Покупка/Продажа              | Покупка          | 1 Пересчитать    |                  |            |                   |
| 3  | ISIN (или рег. номер)                                      | Ручной ввод                  | RU000A0.V3U5     |                  |                  |            |                   |
|    | Соотвествует законодательным требованиям инвестирования    |                              |                  |                  |                  |            |                   |
| -4 | средств пенсионных резервов                                | Выбор из списка, ручной ввод | Соогветствует    |                  |                  |            |                   |
| 5  | Požnujsenog migra (Arnorez, MIN)                           |                              | Итог             | Выпуск           | Рейтинги эмиссии | Эмитент    | Рейтинги эмитента |
| 6  | renninoban ipjina (raperat, mity                           | Автоматический расчет        | NR               | БКЗ финанс-01-об | NR               | БКЗ финанс | NR                |
| 7  |  |                              |                  |                  |                  |            |                   |
| 8  | Текущий номинал  | Автоматический расчет        | 1000             |                  | AV8 C            | правки     |                   |
| 9  | Полкая цена, в валюте номинала                             | Ручной ввод                  | 1089,4           |                  | к погашению      | к оферте   |                   |
| 10 | Ожидаемая доходность по сделке, % годовых                  | Автоматический расчет        | 3,6719           |                  | 9,5606           | 3,6719     |                   |
| 11 | Дюрация, длей  | Автоматический расчет        | 1320             | 2 23501/21/75    | 2702             | 1320       |                   |
| 12 | Наименование корпоративного индекса                        | Автоматический расчет        | RUCBITREBB5Y     | 2. 3di pysuitb   |                  |            |                   |
| 13 | Доходность индекса государственных ценных бумаг, % годовых | Автоматический расчет        | 6,82             |                  |                  |            |                   |
| 14 |  |                              |                  |                  |                  |            |                   |
| 15 |  |                              |                  |                  |                  |            |                   |
|    | Спред между ожидаемой доходностью по сделке и доходностью  |                              |                  |                  |                  |            |                   |
| 16 | Индекса государственных ценных бумаг, б.п.                 | См вкладку Итого             |                  |                  |                  |            |                   |
| 17 | Минимальное значение порогового спреда, % годовых          | Автоматический расчет        | 0,6756           |                  |                  |            |                   |
| 18 | Максимальное значение порогового спреда, % годовых         | Автоматический расчет        | 0,9244           |                  |                  |            |                   |
| 19 | Величина порогового спреда, б.п.                           | Автоматический расчет        | 0,8000           |                  |                  |            |                   |
| 20 | k  | Ручной ввод                  | 3                |                  |                  |            |                   |
| 21 | Вывод  | Автоматический расчет        | Внутри интервала |                  |                  |            |                   |
| 22 | Соответствует наилучшим доступным условиям                 | Автоматический расчет        | Соответствует    |                  | 1                |            |                   |
| 23 | ſ  |                              |                  |                  | -                |            |                   |

с) Нажать «2. Загрузить» в целях расчета порогового спреда для данного инструмента (с использованием вкладки «Данные»):

| 1      | A  | В                            | с                | D                          | E                      | F                     | G                       |
|--------|--|------------------------------|------------------|----------------------------|------------------------|-----------------------|-------------------------|
| 1      | Δατα   | Ручной ввод                  | 30.08.2019       |                            |                        |                       |                         |
| 2      | Сделка   | Покупка/Продажа              | Покупка          | 1. Пересчитать             |                        |                       |                         |
| 3      | ISIN (или рег. номер)                                      | Ручной ввод                  | RU000A0.V3U5     |                            |                        |                       |                         |
|        | Соотвествует законодательным требованиям инвестирования    |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 4      | средств пенсионных резервов                                | Выбор из списка, ручной ввод | Соогветствует    |                            |                        |                       |                         |
| 5<br>6 | Рейтинговая группа ( Агрегат, MIN)                         | Автоматическиќ расчет        | Итог<br>NR       | Выпуск<br>БКЗ финанс-01-об | Рейтинги эмиссии<br>NR | Эмитент<br>БКЗ финанс | Рейтинги эмитента<br>NR |
| -7     |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 8      | Текущий номинал  | Автоматический расчет        | 1000             |                            | AVE C                  | правки                |                         |
| 9      | Полная цена, в валюте номинала                             | Ручной ввод                  | 1089,4           |                            | к погашению            | к оферте              |                         |
| 10     | Ожидаемая доходность по сделке, % годовых                  | Автоматический расчет        | 3,6719           |                            | 9,5606                 | 3,6719                |                         |
| 11     | Дюрация, дисй  | Автоматический расчет        | 1329             | 2 3arovauts                | 2702                   | 1329                  |                         |
| 12     | Наименование корпоративного индекса                        | Автоматический расчет        | RUCBITREBB5Y     | 2. 30 993010               |                        |                       |                         |
| 13     | Доходность индекса государственных ценных бумаг, % годовых | Автоматлческий расчет        | 6,82             |                            |                        |                       |                         |
| 14     |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 15     |  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
|        | Спред между ожидаемой доходностью по сделке и доходностью  |                              |                  |                            |                        |                       |                         |
| 16     | Индекса государственных ценных бумаг, б.п.                 | См вкладку Итого             |                  |                            |                        |                       |                         |
| 17     | Минимальное значение порогового спреда, % годовых          | Автоматический расчет        | 0,6756           |                            |                        |                       |                         |
| 18     | Максимальное значение порогового спреда, % годовых         | Автоматический расчет        | 0,9244           |                            |                        |                       |                         |
| 19     | Величина порогового спреда, б.п.                           | Автоматический расчет        | 0,8000           |                            |                        |                       |                         |
| 20     | k  | Ручной ввод                  | 3                |                            |                        |                       |                         |
| 21     | Вывод  | Автоматический расчет        | Внутри интервала |                            |                        |                       |                         |
| 22     | Соответствует наилучшим доступным условиям                 | Автоматический расчет        | Coorbercrbyer    |                            | 1                      |                       |                         |
| 22     |  |                              |                  |                            | T                      |                       |                         |

На вкладке «Данные» можно настроить глубину анализа (внести нужное число дней в ячейку «В2») в зависимости от изменений по проекту Банка России.

Замечание: также в шаблоне присутствуют листы для расчета суммы восполнения, инструкция по работе с которыми указана на самом листе:

- Восполнение\_Бонды расчет суммы восполнения по облигациям;
- Восполнение\_Депозит расчет суммы восполнения по депозитам.

## 8. Файл-шаблон «TSS»

Шаблон для оценки корректности стоимости, отраженной в бухгалтерском учете.

a) Ввести точность оценки (для сопоставления каскада, созданного с файлом Ru Data и данных бухгалтерского учета) и нажать «Синхронизировать» на вкладке «Список инструментов»:



#### б) На вкладке «Справедливая стоимость»:

Диапазон «G»-«О» для выстраивания собственного каскада цены и сопоставления ее с данными бухгалтерского учета. В столбце «К» компания выстраивает свой каскад<sup>1</sup> (из представленных данных или иных данных). Для проверки в столбце «L» выбирается столбец для сопоставления со стоимостью по бухучету. После выбора столбца нажать «F9» для пересчета формул:



Диапазон «Р»-«Х» для сравнения справедливой стоимости (ТСС) по данным бухгалтерского учета и данным Ценового центра (находится ли цена внутри доверительного интервала или нет). В случае отклонения от интервала в столбце «Х» появляется запись о необходимости проверки учета компании. Также рассчитывается возможное повышение или понижение текущей бухгалтерской цены, но при этом оно остается в рамках доверительного интервала.



<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Возможно построение пользовательских каскадов. Пишите на rudata@interfax.ru

Вкладка «RuPrice» носит служебный характер. На ней отображается оценка стоимости бумаг по данным Ценового центра НРД с указанием доверительного интервала, уровня цены.

### 9. Файл-шаблон «insurstresstest»

Шаблон для оценки финансовой устойчивости страховщика согласно требованиям Банка России (стресс-тестирование согласно стандарту Solvency II).

a) Открыть файл «insurstresstest»;

б) На листе «Портфель (RUData)» указать граничное значение концентрации для расчета кредитного риска (категория контрагента) в столбце J – для ЮЛ, в столбце К – для ФЛ;



Кнопка «Пересчет CDR» позволяет пересчитать категорию контрагента и подверженность кредитному риску после изменения граничного значения.

**в) На листе «Обязательства»** нажать кнопку «Импортировать» и выбрать соответствующий файл для загрузки обязательств из подготовленного файла «liabilities» (в пакете шаблонов продукта);

|    | А   | В                 | С | D | Е | FG | H I           |
|----|---|-------------------|---|---|---|----|---------------|
|    |   |                   |   |   |   |    |               |
| 1  |   |                   |   |   |   |    |               |
| 2  | Показатели  | На дату расчета   |   |   |   | ſ  |               |
| 3  | Резервы по страхованию иному, чем страхование жизни           | 1 501 366 075,48  |   |   |   |    | Импортировать |
| 4  | Резервы по страхованию жизни                                  | 28 109 382 189,07 |   |   |   |    |               |
| 5  | Отложенные налоговые обязательства                            | -                 |   |   |   |    |               |
| 6  | Отложенные налоговые обязательства по 710-П                   |                   |   |   |   |    |               |
| 7  | Отложенные аквизиционные доходы                               | 10 706 289,68     |   |   |   |    |               |
| 8  | Обязательства по договору аренды                              | 32 687 531,37     |   |   |   |    |               |
| 9  | Прочие обязательства  | 602 725 740,90    |   |   |   |    |               |
| 10 | Внебалансовые обязательства                                   | -                 |   |   |   |    |               |
| 11 | Требования по договору аренды                                 | 31 746 676,47     |   |   |   |    |               |
| 12 | Резервы по страхованию иному, чем страхование жизни (регул)   | 1 603 651 220,75  |   |   |   |    |               |
| 13 | Дополнительная часть РНП (регул)                              | 361 992 252,43    |   |   |   |    |               |
| 14 | Резервы по страхованию жизни (регул)                          | 28 667 017 729,52 |   |   |   |    |               |
| 15 | Резерв опций и гарантий (регул)                               | 401 339 093,40    |   |   |   |    |               |
| 16 | Внебалансовые обязательства по 710-П                          | -                 |   |   |   |    |               |
| 17 | Остальное: Амортизация по ОС - ОНА (ОНО)                      | 16 831,97         |   |   |   |    |               |
| 18 | Остальное: Амортизация по НМА - ОНА (ОНО)                     | - 206 981,20      |   |   |   |    |               |
| 19 | Корректировка по опционам (удалить данные ПрограмБанка)       | - 91 852 341,35   |   |   |   |    |               |
| 20 | Корректировка по опционам (признать расчетные данные верными) | 80 754 529,88     |   |   |   |    |               |
| 21 | КЗ, сальдированная с ДЗ                                       | 0                 |   |   |   |    |               |
| 22 | РНП, сальдированный с ДЗ                                      | 0                 |   |   |   |    |               |
| 23 |   |                   |   |   |   |    |               |

Замечание: Для корректного импорта обязательств листы файла должны быть названы «Лист1» и «Лист2» соответственно.

После загрузки обязательств проверить, что обновились данные на листах **«ВОНО»** и **«Баланс»**. Нажать **«**F9**»** если не обновились.

#### г) Нажать «Заполнить полностью» на листе «Портфель (RUData)»:

|   | А          | В                   | С         |  | D            | E        | F                               | G               | н   |  |  |
|---|------------|---------------------|-----------|--|--------------|----------|---------------------------------|-----------------|-----|--|--|
| 1 | 30.04.2022 | Заполнить полностью |           |  | Поэтапное за | полнение | Перерасчёт хор/плох и просрочки |                 |     |  |  |
| 2 | код        | кол-во              | стоимость |  | AC/FV        | ПИФ      | Рыночная<br>стоимость           | Тип<br>ЮЛ/ФЛ/ИП | Тип |  |  |

При заполнении появляется всплывающая подсказка для заполнения пустых строк в колонках «тип» и «ИНН». Нажать «да», если необходимо.

| Тип контрагента                                   | Тип контрагента                                   | ИНН контрагента  |
|---|---|--|
| если тип контрагента не проставлен, поставить ЮЛ? | если тип контрагента не проставлен, поставить ФЛ? | если ИНН контрагента не проставлен, то поставить наименование? |
| Да Нет  | Да Нет  | Да Нет   |

На этой же вкладке будут собраны данные из файла «portfolio» (должен быть открыт) и загружены дополнительные параметры для проверки по классификации плохой/хороший актив.

Замечание: При большом загружаемом объеме данных рекомендуется производить заполнение при помощи кнопки «Поэтапное заполнение». Это позволяет отделить вызов методов друг от друга, и таким образом оптимизировать процесс.

| 1 | A   | В С<br>Заполнить полностью |           |       | D E Поэтапное заполнение |        |                       | F G H<br>Перерасчёт хор/плох и просрочки |     |  |
|---|-----|----------------------------|-----------|-------|--------------------------|--------|-----------------------|--|-----|--|
| 2 | код | КОЛ-ВО                     | стоимость | AC/FV | ПИФ                      | l<br>c | Рыночная<br>стоимость | Тип<br>ЮЛ/ФЛ/ИП<br>▼                     | Тип |  |

После заполнения каждого шага появится уведомление о выполнении, и необходимо будет запустить следующий.



#### Далее необходимо проверить и/или заполнить следующие данные:

В столбцах «BD»-«BF» обозначается подверженность риску. Сама таблица сопоставления класса актива на вкладке «ActClass» (ее можно настраивать в соответствии с требованиями Банка России, а также, если подход Клиента отличается). Для справки в CDR значением «1» отмечены активы, для которых риск оценивается по Монте-Карло, «2» – по Пуассону.

В столбце ВW («хороший» (1)/ «плохой» (0) актив) проверить данные автоклассификации, для активов, помеченных «?», указать нужный коэффициент на листе. ПИФ необходимо разложить на составляющие части. На вкладке «Плохие активы» можно настроить классификацию, а также

пороговое значение рейтинга для признания актива хорошим (если изменяются требования Банка России, а также, если подход Клиента отличается от подхода, реализованного в шаблоне).

При необходимости изменить критерии классификации «плохой/хороший» вручную нужно перепроверить ее при помощи кнопки «Перерасчет хор/плох активы и просрочки».



Замечание: При необходимости перепроверить классификацию плохой хороший можно рассчитать её формулами при помощи кнопки «Рассчитать формулами». После нажатия в скрытых ячейках CF-DS будут протянуты формулы, ссылающиеся на критерии и определяющие значение в столбце «"хороший" (1)/"плохой" (0) актив».



д) На листе «156» для расчета норматива на капитал заполнить ячейки, отмеченные синим цветом.

е) На листе «Оценка рисков» нажать кнопку «Оценить риски», чтобы произвести расчет рисков:

|               |               |    |                                      |                          | Корреляционная  | матрица                              |
|---------------|---------------|----|--------------------------------------|--------------------------|-----------------|--------------------------------------|
| Оценить риски | Рыночный риск |    |                                      | Концентрационный<br>риск | Процентный риск | Риск расширения кредитных<br>спредов |
|               | -             |    | Концентрационный риск                | 100%                     | 0%              | 0%                                   |
|               |               | up | Процентный риск                      | 0%                       | 100%            | 100%                                 |
|               |               |    | Риск расширения кредитных<br>спредов | 0%                       | 100%            | 100%                                 |
|               |               |    | Риск снижения цен акций              | 0%                       | 100%            | 100%                                 |
|               |               |    | Риск снижения цен на<br>недвижимость | 0%                       | 100%            | 100%                                 |
|               |               |    | Риск изменения курса валют           | 0%                       | 75%             | 100%                                 |
|               |               |    | Риск снижения цен на иные активы     | 0%                       | 100%            | 100%                                 |
|               |               |    |                                      |                          |                 |                                      |

После нажатия кнопки «Оценить риски» произойдет автоматическая подкачка данных из листа «Портфель (RUData)» на листы, отвечающие за расчет каждого вида рисков, и произойдет автоматизированный расчет всех рисков (или проставление расчётных формул), кроме Кредитного риска. Затем появится всплывающая подсказка, с вопросом по оценке кредитного риска для 1(Монте-Карло) и 2(Пуассон) категории контрагентов.

| Монте-Карло Х  | L | Пуассон_ЮЛ ————————————————————————————————————             |
|--|---|---|
| Рассчитать крдитный риск для контрагентов категории 1(метод<br>Монте-Карло)? | l | Рассчитать крдитный риск для контрагентов категории 2 (ЮЛ)? |
| Да Нет   | l | Да Нет  |

Для расчёта риска по Пуассону также необходимо выбрать файлы «CDR\_P\_ЮЛ», «CDR\_P\_ФЛ», которые формируются автоматически в папке с шаблонами продукта. Также можно посчитать кредитный риск по Пуассону отдельно, запустив расчет для ФЛ и ЮЛ соответствующими кнопками на листе CDR\_P.

Аналогично, оценку риску по Монте-Карло можно запустить отдельно от общей оценки риска кнопкой «Запустить Монте-Карло» на листе «MC result».

Замечание: расчет будет осуществлен по сценариям (приложения к требованиям Банка России) на дату расчета. Также сценарий можно выбирать, редактируя голубые ячейки на листе «Оценка рисков»:

|  |  |   | 1                       | 2                       | 3                                       | 4                       | 5                          | 6                    |
|--|--|---|-------------------------|-------------------------|---|-------------------------|----------------------------|----------------------|
| После выбора периода вновь<br>нажать "Оценить риски" | иода вновь Все риски, кроме ConcR 5 (макс 6) |   | до 01.07.2022           | 01.07.2022 - 31.12.2022 | 01.07.2022(31.12.20<br>22) - 30.05.2023 | 01.07.2023 - 30.06.2024 | 01.07.2024 -<br>30.06.2025 | начиная с 01.07.2025 |
|  | ConcR(макс 4)                                | 5 | 01.07.2021 - 31.12.2021 | 01.01.2022 - 30.06.2022 | 01.07.2022 -<br>31.12.2022              | начиная с 01.01.2023    |                            |                      |
|  |  |   |                         |                         |   |                         |                            |                      |

Детальные расчеты рисков приведены на следующих вкладках:

- **PrEqR** расчет риска по акциям, недвижимости и прочим активам;
- **CurR** расчет валютного риска;
- **IR** расчет процентного риска;
- Сопс *R* расчета риска концентрации;
- **CDR** данные для расчета кредитного риска по Монте-Карло;
- MC result лист для запуска и получения результата по Монте-Карло;
- **CDR\_P** лист для оценки кредитного риска по Пуассону.

При необходимости можно вручную изменить параметр рисковый/безрисковый актив на листе «**ClassGroups**», столбцы G-K, указав код контрагента в соответствии со столбцом ИНН (столбец Q листа «Портфель (RuData)»):

| ExcludeFromConcR | ExcludeFromSR | ExcludeFromCDR | ExcludeFromAllRisks |  |
|------------------|---------------|----------------|---------------------|--|
| ИНН для          | ИНН для       |                |                     |  |
| исключения из    | исключения    | ИНН для        | ИНН для             |  |
| риска            | из спред-     | исключения из  | исключения из       |  |
| концентрации     | риска         | риска дефолта  | всех рисков         |  |

Кроме того, на данном листе можно редактировать категории, которые учитываются для соответствующего риска (остальные столбцы).

Также для каждого актива можно отредактировать на листе «Портфель (RuData)» безрисковость – столбец CE (0 – безрисковый, 1 – рисковый) и подверженность каждому риску столбцы CA-CD.

**ж) На листе «Аллокация»** нажать кнопку «Fill» для отображения доли каждого актива в риске (необходимо для заполнения отчетных форм);

Также есть возможность учитывать риски Standalone (не учитывать корреляцию) или с итоговой корреляцией. Для этого необходимо выбрать соответствующий пункт в ячейке B2 на листе «Аллокация». Для формирования отчетности корреляция не учитывается.

|   | A                           | В                    | С                 |
|---|-----------------------------|----------------------|-------------------|
| 1 | Значение риска (standalone) |                      |                   |
| 2 | Корреляция (итоговая)       | Учитывать корреляцию |                   |
| 3 | Риск с учетом корреляции    |                      | ₽4 404 229 333,11 |
| 4 | Контроль                    |                      |                   |

Замечание: также в шаблоне присутствуют листы с данными, которые может редактировать пользователь. На них указаны базовые правила и данные согласно методологии RUData.

- Плохие активы редактируемый уровень рейтинга согласно решению Совета Директоров Банка России;
- Param сценарии согласно нормативным требованиям Банка России (редактируемые),
- ОФЗ RUR и ОФЗ USD ставки для процентного риска (для инфо);
- **Tab3\_Ratings** список эмитентов для учета послабления от Банка России редактируется срок действия и сами контрагенты A-D столбцы.
- «ActClass» настраивается общая подверженность риску по классу актива (настраивается согласно методологии клиента, в базовой версии указано согласно методологии продукта)
- «Хорошие Активы» настраивается (согласно методологии клиента, в базовой версии указано согласно методологии продукта) классификация плохой-хороший актив, то есть указываются признаки плохого или хорошего актива для каждого класса.

#### Остальные вкладки носят служебный характер.

з) Сохранить и закрыть insursstresstest.

Далее переходим к работе с шаблоном «input 154» (вкладка «File list»).

## 10. Файл-шаблон «limits»

Шаблон для контроля инвестиционных ограничений портфеля (портфелей) компании. Возможно расширение шаблона и его настройка под требования и методики Клиента (для этого обратитесь в Службу поддержки RU Data).

### а) На вкладке «Config» данного файла<sup>2</sup>:

проверить, что дата оценки синхронизировалась. Если этого не произошло, внести в ручном режиме нужную дату, ввести ограничения для каждого из портфелей под управлением. Если портфелей больше/меньше, то добавить столбцы/не заполнять указанные столбцы:



#### б) На вкладке «Ключевые портфели»:

- Нажать на «Номер портфеля» (синхронизация с номерами с листа «Config»);
- Нажать на «Синхронизировать» и ввести номер портфеля на вкладке «Портфель (RUData)»;
- Нажать на «Рассчитать портфель»;
- Нажать на «Рассчитать».



Замечание: Кнопки «Очистить» и «Очистить портфель» нужны для возврата файла в изначальное состояние. Использовать их при внесении иного лимита на листе «Config» либо иного порогового ограничения.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Возможно задание других видов ограничений, а также создание ограничений с двумя и более условиями, например, на рейтинг и эмитента. Пишите на rudata@interfax.ru

На следующих листах отображаются рассчитанные лимиты: «Эмитенты» – по эмитентам, «Класс актива» – по классу актива, «Листинг» – по листингу, «Рейтинг» – по рейтингам.

Замечание: возможно добавление активов согласно инвестиционной декларации клиента или из лимитной ведомости.

На листе «Ключевые портфели» выводится (цветовой индикацией) итог, есть ли в портфеле (соответствует каждой строке) нарушение (не белая заливка, надпись «Нарушение») соответствующего лимита (столбец) или нет (белая заливка, надпись «ОК»).

## 11. Файл-шаблон «wishlist»

Шаблон для отслеживания заданных изменений по финансовому инструменту (рейтинг эмитента, рейтинг бумаги, уровень листинга), а также приближение даты оферты/погашения.

**а) Заполнить лист «Ценные бумаги»** – вкладка для отслеживания. Внести ISIN и даты отслеживания для уровня листинга. Нажать «Заполнить» для расчета изменений (отобразятся результаты на «Итого индикаторы»);

| 17.05.2018                             |  | 13.05.2019                   | дата для уровня листинга | Заполнить      |
|--|--|------------------------------|--------------------------|----------------|
| ISIN, Гос.per.номер, код<br>НРД, SWIFT | Облигации/А<br>кции/Банков<br>ское<br>вложение | Изменение уровня<br>листинга | Дней до погашения        | Дней до оферты |
| 412019788                              | блигация                                       | 0                            | 97                       |                |
| 4802-01-00372-R-001P                   | блигация                                       | 0                            | 725                      |                |
| 26221RMFS                              | блигация                                       | 0                            | 5424                     |                |
| RU000A0JTVJ2                           | блигация                                       | 0                            | 1790                     | 334            |
| RUOOOAOJUKX4                           | блигация                                       | 0                            | 5402                     | 198            |
|  | e  |                              | 1001                     |                |

**б)** Проверить результат отслеживания на вкладке «Итого индикаторы» – вкладка – индикатор по отслеживаемым событиям, нужно ввести количество дней до оферты/погашения;

| Изменение рейтинга<br>бумаги    | Нет             |
|---------------------------------|-----------------|
| Изменение рейтинга<br>эмитента  | Нет             |
| Изменение уровня<br>листинга    | Нет             |
| мин дней до<br>оферты/погашения | 100             |
| Дней до погашения               | 97              |
| Дней до оферты                  | Больше 100 дней |
|                                 |                 |

## 12. Файл-шаблон «payment»

Шаблон для расчета суммарных выплат по всему портфелю в дневной и годовой агрегации.

**а) На листе «Алгоритм работы»** ввести число лет прогноза. Нажать последовательно все кнопки, выведенные на лист:



б) 6 этап. «Посчитать дисконт»: нажать, если необходимо посчитать дисконтированный поток по кривой Московской биржи (G-curve). Нажать F9, если не загрузилось G-curve.

## 13. Файл-шаблон «forms»

Шаблон для расчета стоимости собственных средств негосударственного пенсионного фонда<sup>3</sup>.

а) Нажать «Заполнить» на листе «Портфель (RUData)»:

|     |                                   | C  | Заполни       | ть    | -      |                   |  |  |  |  |
|-----|-----------------------------------|----|---------------|-------|--------|-------------------|--|--|--|--|
| код | кол-                              | BO | стоимо<br>сть | AC/FV | Валюта | Дат<br>окон<br>ия |  |  |  |  |
|     |                                   |    |               |       |        |                   |  |  |  |  |
|     | ▶ Портфель (RuData) СС (4028-У) + |    |               |       |        |                   |  |  |  |  |

б) На вкладке «Портфель (RuData)» в столбце «AM» внести признак «CC» (проверить, что внесен), если актив относится к портфелю собственных средств;

в) Внести данные управляющей компании и нажать «Заполнить» на листе «СС (4029-У)»:

| 2 A   | В                   | с  | D   | E                                   | F                                   |
|---|---------------------|--|---|-------------------------------------|-------------------------------------|
| :   | Заполнить 1         |  | Наименование управляющей<br>компании, фонла | ИНН управляющей компании, фонда     | ОГРН управляющей компании,<br>фонда |
|   | Заполнить данные УК |  | УК  | 1111111                             | XXXXXXXXXXX200                      |
| Заполнить данные УК<br>Номер строки Дата Наименование<br>управляющей компании,<br>фонда |                     | Наименование<br>управляющей компании,<br>фонда | ИНН управляющей компании, фонда             | ОГРН управляющей компании,<br>фонда | Класс актива, обязательства         |
|   |                     |  |   |                                     |                                     |
| •   | Портфе              | ль (RuData) СС (402                            | 28-Y) (+                                    |                                     |                                     |

г) Внести дополнительные данные, которые не выгрузились. Указать коэффициент (согласно 4028- У);

д) Если средства находятся под управлением разных управляющих компаний, то в ручном режиме добавить эти данные в столбцах «С»-«Е».

Замечание: на лист affNPF выводятся автоматически данные о группах связанных лиц фонда и управляющей компании. Лист «actclass» носит служебный характер.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Возможна доработка для расчета для других видов НФО. Пишите на rudata@interfax.ru

## 14. Файл-шаблон «formsRM»

Шаблон для подготовки примечаний по рискам к МСФО отчетности некредитной финансовой организации.

Замечание: Функционал обсуждается индивидуально с каждым клиентом.

Нажать «Заполнить» на листе «Портфель (RuData)». После этого на каждой вкладке появится раскладка портфеля по соответствующим наименованию вкладок критериям из примечаний по рискам к отчетности.

| A   | В      | c             | D      | E      | F                     | G            | н     | 1               | J     | K      | L      | м             | N                      |
|-----|--------|---------------|--------|--------|-----------------------|--------------|-------|-----------------|-------|--------|--------|---------------|------------------------|
|     |        | Sano.         | лнить  |        |                       |              |       |                 |       |        |        |               |                        |
| код | кол-во | стоимо<br>сть | AC/FV  | валюта | Дата<br>окончани<br>я | ИНН<br>Банка | тип   | Класс<br>актива | Тип   | Выпуск | ВАЛЮТА | Тип<br>купона | Числ<br>купон<br>в год |
|     |        |               |        |        |                       |              |       |                 |       |        |        |               |                        |
|     | Пор    | тфель (       | RuData | ) Pe   | йтинг                 | Прос         | рочка | Геог            | рафия | Дюр    | ация   | Валю          | та                     |

Замечание: Если расчет не произошел, нажать «F9» (один раз на любой вкладке).

## 15. Файл-шаблон «isins»

Шаблон для проверки, является ли введенный код ценной бумаги ISIN или регистрационным номером.

а) Ввести в поле КОД, залитое синим цветом:

#### isin – на вкладке «ISIN» или

регистрационный номер бумаги - на вкладке «рег ном»



Также данные на вкладку «ISIN» могут быть подтянуты из шаблона входных данных - различных вариаций «input». Для этого необходимо нажать кнопку «Проверить input» и не выполнять шаг б).

| l | код          |   | коррект | но? | в чем ошибка?             |   |           |  |
|---|--------------|---|---------|-----|---------------------------|---|-----------|--|
| I | 26207RMFS    |   | ИСТИН   | IA  |                           | Г | Іроверить |  |
| I | 41303349B    |   | ИСТИН   | IA  |                           | _ |           |  |
| I | RU35010SAM0  |   | ИСТИН   | IA  |                           |   |           |  |
| I | 4-09-00004-T |   | ИСТИН   | IA  |                           |   |           |  |
| I | 4-30-00739-A |   | лож     | Ь   | incorr language or lenght |   |           |  |
|   | FB020903349B |   | лож     | Ь   | incorr language or lenght |   |           |  |
|   | ISIN         | р | ег ном  |     | ÷                         |   |           |  |

**б) Нажать кнопку «Проверить» на той вкладке, на которой заполняли данные** (или каждую кнопку на обоих вкладках, если заполнялись обе вкладки):

| кол  | корректно?   | в чем ошибка?   |           |
|--|--|---|-----------|
| RU000725281  | ложь   | incorr language or lenght   |           |
| RU0007775219   | истина   | incon language of length  |           |
| RU00007773215  | истина   |   | Проверить |
| RU000A0DQZE5   | ИСТИНА   | incom languaga an langht  |           |
| RUUUUAUJINYINI   | ЛОжь   | incorr language of lenght   |           |
| RU000A0JQ7Z2   | ИСТИНА   |   |           |
| RU000A0JQAL8   | ИСТИНА   |   |           |
| ISIN I   |  | (+)   |           |
|  |  | 0   |           |
| код  | корректно?   | в чем ошибка?   |           |
| код<br>26207RMFS   | корректно?<br>ИСТИНА   | в чем ошибка?   | Проверить |
| код<br>26207RMFS<br>41303349В  | корректно?<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА                                     | в чем ошибка?   | Проверить |
| код<br>26207RMFS<br>41303349B<br>RU35010SAM0   | корректно?<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА                           | в чем ошибка?   | Проверить |
| код<br>26207RMFS<br>41303349B<br>RU35010SAM0<br>4-09-00004-T                                 | корректно?<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА                 | в чем ошибка?   | Проверить |
| КОД<br>26207RMFS<br>41303349B<br>RU35010SAM0<br>4-09-00004-T<br>4-30-00739-A                 | корректно?<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ЛОЖЬ         | в чем ошибка?   | Проверить |
| КОД<br>26207RMFS<br>41303349B<br>RU35010SAM0<br>4-09-00004-T<br>4-30-00739-A<br>FB020903349B | корректно?<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ИСТИНА<br>ЛОЖЬ<br>ЛОЖЬ | в чем ошибка?<br>incorr language or lenght<br>incorr language or lenght | Проверить |

После этого система выдаст информацию, корректно или нет и в чем ошибка.

## 16. Файл-шаблон «OR»

Шаблон для оценки операционного риска.

Порядок работы и описание вкладок указано на листе «Инструкция».

**а) на вкладке** «Настройка» заполняется перечень рисков (которые оцениваем). При необходимости изменить матрицу оценок вероятности и воздействия и свертки согласно Вашей методологии;



б) на вкладке «Опросник» указываются дата заполнения и перечень наименований бизнес- процессов в организации;

в) на вкладке «Опросник» нажать «Разбить на процессы» – сформируются листы для каждого бизнеспроцесса;



г) на вкладке с каждым процессом (в примере «Итого БП» и «БП1», «БП1» заменяется автоматически после заполнения листа «Опросник» на названия, указанные в 8 строке) можно согласно Вашей методологии редактировать веса процесса и наименования подпроцессов, которые участвуют в оценке;



д) для очистки листов (вкладок) с бизнес-процессами **на вкладке «Опросник»** необходимо нажать «Удалить листы» (перед оценкой для нового подразделения). И начать заполнение с шага а;

Инструкция Настройка Опросник Итого БП БП1 🕀

| A | 8                               | c                              | D                   | E                          | F   | G   | н   | 1    | J   | к   | L A  |
|---|---------------------------------|--------------------------------|---------------------|----------------------------|-----|-----|-----|------|-----|-----|------|
|   | Изменяется подразделением       |                                | No nepe             | Па онни                    |     |     |     |      |     |     | _    |
|   | Дата составления                | 01.01.2018                     | создают<br>(при наз | ся новые листы<br>катии на |     |     |     |      |     |     |      |
|   | Наименование подразделения      | Подразделение 1                | кнопку),<br>БП. БП1 | равные числу<br>- образец. |     |     |     |      |     |     |      |
|   | Составитель                     | Иванов И.И. (начальник отдела) |                     |                            |     |     |     |      |     |     |      |
|   | Перечень бизнес процессов       | eur                            | 6/12                | 603                        | S/M | ens | 606 | 6/17 | 608 | 609 | 6010 |
|   | Разбить на процессы             | Удалить листы                  |                     |                            |     |     |     |      |     |     |      |
|   | Число сотруднкиов подразделения |                                |                     |                            |     |     |     |      |     |     |      |

## 17. Файл-шаблон «VLA»

Шаблон для классификации ликвидных активов с учетом наличия активного рынка и низкого риска. В качестве меры риска используется Basel 3.

Замечание: Методика классификации и оценки ВЛА может корректироваться, текущая в недренная в шаблон по запросу направляется пользователю для изучения.

а) На листе «Портфель (RuData)» нажать кнопку «Заполнить»;

|     |        | Заполни       | ть    |     |    |
|-----|--------|---------------|-------|-----|----|
| код | кол-во | стоимо<br>сть | AC/FV | ПИФ | ок |
|     |        |               |       |     |    |

Если файл input не содержит наименования портфелей, то руками на листе

«Портфель (RuData)» в столбце AN указать, какие активы относятся к собственным средствам (пометить «CC»). По ним идет расчет ВЛА.

| AI              | AJ                 | AK                  | AL                           | AM   | AN           |   |
|-----------------|--------------------|---------------------|------------------------------|------|--------------|---|
|                 |                    |                     |                              |      |              |   |
| Дата<br>дефолта | Причина<br>дефолта | Купон, %<br>годовых | Дата<br>погашени<br>я купона | Курс | Портфел<br>Б |   |
|                 |                    | 6,4                 | *****                        | 1    | cc           | 1 |
|                 |                    | 9,15                | ******                       | 1    | cc           | 1 |
|                 |                    | 9,25                | ******                       | 1    |              | I |
|                 |                    | 7,25                | ******                       | 1    |              | I |
|                 |                    | 7,4                 | ******                       | 1    |              |   |
|                 |                    | 7.3                 | ******                       | 1    |              | J |

б) На листе «ВЛА» проверить дату расчета СЗ и указать 1 в С4, если цены брать из «Портфель (RuData)» (то есть, как указано во входных данных), иначе указать цену самостоятельно. Нажать F9 (если дата не подтянулась);

в) На листе «ВЛА» нажать кнопку «Рассчитать» - заполнится таблица ниже и произойдет классификация активов на высоколиквидные и нет; Нажать F9, если не рассчитались столбцы N-P.

Замечание: Если ставка риска (столбец О) не определена (#знач), то необходимо проверить наличие на сайте НКЦ.

## 18. Файл-шаблон «portfolio\_limits»

Шаблон предназначен для контроля состава и структуры портфеля накоплений негосударственного пенсионного фонда согласно требованиям 580-П.

a) На листе «Portf», нажать кнопку «Import portfolio» и выбрать portfolio, который заполнен на дату проверки:

|             | 30.11.2020 |                | АО "НП | ⊅'НПФ |                       |              |     |         | lm    | port portfolio |              |        |            |                        |        |   |
|-------------|------------|----------------|--------|-------|-----------------------|--------------|-----|---------|-------|----------------|--------------|--------|------------|------------------------|--------|---|
| код         | кол-во     | стоимость      | AC/FV  | ПИФ   | Дата<br>оконч<br>ания | ИНН<br>Банка | тип | Класс а | ктива | Тип            | Выпуск       | ВАЛЮТА | Тип купона | Число купонов в<br>год | Страна | ſ |
| Ψ.          | -          | Ŧ              |        |       | -                     | -            | -   |         | -     | -              | -            | -      | -          | <b>_</b>               | -      |   |
| U000A0JV4L2 | 603900     | 620 350 236,00 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФЗ-29006-ПК | RUB    | Плавающий  | 2                      | RU     | П |
| U000A0JTJL3 | 34840      | 36 112 008,40  | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФЗ-26211-ПД | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A1014N4 | 607400     | 600 906 894,00 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФЗ-26232-ПД | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0ZYCK6 | 125000     | 129 283 750,00 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | 0Ф3-25083-ПД | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0ZYZ26 | 66046      | 73 615 008,91  | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФЗ-52002-ИН | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0JVMH1 | 74000      | 96 801 643,18  | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФ3-52001-ИН | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0JVW30 | 500302     | 509 752 704,78 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | 0Ф3-26217-ПД | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0JSMA2 | 140000     | 146 171 200,00 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | 0Ф3-26209-ПД | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A100QS2 | 229615     | 231 125 866,70 | FV     |       |                       |              |     | ГЦБ РФ  |       | Облигация      | ОФ3-24020-ПК | RUB    | Плавающий  | 4                      | RU     |   |

После загрузки данных внести необходимые признаки в столбцы AO, AS, AZ, BA, BF, если это необходимо:

| v             | AN           | AU  | AP                        | AU        | AK             | AD                | AL   | AU                              | AV         | AVV             | AA                                       | AT                              | AL                                  | DA       | DD           | DU    | DU                     | DE                     |    |
|---------------|--------------|---|---------------------------|-----------|----------------|-------------------|--|---------------------------------|------------|-----------------|--|---------------------------------|-------------------------------------|----------|--------------|-------|------------------------|------------------------|----|
|               |              | прос                                      | гавить 1 дл<br>юров и пок | я<br>упок | IsSubordinated | listing_l<br>evel | внести руками<br>Incli информацию, е<br>акция входит в | всли в сектор                   | CREDIT_CMP | Country         |  |                                 |                                     |          |              |       | проставит<br>депозитов | њ 1 суборд             |    |
| тинг<br>гента | Портфе<br>ль | до 10<br>Дата<br>покупки до<br>10.03.2017 | .03.2017<br>ПИФ           | Флоатер   | Суборд         | Листинг           | акций в этом с   | ока нет<br>егиенте<br>РИИ-Прайм | ко         | Страна<br>риска | Наилучший<br>гарант,<br>наименовани<br>е | Наилучш<br>ий<br>гарант,<br>ИНН | Наилучш<br>ий<br>гарант,<br>рейтинг | Портфель | Указани<br>е | 580-N | Суборд<br>депозит      | Рейтинги<br>абзац<br>т | Pe |
| .8            | NH1          | 1   | 0                         | 1         |                | 0                 |  | 1                               | - Ca       | 0 RUS           |  | 1                               | 1 1                                 | пн       | 580-N        | 1.1.1 |                        |                        |    |
| 24            | NH1          |   | C                         | 0         |                | 0                 |  |                                 | 3          | 0 RUS           |  |                                 |                                     | пн       | 580 🚸        | 1.1.1 |                        |                        |    |
| <u>.</u>      | ПН1          |   | 0                         | 0         |                | 0                 |  |                                 | 1          | 0 RUS           |  |                                 |                                     | ПН       | 580-II       | 1.1.1 |                        |                        |    |
|               | NH1          |   | C                         | 0         |                | 0                 |  |                                 |            | 0 RUS           |  |                                 |                                     | пн       | 580-II       | 1.1.1 |                        |                        |    |
|               | NH1          |   | 0                         | 0         |                | 0                 |  |                                 |            | 0 RUS           |  |                                 |                                     | пн       | 580-II       | 1.1.1 |                        |                        |    |
| •             | ПН1          |   | 0                         | 0         |                | 0                 |  |                                 |            | 0 RUS           |  |                                 |                                     | пн       | 580-II       | 111   |                        |                        |    |

Параметры АО – ВК – это данные, на основании которых вместе с данными их portfolio делается вывод к какому пункту указания с точки зрения классификации относится актив, а также соответствует или нет требованиям 580-П (по составу).

б) На вкладке «affNPF» внести ИНН УК и нажать кнопку загрузить, чтобы получить информацию по связанным лицам:

|            |            | Связанные  | лица УК  |           |
|------------|------------|------------|--|-----------|
| ИНН        | Группа     | ИНН связ   | Наим связ                                      |           |
| 7704750193 | 8601999494 | 8601043652 | ООО "МИКРОРАЙОН "ЦЕНТРАЛЬНЫЙ"                  | Загрузить |
|            |            | 8601069280 | ООО СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ЗАСТРОЙЩИК "24 КВАРТАЛ" |           |
|            |            | 8601042120 | 000 "CCT"                                      |           |
|            |            | 8601042458 | ООО "НПФ-ДИВИЗИОН"                             |           |
|            |            | 8601999494 | АО "ХАНТЫ-МАНСИЙСКИЙ НПФ"                      |           |
|            |            | 8601046621 | ООО "АЛЕКСАНДРИЯ 6-10"                         |           |
|            |            | 8601046646 | ООО "ШАИМСКИЙ ПК5"                             |           |
|            |            | 8601046445 | ООО "ЮГОРСКАЯ ЗВЕЗДА 1"                        |           |
|            |            | 8601026590 | ООО "ХАНТЫ-МАНСИЙСК СТРОЙРЕСУРС"               |           |
|            |            | 7725805164 | ООО "ОРЕОЛ УН"                                 |           |
|            |            | 7704750400 |  |           |

и внести полученные ИНН на листы «1.6(3)» и «1.6(4)»;

| Усл1                        | Усл1       |            |  |  |  |  |  |
|-----------------------------|------------|------------|--|--|--|--|--|
| Депозиты                    | 7704750193 |            |  |  |  |  |  |
| ИНН НПФ                     |            | 7705380065 |  |  |  |  |  |
| ИНН УК ПН                   |            | 7730149408 |  |  |  |  |  |
| ИНН УК ПР                   |            | 8601999494 |  |  |  |  |  |
| ИНН СПЕЦДЕП                 |            | 7709379423 |  |  |  |  |  |
| ИНН АКТУАРИИ<br>ИНН АУЛИТОР |            | 7722515837 |  |  |  |  |  |

в) Внести на лист «1.4.9» сумму производных финансовых инструментов и договоров РЕПО вручную в поле, выделенное синим цветом:

| Портфель       | 16 860 214 663,52 |
|----------------|-------------------|
| 1.4.9          |                   |
| Доля 1.4.9     | 0%                |
| Норматив       | 20%               |
| Отклонение     | 20%               |
| Предупреждение |                   |

г) На листе «1.4.5» нажать кнопку «рассчитать»:

| Портфель       | 16 860 214 663,52 |       |       |
|----------------|-------------------|-------|-------|
| 1.4.5          | 1 457 858 513,41  | Расчи | итать |
| Доля 1.4.5     | 9%                |       |       |
| Норматив       | 15%               |       |       |
| Отклонение     | 6%                |       |       |
| Предупреждение |                   |       |       |

д) **На листе «Итого»** отобразится отчет о нарушениях по каждому пункту 580-П в части структуры (согласно каждому пункту указания) и общее относительно нарушения состава:

| В          | С                | D |
|------------|------------------|---|
| 30.11.2020 | Контроль         |   |
| 1.4.1      |                  |   |
| 1.4.2      |                  |   |
| 1.4.3      |                  |   |
| 1.4.4      |                  |   |
| 1.4.5      |                  |   |
| 1.4.6      |                  |   |
| 1.4.7      |                  |   |
| 1.4.8      |                  |   |
| 1.4.9      |                  |   |
| 1.6(2)     |                  |   |
| 1.6(3)     |                  |   |
| 1.6(4)     |                  |   |
| 1.6(n3)    |                  |   |
| состав     | Норматив нарушен |   |

Детали о нарушении состава можно посмотреть на листе «Portf» в столбце BL – активы, для которых имеется нарушение или неоднозначность определения помечаются красным. Чтобы обнаружить такие проще всего отфильтровать по 0 в столбце BL. Также в столбце BC помечается «указать абзац 580-П», если автоматически актив невозможно отнести к пунктам 580-П (тогда в этом столбце BC можно сделать корректировку):

| зв        | BC           | BD                | BE                | BF                 | BG                   | BH                         | BI                  | BJ                 | BK                     | BL                    | BM   |
|-----------|--------------|-------------------|-------------------|--------------------|----------------------|----------------------------|---------------------|--------------------|------------------------|-----------------------|------|
|           |              | проставит         | гь 1 суборд<br>в  |                    |                      |                            |                     | _                  |                        |                       |      |
|           |              |                   |                   |                    |                      |                            |                     | Ото                | филь                   | гровано               | по 0 |
| зани<br>е | 580-N        | Суборд<br>депозит | Рейтинги<br>абзац | Рейтинги<br>страна | Граничный<br>рейтинг | Рейтинг<br>инструмент<br>а | Рейтинг<br>эмитента | Рейтинг<br>гаранта | Соотв<br>рейтиніа<br>м | Соответствие5<br>80-П |      |
| Ŧ         | -            | -                 | -                 | -                  | -                    | -                          | -                   | -                  |                        | <b>.</b> T.           |      |
| П         | 1.1.3        |                   |                   |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | 1.1.3        |                   | r                 |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | 1.1.2        |                   | 3                 | RU                 | 15                   | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | ац 580-П          |                   |                    | 0                    | 18                         | 11                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абз  | ац 580-П          |                   |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абз  | ац 580-П          |                   |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | 1.1.7        |                   | 11                | RU                 | 13                   | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | <u> </u>          |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | ац 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| П         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | ац 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абза | эц 580-П          | <u> </u>          |                    | 0                    | 18                         | 1                   | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| П         | указать абза | ац 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| п         | указать абз  | эц 580-П          | [                 |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
| П         | указать абза | ац 580-П          |                   |                    | 0                    | 18                         | 18                  | 18                 | 0                      | 0                     |      |
|           |              |                   |                   |                    |                      |                            |                     |                    | L                      |                       | J [] |

Детали о нарушении каждого пункта требований к структуре согласно 580-П можно посмотреть на одноименных с пунктами страницах:

| 1.4.1 1.4.2 1.4.3 1.4.4 1.4.5 1.4.6 1.4.7 1.4.8 1.4.9 1.6 (2) 1.6 (3) 1.6 (4) 1.6 (n |    |
|--|----|
|  | 3) |

Если норматив нарушен, то в графе «Предупреждение» появляется соответствующая запись, которая подсвечивается красным:

| L              |                   |  |
|----------------|-------------------|--|
| Портфель       | 16 849 489 558,97 |  |
| 1.4.3          | -                 |  |
| Доля 1.4.3     | 14%               |  |
| Норматив       | 5%                |  |
| Отклонение     | -9%               |  |
| Предупреждение | Норматив превышен |  |
|                |                   |  |

## 19. Файл-шаблон «portfolio \_limits\_2»

Шаблон предназначен для контроля состава и структуры портфеля резервов негосударственного пенсионного фонда согласно требованиям 5343-У.

**а) На листе «Доп. данные»** внести соответствующие ИНН. При наличии нескольких УК указать все (протянув руками формулу в столбце С);

| 1 |              | ИНН            | ИНН Группы              |
|---|--------------|----------------|-------------------------|
| 2 | ИНН НПФ      | 8601999494     | 8601999494              |
| 3 | ИНН СПЕЦДЕП  | 7705380065     |                         |
| 4 | ИНН АКТУАРИЙ |                |                         |
| 5 | ИНН АУДИТОР  |                |                         |
| 6 | ИНН ОЦЕНЩИК  |                |                         |
| 7 | ИНН УК ПН    | 7704750193     | 8601999494              |
| 8 | ИНН УК ПР    |                |                         |
| 9 | ИНН УК ПР    | 7709379423     |                         |
| 0 | ИНН УК ПР    | 7722515837     | 7722515837              |
| 1 |              |                |                         |
| 2 |              |                |                         |
|   | 🔶 🔸 Дог      | п. данные Port | f <mark>Итого</mark> Се |

**б) На листе «Portf»**, нажать кнопку «Import portfolio» и выбрать portfolio, который заполнен на дату проверки:

|             | 30.11.2020 |                | AO "HIId | у НПФ |                       |              |     |                         | Import portfolio |                         |        |            |                        |        | l |
|-------------|------------|----------------|----------|-------|-----------------------|--------------|-----|-------------------------|------------------|-------------------------|--------|------------|------------------------|--------|---|
| код         | кол-во     | стоимость      | AC/FV    | ПИФ   | Дата<br>оконч<br>ания | ИНН<br>Банка | тип | Класс актива            | Тип              | Выпуск                  | ВАЛЮТА | Тип купона | Число купонов в<br>год | Страна | ſ |
| U000A0JV4L2 | 603900     | 620 350 236,00 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-29006-ПК            | RUB    | Плавающий  | 2                      | RU     | 7 |
| U000A0JTJL3 | 34840      | 36 112 008,40  | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-26211-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A1014N4 | 607400     | 600 906 894,00 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-26232-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0ZYCK6 | 125000     | 129 283 750,00 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-25083-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A0ZYZ26 | 66046      | 73 615 008,91  | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФ3-52002-ИН            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     | П |
| U000A0JVMH1 | 74000      | 96 801 643,18  | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-52001-ИН            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     | П |
| U000A0JVW30 | 500302     | 509 752 704,78 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФ3-26217-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     | Т |
| U000A0JSMA2 | 140000     | 146 171 200,00 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-26209-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A100QS2 | 229615     | 231 125 866,70 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФ3-24020-ПК            | RUB    | Плавающий  | 4                      | RU     | П |
| 0000A0JX0H6 | 225000     | 228 386 250,00 | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФ3-29012-ПК            | RUB    | Плавающий  | 2                      | RU     |   |
| U000A0JXB41 | 13906      | 14 632 032,26  | FV       |       |                       |              |     | ГЦБ РФ                  | Облигация        | ОФЗ-26220-ПД            | RUB    | Постоянный | 2                      | RU     |   |
| U000A102G35 | 126450     | 123 675 479,62 | FV       |       |                       |              |     | Облигации субъектов РФ  | Облигация        | Московская Обл-35016-об | RUB    | Постоянный | 4                      | RU     | R |
| U000A0JTU85 | 37289      | 37 370 662,91  | FV       |       |                       |              |     | Облигации корпоративные | Облигация        | РЖД-28-об               | RUB    | Переменный | 2                      | RU     | 4 |
| U000A0JRLE8 | 2220       | 2 282 020,54   | FV       |       |                       |              |     | Облигации корпоративные | Облигация        | РСХБ-14-об              | RUB    | Переменный | 2                      | RU     |   |

После загрузки данных внести необходимые признаки в столбцы AO, AS, AZ, BA, BF, BE, если это необходимо:



Параметры АО – СО– это данные, на основании которых вместе с данными их portfolio делается вывод к какому пункту указания с точки зрения классификации относится актив, а также соответствует или нет требованиям 5343-У (по составу).

в) На странице «2.1.15» необходимо в ручном режиме указать объем акций, купленных до 31.03.2020;

| Портфель       | 11 378 525 254,76 |                      |
|----------------|-------------------|----------------------|
| 2.1.13         |                   | режиме, купленные до |
| Доля 2.1.13    | 0%                | 31.03.2020           |
| Норматив       | 25%               |                      |
| Отклонение     | 25%               |                      |
| Предупреждение |                   |                      |

г) **На листе «Итого»** отобразится отчет о нарушениях по каждому пункту 5343-У в части структуры и общее относительно нарушения состава;

| 2.1.1     | Норматив превышен |
|-----------|-------------------|
| 2.1.2     |                   |
| 2.1.3     |                   |
| 2.1.4     |                   |
| 2.1.5     |                   |
| 2.1.6     |                   |
| 2.1.7     |                   |
| 2.1.8     |                   |
| 2.1.9     |                   |
| 2.1.10    |                   |
| 2.1.11    |                   |
| 2.1.12    |                   |
| 2.1.13    |                   |
| 2.1.14    | Норматив превышен |
| 2.1.15    |                   |
| структура | Норматив нарушен  |

Детали о нарушении состава можно посмотреть на листе «Portf» в столбце СА – активы, для которых имеется нарушение или неоднозначность определения помечаются красным. Чтобы обнаружить такие проще всего отфильтровать по 0 в столбце СА. В столбце ВІ указывается пункт 5343-У, к которому относится актив. Если это поле пустое, то необходимо указать пункт, к которому относится актив согласно 5343-У.

|          | BG       | BH                | в       | BJ       | BK      | BL      | BM    | BN     | BO     | BP     | BQ | BR  | BS  | BT         | BU                 | BV      | BW         | BX                  | BY                 | BZ        | CA                 |       |
|----------|----------|-------------------|---------|----------|---------|---------|-------|--------|--------|--------|----|-----|-----|------------|--------------------|---------|------------|---------------------|--------------------|-----------|--------------------|-------|
| c        | простав  | ить 1 субор<br>ов | лд      |          |         |         |       |        |        |        |    |     |     |            |                    |         |            |                     |                    |           |                    |       |
|          |          |                   |         |          |         |         |       |        |        |        |    |     |     |            |                    |         | Paäraur    |                     |                    |           |                    |       |
| ад<br>ит | Портфель | Указание          | 5343 V  | иты      | гць     | и       | Акции | Недвиж | активы | дз     | RU | ю   | C/6 | ип         | Код рейтинг        | рейтинг | инструмент | Рейтинг<br>амитента | Райтинг<br>гаранта | рейтингам | Соотаетстане5343-У |       |
| ٣        | -        | -                 | -       | -        | -       | -       | -     | -      | -      | -      | -  | -   | -   | -          | <b>•</b>           | -       | -          | -                   | -                  | -         | ,T                 |       |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.3,2 |          | · · · · | 1.1.3,2 |       |        |        |        | RU | ~KO |     | ~ип        | 1.1.3,2RU**KO**wn  | 5       | 9          | 9                   | 9                  | 0         | 0                  | 113   |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.3,2 |          | r       | 1.1.3,2 |       |        |        |        | RU | ~KO |     | ~ип        | 1.1.3,2RU**KO**vin | 5       | 9          | 9                   | 18                 | 0         | 0                  | 1.1.3 |
|          | np       | 5343 y            | 1.1.3,2 |          | r       | 1.1.3,2 |       |        |        |        | RU | ~KO |     | °'MD       | 1.1.3,2RU**KO**wn  | 5       | 9          | 9                   | 9                  | 0         | 0                  | 1.1.3 |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.3,2 | · · · ·  | r       | 1.1.3,2 | ·     |        | r      |        | RU | ~KO |     | ~wп        | 1.1.3,2RU**KO**wn  | 5       | 9          | 9                   | 18                 | 0         | 0                  | 1.1.3 |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.8   |          | r       | r       | 1.1.8 |        |        |        | RU | ~KO |     | ~ип        | 1.1.8RU~KO~wn      | 4       | 9          | 9                   | 18                 | 0         | 0                  | 1.1.8 |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.8   | ·        | r       | r       | 1.1.8 |        | •      |        | RU | ~KO |     | "WIT       | 1.1.8RU~KO~wn      | 4       | 9          | 9                   | 18                 | 0         | 0                  | 1.1.8 |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.18  |          | r       |         |       |        |        | 1.1.18 | RU | ~KO |     | "WIT       | 1.1.18RU~KO~wn     | 18      | 18         | 9                   | 18                 | 1         | 0                  | 1.1.1 |
|          | ΠP       | 5343 y            | 1.1.19  | <b>1</b> | r       |         |       |        | 1.1.19 |        | RU | ~KO |     | тип 👘      | 1.1.19RU**KO**vn   | 18      | 18         | 9                   | 18                 | 1         | 0                  | 1.1.1 |
|          | ΠP       | 5343 y            |         |          | ·       |         |       |        |        |        | RU | ~KO |     | <b>"ип</b> | RU~KO~wn           | 4       | 18         | 9                   | 18                 | 0         | 0                  |       |
|          | ΠP       | 5343 y            |         | <b>1</b> | r       | ·       |       |        |        |        | RU | ~KO |     | тип        | RU~KO~wn           | 4       | 18         | 9                   | 18                 | 0         | 0                  |       |
|          | np.      | 5343 v            |         |          | r       | r       |       |        | r      |        | RH | ~KO |     | mum        | RUMKOmun           | 4       | 18         | 9                   | 18                 | n         | n                  |       |

Детали о нарушении каждого пункта требований к структуре согласно 5343-У можно посмотреть на одноименных с пунктами страницах:

| 2.1.1 | 2.1.2 | 2.1.3 | 2.1.4 | 2.1.5 | 2.1.6 | 2.1.7 | 2.1.8 | 2.1.9 | 2.1.10 | 2.1.11 | 2.1.12 | 2.1.13 | 2.1.14 | 2.1.15 |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|

Если какой-то норматив (пункт указания) нарушен, то в графе «Предупреждение» появляется соответствующая запись, которая подсвечивается красным:

| L              | 1                 |  |
|----------------|-------------------|--|
| Портфель       | 16 849 489 558,97 |  |
| 1.4.3          | -                 |  |
| Доля 1.4.3     | 14%               |  |
| Норматив       | 5%                |  |
| Отклонение     | -9%               |  |
| Предупреждение | Норматив превышен |  |
|                |                   |  |

Для проверки групп связанности и вывода информации о том, в какую группу входит контрагент (по ИНН) введена страница «affnpf». Для получения информации о связанности необходимо указать проверяемый ИНН в синем поле F3 и нажать кнопку «Загрузить»:

|   | F                       | G          | н          | I. I.              | J | К | L      | м     | N |
|---|-------------------------|------------|------------|--------------------|---|---|--------|-------|---|
|   |                         |            | Связанные  | лица УК            |   |   |        |       |   |
| C | <del>- ////</del>   1 - | Группа     | ИНН связ   | Наим связ          |   | Г |        |       |   |
|   | 7722515837              | 7722515837 | 7712025390 | АО "ГИПРОКИСЛОРОД" |   |   | 2 Загр | узить |   |
|   |                         | <b>,</b>   | 5001000066 | ПАО "КРИОГЕНМАШ"   |   | L | _      |       | J |
|   |                         |            | 6663059899 | TAO OM3            |   |   |        |       |   |
|   |                         |            | 7722515837 | АО "ГПБ - УА"      |   |   |        |       |   |
|   |                         |            | 7806026889 | ΔΟ "ΗΠΦ "ΗΚΕΔ"     |   |   |        |       |   |

## 20. Файл-шаблон «input\_154»

Шаблон для сбора входных данных из выгрузок клиента и автоматизации заполнения отчетных форм (таблиц) для таксономии (154 и 150 формы).

а) Открыть файл «Input 154» и файл реестр активов страховой компании;

б) На вкладке «Общий» заполнить поля дата расчета и ИНН. ИНН компании необходим для настройки шаблона под конкретного пользователя;

| Дата расчета | 31.08.2021 |
|--------------|------------|
| ИНН          |            |
| Наименование |            |
| Тип          | СК         |

Замечание: При выполнении шагов «в-г» и «ж» переносим мэппинги из ранее используемого Вами шаблона- лист «Table», если направляем пустые шаблоны.

#### в) На вкладке «Table» заполнить следующие столбцы:

Поля «Название книги» - имя Excel файла с данными для разделов форм или классов активов, «Реестр лист» - наименование листа, на котором расположен указанный раздел или класс актива;

| Таблица                                    |                    |        |         |
|--|--------------------|--------|---------|
|  |                    |        |         |
|  |                    |        |         |
|  |                    |        |         |
| Название книги                             | Реестр лист        | Раздел | Таблица |
|  |                    |        |         |
|  |                    |        |         |
| Рорма 0420154 Раздел 10+.xls               | Раздел 10          |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.1.+.х | I: Подраздел 12.1. |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.11+.) | «Подраздел 12.11.  |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.12.+. | » Подраздел 12.12. |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.2.+.х | I: Подраздел 12.2. |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.3.+.х | I: Подраздел 12.3. |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 12 Подраздел 12.4.+.х | l: Подраздел 12.4. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 13_Подраздел 13.2.+.х | l: Подраздел 13.2. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 13_Подраздел 13.8.+.х | l: Подраздел 13.8. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 14+.xls               | Раздел 14          |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 15+.xls               | Раздел 15          |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.1.+.х | l: Подраздел 17.1. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.2.+.х | l: Подраздел 17.2. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.3.+.х | l: Подраздел 17.3. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.4.+.х | l: Подраздел 17.4. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.7.+.х | l: Подраздел 17.7. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 17_Подраздел 17.8.+.х | l: Подраздел 17.8. |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 4_Подраздел 4.1 +.xls | Подраздел 4.1      |        |         |
| Форма 0420154_Раздел 4_Подраздел 4.2+.xls  | Подраздел 4.2      |        |         |
| Ферма 0420154_Раздел 4_Подраздел 4.3+.xls  | Подраздел 4.3      |        |         |
| Форма 0420154 Раздел 5+                    | Раздел 5           |        |         |

г) Произвести «меппинг» остальных столбцов на вкладке «Table» (соотнести названия столбцов в реестрах активов (входных данных) с названиями столбцов таксономии, проверить наличие данных);

д) Перейти на вкладку «FileList» и нажать на кнопку Список файлов. В появившемся окне выбрать папку с реестрами активов и нажать «да». Среди появившихся файлов выбрать необходимые для загрузки и отметить их «+», ненужные «-»;

<mark>Замечание</mark>: Для дальнейшего корректного заполнения Shared Table файлы из папки не должнь быть открыты.

e) Нажать на кнопку заполнить данные для заполнения листа Shared Table данными из файловреестров активов;

Данное число определяет, до какой строки включительно программа ищет заголовки по мэппингу. Если в файле заголовки расположены в 5 строке, оптимально указывать глубину поиска 5 и т.д. Данная функция позволяет существенно ускорить заполнение листа «ShareTable».

ж) Для дальнейшего корректного заполнения листов «банковские Д3+К3», «неRUData» и «ЦБ» необходимо:

• На листе «MatchTable» провести сопоставление названий столбцов «SharedTable» и банковские дз+кз/ЦБ;



- Внести информацию по контрагентам на соответствующий лист «Контрагенты»;
- Провести сопоставление вида актива из реестра клиента и класса активов СК на листе «для тип».



з) Нажать на листе «FileList» на кнопку «Создать Input» и выбрать вариант заполнения с очисткой листа или без. Выбираем «Да», если нужно заполнить данные заново, а не добавить к имеющимся;



После нажатие произойдёт автоматическая группировка данных из Shared Table на листы банковские ДЗ+КЗ, ЦБ и неRuData (для контрагентов, которых нет на соответствующем листе).

Замечание: При большом количестве строк в файлах процесс может занять некоторое время. Не закрывайте Excel файл!

Для пересчёта стоимости депозитов ответить на вопросы:

| Досрочное погашение депозитов                         |  |
|---|--|
| Все депозиты соотв. 3.2 и погашаются за 5 дней?       | «Да» и далее – «Нет», если нужно<br>заменить дату окончания депозита на  |
| Да Нет  | значение «дата расчета + 5 дней».  |
|   | «Нет» и далее – «Да», если во входных<br>данных указана верная дата окончания<br>депозита, учитывающая досрочное<br>окончание. |
| Досрочное погашение депозитов 🛛 👋                     |  |
| В дате погашения депозита учтено досрочное погашение? |  |
| Да Нет  |  |

и) Замечание: Далее переходим к работе с шаблоном «portfolio» согласно очередности, указанной на «FileList». Следующая часть выполняется после завершения работы с шаблоном insurstresstest. Для работы с указанными шаблонами сморите инструкцию по ним.

и) Настроить соответствие листов insurstresstest колонкам Shared Table на листе Insurance\_MatchTable (в направляемых шаблонах внесены базовые соответствия согласно методологии продукта, которые пользователь может редактировать);

|    | А  | В |  | С  |                   | D |                   |
|----|--|---|--|----|-------------------|---|-------------------|
| 1  | input154 👻   |   | insurstresstest 👻                          |    | лист              | - | Exception_Rules 👻 |
| 2  | Название книги   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 3  | Реестр лист  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 4  | Раздел   | 0 | пределяется по плохои/хорошии и класс акти | ва | Портфель (RuData) |   |                   |
| 5  | Таблица  |   | пределяется по плохои/хорошии и класс акти | ва | Портфель (RuData) |   |                   |
| 6  | Внутренний ID контрагента (ИНН, TIN, ОГРН, ОГРНИП)                                     |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 7  | Внутренний ID актива/обязательства   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 8  | Код валюты   |   | валюта2                                    |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 9  | Первоначальная стоимость на начало отчетного периода                                   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 10 | Первоначальная стоимость, поступило  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 11 | Первоначальная стоимость, выбыло   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 12 | Влияние валютных курсов  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 13 | Первоначальная стоимость на отчетную дату  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 14 | Балансовая стоимость   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 15 | Категория в бухгалтерской (финансовой) отчетности                                      |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 16 | Резерв под обесценение на начало отчетного периода                                     |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 17 | Начисление процентов   |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 18 | Изменение резерва под обесценение  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 19 | Резерв под обесценение на отчетную дату  |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 20 | Стоимость, определенная в соответствии с Положением Банка России № 710-П               |   | Стоимость с учетом плохой/хороший актив    |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 21 | стоимость, определенная в соответствии с положением Банка России № 710-11, в которую   |   | Сумма СР                                   |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 22 | стоимость, определенная в соответствии с положением ванка России № 710-11, в которую   |   | Сумма СС                                   |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 23 | Риски изменения стоимости активов в полном обвеме возложены на                         |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 24 | копии первичных документов переданы в специализированный депозитарии в                 |   |  |    |                   |   |                   |
| 25 | Поручительство (независимая гарантия) соответствует треоованиям подпункта 5.1.8 пункта | 1 | Гарант (наименование)                      |    | Портфель (RuData) |   | 3                 |
| 26 | Группа кредитного качества   |   | Группа кредитного качества_акт             |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 27 | Цена возмещения при дефолте  |   |  |    |                   |   |                   |
| 28 | Влияние риска изменения валютного курса (рост курса)                                   |   | CurrR                                      |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 29 | Влияние риска изменения валютного курса (снижение курса)                               |   | CurrR                                      |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 30 | паложен арест, иное обременение или обеспечительные меры, препитствующие               |   | заполнено изначально                       |    |                   |   |                   |
| 31 | Идентификационный номер поручителя (гаранта)   |   | ИНН гарант                                 |    | Портфель (RuData) |   |                   |
| 32 | Идентификатор доверительного управляющего  |   |  |    |                   |   |                   |

к) На листе «Rules» настроить попадание классов активов в соответствующие таблицы таксономии XBRL (в направляемых шаблонах внесены базовые соответствия согласно методологии продукта, которые пользователь может редактировать);

л) На листе «File List» нажать на кнопку «Импортировать insustresstest» для дополнения «Shared Table» данными из соответствующего файла. Выбрать заполненный файл «insustresstest»;

|             | А            |                                      | В                |                                   |                           |
|-------------|--------------|--------------------------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------------|
| 1<br>2<br>3 | Список       | файлов Заполнить данные              | Создать input    | Импортировать<br>insurstresstrest | Заполнить<br>страховщиков |
| 5           |              |                                      |                  |                                   |                           |
|             |              |                                      |                  |                                   |                           |
|             | 🔜 Рабочий с  | щ.: голипти нари                     | V1.11.202122.12  | JIVICE IVITCEOSOTE EX             | 17 KU                     |
|             | Локальны     | 🕼 Таблицы_Страховщики_4.2_Label      | 07.11.2021 22:39 | Лист Microsoft Ex                 | 1 431 KE                  |
|             | - Hokanbirbi | 🔊 Форма 0420154_Раздел 4_Подраздел 4 | 02.11.2021 17:18 | Лист Microsoft Ex                 | 31 KE 🧹                   |
| <b></b>     | Сеть         | v <                                  |                  |                                   | >                         |
|             |              | Имя файла: insurstresstest           | ~                | Все файлы                         | ~                         |
|             |              |                                      | Сервис 🔻         | Открыть Отм                       | ена                       |

м) Проверить корректное проставление таблиц таксономии для разделов на листе «SharedTable» (соответствует Вашим ожиданиям). Если не соответствует, вернуться к шагу к);

н) **На листе «File List»** нажать на кнопку «Экспорт для страховых» и выбрать файл «Таблицы\_Страховщики» для заполнения разделов 154 формы.

|  | A                | В            |             | C                                   | D E              |               |  |  |  |
|--|------------------|--------------|-------------|-------------------------------------|------------------|---------------|--|--|--|
| 1  | 1. Список файлов | 2. Заполнить | 3. Создать  | 4. Заполнить шаблон Portfolio       | 6. Импорт из     | 7. Экспорт    |  |  |  |
| 2  | т. список файлов | Shared Table | листы input | 5. Заполнить шаблон Insurstresstest | insurstresstrest | для страховых |  |  |  |
|  |                  |              |             |                                     |                  |               |  |  |  |
| Замечание: Листы, о которых не сказано в инструкции, несут служебный характер. |                  |              |             |                                     |                  |               |  |  |  |

### <u>Частые ошибки Input154</u>

 Для корректной работы шаблонов необходимо на листе «Table» указать столбец, где во входных данных находятся внутренние идентификаторы (для ценной бумаги только идентификатор бумаги - ISIN, для иных инструментов - ИНН или TIN для контрагента, а также любой идентификатор (пусть идентификатор актива) как код инструмента);

Если не заполнен «Внутренний ID актива/обязательства», то данные могут не уйти в portfolio, а значит не посчитаются риски. Если не заполнен «Внутренний ID контрагента (ИНН, TIN, ОГРН, ОГРНИП)», то по контрагенту не будет загружаться инфо, так как его нет идентификатора для загрузки этой инфо.

- Для оценки рисков в input154 нужно сформировать «укороченный» input кнопка «3. Создать листы input» на листе «FileList». При этом активы, по контрагентам которых нет данные в RUData, выносятся на лист «неRuData»:
  - ЮЛ добавляются в БД RUData по запросу на Службу поддержки. Принимаются к добавлению контрагенты, по которым есть лицензии (медицинские и финрынок), данные о банкротствах или информация о рейтингах. ФЛ в БД RUData не добавляются;

 данные о ФЛ выносятся пользователем на лист «Контрагенты», указывая название и тип. ЮЛ также можно вынести на лист «Контрагенты» до добавления в RUData, чтобы не ждать добавления.

Если по контрагенту не подгрузилось наименование – столбец «Тип ЮЛ/ФЛ/ИП» или «Эмитент», то проверить, что на листе «Контрагенты» верно указан ИНН (внутренний идентификатор контрагента). Если неверно – отредактировать.

- Если не загрузились стоимости или иные колонки на листах «укороченного» input («Общий», «банковские+дз+кз», «ЦБ», «неRuData») они нужны для оценки рисков проверить меппинг на листе Table:
  - Заполнены на листе «Table» все колонки, которые используются на листе «MatchTable» данные из них переносятся в короткий input после заполнения листа «sharedtable»;
  - о Все колонки, указанные на листах «MatchTable» и листе «Table» есть во входных данных.

## 21. Файл-шаблон «511р»

Шаблон для оценки рисков согласно Basel 3.

#### a) На листе «Сводный отчет» нажать кнопку «1.Импорт portfolio» для загрузки данных.

|  |   |              |                  |                                  |             |              |             |                     |     | дополнительн | ые валюты |
|--|---|--------------|------------------|----------------------------------|-------------|--------------|-------------|---------------------|-----|--------------|-----------|
| СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА |   |              | Положения ЦБ РФ: |                                  | 511-П/мар19 | 199-И/янв20  | 421-П/окт19 |                     |     |              |           |
|  |   |              |                  | Заморозка рейтингов:             |             | Да           |             | 1. Импорт portfolio |     |              |           |
| Дата:                                    | 30.09.2020  | Выбрать дату |                  | Размерность исходных данных: р   |             | руб          |             |                     |     | 2. Полны     | расчет    |
|  |   |              |                  | Корректировка на ликвидность: не |             | не вычислять |             |                     |     |              |           |
|  |   |              |                  | Период ликвидации, дней:         |             | 10           |             |                     |     |              |           |
| Номер                                    | Наименование  | рнска        |                  | Размер риска                     |             |              |             |                     |     |              |           |
| n/n                                      | Итого   |              | RUB              | USD                              | EUR         | GBP          | CHF         | JPY                 | GLD |              |           |
| 1  | 1 Процентный риск (ПР)  |              | 0,00             |                                  |             |              |             |                     |     |              |           |
| 2  | общий   |              | 0,00             |                                  |             |              |             |                     |     |              |           |
| •  | Сводный отчет Состав портфеля Биржевые ПФИ Греки ГВР ОПР ТР 🕂 : 📢 |              |                  |                                  |             |              |             |                     |     |              |           |
|  |   |              |                  |                                  |             |              |             |                     |     |              |           |

Данные загружаются на лист «Состав портфеля».

б) На листе «Сводный отчет» нажать кнопку «2. Полный расчет» для проведения оценки рисков.

Замечание: остальные вкладки позволяют внести дополнительные данные для оценки рисков. Инструкцию можно запросить у Службы поддержки.

#### СЛУЖБА ПОДДЕРЖКИ RUData +7 495 357 2077 help@ rudata.info

- ответит на вопросы по работе с сервисами;
- проведет обучение для пользователей;
- настроит индивидуальную выгрузку данных под Ваши потребности;
- расскажет обо всех обновлениях системы.