

The logo consists of the text "RU DATA" in a bold, dark grey, sans-serif font, enclosed within a teal-colored rectangular frame with rounded corners.

RU DATA

REFERENCE UNITED DATA

ЕДИНЫЙ СПРАВОЧНИК ПО ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ И ЭМИТЕНТАМ

www.rudata.info

верифицированный источник данных по эмитентам и финансовым инструментам, объединяющий информацию по рынку ценных бумаг

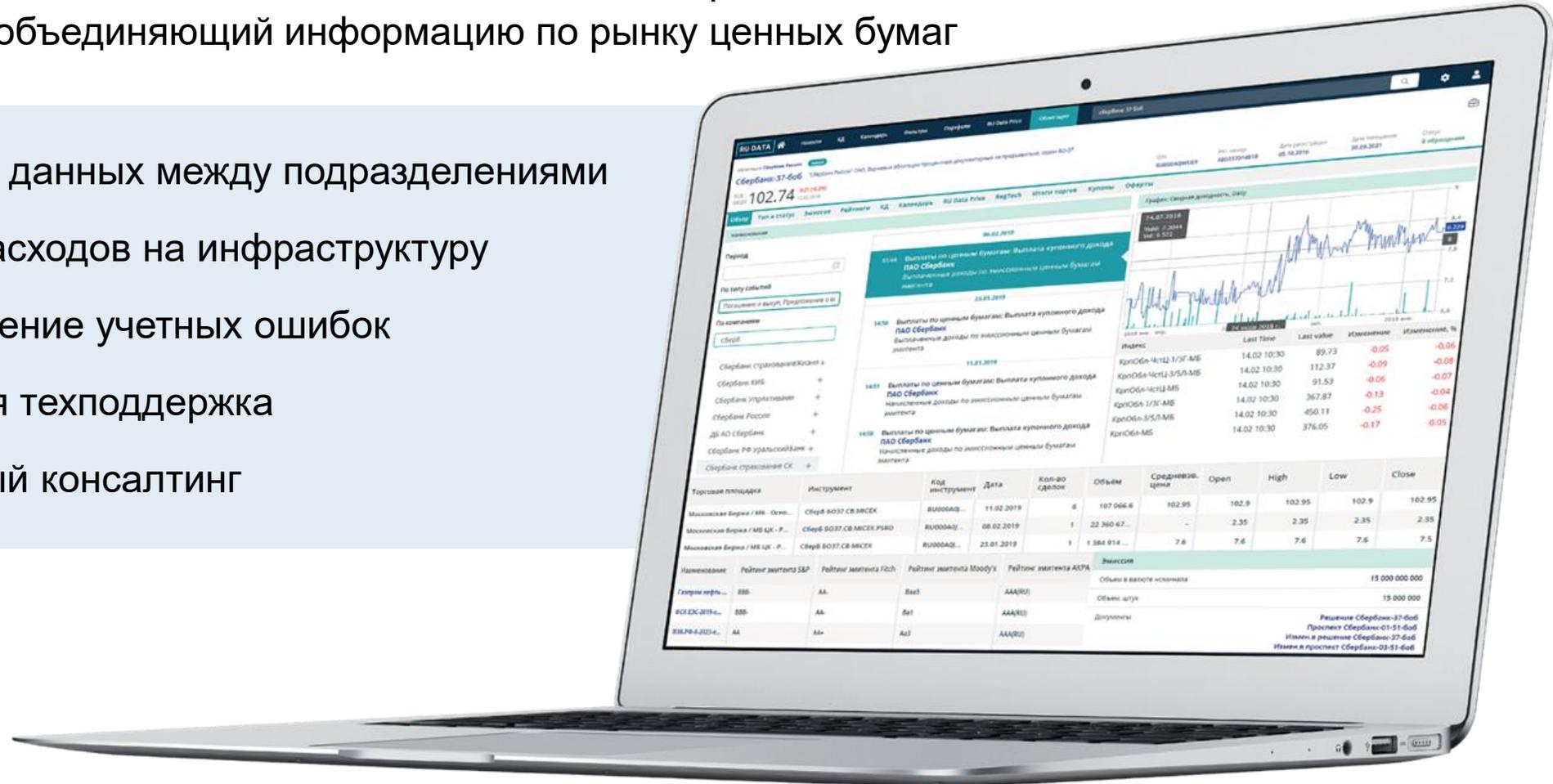
1 унификация данных между подразделениями

2 снижение расходов на инфраструктуру

3 предотвращение учетных ошибок

4 оперативная техподдержка

5 регуляторный консалтинг



ДОСТУП К RU Data



Для быстрого просмотра
данных

www.rudata.info



Для интеграции с корпоративной
системой

RestAPI



Для формирования индивидуальных
выгрузок, автоматизации локальных
процессов и получения данных

MS Excel



Для принятия решений на рынке
ценных бумаг

Терминал ЭФИР



СИНЕРГИЯ УЧАСТНИКОВ RU DATA

УЧАСТНИКИ	НРД	«ИНТЕРФАКС»
СТАТУС	Центральный депозитарий и центр корпоративных действий. Официальный первоисточник	Уполномоченное агентство по раскрытию информации. Лидер российского информационного рынка
ОПЕРАТИВНОСТЬ	Данные фиксируются по факту получения всех документов по официальным каналам	Данные, поступающие напрямую от эмитентов, с момента появления на рынке в режиме онлайн
ОХВАТ	60% рынка (инструменты, принятые на обслуживание в НРД)	100% рынка торгуемых инструментов, включая внебиржевые
ШИРОТА ДАННЫХ	Информация о корпоративных действиях по бумагам, принятым на обслуживании в НРД (60% рынка), а также факторы расчета цен от Ценового центра НРД	Полная база сущ. фактов, доп. данные (рейтинги, календари, расчетные поля и инструменты для риск-менеджмента), а также ценовая информация от Базы данных ЭФИР с расчетными полями
ВЕРИФИКАЦИЯ	Верификация встречных потоков данных от эмитентов и регистраторов, Банка России и Интерфакса	Первичная верификация и контрольная сверка объединенного потока после получения данных НРД

ТЕХНОЛОГИЧЕСКОЕ РЕШЕНИЕ RU DATA





RU Data – БАЗА ДАННЫХ

1 СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

подробная справочная информация по эмитентам (гарантам, поручителям) и выпущенным ими ценным бумагам (внешние и внутренние облигации, акции, депо-расписки, паи, ИСУ, ПФИ и т.д.)

2 КАЛЕНДАРИ

потоки платежей: календари купонов, оферт, погашений, досрочных погашений, конвертаций, дивидендов, дефолтов

3 КОРПОРАТИВНЫЕ ДЕЙСТВИЯ

корпоративные действия в структурированном виде с максимальной детализацией ключевой информации

4 КРЕДИТНЫЕ РЕЙТИНГИ

международные и национальные КРА, включая: АКРА, Эксперт РА, НКР, НРА; 350 видов рейтингов, 100 шкал; все рейтинговые действия и агрегация для НПА; срез на заданную дату и полная история рейтинговых событий.

5 ЦЕНОВАЯ ИНФОРМАЦИЯ

биржевые и внебиржевые цены с российских и иностранных площадок; валюты, ставки, индексы, товары, фьючерсы, свопы, форварды; покрытие всех основных международных рынков; индексные цены Интерфакс RUDIP для оценки ТСС и СЧА; справедливые стоимости от Ценового центра НРД.

6 БИБЛИОТЕКА ДАННЫХ ДЛЯ БРОКЕРСКИХ РЕШЕНИЙ

мультипликаторы, описание деятельности компаний, «светофор» кредитной оценки, рейтинг ликвидности и др.

7 БИБЛИОТЕКА ДАННЫХ ДЛЯ НФО

структурированные данные для Положения 710-П, в т.ч. банкротства, обременения, лицензии НФО, попадание в листинг / котировальные списки.



СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

ПОДРОБНАЯ СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ С ДОСТУПОМ К ЭМИССИОННЫМ ДОКУМЕНТАМ



справочная информация по эмитентам, поручителям, гарантам, финансовым посредникам и их инструментам (внешним и внутренним облигациям, акциям, депозитарным распискам, производственным финансовым инструментам, паевым фондам, ипотечным сертификатам и др.)



более **120 полей параметров** на инструмент (например, «Тип выпуска», «CFI код», «Объем в обращении в валюте номинала» и др.)



связь с организаторами (более 30 ролей, которые могут играть компании по отношению к выпуску)



информация по **бумагам**, которые только **готовятся к размещению**, идентификаторы и основные параметры организаций



качество данных, проходящих тройную верификацию:

фильтрация встречных потоков данных от эмитентов и регистраторов, Банка России и «Интерфакс» в НРД

поиск несоответствий и проверка на связанность информации

контрольная сверка объединенного потока данных «Интерфаксом»



КАЛЕНДАРИ

КАЛЕНДАРИ КУПОНОВ, ОФЕРТ, ПОГАШЕНИЙ, КОНВЕРТАЦИЙ, ДИВИДЕНДОВ, ДЕФОЛТОВ

- полный цикл отслеживания календарей: от исторических, текущих и до погашения
- охват по всем выпускам, обращающимся на рынке
- учет выходных и праздничных дней
- информация, позволяющая точно оценить реальную доходность, дюрацию и риски по бумагам

NEW!
Календари клиринговых центров, торговые дни, производственные календари стран и валютных зон.

RU DATA																
Облигации: купоны Облигации: погашения Облигации: доср. погашения (оферты) Акции: дивиденды Конвертации																
Инструмент	Эмитент	Номер	Тип купона	Начало куп. периода	Конец куп. периода	Дата фикс. реестра	Факт. дата выплаты	Дата опред. куп. ставки	Ставка купона, %	Выплата на 1 облиг.	Выплаты на все облиг.	Кол-во бумаг в выплате	Дней с даты разм.	Дней в периоде	Валюта	
Металлург-Р-01-об	Металлург КБ	16	Прочий	26.12.2018	27.03.2019	-	-	-	-	-	-	-	1456	91	RUB	
Бинбанк-3-2019-евро	B&N Bonds D.A.C	6	Постоян...	27.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	8.5	42.5	6 375 000	150 000	1101	180	USD	
РСХБ-28-об	Россельхозбанк	13	Постоян...	26.12.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	12.87	32.09	160 434 0...	4 999 501	1183	91	RUB	
ОФЗ-26219-ПД	Минфин РФ	6	Постоян...	26.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	7.75	38.64	13 524 00...	350 000 0...	1001	182	RUB	
ИАВ 4-1-об	ИАВ 4	44	Постоян...	27.02.2019	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	21.02.2019	9	1.28	3 840 000	3 000 000	1393	28	RUB	
Турция-200324-об	Минфин Турции	10	Постоян...	26.09.2018	27.03.2019	-	-	-	10.4	0.052	394 555 2...	7 587 600...	1820	182	TRY	
Турция-270319-об	Минфин Турции	10	Постоян...	26.09.2018	27.03.2019	-	-	-	10.4	0.052	412 718.8...	7 936 900...	1820	182	TRY	
Саха Респ-35006-об	Минфин Саха (Якутия)	19	Постоян...	26.12.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	10.1	7.55	18 875 000	2 500 000	1729	91	RUB	
ДельтаКредит-14-об	ДельтаКредит КБ	20	Постоян...	27.12.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	12	29.59	147 950 0...	5 000 000	1826	90	RUB	
КМЗ-1-об	Курганмашзавод	7	Постоян...	26.09.2018	27.03.2019	-	-	-	9	44.88	-	-	1274	182	RUB	
ОФЗ-26126-ПД	Минфин РФ	19	Постоян...	28.03.2018	27.03.2019	-	-	-	2	19.95	0	0	6676	364	RUB	
Инград-1-об	Инград	6	Плавако...	26.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	-	-	-	-	-	1092	182	RUB	
Времен-19-об	Бремен Прав	26	Плавако...	27.12.2018	27.03.2019	-	-	25.12.2018	0	0	0	-	2372	90	EUR	
Турция-180924-об	Минфин Турции	9	Плавако...	26.09.2018	27.03.2019	-	-	-	-	-	-	-	1638	182	TRY	
СИБУР Холдинг-12-об	СИБУР Холдинг	5	Перемен...	26.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	22.09.2016	9.65	48.12	481 178 0...	9 999 543	910	182	RUB	
ПКТ-3-об	ПКТ	6	Перемен...	26.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	25.03.2016	12.5	62.33	311 644 0...	4 999 904	1092	182	RUB	
Европлан ЛК-1-об	Европлан ЛК	11	Перемен...	26.09.2018	27.03.2019	26.03.2019	27.03.2019	14.09.2018	9.5	47.37	94 740 000	2 000 000	2002	182	RUB	



КОРПОРАТИВНЫЕ ДЕЙСТВИЯ

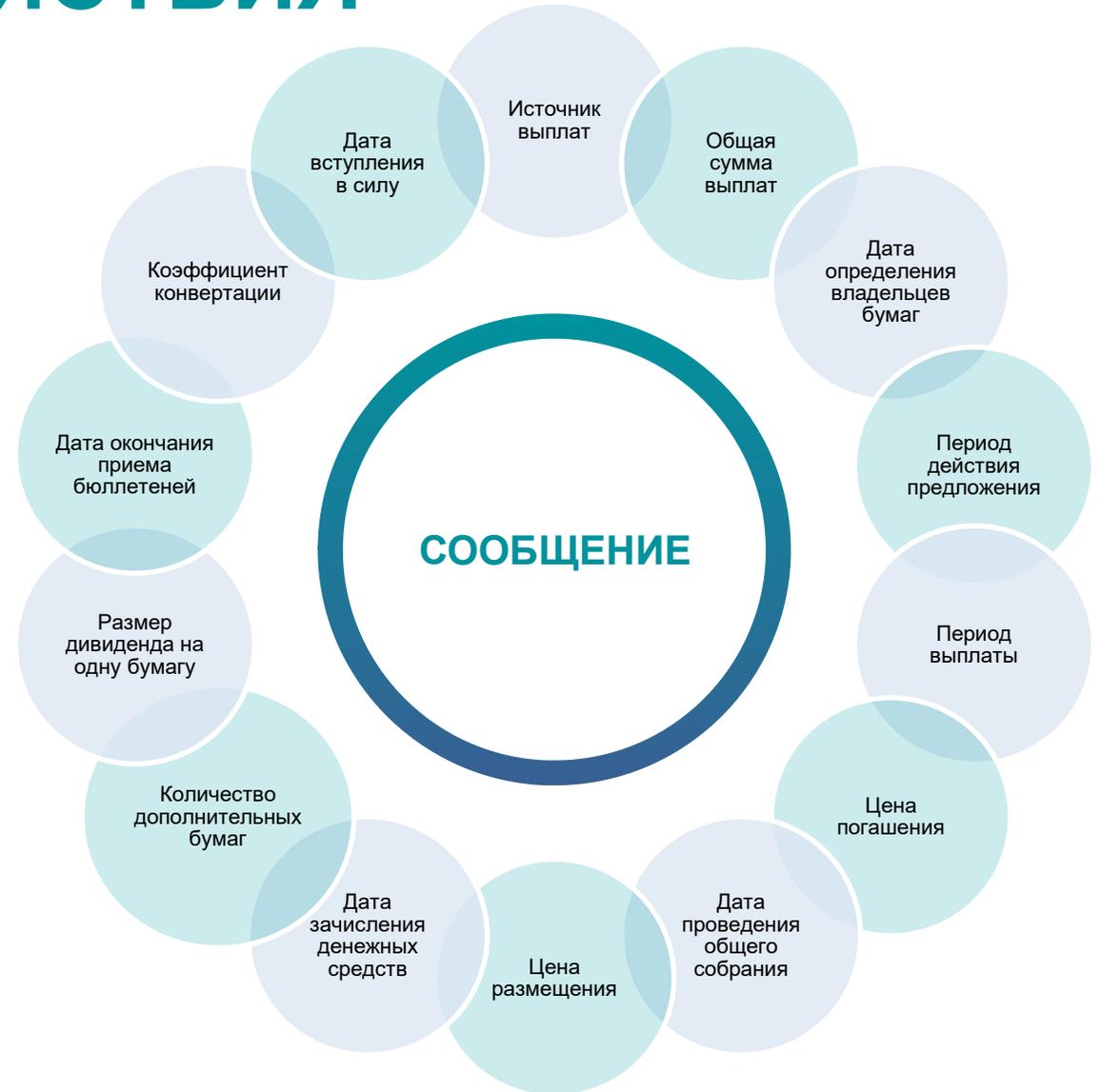
ОСНОВНЫЕ ПАРАМЕТРЫ РАСКРЫТИЯ

Формат выделяет

40

типов
корпоративных
событий, покрывающих
корпоративную
деятельность
эмитента

Структурированная и форматированная информация о корпоративных действиях на основе «**Единого окна раскрытия информации**» эмитентов с архивом эмиссионных документов





КРЕДИТНЫЕ РЕЙТИНГИ

«ИНТЕРФАКС» ЯВЛЯЕТСЯ ОФИЦИАЛЬНЫМ ПАРТНЕРОМ АКРА, ЭКСПЕРТ РА, НКР, НРА

- рейтинги по эмитентам и инструментам как за дату, так и за любой период времени
- связка: эмиссия – оператор – реальный заемщик – гарант
- доступны рейтинговые действия, а также архивы

NEW!

Композит/свертка - универсальная агрегация рейтингов (max/min) по всем основным регуляторным моделям

The screenshot shows the RU DATA website interface. The top navigation bar includes 'RU DATA', 'Новости', 'КД', 'Календарь', 'Фильтры', 'Рынки', 'Портфели', 'Аффилированные лица', and 'ГПБ-7-606'. Below the navigation, the page title is 'Облигация Банк ГПБ' and 'ГПБ-7-606 "Газпромбанк" АО, облигации биржевые процентные документарные на предъявителя, серия БО-07'. The page features a table of ratings with columns for 'Дата', 'Агентство', 'Код рейтинга', 'Наименование рейтинга', 'Значение', 'Изменение', and 'Прогноз'. The table lists several ratings from Dagong and Fitch agencies, including credit ratings for international and national currencies, and default ratings for international and national currencies.

Дата	Агентство	Код рейтинга	Наименование рейтинга	Значение	Изменение	Прогноз
18.03.2015	Dagong	DGN-I-Cr&D-LT-Isc-Icur	Кредитный рейтинг эмитента, долгосрочный, международная шкала, иностранная валюта	A-	Установлен	Стабильный
18.03.2015	Dagong	DGN-I-Cr&D-LT-Isc-Ncur	Кредитный рейтинг эмитента, долгосрочный, международная шкала, национальная валюта	A-	Установлен	Стабильный
22.11.2018	Fitch	FCH-I-VIR	Рейтинг устойчивости	bb-	Подтвержден	-
19.08.2019	Fitch	FCH-I-Dflt-LT-Isc-Icur	Рейтинг дефолта эмитента, долгосрочный, международная шкала, иностранная валюта	BBB-	Повышен	Стабильный
19.08.2019	Fitch	FCH-I-Dflt-LT-Isc-Ncur	Рейтинг дефолта эмитента, долгосрочный, международная шкала, национальная валюта	BBB-	Повышен	Стабильный
19.08.2019	Fitch	FCH-I-Dflt-SHT-Isc-Icur	Рейтинг дефолта эмитента, краткосрочный, иностранная валюта	F3	Повышен	-



ЦЕНОВАЯ ИНФОРМАЦИЯ

ПОКРЫТИЕ РОССИЙСКОГО И МЕЖДУНАРОДНЫХ РЫНКОВ

5

БЛОК ДАННЫХ

I. КАЛЬКУЛЯТОР МСФО-13 И ИНДЕКСЫ ЕВРООБЛИГАЦИЙ

- проверка адекватности справедливых стоимостей
- обоснование корректности оценки ТСС и переоценка позиций (корректировка стоимости)
- оценка справедливой стоимости в том числе и по методике, аккредитованной Банком России
- семейство индексов по еврообондам, включая состав индексов с указанием веса

II. ЦЕНОВАЯ СТАТИСТИКА

- итоги торгов с биржевых и внебиржевых площадок, включая валюты, ставки, индексы, товары, фьючерсы, свопы, форварды и др.
- биржевая и внебиржевая статистика
- архивы
- индексные цены Интерфакс: RUDIP
- RU Data Price: методики Ценового Центра НРД с расширенными параметрами
- три уровня иерархии цены в зависимости от активности и ликвидности инструмента

III. РЫНОЧНЫЕ И КРЕДИТНЫЕ РИСКИ

- агрегированный показатель активности торгов
- рейтинг ликвидности
- корректировка на ликвидность стоимости позиции (в соответствии с Положением ЦБ РФ №511-П)
- показатели VaR и ES
- stress-testing
- дюрации, выпуклости, basis point value (BPV)

СОСТАВ ИНФОРМАЦИИ

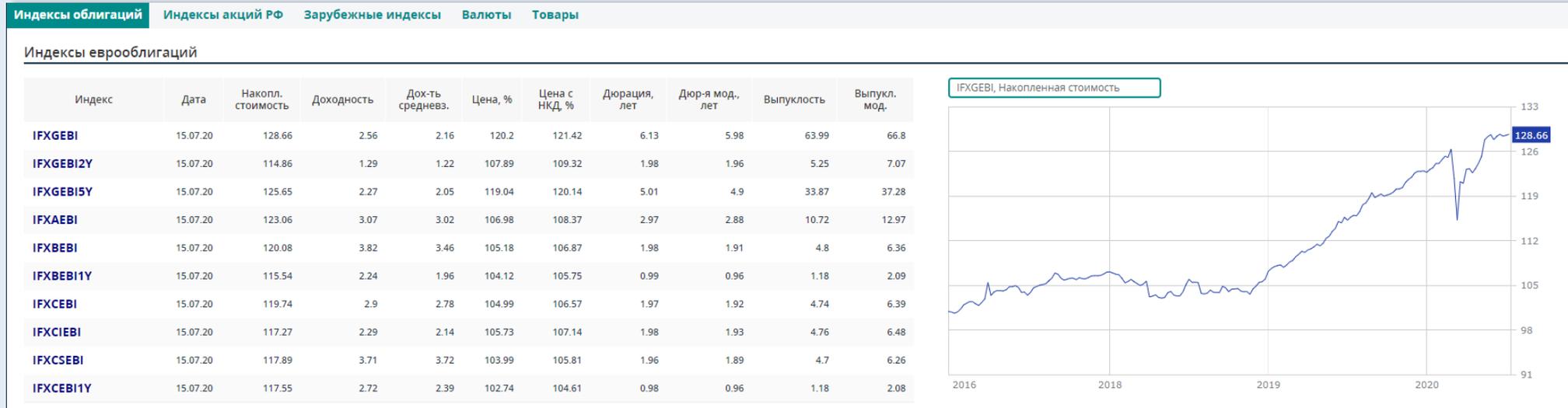
Больше информации о RU Data Price | https://rudata.info/files/rudata/landing/documents/RU_DATA_PRICE_PREZ.pdf



ЦЕНОВАЯ ИНФОРМАЦИЯ: RUDIP

ОЦЕНКА СТОИМОСТИ ЕВРООБЛИГАЦИЙ С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ ИНДЕКСОВ И ВНЕБИРЖЕВЫХ ДАННЫХ

- RUDIP – индексные цены на основе лучших котировок и сделок с торговых площадок (аналог BGN)
- оценка стоимости еврооблигаций на основе данных биржевых и внебиржевых сделок (MiFID II)
- оценка низколиквидных евробондов на основе семейства индексов Интерфакс IFXEVI





ОСНОВНАЯ СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ И КАЛЕНДАРИ

- Корпоративные действия
- Характеристики ценных бумаг и эмитентов
- Расширенные календари событий
- Текстовые описания деятельности
- Логотипы

АНАЛИТИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ ДЛЯ ЧАСТНОГО ИНВЕСТОРА

- Мультипликаторы по эмитентам
- ESG рейтинги
- Светофор кредитной оценки
- Консенсус-прогнозы
- Риск проскальзывания (ликвидность)
- Дюрация
- VaR
- Ценовые шоки

ЦЕНОВАЯ ИНФОРМАЦИЯ И МАРКИРОВКА ИНСТРУМЕНТОВ

- Маркировка финансовых инструментов (квал./неквал.)
- Итоги торгов
- Еврооблигационные индексы
- Внебиржевой рынок еврооблигаций



Библиотека данных для НФО: Solvency

СТРУКТУРИРОВАННАЯ ИНФОРМАЦИЯ ДЛЯ НФО И АВТОМАТИЗАЦИЯ РЕГУЛЯТОРНОЙ ОТЧЕТНОСТИ

Справочные данные по бумаге

- В т.ч. конвертируемость в акции, субординируемость, наличие дефолта, наличие залога, попадание в листинг или котировальные списки)
- Связь выпуск-эмитент/гарант/поручитель

Для обязанных лиц и контрагентов:

- Банкротства организаций, обременения и аресты на имущество
- Лицензии НФО (в том числе, инфраструктурные организации и перестраховщики)
- Лицензии фин. рынка (в том числе, инфраструктурные организации и перестраховщики) и медицинские
- Списки стран (ЕАЭС, ОЭСР, ЕС, БРИКС, ШОС)

Агрегированные рейтинги финансовых инструментов и обязанных лиц:

- Решения советов директоров (список рейтингов и граничные значения)
- Таблица соответствия шкал
- Кредитное качество

Калькулятор облигаций и итоги торгов:

- Расчет дюрации, выпуклости, доходности, НКД
- Информация о дате погашения и досрочного погашения

Risk-free по USD и RUB и другие параметры 710-П



RD – СЕРВИСЫ

1 RD Risk (ЭФИР Add-In)

автоматизация требований Банка России: Положение №511-П, Инструкция №199-И, Положение №421-П, расчет нагрузки на капитал в разрезе каждой позиции как в торговом, так и в инвестиционном портфеле ценных бумаг

2 RD Affiliate

цепочки связей на основании собранной информационной базы

3 RD FOR

оценка рисков НФО и автоматизация регуляторной отчетности для Банка России, в том числе, оценка рисков: стресс-тестирование для НПФ (4060-У), Solvency II (РОПР) для страховых и Basel III для ПУРЦБ (4501-У)

4 RD Score

интеллектуальная система анализа финансовой отчетности эмитентов

5 RD Обращаемость

показатель обращаемости для учета налогообложения НДФЛ

6 SPPI-тестирование

автоматизированное проведения SPPI-теста для долговых ценных бумаг

7 Калькуляторы и риск-метрики

нестандартные и кастомизированные решения



RD Risk (ЭФИР Add-In)

АВТОМАТИЗАЦИЯ РАСЧЕТА РЕГУЛЯТОРНЫХ ТРЕБОВАНИЙ БАНКА РОССИИ

- расчет рыночного риска торгового портфеля ценных бумаг, ОВП и ПФИ (Положение № 511-П)
- расчет кредитного риска инвестиционного портфеля ценных бумаг и ПФИ (Инструкция № 199-И)
- расчет показателя краткосрочной ликвидности (ПКЛ, Положение № 421-П)
- оценка нагрузки на капитал, в том числе с учетом корректировки на ликвидность финансовых инструментов
- стресс-тестирование на основе сценарных моделей в соответствии с Базель II (193-Т)

СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА		Положения ЦБ РФ: 4969-У		421-П (new)					
Дата: 22.03.2019		Выбрать дату		Заморозка рейтингов: Да		Полный расчет			
				Размерность исходных данных: руб					
				Корректировка на ликвидность: не вычислять					
				Период ликвидации, дней: 10					
Номер п/п	Наименование риска	Итого	Размер риска						
			RUB	USD	EUR	GBP	CHF	JPY	GLD
1	Процентный риск (ПР)	2 347 856 042,52							
2	общий	155 219 792,52	79 033 005,73	53 252 566,74	22 934 220,04	0,00			
3	специальный	2 192 636 250,00	1 944 636 250,00	152 000 000,00	96 000 000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
4	гамма и вега	0,00	X	X	X	X	X	X	X
5	Фондовый риск (ФР)	450 352 757,60							
6	общий	131 335 160,22	104 260 460,70	3 074 699,51	16 000 000,00	8 000 000,00	0,00	0,00	0,00
7	специальный	312 396 357,27	104 260 460,70	184 135 896,56	16 000 000,00	8 000 000,00	0,00	0,00	0,00
8	гамма и вега	6 621 240,11	X	X	X	X	X	X	X
9	Валютный риск (ВР)	24 891 512,02	X	X	X	X	X	X	X
10	РВА по ОВП	16 000 000,00	X	10 000 000,00	2 000 000,00	1 600 000,00	0,00	0,00	2 400 000,00
11	гамма и вега	8 891 512,02	X	X	X	X	X	X	X
12	Товарный риск (ТР)	94 416 282,82							
13	общий	68 999 219,41	68 999 219,41	X	X	X	X	X	X
14	дополнительный	23 949 733,86	23 949 733,86	X	X	X	X	X	X
15	гамма и вега	1 467 329,56	X	X	X	X	X	X	X
16	Рыночный риск (РР)	36 468 957 437	X	X	X	X	X	X	X

Больше информации о RD Risk | https://rudata.info/files/rudata/add-in/documents/efir_add_in_19.pdf



1

полное соответствие требованиям Банка России к связанным (аффилированным) лицам: 208-ФЗ, 75-ФЗ и 4015-1-ФЗ, 39-ФЗ, а также требованиям к составу и структуре активов

2

собранная информационная база построена по данным публичной отчетности некредитных финансовых организаций и эмитентов ценных бумаг об их аффилированных лицах (МСФО 24)

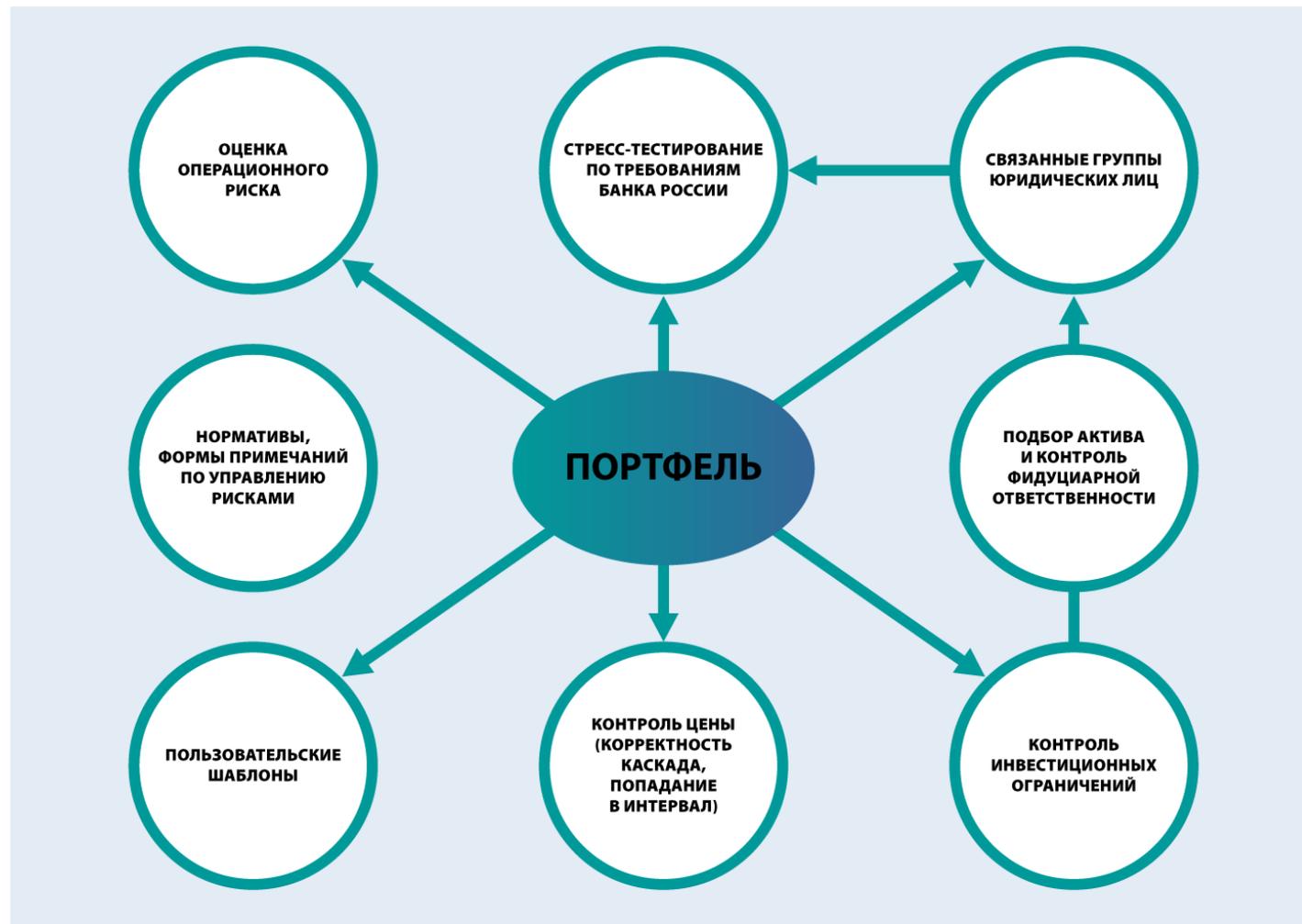
The screenshot displays the 'Аффилированные лица' (Affiliated Entities) section for 'Банк ВТБ (ЗАО)' (Bank VTB (JSC)). The interface includes a search bar, filters, and a table of affiliated entities. The table columns are: Тип (Type), Наименование (Name), Тип аффилированности (Type of affiliation), and Подтверждающие документы (Supporting documents). The table lists 20 affiliated entities, all categorized as 'Одна группа лиц' (One group of persons). The supporting documents for each entry are 'Первый документ' (First document) and 'Последний документ' (Last document). The table is paginated, showing 17 items on the first page.

Тип	Наименование	Тип аффилированности	Подтверждающие документы
И	Airport Alliance (Netherlands) B.V.	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Airera Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Anglo Capital Limited (BVI)	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Banco VTB Africa, SA	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	BM Holding AG	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	BoM Asset Management Ltd.	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	BoM Finance Ltd.	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	BoM Project Financing Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	CAPRA INVESTMENTS LIMITED	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Cesney Trading Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	CITec Invest B.V.	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Comfast Enterprises Limited (Kamp)	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Critinium Bay Holding Limited (Cyprus)	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Crossplanet Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	EMBASSY DEVELOPMENT LIMITED	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Euroleasing GmbH	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Franzoa Investments Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Golden Star Investments Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Golden Star VTB Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ
И	Ipwameta Holdings Limited	Одна группа лиц	Первый документ, Последний документ

ВИДЫ ОРГАНИЗАЦИИ



РОЛИ ПОЛЬЗОВАТЕЛЕЙ



- эконометрическая модель оценки кредитного риска эмитентов на основе данных финансовой отчетности компаний по РСБУ и МСФО
- оценка кредитного риска производится в шкале, сопоставимой со шкалами ведущих рейтинговых агентств

Рассчитываются коэффициенты PD и LGD (в вариантах PIT и TTC), что позволяет использовать оценки риска в т.ч. для подготовки отчетности в соответствии со стандартом МСФО 9.

Итоговые оценки риска дополняются развернутым анализом финансовой отчетности компании с интерпретацией значений показателей отчетности и финансовых коэффициентов. Результаты такого анализа могут использоваться при определении категорий качества компаний в соответствии с требованиями Положений Банка России №590-П и №611-П.

Предоставляется доступ к исходным базам данных ежеквартальной отчетности компаний по стандартам МСФО (уникальная база данных в формате API, формируемая аналитиками Интерфакса) и РСБУ.



RD Обращаемость

ПОКАЗАТЕЛЬ ОБРАЩАЕМОСТИ ИНСТРУМЕНТОВ ДЛЯ ЦЕЛЕЙ УЧЕТА НАЛОГООБЛОЖЕНИЯ НДФЛ

- режим торгов
- количество сделок, оборот и объем за день
- рыночная цена
- итоги торгов на день запроса, а также за период как подтверждение того или иного показателя обращаемости

RU DATA | Новости | КД | Календарь | Фильтры | Рынки | Портфели | **Сбербанк-37-60б** | Сбербанк-37-60б

Облигация **Сбербанк России** Банки

Сбербанк-37-60б "Сбербанк России" ОАО, биржевые облигации процентные документарные на предъявителя, серии БО-37

RUB 104.3% 09.09.2019 НКД 41.31 Дюрация, дн. 677 ISIN RU000A0JWUE9 Рег. номер 4B023701481B Дата регистрации 10.01.2013 Дата погашения 30.09.2021 Статус **В обращении**

Обзор Эмиссия Рейтинги КД Календарь RU Data Price RegTech Архив **Итоги торгов** График

Торговая площадка	Инструмент	Код инструмента	Дата	Кол-во сделок	Объём	Средне... цена	Open	High	Low	Close
Московская Биржа / МБ - Основной	СберБ БО37.CB.MICEX	RU000A0JWUE9	06.09.2019	16	32 115 957	103.9	103.89	104.19	103.7	104.19
Московская Биржа / МБ - РПС	СберБ БО37.CB.MICEX.PSOB	RU000A0JWUE9	27.08.2019	1	258 625 ...	103.45	103.45	103.45	103.45	103.45
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX	RU000A0JWUE9	09.08.2019	3	16 288 002	6.9	6.9	6.9	6.9	6.9
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО РПС	СберБ БО37.CB.MICEX.PSRD	RU000A0JWUE9	28.06.2019	1	32 406 910	2.17	2.17	2.17	2.17	2.17
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО РПС	СберБ БО37.CB.MICEX.PSRP	RU000A0JWUE9	17.06.2019	1	112 500 ...	7.5	7.5	7.5	7.5	7.5
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX	RU000A0JWUE9	08.05.2019	1	28 862 860	7.75	7.75	7.75	7.75	7.75
Московская Биржа / МБ - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX.RPMO	RU000A0JWUE9	23.01.2019	1	29 132 709	97.88	97.8823	97.8823	97.8823	97.8823
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО РПС	СберБ БО37.CB.MICEX.PSRE	RU000A0JWUE9	01.10.2018	1	9 900 000	1	1	1	1	1
Московская Биржа / МБ ЦК - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX	RU000A0JWUE9	17.09.2018	1	60 000 000	4	4	4	4	4
Московская Биржа / МБ - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX.RPUO	RU000A0JWUE9	-	-	-	-	-	-	-	-
Московская Биржа / МБ - РЕПО	СберБ БО37.CB.MICEX.RPEO	RU000A0JWUE9	-	-	-	-	-	-	-	-

Больше информации о RD Обращаемость | <https://rudata.info/files/rudata/info1/currency.pdf>



SPPI-тестирование

ПРОВЕРКА ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ОПРЕДЕЛЕНИЯ СПОСОБА УЧЕТА СОГЛАСНО МСФО

Реализация данного сервиса представлена в виде шаблона Excel Add-In, в котором пользователю достаточно указать идентификатор ценной бумаги (код ISIN), после чего производится автоматизированное прохождение теста путем загрузки всех необходимых данных с серверов RU Data и их последующей обработки. Также существует реализация SPPI-теста в формате методов API.

КЛЮЧЕВЫЕ ОСОБЕННОСТИ

- 1 пользователи могут видеть не только итоговый результат теста, но и все промежуточные этапы анализа, а также существует возможность скорректировать результат теста;
- 2 SPPI-тест реализован в "гибком" формате, позволяющем пользователю при необходимости редактировать состав используемых логических правил в соответствии с пожеланиями собственного аудитора;
- 3 пользователи имеют возможность не только провести расчеты, но и получить все необходимые исходные данные по ценным бумагам.



Калькуляторы и риск-метрики

НЕСТАНДАРТНЫЕ И КАСТОМИЗИРОВАННЫЕ РЕШЕНИЯ

1

Калькулятор облигаций – расчет доходности, НКД, модифицированной дюрации и выпуклости для всех видов российских и иностранных облигаций с учетом сдвига расчета по сделке T+n, согласно календарю выходных и праздничных дней страны-эмитента валюты номинала.

2

Подбор аналогов – поиск аналогов по списку облигаций, а также по критериям, настраиваемым пользователем.

3

Опционный калькулятор – расчет греков, волатильности (решение обратной задачи) с учетом возможности проведения вычислений по нескольким опционам с одинаковым активом и датой погашения для построения кривой волатильности.

4

Досье контрагента – информация о контрагенте: справочные и регистрационные данные, мониторинг динамики финансового положения, снижение/отзыв рейтинга, наличие/аннулирование лицензий на деятельность, наличие дефолта, банкротства или его признаков, обременения на активы, анализ бумаг (доходность, рейтинги), наличие групповой поддержки. Данный сервис может быть использован для задачи выявления признаков обесценения активов.

5

Риск-метрики для расчета VaR, ES, BPV, Stress-testing и др.



СПОСОБЫ ПОЛУЧЕНИЯ ДАННЫХ

	rudata.info	Excel	API
RU Data – БАЗА ДАННЫХ	✓	✓	✓
RU Data Price	✓	✓	✓
RD Risk (ЭФИР Add-In)	✓	✓	✓
RD FOR		✓	
RD Affiliate	✓	✓	✓
RD Score	✓	✓	✓



СЛУЖБА ПОДДЕРЖКИ RU Data

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

+7 495 357 2077 | help@rudata.info

Новости проекта смотрите на сайте: www.rudata.info

Вы также можете принять участие в обучающих мероприятиях Учебного центра Группы «Интерфакс»: event.interfax.ru