

RU Data PRICE

www.rudata.info

НОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНКИ

**СТОИМОСТИ, ЛИКВИДНОСТИ И АКТИВНОСТИ
РОССИЙСКИХ ОБЛИГАЦИЙ**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

интерфакс

ТЕХНОЛОГИЧЕСКОЕ РЕШЕНИЕ RU DATA



RU DATA PRICE: ПОЛНЫЙ ОБЪЕМ ЦЕНОВОЙ ИНФОРМАЦИИ

для анализа рыночных рисков и формирования регуляторной отчетности, в том числе – оценки справедливой стоимости в соответствии со стандартами МСФО 13

- 1 Расширенные данные Ценового Центра НРД (по старой и новой методикам): уровень иерархии определения цены, структура владения ценной бумагой, показатель Херфиндаля Хиршмана;
- 2 Три фактора разложения цены в полном соответствии с МСФО 13 (по аккредитованной регулятором методике);
- 3 Ликвидность ценных бумаг и показатели активности рынка, данные для IN-HOUSE моделей (дюрация, доходность, Z- и I-спреды);
- 4 Калькулятор МСФО13: проверка адекватности справедливых стоимостей, обоснование корректности оценки ТСС, переоценка позиций;
- 5 Облигационные индексы (доходности и накопленной стоимости) для рынка еврооблигаций;
- 6 Индексы акций РФ;
- 7 Итоги торгов;
- 8 Расчет Value at Risk, Expected Short-fall, Basis Point Value, Stress-testing и др.



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



интерфакс

ЦЦ НРД – ОЦЕНКА СПРАВЕДЛИВОЙ СТОИМОСТИ ЦЕННЫХ БУМАГ

единственный, [официально признанный Банком России](#) источник расчета справедливых цен

Есть возможность выгрузить цены ЦЦ НРД по портфелю за определённый период или на интересующую дату, посмотреть оценку как **по старой, так и по новой методике** ЦЦ НРД по списку бумаг

Цены и коридоры **по всем** методам

		* Внесите свои ISIN и поменяйте дату					
12.02.2018		Старая методика		Новая методика			
ISIN	Наименование ЦБ	Цена Ценового Центра, % от номинала (старая методика)	Цена Ценового Центра, валюта номинала (старая методика)	Цена Ценового Центра, % от номинала (новая методика)	Цена Ценового Центра, валюта номинала (новая методика)	Верхняя границы цены, % от номинала (новая методика)	Нижняя граница цены, % от номинала (новая методика)
RU000A0JX199	ГТЛК-001P-02-боб			103,07	847,13	103,9	102,24
RU000A0JS6M0	ДельтаКредит-5-боб			104,5	1045	105,34	103,66
RU000A0JUQR3	МосковКредБанк-11-боб			99,38	993,8	100,46	98,3
RU000A0JWGV2	Почта России-2-боб			103,49	1034,9	104,32	102,66
RU000A0JTYM0	Роснефть-9-об			100,26	1002,6	101,07	99,45
RU000A0JNHJ4	ОФЗ-46019-Ад			97,17	388,68	97,88	96,46
RU000A0JS7H8	ФСК ЕЭС-12-об			100,96	1009,6	101,77	100,15
RU000A0JUFL9	Совкомбанк-1-боб			100,01	1000,1	100,16	99,86
RU000A0JTR15	Ростелеком-19-об			100,39	501,95	101,22	99,56

цены ЦЦ НРД по старой и новой методике



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

RU DATA

интерфакс

1 РАСШИРЕННЫЕ ДАННЫЕ ЦЕНОВОГО ЦЕНТРА НРД ПО СТАРОЙ И НОВОЙ МЕТОДИКАМ

Показатели ликвидности

Активность торгов

Индекс Херфиндала-Хиршмана для структуры владения

Обоснование оценки рейтинга ликвидности

Индекс вмененной ликвидности

Границы доверительного интервала

Агрегированные рейтинги инструмента, эмитента, гаранта

The screenshot shows the INTERFAX software interface. A menu is open over the 'Банки' (Banks) section, with '511-П: проверка' (511-P: check) highlighted. The main window displays a table titled 'Показатели ликвидности' (Liquidity Indicators) with columns for various metrics and rows for different banks.

Банк	Рейтинг ликвидности	Коэффициент "глубины" рынка	Коэффициент Ликвидности по очереди МБ	Эксп. среднее стандартной ошибки	Объем эмиссии в обращении	Показатель активности торгов	Индекс Херфиндала-Хиршмана для структуры владения	Индекс вмененной ликвидности
4,9 L2	4,30986767	3,96	0,05887031	5000000000	2,010202	0,10816559	0,30292053	
1,8 L2	4,33984864	3,96	0,03539827	5000000000	1,513874	0,15593848	0,4215949	
1,0 L5	2,14276949	2,39	0,91004405	10000000000	2,281331	0,24383951	0,36337231	
10,6 L2	4,66039262	3,96	0,0695785	15000000000	1,606941	0,16177388	0,27980746	
0,5 L2	4,10069426	3,96	0,45072787	10000000000	0,735427	0,13724436	0,32931772	
9,7 L1	5,65149305	5,67	0,01088948	15000000000	1,161747	0,12036695	0,27440374	
11,3 L2	4,29400353	3,96	0,0252946	15000000000	1,089061	0,18275606	0,28720273	
134,7 L2	4,09843623	3,96	0,04057215	25000000000	1,708702	0,11418603	0,28953252	
2,8 L1	5,05686768	5,67	0,12475063	15000000000	0,618099	0,35581845	0,41427154	

2 УРОВЕНЬ ИЕРАРХИИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ЦЕНЫ ПО ТРЕМ МЕТОДАМ

КРИТЕРИЙ ОПТИМАЛЬНОСТИ

Расчетная цена должна быть применима для реализации залога в сделках РЕПО на день оценки минимальным лотом

Приемлемая точность оценок: **1%** от цены

RU Data Price дает возможность: оценивать справедливые стоимости финансовых инструментов на основе трех методов в соответствии с трехуровневой иерархией источников информации, доступных для инструментов с различной активностью торгов

КАСКАД МЕТОДОВ

- 1 МЕТОД ФАКТИЧЕСКИХ ЦЕН**
применяется, если облигация активно торгуется на бирже с достаточным уровнем достоверности сделок
- 2 МЕТОД ЭКСТРАПОЛЯЦИИ ИНДЕКСОВ**
применяется, если уровень достоверности сделок недостаточен
- 3 МЕТОД ФАКТОРНОГО РАЗЛОЖЕНИЯ ЦЕНЫ**
применяется, если бумага не торгуется на бирже

Каскадный принцип учитывает требования IFRS 13 и позволяет производить расчет как ТСС, так и доверительного интервала стоимости



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



интерфакс

3 ЛИКВИДНОСТЬ ЦЕННЫХ БУМАГ И ПОКАЗАТЕЛИ АКТИВНОСТИ РЫНКА

является важным параметром, характеризующим риски для участников рынка

ЛИКВИДНОСТЬ

отражает способность продать бумагу с минимальными издержками



АКТИВНОСТЬ

характеризует достоверность ТСС

«	Сводные данные	Ценовой центр НРД	Статистика торгов	Ликвидность	Рыночный риск
	Корректировка позиции на ликвидность			Показатели ликвидности	
	Стоимость позиции, тыс руб		0.001	Омега	4.6757
	Корректировка на ликвидность, %		0.01096478	Индекс Херфиндаля-Хиршмана	0.1876
	Корректировка на ликвидность, тыс руб		NaN	Индекс ликвидности IL	0.2918
	Стоимость позиции с учетом корректировки, тыс руб		0.001	Индекс ликвидности IL4	0.4156
	Оценка ликвидности			Активность тогов (R2)	2.1391
	Рейтинг ликвидности		2		

[подробнее о методологии оценки](#)



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



4 КАЛЬКУЛЯТОР МСФО 13

возможность проверить справедливость цены, а также правильность работы учетной политики организации

- ✓ верификация учетных цен облигаций по стандартам МСФО13
- ✓ проверка адекватности справедливых стоимостей
- ✓ обоснование корректности оценки ТСС
- ✓ переоценка позиций
- ✓ полная информация по отрасли, уровню кредитного качества и срочности

Попадает ли цена в допустимый интервал колебания?

Как можно обосновать отклонение от этого интервала?

Справедливые цены		Переоценка позиций		Сводная статистика								
Инструмент	ISIN	Базовая ТСС: Стоимость, % от ном.	Референтная ТСС			Цены ЦЦ НРД +		Итоги торгов +		Активность +		
			ТСС	ТСС min	ТСС max	ТСС ЦЦ	Иерархия ТСС (номер метода)	RuDIP (евробонд)	Цена закрытия	Индекс акт-ти ЦЦ НРД (R2)	Рейтинг ликвидн. (RuData)	Кол-во сделок (посл. 10 сессий)
АИЖК 2011-2-2-об	RU000A0JRMW8	100.1	100.88	99.36	102.39	100.88					L7	0
Воронежская Обл-34007-об	RU000A0JUWK6	102.1	101.77	100.24	103.3	101.77			102.1		L2	309
Газпром Нефть-001P-04R	RU000A0ZYLC4	96.2	96.2	95.47	96.93	96.2	1		96.2	2.26	L2	232
Лукойл-12-2026-евро	XS1514045886		103.63	102.08	105.18	103.63		103.77	102.59			0
МТС-8-об	RU000A0JR4J2	100	100.08	99.03	101.13	100.08	3			4.65	L3	17
Московская Обл-35010-об	RU000A0JX0B9	104.55	104.42	104.03	104.81	104.42	1		104.55	1.04	L2	76
ОКЕЙ-6-6об	RU000A0JWCK4	102.5	99.37	97.88	100.86	99.37			102.5		L4	16

зеленым выделяется адекватная цена, красным – не попадающая в заданный коридор отклонения



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



МИНИМАЛЬНАЯ ПЕРЕОЦЕНКА ПОЗИЦИЙ В ПРОЦЕНТАХ И РУБЛЯХ...

<< Справедливые цены
Переоценка позиций
Сводная статистика

Инструмент	ISIN	Базовая ТСС				Референтная ТСС			Переоценка по референтной цене (Корректировка стоимости)				Доп. ценовые параметры		
		Кол-во	Дата ТСС	Стоимость бумаги, % от номинала	Стоимость позиции, вал. ном.	ТСС	ТСС min	ТСС max	бумаги по ТСС	позиции по ТСС	бумаги по ближ. гран. интервала ТСС	позиции по ближ. гран. интервала ТСС	Номинал	Валюта номинала	НКД
АИЖК 2011-2-2-об	RU000A0JRMW8	10 000	20.05.2019	100.1	10 029 100	100.88	99.36	102.39	0.78	77 670	0	0	1 000	RUB	1.91
Воронежская Обл-34007-об	RU000A0JUWK6	10 000	20.05.2019	102.1	10 244 800	101.77	100.24	103.3	-0.33	-33 000	0	0	1 000	RUB	3.48
Газпром Нефть-001P-04R	RU000A0ZYLC4	10 000	20.05.2019	96.2	9 938 500	96.2	95.47	96.93	0	0	0	0	1 000	RUB	31.85
Лукойл-12-2026-евро	XS1514045886	10 000	20.05.2019			103.63	102.08	105.18				0	1 000	USD	23.35
МТС-8-об	RU000A0JR4J2	10 000	20.05.2019	100	10 028 100	100.08	99.03	101.13	0.08	8 000	0	0	1 000	RUB	2.81
Московская Обл-35010-об	RU000A0JX0B9	10 000	20.05.2019	104.55	10 674 400	104.42	104.03	104.81	-0.13	-13 000	0	0	1 000	RUB	21.94
ММ-6-6об	RU000A0JWCK4	10 000	20.05.2019	102.5	10 358 400	99.37	97.88	100.86	-3.13	-312 850	-1.64	-163 793	1 000	RUB	10.84

<< Справедливые цены
Переоценка позиций
Сводная статистика

Стоимость портфеля 1 197 524 040

Число позиций 16

Позиции	Переоценка по реферативной ТСС	
	Число	% от числа позиций
Стоимость > ТСС	0	0
Стоимость < ТСС	0	0
Оцененные по ТСС	16	100
Переоценка по ближайшей границе реферативной ТСС		
	Рубли	% от стоим. портфеля
Положительная по ближайшей границе ТСС	0	0
Отрицательная по ближайшей границе ТСС	0	0
ИТОГО по ближайшей границе ТСС	0	0

...для
каждого
инструмента

...и для
портфеля



5 ИНДЕКСЫ ЕВРООБЛИГАЦИЙ

для отслеживания динамики рынка, оценки рыночных рисков и определения ТСС

Индексы еврооблигаций

Индекс	Дата	Накопл. стоимость	Доходность	Дох-ть средневз.	Цена, %	Цена с НКД, %	Дюрация, лет	Дюр-я мод., лет	Выпуклость	Выпул. мод.
IFXGEBI	14.05.19	111.2	4.4	4.05	108.01	109.22	6.07	5.82	62.91	63.53
IFXGEBI2Y	14.05.19	107.28	3.28	3.16	102.8	103.17	2	1.93	5.24	6.85
IFXGEBI5Y	14.05.19	110.44	4.12	3.93	108.46	109.87	4.96	4.77	33.34	35.52
IFXAEBI	14.05.19	111.89	4.72	4.53	102.28	103.39	2.98	2.85	10.77	12.67
IFXBEBI	14.05.19	109.76	4.47	4.27	103.62	104.53	1.99	1.9	4.8	6.3
IFXBEBI1Y	14.05.19	107.73	4.12	4.49	102.86	104.98	0.98	0.95	1.19	2.04
IFXCEBI	14.05.19	110.84	4.18	4.01	102.68	103.68	1.99	1.91	4.78	6.31
IFXCIEBI	14.05.19	109.58	3.76	3.64	103.04	103.9	1.99	1.91	4.77	6.35
IFXCSEBI	14.05.19	110.86	4.71	4.41	102.71	103.91	1.99	1.9	4.79	6.27
IFXCSEBI1Y	14.05.19	109.53	3.39	1.73	102.39	103.29	0.99	0.96	1.19	2.07



Облигационные индексы долговых бумаг российских эмитентов (рублевые облигации и евробонды), рассчитываемые Интерфаксом



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



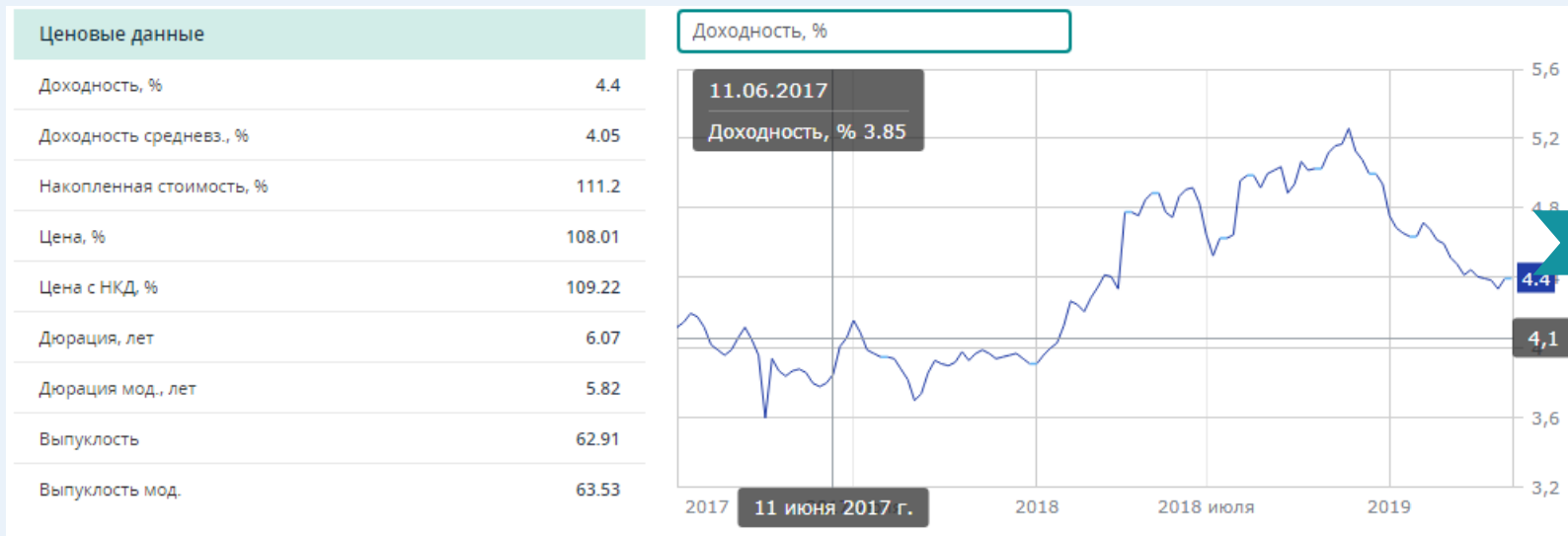
[вернуться в меню](#)

Возможность посмотреть историю значений индекса, а также состав инструментов на каждый день, которые участвовали в формировании индекса с указанием веса



Ориентация на биржевую информацию с европейских площадок, поэтому все данные максимально приближены к рынку

Плавное включение и выключение новых бумаг, что исключает резкое изменение индекса



Модель основана на методе главных компонент, который позволяет определить веса индексов так, чтобы наилучшим образом объяснить общую динамику рынка



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



6 ИНДЕКСЫ АКЦИЙ РФ

фондовые индексы российских эмитентов (индексы Московской Биржи)

- ✓ для каждого индекса представлена информация о его составе (веса бумаг и их цены)
- ✓ доступны все архивные значения индексов
- ✓ более 40 мировых фондовых индексов
- ✓ доступны все архивные значения индексов

Индексы Московской Биржи

Индекс	Last Time	Last	Изм.	Изм., %
MOEX Russia Index	15.05 17:20	2559.59	-2.74	-0.11
MOEXINN	15.05 17:20	322.47	+1.65	+0.51
MOEX10	15.05 17:20	4540.72	-10.69	-0.23
MOEXBMI	15.05 17:20	1836.97	+0.14	+0.01



Индексы РТС

Индекс	Last Time	Last	Изм.	Изм., %
MOEXBC	15.05 17:20	17339.97	-21.82	-0.13
RTS Index RUB	15.05 17:20	18307.82	+29.87	+0.16
RTS Index	15.05 17:20	1246.78	+5.27	+0.42
RVI	15.05 17:20	18.93	+1.11	+6.23



Индексы Московской Биржи Отраслевые

Индекс	Last Time	Last	Изм.	Изм., %
MOEXMM	15.05 17:20	6199.79	-10.46	-0.17
MOEXOG	15.05 17:20	7228.79	-31.89	-0.44
MOEXCN	15.05 17:20	5818.39	-12.7	-0.22
MOEXTL	15.05 17:20	1807.33	+1.67	+0.09
MOEXTN	15.05 17:20	1361.04	+0.6	+0.04
MOEXFN	15.05 17:20	6068.53	+17.49	+0.29
MOEXCH	15.05 17:20	14233.59	-79.57	-0.56
MOEXEU	15.05 17:20	1780.15	+8.72	+0.49



Индексы РТС Отраслевые

Индекс	Last Time	Last	Изм.	Изм., %
RTSmm	15.05 17:20	201.54	+0.75	+0.37
RTSog	15.05 17:20	217.03	+0.22	+0.1
RTSeu	15.05 17:20	69.79	+0.72	+1.04
RTSfn	15.05 17:20	163.17	+1.36	+0.84
RTScr	15.05 17:20	203.8	+0.66	+0.32



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



7 ИТОГИ ТОРГОВ

официальные итоги торгов по портфелю:

общие цены, общий объем сделок по портфелю:

Инструмент	Итоги торгов								Активность								
	RuDIP (евробонд)	Цена закрытия	Признавае... котировка	Рыночная цена 2	Рыночная цена 3	Средневзв. цена	Мах. цена	Min цена	Индекс акт-ти ЦЦ НРД (R2)	Рейтинг ликвидн. (RuData)	Дата посл. сделки	Кол-во сделок (посл. торг. сессия)	Кол-во сделок (посл. 10 торг. сессий)	Объем, шт. (посл. торг. сессия)	Объем, шт. (посл. 10 торг. сессий)	Объем, руб. (посл. торг. сессия)	Объем, руб. (посл. 10 торг. сессий)
АИЖК 2011-2-2-об		100.1	100.1							L7		0	0	0	0	0	0
Воронежская Обл-34007-об		101.5	101.5		101.63	101.66	102	101.5		L2		12	319	67	5 273	20 434	1 611 147
Газпром Нефть-001P-04R		95.8	95.8		95.83	95.86	95.98	95.7	2.3	L2		10	156	283	14 996	271 282	14 304 338
Лукойл-12-2026-евро	103.52												0		0		0
МТС-8-об		100.43	100.43		100.24				5.81	L4		0	6	0	7	0	6 994
Московская Обл-35010-об		104.5	104.5		104.26	104.29	104.5	104.2	1.25	L2		2	62	70	7 149	73 000	7 456 067
ОКЕЙ-6-6об		101.5	101.5		100.88					L4		0	21	0	349	0	352 499
ОФЗ-25083-ПД		98.86	98.86	98.85	98.85	98.85	98.88	98.73	0.32	L1		151	1 421	413 070	1 949 534	408 303 5...	1 923 655...
ОФЗ-29007-ПК		105.6	105.6		105.58	105.63	105.9	105.51		L2		15	103	127	2 769	134 150	2 924 694
Роснефть-2-6об		101.4	101.4							L6		0	0	0	0	0	0
Россия-2020	101.97						101.81	101.74					0		0		0
Сбербанк-18-6об		100.05	100.05	100.1	100.1	100.1	100.11	100.03	0.66	L1		24	263	1 339	26 342	1 340 377	26 371 679
СистемаАФК-2019-евро	100												0		0		0
ФСК ЕЭС-10-об		98.7	98.7							L7		0	0	0	0	0	0
ЮниКредит Банк-22-6об		100.45	100.45		100.52	100.45	100.45	100.45		L4		1	2	448	449	450 016	451 016
Ярославская Обл-35015-об		100.37	100.37		100.01	100.17	100.37	99.56	4.91	L5		5	62	8	403	8 013	403 086



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



- ✓ Есть возможность выбрать торговую систему, тот сектор Московской Биржи, который Вас интересует, а также период и режим торгов;
- ✓ RU Data Price позволяет выгрузить справочники (рынки и площадки, инструменты, фьючерсы, опционы) с национальных и иностранных площадок, настроив при этом поля и справочники по торговым площадкам и торгуемым инструментам

17.05.2019													
	МБ основной	МБ РПС	МБ РЕПО	МБ основной долл.	Фиксинг НФА	Внебиржевой рынок							
период 60 дней	24.02.2019	24.02.2019	24.02.2019	24.02.2019	24.02.2019	24.02.2019							
период 180 дней	09.09.2018	09.09.2018	09.09.2018	09.09.2018	09.09.2018	09.09.2018							
							60 ТОРГОВЫХ Дней МБ основной						
ISIN	Наим.	Средняя срвзв. 60 дн	Кол-во дней со срвзв. ценой	Кол-во сделок за 60 дн	Суммарный объем в шт. за 60 дн	Суммарный объем в вал. за 60 дн	Эмиссия заявленная в шт.	Эмиссия заявленная в валюте ном.	Эмиссия в обращении в шт.	Эмиссия в обращении в вал. ном.	Последняя дата срвзв.	ВІD (на дату отч.)	
RU000A0JR217	ФСК ЕЭС-10-об	98,7	1	1	1	987	10000000	10000000000	29151	29151000	27.02.2019	98,04	
RU000A0JR4J2	МТС-8-об	100,0494444	18	42	232	233437,1	15000000	15000000000	40193	40193000	16.05.2019	99,75	
RU000A0JX0B9	Московская Обл-35010-об	104,1225455	55	402	970898	1010506822	25000000	25000000000	25000000	25000000000	16.05.2019	104,35	

- ✓ Общие цены, общий объем сделок по портфелю за указанные периоды с интересующих Вас площадок;
- ✓ Есть возможность изменить количество дней, а также выбрать режим торгов



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



интерфакс

8 РАСЧЕТ VALUE AT RISK, EXPECTED SHORT-FALL, BASIS POINT VALUE, STRESS-TESTING

Процентный риск		Стресс-тестирование					
Дюрация, лет	2.1699	№	Сценарий	Рост доходностей гос.обл.	Рост доходностей корп. обл.	Обещ. нац. валюты	Переоценка, %
Модиф. дюрация	2.0076						
Выпуклость	7.1427	1	Умеренный	2	5	-20	-9.27
Модиф. выпуклость	6.1192	2	Консервативный	3.5	10	-30	-17.02
Basis Point Value (BPV, DV01)	-0.2087	3	1998	10	20	-250	-27.91
		4	2004	1.5	2.5	-2	-4.83
		5	2008	6	14	-50	-22.11
		6	Февраль 2014	4	1.3	-20	-2.56
		7	Пользовательский	4	1.3	-20	-2.56

Value at Risk (VaR)				Expected Shortfall (ES)					
	% от стоим. позиции в руб.		% от стоим. позиции в вал. номинала			% от стоим. позиции в руб.		% от стоим. позиции в вал. номинала	
	1 день	10 дней	1 день	10 дней		1 день	10 дней	1 день	10 дней
Дельта-норм. метод	0.1167	0.6069	0.1167	0.6069	Дельта-норм. метод	0.2407	0.7611	0.2407	0.7611

- ✓ оценка уровня риска и получение инструментов для риск-менеджмента;
- ✓ расчет таких показателей как: Value at Risk, Expected Short-fall, Basis Point Value, Stress-testing и др.;
- ✓ оценка вероятности возникновения регулятивных рисков в случае использования собственных моделей оценки справедливых стоимостей инструментов

Идентификатор инструмента	Стоимость позиции в руб.	Фактор риска ID	Множ-ль риска	Валюта ном-ла	Дата расчета: 07.09.2018				VaR_port	ES_port			
ID (ISIN,CUR)	SUM	RF	TYPER	RO_ISII	CUI	SUM*RO	SUM(CUR)	Расчет портфеля					
								Факторы риска портфеля			Portfolio		
								Name	RF ID	SUM*RO	SIGMA_RF	VAR_RF	ES_RF
RU000A0JV4P3	100 000 000,00	37	0	-6,7386	RUB	-673 860 000,00	0,00	ГосОбл-5+Л-МБ	37	-2 475 440 000,00	0,000816	-10 507 935,37	-12 038 568,73
RU000A0JS3W6	100 000 000,00	37	0	-5,6386	RUB	-563 860 000,00	0,00	Мунобл-1/ЗГ-В-МБ	39	-825 860 000,00	0,001325	-5 692 461,05	-6 521 650,65
RU000A0JX2S9	100 000 000,00	39	0	-2,4132	RUB	-241 320 000,00	0,00	Мунобл-3+Г-В-МБ	40	-342 940 000,00	0,000792	-1 412 911,44	-1 618 722,51
RU000A0JWSQ7	100 000 000,00	39	0	-1,7161	RUB	-171 610 000,00	0,00						
RU000A0JV4P3	100 000 000,00	37	0	-6,7386	RUB	-673 860 000,00	0,00						
RU000A0JS3W6	100 000 000,00	37	0	-5,6386	RUB	-563 860 000,00	0,00						
RU000A0JX2S9	100 000 000,00	39	0	-2,4132	RUB	-241 320 000,00	0,00						
RU000A0JWSQ7	100 000 000,00	39	0	-1,7161	RUB	-171 610 000,00	0,00						
RU000A0JXSD3	100 000 000,00	40	0	-3,4294	RUB	-342 940 000,00	0,00						



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



Доступ к RU DATA PRICE

rudata.info

WEB-портал, предоставляющий быстрый и удобный доступ к данным RU Data

Дата

Дов. уровень (confidence level), %

« **Сводные данные** | Ценовой центр НРД | Статистика торгов | Ликвидность | Рыночный риск

Общая информация	Ценовой центр НРД	Подробнее >
Листинг МБ	1	Цена, % от номинала 102.8924
Ломбардный список	Нет	Нижний порог цены, % от номинала 101.432
		Верхний порог цены, % от номинала 104.3527
		Метод справедливой оценки 1: фактических цен

Рыночный риск	Подробнее >
Basis point value (BPV)	-0.2087
Value at Risk (VaR) 1 день, %	0.1167
Expected Shortfall (ES) 1 день, %	0.2407
Stress-testing 2008, %	-22.1096

Статистика торгов	Подробнее >
Средневзв. цена, % от номинала	102.89
Доходность	8.04
НКД	12.16

Ликвидность	Подробнее >
Рейтинг ликвидности	L2
Индекс ликвидности IL	0.2938
Индекс ликвидности IL4	0.4097
Активность тогов (R2)	2.0279



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

RU DATA

интерфакс

Доступ к RU DATA PRICE

Excel Add-In

сертифицированная надстройка для Excel, с помощью которой выгружаются необходимые данные RU Data в виде настраиваемых персональных отчетов

ISIN	Кр.имя	Метод3	Козф.сект.	Параметры облигации	Дата посл.оценки	Тек.номинал	Вал.номинал а	Дата расч.	Дата возм.погашения	Рыночные показатели	Срвз.цена	Дох-ть по срвз.	Z-спред по срвз.	Мод.дюр.	I-спред по срвз.	Оценка	Метод	TCC%	TCC
RU000A0JV3M2	Волжский-34001-об		0,254228856		11.05.2018	400	RUB	31.10.2018	24.12.2019		0	0	0	0	0		3	109,68	438,72
RU000A0ZYKE2	ИА ВТБ-2013-2-01-об		2,808764606		07.09.2018	763,78	RUB	31.10.2018			0	0	0	0	0		3	102,56	783,332768
RU000A0JXC40	О1 Пропертиз Фин-П01-боб		1,108585182		29.06.2018	1000	USD	31.10.2018	23.01.2026		0	0	0	0	0		3	86,42	864,2
RU000A0GN9A7	ОФЗ-46020-АД		-0,41685374		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	06.02.2036		86,276	8,63	-0,0072	8,8631	-0,0281		1	86,22	862,2
RU000A0JXB41	ОФЗ-26220-ПД		-0,41685374		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	07.12.2022		97,558	8,27	-0,0967	3,3554	-0,0384		2	97,33	973,3
RU000A0JSMA2	ОФЗ-26209-ПД		-0,41685374		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	20.07.2022		98,566	8,21	-0,1156	3,0808	-0,0568		2	98,42	984,2
RU000A0ZYCK6	ОФЗ-25083-ПД		-0,41685374		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	15.12.2021		97,01	8,26	0,0117	2,6596	0,0692		2	96,92	969,2
RU000A0ZZ6K5	ИА Металлинвест-2-1-об		2,639345263		31.10.2018	852,52	RUB	31.10.2018	28.12.2018		0	0	0	0	0		3	99,66	849,621432
RU000A0ZYM47	ЯНАО-35004-об		-0,00041189		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	25.12.2024		0	0	0	0	0		3	94,66	946,6
RU000A0ZYJ42	РСХБ-04Р-боб		0,314162446		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	09.12.2020		99,89	8,32	0,2666	1,8445	0,3187		3	99,1	991
RU000A0ZYFS2	ТрансФин-М-001Р-05-боб				31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	14.11.2018		0	0	0	0	0		3	100,08	1000,8
RU000A0ZYEB1	ТрансФин-М-001Р-04-боб				31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	22.10.2020		100	10,77	2,7593	1,6799	2,8253		1	100	1000
RU000A0ZYDD9	Транснефть АК-001Р-08		0,130494832		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	09.10.2025		95,2	9,03	0,4877	5,0145	0,5424		3	95,52	955,2
RU000A0ZYCZ4	Карелия Респ-35018-об		0,018240991		05.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	15.10.2023		99,09	8,52	0,1846	3,2992	0,306		1	99,1	991
RU000A0JXU89	ИА ТКБ-3-1-об				31.10.2018	443,62	RUB	31.10.2018			0	0	0	0	0		3	100,05	443,84181
RU000A0JXTW1	БелгородскаяОбл-35011-об		-0,00041189		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	11.06.2024		108	6,26	-2,1273	3,5089	-2,0689		3	99,41	994,1
RU000A0JXTB5	Белуга Групп-БО-ПО1		0,620394778		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	07.06.2022		0	0	0	0	0		2	100,08	1000,8
RU000A0JXT41	Самарская Обл-35013-об		-0,00041189		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	31.05.2024		100	8,44	0,0669	3,2909	0,1426		3	98,98	989,8
RU000A0JXMQ8	РСХБ-01Р-боб		0,314162446		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	25.09.2020		102,2	8,39	0,3931	1,6631	0,4439		3	101,74	1017,4
RU000A0JXFY6	Газпром капитал-6-боб		0,130494832		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	07.02.2024		0	0	0	0	0		3	100,79	1007,9
RU000A0JX0L8	МКБ 2 ИА-1-об				31.10.2018	412,47	RUB	31.10.2018	07.12.2018		0	0	0	0	0		3	101,52	418,739544
RU000A0JX009	Автодор ГК-001Р-01-боб		0,632482976		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	20.11.2020		98,62	11,31	3,2805	1,7255	3,3493		3	102,69	1026,9
RU000A0JWWG0	ПервоеКоллекторБюро-1-боб		2,639345263		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	15.10.2021		99,67	16,1	8,095	1,3987	8,2378		3	104,14	1041,4
RU000A0JWUX9	Альфа-Банк-17-боб		0,314162446		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	28.09.2021		0	0	0	0	0		3	102,15	1021,5
RU000A0JWUE9	Сбербанк-37-боб		0,314162446		31.10.2018	1000	RUB	31.10.2018	30.09.2021		103,25	8,13	-0,0755	2,4461	-0,0141		1	103,49	1034,9



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



Доступ к RU DATA PRICE

API RU Data

набор web-сервисов для интеграции с внутренними системами в форматах JSON и XML
техническая документация: <http://developer.efir-net.ru/Docs>

API Reference United Data (RU DATA)

Здесь Вы можете оценить работу API базы данных RU DATA.

Method	Endpoint	Description	Operations
POST	/Account/Login	Авторизация пользователя для начала работы	Login operation
POST	/Account/Logoff	Авторизация пользователя для начала работы	Logoff operation
POST	/Account/OAuth2/Login/1	Авторизация пользователя для начала работы	Login operation via OAuth2
POST	/Account/OAuth2/Login/2	Авторизация пользователя для начала работы	Login operation via OAuth2
GET	/Account/Subscription	Авторизация пользователя для начала работы	User subscription operation
GET	/Account/Validate	Авторизация пользователя для начала работы	User token validate operation
ArchiveService : "Архивные данные по итогам торгов, курсам валют и пр"			
BondService : "База данных по облигациям. Параметры выпуска, организаторы, купоны"			
CAService : "Информация по корпоративным действиям"			
ForecastService : "Прогнозы и рекомендации"			
InfoService : "Справочная информация по эмитентам и их ценным бумагам"			
MoexService : "Официальные итоги Московской Биржи"			
NsdService : "База данных НРД"			
RatingService : "Рейтинги компаний и облигаций"			
RiskService : "Всё, что нужно для расчета рыночного риска и показателей ликвидности"			



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



СЛУЖБА ПОДДЕРЖКИ RU DATA

СПЕЦИАЛИСТЫ СЛУЖБЫ ПОДДЕРЖКИ RU Data:

- ✓ предоставят тестовый доступ
- ✓ оперативно ответят на вопросы по работе с сервисами
- ✓ проведут обучение для пользователей
- ✓ настроят индивидуальную выгрузку данных под Ваши потребности
- ✓ расскажут обо всех обновлениях системы

+7 495 357 2077 | rudata@interfax.ru

Новости проекта смотрите на сайте: www.rudata.info

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



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

