

**интерфакс**

МЕЖДУНАРОДНАЯ ИНФОРМАЦИОННАЯ ГРУППА



**Управление рисками и контроль для НФО**

# Основа сервиса RD FOR – это эталонная база данных по эмитентам и финансовым инструментам RU DATA

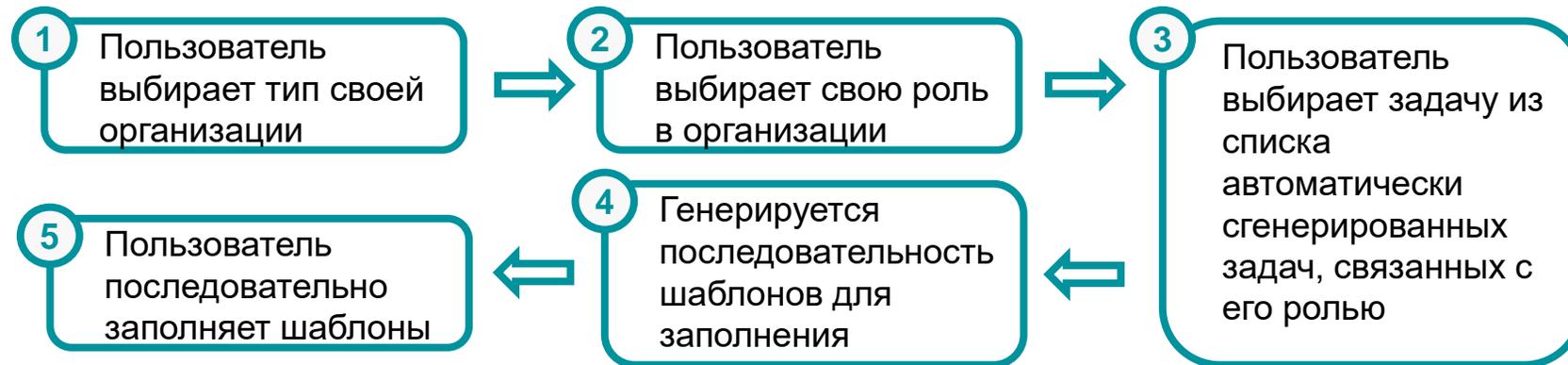
- ✓ подробная справочная информация по эмитентам (гарантам, поручителям) и выпущенным ими ценным бумагам (внешние и внутренние облигации, акции, депо-расписки, паи, ИСУ, ПФИ и т.д.)
- ✓ расширенные календари купонов, оферт, погашений, досрочных погашений, конвертаций, дивидендов, дефолтов
- ✓ корпоративные действия в структурированном виде с максимальной детализацией ключевой информации
- ✓ национальные и международные рейтинги, срез на заданную дату и полная история рейтинговых событий
- ✓ вся биржевая и внебиржевая информация по истории торгов ценными бумагами с архивами
- ✓ расширенные данные ЦЦ НРД по оценке текущей справедливой стоимости в рамках МСФО-13, включая уровни иерархии определения цены и все метрики, участвующие в расчетах для каждого метода

# Концепция сервиса RD FOR

**RD FOR** – сервис для реализации законодательных требований для НФО по оценке рисков, управлению активами, контролю и подготовке отчетности

Сервис выполнен в формате Excel Add-In

В текущей версии сервис реализован в виде файла конфигуратора, который выстраивает шаблоны согласно выбранным типам организации, ролям внутри организации и задачам



# Виды организаций и роли пользователей выстраивают шаблоны сервиса RD FOR

## Виды организации



НПФ



ПФР



Страховые

## Роли пользователей



Риск-менеджер



Управляющий активами



Контролер

# Шаблоны RD FOR

**Портфель** (со  
всей справочной  
инфо)

**Оценка рисков**  
(4060У, 710П,  
Basel)

**Подбор актива**  
(фидуциарная  
ответственность)

**Операционный  
риск**  
(качественная  
оценка)

**Лимиты** (контроль  
инвестиционных  
ограничений)

**Связанные  
лица**

**Бескупонная  
кривая**

**Формы**  
(примечания к  
МСФО-  
отчетности)

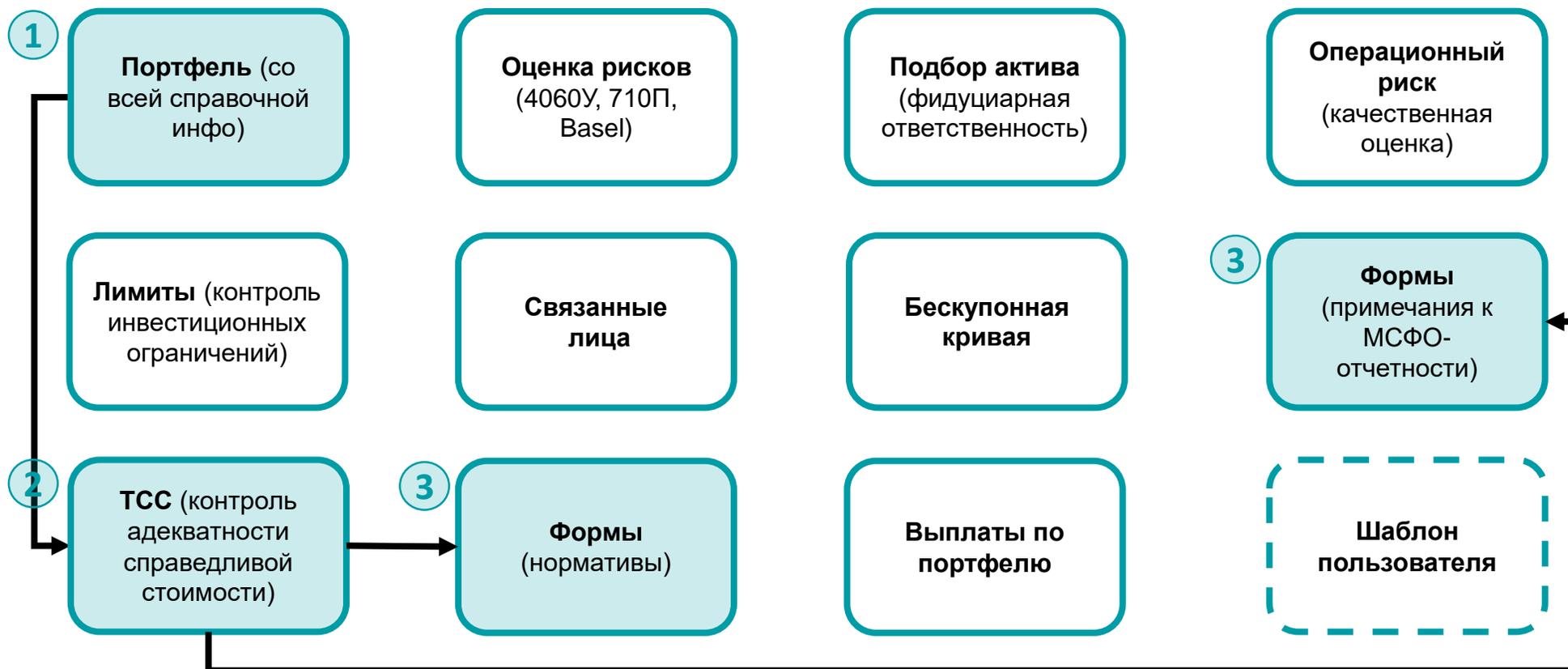
**ТСС** (контроль  
адекватности  
справедливой  
стоимости)

**Формы**  
(нормативы)

**Выплаты по  
портфелю**

**Шаблон  
пользователя**

# Шаблоны RD FOR



# Шаблон RD FOR

## Портфель

Это шаблон является основой для остальных шаблонов и аккумулирует в себе всю основную портфельную информацию, необходимую как для анализа и оценки каких-либо показателей, так и для составления отчетов, в том числе, по МСФО



Загрузка данных из стандартизированных входных файлов по видам инструментов



Создание общего портфеля (агрегат по видам инструментов)



Выгрузка справочной и рейтинговой информации и календари событий из RU Data

# Шаблоны RD FOR

**ТСС** (контроль адекватности справедливой стоимости)

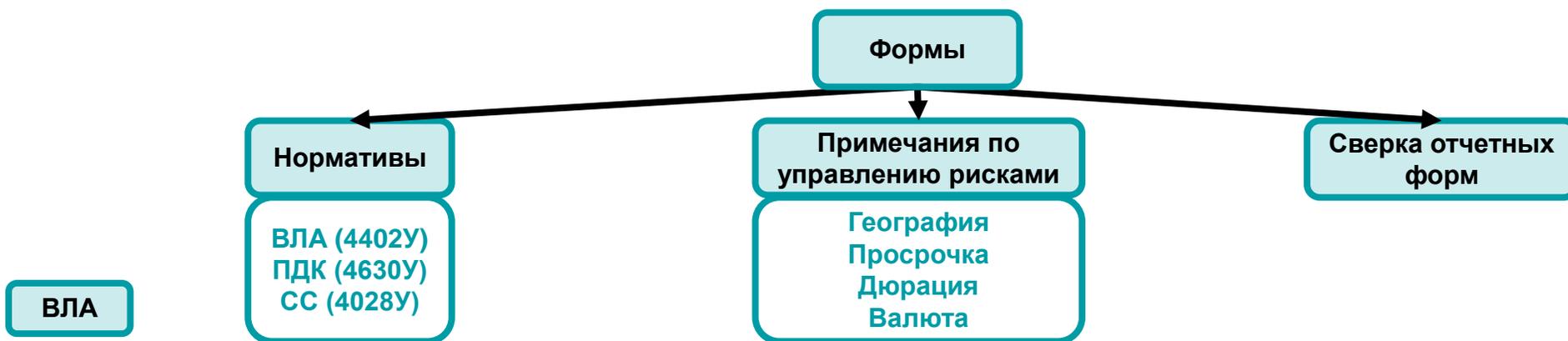
В базовом функционале шаблона на основе сопоставления бухгалтерской стоимости и данных ценового центра (по отклонению от доверительного интервала) определяются подозрительные стоимостные оценки. Также возможна настройка собственных критериев для сравнения различных цен (в том числе каскада цен из учетной политики компании) с данными бухгалтерии

14.02.2020										Подбор цены (по расширенному фиду ЦЦ)												
ISIN	Эмитент	Тип	Статус	Баланс в а	any	RuPrice	RuPrice0	Market	Close	Свой каскад	Цена сравнения	Оценка	Замечания	Номинал	Метод	нkd	ТСС_нижн в вал номинала	ТСС_верхн в вал номинала	Балансовая цена в границе?	Можно уменьшить на	Можно увеличить на	Рекомендации
RU000AQJREQ7	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 051,50	1 051,50	1 051,50	1 051,43	1 051,69	1 051,43	1 051,50	4,41%		1000	1	25,2	1051,1	1052	ЛОЖЬ	48,9	0	Проверить бух учет
RU000AQJWM07	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 138,15	1 138,15	1 138,39	1 138,39	1 139,15	1 138,39	1 138,15	3,47%		1000	1	30,15	1135,85	1140,45	ЛОЖЬ	0	40,45	Проверить бух учет
RU000A1007F4	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 075,16	1 075,16	1 075,15	1 075,06	1 075,06	1 075,15	1 075,16	2,26%		1000	1	4,66	1073,66	1076,66	ЛОЖЬ	26,34	0	Проверить бух учет
RU000AQJTLJ3	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 044,57	1 044,57	1 044,46	1 044,56	1 044,56	1 044,46	1 044,57	5,04%		1000	1	3,07	1043,17	1045,97	ЛОЖЬ	56,83	0	Проверить бух учет
RU000AOZYCK6	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 039,22	1 039,22	1 039,22	1 039,51	1 039,51	1 039,22	1 039,22	5,53%		1000	1	11,12	1038,52	1040,02	ЛОЖЬ	61,48	0	Проверить бух учет
RU000AOZYU88	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 063,03	1 063,03	1 062,72	1 063,33	1 063,33	1 062,72	1 063,03	3,36%		1000	1	29,03	1061,63	1064,43	ЛОЖЬ	38,37	0	Проверить бух учет
RU000AQJUL43	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 080,94	1 080,94	1 080,94	1 081,43	1 081,43	1 080,94	1 080,94	1,73%		1000	1	33,94	1079,74	1082,14	ЛОЖЬ	20,26	0	Проверить бух учет
RU000AQJVL42	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 067,41	1 067,41	1 067,29	1 068,29	1 068,29	1 067,29	1 067,41	2,96%		1000	1	1,91	1065,91	1067,91	ЛОЖЬ	34,09	0	Проверить бух учет
RU000AQJVV30	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 067,87	1 067,87	1 067,84	1 068,22	1 068,22	1 067,84	1 067,87	2,92%		1000	1	36,37	1067,17	1068,47	ЛОЖЬ	32,83	0	Проверить бух учет
RU000AQJYA5	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 017,25	1 017,25	1 017,23	1 017,33	1 017,33	1 017,25	1 017,25	7,52%		1000	1	13,85	1017,05	1017,45	ЛОЖЬ	82,95	0	Проверить бух учет
RU000AQJ5MA2	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 054,49	1 054,49	1 054,53	1 054,46	1 054,46	1 054,53	1 054,49	4,14%		1000	1	4,79	1053,59	1055,49	ЛОЖЬ	46,41	0	Проверить бух учет
RU000AQJTG59	Минфин РФ	Государственные облигации (Выпуск Погашен)	Погашен	110	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	0,00%	Проверить бух учет		2	0						
RU000AQJ7J9	Минфин РФ	Государственные облигации (Выпуск Погашен)	Погашен	110	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	Погашен	0,00%	Проверить бух учет		3	0						
RU000AQJXQF2	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 084,17	1 084,17	1 084,10	1 084,66	1 084,66	1 084,10	1 084,17	1,44%		1000	1	22,17	1082,27	1085,97	ЛОЖЬ	17,73	0	Проверить бух учет
RU000AQJXB41	Минфин РФ	Государственные облигации	в обращении	110	1 063,98	1 063,98	1 063,96	1 063,97	1 063,97	1 063,96	1 063,98	3,27%		1000	1	13,18	1062,78	1065,18	ЛОЖЬ	37,22	0	Проверить бух учет
RU000AOZYML3	Московская Обл Прав	Муниципальные облигации	в обращении	110	777,59	777,59	777,29	777,29	777,29	777,29	777,59	29,31%		750	2	7,71	776,235	779,01	ЛОЖЬ	323,765	0	Проверить бух учет
RU000AOZYCQ3	РН Банк	Корпоративные облигации	в обращении	110	1 042,68	1 042,68	1 042,88	1 044,38	1 044,38	1 042,68	1 042,68	5,21%		1000	2	28,48	1041,78	1043,68	ЛОЖЬ	58,22	0	Проверить бух учет
RU000AQJXNV6	РН Банк	Корпоративные облигации	в обращении	1100	1 036,33	1 036,33	1 036,33	1 036,33	1 036,33	1 036,33	1 036,33	5,79%		1000	1	31,33	1036,03	1036,63	ЛОЖЬ	63,97	0	Проверить бух учет
RU000A1003Q0	РН Банк	Корпоративные облигации	в обращении	1100	1 093,72	1 093,72	1 094,42	1 100,62	1 100,62	1 094,42	1 093,72	0,57%		1000	2	45,62	1090,82	1096,62	ЛОЖЬ	9,18	0	Проверить бух учет

Контроль каскада цены

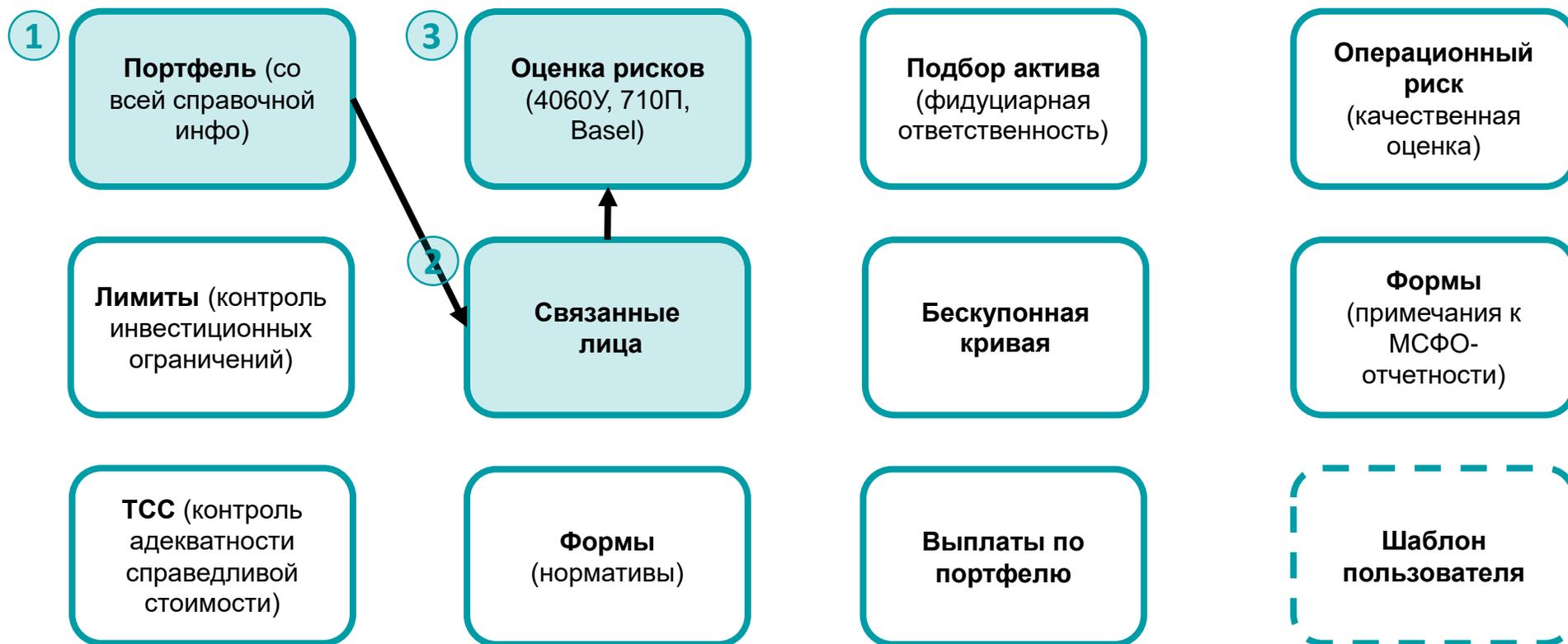
Контроль попадания в доверительный интервал цены

# Шаблоны RD FOR



Дата: 14.10.2019		Рассчитать													ИТОГО:	
TCC по портфелю 1		Классификация высоколиквидных активов, принадлежащих брокеру на 14.10.2019											ВЛА-1	2,87		
													ВЛА-2	0,00		
													не ВЛА	0,00		
№ п/п	Ценная бумага			ВЛА-1		ВЛА-2			ЦБ относится	Расчет стоимости ЦБ для ПКЛ				Общая стоимость ЦБ для расчета ПКЛ		
	торговый код	количество ЦБ	ISIN/Номер регистрации	являются индивидуальным клиринговым обеспечением	принимаются в обеспечение клиринговой организацией	обращаются на активном рынке	характеризуются низким уровнем рыночного, кредитного, правового, валютного рисков и риска рыночной ликвидности	низкий уровень риска		Рыночная цена ценной бумаги в соответствии с IFRS 13	Ставка риска клиринговой организации	наименование клиринговой организации	Стоимость ценной бумаги для расчета ПКЛ			
1	2	3	4													
1		1	RU000A01VW30	да	НКЦ	да	да	Федерации или Центральным банком Российской Федерации, ценные бумаги, эмитированные Правительством Российской Федерации или Центральным банком Российской Федерации, номинированные и фондируемые в рублях (порядок отнесения ценных бумаг к категории "фондируемые в рублях" установлен	ВЛА-1	1	5%	НКЦ	0,95	0,95		
2		1	RU000A01TYAS	да	НКЦ	да	да	ценные бумаги, эмитированные Правительством Российской Федерации или Центральным банком Российской Федерации, номинированные и фондируемые в рублях (порядок отнесения ценных бумаг к категории "фондируемые в рублях" установлен подпунктом 2.3.8 пункта 2.3 Инструкции Банка России N 139-И)	ВЛА-1	1	4%	НКЦ	0,96	0,96		
3		1	RU000A01SMA2	да	НКЦ	да	да		ВЛА-1	1	4%	НКЦ	0,96	0,96		

# Шаблоны RD FOR

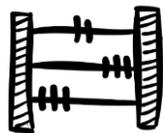


# Шаблоны RD FOR

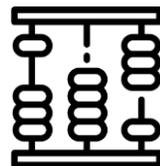
Оценка рисков



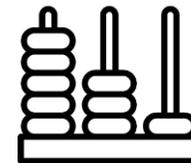
Оценка рисков производится после синхронизации с шаблоном Портфель



**Стресс-тест  
4060-У**



**Solvency II,  
Стресс-тест 710-П**



**Basel III,  
511-П**

Выбор метрики зависит от вида финансовой организации и законодательных требований по оценке рисков для данного вида организации

При этом компании могут выбирать и комбинировать метрики рисков в зависимости от групповых требований внутри компании и особенностей групповой консолидации: например, НПФ могут выбрать для своей оценки Solvency II, а проф. участники – стандарт Basel

# Шаблоны RD FOR

## Оценка рисков

Различные метрики (методы) оценки рисков и финансовой устойчивости (достаточности капитала), установленные нормативными актами для разных видов НФО

Виды рисков	НПФ	Страховщики	ПУРЦБ
Рыночный	Так как нет закрепленных законодательными требованиями подходов по оценке рисков, клиент может проводить только стресс-тест, либо использовать собственные методики или метрики других видов организаций		
Кредитный	Так как нет закрепленных законодательными требованиями подходов по оценке рисков, клиент может проводить только стресс-тест, либо использовать собственные методики или метрики других видов организаций		
ПКЛ/ВЛА	4028-У	710-П/РОПР	4402-У
ПДК	4028-У	710-П/3743-У	4630-У
Стресс-тест	4060-У	710-П	4501-У*
Операционный (качественная оценка)	4060-У	РОПР	4501-У

\*Для ПУРЦБ предлагаем возможность выбора метрики – Базельские требования (511-П и 193-Т), 710-П/Solvency II или модель стресс-тестирования НПФ. Кроме того, поддерживаем V@R и его модификацию для стресс-тестирования ПУРЦБ: по сценариям Банка России или с генерацией сценариев исходя из V@R подхода.

# Шаблоны RD FOR

4060-У для НПФ

Данные для заполнения файла Bonds

ID	Гос. Регистрационный номер	Наименование Актива	ИНН	Валю	Номинал	Непогашенный номинал	Периодичность в выплаты	Дата погашения	Дата ближайшей оферты	Плавящаяся стоимость	До погашения 0, по справ.	Индекс номинал						
4	RU000A0JU286	RU35007BELO	Белгородская Обл Прав	3124016792	RUR	1000	200	28.07.2020	00.01.1900	0	1	204,68						
5	RU000A0JTM44	4-08-00013-A	Башнефть	274051582	RUR	1000	1000	31.01.2023	00.01.1900	0	1	1049,47						
6	RU000A0JX0N6	29012RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	16.11.2022	00.01.1900	1	1	1023,03						
7	RU000A0JV7J9	29011RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	29.01.2020	00.01.1900	1	1	1032,01						
8	RU000A0JXFM1	26221RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	23.03.2033	00.01.1900	0	1	1113,34						
9	RU000A0JVV30	26217RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	18.08.2021	00.01.1900	0	1	1048,38						
10	RU000A0JTYA5	26214RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	27.05.2020	00.01.1900	0	1	1003,3						
11	RU000A0JTG59	26210RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	11.12.2019	00.01.1900	0	1	1031,99						
12	RU000A0J3W6	26207RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	03.02.2027	00.01.1900	0	1	1133,63						
13	RU000A0JREQ7	26205RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	14.04.2021	00.01.1900	0	1	1034						
14	RU000A0ZYCK6	25083RMF5	Минфин РФ	7710168360	RUR	1000	1000	15.12.2021	00.01.1900	0	1	1054,45						
15	RU000A0JUDX9	4-01-36431-R	финстоун	7701874112	RUR	1000	1000	04.01.2024	00.01.1900	1	1	794,97						
16	RU000A0JS8R5	4-01-36413-R	финСтандарт	7718876189	USD	1000	1000	22.05.2020	21.05.2020	0	1	56926,98						
17	RU000A0JUNV4	4-01-36433-R	Вейл финанс	7718788824	RUR	1000	1000	08.03.2023	00.01.1900	0	1	806,88						
18	RU000A0JUJW8	4-01-36438-R	Арчер финанс	77237	O	P	Q	R	S	T	U	V	W	X	Y	Z	AA	AB
7	RU000A0JV7J9	29011RMF5	Минфин РФ	7710168360	Эмитент	Дата выплаты	Ставка купона, % годовых	Сумма купона	Погашение номинала	Итого поток	Код потока	Плавящая ставка	Индекс номинал	Выпуск	От чего зависит флоутер	номер текущего купона		
9	RU000A0JVV30	26217RMF5	Минфин РФ	7710168360	Эмиссии													
14	RU000A0ZYCK6	25083RMF5	Минфин РФ	7710168360														
19	RU000A0JVK00	RU34011SAM0	МинуправлфинансамарскОбл	63158														
13	RU000A0JREQ7	Минфин РФ	15.04.2020	7,60%	37,90		37,90	13-43936	0									
13	RU000A0JREQ7	Минфин РФ	14.10.2020	7,60%	37,90		37,90	13-44118	0									
13	RU000A0JREQ7	Минфин РФ	14.04.2021	7,60%	37,90	1 000,00	1 037,90	13-44300	0									
24	RU000A0JRL96	ФСК ЕЭС	24.12.2019	8,50%	42,38		42,38	24-43823	0									
24	RU000A0JRL96	ФСК ЕЭС	23.06.2020	8,50%	42,38		42,38	24-44005	0									
24	RU000A0JRL96	ФСК ЕЭС	22.12.2020	8,50%	42,38		42,38	24-44187	0									
24	RU000A0JRL96	ФСК ЕЭС	22.06.2021	8,50%	42,38	1 000,00	1042,38	24-44369	0									
40	RU000A0JRU20	СЗКК	10.04.2020	7,31%	34,34		21,00	40-43931	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга	17	
40	RU000A0JRU20	СЗКК	09.10.2020	0,00%	-		22,00	40-44113	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	09.04.2021	0,00%	-		23,00	40-44295	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	08.10.2021	0,00%	-		25,00	40-44477	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	08.04.2022	0,00%	-		26,00	40-44659	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	07.10.2022	0,00%	-		27,00	40-44841	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	07.04.2023	0,00%	-		28,00	40-45023	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	06.10.2023	0,00%	-		30,00	40-45205	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	05.04.2024	0,00%	-		31,00	40-45387	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	04.10.2024	0,00%	-		33,00	40-45569	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		
40	RU000A0JRU20	СЗКК	04.04.2025	0,00%	-		34,00	40-45751	1						65888	ИПЦ; Ставка купона определяется по итогам бук-билдинга		

Информация об эмиссии, в том числе:

- непогашенный номинал
- даты погашения и оферты
- индексируемый номинал

Потоки выплат:

- купоны
- тело
- амортизация номинала

Параметры флоутера

# Шаблоны RD FOR

4060-У для НПФ

Данные для заполнения файла Модель с автоматизацией подтягивания потоков из файла Bonds

Дата	ТИП	НПФ	ИНН НПФ	Класс	Код	Наименование Актива	ИНН	MAX рейтинг	Наименование гаранта	ИНН	MAX рейтинг	Доля поручителя	Доля поручителя	Количество	Стоимость	Цена	Тип цен	Резерв	Дата погашения	Дата ближайшей оферты	Валюта	Recovery Rate	Резерв	Дивиденд объем в стрессе	Рэнкинг	Рез	
30.11.2019	ПН	АО "НПФ"	7707492166	Акции	RU000A0JUG31	Московский Кредитный	7734202860	BB				0%	0%	707627400	4185616071	5,915	1				RUR	0%					
30.11.2019	ПН	АО "НПФ"	7707492166	Акции	RU000A0JVVW89	Сафмар ФинИнвестици	6164077483	BB				0%	0%	9315390	4676325780	502	1				RUR	0%					
30.11.2019	ПР1	АО "НПФ"	7707492166	Акции	RU000A0JVVW89	Сафмар ФинИнвестици	6164077483	BB				0%	0%	4,7415	2380,233	502	1				RUR	0%					
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Акции	RU000A0JVVW89	Сафмар ФинИнвестици	6164077483	BB				0%	0%	0,2585	129,767	502	1				RUR	0%					
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации субъектов РФ	RU000A0JU286	Волгоградская Обл Пра	3124016792	BB				0%	0%	2,585	529,0978	204,68	1		28.07.2020		RUR	35%		3107198,16	24		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации корпоративные	RU000A0JTM44	Башнефть	274051582	BBB				0%	0%	6,721	7053,48787	1049,47	1		31.01.2023		RUR	35%		276647132	14		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JX0H6	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	30,2962	30993,92149	1023,03	1		16.11.2022		RUR	35%		12804179928	8		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JV719	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	155,1	160064,751	1032,01	1		29.01.2020		RUR	35%		36737441767	1		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JXFM1	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	14,993	16692,30662	1113,34	1		23.03.2033		RUR	35%		32885105921	4		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JVVW30	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	127,699	133877,0776	1048,38	1		18.08.2021		RUR	35%		35683773464	3		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JTYA5	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	29,469	29566,2477	1003,3	1		27.05.2020		RUR	35%		23205683719	6		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JTG39	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	29,2105	30144,9439	1031,99	1		11.12.2019		RUR	35%		17695181409	7		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0J53W6	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	28,435	32234,76905	1133,63	1		03.02.2027		RUR	35%		10759869494	9		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JREC7	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	45,7545	47310,153	1034	1		14.04.2021		RUR	35%		35811359985	2		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0ZYCK6	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	126,665	133561,9093	1054,45	1		15.12.2021		RUR	35%		29512657441	5		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации корпоративные	RU000A0JUDX9	Финстоун	7701874112	NR	GILLESPIE		NR	100%	100%	2164,162	1720443,865	794,97	1		04.01.2024		RUR	0%		17720	34		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации корпоративные	RU000A0JS8R5	ФинСтандарт	7718876189	NR	O1 GROUP LIMITED	2138002RDL	NR	100%	100%	12,3563	703406,843	56926,98	1		22.05.2020	21.05.2020	USD	0%		0	38		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации корпоративные	RU000A0JUNV4	Войл Финанс	7718788824	NR	Forlema Trading		NR	100%	100%	1776,1535	1433142,736	806,88	1		08.03.2023		RUR	0%		84000	32		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации корпоративные	RU000A0JUVW8	Арчер Финанс	7723735867	NR	Svenner Ventures	9909397649	NR	100%	100%	1213,2956	1319628,826	1087,64	1		23.03.2027	24.03.2022	RUR	0%		99138,2	31		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JV719	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	977,13	1008407,931	1032,01	1		29.01.2020		RUR	35%		36737441767	1		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0JVVW30	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	961,62	1008143,176	1048,38	1		18.08.2021		RUR	35%		35683773464	3		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	ПЦБ РФ	RU000A0ZYCK6	Минфин РФ	7710168360	BBB				0%	0%	956,45	1008528,703	1054,45	1		15.12.2021		RUR	35%		29512657441	5		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации субъектов РФ	RU000A0JVK00	МинИзраилФинансСам	6315802231	BB+				0%	0%	310,2	122020,272	393,36	1		18.06.2020		RUR	35%		93795169,66	15		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации субъектов РФ	RU000A0JW087	Минфин Финанс Обл	5503078670	BB				0%	0%	229,7548	240495,8369	1046,75	1		01.11.2021		RUR	35%		426808,7	27		
30.11.2019	СР	АО "НПФ"	7707492166	Облигации субъектов РФ	RU000A0JU386	Минфин						0%	0%	16,544	2568,456	155,25					RUR	35%					

Эмитенты, гаранты, поручители, группы связанности и их рейтинги

Дата оферты и погашения (фактическая выплата)

Объем торгов и рэнкинг, бета для акций

Связанные лица

Для определения связанных групп используется шаблон affiliate, в котором по идентификатору компании определяется групповая принадлежность компании (связные группы)

# Шаблоны RD FOR

710-П ДЛЯ СТРАХОВЩИКОВ

КОД	КОЛ-ВО	СТОИМОСТЬ	AC/FV	Класс актива	Выпуск	ВАЛЮТА	Страна	Гос рег номер	ИНН	Номинал	Сектор Эмитента	Инструмент	Рейтинг инструмента	Эмитент	Рейтинг эмитента	НКД, руб	Дюрация, дней	Мод. дюрация, лет	ДАТА ПОГАШЕНИЯ	Доходность к погашению, % годовых	Модиф. дюрация свод	Срок до даты погашения (дней)	Торгуется	субординированность	конвертируемость	просрочен?	Класс актива СК	Маркер "хороший" (1) / "плохой" (0) актив	ТИП контр-агента (Л/Ю/Л)	Стоимость с учетом плохой/хорошей акции	Рейтинг итого	госрегол	RD (сценарий)	RD с учетом срока	SR	CDR	IR	Подверженность риску
X50971721450	1	1	FV	ОВОЗ	Россия-20	USD	GB	12840068	7710168360	200000	Государств	Россия-20	BBB-	Минфин П	BBB-	2816,67	114	0,0095	15.09.2023	3217,44	0,0095	4,71232877	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ОВОЗ	1	1	BBB-	0,35	0,0064	0,0064	1	1	1		
X51317815550	1	1	FV	Облигации корпор	Goldman S	USD	GB		9909117323	1000	Банки	Goldman S	NR	Goldman S	BBB-	0	857	0,0203	05.05.2021	11438,3	0,0203	2,34794521	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
X51317815634	1	1	FV	Облигации корпор	Goldman S	USD	GB		9909117323	1000	Банки	Goldman S	NR	Goldman S	BBB-	0	1590	0,337	08.05.2023	1192,66	0,337	4,35616438	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
X51318252340	1	1	FV	Облигации корпор	Goldman S	USD	GB		9909117323	1000	Банки	Goldman S	NR	Goldman S	BBB-	0	920	0,0302	07.07.2021	8235,5	0,0302	2,52054795	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
X51318255012	1	1	FV	Облигации корпор	Goldman S	USD	GB		9909117323	1000	Банки	Goldman S	NR	Goldman S	BBB-	0	919	0,0301	06.07.2021	8275,71	0,0301	2,51780822	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JRCX7	1	1	FV	Облигации госуда	ВЭБ.РФ-9	RUB	RU	4-09-0000	7750004150	1000	Банки	ВЭБ.РФ-9	NR	ВЭБ.РФ	BBB-	24,87	132	0,0115	17.03.2021	3045,12	0,0115	2,21369863	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации гос	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JTB82	1	1	FV	Облигации госуда	ВЭБ.РФ-19	RUB	RU	4-24-0000	7750004150	1000	Банки	ВЭБ.РФ-19	NR	ВЭБ.РФ	BBB-	21,64	140	0,012	22.09.2032	3105,66	0,0123	2,27123288	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации гос	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JU1T2	1	1	FV	Облигации субъект	Новосибир	RUB	RU	RU35006N	5406285846	1000	Государств	Новосибир	BB-	Новосибир	BB-	3,89	84	0,0001	21.07.2020	420937	0,0001	1,55890411	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации му	1	1	BB-	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JU2H5	1	1	FV	Облигации субъект	Самарская	RUB	RU	RU35009S	6315802231	1000	Государств	Самарская	BB	Минфин ВВ	BB	2,63	105	0,0005	30.07.2020	59381,4	0,0005	1,58356164	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	BB	0,35	0,0126	0,0126	1	1	1		
RU000A0JU740	1	1	FV	Облигации субъект	Удмуртская	RUB	RU	RU35001U	18318072895	1000	Государств	Удмуртская	NR	Удмуртия Г В	BB	4,49	197	0,0029	30.09.2020	18544,1	0,0029	1,75342466	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JUQ87	1	1	FV	Облигации субъект	Белгородс	RUB	RU	RU35008B	3124016792	1000	Государств	Белгородс	NR	Белгородс	BB	0,51	84	0	20.06.2021	999900	0	2,4739726	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JUR46	1	1	FV	Облигации субъект	Новосибир	RUB	RU	RU34016A	5406634649	1000	Государств	Новосибир	BB	Минфин ВВ	BB	6,17	52	0,0001	07.10.2019	212598	0,0001	0,76986301	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	BB	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JV7J9	1	1	FV	ЦБ РФ	ФЗ-2901	RUB	RU	29011RMF	7710168360	1000	Государств	ФЗ-2901	NR	Минфин П	BBB-	33,4	98	0,002	28.01.2020	13298	0,002	1,07945205	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ЦБ РФ	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JKV9	1	1	FV	Облигации субъект	Коми Респ	RUB	RU	RU35012K	1101481969	1000	Государств	Коми Респ	BB	Минфин П	BBB-	32,98	105	0,002	28.01.2020	13298	0,002	1,07945205	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ЦБ РФ	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JVL33	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	12,48	71	0,0048	28.07.2026	3987,16	0,0048	2,59452055	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB+	0,35	0,0079	0,0079	1	1	1		
RU000A0JVM00	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	57,02	95	0,0082	03.12.2032	5690,03	0,0084	1,90410959	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB+	0,35	0,0064	0,0064	1	1	1		
RU000A0JVR3	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	7,78	59	0,0002	21.01.2032	76645,2	0,0002	5,09041096	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB+	0,35	0,0126	0,0126	1	1	1		
RU000A0JVAQ7	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	9,83	160	0,0117	24.09.2020	3653,12	0,0117	1,7369863	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JVS3	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	3,74	42	0,0001	05.04.2032	104418	0,0001	4,29863014	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB	0,35	0,0126	0,0126	1	1	1		
RU000A0JVV30	1	1	FV	ЦБ РФ	ФЗ-2901	RUB	RU	29011RMF	7710168360	1000	Государств	ФЗ-2901	NR	Минфин П	BBB-	26,92	99	0,002	28.01.2020	13298	0,002	1,07945205	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ЦБ РФ	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JWN89	1	1	FV	Облигации корпор	ГПЛК-7	RUB	RU	4802-07-3	7720261827	1000	Фин.серви	ГПЛК-7	BB	ГПЛК	BB	1,34	160	0,0117	24.09.2020	3653,12	0,0117	1,7369863	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JWN89	1	1	FV	Облигации корпор	ГПЛК-7	RUB	RU	4802-07-3	7720261827	1000	Фин.серви	ГПЛК-7	BB	ГПЛК	BB	1,34	160	0,0117	24.09.2020	3653,12	0,0117	1,7369863	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JWR5	1	1	FV	Облигации корпор	Газпром н	RUB	RU	4802-01-0	5504036333	1000	Нефтегазо	Газпром н	NR	Газпром н	BBB-	32,19	96	0,0082	23.07.2046	3093,02	0,0084	2,64931507	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JWR5	1	1	FV	Облигации корпор	Газпром н	RUB	RU	4802-01-0	5504036333	1000	Нефтегазо	Газпром н	NR	Газпром н	BBB-	32,19	96	0,0082	23.07.2046	3093,02	0,0084	2,64931507	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JWR5	1	1	FV	Облигации корпор	Газпром н	RUB	RU	4802-01-0	5504036333	1000	Нефтегазо	Газпром н	NR	Газпром н	BBB-	32,19	96	0,0082	23.07.2046	3093,02	0,0084	2,64931507	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JWST1	1	1	FV	Облигации корпор	ГПЛК-8	RUB	RU	4802-08-3	7720261827	1000	Фин.серви	ГПЛК-8	BB	ГПЛК	BB	33,76	111	0,0099	31.08.2026	2961,53	0,0101	2,68767123	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JX0B9	1	1	FV	Облигации субъект	Московск	RUB	RU	RU35010N	5000001451	1000	Государств	Московск	BB+	МЭФ Мос	BB+	8,96	77	0,0002	20.11.2023	98519,2	0,0002	4,89315068	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	BB+	0,35	0,0079	0,0079	1	1	1		
RU000A0JX0H6	1	1	FV	ЦБ РФ	ФЗ-2901	RUB	RU	29011RMF	7710168360	1000	Государств	ФЗ-2901	NR	Минфин П	BBB-	8,23	165	0,0087	15.11.2022	5109,99	0,0087	3,87945205	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ЦБ РФ	1	1	NR	0	0,3	0,3	1	2	1		
RU000A0JX259	1	1	FV	Облигации субъект	Калинингр	RUB	RU	RU34001K	3905014118	1000	Государств	Калинингр	BB+	Минфин К	BB+	2,88	92	0	16.12.2021	891505	0	2,96438356	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации суб	1	1	BB+	0,35	0,0316	0,0316	1	1	1		
RU000A0JXE06	1	1	FV	Облигации корпор	ГПЛК-001P	RUB	RU	4802-03-3	7720261827	1000	Фин.серви	ГПЛК-001P	BB	ГПЛК	BB	15,97	59	0,0002	21.01.2032	76645,2	0,0002	5,09041096	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB+	0,35	0,0126	0,0126	1	1	1		
RU000A0JXM08	1	1	FV	Облигации корпор	РСКБ-01P	RUB	RU	48020103	7725114488	1000	Банки	РСКБ-01P	NR	РСКБ	BB+	24,47	160	0,0117	24.09.2020	3653,12	0,0117	1,7369863	ИСТИНА	ЛОЖЬ	ИСТИНА	ЛОЖЬ	Облигации кор	1	1	BB	0,35	0,0225	0,0225	1	1	1		
RU000A0JXP2	1	1	FV	Облигации корпор	ГПЛК-001P	RUB	RU	4802-04-3	7720261827	1000	Фин.серви	ГПЛК-001P	BB	ГПЛК	BB	18,62	42	0,0001	05.04.2032	104418																		

# Шаблоны RD FOR

710-П для СТРАХОВЩИКОВ

Возможность выбирать сценарии и квантили для учета рисков

Корреляционные матрицы согласно Проекту  
Если корреляция не учитывается, то ставим везде 100%

Оценить риски	Рыночный риск	Корреляционная матрица								со страниц рисков				
		Концентрационный риск	Процентный риск	Риск расширения кредитных спредов	Риск снижения цен на акции	Риск снижения цен на недвижимость	Риск изменения курса валют	Риск снижения цен на иные активы	Standalone	Взвеш	Диверсификац	Скорр рыночн	С итоговой корр	
	261,06	Концентрационный риск	100%	0%	0%	0%	0%	0%	254,00	254,00	97%	247,13	247,13	
		Процентный риск	0%	100%	100%	100%	100%	75%	2,24	60,29	23%	0,52	0,52	
		Риск расширения кредитных спредов	0%	100%	100%	100%	100%	100%	40,19	60,29	23%	9,28	9,28	
		Риск снижения цен на акции	0%	100%	100%	100%	100%	100%	17,85	60,29	23%	4,12	4,12	
		Риск снижения цен на недвижимость	0%	100%	100%	100%	100%	100%	-	60,29	23%	-	-	
		Риск изменения курса валют	0%	75%	100%	100%	100%	100%	-	59,72745216	23%	-	-	
		Риск снижения цен на иные активы	0%	100%	100%	100%	100%	100%	-	60,28846954	23%	-	-	
		Кредитный риск	Матрица корреляции			Standalone	Взвеш	Диверсификац	Скорр кредитн	С итоговой корр				
	1,00	0,6	Значительные вложения в юр. и физ. лиц, вложения в юр. лиц с рейтингом	Незначительные вложения в юр. Лиц	Незначительные вложения в физ. Лиц	1,00	1	100%	1	0,253585995				
			Значительные вложения в юр. и физ. лиц, вложения в юр. лиц с рейтингом	75%	25%	0,75	0,75	75%	0	0				
			Незначительные вложения в юр. Лиц	75%	100%	0,25	0,25	25%	0	0				
			Незначительные вложения в физ. Лиц	25%	25%	100%								
			Рыночный риск	Кредитный риск	Standalone	Взвеш	Диверсификац	С итоговой корреляцией						
			100%	25%	261,1	261,31	100%	261,06						
			Кредитный риск	25%	1,00	66,26	25%	0,25						
			Итого оценка фин риск	Рыночный риск	Кредитный риск	Standalone	Взвеш	Диверсификац	С итоговой корреляцией					
			261,31	100%	25%	261,1	261,31	100%	261,06					
				Кредитный риск	25%	1,00	66,26	25%	0,25					
			Оценка опер рисков											
			Итоговая оценка рисков:	261,31										

Обратное разложение рисков по каждому риску с учетом корреляционных эффектов

Общая оценка рисков с учетом корреляции

Автоматизированный расчет кредитного риска  
(для незначит. рисков – ручной ввод результата по автоматизированному алгоритму)

# Шаблоны RD FOR

511-П для ПУРЦБ

СВОДНЫЙ ОТЧЕТ О ВЕЛИЧИНЕ РЫНОЧНОГО РИСКА		Положения ЦБ РФ:	511-П/мар19	199-И/янв20	421-П/окт19	дополнительные валюты	
Дата:	30.11.2019	Выбрать дату	Заморозка рейтингов:	Да		1. Импорт portfolio	2. 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)	29 072 736 170,67								
2	общий	4 196 766 431,13	4 143 721 243,29	53 045 187,84						
3	специальный	24 875 969 739,54	22 505 449 374,88	2 370 520 364,66	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
4	гамма и вега	0,00	X	X	X	X	X	X	X	X
5	Фондовый риск (ФР)	2 124 661 130,31								
6	общий	1 062 330 565,15	1 062 330 565,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
7	специальный	1 062 330 565,15	1 062 330 565,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
8	гамма и вега	0,00	X	X	X	X	X	X	X	X
9	Валютный риск (ВР)	0,00	X	X	X	X	X	X	X	X
10	РВА по ОВП	0,00	X	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11	гамма и вега	0,00	X	X	X	X	X	X	X	X
12	Товарный риск (ТР)	0,00								
13	общий	0,00	0,00	X	X	X	X	X	X	X
14	дополнительный	0,00	0,00	X	X	X	X	X	X	X
15	гамма и вега	0,00			X	X	X	X	X	X
16	Рыночный риск (РР)	389 967 466 262			X	X	X	X	X	X

Общая оценка рыночного риска в разбивке на виды рисков и на валюты



# Шаблоны RD FOR



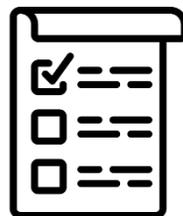
# Шаблоны RD FOR

## Лимиты, связанные лица

Шаблон позволяет проконтролировать инвестиционные ограничения как установленные законодательством для различных видов НФО, так и установленные в рамках инвестиционных деклараций и договоров. Группы связанных лиц также учитываются (с применением шаблона affiliate).



Маркировка  
портфелей в  
загруженном  
шаблоне  
Портфель



Определение  
списка  
ограничений  
для каждого  
вида  
портфелей



Автоматизированный  
контроль лимитов

Возможна настройка импорта портфеля из торгового терминала, либо отчетной формы компании

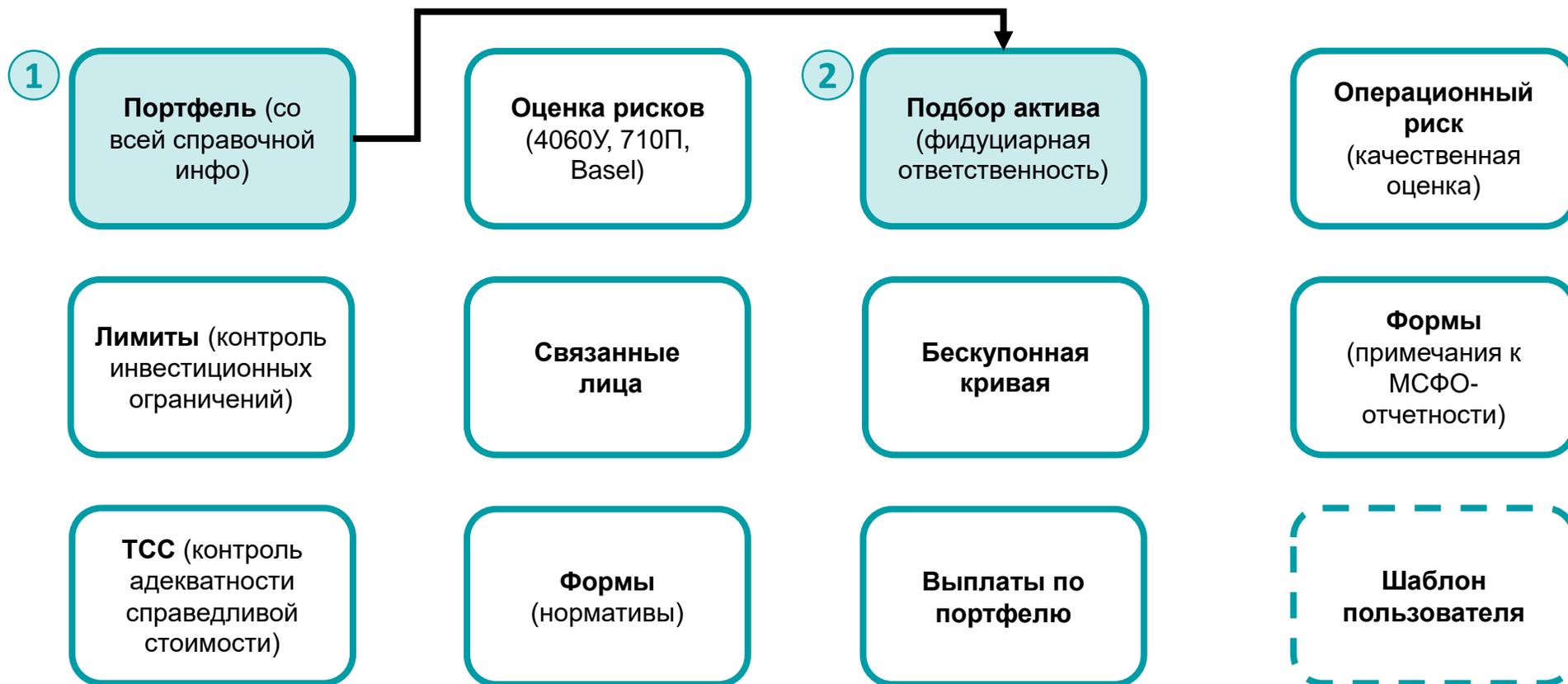
# Шаблоны RD FOR

Лимиты			Дюрация	Эмитент	Класс акти	Листинг	Рейтинг	Инструме	Класс акт	Класс акт	Класс акт	Облигаци	Банки	Доля СЧА	Алгоритм работы	X	Y	
1	1		1,3	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение	0	Заполнить Config и Внести депозиты								
2	1	НПФ	1,5	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение	0,62%	1	Скопировать номера портфелей	Номер портфеля						
3	1		3,0	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение		2	Очистить портфель	Очистить портф						
4	1	Елена Малинина: те, для кого смотрим долю СЧА	4,1	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение	1,64%	3	Загрузить данные RU Data	Заполнить портф						
5	1		3,9	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение		2	Очистить стр лимитов	Очистить						
6	1		4,5	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение		3	Рассчитать лимиты	Рассчитать						
7	1		3,3	OK	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
8	1		1,3	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
9	1		2,7	OK	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
10	1		1,6	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
11			0,4	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
12			0,2	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
13			1,7	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
14			9,1	Нарушение	Нарушение	OK	OK	Нарушение										
15	1		3,0	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
16			7,9	Нарушение	Нарушение	OK	OK	Нарушение										
17			3,3	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
18			3,0	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
19			3,8	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										
20			6,32	Нарушение	Нарушение	OK	OK	Нарушение										
21			0,53	Нарушение	Нарушение	Нарушение	OK	Нарушение										

Контроль ограничений по портфелю:

- законодательные
- по договору ДУ (инвест. декларация)

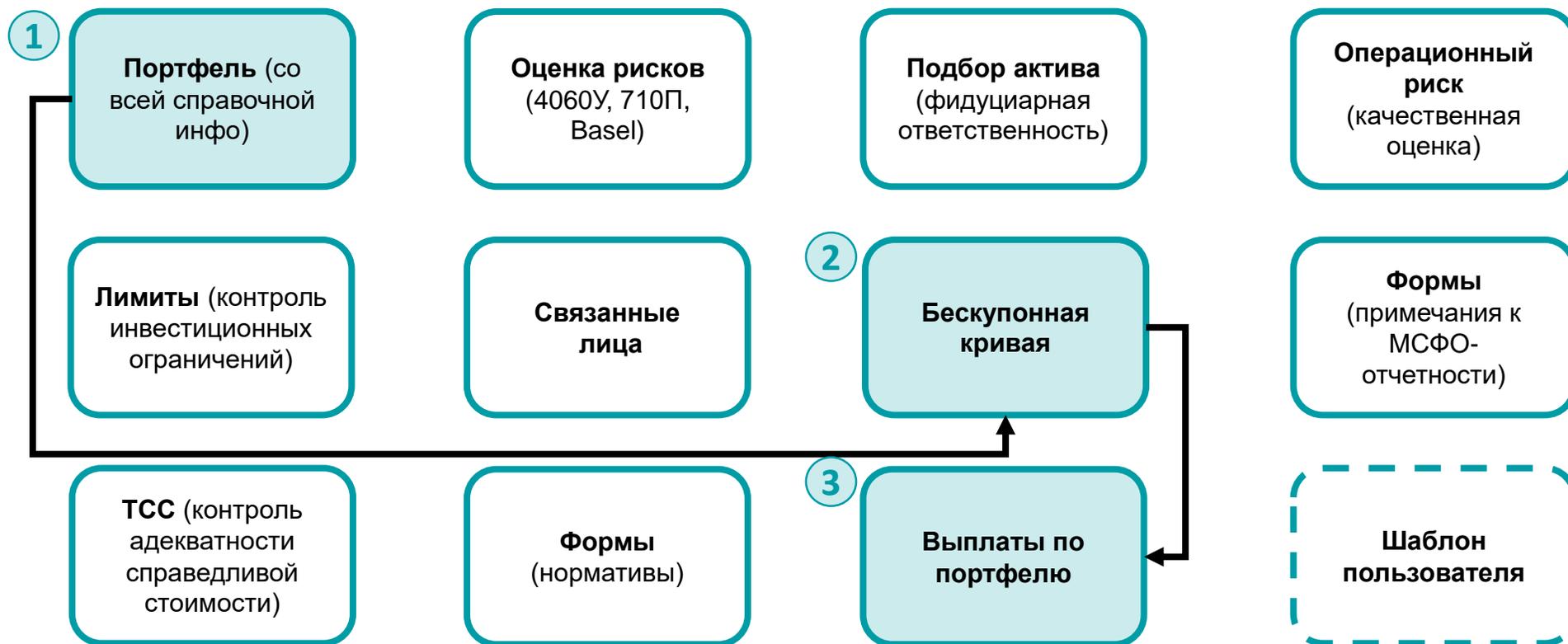
# Шаблоны RD FOR







# Шаблоны RD FOR



# Шаблоны RD FOR

## Выплаты, бескупонная кривая

Шаблон позволяет оценить объемы выплат по портфелю активов в дневной и годичной агрегации. Представление – горизонтальный календарь. Выплаты могут быть дисконтированы при помощи бескупонной кривой Московской Биржи на заданную дату

Алгоритм работы

Сумма выплат по годам (для ALM по Solvency II)

	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Активы	260 464,67	1 438 832,39	1 635 491,24	1 043 397,36	323 883,06	584 515,47
Ставка	6,07	6,17	6,20	6,20	6,23	6,26

Бескупонная кривая

1 Ввести Рег код и Количество бумаг на странице "Портфель" (столбцы А и Б)	Завести портфель
3 Проверить дату расчета	30.11.2019
4 Ввести число лет прогноза	5,00
5 Нажать кнопку:	Загрузить таблицу
6 Нажать кнопку:	Расчитать оферты
7 Нажать кнопку:	Показать календарь
8 Нажать кнопку:	Посчитать дисконт
9 Нажать F9, если не загрузилось G-curve	

КОД	КОЛ-ВО	Дата оферты	Выплата оферты	Дата погашения	Выплата погашения	НКД на дату оферты	30.11.2019	01.12.2019	02.12.2019	03.12.2019	04.12.2019	05.12.2019	06.12.2019	07.12.2019	08.12.2019	09.12.2019	10.12.2019	11.12.
RU000A01REQ7	1	31.12.2019		14.04.2021	1000	0				37,9								
RU000A01WMO7	1	31.12.2019				0												
RU000A1007F4	1	31.12.2019		17.07.2024	1000	0												
RU000A01TL3	1	31.12.2019		23.01.2023	1000	0												
RU000A02YCK5	1	31.12.2019		13.12.2021	1000	0												
RU000A02YU88	1	31.12.2019		28.02.2024	1000	0												
RU000A01U4L3	1	31.12.2019		16.08.2023	1000	0												

Выплаты по разбивке по дням на заданном горизонте лет

# Шаблоны RD FOR

**Портфель** (со  
всей справочной  
инфо)

**Оценка рисков**  
(4060У, 710П,  
Basel)

**Подбор актива**  
(фидуциарная  
ответственность)

**Операционный  
риск**  
(качественная  
оценка)

**Лимиты** (контроль  
инвестиционных  
ограничений)

**Связанные  
лица**

**Бескупонная  
кривая**

**Формы**  
(примечания к  
МСФО-  
отчетности)

**ТСС** (контроль  
адекватности  
справедливой  
стоимости)

**Формы**  
(нормативы)

**Выплаты по  
портфелю**

**Шаблон  
пользователя**

- Проверка ISIN
- WishList

# Шаблоны RD FOR

## Шаблоны пользователя: ISIN

В данном шаблоне реализуется контроль входных идентификаторов согласно существующим ГОСТ и иным стандартам

### Контроль корректности ISIN

КОД	корректно?	в чем ошибка?		
RU000A0ZYAP9	ИСТИНА			
RU000A1006H2	ИСТИНА		Проверить	
RU000A0JXY44	ИСТИНА			
RU000A0ZZ1M2	ИСТИНА		Проверить	
RU000A0ZZXL7	ЛОЖЬ	incorr pattern	input	
RU000A1008Q9	ИСТИНА			
RU000A0ZYG52	ИСТИНА			
RU000A0ZYBT9	ИСТИНА			
RU000A100KX5	ИСТИНА			
RU000A0ZZXS2	ИСТИНА			
RU000A0JRU20	ИСТИНА			
RU000A0JRU46	ИСТИНА			
RU000A0JV3T7	ЛОЖЬ	incorr language or lenght		
RU000A0JV3U5	ИСТИНА			

### Контроль корректности рег. номера

КОД	корректно?	в чем ошибка?		
26207RMFS	ИСТИНА		Проверить	
41303349B	ИСТИНА			
RU35010SAM0	ИСТИНА			
4-09-00004-T	ИСТИНА			
4-30-00739-A	ЛОЖЬ	incorr language or lenght		
FB020903349B	ЛОЖЬ	incorr language or lenght		
4B02-07-36241-R	ИСТИНА			
4B02-01-01556-A	ИСТИНА			
4B02-05-00206-A-001P	ИСТИНА			
4-01-00303-R-234D	ИСТИНА			
401-00303-R	ИСТИНА			
KZ1C40310O19	ЛОЖЬ	incorr language or lenght		
KZ1P40310115	ИСТИНА			

# Шаблоны RD FOR

Шаблоны пользователя:  
Wishlist

В данном шаблоне происходит отслеживание изменений на дату по заведенному портфелю: изменение рейтинга, уровня листинга, приближение даты погашения и досрочного погашения

## Отслеживание выбранных событий для портфеля

Изменение рейтинга бумаги	Нет	17.05.2018	13.05.2019	-дата для уровня листинга	Заполнить								
Изменение рейтинга эмитента	Нет	ISIN, Гос.рег.номер, код НРД, SWIFT	Облигации/Дкци/Банковское вложение	Изменение уровня листинга	Дней до погашения	Дней до оферты	Дата погашения	Дата оферты	Изменение рейтинга бумаги	Изменение рейтинга эмитента	макс дата бумага	макс дата эмитент	Рейтинги Эмиссии
Изменение уровня листинга	Нет	412019788	Облигация	0	97		22.08.2018		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	
<i>мин дней до оферты/погашения</i>	<b>100</b>	4802-01-00372-R-001P	Облигация	0	725		11.05.2020		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	
Дней до погашения	97	26221RMFS	Облигация	0	5424		23.03.2033		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	
Дней до оферты	Больше 100 дней	RU000A0JTVJ2	Облигация	0	1790	334	11.04.2023	16.04.2019	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	РСХБ-20-об
		RU000A0JUKX4	Облигация	0	5402	198	01.03.2033	01.12.2018	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-30-об
		RU000A0JQAL8	Облигация	0	1824		15.05.2023		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-14-об
		RU000A0JPE6	Облигация	0	182		15.11.2018		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-10-об
		RU000A0JQAL8	Облигация	0	1824		15.05.2023		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-14-об
		RU000A0JUU9	Облигация	0	2310	854	12.09.2024	17.09.2020	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	12:00:00 AM	0	МОЭСК-4-боб
		RU000A0JTVJ2	Облигация	0	1790	334	11.04.2023	16.04.2019	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	РСХБ-20-об
		RU000A0JWU98	Облигация	0	1224		22.09.2021		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Группа ЛСР-50-001P-01
		RU000A0JBX1	Облигация	0	2506	140	27.03.2025	04.10.2018	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Банк Зенит-9-боб
		RU000A0JU674	Облигация	0	855		18.09.2020		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	12:00:00 AM	0	ВашкортостанРесп-34008-об
		RU000A0JUY9	Облигация	0	2713	338	20.10.2025	20.04.2019	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Росбанк-1-8-боб
		RU000A0JWM31	Облигация	0	1134	224	24.06.2021	27.12.2018	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Тинькофф Банк-7-боб
		RU000A0JRF37	Облигация	0	182		15.11.2018		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-19-об
		RU000A0JUWT7	Облигация	0	329		11.04.2019		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	12:00:00 AM	0	ВашкортостанРесп-34009-об
		RU000A0JUKX4	Облигация	0	5402	198	01.03.2033	01.12.2018	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-30-об
		RU000A0JQAL8	Облигация	0	1824		15.05.2023		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-14-об
		RU000A0JPE6	Облигация	0	182		15.11.2018		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	ДОМ.РФ-10-об
		RU000A0JUU9	Облигация	0	2310	854	12.09.2024	17.09.2020	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	12:00:00 AM	0	МОЭСК-4-боб
		RU000A0JTVJ2	Облигация	0	1790	334	11.04.2023	16.04.2019	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	РСХБ-20-об
		RU000A0JWU98	Облигация	0	1224		22.09.2021		ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Группа ЛСР-50-001P-01
		RU000A0JBX1	Облигация	0	2506	140	27.03.2025	04.10.2018	ЛОЖЬ	ЛОЖЬ	0	0	Банк Зенит-9-боб

# КОНТАКТЫ

## 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](mailto:rudata@interfax.ru)

Новости проекта смотрите на сайте: [www.rudata.info](http://www.rudata.info)

Вы также можете принять участие в обучающих мероприятиях Учебного центра Группы «Интерфакс»: [event.interfax.ru](http://event.interfax.ru)