

«Терминал.ТрэкРекордс»

Функциональные характеристики

Core: 0.12.27

API: 0.61.21

Frontend: 1.1.19

ООО «ТРЭКРЕКОРДС»

г. Москва

Предупреждение об исключительных правах

Этот документ является составной частью технической документации ТрэкРекордс

Все права защищены. © 2013-2024, ООО "ТРЭКРЕКОРДС"

Программа для ЭВМ Терминал.ТрэкРекордс (Программное обеспечение)

ООО "ТРЭКРЕКОРДС" является правообладателем исключительных прав на Программное обеспечение. Авторские права подтверждены Федеральной службой по интеллектуальной собственности (Роспатент).

Программное обеспечение внесено в единый реестр российских программ для электронных вычислительных машин и баз данных 12.12.2023, регистрационный номер 2023687142. Свидетельство о государственной регистрации Программного обеспечения опубликовано на [сайте](#).

Контактная информация

ООО «ТРЭКРЕКОРДС»

ИНН: 7708786610

Email: support@trackrecords.ru

Web: trackrecords.ru/terminal/

Юр. адрес: 107140, Москва, Красносельский 1-й Переулок, д.3, помещение I, комната 17

Оглавление

Общее описание	4
Функциональные характеристики и набор модулей (пользовательский)	5
Портфели (Анализ срезов портфелей).....	5
Сценарии	6
Инструменты.....	6
Watchlist	7
Калькулятор облигаций	8
Скринеры облигаций.....	10
Навигатор сделок	11
Сканер стаканов.....	12
Скринеры акций.....	13
Рабочие столы.....	13
Суперграфик.....	14
Ассистент.....	14
Полная доходность.....	15
Фидуциарка.....	15
RFQ и рассылки	16
Поиск инструментов и справочные витрины	17
Наполнение платформы данными	19
Административная часть Платформы.....	19
Учетные записи	19
Справочники	20
МОEX.....	20
Облигации	20
Цены облигаций	20
Денежные потоки.....	20
Сценарии	20
Ежедневные показатели	20
Индексы.....	21
Рейтинги	21
Акции	22
Цены акций	22
Ассистент	22

Общее описание

Терминал.ТрэкРекордс позволяет автоматизировать решение задач институциональных инвесторов (УК, СК, НПФ, Банки, Брокеры, Инвестиционные консультанты)

Помогает автоматизировать инвестиционные процессы, анализировать инвестиции, управлять портфелями, визуализировать аналитические данные по портфелям и рынку, создавать новые аналитические продукты/отчеты, автоматизировать процессы внутри компании.

Нашу платформу и сервисы используют для:

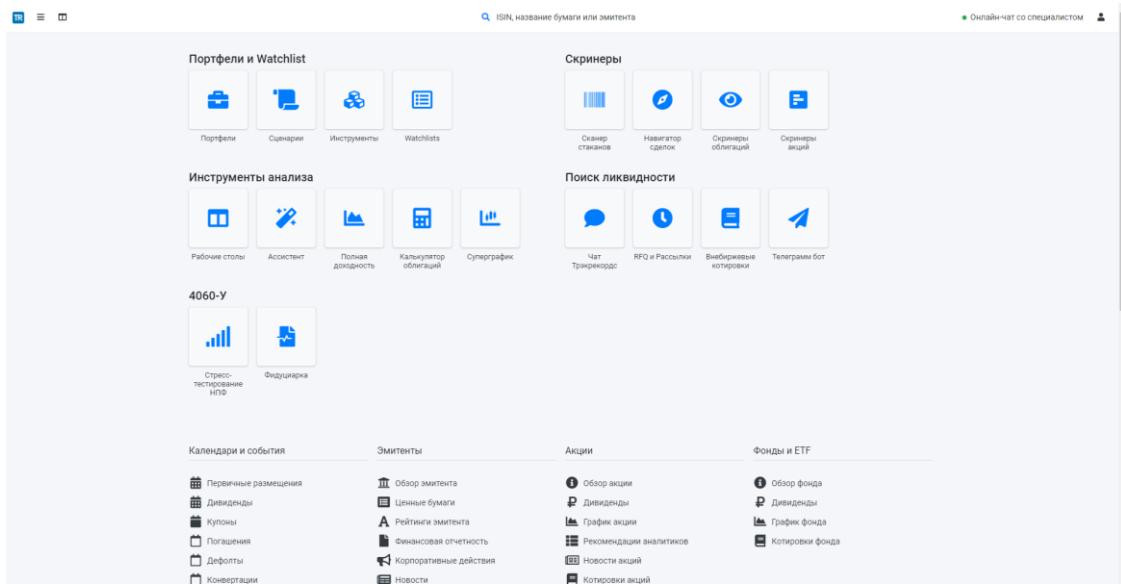
- Анализа рыночной информации и просмотра справочной информации о ценных бумагах
- Анализа срезов портфелей ценных бумаг на дату
- Стресс-тестирования НПФ и СК
- Real-time анализа рынка облигаций Московской биржи и поиска ликвидности в стаканах
- Pre-trade и Post-trade контроля сделок на наличие фидuciарной ответственности при управлении активами НПФ (как для облигаций, так и для акций) по методикам ЦБ;
- Расчета справедливой цены неликвидных бумаг;
- Оценки целесообразности владения активами;
- Поиска облигаций-аналогов с учетом заданных критериев;
- Анализа кредитных спредов на основе цен сделок в разных срезах;
- Построения карты рынка облигаций на основе данных из глубины стаканов;
- Создания аналитических отчетов;
- ... и для многоного другого.

ТрэкРекордс может быть установлен на серверах заказчика или предоставляться в виде облачного сервиса.

ТрэкРекордс используют более 30 компаний финансового рынка России. Список наших клиентов можно посмотреть [здесь](#)

Функциональные характеристики и набор модулей (пользовательский)

ТрэксРекордс предоставляет широкий набор функциональных возможностей и модулей для анализа ценных бумаг и управления портфелями. Ниже приведен краткий обзор основных модулей и их функциональных характеристик



Портфели (Анализ срезов портфелей)

Модуль портфели позволяет анализировать срезы портфелей ценных бумаг на дату, проводить анализ рыночной информации и просматривать справочную информацию о ценных бумагах.

The screenshot shows the 'Фонд-Демо' (Fund-Demo) portfolio analysis module. At the top, there's a back arrow, a search bar, and a 'Рабочий стол / Портфели / Фонд-Демо' breadcrumb. Below that are buttons for 'Состав' (Composition), 'Стресс-тесты' (Stress tests), 'Дашборды' (Dashboards), and 'Ассистент' (Assistant). On the right, there are buttons for 'Редактировать состав' (Edit composition) and 'Загрузить активы' (Upload assets). The main area displays a table of securities with columns: Подпортфель (Subportfolio), Класс актива (Asset class), ISIN, Эмитент (Issuer), ИНН, Количество (Quantity), Цена, руб (Price, rub), Сумма, руб (Sum, rub), Тип цены (Type of price), ПИФ (PIF), Валюта (Currency), and Непогашенный номинал (Unpaid nominal). The table lists various bonds from issuers like РЖД, Минфин РФ, Банк ФК Открытие, and Россети, with quantities ranging from 228.0 to 310.0 units and prices from 947.9 to 979.08 rubles.

Ниже представлены основные функции модуля портфели:

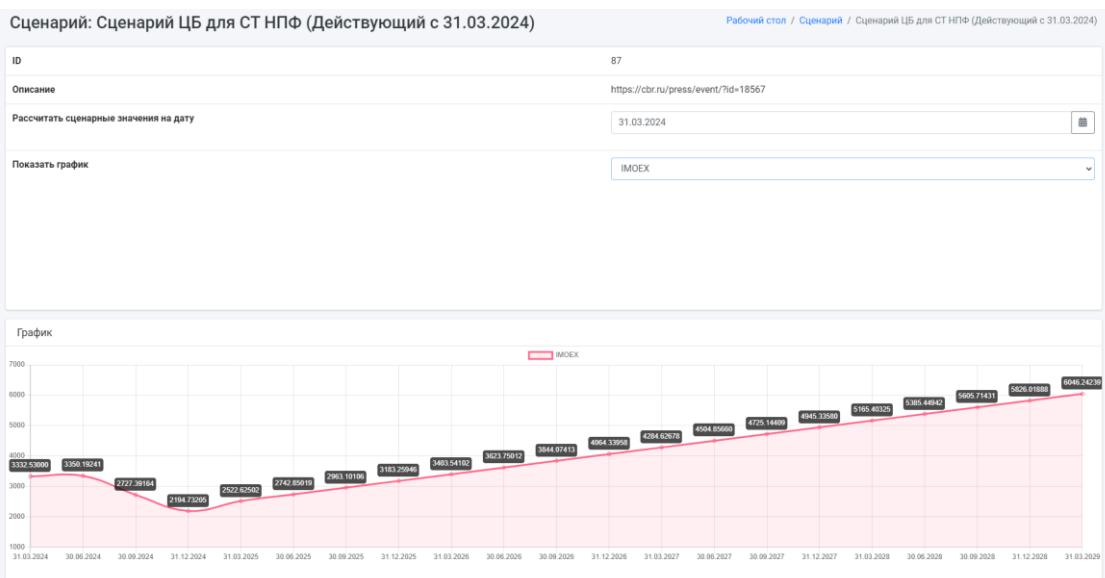
- Загрузка срезов портфелей по арі и через Excel
- Показатели риска портфеля (дюрация, beta, рейтинги, pd, среднедневные объемы торгов)
- Инвестиционные показатели (YTM, Gspread, и др)
- Выгрузка готового отчета в Excel
- ВІ инструментарий для анализа портфеля
- Оценка активов портфеля по рыночным ценам
- Календари купонов, оферт и погашений по портфелю

- Анализ кредитного риска по портфелю
- Сканирование ликвидности облигаций в стаканах облигаций портфеля на Московской бирже
- Стресс-тестирование портфеля НПФ по методикам ЦБ РФ (4060-У)

Сценарии

Модуль сценарии позволяет создавать собственные сценарии о изменении индикаторов финансового рынка и экономики, а также анализировать их влияние на портфели ценных бумаг.

Сценарии используются в стресс-тестировании инвестиционных портфелей, а также для анализа чувствительности портфелей к изменениям рыночных условий. Сценарии также используются в калькуляторах облигаций для расчета справедливой цены и доходности.



Инструменты

Модуль Инструменты позволяет пользователю создавать собственные уникальные финансовые инструменты, а также проводить анализ их характеристик и параметров в портфелях. В данном модуле пользователь может создать следующие типы инструментов:

- депозиты
- дебиторская задолженность
- кредиторская задолженность
- денежные средства на расчетных счетах
- РЕПО
- недвижимость
- займы

The screenshot shows a table titled 'Список инструментов' (List of Instruments) with 15 rows. The columns are: 'Строки с 1 по 15 из 958' (Rows 1 to 15 of 958), 'Дата записи' (Record Date), 'Уникальный код' (Unique Code), 'Название актива' (Name of Asset), and 'Класс актива' (Asset Class). The data includes various financial instruments like '61009', '60302', and 'deb_euroclear_evraz'. A blue button '+ Создать инструмент' (Create instrument) is located at the top right.

Watchlist

Модуль Watchlist позволяет создавать и анализировать собственные списки ценных бумаг или эмитентов для дальнейшего мониторинга и анализа. Watchlist позволяет отслеживать изменения цен, объемов торгов, кредитных рейтингов и других параметров ценных бумаг, а также проводить анализ и сравнение различных инструментов.

The screenshot shows a table titled 'Списки' (Lists) with 10 rows. The columns are: 'Строки с 1 по 10 из 10' (Rows 1 to 10 of 10), 'Списки' (Lists), and 'Витрины' (Shelves). The lists include: 'Акции' (Created 21.11.2023 11:49, 2 instruments), 'Эмитенты' (Created 17.11.2023 10:02, 4 emitters), 'Замещающие' (Created 12.10.2023 11:06, 30 ISINs), 'Новые эмитенты' (Created 14.09.2023 11:17, 5 emitters), 'WL' (Created 17.03.2023 13:11, 165 ISINs), 'Watchlist 2' (Created 10.02.2023 10:16, 39 ISINs), and 'BB-эмитенты' (Created 15.11.2022 21:40, 3 emitters). A black button 'Сканир стаканной по эмитентам' (Scan by emitter in the order book) is visible above the list. A blue button '+ Новый список' (New list) is at the top right.

Калькулятор облигаций

Модуль для расчета метрик облигаций, таких как YTM, Duration, Macaulay Duration, Modified Duration, Yield to Call, Yield to Worst, Yield to Maturity, Spread to Benchmark, Spread to Curve, Z-Spread, и других. Модуль позволяет проводить анализ сделок с облигациями, расчет справедливой цены и доходности, а также оценку кредитного риска.

Калькулятор облигаций также позволяет проводить контроль сделок на наличие фидуциарной ответственности при управлении активами НПФ по методикам ЦБ. Вот некоторые из возможностей калькулятора облигаций:

- Расчет справедливой цены облигации на основе спредов индекса, аналогов и эмитента
- Автоматический подбор облигаций-аналогов по заданным критериям
- Расчет всех ключевых характеристик облигаций
- Расчет кредитных спредов к КБД Московской биржи
- Визуальное представление диапазона кредитных спредов аналогов и сравнительного индекса
- Оценка среднего z-spread эмитента
- Гибкое управление фильтрами
- Выгрузка отчета в Excel и PDF с отображением сделки на кривой доходности
- Расчет вмененные ставок RUONIA, CPI
- Расчет потоков и метрик по облигациям с плавающим купоном и номиналом на основе своих сценариев или на основе последних известных значений зависимых показателей (инфляция, ВВП, Ruonia, ОФЗ и тд)

Облигационный калькулятор *

Расчет справедливой цены сделки с облигацией выполнен по методике ЦБ.

[Рассчитать по методике ЦБ](#)

Поиск эмиссии	Дата расчета	Цена	Тип цены	Сценарий	Корректирующий коэффициент*																																																																																																																																																																																																																																				
RU000A0ZY226	12.04.2024	89,14	% от номинала без НКД	Временный сценарий	3																																																																																																																																																																																																																																				
выбрать текущую дату																																																																																																																																																																																																																																									
Рассчитать Считать до последнего известного купона																																																																																																																																																																																																																																									
<small>* для расчета нижней и верхней границы Z-spread релевантного индекса</small>																																																																																																																																																																																																																																									
<small>Справка Стакан График Аналоги История сделок Все котировки (All) Календари, купоны, оферты Методология</small>																																																																																																																																																																																																																																									
Индекс облигаций																																																																																																																																																																																																																																									
Соответствующий индекс (код) RUBGIBTR5Y G-spread, б.п. -6 Медианный G-spread, б.п. 4 СКО (20 дн) G-spread, б.п. 5 Доходность YTM (эфф.), % год 13,45 Дорагация, лет 3,84 Верхняя граница G-spread, б.п. 18 Нижняя граница G-spread, б.п. -10																																																																																																																																																																																																																																									
Метрики сделки																																																																																																																																																																																																																																									
Дорагация Макколея, лет 3,63 Модифицированная дорагация 3,4 Доходность YTM (эфф.), % 13,38 Доходность YTM (эфф.), % на Gcurve с тем же сроком 13,54 G-spread (к кривой Gcurve), б.п. -16 Z-spread (к кривой Gcurve), б.п. -15 Временная инфляция, % 7,22 Реальная доходность к базе, % 6,03 Реальная доходность к инфляции, % 6,03																																																																																																																																																																																																																																									
Цены и НКД																																																																																																																																																																																																																																									
Дата расчета 12.04.2024 НКД 6,68 Длительность текущего купонного периода, дней 182 Дней накопления текущего купона 65 Дней до выплаты купона 117 Чистая цена, % 89,14 Грязная цена, % 89,59 Чистая цена, в валюте номинала 1 315,57 Грязная цена, в валюте номинала 1 322,25 Непогашенный номинал 1 475,85 Номинал(начальный) 1000																																																																																																																																																																																																																																									
Справедливая цена облигации, рассчитанная разными методами, %																																																																																																																																																																																																																																									
G-spread индекса, Z-spread аналогов и Эмитента, б.п.																																																																																																																																																																																																																																									
Аналоги																																																																																																																																																																																																																																									
Возраст цены(дней) Разброс срока до погашения (лет) Мин. объем торгов Разброс G-spread от индекса(б.п.) Выберите рейтинги Сектор / Отрасли Режимы торгов 10 0,5 500000 300 AAA(ru) * Государственный выбрать Все																																																																																																																																																																																																																																									
<small>* При выборе аналогов используется та же валюта, класс актива и рейтинговая группа. Максимальное число аналогов 50. Аналоги с z-spread меньше -100 б.п. исключаются. ** При подборе аналогов флотеры и линеры исключаются.</small>																																																																																																																																																																																																																																									
Применить																																																																																																																																																																																																																																									
<table border="1"> <thead> <tr> <th>#</th> <th>Эмитент</th> <th>Document(paper)</th> <th>ISIN</th> <th>Дата погашения (оферты)</th> <th>Чистая цена, % от номинала</th> <th>Дата торгов</th> <th>Объем торгов</th> <th>Дорагация Макколея, лет</th> <th>Агрегированный рейтинг</th> <th>Режим торгов</th> <th>YTM (эфф.), %</th> <th>YTM (эфф.), % на Gcurve</th> <th>G-spread (к кривой Gcurve), б.п.</th> <th>Z-spread (к кривой Gcurve), б.п.</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>Минфин РФ</td> <td>ОФЗ-26236-ПД</td> <td>RU000A102B78</td> <td>17.05.2028</td> <td>77,35</td> <td>12.04.2024</td> <td>7 704 995,88</td> <td>3,55</td> <td>AAA(ru)</td> <td>T+ Гособлигации - безадрес.</td> <td>13,42</td> <td>13,55</td> <td>-13</td> <td>-10</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>Минфин РФ</td> <td>ОФЗ-26212-ПД</td> <td>RU000A0JTK38</td> <td>19.01.2028</td> <td>82,69</td> <td>12.04.2024</td> <td>9 604 355,97</td> <td>3,27</td> <td>AAA(ru)</td> <td>T+ Гособлигации - безадрес.</td> <td>13,41</td> <td>13,59</td> <td>-18</td> <td>-16</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>Минфин РФ</td> <td>ОФЗ-26232-ПД</td> <td>RU000A1014N4</td> <td>06.10.2027</td> <td>80,88</td> <td>12.04.2024</td> <td>5 859 403,02</td> <td>3,16</td> <td>AAA(ru)</td> <td>T+ Гособлигации - безадрес.</td> <td>13,42</td> <td>13,61</td> <td>-19</td> <td>-18</td> </tr> </tbody> </table>						#	Эмитент	Document(paper)	ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дорагация Макколея, лет	Агрегированный рейтинг	Режим торгов	YTM (эфф.), %	YTM (эфф.), % на Gcurve	G-spread (к кривой Gcurve), б.п.	Z-spread (к кривой Gcurve), б.п.	1	Минфин РФ	ОФЗ-26236-ПД	RU000A102B78	17.05.2028	77,35	12.04.2024	7 704 995,88	3,55	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,42	13,55	-13	-10	2	Минфин РФ	ОФЗ-26212-ПД	RU000A0JTK38	19.01.2028	82,69	12.04.2024	9 604 355,97	3,27	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,41	13,59	-18	-16	3	Минфин РФ	ОФЗ-26232-ПД	RU000A1014N4	06.10.2027	80,88	12.04.2024	5 859 403,02	3,16	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,42	13,61	-19	-18																																																																																																																																																																								
#	Эмитент	Document(paper)	ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дорагация Макколея, лет	Агрегированный рейтинг	Режим торгов	YTM (эфф.), %	YTM (эфф.), % на Gcurve	G-spread (к кривой Gcurve), б.п.	Z-spread (к кривой Gcurve), б.п.																																																																																																																																																																																																																											
1	Минфин РФ	ОФЗ-26236-ПД	RU000A102B78	17.05.2028	77,35	12.04.2024	7 704 995,88	3,55	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,42	13,55	-13	-10																																																																																																																																																																																																																											
2	Минфин РФ	ОФЗ-26212-ПД	RU000A0JTK38	19.01.2028	82,69	12.04.2024	9 604 355,97	3,27	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,41	13,59	-18	-16																																																																																																																																																																																																																											
3	Минфин РФ	ОФЗ-26232-ПД	RU000A1014N4	06.10.2027	80,88	12.04.2024	5 859 403,02	3,16	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадрес.	13,42	13,61	-19	-18																																																																																																																																																																																																																											
Средний кредитный спред по эмитенту																																																																																																																																																																																																																																									
Период анализа(дней) Мин. объем торгов Диапазон Дорагия (от) Диапазон Дорагия (до) Валюта Режимы торгов 10 500000 0 10 RUB Все																																																																																																																																																																																																																																									
<small>* Выпуски эмитента с z-spread меньше -100 б.п. исключаются. ** При расчете среднего кредитного спреда флотеры и линеры исключаются.</small>																																																																																																																																																																																																																																									
Применить																																																																																																																																																																																																																																									
Расчет средних																																																																																																																																																																																																																																									
Средние арифметические Средневзвешенное																																																																																																																																																																																																																																									
<table border="1"> <thead> <tr> <th>ISIN</th> <th>Дата погашения (оферты)</th> <th>Чистая цена, % от номинала</th> <th>Дата торгов</th> <th>Объем торгов</th> <th>Дорагация Макколея, лет</th> <th>Агрегированный рейтинг</th> <th>Режим торгов</th> <th>YTM (эфф.), %</th> <th>YTM (эфф.), % на Gcurve</th> <th>G-spread (к кривой Gcurve), б.п.</th> <th>Z-spread</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ОФЗ-26244-ПД</td> <td>RU000A1074G2</td> <td>15.03.2034</td> <td>89,3</td> <td>—</td> <td>1 802 867 429</td> <td>5,98</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,65</td> <td>13,2</td> <td>45</td> <td>24</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26234-ПД</td> <td>RU000A101QE0</td> <td>16.07.2025</td> <td>89,2</td> <td>—</td> <td>435 550 469</td> <td>1,24</td> <td>AAA(ru)</td> <td>14,53</td> <td>14,29</td> <td>24</td> <td>26</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-46020-АД</td> <td>RU000A0GN9A7</td> <td>06.02.2036</td> <td>66,86</td> <td>—</td> <td>2 053 687</td> <td>7,01</td> <td>AAA(ru)</td> <td>12,9</td> <td>13,22</td> <td>-33</td> <td>-59</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26233-ПД</td> <td>RU000A101F94</td> <td>18.07.2035</td> <td>59,46</td> <td>—</td> <td>282 212 940</td> <td>7,16</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,49</td> <td>13,23</td> <td>26</td> <td>-1</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26242-ПД</td> <td>RU000A105RV3</td> <td>29.08.2029</td> <td>84,91</td> <td>—</td> <td>455 907 184</td> <td>4,25</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,39</td> <td>13,28</td> <td>11</td> <td>13</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26235-ПД</td> <td>RU000A102B83</td> <td>12.03.2031</td> <td>68,35</td> <td>—</td> <td>48 154 773</td> <td>5,47</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,38</td> <td>13,19</td> <td>19</td> <td>11</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26226-ПД</td> <td>RU000A0ZYYW2</td> <td>07.10.2026</td> <td>89,63</td> <td>—</td> <td>308 614 785</td> <td>2,24</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,35</td> <td>13,76</td> <td>-40</td> <td>-34</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26232-ПД</td> <td>RU000A1014N4</td> <td>06.10.2027</td> <td>81,06</td> <td>—</td> <td>218 639 953</td> <td>3,09</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,31</td> <td>13,44</td> <td>-12</td> <td>-11</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26230-ПД</td> <td>RU000A100EF5</td> <td>16.03.2039</td> <td>64,72</td> <td>—</td> <td>433 424 392</td> <td>7,61</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,58</td> <td>13,27</td> <td>32</td> <td>-8</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26222-ПД</td> <td>RU000A0JXQF2</td> <td>16.10.2024</td> <td>96,74</td> <td>—</td> <td>144 091 387</td> <td>0,51</td> <td>AAA(ru)</td> <td>14,22</td> <td>14,71</td> <td>-48</td> <td>-47</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26227-ПД</td> <td>RU000A1007F4</td> <td>17.07.2024</td> <td>98,2</td> <td>—</td> <td>428 951 370</td> <td>0,28</td> <td>AAA(ru)</td> <td>14,65</td> <td>14,82</td> <td>-17</td> <td>-17</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26221-ПД</td> <td>RU000A0JXFMI</td> <td>23.03.2033</td> <td>72,26</td> <td>—</td> <td>97 968 332</td> <td>6,12</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,46</td> <td>13,2</td> <td>26</td> <td>9</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26224-ПД</td> <td>RU000A0ZYUAA9</td> <td>23.05.2029</td> <td>77,84</td> <td>—</td> <td>52 274 171</td> <td>4,16</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,36</td> <td>13,29</td> <td>7</td> <td>11</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26228-ПД</td> <td>RU000A100A82</td> <td>10.04.2030</td> <td>78,29</td> <td>—</td> <td>87 144 192</td> <td>4,55</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,38</td> <td>13,24</td> <td>14</td> <td>12</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26207-ПД</td> <td>RU000A0JS3W6</td> <td>03.02.2027</td> <td>88,95</td> <td>—</td> <td>258 229 761</td> <td>2,53</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,35</td> <td>13,63</td> <td>-29</td> <td>-22</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26229-ПД</td> <td>RU000A100EG3</td> <td>12.11.2025</td> <td>91,24</td> <td>—</td> <td>92 300 245</td> <td>1,49</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,85</td> <td>14,14</td> <td>-29</td> <td>-25</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26238-ПД</td> <td>RU000A1038V6</td> <td>15.05.2041</td> <td>59,43</td> <td>—</td> <td>975 826 612</td> <td>7,77</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,52</td> <td>13,28</td> <td>24</td> <td>-23</td> </tr> <tr> <td>ОФЗ-26241-ПД</td> <td>RU000A105F29</td> <td>17.11.2032</td> <td>81,63</td> <td>—</td> <td>149 560 506</td> <td>5,54</td> <td>AAA(ru)</td> <td>13,55</td> <td>13,19</td> <td>36</td> <td>19</td> </tr> </tbody> </table>						ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дорагация Макколея, лет	Агрегированный рейтинг	Режим торгов	YTM (эфф.), %	YTM (эфф.), % на Gcurve	G-spread (к кривой Gcurve), б.п.	Z-spread	ОФЗ-26244-ПД	RU000A1074G2	15.03.2034	89,3	—	1 802 867 429	5,98	AAA(ru)	13,65	13,2	45	24	ОФЗ-26234-ПД	RU000A101QE0	16.07.2025	89,2	—	435 550 469	1,24	AAA(ru)	14,53	14,29	24	26	ОФЗ-46020-АД	RU000A0GN9A7	06.02.2036	66,86	—	2 053 687	7,01	AAA(ru)	12,9	13,22	-33	-59	ОФЗ-26233-ПД	RU000A101F94	18.07.2035	59,46	—	282 212 940	7,16	AAA(ru)	13,49	13,23	26	-1	ОФЗ-26242-ПД	RU000A105RV3	29.08.2029	84,91	—	455 907 184	4,25	AAA(ru)	13,39	13,28	11	13	ОФЗ-26235-ПД	RU000A102B83	12.03.2031	68,35	—	48 154 773	5,47	AAA(ru)	13,38	13,19	19	11	ОФЗ-26226-ПД	RU000A0ZYYW2	07.10.2026	89,63	—	308 614 785	2,24	AAA(ru)	13,35	13,76	-40	-34	ОФЗ-26232-ПД	RU000A1014N4	06.10.2027	81,06	—	218 639 953	3,09	AAA(ru)	13,31	13,44	-12	-11	ОФЗ-26230-ПД	RU000A100EF5	16.03.2039	64,72	—	433 424 392	7,61	AAA(ru)	13,58	13,27	32	-8	ОФЗ-26222-ПД	RU000A0JXQF2	16.10.2024	96,74	—	144 091 387	0,51	AAA(ru)	14,22	14,71	-48	-47	ОФЗ-26227-ПД	RU000A1007F4	17.07.2024	98,2	—	428 951 370	0,28	AAA(ru)	14,65	14,82	-17	-17	ОФЗ-26221-ПД	RU000A0JXFMI	23.03.2033	72,26	—	97 968 332	6,12	AAA(ru)	13,46	13,2	26	9	ОФЗ-26224-ПД	RU000A0ZYUAA9	23.05.2029	77,84	—	52 274 171	4,16	AAA(ru)	13,36	13,29	7	11	ОФЗ-26228-ПД	RU000A100A82	10.04.2030	78,29	—	87 144 192	4,55	AAA(ru)	13,38	13,24	14	12	ОФЗ-26207-ПД	RU000A0JS3W6	03.02.2027	88,95	—	258 229 761	2,53	AAA(ru)	13,35	13,63	-29	-22	ОФЗ-26229-ПД	RU000A100EG3	12.11.2025	91,24	—	92 300 245	1,49	AAA(ru)	13,85	14,14	-29	-25	ОФЗ-26238-ПД	RU000A1038V6	15.05.2041	59,43	—	975 826 612	7,77	AAA(ru)	13,52	13,28	24	-23	ОФЗ-26241-ПД	RU000A105F29	17.11.2032	81,63	—	149 560 506	5,54	AAA(ru)	13,55	13,19	36	19
ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дорагация Макколея, лет	Агрегированный рейтинг	Режим торгов	YTM (эфф.), %	YTM (эфф.), % на Gcurve	G-spread (к кривой Gcurve), б.п.	Z-spread																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26244-ПД	RU000A1074G2	15.03.2034	89,3	—	1 802 867 429	5,98	AAA(ru)	13,65	13,2	45	24																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26234-ПД	RU000A101QE0	16.07.2025	89,2	—	435 550 469	1,24	AAA(ru)	14,53	14,29	24	26																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-46020-АД	RU000A0GN9A7	06.02.2036	66,86	—	2 053 687	7,01	AAA(ru)	12,9	13,22	-33	-59																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26233-ПД	RU000A101F94	18.07.2035	59,46	—	282 212 940	7,16	AAA(ru)	13,49	13,23	26	-1																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26242-ПД	RU000A105RV3	29.08.2029	84,91	—	455 907 184	4,25	AAA(ru)	13,39	13,28	11	13																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26235-ПД	RU000A102B83	12.03.2031	68,35	—	48 154 773	5,47	AAA(ru)	13,38	13,19	19	11																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26226-ПД	RU000A0ZYYW2	07.10.2026	89,63	—	308 614 785	2,24	AAA(ru)	13,35	13,76	-40	-34																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26232-ПД	RU000A1014N4	06.10.2027	81,06	—	218 639 953	3,09	AAA(ru)	13,31	13,44	-12	-11																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26230-ПД	RU000A100EF5	16.03.2039	64,72	—	433 424 392	7,61	AAA(ru)	13,58	13,27	32	-8																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26222-ПД	RU000A0JXQF2	16.10.2024	96,74	—	144 091 387	0,51	AAA(ru)	14,22	14,71	-48	-47																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26227-ПД	RU000A1007F4	17.07.2024	98,2	—	428 951 370	0,28	AAA(ru)	14,65	14,82	-17	-17																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26221-ПД	RU000A0JXFMI	23.03.2033	72,26	—	97 968 332	6,12	AAA(ru)	13,46	13,2	26	9																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26224-ПД	RU000A0ZYUAA9	23.05.2029	77,84	—	52 274 171	4,16	AAA(ru)	13,36	13,29	7	11																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26228-ПД	RU000A100A82	10.04.2030	78,29	—	87 144 192	4,55	AAA(ru)	13,38	13,24	14	12																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26207-ПД	RU000A0JS3W6	03.02.2027	88,95	—	258 229 761	2,53	AAA(ru)	13,35	13,63	-29	-22																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26229-ПД	RU000A100EG3	12.11.2025	91,24	—	92 300 245	1,49	AAA(ru)	13,85	14,14	-29	-25																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26238-ПД	RU000A1038V6	15.05.2041	59,43	—	975 826 612	7,77	AAA(ru)	13,52	13,28	24	-23																																																																																																																																																																																																																														
ОФЗ-26241-ПД	RU000A105F29	17.11.2032	81,63	—	149 560 506	5,54	AAA(ru)	13,55	13,19	36	19																																																																																																																																																																																																																														

Скринеры облигаций

Скринеры облигаций позволяют отслеживать последние сделки по выбранной когорте облигаций, с учетом фильтра по ликвидности и размеру сделки. Скринер строит кривые доходности на основе информации о сделках, проходящих на Московской бирже. Вы также можете составить скринер на основе лимитной ведомости. Скринер полезен для построения релевантной кривой доходности, учитывая ликвидность инструментов.

- Поиск идей для инвестирования (выбор облигаций)
- Анализ последних цен и доходностей облигаций. Построение карты рынка
- Создание списка облигаций по своим критериям
- Построение кривой доходности на основе своей инвестиционной декларации для учета ставки дисконтирования при моделировании продуктов

Основной особенностью скринеров ТрэкРекордс, является возможность фильтровать отражаемые цены, исходя из объема сделок. Например, можно установить фильтр и отслеживать цены только с объемом от 5 млн. рублей. Это позволит отсеять цены по маленьким трейдам, совершаемых частными инвесторами на рынке, совершаемые не всегда по рыночным ценам.

Дополнительной особенностью скринера ТрэкРекордс является построение кривой доходности на выбранном списке облигаций. Это позволяет сформировать свой юниверс облигаций и мониторить доходность на собственной кривой доходности.

В разделе скринеры представлены готовые списки облигаций, сгруппированные по показателям рейтинга, дюрации и сектора экономики.

Однако пользователь может самостоятельно сформировать свой собственный скринер, задав параметры поиска

Скринеры облигаций ★

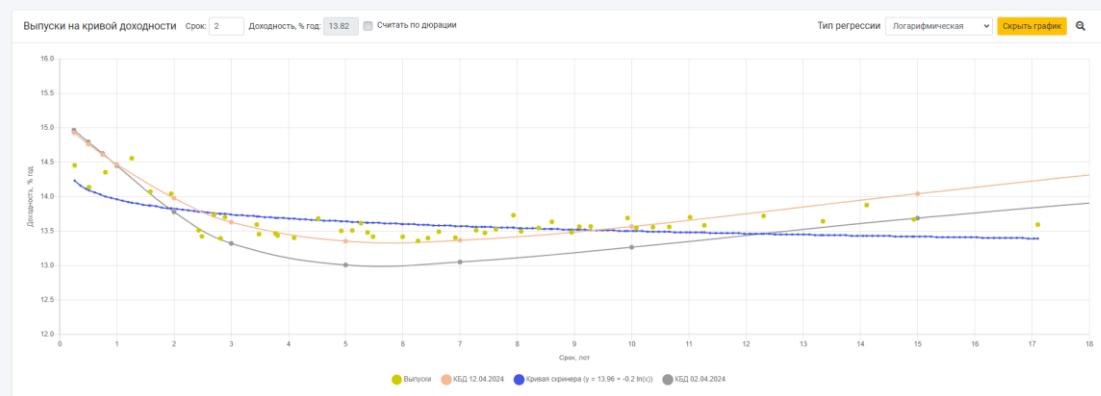
Скринеры облигаций позволяют отслеживать последние сделки по выбранной когроте облигаций, с учетом фильтра по ликвидности и размеру сделки. Скринер строит кривые доходности на основе информации о сделках, проходящих на Московской бирже. Вы также можете составить скринер на основе лимитной ведомости. Скринер будет вам полезен для построения релевантной кривой доходности, учитывая ликвидность инструментов.

По состоянию на 13.04.2024 11:17:25 (мск) [выбрать другую дату](#)

Лимитная ведомость

[Ликвидные корпораты \(от 200 млн за 10 дней\)](#) [Крупные сделки в корпоратах \(от 20 млн\)](#) [Банки \(A\(ru\)\)](#) [Банки \(AAA\(ru\), AA\(ru\)\)](#) [Высокодоходные](#) [Надежные корпораты \(3-5\)](#) [Надежные корпораты \(1-3 года\)](#) [Надежные корпораты \(до 1 года\)](#)

[Создать скринер](#)



Сортировать: Самые доходные | Название компании | Самые короткие | Самые длинные | Самые новые сделки | Самые ликвидные

Облигация	Дата погашения (оферты)	Надежность	Доходность	Цена и объем последней сделки	Объем торгов за 10 дней (РПС + Основной режим)	Справедливый диапазон цен и доходности
ОФЗ-52003-ИН RU000A102069 • навигатор	17.07.2030 6.3 лет	AAA(ru) 5,76 лет	13.36% 8.6н.	84.62	20 217 млн ₽	Доход., % 13.6 13.5 Покупка 83.6 84 Продажа 84.8 85.2
ОФЗ-26207-ПД RU000A0JS3W6 • навигатор	03.02.2027 2.8 года	AAA(ru) 2,52 года	13.39% -40.6н.	88.9	2 488 417 млн ₽	Доход., % 14.22 13.92 Покупка 87.3 87.9 Продажа 89.1 89.7
ОФЗ-29013-ПК RU000A101KT1 • навигатор	18.09.2030 6.4 лет	AAA(ru) 4,47 года	13.4% -3.6н.	99.23	15 681 млн ₽	Доход., % 13.81 13.68 Покупка 97.7 98.2 Продажа 99.2 99.7
ОФЗ-26236-ПД RU000A102B7B • навигатор	17.05.2028 4.1 года	AAA(ru) 3,55 года	13.4% -10.6н.	77.4	1 265 406 млн ₽	Доход., % 13.99 13.77 Покупка 76 76.5 Продажа 77.6 78.2
ОФЗ-26235-ПД RU000A102B83 • навигатор	12.03.2031 6.9 лет	AAA(ru) 5,46 лет	13.4% 10.6н.	68.29	428 495 млн ₽	Доход., % 13.68 13.59 Покупка 67.4 67.7 Продажа 68.3 68.6
ОФЗ-26228-ПД RU000A100A82 • навигатор	10.04.2030 6.0 лет	AAA(ru) 4,54 лет	13.42% 0.6н.	78.21	757 169 млн ₽	Доход., % 13.73 13.63 Покупка 77.2 77.5 Продажа 78.2 78.5
ОФЗ-29008-ПК RU000A0J4P3 • навигатор	03.10.2029 5.5 лет	AAA(ru) 3,99 года	13.42% -7.6н.	104.74	42 543 млн ₽	Доход., % 13.98 13.77 Покупка 102.7 103.5 Продажа 105.1 105.9
ОФЗ-24226-ПД RU000A0ZYZW2 • навигатор	07.10.2026 2.5 года	AAA(ru) 2,29 года	13.42% -45.6н.	89.55	2 757 134 млн ₽	Доход., % 14.38 14.04 Покупка 87.9 88.5 Продажа 89.7 90.3
ОФЗ-52002-ИН RU000A0ZYZ26 • навигатор	02.02.2028 3.8 года	AAA(ru) 3,63 года	13.43% -7.6н.	88.83	472 087 млн ₽	Доход., % 14.02 13.8 Покупка 87.2 87.8 Продажа 89.1 89.7
ОФЗ-26232-ПД RU000A1014N4 • навигатор	06.10.2027 3.5 года	AAA(ru) 3,16 года	13.45% -15.6н.	80.8	1 961 9 млн ₽	Доход., % 14.08 13.8 Покупка 79.4 80.1 Продажа 81.3 81.9

Строки с 1 по 10 из 48 на странице: 10

Навигатор сделок

Навигатор сделок позволяет отслеживать сделки с ценными бумагами на Московской бирже, а также проводить анализ сделок по различным параметрам, таким как объем сделки, цена, дата сделки, тип сделки и другие. Навигатор сделок позволяет отслеживать последние сделки с облигациями и проводить анализ рыночной активности и ликвидности, а также справедливости ценообразования.

Навигатор сделок полезен управляющим активами и сейлз подразделениям банков для мониторинга рыночной активности и поиска справедливой цены сделки.

Навигатор сделок с облигациями на Московской бирже★

Методология

ID или ISIN	Флаг	Режим торгов	Класс актива	Флоатеры
<input type="text"/> ID сделки / ISIN / бумага	Все	Все	Облигации корпоративные	Нет
Мин. сумма сделки	Валюта	Дата от	Дата до	Дюрация от
200000	RUB*	10.04.2024	14.04.2024	Дюрация до

Применить

Результаты расчета: 3265 | 4109 | 2001

Строки с 1 по 15 из 10029 на странице: 15

12.04.2024 18:45:24 ТОСБ 10112340090
Ступ Групп, RU000A108482
Группа А(н) / Валюта: RUB
НКД: 5.95 / Номинал: 1000,0
Дюрация Маколек: 1,67
Подробный анализ

300 шт. 298 214 RUB 98,81 17,48 340
Количество Сумма сделки Чистая цена, % УТМ, % год З-Spread, б.п.

Выпуски эмитента Z-Spread, б.п.
Выпуски эмитента (10д.) 94 438
Облигации аналоги (Выш.) 139 348
Диапазон цен и доходности
Дохьт, % 18.18 17.24 15.36 14.42
Покупка Цена 97.9 99.2 101.9 103.3
Продажа

12.04.2024 18:45:41 ТОСБ 10112337470
Самолет ГК, RU000A107RZ0
Группа А(н) / Валюта: RUB
НКД: 1.21 / Номинал: 1000,0
Дюрация Маколек: 1,59
Подробный анализ

1 000 шт. 995 512 RUB 99,43 16,2 208
Количество Сумма сделки Чистая цена, % УТМ, % год З-Spread, б.п.

Выпуски Z-Spread, б.п.
Выпуски эмитента (10д.) 73 314
Диапазон цен и доходности
Дохьт, % 16.66 16.33 15.68 15.35
Покупка Цена 98.8 99.3 100.2 100.6
Продажа

Сканер стаканов

Модуль для анализа облигаций в режиме реального времени. Система сканирует все стаканы облигаций на Московской бирже, обогащает данные дополнительной аналитической информацией и позволяет проводить быстрый поиск и агрегацию данных. Модуль существенно сокращает время трейдера на поиск ликвидности в стаканах, поиск облигаций аналогов и анализ глубины рынка.

- Поиск ликвидности во всех стаканах с учетом фильтров без необходимости "прокликивания" каждого стакана
- Фильтры по объему заявки, рейтингам, дюрации, др.
- Расширенный стакан по бумаге с доп. аналитикой
- Кнопка подбора аналогов, где есть ликвидность
- Расчет справедливой цены для неликвидных выпусков
- История сделок с облигациями в РПС и сканах, Gspread, время и объемы сделок

Scan / Средневзвешенные спреды по Peer Group

Облигации: РКД, 32 ISBN: RU000A0J6V0 - Кап-кв 100 - Выбей В+ - Дата: 2022-09-20 -

Элемент: Облигации: РКД, 32 ISBN: RU000A0J6V0 - Дата погашения: 2023-07-07 - Тип обрет.: Кап-кв - День до погашения: 290 - Валюта: RUB

Показатели риска и статистика сделок за 10 дней

Модифицированный доходность 0.744 Учтено (агрегированный) BBB- - Объем торгов за 10 дней (14) 7 945 918 Объем торгов за 10 дней (РПС) 101 430 000

Статистика сделок за 200 тыс. (0-брока) за 10 дней

Режим торгов: РПС Сумма сделок: 101 430 000 Кап-кв сделок: 2 Г-брока (Мин): 65 Г-брока (Макс): 71 Г-брока (Средневзвешенный): 68

Сделки за последние 10 дней (от 200 тыс. руб)

Номер сделки	Режим торгов	Объем	Дата и время	Цена	Доходность	G-spread
6413746899	ТОСБ	755 309	2022-09-19 16:44:14,000	101.52	8.02	49
6412987102	ТОСБ	1 518 600	2022-09-19 13:51:31,000	101.34	8.40	100
6389410330	ТОСБ	234 877	2022-09-14 15:29:23,000	101.34	8.43	99
6389425271	ТОСБ	289 241	2022-09-14 14:17:41,000	101.52	8.05	53

Идентификаторы

Режим торгов	Дата, к которой сч.	Флоатер/лифт.
ТОСБ	07.07.2023	-
Код ИБ	Срок облигации в ...	Амортизация
Элемент	Дата погашения	Структурная

Средние значения по группе

Мяг. цена	Доходн. %	Г-брока в %
1.05	7.84	28.3

Информация

Используются флютбоксы, пикеты, субяды, бесконечные и конечные блоки. Расчитывается средневзвешенное значение доходности и спреда на основе объема заявок из стаканов

Скринеры акций

Позволяет отслеживать акции по различным параметрам, таким как рыночная капитализация, дивиденды, Р/Е, Р/В, Р/С, Р/СФ, ЕВ/ЕБИДА, ROE, ROA, дивидендная доходность и другие. Скринер акций позволяет фильтровать акции по различным критериям и проводить анализ акций на основе фундаментальных показателей.

Скринеры и сканеры / Скринер акций

Биржа МБ Основной Т+ | 170 Отрасль Нефтегазовая отрасль + Банки Дата 2023-10-13

Ход торгов Мультилипликаторы Дивиденды Консенсус прогнозы

Инструмент	Код IFX	Тикер	Дата	Лst	Банк	Bid	Ask	Итм.	Изм. %	Оборот ден. +	Оборот шт.	Нед. %	Мес. %	Год. %	Капитализация	Close	High	Low	ISIN
ЛУКОЙЛ АО	LKOH.MICEX	LKOH	2023-10-13T00:00:00	7 244	RUB	7 243	7 244	124	1.74%	12 045 578 400	1 676 799	7.77%	7.65%	74.6%	6 110 191 254 943	7 120	7 250	7 135	RL
Газпром-АО	GAZP.MICEX	GAZP	2023-10-13T00:00:00	170 2	RUB	170 21	170 29	0	0.41%	6 540 513 137	38 618 230	2.49%	-4.2%	5.19%	4 009 346 144 744	169.5	170.79	167.15	RL
Сбербанк-АО	SBER.MICEX	SBER	2023-10-13T00:00:00	263.51	RUB	263.5	263.51	-0.99	-0.37%	4 851 837 828	18 408 670	1.59%	0.420%	14.9%	5 669 456 014 880	204.5	205.04	202.7	RL
Татнефть-АО	TATN.MICEX	TATN	2023-10-13T00:00:00	628.3	RUB	628.2	628.4	10.7	1.73%	2 823 295 640	4 543 300	-0.86%	3.57%	78.8%	1 353 620 531 910	617.6	630	615.2	RL
Роснефть-АО	ROSN.MICEX	ROSN	2023-10-13T00:00:00	561.85	RUB	561.85	561.9	15.8	2.89%	2 757 295 325	4 973 322	5.07%	-0.020%	92.4%	5 875 841 745 301	546.05	562	545.4	RL
ТCSКолл-АО	TCSE.E.MICEX...	TCSE	2023-10-13T00:00:00	3 475	RUB	3 475.5	3 476	84	2.48%	2 640 342 434	761 006	5.92%	-3.3%	38.8%	0	3 391	3 503.5	3 395	RL
Сургутнефтегаз-АО	SNGSP.MICEX	SNGSP	2023-10-13T00:00:00	52.865	RUB	52.865	52.865	-0.435	-1.19%	2 381 159 929	44 843 100	-7.0%	7.10%	12.7%	40 876 106 278	53.5	53.645	52.8	RL
ВТБ-АО	VTBR.MICEX	VTBR	2023-10-13T00:00:00	0,025	RUB	0,025	0,025	0	0.81%	2 070 230 479	81 731 37...	2.35%	-7.2%	66.6%	328 290 512 074	0,025	0,026	0,025	RL
Транснефть-АО	TRNFP.MICEX	TRNFP	2023-10-13T00:00:00	141 800	RUB	141 750	141 800	950	0.67%	1 381 694 300	9 766	1.21%	-5.2%	92.4%	220 015 656 329	140 850	142 000	140 500	RL
Сургутнефтегаз-АО	SNGS.MICEX	SNGS	2023-10-13T00:00:00	32.48	RUB	32.48	32.49	0.245	0.76%	862 317 776	26 512 000	-3.7%	5.11%	75.0%	1 162 023 703 774	32,235	32,75	32,135	RL
Новатэк-АО	NVTK.MICEX	NVTK	2023-10-13T00:00:00	1 708.4	RUB	1 708.2	1 708.8	4.8	0.28%	741 499 056	434 490	-0.14%	2.27%	75.6%	5 181 759 819 600	1 703.6	1 713	1 700.4	RL
Руссети-АКБ-АО	RNTF.T.MICEX	RNTF	2023-10-13T00:00:00	164.5	RUB	164.5	164.5	2.4	1.48%	658 536 047	3 997 840	5.51%	-7.3%	12.4%	48 441 564 000	162.1	166.4	162.2	RL
Газпромнефть-АО	SIBN.MICEX	SIBN	2023-10-13T00:00:00	747.45	RUB	747.4	747.45	1345	1.83%	439 016 739	591 390	4.97%	11.7%	105%	3 519 703 787 011	734	748.3	731	RL
Сбербанк-АП	SBERPM.MICEX	SBER	2023-10-13T00:00:00	263.21	RUB	263.19	263.21	-0.8	-0.30%	429 474 746	1 630 830	1.53%	0.540%	156%	263 350 000 000	254.01	264.59	262.33	RL
Татнефть-АО	TATNPMICEX	TATNP	2023-10-13T00:00:00	629.6	RUB	629.5	629.6	10.6	1.71%	387 442 311	622 096	-0.64%	5.88%	87.9%	91 868 293 800	619	630	614	RL
Башнефть-АО	BANEPMICEX	BANE	2023-10-13T00:00:00	1 551	RUB	1 551	1 529	12.5	0.81%	378 170 450	242 345	5.72%	6.81%	164%	46 484 192 726	1 538.5	1 570	1 536.5	RL
БСП-АО	BSFB.MICEX	BSFB	2023-10-13T00:00:00	268.1	RUB	268.1	268.1	-1.15	-0.57%	247 203 561	918 120	-4.9%	-11%	23.3%	118 349 914 500	269.65	271.5	268	RL
Москович-АО	CBOM.T.MICEX	CBOM	2023-10-13T00:00:00	7,019	RUB	7,02	7,021	0.01	0.14%	126 924 772	18 009 200	1.41%	3.34%	19.7%	135 929 285 000	7,009	7,038	6,956	RL
Башнефть-АО	BANE.MICEX	BANE	2023-10-13T00:00:00	2 017.5	RUB	2 017.5	2 017.5	2.5	0.12%	63 573 706	31 410	2.75%	3.46%	147%	299 241 293 736	2 015	2 050	2 003	RL
РНЗарис-АО	CHGZ.MICEX	CHGZ	2023-10-13T00:00:00	105.8	RUB	105.8	105.8	18.8	21.61%	22 255 862	223 580	20.8%	9.29%	20.8%	2 663 756 290	87	105.8	85	RL
Якутэнерго-АО	YAKG.MICEX	YAKG	2023-10-13T00:00:00	130.7	RUB	130.7	130.7	-1.25	-0.95%	13 954 253	106 440	0.920%	-8.0%	23.1%	108 409 130 062	131.95	132.6	129.75	RL

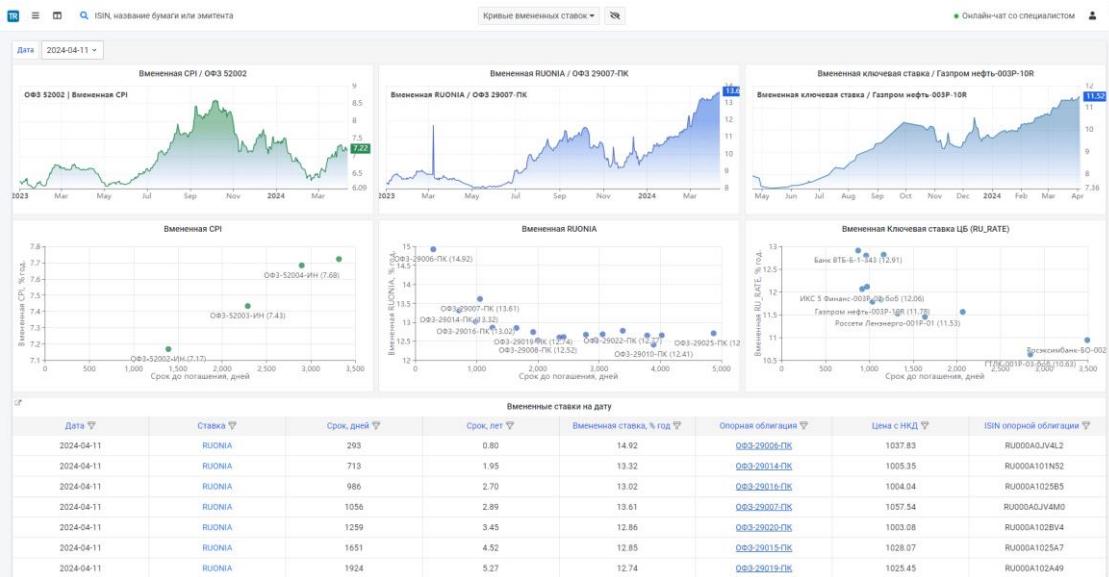
Мультилипликаторы															
Эмитент	Тикер	Валют	Дата расчета	Дата крайней отч.	Капитализация, млрд. +	P/E	P/B	EV/Ebitda	EV/Sales	NetDebt/Ebitda	NetIncome/Ebitda	NetProfit Margin	ROE	exch	ISIN
Роснефть НК	ROSN	RUB	2024-04-13	2023-06-30	6 123.1	4,17	0.83	4,1	0,9	1,85	0,79	0,2	0,2	MS Основной Т+	RU000AOJ2Q2
ЛУКОЙЛ	LKOH	RUB	2024-04-13	2023-06-30	5 418.56	4,79	0,9	2,49	0,66	-0,58	0,59	0,16	0,19	MS Основной Т+	RU00092424
Газпром	GAZP	RUB	2024-04-13	2023-06-30	3 927.44	5,93	0,23	12.8	1,12	5,7	0,92	0,08	0,04	MS Основной Т+	RU00076616
Новатэк	NVTK	RUB	2024-04-13	2023-06-30	3 918.05	12,39	1,63	7,6	3,03	-0,11	0,62	0,25	0,13	MS Основной Т+	RU000A0DKV
Газпром нефть	SIBN	RUB	2024-04-13	2021-12-31	3 645.59	4,18	0,85	3,59	0,76	-0,11	0,8	16.93	0,2	MS Основной Т+	RU00090624
Татнефть	TATNP	RUB	2024-04-13	2022-12-31	1 662.46	5,77	1,59	3,42	1,03	-0,54	0,67	0,2	0,28	MS Основной Т+	RU00094411
Татнефть	TATN	RUB	2024-04-13	2022-12-31	1 662.46	5,77	1,59	3,42	1,03	-0,54	0,67	0,2	0,28	MS Основной Т+	RU00090335
Сургутнефтегаз	SNGSP	RUB	2024-04-13	2023-06-30	1 653.39	0,98	0,25				0,78	0,92	0,25	MS Основной Т+	RU0009295
Сургутнефтегаз	SNGS	RUB	2024-04-13	2023-06-30	1 653.39	0,98	0,25				0,78	0,92	0,25	MS Основной Т+	RU00089262
Башнефть	BANE	RUB	2024-04-13	2021-12-31	1	1,67	0,29	2,04	0,34	0,6	0,6	10,05	0,15	MS Основной Т+	RU00077679
Башнефть	BANE	RUB	2024-04-13	2021-12-31	1	1,67	0,29	2,04	0,34	0,6	0,6	10,05	0,15	MS Основной Т+	RU00077679
Транснефть	TRNFP	RUB	2024-04-13	2023-09-30	252,05	0,74	0,09	0,81	0,41	0,35	0,51	0,26	0,13	MS Основной Т+	RU00090915
ЯТЭК	YAKG	RUB	2024-04-13	2023-06-30	82,98	41,97	5,78	29,59	12,19	2,1	0,65	0,27	0,14	MS Основной Т+	RU00077968
ННК-Барынганснефтегаз	VJGZ	RUB	2024-04-13	2023-06-30	67,12	3,65	0,95				0,73	0,28	0,26	MS Основной Т+	RU00079647
Mean					1 214.63	4,56	0,98	6,37	1,57	1,29	0,47	2	0,2		

Рабочие столы

Модуль Рабочие столы позволяет создавать персонализированные рабочие пространства для анализа финансовой информации. Рабочие столы позволяют группировать и анализировать различные виджеты и графики, а также проводить анализ и мониторинг рыночной активности.

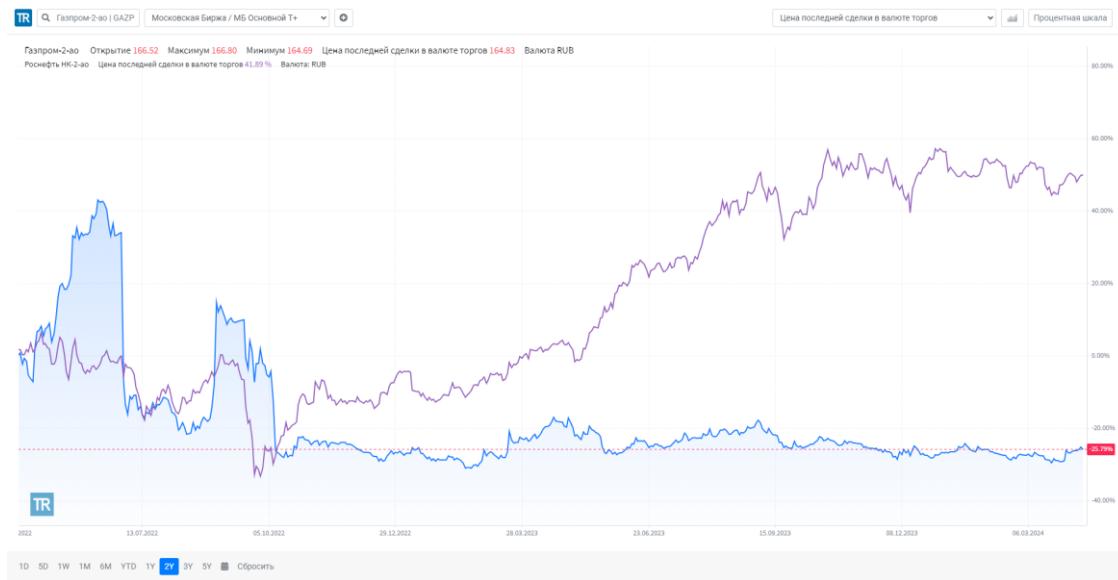
Примеры предустановленных рабочих столов можно отметить:

- Кривые вмененных ставок
- Валютный скринер
- ОФЗ сканер
- Основные индекссы
- Много графиков



Суперграфик

Модуль для анализа и сравнения цен инструментов на одном графике. Суперграфик позволяет строить свечные и линейные графики изменения цен, объемов торгов ценных бумаг, а также проводить анализ и сравнение различных инструментов.



Ассистент

Модуль для автоматизации микрозадач на расчет портфелей, сделок или создания аналитических отчетов. Ассистент это расширяемый модуль, за счет подключения python ноутбуков, которые могут быть использованы для автоматизации рутинных задач. Например, расчет портфеля, расчет кредитного риска, расчет справедливой цены облигации, анализ сделок и другие. Модуль включает административную часть и пользовательскую часть, где пользователь может создавать и запускать задачи. Административная часть позволяет управлять задачами, просматривать историю выполнения задач, а также управлять доступом к задачам.

Одна отдельная задача - это отдельный python ноутбук, который может быть создан и запущен в ассистенте. Ноутбук может содержать код на python, который будет

выполняться при запуске задачи. Ноутбук может использовать данные из базы данных, проводить расчеты, анализировать данные и генерировать отчеты.

ISIN, название бумаги или эмитента

Онлайн-чат со специалистом

Ассистент

Ассистент - ваш личный помощник для сбора, обработки и анализа данных о рынке, портфелях и активах. Ассистент подготовит аналитический отчет, рассчитает модель в Excel, подготовит аналитическую витрину. Перечень решаемых задач представлен ниже. Читайте подробнее про ассистента по этой [ссылке](#).

Задачи

Название задачи	Категория	Запуск	Действия
Анализ портфеля на дату v2	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Value at Risk активов из портфеля	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Переоценка	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Анализ портфеля на дату	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск

Полная доходность

Модуль для расчета полной доходности акций с учетом дивидендов и капитализации. Модуль позволяет проводить анализ и сравнение акций на основе полной доходности, а также строить графики и диаграммы изменения доходности акций.

ISIN, название бумаги или эмитента

Онлайн-чат со специалистом

Акции / Полная доходность (Total return)

Акция | Газпром-2-ое | RU0007661625 | GAZP | МБ Основной Т+ | 170 | От 2020-10-15 | До 2023-10-15

Обзор График Дивиденды Полная доходь Новости Консенсус Конкуренты КД Все котировки Архив котировок

Сегодня За неделю 1 месяц 3 месяца 6 месяцев С начала года 1 год 3 года 5 лет

Цена покупки	Цена продажи	Всего дивидендов	Доходность ценовая, %	Доходность полная, %	Доход ценовой на 1 акцию	Доход полный на 1 акцию
166.99000	164.83000	63.58000	-1.29349	34.54874	-2.16000	57.69295

Рост стоимости 1 акции с учетом реинвестирования дивидендов

Газпром-2-ое | RU0007661625 | GAZP | МБ Основной Т+ | 170

Накопленная доходность с реинвестированием дивидендов, %

Дата	Цена	Дивиденд	Стоимость с учетом дивидендов
2020-10-15T00:00:00	166.99000	0	166.99001
2020-10-16T00:00:00	163.80000	0	163.80000
2020-10-17T00:00:00	163.92000	0	163.92000
2020-10-20T00:00:00	166.39000	0	166.39000
2020-10-21T00:00:00	163.96000	0	163.96001
2020-10-22T00:00:00	165.07000	0	165.07001
2020-10-23T00:00:00	164.66000	0	164.66000
2020-10-26T00:00:00	162.11000	0	162.11000
2020-10-27T00:00:00	159.08000	0	159.08000
2020-10-28T00:00:00	153.79000	0	153.78999
2020-10-29T00:00:00	155.52000	0	155.52000
2020-10-30T00:00:00	155.00000	0	155.00000
2020-10-31T00:00:00	156.59000	0	156.59000
2020-11-01T00:00:00	160.59000	0	160.59000
2020-11-05T00:00:00	164.59000	0	164.59000

Фидуциарка

Модуль для контроля сделок на наличие фидуциарной ответственности при управлении активами НПФ по методикам ЦБ. Модуль позволяет проводить анализ сделок с ценными бумагами, а также контролировать соблюдение требований ЦБ к управлению активами НПФ.

The screenshot shows a financial software interface with the following components:

- Top Bar:** Includes a search bar ("ISIN, название бумаги или эмитента"), a "Онлайн-чат со специалистом" (Online chat with specialist) button, and a user profile icon.
- Left Panel:** Titled "Фидуциарная ответственност...", it displays a "Список сделок" (List of deals) table with columns "ID" and "Сделка". It lists three entries: "644 Блок сделок за 20.02.2024 - 27.02.2024", "577 Блок сделок за 20.01.2020 - 29.09.2023", and "576 Блок сделок за 12.01.2024 - 15.01.2024".
- Center Dialog:** Titled "Расчет сделок" (Trade Calculation), it contains several tabs: "Основные" (Main), "Облигации" (Bonds), and "Акции" (Stocks). The "Основные" tab is selected. It includes fields for "Дата от:" (Date from: 20.02.2024) and "Дата до:" (Date to: 27.02.2024). A "Комментарий к расчету:" (Comment on calculation:) field contains the text "Задание на расчет активов для стресс-теста". There are also two checked checkboxes: "Рассчитать облигации" (Calculate bonds) and "Рассчитать акции" (Calculate stocks). A "Далее" (Next) button is at the bottom right.
- Right Panel:** Titled "Рабочий стол / Сделки" (Workplace / Deals), it shows a list of tasks with checkboxes and buttons like "Рассчитать блок сделок" (Calculate deal block).
- Bottom Section:** Titled "Расчет: №592" (Calculation: #592), it displays a detailed table of results. The table has columns: "Статус" (Status), "Операция" (Operation), "Дата" (Date), "ISIN" (ISIN), "Класс актива" (Asset class), and "ID сделки" (Deal ID). It includes a "Сформировать" (Formulate) and "Применить" (Apply) button, and a "Выгрузить все в Excel" (Export all to Excel) button.
- Table Data:** The main table shows two rows of data, each representing a trade calculation. The first row is for "Минфин РФ" (Minfin RF) with ISIN RU000A0JWM07, quantity 520, price 488 893,6 RUB, and a 90,62% yield. The second row is for the same entity with a different date and slightly different values.

RFQ и рассылки

Модуль для отправки запросов на котировки (RFQ) и рассылок по ценным бумагам. Модуль позволяет отправлять запросы на котировки по ценным бумагам, а также проводить анализ и сравнение котировок от различных поставщиков ликвидности.

RFQ
Сохраним сообщение

Получатели * chat (Администратор) * mky (Константин Михайлов)

Список контрагентов

Актуально до* 08.12.2023

Отправить Чат + Телеграм бот

Шаблон Таблица активов

Ваша заявка со списком бумаг будет направлена указанному списку участников в чат или телеграм. Пользователи также получат уведомления о заявке на почту (для статусов offline). Отчет будет доступен в чате. Детали сделки обсуждаются в приватных чатах. Для тестирования функционала отправьте заявку пользователю @test

Показывать таблицу активов всем пользователям в Сканере стаканов

Таблица активов

RFQ

№	Поиск эмиссии*	Намерение Кол-во*	Валюта	Цена	Расчёты	Место хранения
1	RU000A105RV3	Купле ▾ 100	RUB ▾	-	НРД ▾	<input checked="" type="checkbox"/>
2	RU000A0ZYZZ6	Купле ▾ 10	RUB ▾	-	НРД ▾	<input checked="" type="checkbox"/>

+ Добавить ещё бумагу

Предпросмотр

Облигация	ISIN	BS	Объем	Цена	Расчёты	Место хранения	Валюта
ОФЗ-26242-ГД	RU000A105RV3	Продам	100k	-	НРД	RUB	
ОФЗ-52002-ИН	RU000A0ZYZZ6	Продам	10k	-	НРД	RUB	

Отправить запрос после сохранения

Сообщение №78 24.08.2023 19:00 флаг (Армин Миттарин)

Сохранить изменения и отправить Отмена

Сканировать

Поиск инструментов и справочные витрины

Поиск инструментов в терминале реализован через строку поиска в верхней части терминала. Поиск инструментов позволяет быстро находить ценные бумаги, эмитентов, индексы и другие финансовые инструменты по различным параметрам, таким как название, ISIN, тикер.

Портфель							Онлайн-чат со специалистом
	Биржи	Облигации	Эмитенты	Акции	ИСУ	Фонды	Избранные
Портфель							
Инструменты							
Рабочий стол							
4060-У							
Стратегии НТВ							
Календарь							
Период							
Дивиденды							
Купли-продажи							
Популярно							
Дебюты							
Компаниями							
Новости							
Котировки акций							

В терминале реализованы справочные витрины по облигациям, акциям, фондам, индексам и другим финансовым инструментам. Витрины содержат информацию о ценных бумагах, эмитентах, рейтингах, котировках, объемах торгов и других параметрах.

Вот список основных витрин:

Календари и события:

- Первичные размещения
 - Дивиденды
 - Купоны
 - Оферты и погашения

- Дефолты
- Конвертации
- Рейтинговые действия

Эмитенты:

- Обзор эмитента
- Ценные бумаги
- Рейтинги эмитента
- Финансовая отчетность
- Корпоративные действия
- Новости
- История сделок

Акции:

- Обзор акции
- Дивиденды
- График цены
- Рекомендации аналитиков
- Новости акций
- Котировки акций
- Аналоги и конкуренты

Облигации:

- Обзор облигации
- Стакан облигации
- График облигации
- Аналоги в стаканах
- История сделок
- Календари, купоны, оферты
- Все котировки облигации

Фонды и ETF:

- Обзор фонда
- Дивиденды
- График цены
- Котировки фонда

Наполнение платформы данными

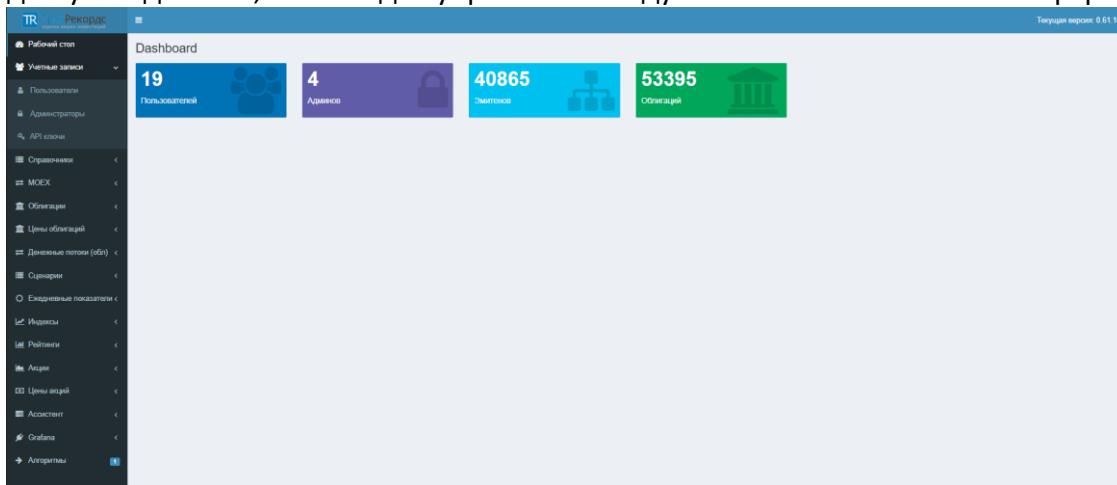
За обогащение Терминала ТрэкРекордс данными отвечает отдельно разработанный модуль Extractor, который обеспечивает загрузку, обработку и хранение данных из различных источников в автоматическом режиме. Модуль взаимодействует напрямую с базами данных PostgreSQL и ClickHouse, а также с другими компонентами платформы.

ТрэкРекордс.Терминал в качестве источников данных использует следующие ресурсы:

Данные	Источник	Комментарий
Справочные данные по ценным бумагам и эмитентам	Интерфакс. RuData	
Торговые данные с Московской биржи (итоги торгов, сделки, стаканы заявок)	Московская Биржа	
Показатели вмененных ставок RUONIA, Ключевой ставки ЦБ, RU_CPI	Расчеты ТрэкРекордс	
Gspread по сделкам/заявкам с облигациями Московской биржи	Расчеты ТрэкРекордс	
YTM ,Duration, Real Yield и другие метрики в портфелях, сделках, скринерах	Расчеты ТрэкРекордс	
Агрегированные рейтинги	Расчеты ТрэкРекордс	

Административная часть Платформы

ТрэкРекордс обладает административной панелью управления. Она разработана в модуле API и имеет интерфейс для управления ролями пользователей, настройками доступа к данным, а также для управления модулями и компонентами платформы.



Административная панель состоит из нескольких разделов:

Учетные записи

- Позволяет создать нового пользователя, изменить его роль, пароль, почту и другие параметры.
- Позволяет создавать администраторов системы
- Позволяет создавать API ключи для взаимодействия с платформой по API

Справочники

Позволяет управлять статичными справочными данными, создавать новые записи, изменять и удалять существующие записи в следующих справочниках:

- Эмитенты
- Классы активов
- Секторы экономики
- Валюты
- Страны
- Биржи

МОЕХ

Таблица со списком сделок и параметрами ценных бумаг с Московской биржи.

Облигации

Позволяет управлять справочными данными по облигациям, создавать новые записи, изменять и удалять существующие записи в следующих справочниках:

- Облигации
- Расширенные параметры (хранится информация по облигациям с плавающим номиналом, купоном и ипотечным ценным бумагам)
- Данные по облигации (динамические данные по облигациям, которые меняются каждый день)
- Базисы (хранится информация по базисам облигаций)
- Гаранты (хранится информация по гарантам облигаций)
- Импорт (возможность импорта данных по облигациям из Excel)

Цены облигаций

Раздел для управления ценами облигаций, позволяет загружать цены облигаций из Excel, а также просматривать и редактировать цены облигаций, и управлять справочником Режимов торгов.

Денежные потоки

Раздел для управления денежными потоками облигаций, позволяет загружать денежные потоки из Excel, а также просматривать и редактировать денежные потоки облигаций.

Сценарии

Раздел для управления сценариями, позволяет создавать новые сценарии из Excel файла, изменять и удалять существующие сценарии.

Ежедневные показатели

В данном разделе хранятся ежедневные показатели, такие как ставки, курсы валют, ВВП, доходности госбумаг с разными сроками и другие показатели, которые обновляются каждый день. Данные используются для расчета метрик и аналитики по ценным бумагам. Есть возможность загрузить данные из Excel.

Раздел также хранит информацию о вмененных ставках RUONIA, CPI, ключевой ставке ЦБ и других ключевых показателях, которые рассчитывает ТрэКРекордс.

Индексы

Раздел для управления индексами акций и облигаций, позволяет загружать новые индексы, изменять и удалять существующие записи по индексам и их ценам на каждый день.

Рейтинги

Раздел позволяет управлять данными по рейтингам, загружать новые рейтинги, изменять и удалять существующие записи по рейтингам.

В разделе предусмотрены настройки для расчета агрегированных рейтингов. Для этого модуль содержит информацию об алгоритмах рейтингования, карты сопоставления рейтингов для последующего расчета.

Раздел также содержит информацию о таблицах сопоставления рейтингов, валюты, сроков и типов облигаций и их соотнесении с индексами облигаций. Данная таблица необходима для управления расчетами сделок с облигациями на предмет фидуциарной ответственности НПФ.

Акции

Раздел содержит информацию о справочниках акций, позволяет загружать новые акции, изменять и удалять существующие записи по акциям. Таблица также содержит информацию о биржах, на которых торгуются акции, и их взаимосвязи. Раздел позволяет загружать данные из Excel и управлять справочником прямо из интерфейса.

Цены акций

Раздел для управления ценами акций, позволяет загружать цены акций из Excel, а также просматривать и редактировать цены акций, и управлять справочником Режимов торгов.

Ассистент

Раздел для управления задачами ассистента, позволяет создавать новые задачи, изменять и удалять существующие задачи, а также просматривать историю выполнения задач.

- Задачи - это список доступных пользователю Python ноутбуков, которые могут быть запущены в ассистенте. Ноутбуки могут содержать код на Python, который будет выполняться при запуске задачи. Ноутбук может использовать данные из базы данных, проводить расчеты, анализировать данные и генерировать отчеты.
- Запуски - это история выполнения задач, которая содержит информацию о времени запуска, времени выполнения, статусе выполнения и другие параметры.
- Группы - это списки пользователей, обладающих доступом к задачам. Предусмотрена возможность добавить в группы нужных пользователей и далее добавить доступ к задаче через добавление группы к задаче. Это элемент управления доступом к задачам.

Создание задачи предполагает следующий набор параметров:

- Название задачи
- Описание задачи
- Ссылка на документацию
- Ссылка на ноутбук (файл с кодом на python)
- Группы пользователей, которые имеют доступ к задаче
- Версия
- Ссылка на дашборд (если предполагается)
- Параметры задачи (параметры, которые будут переданы в ноутбук при запуске). Задаются в виде JSON объекта.

