

«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
МОЕХ.....	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:

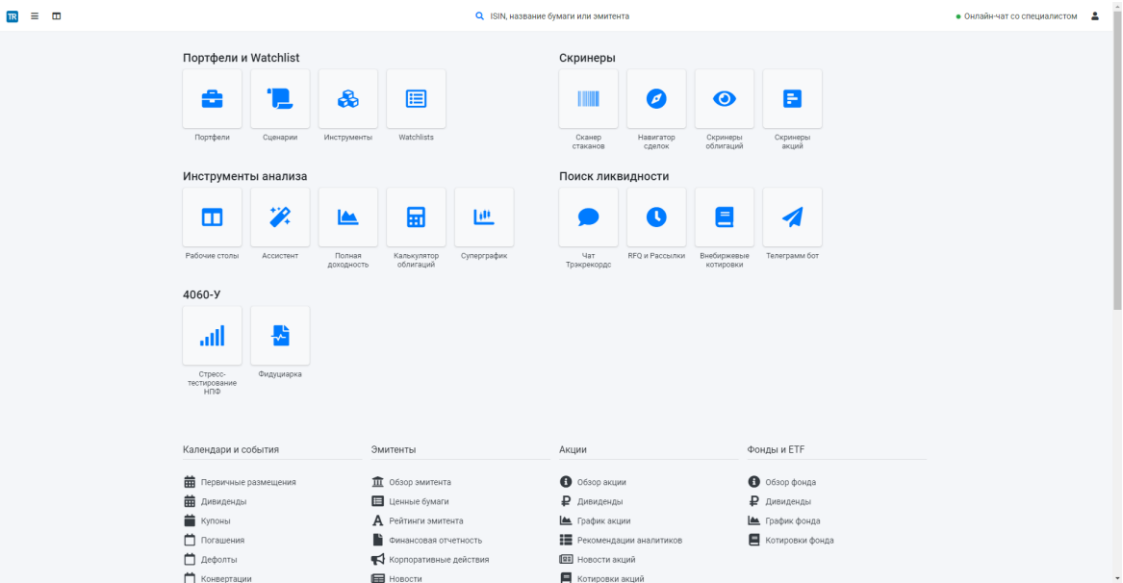
- Анализа рыночной информации и просмотра справочной информации о ценных бумагах
- Анализа срезов портфелей ценных бумаг на дату
- Стресс-тестирования НПФ и СК
- Real-time анализа рынка облигаций Московской биржи и поиска ликвидности в стаканах
- Pre-trade и Post-trade контроля сделок на наличие фидуциарной 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 многого 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)

ТрэкРекордс 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) interface with a table of portfolio data. The table has the following columns: Подпортфель, Класс актива, ISIN, Эмитент, ИНН, Количество, Цена, руб, Сумма, руб, Тип цены, ПИФ, Валюта, and Непогашенный номинал. The table contains 10 rows of data, including corporate bonds, government bonds, and floating rate notes.

Подпортфель	Класс актива	ISIN	Эмитент	ИНН	Количество	Цена, руб	Сумма, руб	Тип цены	ПИФ	Валюта	Непогашенный номинал
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JQ7Z2	РЖД	7708503727	228.0	1 005.2	229 185.6	1		RUB	1 000.0
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JQRD9	РЖД	7708503727	406.0	969.45	393 596.7	1		RUB	1 000.0
АБС	ГЦБ РФ	RU000A0JRTL6	Минфин РФ	7710168360	438.0	190.77	83 559.01	1		RUB	200.0
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JS4Z7	ВЭБ РФ	7750004150	443.0	963.25	426 719.75	1		RUB	1 000.0
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JSGV0	РЖД	7708503727	837.0	947.9	793 388.86	1		RUB	1 000.0
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JSQ58	Россети	4716016979	244.0	1 002.55	244 622.2	1		RUB	1 000.0
АБС	Облигации корпоративные	RU000A0JT403	ВЭБ РФ	7750004150	310.0	966.25	299 537.5	1		RUB	1 000.0
АББГД	Облигации корпоративные	RU000A0JU0N7	Банк ФК Открытие	7706092528	678.0	910.0	616 980.0	1		RUB	1 000.0
АББГД	Облигации корпоративные	RU000A0JUAN8	РЖД	7708503727	356.0	979.08	348 552.48	1		RUB	1 000.0
Флоатеры	ГЦБ РФ	RU000A0JX0H6	Минфин РФ	7710168360	300.0			1		RUB	1 000.0

Ниже представлены основные функции модуля портфели:

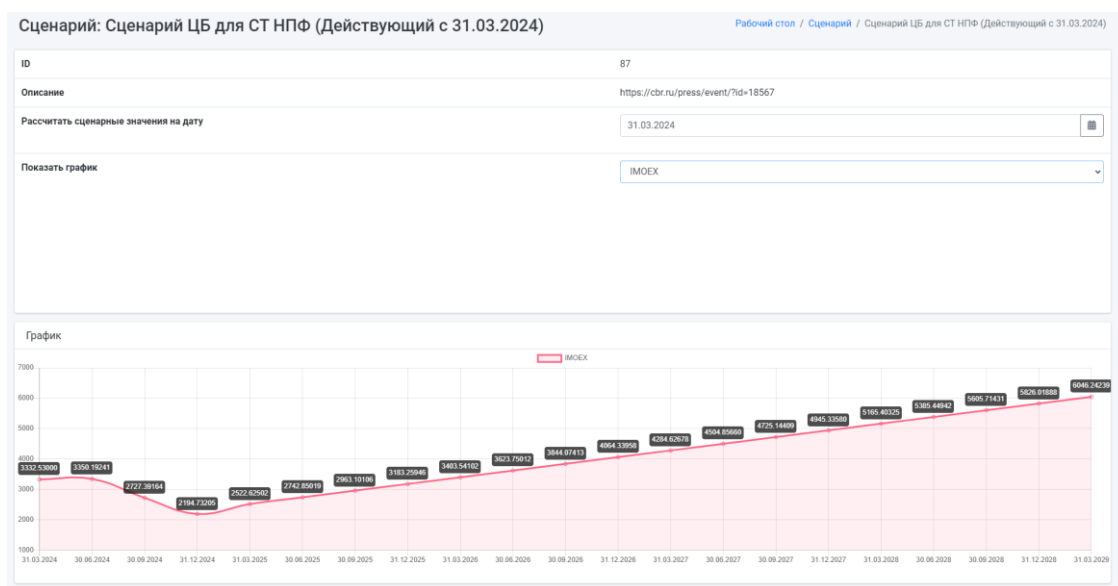
- Загрузка срезов портфелей по api и через Excel
- Показатели риска портфеля (дюрация, beta, рейтинги, pd, средние дневные объемы торгов)
- Инвестиционные показатели (YTM, Gspread, и др)
- Выгрузка готового отчета в Excel
- VI инструментарий для анализа портфеля
- Оценка активов портфеля по рыночным 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

Инструменты

Рабочий стол / Инструменты

Список инструментов

Строки с 1 по 15 из 958

Дата записи	Уникальный код	Название актива	Класс актива
29.02.2024	61009	—	Прочие активы
29.02.2024	60302	—	Прочие активы
31.01.2024	deb_euroclear_euraz	ЕвроКлир Евраз	Дебиторская задолженность
01.01.2023	ОПИФ рыночных финансовых инструментов «Мой будущее»	Ингосстрах-Инвест УК Определено по ИФН	Фонды
01.01.2023	ОПИФ рыночных финансовых инструментов "Мои акции"	Ингосстрах-Инвест УК Определено по ИФН	Фонды
01.01.2023	Интервальный паевой инвестиционный комбинированный фонд "AAA - Ирис"	AAA Управление капиталом Определено по ИФН	Фонды
31.12.2023	RU000A0JV4N8 РЕПО_CP_311223_79766950.7	НКО НКЦ Определено по ИФН	Дебиторская задолженность п
31.12.2023	RU000A0JV4N8 РЕПО_CP_311223_1030113.52	НКО НКЦ Определено по ИФН	Дебиторская задолженность п
31.12.2023	RU000A0JV4N8 РЕПО_ПР4_311223_21517926.77	НКО НКЦ Определено по ИФН	Дебиторская задолженность п
31.12.2023	RU000A0JV4N8 РЕПО_ПР4_311223_1000296.97	НКО НКЦ Определено по ИФН	Дебиторская задолженность п
31.12.2023	RU000A0JV4N8 РЕПО_ПР3_311223_1890946.01	НКО НКЦ	Дебиторская задолженность п

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.

Списки

Рабочий стол / Списки

Списки

Строки с 1 по 10 из 10

Списки	Витрины
Акции создан 21.11.2023 11:49 2 инструмента	Сканировать ставки по эмитентам
Эмитенты создан 17.11.2023 10:02 4 эмитента	
Замещающие создан 12.10.2023 11:06 30 ISINs	
Новые эмитенты создан 14.09.2023 11:17 5 эмитентов	
WL2 создан 17.03.2023 13:11 105 ISINs	
Watchlist 2 создан 10.02.2023 10:16 36 ISINs	
BB- эмитенты создан 15.11.2022 21:40 3 эмитента	

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 ★

Рабочий стол / Облигационный калькулятор

Расчёт справедливой цены сделки с облигацией выполнен по методике ЦБ.

[🔗 Рассчитать по методике ЦБ](#)

📄 Справка

📉 Ставки

📊 Графики

📋 Аналоги

🕒 История сделок

📄 Все котировки (ALLG)

📅 Календари, купоны, облиг.

Поиск эмиссии

Дата расчета

Цена

Тип цены

Сценарий

Корректирующий коэфф.*

RU000A0ZY226

12.04.2024

89,14

% от номинала без НКД

Вмененный сценарий

3

Рассчитать

🔗 Считать до последнего известного купона

🔗 Методология

✖ Для флотов

✖ Для расчета нижней и верхней границы G-spread релевантного индекса

Минфин РФ		Метрики сделки		Индекс облигаций	
Короткое название	ОФЗ-52002-ИИ	Дюрация Маколея, лет	3,63	Соответствующий индекс (код)	RUGBITRSY
ISIN	RU000A0ZY226	Модифицированная дюрация	3,4	G-spread, б.п.	-6
Гос.Рег. номер	52002RMFS	Доходность YTM (эфф), %	13,38	Медианный G-spread, б.п.	4
Сектор экономики	Государственный	Доходность YTM (эфф), % на Gcurve с тем же сроком	13,54	СКО (20 дн) G-spread, б.п.	5
Отрасль	Государственный сектор	G-spread (к кривой Gcurve), б.п.	-16	Доходность YTM (эфф), % год	13,45
База расчета	365 дней	Z-spread (к кривой Gcurve), б.п.	-15	Дюрация, лет	3,84
Валюта	RUB	Вмененная инфляция, %	7,22	Верхняя граница G-spread, б.п.	18
Агрегированный рейтинг	AAA(nu)	Реальная доходность к базе, %	6,03	Нижняя граница G-spread, б.п.	-10
Рейтинговая группа (фидучиарка)	I	Реальная доходность к инфляции, %	6,03	Аналоги, б.п.	
Соответствующий индекс	RUGBITRSY	Цены и НКД		Средний G-spread по аналогам	
Дата начала начисления процентов	21.03.2018	Дата расчета	12.04.2024	Средний Z-spread по аналогам	
Дата погашения	02.02.2028	НКД	6,68	Минимальный Z-spread по аналогам	
Срок до погашения (оферты), лет	3,81	Длительность текущего купонного периода, дней	182	Максимальный Z-spread по аналогам	
Периодичность купона	2	Дней накопления текущего купона	65	Справедливая цена сделки, %	
Плывающая ставка	Нет	Дней до выплаты купона	117		
Базовый индикатор	RU_CPI	Чистая цена, %	89,14	На основе среднего G-spread по аналогам	
Вмененная ставка индикатора, %	7,22	Грязная цена, %	89,59	На основе среднего Z-spread по аналогам	
		Чистая цена, в валюте номинала	1 315,57	На основе среднего Z-spread эмитента	
		Грязная цена, в валюте номинала	1 322,25	На основе верхней границы G-spread индекса	
		Непогашенный номинал	1 475,85	На основе нижней границы G-spread индекса	
		Номинал(начальный)	1000		



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		
<div>10</div>		<div>0,5</div>		<div>500000</div>		<div>300</div>		<div>AAA(ru) +</div>		<div>Государственный</div> <div>выбрать</div>		<div>Все</div>		
<div>* 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.</div> <div>* При подборе аналогов флотеры и линеры исключаются.</div> <div>Применить</div>														
#	Эмитент	Document(paper)	ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дюрация Маколея, 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	RU000A102BT8	17.05.2028	77,35	12.04.2024	7 704 995,88	3,55	AAA(ru)	T+ Гособлигации - безадес.	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 - безадес.	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 - безадес.	13,42	13,61	-19	-18

Средний кредитный спред по эмитенту

Период анализа(дней)

Мин. объем торгов

Диапазон Дюрации (от)

Диапазон Дюрации (до)

Валюта

Режимы торгов

10

500000

0

10

RUB

Все

Выпуск эмитента с z-spread меньше -100 б.п. исключается.

При расчете среднего кредитного спреда флотеры и линеры исключаются.

Применить

Расчет средних													
Среднее арифметическое													
	ISIN	Дата погашения (оферты)	Чистая цена, % от номинала	Дата торгов	Объем торгов	Дюрация Маколея, 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(nu)	13,65	13,2	45	24	
▼	ОФЗ-26234-ПД	RU000A1010E0	16.07.2025	89,2	—	435 550 469	1,24	AAA(nu)	14,53	14,29	24	26	
▼	ОФЗ-46020-АД	RU000A0GN9A7	06.02.2036	66,86	—	2 053 687	7,01	AAA(nu)	12,9	13,22	-33	-59	
▼	ОФЗ-26233-ПД	RU000A101F94	18.07.2035	59,46	—	282 212 940	7,16	AAA(nu)	13,49	13,23	26	-1	
▼	ОФЗ-26242-ПД	RU000A105RV3	29.08.2029	84,91	—	455 907 184	2,25	AAA(nu)	13,39	13,28	11	13	
▼	ОФЗ-26235-ПД	RU000A102BE3	12.03.2031	68,35	—	48 154 773	5,47	AAA(nu)	13,38	13,19	19	11	
▼	ОФЗ-26226-ПД	RU000A0ZYVW2	07.10.2026	89,63	—	308 614 785	2,24	AAA(nu)	13,35	13,76	-40	-34	
▼	ОФЗ-26232-ПД	RU000A1014N4	06.10.2027	81,06	—	218 639 953	3,09	AAA(nu)	13,31	13,44	-12	-11	
▼	ОФЗ-26230-ПД	RU000A100EF5	16.03.2039	64,72	—	433 424 392	7,61	AAA(nu)	13,58	13,27	32	-8	
▼	ОФЗ-26222-ПД	RU000A0JKQF2	16.10.2024	96,74	—	144 091 387	0,51	AAA(nu)	14,22	14,71	-48	-47	
▼	ОФЗ-26227-ПД	RU000A1007F4	17.07.2024	98,2	—	428 951 370	0,28	AAA(nu)	14,65	14,82	-17	-17	
▼	ОФЗ-26221-ПД	RU000A0JXFM1	23.03.2033	72,26	—	97 968 332	6,12	AAA(nu)	13,46	13,2	26	9	
▼	ОФЗ-26224-ПД	RU000A0ZYU99	23.05.2029	77,84	—	52 274 171	4,16	AAA(nu)	13,36	13,29	7	11	
▼	ОФЗ-26228-ПД	RU000A100A82	10.04.2030	78,29	—	87 144 192	4,55	AAA(nu)	13,38	13,24	14	12	
▼	ОФЗ-26207-ПД	RU000A0JS3W6	03.02.2027	88,95	—	258 229 761	2,53	AAA(nu)	13,35	13,63	-29	-22	
▼	ОФЗ-26229-ПД	RU000A100EG3	12.11.2025	91,24	—	92 300 245	1,49	AAA(nu)	13,85	14,14	-29	-25	
▼	ОФЗ-26238-ПД	RU000A1038V6	15.05.2041	59,43	—	975 826 612	7,77	AAA(nu)	13,52	13,28	24	-23	
▼	ОФЗ-26241-ПД	RU000A105FZ9	17.11.2032	81,63	—	149 560 506	5,54	AAA(nu)	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.

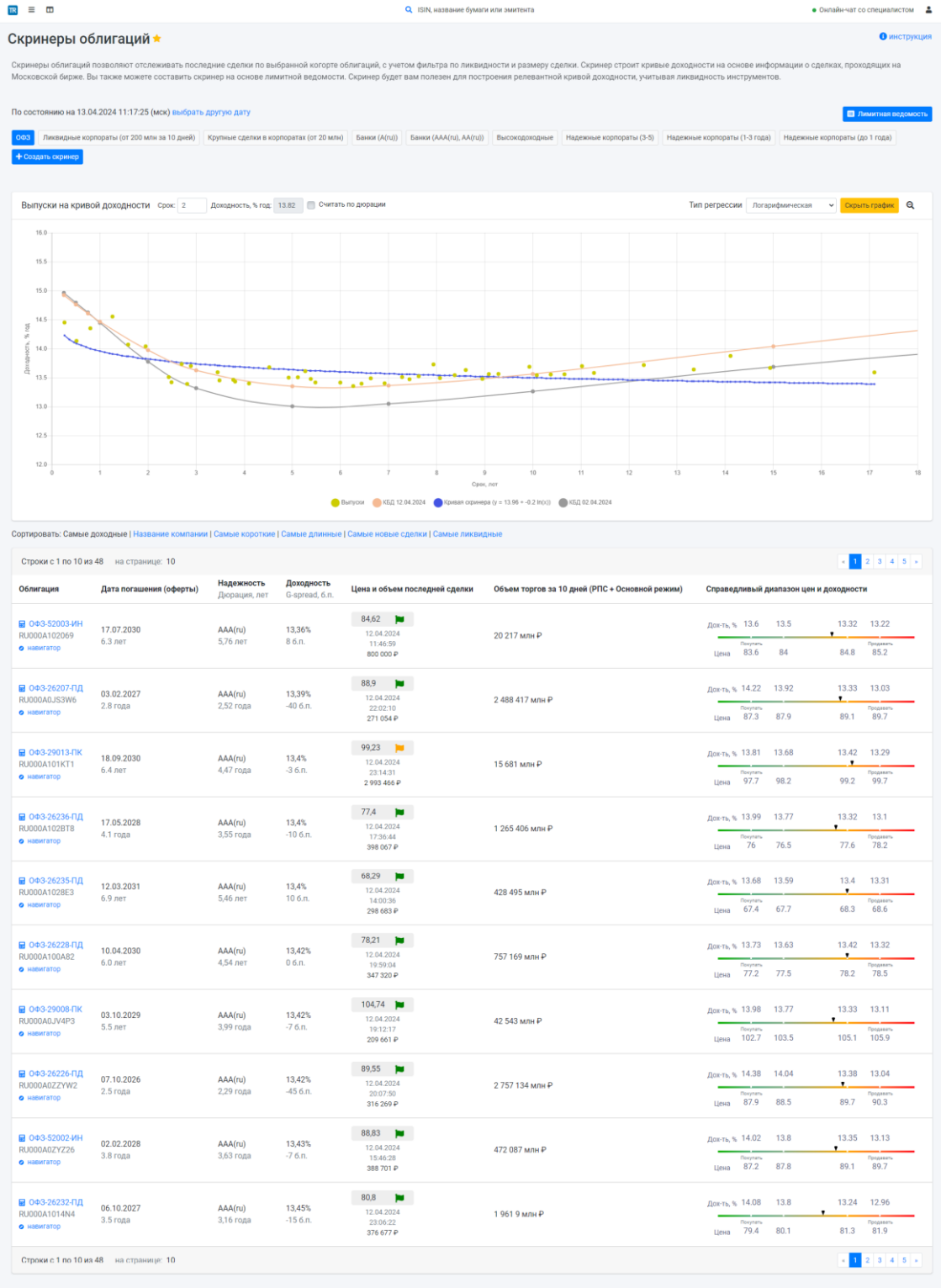
- Поиск идей для инвестирования (выбор облигаций)
- Анализ последних цен и доходностей облигаций. Построение карты рынка
- Создание списка облигаций по своим критериям
- Построение кривой доходности на основе своей инвестиционной декларации для учета ставки дисконтирования при моделировании продуктов

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.

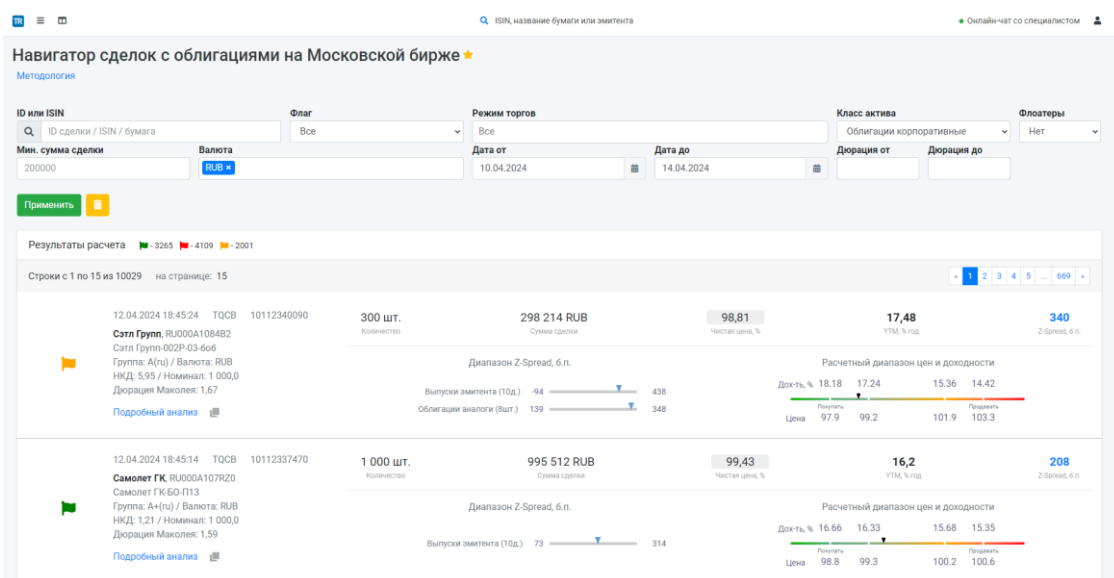
Однако пользователь может самостоятельно сформировать свой собственный скринер, задав параметры поиска



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.

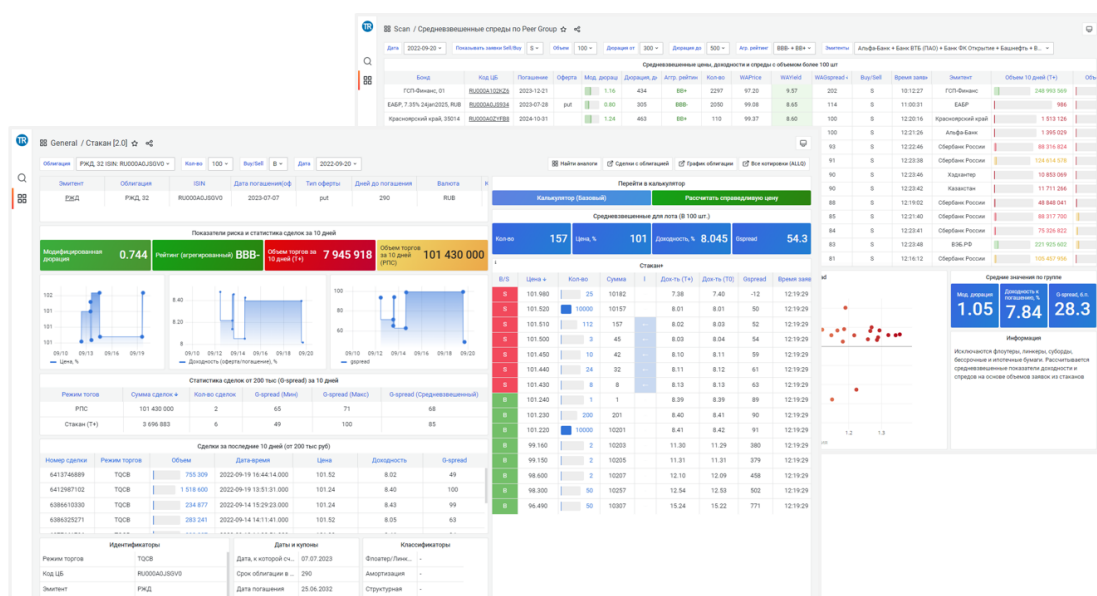
Навигатор сделок полезен управляющим активами и сейлз подразделениям банков для мониторинга рыночной активности и поиска справедливой цены сделки.



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, Gspred, время и объемы сделок



Скринеры акций

Позволяет отслеживать акции по различным параметрам, таким как рыночная капитализация, дивиденды, P/E, P/B, P/S, P/CF, EV/EBITDA, ROE, ROA, дивидендная доходность и другие. Скринер акций позволяет фильтровать акции по различным критериям и проводить анализ акций на основе фундаментальных показателей.

ISIN, название бумаги или эмитента

Онлайн-чат со специалистом

Скринеры и сканеры / Скринер акций

Биржа: МБ Основной Т+1 170 Отрасль: Нефтегазовая отрасль + Банки + Дата: 2023-10-13

Ход торговМультипликаторыДивидендыКонсенсус прогнозы

Инструмент	Код IFX	Тикер	Дата	Lst	Balk	Bid	Ask	Изм.	Изм. %	Оборот ден. +	Оборот шт.	Нед. %	Мес. %	Год. %	Капитализация	Close	High	Low	IS
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	7.136	RU0000000000
Газпром-АО	GAZP.MICEX	GAZP	2023-10-13T00:00:00	170.2	RUB	170.21	170.29	0.7	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	RU0000000000
Сбербанк-АО	SBER.MICEX	SBER	2023-10-13T00:00:00	263.51	RUB	263.5	263.51	0.99	-0.37%	4 651 837 828	18 408 670	1.59%	0.420%	149%	5 689 456 014 880	264.5	265.04	262.7	RU0000000000
Татнефть-АО	TATN.MICEX	TATN	2023-10-13T00:00:00	628.3	RUB	628.3	628.4	10.7	1.73%	2 823 856 640	4 545 300	-0.66%	3.57%	78.8%	1 353 620 531 910	617.6	630	615.2	RU0000000000
Роснефть-АО	ROSN.T.MICEX	ROSN	2023-10-13T00:00:00	561.85	RUB	561.85	561.9	15.8	2.89%	2 757 295 325	4 973 328	5.07%	-0.020%	92.4%	5 875 841 745 301	546.05	562	545.4	RU0000000000
ТКС-Корп. АО	TCSO.E.MICEX...	TCSO	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	RU0000000000
Сургутнефтегаз-АО	SNNGSP.MICEX	SNNGSP	2023-10-13T00:00:00	52.865	RUB	52.845	52.865	-0.635	-1.19%	2 381 153 929	44 843 100	-7.0%	7.10%	127%	408 976 106 278	53.5	53.645	52.8	RU0000000000
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	RU0000000000
Транснефть-АО	TRNFP.MICEX	TRNFP	2023-10-13T00:00:00	141.800	RUB	141.750	141.800	950	0.67%	1 381 894 300	9 766	1.21%	-5.2%	82.4%	220 015 656 329	140.850	142.000	140.500	RU0000000000
Сургутнефтегаз-АО	SNNGS.MICEX	SNNGS	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	RU0000000000
Новатек-АО	NVTK.MICEX	NVTK	2023-10-13T00:00:00	1.708.4	RUB	1.708.2	1.708.6	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	RU0000000000
Руснефтегаз-АО	RNFT.T.MICEX	RNFT	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%	124%	48 441 564 000	162.1	166.4	162.2	RU0000000000
Газпромнефть-АО	SIBN.MICEX	SIBN	2023-10-13T00:00:00	747.45	RUB	747.4	747.45	13.45	1.83%	439 016 735	591 390	4.97%	11.7%	105%	3 519 703 787 011	734	748.3	731	RU0000000000
Сбербанк-АО	SBERP.MICEX	SBERP	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	264.01	264.59	262.33	RU0000000000
Татнефть-АО	TATNP.MICEX	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	RU0000000000
Банкрест-АО	BANER.MICEX	BANER	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	RU0000000000
БСП-АО	BSPB.MICEX	BSPB	2023-10-13T00:00:00	268.1	RUB	268.1	268.1	-1.35	-0.57%	247 203 561	918 120	-4.9%	-11%	233%	118 349 914 500	269.65	271.5	268	RU0000000000
Максимум-АО	CBOM.T.MICEX	CBOM	2023-10-13T00:00:00	7.019	RUB	7.02	7.021	6.01	0.14%	126 324 772	18 009 200	1.41%	3.34%	19.7%	135 929 285 000	7.009	7.038	6.956	RU0000000000
Банкрест-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	RU0000000000
ННК-Вазо-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%	208%	2 663 756 290	87	105.8	85	RU0000000000
Вулкан-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	RU0000000000

ISIN, название бумаги или эмитента

Онлайн-чат со специалистом

Скринеры и сканеры / Скринер акций (мультипликаторы)

Биржа: МБ Основной Т+1 170 Отрасль: Нефтегазовая отрасль + Банки + Дата: 2023-10-13

Ход торговМультипликаторыДивидендыКонсенсус прогнозы

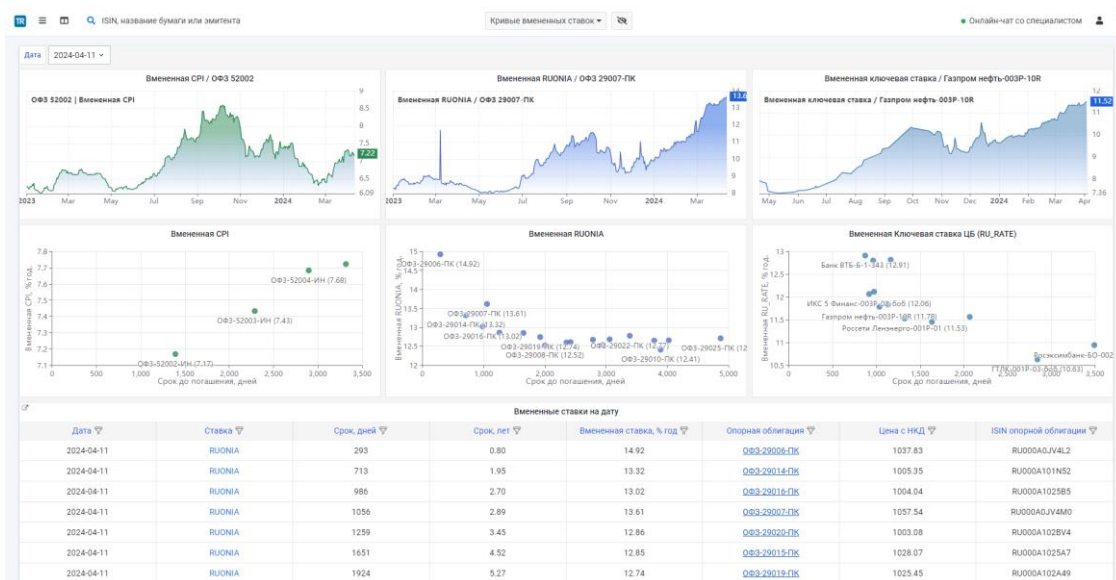
Эмитент	Тикер	Валют	Дата расчета	Дата крайней от.	Капитализация, млрд. +	P/E	P/B	EV/Ebitda	EV/Sales	NetDebt/Ebitda	NetIncome/Ebitda	NetProfit Margin	ROE	exch	ISIN
Роснефть-НК	ROSN	RUB	2024-04-13	2023-06-30	6 123.1	4.17	0.83	4.1	0.9	1.85	0.79	0.2	0.2	МБ Основной Т+1	RU0000000000
ЛУКОЙЛ	LKOH	RUB	2024-04-13	2023-06-30	5 418.56	4.79	0.9	2.49	0.66	-0.58	0.59	0.16	0.19	МБ Основной Т+1	RU0000000000
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	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Новатек	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	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Газпром нефть	SIBN	RUB	2024-04-13	2021-12-31	3 645.99	4.16	0.85	3.59	0.76	-0.11	0.8	16.93	0.2	МБ Основной Т+1	RU0000000000
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	МБ Основной Т+1	RU0000000000
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	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Сургутнефтегаз	SNNGSP	RUB	2024-04-13	2023-06-30	1 653.39	0.86	0.25				0.78	0.92	0.25	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Сургутнефтегаз	SNNGS	RUB	2024-04-13	2023-06-30	1 653.39	0.96	0.25				0.78	0.92	0.25	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Банкрест	BANER	RUB	2024-04-13	2021-12-31	576.88	1.87	0.29	2.04	0.34	0.6	0.6	10.05	0.15	МБ Основной Т+1	RU0000000000
Банкрест	BANE	RUB	2024-04-13	2021-12-31	576.88	1.87	0.29	2.04	0.34	0.6	0.6	10.05	0.15	МБ Основной Т+1	RU0000000000
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	МБ Основной Т+1	RU0000000000
ВТБ	YAKG	RUB	2024-04-13	2023-06-30	82.98	41.87	5.78	29.59	12.19	2.1	0.65	0.27	0.14	МБ Основной Т+1	RU0000000000
ННК-Вазо-Нефтегаз	VJGZP	RUB	2024-04-13	2023-06-30	67.12	3.65	0.95				0.73	0.28	0.26	МБ Основной Т+1	RU0000000000
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 представленных рабочих столов можно отметить:

- Кривые вмененных ставок
- Валютный скринер
- ОФЗ сканер
- Основные индексы
- 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

Запуски

Задачи

Выберите категорию

Название задачи	Категория	Запуски	Действия
Анализ портфеля на дату v2 v2.2 Расчет инвестиционных характеристик и показателей риска среза портфеля на дату. Формирование аналитического отчета. Документация	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Value at Risk активов из портфеля v1.2 Расчет Value at Risk для активов из портфеля историческим методом. Пользователь выбирает период анализа и доверительный интервал.	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Переоценка v1.0 Расчет переоценки портфеля, учитывая балансовую стоимость и коррективы	Портфели	Перейти к запускам	▶ Новый запуск
Анализ портфеля на дату v1.2 Расчет инвестиционных характеристик и показателей риска портфеля на дату. Формирование аналитического отчета и данных для дашборда. Документация	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-го | RU0007661625 | GAZP | MB Основной T+1170

От 2020-10-15 До 2023-10-15

Обзор

График

Дивиденды

Полная дох-ть

Новости

Консенсус

Конкуренты

KD

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	62.58000	-1.29349	34.54874	-2.16000	57.69295

Рост стоимости 1 акции с учетом реинвестирования дивидендов

Газпром-2-го | RU0007661625 | GAZP | MB Основной T+1170

Накопленная доходность с реинвестированием дивидендов, %

Котировки и дивиденды			
Дата	Цена	Дивиденд	Стоимость с учетом
2020-10-15T00:00:00	166.99000	0	166.99001
2020-10-16T00:00:00	163.80000	0	163.80000
2020-10-19T00:00:00	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
2020-11-02T00:00:00	156.59000	0	156.59000
2020-11-03T00:00:00	160.59000	0	160.59000
2020-11-05T00:00:00	164.99000	0	164.99000

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.

Фидуциарная ответственность

Список сделок

ID	Сделка
644	Блок сделок за 20.02.2024 - 27.02.2024
577	Блок сделок за 20.01.2020 - 29.09.2023
576	Блок сделок за 12.01.2024 - 15.01.2024

Расчёт сделок

Основное

Облигации

Акции

Основные настройки

Дата от: 20.02.2024

Дата до: 27.02.2024

Комментарий к расчёту: Задание на расчёт активов для стресс-теста

☒ Рассчитать облигации

☒ Рассчитать акции

Далее

Рабочий стол / Сделки

Посмотреть результаты

Оформить сделки

Оформить сделки

Оформить сделки

Оформить сделки

Расчет: №592

Рабочий стол / Сделки / Расчеты / №592

Диапазон расчета: от 20.02.2024 до 27.02.2024

Статус: Все

Операция: Все

Дата: dd.mm.yyyy

ISIN: ISIN, название бумаги или эмитента

Класс актива: Все

ID сделки: ID сделки

Собрать

Применить

Результат расчета

Выгрузить все в Excel

27.02.2024 18:16:20 Продажа Аналог 1 Управляющий 1 ID: 9707391440

Облигации

Минифин РФ

520 шт.

488 893,6 RUB

90,62

12,49

-74

0,0000, 0,0

043-26219-ПД RU000A0JWM07 I / AAA(n) / RUB НКД: 33,97 / Номинал: 1 000,0 Дюрация Маклеж: 2,27

RUBBTRZY

89,39 – 89,92

-47

90,3

0,32%

1 654,8 RUB

Временная и фактическая цены облигаций, рассчитанные на основе рыночного индекса, % Средний 2-х летний анализ Фундаментальная цена, % Прогноз (доходности) и фундаментальной цены

27.02.2024 15:48:54 Продажа Аналог 1 Управляющий 1 ID: 9706218589

Облигации

Минифин РФ

50244 шт.

47 238 403,92 RUB

90,62

12,49

-74

0,0000, 0,0

043-26219-ПД RU000A0JWM07 I / AAA(n) / RUB НКД: 33,97 / Номинал: 1 000,0 Дюрация Маклеж: 2,27

RUBBTRZY

89,39 – 89,92

-47

90,3

0,32%

159 890,3 RUB

Временная и фактическая цены облигаций, рассчитанные на основе рыночного индекса, % Средний 2-х летний анализ Фундаментальная цена, % Прогноз (доходности) и фундаментальной цены

27.02.2024 15:44:52 Продажа Аналог 1 Управляющий 1 ID: 9706191610

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.

Сохранение сообщения

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

Тема

Актуально до* 08.12.2023 19:00

Отправить Чат + Телеграм бот Шаблон Таблица активов

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

☐ Показывать таблицу активов всем пользователям в Сканире стаканов

Таблица активов RFQ

№	Поиск эмиссии*	Намерение	Кол-во*	Валюта	Цена	Расчёты	Место хранения
1	RU000A105RV3	Купля	100	RUB		-	НРД
2	RU000A02YZ26	Купля	10	RUB		-	НРД

+ Добавить ещё бумагу

Предпросмотр

Облигация	ISIN	BS	Объем	Цена	Расчёты	Место хранения	Валюта
043-26242-ПД	RU000A105RV3	Продам	100k		-	НРД	RUB
043-52002-ИИ	RU000A02YZ26	Продам	10k		-	НРД	RUB

☒ Отправить запрос после сохранения Сохранить изменения и отправить Отмена

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.

Q: газр

Облигация	Эмитент	Акция	ИСУ	Фонды	Избранное
Эмитент	GPB International				ЛЮКСЕМБУРГ
Эмитент	Gazprombank Mortgage				ЛЮКСЕМБУРГ
Эмитент	Gazprom International				ЛЮКСЕМБУРГ
Эмитент	Gazprombank Switzerland				ШВЕЙЦАРИЯ
Эмитент	GPB Latin America Ventures				НИДЕРЛАНДЫ
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS Основная Т+*	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS ЦК - РЕПО	USD
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - Поставка по СК	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS ЦК - РТС	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - РЕПО	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - Крупные лоты	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - Мелкие лоты	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - Арбитраж	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	ПАО "СПБ" - рос.	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	ПАО "СПБ" - выборок.	RUB
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS ЦК - РЕПО РТС	USD
Акция	RU0007661625	Газпром-2-ао	Обыкновенная	MS - РТС	RUB
Еврооблигация	CH0222948710	ГПБ-24-2016-евро	Погашен		
Еврооблигация	XS0304301582	ГПБ-Ипотека А5-2047А1-евр	Погашен		RUB
Еврооблигация	XS0304303521	ГПБ-Ипотека А5-2047А2-евр	Погашен		RUB
Еврооблигация	XS0304304339	ГПБ-Ипотека А5-2047В-евро	Погашен		RUB
Еврооблигация	XS0304304685	ГПБ-Ипотека А5-2047С-евро	Погашен		RUB
Еврооблигация	XS0197695009	Газпром-06-2020-евро	Погашен		

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

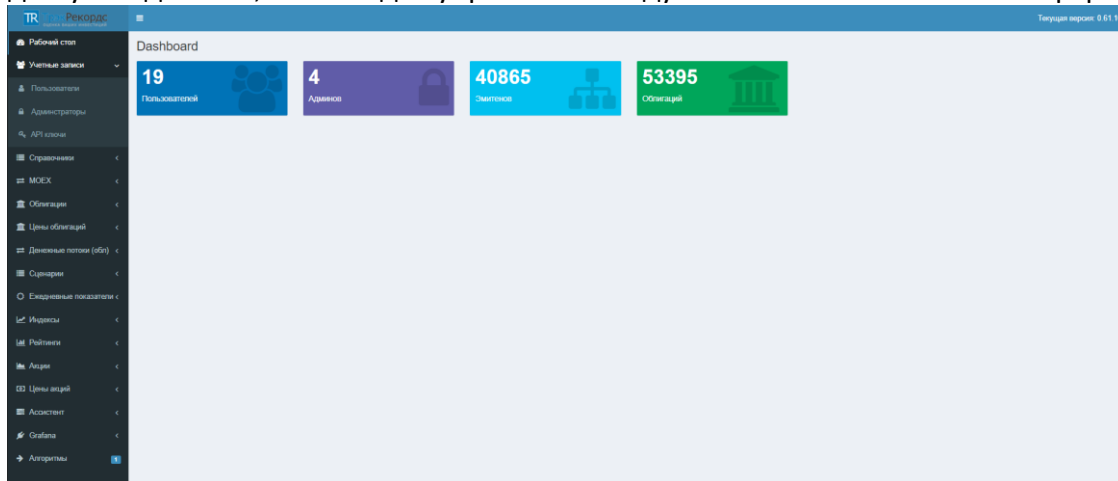
За обогащение Терминала ТрэкРекордс данными отвечает отдельно разработанный модуль Extractor, который обеспечивает загрузку, обработку и хранение данных из различных источников в автоматическом режиме. Модуль взаимодействует напрямую с базами данных PostgreSQL и ClickHouse, а также с другими компонентами 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 ставка RUONIA, CPI, ключевой ставке ЦБ и других ключевых показателях, которые рассчитывает ТрэкРекордс.

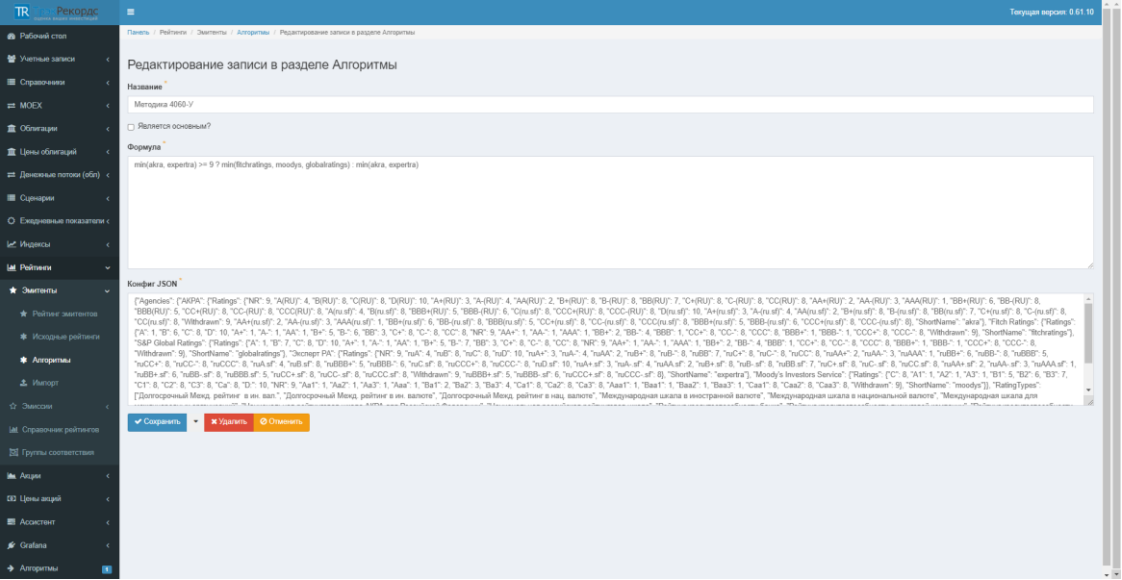
Индексы

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 данные 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 соотносении с индексами облигаций. Данная таблица необходима для управления расчетами сделок с облигациями на предмет фидуциарной ответственности НПФ.

Рейтинговая группа	Список рейтингов	Длительность (лет)	Длительность (лет)	Benchmark ticker	Классы активов	Benchmark name	
2 I	A, BBB, BBB+, BBB-	0	3	RUCBTRBBB3Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BBB 3Y	
3 I	A, BBB, BBB+, BBB-	3	5	RUCBTRBBB5Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BBB 5Y	
4 I	A, BBB, BBB+, BBB-	5	50	RUCBTRBBB3+	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BBB 3+	
5 II	BB, BB+, BB-	0	3	RUCBTRBBB3Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BB 3Y	
6 II	BB, BB+, BB-	3	5	RUCBTRBBB5Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BB 5Y	
7 II	BB, BB+, BB-	5	50	RUCBTRBBB3+	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR BB 3+	
8 III	B, B+, B-	0	3	RUCBTRB3Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR B 3Y	
9 III	B, B+, B-	3	5	RUCBTRB5Y	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR B 5Y	
10 III	A, B, B+, B-	5	50	RUCBTRB3+	Облигации, Облигации корпоративные, Облигации с ипотечными порфелами	CBi TR B 3+	
11 I	A, B, B+, B-, BB, BB+, BB-, BBB, BBB+, BBB-, CCC, D, NR	0	1	RUGBITR1Y	ГДБ РФ	GBi TR 1Y	
12 I	A, B, B+, B-, BB, BB+, BB-, BBB, BBB+, BBB-, CCC, D, NR	1	3	RUGBITR3Y	ГДБ РФ	GBi TR 3Y	
13 I	A, B, B+, B-, BB, BB+, BB-, BBB, BBB+, BBB-, CCC, D, NR	3	5	RUGBITR5Y	ГДБ РФ	GBi TR 5Y	
14 I	A, B, B+, B-, BB, BB+, BB-, BBB, BBB+, BBB-, CCC, D, NR	5	50	RUGBITR3+	ГДБ РФ	GBi TR 3+	
15 I	A, BBB, BBB+, BBB-	0	3	RUMBITRBBB3Y	Облигации субъектов РФ	MBi TR BBB 3Y	
16 I	A, BBB, BBB+, BBB-	3	5	RUMBITRBBB5Y	Облигации субъектов РФ	MBi TR BBB 5Y	

