

Источники информации для оценки ИЦБ

20 сентября 2018 г.

GLOBAL

Cbonds Pages

Loans.Cbonds

Cbonds Review

Cbonds Congress

FINANCIAL

CBONDS

INFORMATION

Авторизация

Забыли пароль?

Логин-пароль

Пароль

Или запомните

Вход

Регистрация

Подписка

Пробный доступ

В МЕСТО «ЛУЧШИЙ ИНВЕСТИЦИОННЫЙ БАНК (КОМПАНИЯ) ПО РАБОТЕ СО Н-ИИ ЭШЕЛОНОВ ЗАЕМЩИКОВ» (РАСЧЕТ АНКИВ 2017)

КОМПАНИЯ ЭМИССИИ

Эмитент на торгах: ДОМ.РФ

НОВОСТИ И КОММЕНТАРИИ

ОБЩИЕ АКЦИИ

КОТИРОВКИ

WATCHLIST

ИНСТРУМЕНТАРИИ

ЭМИТЕНТЫ

ИНВЕСТИЦИИ

ЛИДИ

ИНДЕКСЫ И СТАТИСТИКА

О САЙТЕ

НСДП

FAQ

Следующий

Ипотечный сертификат участия (ИСУ)

ДЕФОЛТЫ И РЕСТРУКТУРИЗАЦИИ: РОССИЙСКАЯ И ЗАРУБЕЖНАЯ ПРАКТИКА

Присоединяйтесь к нам

АЛТЕРНАТИВА ДЕПОЗИТАМ

50 ВЫПУСКОВ ЕВРОБОНДОВ

ОБЪЕМ ОТ \$ 1000

ТВЕРДЫЕ ДВОСТОРОННИЕ КОТИРОВКИ

Задать вопрос

Отправить запрос на обучение

Свяжитесь с нами (наш номер в мессенджерах: +7 (821) 448-35-10)

Облигации: ДОМ.РФ Ипотечный агент, 002P (4-02-00307-R-002P, RU000A0ZYJT2, ДОМРФИА 2P)

Описание страницы

Статус

Страна риска

Получение (эффект)

Объем

Рейтинги эмитента (M&P)

В обращении

Россия

33 981 620 041,75 RUB

Для действия требуется регистрация. Пожалуйста, перейдите в форму регистрации или авторизуйтесь на сайте.

Excel

В Watchlist

Калькулятор

Перейти к сравнению

Просмотреть события

Эмиссия

Денежный поток

Кредитные рейтинги

Состояние эмитента

ЭМИССИОННЫЕ ДОКУМЕНТЫ

Купить документ

Решение о выпуске (условия)

Информация для инвесторов

Проект эмиссии (программа)

Решение о выпуске (программа)

Информация по эмиссии

Эмитент

ДОМ.РФ Ипотечный агент

Дата окончания размещения

Получатель

ДОМ.РФ

Дата погашения

Вид облигаций

Купонные

Плавящая ставка

Нет

Формы выпуска

Документарные на предъявителя

Ставка купона

100% купоны + 11,5% годовых

Способ размещения

Открытый аукцион

Ставка текущего купона

11,5%

Тип размещения

Публичное

Метод расчета НКД

Номинал

1 000 RUB

НКД

Напогашенный номинал

104,83 RUB

Периодичность выплаты купона

4 раз в год

Объем эмиссии

48 197 808 000 RUB

Расчетная дата начала обращения

Объем в обращении по непогашенному номиналу

33 981 620 041,75 RUB

Дата начала начисления купонов

Дата принятия решения

14.11.2017

Листинг

Московская Биржа, RU000A0ZYJT2 (Первый листинг: 05.12.2017)

Другие выпуски эмитента

ДОМ.РФ Ипотечный агент, 01

ДОМ.РФ Ипотечный агент, 002P

ДОМ.РФ Ипотечный агент, 003P

ДОМ.РФ Ипотечный агент, 001P

ДОМ.РФ Ипотечный агент, 03

Посмотреть все выпуски эмитента

Сbonds Valuation

Для действия требуется регистрация. Пожалуйста, перейдите в форму регистрации или авторизуйтесь на сайте.

Котировки участников рынка

Участник рынка

Дата и время

Котировка на покупку/продажу или последняя сделка

ДОМ.РФ

14.09.2015

Для действия требуется регистрация. Пожалуйста, перейдите в форму регистрации или авторизуйтесь на сайте.

График архивных значений торгов облигациями

Московская Биржа

За период

1M

3M

1Y

3Y

с

15.08.2015

до

14.09.2015

Цена

Объем торгов

Для действия требуется регистрация. Пожалуйста, перейдите в форму регистрации или авторизуйтесь на сайте.

2

Рассылка котировок. Условный пример.

ISIN	ISSUE	Yld Bid	Price Bid	Price Ask	Yld Ask	Dur
Балансовые ИЦБ						
RU000A0JVSU7	Юникредитбанк 02-ИП	8,15%	99,95%	100,03%	0,00%	0,01
RU000A0JW5K0	Газпромбанк 2-ИП	7,75%	99,85%	100,05%	0,00%	0,73
RU000A0JWBNO	ДельтаКредит 17-ИП	8,47%	101,20%		0,00%	0,51
...						
ИЦБ АИЖК						
RU000A0JQY35	2010-1 А2	8,86%	100,05%	100,20%	8,74%	0,39
RU000A0JV7G5	АИЖК 2014-2, А2	9,14%	100,85%	0,00%	0,00%	0,55
RU000A0JRMW8	2011-2 А2	9,21%	100,05%	0,00%	0,00%	0,85
RU000A0JSKJ7	АИЖК 2012-1, А2	9,37%	99,90%	100,30%	8,99%	1,01
RU000A0JU3J9	АИЖК 2013-1, А2	9,73%	99,30%	100,05%	9,29%	1,79
RU000A0JUJ87	АИЖК 2014-1, А3	9,80%	98,15%	100,00%	9,37%	1,98
RU000A0JV755	АИЖК 2014-2, А3	9,91%	102,45%	103,55%	9,46%	2,65
Ипотечный агент ДОМ.РФ						
RU000A0ZYL89	ДОМРФИА 04	9,84%	103,45%	0,00%	0,00%	1,32
RU000A0ZYJT2	ДОМРФИА 2Р	9,78%	104,55%	105,55%	9,48%	1,70
RU000A0JX3M0	ДОМРФИА 1Р	9,82%	108,90%	109,60%	9,42%	1,72
RU000A0ZZCH9	ИА ДОМ 5Р2	9,82%	97,40%	100,00%	9,32%	1,76
RU000A0JXS26	ДОМРФИА 02	9,70%	105,75%	106,70%	9,52%	1,87
RU000A0ZYLX0	ДОМРФИА 03	9,91%	107,00%	107,85%	9,51%	2,11
RU000A0JXRM6	ДОМРФИА 01	10,00%	105,30%	0,00%	0,00%	2,44
ИЦБ (иные originаторы)						
RU000A0JTHU8	ИА АТБ	8,81%	100,00%	100,05%	8,51%	0,11
RU000A0JUNU4	ИА МКБ	8,88%	100,40%	100,95%	8,77%	0,22
RU000A0JTZN5	ПСБ 2013	8,84%	99,95%	100,00%	8,75%	0,38
RU000A0JUNY8	ИА Петрокоммерц-1	8,89%	100,00%	100,10%	8,81%	0,50
RU000A0JUCP7	Абсолют 2	8,84%	100,00%	100,15%	8,87%	0,55

...

MBSF 4 A
As of --
MBSF 4 A Mtge
RU RMBS
1) Bond Summary
Issuer Mortgage Agent MBS Factory
Series 4
10) Class Description PT
Current
Bal RUB 33,961,620,042
Fct (Jul 18) 0.704630000
Cpn (Jul 18) 11.50000%
Class/Grp Pct 100.00%
Beg Accrue 07/30/2018
End Accrue 10/28/2018
11) Cr Supp 0.00%
Fctr Oct18 Jul Apr18
Cpn 11.50 11.50 11.50

Not Priced
Prepay OCPR
60 Send
60 Buy 90 Sell
2) Group Summary
3) Comments
4) Structural Summary
5) Overview
6) Pro | DSCO »
7) Docs | DSCO »
16) Servicer
17) Lead Mgr
18) Trustee
VTB24 ZAO (100%)
VTB Capital PLC
Payment Details
Rating Curr Orig
Original
SYT
WAL
Enter all values and hit <G0>
MBSF 4 A Mtge
RU RMBS
1M
105-16
10.3925
10.1
7.00
4.24
10/18-1/46
744
GOVT 4:11 6M2.32 1Y2.55 2Y2.77 3Y2.84 5Y

CUSIP BCC2F6E92
Yield --/--
Collateral 100.0% WHOL13.2%
ISIN RU000A0ZYJT2
FIGI BBG00JGG2N11
95 Buy 90 Sell
1) Price-to-Yield
2) Cashflows
3) Table
4) Bond Flow
5) Collateral Flow
6) Deal Flow
7) Liquidity
8) Close Repo

Yield Table
As of 07/2018
1st Proj 10/28/2018
Day Count ACT/365
Created 9/17/2018
1M
105-16
10.3925
10.1
7.00
4.24
10/18-1/46
744
GOVT 4:11 6M2.32 1Y2.55 2Y2.77 3Y2.84 5Y

CFT
Enter all values and hit <G0>
MBSF 4 A Mtge
RU RMBS
1M
105-16
10.3925
10.1
7.00
4.24
10/18-1/46
744
GOVT 4:11 6M2.32 1Y2.55 2Y2.77 3Y2.84 5Y

Yield Table
As of 07/2018
1st Proj 10/28/2018
Day Count ACT/365
Created 9/17/2018
1M
105-16
10.3925
10.1
7.00
4.24
10/18-1/46
744
GOVT 4:11 6M2.32 1Y2.55 2Y2.77 3Y2.84 5Y

RU000A0JX3M0

RUB

FASPMC

IA Fabrica ITSB OOO

14.293%

28 Dec 2039

Калькулятор ДОМ.РФ. В разработке.

Расчёты

Облигация

Портфель

Найти

Последние просмотренные

Предварительная оценка

Предварительная оценка выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Мониторинг выпуска

Расчёты

Оригинатор

Облигация

Портфель

Найти

Последние просмотренные

Предварительная оценка

Предварительная оценка

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Оценка выпуска

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - третий купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - Второй купонный период

Главная

Параметры

Потоки

Макроэкономика

Действия

Макроэкономические показатели, %

Дата	КБД факт.	КБД сцен.	Спот-ставка	Ставка по ипотеке	ИЦЖ
11.11.2017	7,54	7,54	7,54	8,34	100,04
07.12.2017	7,53	7,59	7,55	8,88	100,15

Симуляция короткой ставки (или спот-ставки) (Short rate), %

Расчёты

Оригинатор

Облигация

Портфель

Найти

Последние просмотренные

Предварительная оценка

Предварительная оценка

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Оценка выпуска

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - третий купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - второй купонный период

Мониторинг выпуска - Второй купонный период

Главная

Параметры

Потоки

Макроэкономика

Действия

Оценка облигаций от 11.11.2017

	-100 б.п.	Среднее	+100 б.п.
OAS_6n к shortrate		130,00	
Грязная цена, %	107,07	105,47	103,53
Чистая цена, %	107,07	105,47	103,53
Доходность, %	7,82	8,90	10,00
Дюрация Маклея, год	2,06	2,24	2,42
Модифицированная дюрация	1,91	2,05	2,20
Эффективная дюрация		1,68	
Выпуклость		-30,67	
Ставка досрочного погашения (CPR), %	30,98	26,72	22,67

Тех. параметры модели

Распределение цены



Оригинатор

Облигация

Портфель

найти

- Последние просмотренные
- Предварительная оценка
 - Предварительная оценка
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Оценка выпуска
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период

Предварительная оценка

2500 сценариев, без модификаций

Главная Параметры Поток Макроэкономика Действия

Параметры облигаций

Непогашенный номинал, руб./шт.	1 000,00
Тип купона	Фиксированный
Накопленные проценты, руб.	0,00
Купон, %	11,50
Купонный период, мес.	3,00
Дата выпуска	07.12.2017
Дата первого купона	07.03.2018

Облигация

Портфель

найти

Сводные показатели ипотеч

- Объем непогашенного ОФЗ, руб.
- Первоначальный объем выданных
- Кол-во заложных, шт.
- Процентная ставка (WAI), %
- Текущий K/3 (WAI), %
- Первоначальный K/3 (WAI), %
- Выдержка (WAI), мес.
- Срок по погашения (WAI), мес.
- Средний размер кредита, руб.

Расчёты

Облигация

Портфель

найти

- Последние просмотренные
- Предварительная оценка
 - Предварительная оценка
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Оценка выпуска
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - третий купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период
 - Мониторинг выпуска - второй купонный период

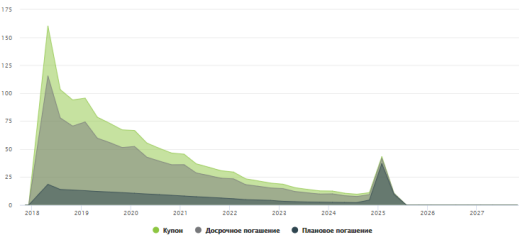
Главная Параметры Поток Макроэкономика Действия

Денежные потоки по облигациям [руб. на 1 облигацию]

Дата	Номинал	Купон	Погашение	CPR, %	Ставка, %
11.11.2017	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
07.12.2017	1 000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
28.04.2018	884,42	44,74	115,58	24,95	11,50
28.07.2018	806,50	25,36	77,92	29,02	11,50
28.10.2018	735,89	23,38	70,61	28,15	11,50
28.01.2019	661,59	21,33	74,30	33,14	11,50
28.04.2019	601,79	18,76	59,80	29,20	11,50
28.07.2019	545,91	17,25	55,88	29,49	11,50
28.10.2019	494,48	15,82	51,43	29,31	11,50
28.01.2020	442,12	14,33	52,36	33,56	11,50
28.04.2020	399,33	12,68	42,78	29,86	11,50
28.07.2020	359,99	11,45	39,34	30,17	11,50
28.10.2020	323,95	10,43	36,05	30,13	11,50
28.01.2021	287,86	9,39	36,09	34,30	11,50
28.04.2021	259,16	8,16	28,70	29,97	11,50
28.07.2021	232,73	7,43	26,43	30,27	11,50
28.10.2021	208,79	6,75	23,94	30,07	11,50
28.01.2022	185,35	6,05	23,44	33,82	11,50
28.04.2022	167,14	5,26	18,21	29,36	11,50
28.07.2022	150,32	4,79	16,82	29,58	11,50
28.10.2022	135,05	4,36	15,27	29,25	11,50
28.01.2023	120,32	3,91	14,74	33,41	11,50
28.04.2023	108,23	3,41	12,09	30,56	11,50



Денежный поток, млн. руб.



CPR, %

