

РЫНОЧНЫЕ ДАННЫЕ В НОВЫХ РЕАЛИЯХ.

INVESTFUNDS FORUM XIV

СЕРГЕЙ ШЛЫК,
ДИРЕКТОР ПО ИНФОРМАЦИОННЫМ СЕРВИСАМ, НРД

Инвест. идеи и стратегии на российском рынке:
новые горизонты

25-26 МАЯ 2023, САНКТ-ПЕТЕРБУРГ



СТРУКТУРНЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ НА РЫНКЕ ИСТОЧНИКОВ ФИНАНСОВЫХ ДАННЫХ

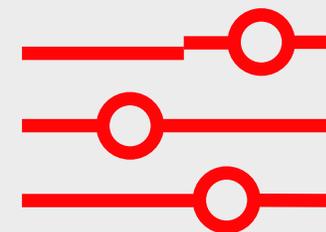
Вызовы и изменения на рынке данных

- Уход иностранных поставщиков маркет даты, терминальных решений, рейтинговых агентств
- Отказ от работы с Россией иностранных поставщиков данных
- Снижение объемов ИЦБ, изменение в составе, формате и порядке раскрытия данных
- Снижение количества сделок и данных по ним

Новые тренды и возможности

- Усиление рынка отечественных поставщиков данных и развитие собственной продуктовой линейки рыночных данных
- Поддержка ЦБ РФ рынка поставщиков данных и администраторов финансовых индикаторов
- Формирование новых подходов к оценке фин. инструментов без привязки к иностранным методикам, рейтингам и данным

ИЗМЕНЕНИЯ В ПОДХОДАХ К ОЦЕНКЕ ФИН. ИНСТРУМЕНТОВ



ИЗМЕНЕНИЯ В МЕТОДИКАХ

- Облигации ипотечные, рублевые, с плавающей ставкой и корп. евробонды
- Еврооблигации корпоративные
- Еврооблигации корпоративные/Минфин

ФАКТОРЫ

- Снятие суверенных рейтингов и рейтингов российских эмитентов со стороны международных рейтинговых агентств
- Сделки по российским корпоративным еврооблигациям на российских и зарубежных площадках проходят по очень разным ценам
- Рост размещений на рынке выпусков, номинированных в иностранных валютах (CNY, CHF, GBP)
- Сокращение объемов торгов российскими корпоративными еврооблигациям

ИЗМЕНЕНИЯ

- Переход на использование национальных рейтингов в расчетах Методик
- Расчет справедливой стоимости на основе данных российских источников
- Внесение изменений в алгоритм расчета для возможности оценки еврооблигаций в ин. валютах
- Изменение минимальных требований для расчета справедливой стоимости по методу рыночных цен

РЫНОЧНЫЕ ДАННЫЕ НРД НА СЕГОДНЯ

ИСТОЧНИК ДАННЫХ ПО РЕШЕНИЮ БАНКА РОССИИ

о стоимости финансовых
инструментов, драгоценных
металлов и иностранных валют

new

ДАННЫЕ НАПРЯМУЮ ИЗ ЦЕНТРАЛЬНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ РОССИИ

основаны на информации,
аккумулируемой в базах
данных НРД

МЕТОДИКИ ОДОБРЕННЫ ЭКСПЕРТНЫМ СОВЕТОМ РЫНКА

и обеспечивают компании
снижение операционных рисков,
повышение эффективности
и сокращение расходов

Решение совета директоров Банка России от 29.04.2022

ЕДИНЫЙ

ОФИЦИАЛЬНЫЙ

ИСТОЧНИК

ИНФОРМАЦИИ

– здесь
рождаются данные
по эмитентам и ценным бумагам

ЧТО ВНУТРИ?

■ API NSD

■ ЭМИССИОННАЯ
БИБЛИОТЕКА

■ ЦЕНОВОЙ ЦЕНТР

■ ЦЕНОВЫЕ ДАННЫЕ ОТС РЫНКА

■ ДИСК НРД

■ РАССЫЛКА ИНФОРМАЦИИ
ДЕПОНЕНТАМ НРД

■ TTL **new**

new

«ИТОГИ ТОРГОВ» И «ИТОГИ ТОРГОВ ЧЕРЕЗ API»

Предоставление агрегированной информации об **итогах торгов ценными бумагами с зарубежных торговых площадок**. Информация о ценах представляет собой набор рыночных данных по ценным бумагам (акциям, облигациям, депозитарным распискам, ETF), собранным по итогам торгового дня с зарубежных биржевых и иных торговых площадок.

Ежедневные рыночные данные с зарубежных торговых площадок по бумагам, входящим в портфель

1

Покрытие со всех пяти частей света: Америка, Европа, Азия, Австралия, Африка

2

Широкий спектр ценных бумаг в покрытии

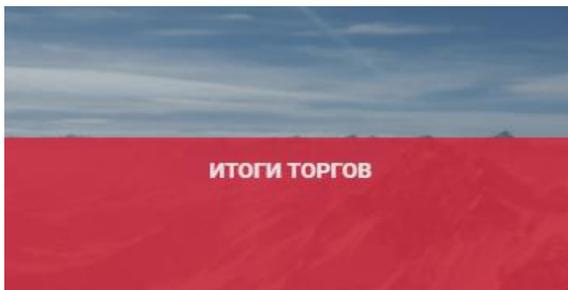
3

Обновление данных по итогам закрытия площадок несколько раз в сутки

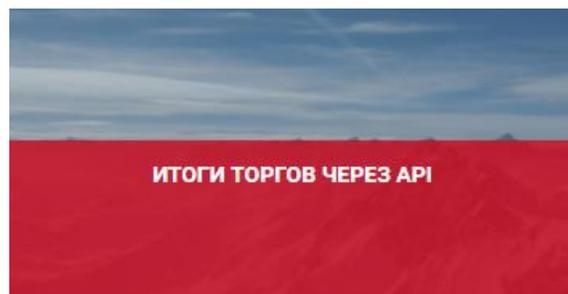
ПРЕДСТАВЛЕНИЕ НА САЙТЕ

Формат предоставления данных:

- представление данных на сайте **nsddata.ru** в табличном виде с возможностью выгрузки данных в форматах XLS, XLSX, CSV



- представление данных в формате JSON



ИТОГИ ТОРГОВ

Фильтр Столбцы Статус заказов ISIN

ISIN Дата

Тип инструмента

ISIN	Наименование	Категория ценной бумаги	Тип инструмента	Валюта	Последняя доступная торговая дата	Цена открытия	Максимальная цена	Минимальная цена	Цена закрытия	Объем торгов	Цена bid	Цена ask	Код биржи
AT0000A2UF10	5 Bd Redeem 21/01/2025 Usd 1000	bond	Fixed	USD	07.04.2023				83.24				MISX
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	bond	Fixed-Floating Rate	EUR	06.04.2023	70.03	70.87	70.03	70.87				XBER
AMUNIBB2DER6	5.30 Bd Redeem 05/02/2024 Usd 100	bond	Fixed	USD	04.04.2023	5.09	5.09	5.09	5.09	250	5.09	4.85	XARM
AMUNIBB2AER2	5.25 Bd Redeem 15/11/2022 Usd 100	bond	Fixed										XARM
AT0000A1HEX7	Fxdzc Bd Redeem 05/12/2024 Usd 140000	bond	Fixed-Zero Coupon										XWBO
AT0000A284R6	Zc Bd Redeem 31/12/2024 Eur 10000	bond	Zero Coupon										XWBO
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	stock	Common Stock	EUR	05.04.2023	13.9	13.9	13.9	13.9	0	14.27	14.35	XFRA
AT0000652011	Erste Group Bnk Inh. O.N.	stock	Common Stock	EUR	06.04.2023	30.56	31.08	30.56	31.08	12756	31.1	31.21	XETR
AT0000831706	Wienerberger	stock	Common Stock	EUR	06.04.2023	25.46	25.68	25.36	25.36	978	25.44	25.56	XETR

ИСТОРИЧЕСКИЕ ДАННЫЕ



Bonds

ISIN	Наименование облигации	Код валюты	Дата окончательного платежа	Купон (в % годовых)	Тип купона	Последняя доступная торговая дата	Доходность до погашения	Дюрация	Цена открытия для торгового дня	Максимальная цена для торгового дня	Минимальная цена для торгового дня	Цена закрытия для торгового дня	Код биржи	Классификация SIC
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	18.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	06.04.2023	4.336091	0.666287	70.04	70.04	70.04	70.04	XFRA	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	19.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	05.04.2023	4.365971	0.666188	70.72	71.05	70.72	71.05	XHAM	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	20.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	06.04.2023	4.545983	0.665595	68.5	68.5	68.19	68.21	XMUN	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	21.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	06.04.2023	4.515763	0.665694	70.03	70.02	70.02	70.02	XSTU	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	22.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	06.04.2023	4.620709	0.665348	70.18	70.18	70.18	70.18	XGAT	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	23.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	05.04.2023	4.692612	0.665111	70.18	70.18	70.18	70.18	XSTU	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	24.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	05.04.2023	4.764515	0.664874	70.18	70.18	70.18	70.18	XGAT	Plastics Materials
BE0002582600	Fxdfr Bd Perpetual Eur 200000 - Reg S	EUR	25.12.2023	3.625	Fixed-Floating Rate	04.04.2023	4.836417	0.664636	68.5	68.5	68.19	68.21	XMUN	Plastics Materials

Stocks

ISIN	Наименование компании	Тип ценной бумаги	Последняя доступная торговая дата	Цена открытия	Максимальная цена	Минимальная цена	Цена закрытия	Объем	Цена bid	Цена ask	Код валюты	Код биржи	Наименование биржи	Идентификационный код первичной биржи	Наименование первичной биржи	Классификация SIC	Классификация GICS	LEI
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	06.04.2023	13.97	14.39	13.97	14.33	12287	14.24	14.43	EUR	XETR	Xetra	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB72
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	06.04.2023	13.9	13.9	13.9	13.9	0	14.27	14.35	EUR	XFRA	Deutsche Boerse Ag	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB73
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	05.04.2023	10.99	11.23	10.92	11.14	478598	10.8	11.49	EUR	XETR	Xetra	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB72
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	05.04.2023	10.04	10.08	10.04	10.08	0	9.98	10.14	EUR	XFRA	Deutsche Boerse Ag	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB73
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	04.04.2023	7.931513	0.970277	97.14	97.14	97.14	97.14	14.43	EUR	XETR	Xetra	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB72
AT0000606306	Raiffeisen Bk Intl Inh.	Common Stock	04.04.2023	7.931513	0.970277	97.14	97.14	97.14	97.14	14.35	EUR	XFRA	Deutsche Boerse Ag	XWBO	Wiener Boerse Ag	Commercial Banks	Bank	529900ZAXBMQDIWPNB73

САМЫЙ ПРОСТОЙ И НАДЕЖНЫЙ БОТ-ПОМОЩНИК В МИРЕ ИНВЕСТИЦИЙ

МОЕХ НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ

ТВОЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
И БИРЖА
В ТЕЛЕФОНЕ
КАЖДЫЙ ДЕНЬ



@NSDNEWSBOT

БЛАГОДАРЮ ЗА ВНИМАНИЕ

ТЕЛЕФОН: +7 495 232-05-14

E-MAIL: DATASALES@NSD.RU

МОЕХ НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ

