



ОЦЕНКА ЗАМЕЩАЮЩИХ ЕВРООБЛИГАЦИЙ.

НОВЫЙ СЕРВИС – ИТОГИ ТОРГОВ С ЗАРУБЕЖНЫХ ПЛОЩАДОК

Павел Ерыкалов, начальник отдела развития
ценового центра



РОССИЙСКИЙ РЫНОК ОБЛИГАЦИЙ, НОМИНИРОВАННЫХ В ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТАХ

424

ВЫПУСКОВ В ОБРАЩЕНИИ,
НОМИНИРОВАННЫХ
В ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТАХ
СО СТРАНОЙ РИСКА RU

186

ИЗ НИХ –
НЕСУБОРДИНИРОВАННЫЕ
И НЕСТРУКТУРНЫЕ ВЫПУСКИ

64

ЭМИТЕНТА ВЫПУСКАЮТ
ОБЛИГАЦИИ ТАКОГО ТИПА

8

САМЫХ КРУПНЫХ ЭМИТЕНТОВ

ВСЕ 186 БУМАГ ЦЕНОВОЙ
ЦЕНТР НРД ОЦЕНИВАЕТ В РАМКАХ МЕТОДИК
ОЦЕНКИ СПРАВЕДЛИВОЙ СТОИМОСТИ КОРПОРАТИВНЫХ
ЕВРООБЛИГАЦИЙ И ЕВРООБЛИГАЦИЙ ПРАВИТЕЛЬСТВА РФ

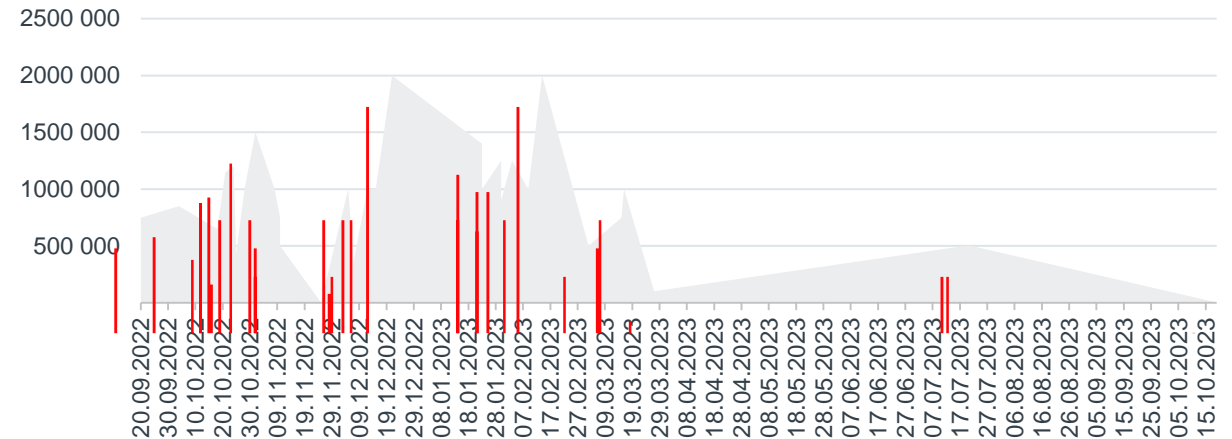
Наименование эмитента	Количество уникальных isin-ов в обращении
Минфин РФ	13
Gaz Capital	11
МКПАО ОК	
РУСАЛ	9
СИБУР Холдинг	9
Gaz Finance	8
RZD Capital	6
СВОМ Finance	5
GTLK Europe Capital	5

РЫНОК ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ

Замещающие облигации – это облигации российских компаний, выпущенные ими взамен своих же еврооблигаций. Номинал и купоны замещающих облигаций выражены в иностранной валюте, но инвесторам номинал и купоны выплачиваются в рублях.

Это позволяет выплачивать деньги без участия иностранных финансовых организаций

ДИНАМИКА ОБЪЕМОВ ЭМИССИИ ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ, ШТ.



33 ВЫПУСКА

ЗАМЕЩАЮЩИХ
ОБЛИГАЦИЙ
ОБРАЩАЕТСЯ
НА РЫНКЕ

9 УЧАСТНИКОВ

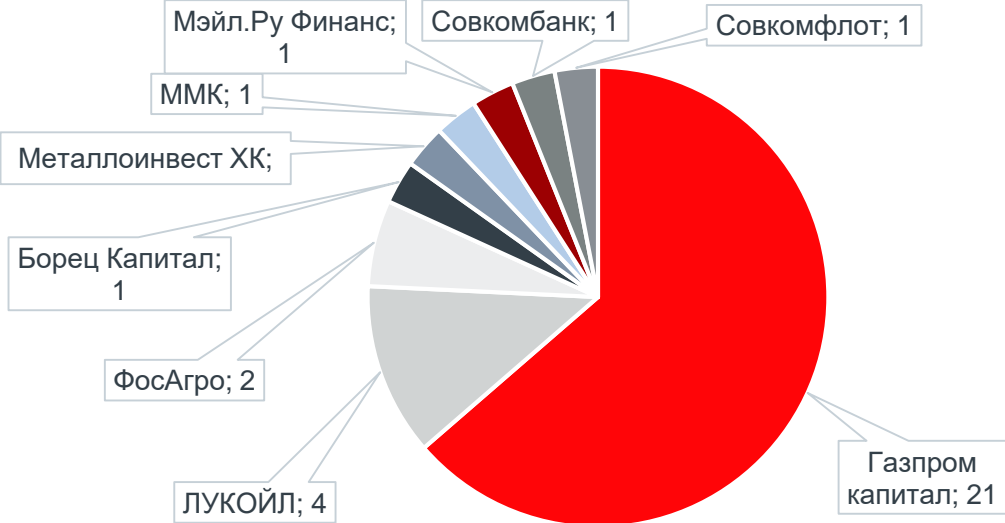
РЫНКА ВЫПУСТИЛИ
ЗАМЕЩАЮЩИЕ
ОБЛИГАЦИИ

В 4 ВАЛЮТАХ

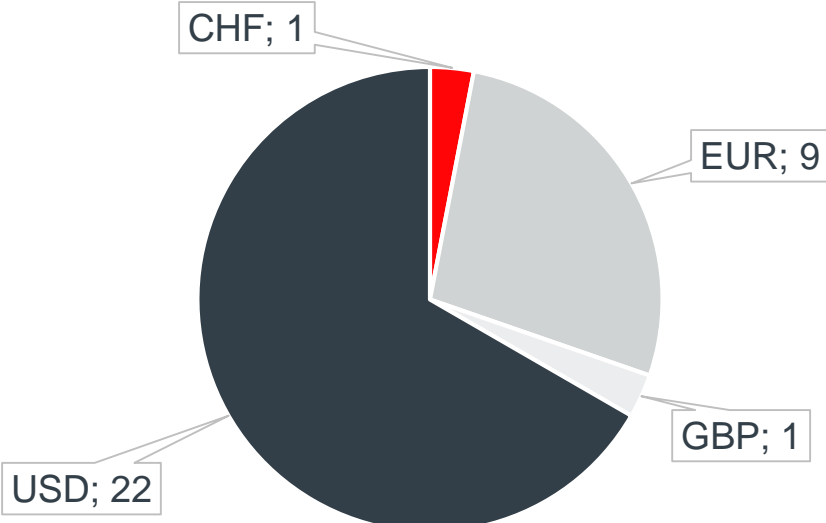
ВЫПУЩЕНЫ
ЗАМЕЩАЮЩИЕ
ОБЛИГАЦИИ: USD,
EUR, GBP, CHF

РЫНОК ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ

КОЛИЧЕСТВО ВЫПУСКОВ ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ В РАЗБИВКЕ ПО ЭМИТЕНТАМ, ШТ.



КОЛИЧЕСТВО ВЫПУСКОВ ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ В РАЗБИВКЕ ПО ВАЛЮТЕ НОМИНАЛА, ШТ.



31 ЗАМЕЩАЮЩАЯ ОБЛИГАЦИЯ В НАСТОЯЩИЙ МОМЕНТ ОЦЕНИВАЕТСЯ ЦЕНОВЫМ ЦЕНТРОМ НРД В РАМКАХ МЕТОДИКИ ОЦЕНКИ КОРПОРАТИВНЫХ ЕВРООБЛИГАЦИЙ

МЕТОД РЫНОЧНЫХ ЦЕН

УСЛОВИЯ: С облигацией совершена минимум одна достоверная сделка. Исторически с облигацией совершено минимум 50 сделок. Минимальный срок с начала вторичного обращения 5 дней

РАСЧЕТ: Справедливая стоимость = медиана распределения цен достоверных сделок

МЕТОД

ДИСКОНТИРОВАННОГО ДЕНЕЖНОГО ПОТОКА

УСЛОВИЯ: С облигацией отсутствуют достоверные сделки, но есть рыночные данные по выпускам данного эмитента или бумагам аналогичной рейтинговой группы.

РАСЧЕТ: Сумма дисконтированных денежных потоков по кривой бескупонной доходности МосБиржи с использованием наблюдаемого z-спреда эмитента

Ежедневно каждая бумага из покрытия методик ценового центра оценивается одним из трех методов в зависимости от наличия рыночных данных.

Самые ликвидные выпуски оцениваются первым методом, менее ликвидные – вторым или третьим

МЕТОД

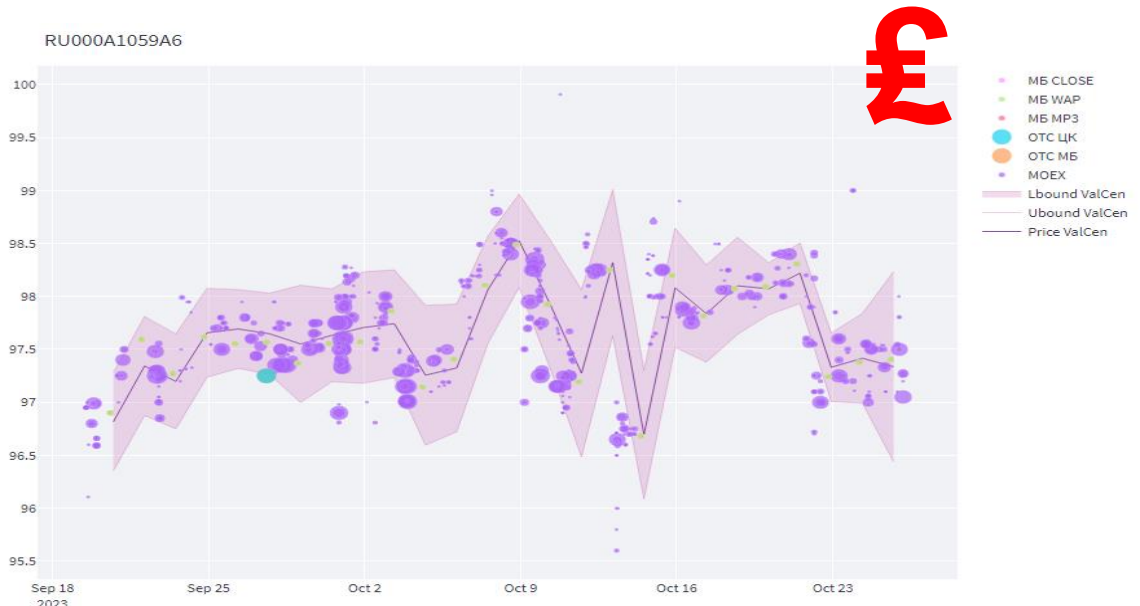
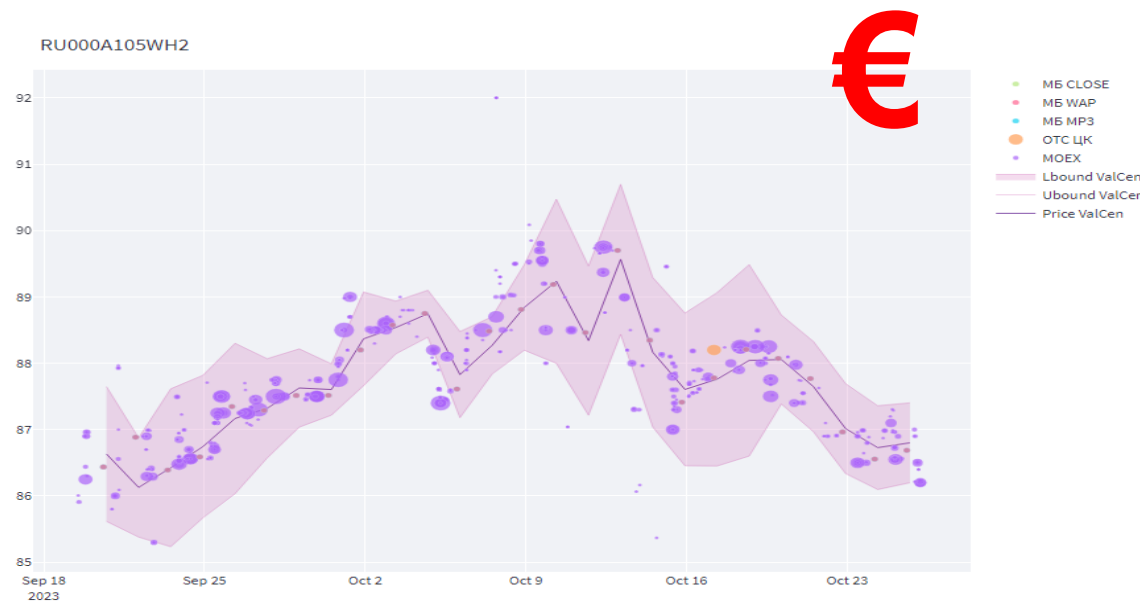
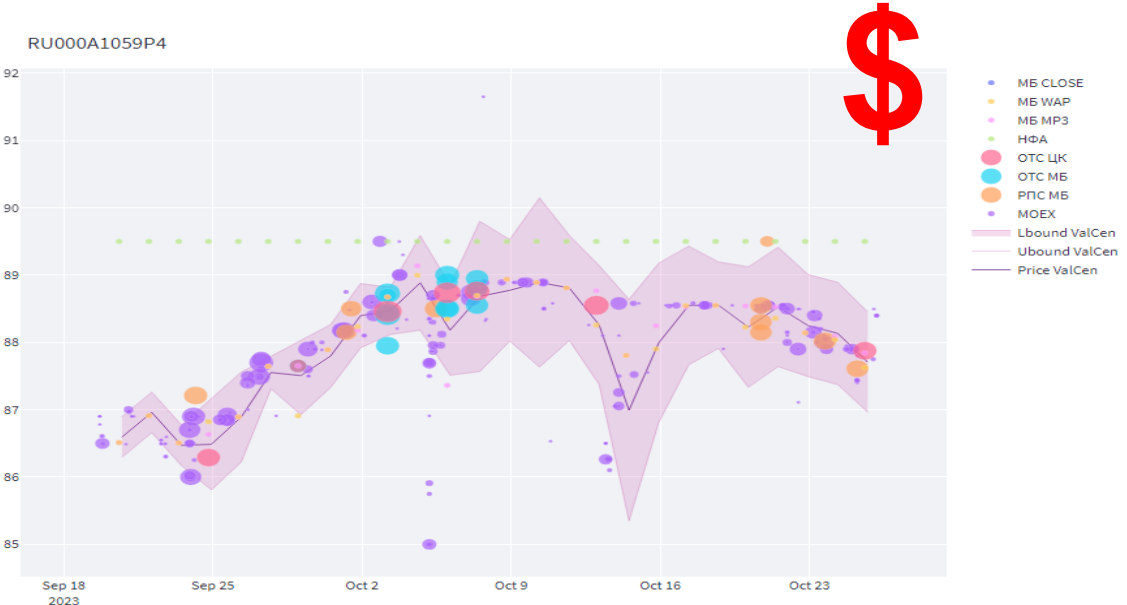
ИНДЕКСНОГО

ДИСКОНТИРОВАННОГО ДЕНЕЖНОГО ПОТОКА

УСЛОВИЯ: Наблюдаются рыночные данные менее, чем по 3 выпускам еврооблигаций с аналогичным рейтингом.

РАСЧЕТ: Справедливая стоимость рассчитывается, как во втором методе, но в качестве наблюдаемых z-спредов используются z-спреды индексов

ПРИМЕР ОЦЕНКИ ЗАМЕЩАЮЩИХ ОБЛИГАЦИЙ ЦЕНОВЫМ ЦЕНТРОМ НРД В РАЗНЫХ ВАЛЮТАХ НОМИНАЛА



НОВЫЙ СЕРВИС

– ИТОГИ ТОРГОВ С ЗАРУБЕЖНЫХ ПЛОЩАДОК

«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.

Подписка на данный сервис позволит **ежедневно** получать рыночные данные с зарубежных торговых площадок по бумагам, входящим в портфель

ПРЕИМУЩЕСТВА СЕРВИСА

01

Покрытие со всех пяти частей света: Америка, Европа, Азия, Австралия, Африка, Ближний Восток, Индия, Турция

02

Гибкая тарифная система

03

Широкий спектр ценных бумаг в покрытии

04

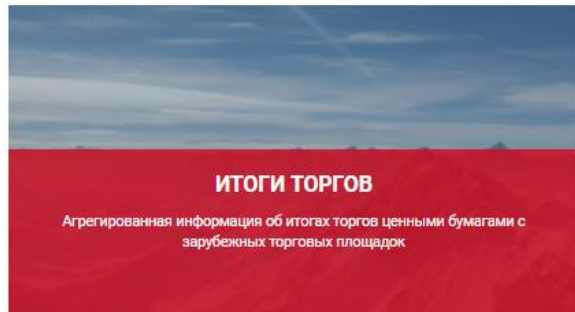
Обновление данных по итогам закрытия площадок несколько раз в сутки

ПРЕДСТАВЛЕНИЕ НА САЙТЕ

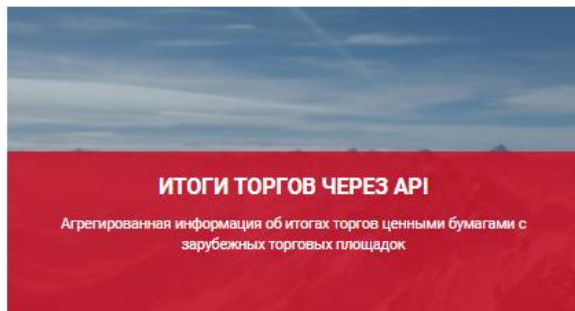
ФОРМАТ ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ

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
Агрегированная информация об итогах торгов ценными бумагами с зарубежных торговых площадок

Фильтр Столбцы Статус заказов ISIN

ISIN:

Дата с:

Дата по:

Эмитент:

Тип инструмента:

ISIN	Эмитент	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
USP93077AC28	Transportadora de Gas Internacional SA	облигации	Fixed	USD	2023-08-25	95.13	95.37	95.12	95.2				XSTU
USP9379RBC09	Empresas Public Medellin	облигации	Fixed	USD	2023-08-25		77	76.92	77				FINR
USP9406GAB43	Fibra Uno Administracion S.A. De C.V.	облигации	Fixed	USD	2023-08-25		86.6	86.6	86.6				FINR
USP94461AD52	Unifin Financiera SAB DE CV	облигации	Fixed-Floating Rate	USD	2023-08-25		0.78	0.78	0.78				XLUX
USP9485MAC30	Unifin Financiera SAB DE CV	облигации	Fixed	USD	2023-08-25	5.07	5.07	5.07	5.07				XFRA
XS2234859283	Oman	облигации	Fixed	USD	2023-08-25	108.26	108.26	108.26	108.26				XFRA
XS2237422972	BrokerCreditService Structured Products Plc	облигации	Fixed	USD	2023-08-25				73				MISX
XS2238777374	PPF Telecom Group B.V.	облигации	Fixed	EUR	2023-08-25	93.57	93.57	93.57	93.57				XFRA
XS2238783778	Jt International Financial Services BV	облигации	Fixed-Floating Rate	EUR	2023-08-25	87.88	87.88	87.88	87.88				XFRA

ИСТОРИЧЕСКИЕ ДАННЫЕ

BONDS

ISIN	Эмитент	Наименование облигации	Код валюты	Дата погашения	Купон (в % годовых)	Тип купона	Последняя доступная торговая дата	Доходность до погашения	Цена bid	Цена ask	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
RU000A101RV2	Kazakhstan	6.55% BD REDEEM 15/09/2027 RUB 1000 - Ser 07	RUB	2027-09-15	6.55	Fixed	2023-09-01	11.148	85.43	85.6	3.25602	85.67	85.68	84.96	85.4	MISX	
RU000A101RV2	Kazakhstan	6.55% BD REDEEM 15/09/2027 RUB 1000 - Ser 07	RUB	2027-09-15	6.55	Fixed	2023-08-31	11.0772	85.36	85.66	3.26578	85.13	85.69	84.66	85.58	MISX	
RU000A101RV2	Kazakhstan	6.55% BD REDEEM 15/09/2027 RUB 1000 - Ser 07	RUB	2027-09-15	6.55	Fixed	2023-08-30	11.1468	85.14	85.61	3.26643	85.69	85.69	84.64	85.37	MISX	

STOCKS

ISIN	Эмитент	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	Код первичной биржи	Наименование первичной биржи	Классификация SIC	Классификация GICS	LEI
AEA001001014	Ad Aviation	Common Stock	2023-09-01	7.36	7.55	7.35	7.47	184946	4.33	4.34	AED	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange			
AEA001001014	Ad Aviation	Common Stock	2023-08-30	7.56	7.65	7.56	7.6	209530	4.33	4.34	AED	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange			
AEA001001014	Ad Aviation	Common Stock	2023-08-28	7.53	7.58	7.53	7.58	67113	4.33	4.34	AED	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange			
AEA001001014	Ad Aviation	Common Stock	2023-08-25	7.63	7.65	7.5	7.53	175158	4.33	4.34	AED	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange	XADS	Abu Dhabi Securities Exchange			

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!

КОМАНДА ЦЕНОВОГО ЦЕНТРА

valcen@nsd.ru

ИНФОРМАЦИОННЫЕ СЕРВИСЫ

datasales@nsd.ru

Informservices_support@nsd.ru