

Дайджест событий Ценового центра 2025 год

Развиваем отказоустойчивый полностью автоматизированный data — сервис с расчетной и аналитической информацией по ценным бумагам

Мы предоставляем качественные данные, прозрачные процессы, соответствующие высоким рыночным стандартам

+300

выпусков к покрытию

Новая методика оценки
справедливой стоимости
структурных облигаций

Ценовой центр НРД движется к глобальной цели — обеспечить расчеты справедливой стоимости по всем российским ценным бумагам, поэтому постоянно расширяет список инструментов, доступных для расчета справедливой стоимости. Новая методика Ценового центра учитывает уникальные особенности ценообразования сложных структурных продуктов.

Методика позволила добавить к сервису по оценке справедливой стоимости 300 новых выпусков. Также НРД готов произвести расчет справедливой стоимости по запросу.

С новой методикой вы можете ознакомиться [по ссылке](#)

+50дополнительных
параметров
методик

Запущен комплементарный сервис по предоставлению расширенного набора метрик по облигациям в покрытии Методик Ценового центра. Теперь пользователям стали доступны свыше 50 новых расчётных параметров облигаций, в числе которых: базовые параметры, параметры флоатеров, показатели ликвидности, доходности, рейтинги и другие данные в едином окне. Продукт позволяет глубже взглянуть на параметры, участвующие при формировании справедливой стоимости, и усилить анализ долгового рынка.

Описание набора данных и тестовый доступ [по ссылке](#)

Расширение функционала сервиса сделки репо с глобальными кредиторами

Для пользователей стали доступны расширенные сведения по операциям РЕПО через API НРД. В сервис добавлены данные:

- Состав корзин ценных бумаг Глобальных кредиторов
- Рыночные цены, НКД и корпоративные действия ценных бумаг для сделок
- Пороги переоценки



Усовершенствование методики Ценового центра

- Разработана модель прогнозирования ключевой ставки для флоатеров
- В методике субординированных облигаций крупного номинала упрощены критерии проверки на достоверность сделок
- Оптимизирован расчет облигаций со смешанным ипотечным покрытием и переменным купоном

Проведен комплекс работ по усовершенствованию рыночного метода в Методиках Ценового центра по рекомендациям Банка России:

- Внедрены наивный критерий и критерий монотонности
- Внедрена дополнительная фильтрация, включающая анализ внутридневной торговой динамики и проверку обоснованности рыночной оценки с точки зрения модельного подхода



Приглашаем вас протестировать наши новые продукты!

Для получения доступа напишите нам на datasales@nsd.ru

Контакты

+7 495 956-27-90

nsddata.ru

informservices_support@nsd.ru