

Portfolio ROR. Securities

Securities	Dynamic	Cashflows	Deals																	
Issue					ROR			P&L		Market								Date 2		
Instrument	ISIN	Maturity	FaceVal	Ccy	Portfolio	Market	Spread	Total	Coupon	YTM	CY	CY Mod	Dur	DurM	Convty	BPV	Cpn Days	Market		
РЖД 1P-07R	RU000A0ZZ9R4	26.05.2033	1 000	RUB	53.222	24.291	28.931	1 102	202	1.0895	7.4315	7.5805	9.20	9.15	96.85	0	91	98.50000		
ГазпромКРЗ	RU000A101QM3	27.05.2025	1 000	RUB	25.290	25.290		1 493	430	9.0990	6.1261	9.3672	2.09	2.00	5.10	-2	100	93.29000		
ВЭБ 1P-21	RU000A101WF5	21.07.2023	1 000	RUB	19.152	19.152		1 261	433	7.7369	5.7808	7.7563	0.37	0.35	0.30	-0	48	99.28000		
РоснефтьP4	RU000A0IXQK2	22.04.2027	1 000	RUB	18.730	18.730		1 112	571	0.2732	1.1605	1.1508	3.96	3.95	18.22	-3	133	100.04000		
Сбербанк-001P-SBER19	RU000A102CU4	17.11.2023	1 000	RUB	23.045	23.045		1 451	418	8.3919	5.6555	8.4347	0.68	0.65	0.75	-1	111	98.11000		
СФО ВТБ ПКС-1-01-06	RU000A103ZP1	01.12.2030	1 000	RUB	58.333	58.356	-0.023	2 375	528	9.4361	8.7062	9.8103	5.84	5.79	40.24	-4	8	92.13000		
МТС-001P-21	RU000A104W11	22.06.2026	1 000	RUB	0			277	403	9.0496	9.5162	9.0111	2.83	2.77	9.14	-2	73	101.69000		
								9 071	2 984										-11	

Columns

Состав выбранного портфеля:

1. Инструменты, позиции на даты начала и окончания отчета,
2. Доходности RoR Time Weighted позиций и рынка, расчет спреда между ними
3. Доходы по бумагам выбранного портфеля — общий и купонный (дивидендный)
4. BPV, YTM/YTO, CY, CY Modified, Dur, Dur Modified, Convexity долговых инструментов
5. Рыночные стоимости инструментов и их НКД на даты отчета
6. Денежные потоки в разрезе инструментов (сделки, выплаты эмитента, комиссии)

Группа полей	Описание
Instrument	Описание инструмента: FaceVal Величина <i>текущего</i> номинала инструмента, попавшего в отчёт. Указывается в валюте номинала инструмента. Maturity Дата погашения инструмента. Для акций и бессрочных облигаций поле остается пустым Instrument Название инструмента Ccy Валюта номинала инструмента FaceVal Текущий номинал инструмента на дату <i>now</i> ISIN Код ISIN инструмента.
ROR	Rate Of Return Portfolio Внутренняя норма инструмента, рассчитанная для всех платежей с ним: сделки, выплаты эмитента, комиссии. В расчет включаются платежи открытия и закрытия позиции на даты начала и окончания отчета $r = \frac{1}{t} \ln \frac{F_t}{F_0}$где: <i>t</i> — платёж через <i>t</i> лет (<i>t</i>) и <i>F₀</i> — начальная инвестиция Market Доходность стратегии Buy-And-Hold. Расчет параметра производится по логике: 1. купили 1 бумагу в дату <i>t_{buy}</i> по рыночной цене на дату <i>t_{buy}</i>, 2. включили в обороты все погашения (амортизации) и купонные (дивидендные выплаты), причитающиеся на 1 бумагу и 3. продали 1 бумагу в дату <i>t_{sell}</i> по цене на дату <i>t_{sell}</i>. Spread Спред между доходностью Портфеля и Рынка. Расчет производится по формуле: Позиция — Рынок. Если трейдер сработал лучше рынка — значение параметра положительное, и наоборот.

P&L	Profit and Loss:	
	Coupon	Сумма реализованного и нереализованного дохода по купонам / дивидендам
	Total	Общий доход. Сумма реализованных и нереализованных доходов позиции.
Market	Market:	
	DurM	Модифицированная дюрация (Modified Duration, MD) — параметр, который описывает эластичность цены облигации относительно доходности. Подробнее — в статье Дюрация модифицированная.
	Dur	Дюрация (Duration, D) — это средневзвешенный по дисконтированной сумме срок потока платежей. Подробнее — в статье Дюрация.
	CY Mod	Модифицированная текущая доходность рассчитывается путем прибавления к текущей доходности следующей величины: $\frac{MD \times (1 - \text{TaxRate})}{1 + \text{YTM}}$ где: TaxRate — чистая стоимость облигации YTM — срок до погашения облигации в годах Формула расчета модифицированной доходности: $\text{CY}_{\text{Mod}} = \text{CY} + \frac{MD \times (1 - \text{TaxRate})}{1 + \text{YTM}}$ Модифицированная текущая доходность — один из упрощенных методов сравнения облигаций, который, в отличие от текущей доходности, в некоторой степени учитывает возможность покупки облигации с премией или дисконтом. Текущая модифицированная доходность бессрочной облигации Текущая модифицированная доходность бессрочной облигации рассчитывается по формуле $\text{CY}_{\text{Mod}} = \text{CY} + \left(\frac{MD \times (1 - \text{TaxRate})}{1 + \text{YTM}} \right)$ При расчете к оферте с известной датой используется формула для срочных облигаций.
	CY	Текущая доходность процентной облигации — это сумма купонных платежей за год, делённая на текущую <i>Рыночную стоимость</i> облигации. Подробнее — в статье Доходность текущая.
	YTM	Доходность к погашению, рассчитанная на дату отчёта для Текущей рыночной цены При расчете значения используется метод расчета YTM, указанный в настройках облигации. Методы используемые в расчетах описаны в статье Доходность.
	BPV	Цена базисного пункта (Price value of a basis point, BP01) — показатель, оценивающий изменение стоимости облигации при изменении доходности на один базисный пункт вверх. Подробнее — в статье Цена базисного пункта (BV01).
	Convxy	Выпуклость потока платежей (Convexity, C) характеризует степень отклонения стоимости потока платежей от линейной функции и представляет собой второй коэффициент разложения этой стоимости в ряд Тейлора по процентной ставке. Подробнее — в статье Выпуклость.
	Cpn Days	Количество дней текущего купонного периода

Date 2	Дата окончания отчета:
Value	Value Рыночная стоимость позиции с НКД на дату . Рыночная стоимость рассчитывается по <i>Рыночной цене</i> и приводится к валюте отчета по курсу, указанному в параметре тип курса. Если <i>Валюта отчета</i> не указана, то рассчитывается в национальной валюте. Для большинства случаев для акций и облигаций рыночная стоимость определяется по формуле: $Value = \frac{Price}{1 + \frac{Yield}{100}} \times Quantity$ где — коррекционный фактор инструмента на дату окончания отчета, — количество инструмента позиции на дату . — рыночная цена на дату . Для счета подтипа <i>До погашения</i> рассчитывается на основании сделок покупки. Подробнее — в статье Рыночная стоимость.
Weight	Weight Доля инструмента от совокупной рыночной стоимости портфеля на <i>Дату окончания отчета</i>. Указывается в процентах.
Market	Market Рыночная цена, действующая на дату . Площадка и тип цены переоценки могут быть заданы параметрами отчета. Для счета подтипа До погашения рассчитывается на основании сделок покупки. Подробнее — в статье Рыночная стоимость. Если параметры отчета не заданы, то используются настройки инструмента. Источник цены указывается в поле Площадка переоценки. Если цена найдена, то: - Для долевых бумаг (акция) рыночная цена конвертируется в валюту отчета по курсу площадки, указанной в параметре <i>Тип курса</i> (используется курс на дату отчета). - Для долговых бумаг (облигация), рыночная цена показывается в процентах от номинала. - Для фьючерсов, в настройках которых указан тип цены <i>Price</i>, рыночная цена конвертируется в <i>Валюту отчета</i>. Если цена с указанными параметрами не может быть найдена, то в поле <i>Ошибка</i> указывается причина. Значение <i>не округляется</i>.
Accrued	Accrued НКД на дату . Расчет производится только для долговых инструментов. При расчете используется тип округления НКД, указанный в настройках инструмента. Подробнее о расчете НКД — в статье Расчет купонов и НКД.
Qty	Qty Величина балансовой и форвард позиций на дату .

Date 1	Дата начала отчета:
Market	Market Рыночная цена, действующая на дату Market. Площадка и тип цены переоценки могут быть заданы параметрами отчета. Для счета подтипа До погашения рассчитывается на основании сделок покупки. Подробнее — в статье Рыночная стоимость. Если параметры отчета не заданы, то используются настройки инструмента. Источник цены указывается в поле Площадка переоценки. Если цена найдена, то: 1. Для долевого бумага (акция) рыночная цена конвертируется в валюту отчета по курсу площадки, указанной в параметре Тип курса (используется курс на дату отчета). 2. Для долговых бумаг (облигация), рыночная цена показывается в процентах от номинала. 3. Для фьючерсов, в настройках которых указан тип цены Price, рыночная цена конвертируется в Валюту отчета. Если цена с указанными параметрами не может быть найдена, то в поле Ошибка указывается причина. Значение не округляется.
Qty	Qty Величина балансовой и форвард позиций на дату Qty.
Accrued	Accrued НКД на дату Accrued. Расчет производится только для долговых инструментов. При расчете используется тип округления НКД, указанный в настройках инструмента. Подробнее о расчете НКД — в статье Расчет купонов и НКД.
Value	Value Рыночная стоимость позиции с НКД на дату Value. Рыночная стоимость рассчитывается по Рыночной цене и приводится к валюте отчета по курсу, указанному в параметре тип курса. Если Валюта отчета не указана, то рассчитывается в национальной валюте. Для большинства случаев для акций и облигаций рыночная стоимость определяется по формуле: Value = Qty * Price * CF * (1 - Accrued / Price) где 1. CF — коррекционный фактор инструмента на дату окончания отчета, 2. Qty — количество инструмента позиции на дату Qty, 3. Price — рыночная цена на дату Price. Для счета подтипа До погашения рассчитывается на основании сделок покупки. Подробнее — в статье Рыночная стоимость.
Weight	Доля инструмента от совокупной рыночной стоимости портфеля на Дату начала отчета минус 1 день. Указывается в процентах.