

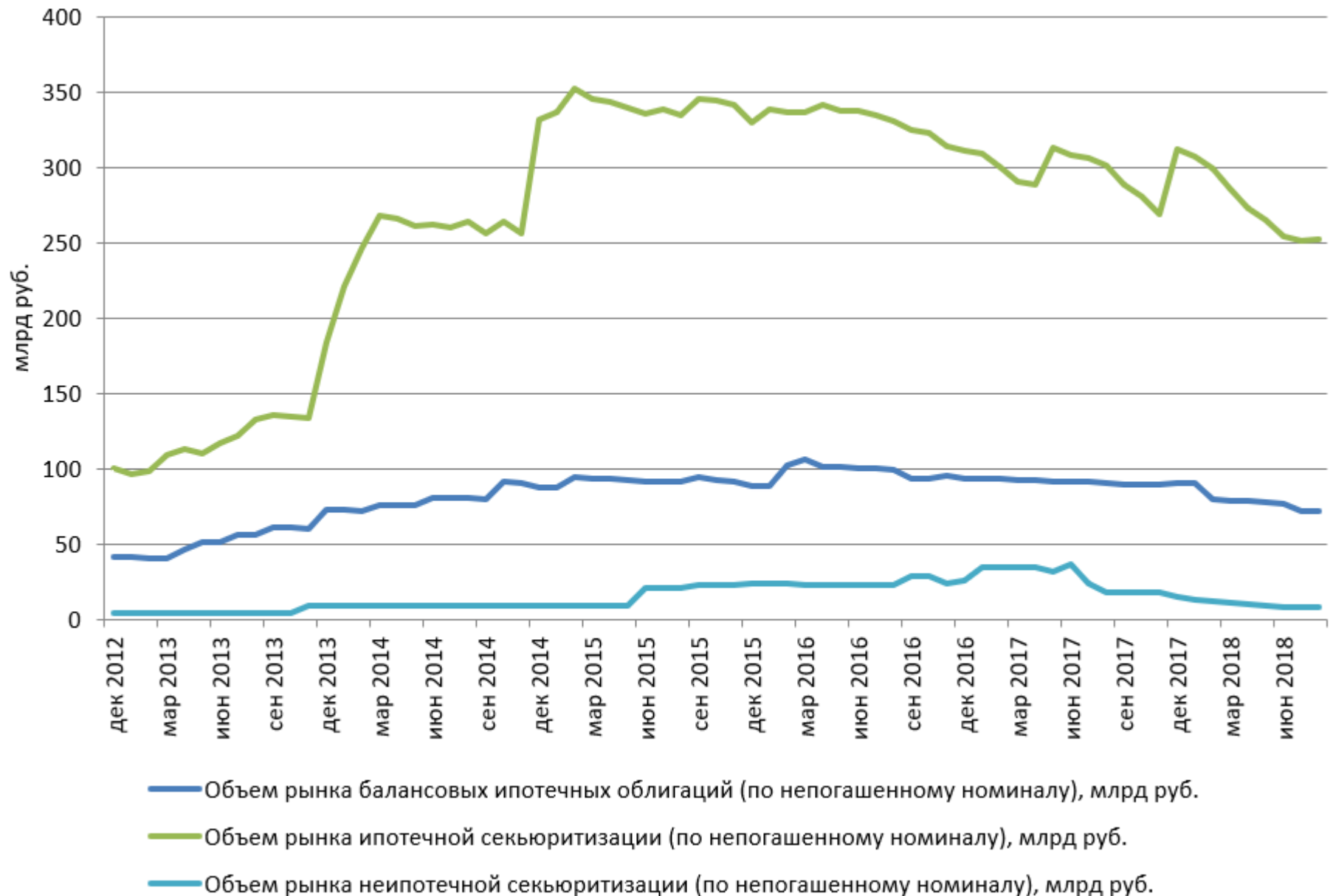
# **VII КОНФЕРЕНЦИЯ «ИПОТЕЧНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ И СЕКЬЮРИТИЗАЦИЯ В РОССИИ»**

## **Оценка и анализ ипотечных ценных бумаг**

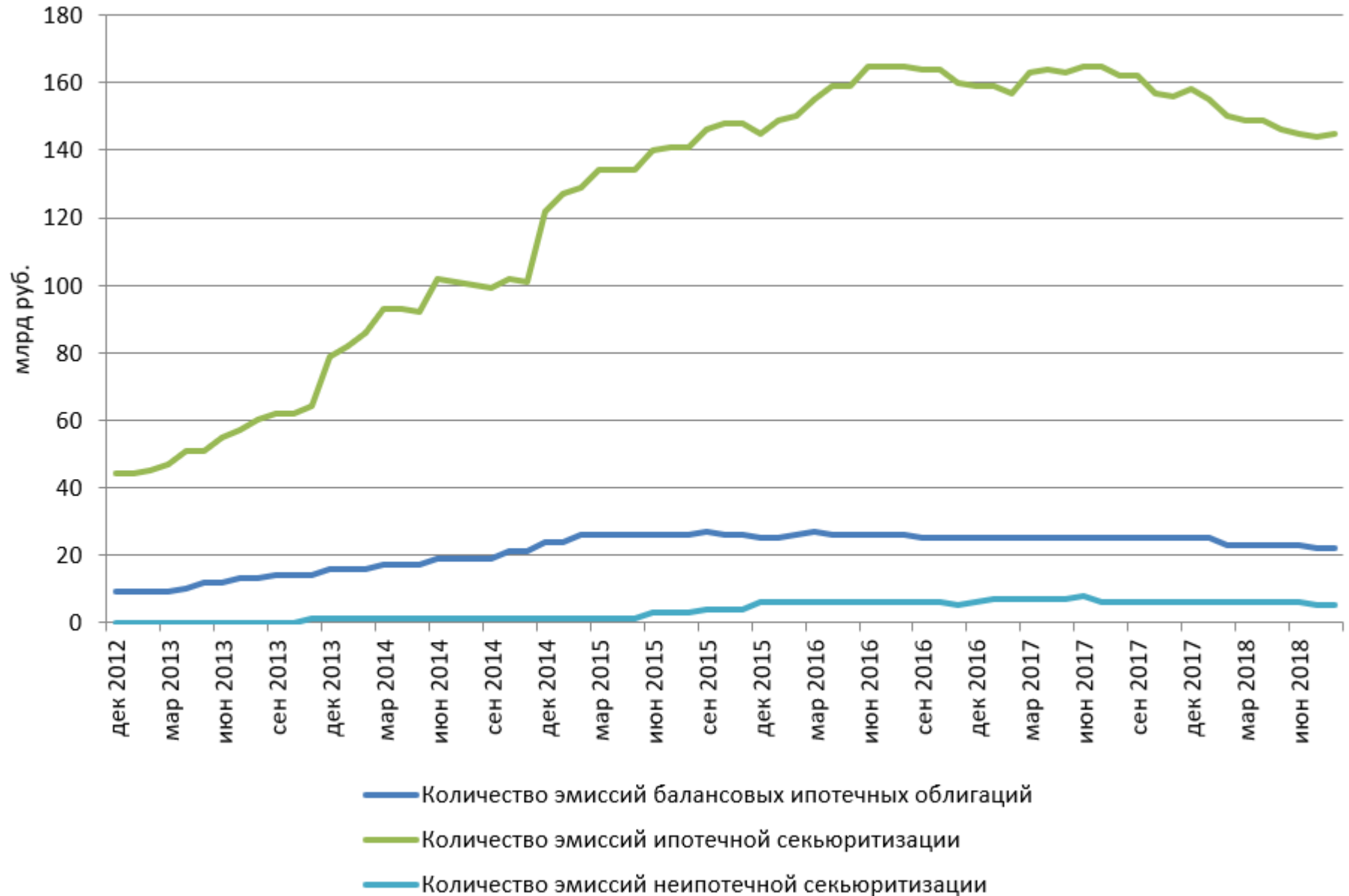
**Елена Скурихина,**  
руководитель группы развития  
проектов, Cbonds

20 сентября 2018

# Объем рынка секьюритизации



# Динамика количества выпусков



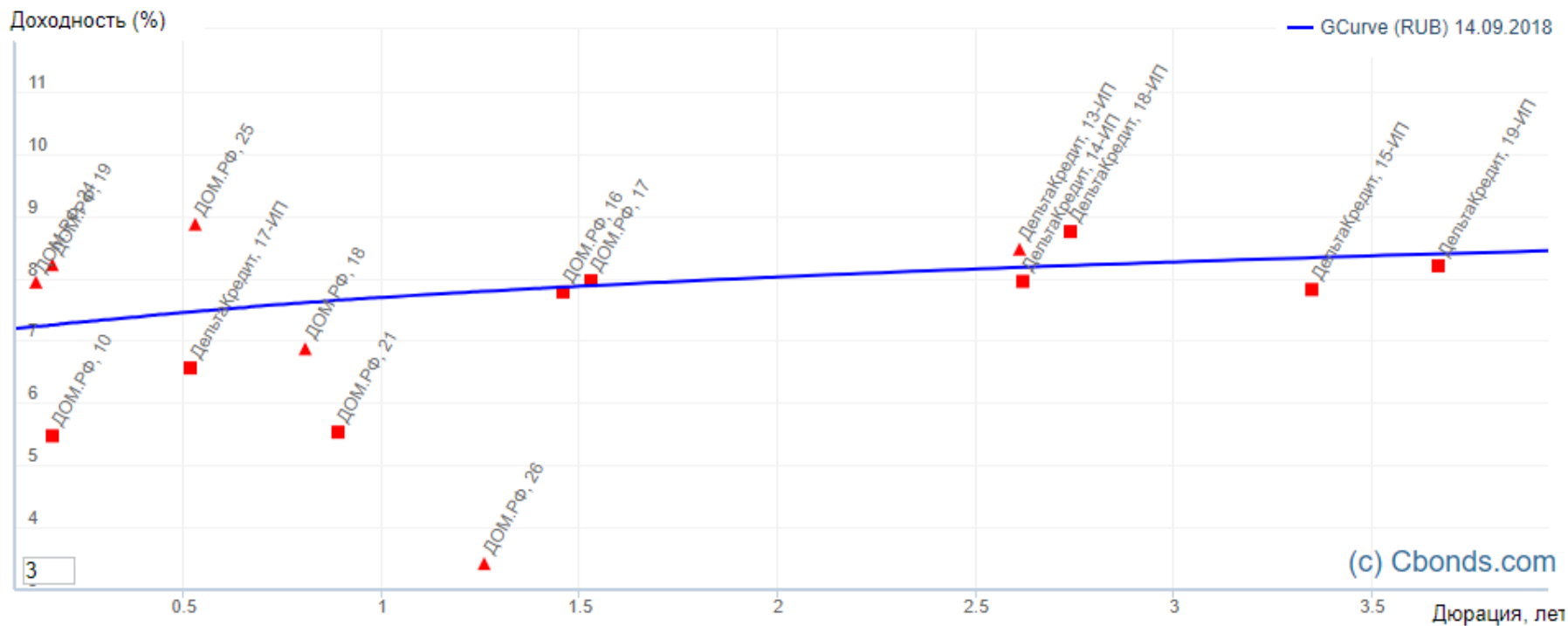
# Текущее состояние

По состоянию на начало сентября

- в обращении находится около 170 выпусков облигаций (ИЦБ + секьюритизация),
- из них по 70 есть котировки на бирже или от участников рынка на сайте Cbonds,
- торгуемые выпуски представлены от 50 ипотечных агентов и СФО.



# Карта доходности на рынке обеспеченных и ипотечных облигаций



# Информация по ИЦБ на сайте Cbonds

## Cbonds Valuation 1

Торговая площадка	Дата и время	Котировка на покупку/ продажу (Дох-ть)	Индикативная цена (Дох-ть)	Архив
CBONDS ESTIMATION <span style="float: right;">1</span>	18.09.2018	100,05 / 100,15 (8,90 / 8,89)	100,1 (8,89)	

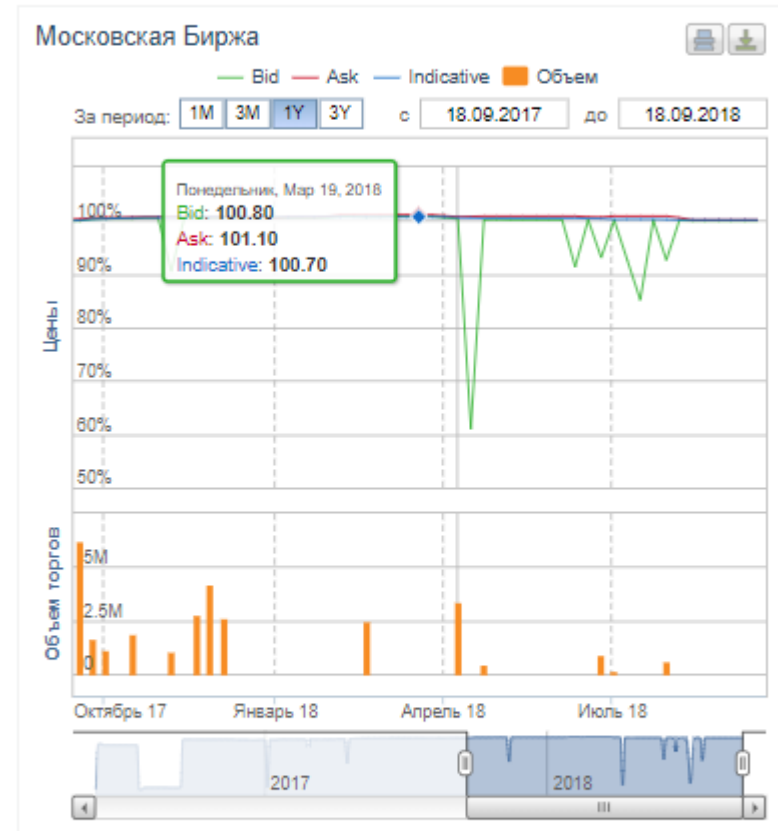
## Котировки участников рынка

Участник рынка	Дата и время	Котировка на покупку/продажу или последняя (Дох-ть)
ДОМ.РФ	19.09.2018 12:33	100,00 / 100,15
ВТБ Капитал	18.09.2018	100,00 / 100,00

**Облигации: Ипотечный агент  
Абсолют 2, класс А  
(4-02-81210-Н, RU000A0JUCP7,  
ИААбсолют2)**

<http://ru.cbonds.info/emissions/issue/52439>

## График архивных значений торгов облигациями



## Биржевые и внебиржевые котировки

Торговая площадка	Дата и время	Котировка на покупку/ продажу (Дох-ть)	Индикативная цена (Дох-ть)	Архив
Московская Биржа	19.09.2018 09:45	- / - / -	100,14 (8,14)	
Московская Биржа	18.09.2018	100,00 / 100,15 (8,9 / 8,89)	100,14 (8,89)	Архив
Ценовой центр НРД	18.09.2018	- / - / -	100,36 (-)	Архив

# Поставщики котировок по ипотечным бумагам на сайте Cbonds

- Московская биржа
- Ценовой центр НРД
- ДОМ.РФ
- ВТБ Капитал
- Внешэкономбанк
- РОНИН



# Котировки по ипотечным бумагам на 14.09.2018

Эмиссия	Московская биржа				ЦС НРД		ДОМ.РФ		Внешэкономбанк	
	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask		
ВТБ, 2-ИП, класс Б	65	4,62			90,33	3,32				
ВТБ, 3-ИП, класс Б	65	4,62			90,23	3,32				
ВТБ, 4-ИП, класс Б	61	4,92			87,46	3,43				
ВТБ, 5-ИП, класс Б	61	4,92			87,65	3,42				
ДельтаКредит, 13-ИП	70	13,79			102,12	9,44	101,65		101	103
ДельтаКредит, 14-ИП	108,75	11,03	110	10,91	108,55	11,05	108			
Ипотечный агент Абсолют 2, класс А	100	8,90	100,15	8,89	100,37	8,87	100	100,2	100	100
Ипотечный агент АИЖК 2010-1, класс А2	99,96	9,00			103,06	8,73	100,05	100,2	99	100
Ипотечный агент АИЖК 2011-1, класс А2/11	70,01	4,29			92,5	3,24				
Ипотечный агент АИЖК 2011-1, класс А2/12	71,01	3,32			89,34	3,36				
Ипотечный агент АИЖК 2011-1, класс А2/13	71,01	4,22			88,54	3,39				
Ипотечный агент АИЖК 2012-1, класс А2	99,96	9,00			100,75	8,93	99,95	100,3		
Ипотечный агент АИЖК 2013-1, класс А2	99,31	9,06			100,66	8,94	99,35	100,1		
Ипотечный агент АИЖК 2014-1, класс А3	98,16	8,66	102,99	8,25	99,38	8,55	98,2	100		
Ипотечный агент АТБ 2, класс А	99,9	9,01	100,9	8,92	100,5	8,96	100,1	100,2	96	97
Ипотечный агент АТБ, класс А	100	8,75	101	8,66	100,09	8,74	100	100,05		
Ипотечный агент Возрождение 3, класс А	61	14,75			100,56	8,95	100	100,3	100	101
Ипотечный агент МКБ, класс А	63,21	16,85			101,26	10,52	100,45	100,95	100	101
Ипотечный агент МТСБ, класс А					101,49	10,34	100,65	101,15	102	102
Ипотечный агент Петрокоммерц-1, класс А	60	14,58			100,39	8,72	100	100,1	100	101
Ипотечный агент ПСБ 2013, класс А	95	8,95			100,12	8,49	99,95	100	100	100
Ипотечный агент ПСПб, класс А	65	13,08			100,07	8,49	99,05	100	98	99
Ипотечный агент Райффайзен 01, класс А	96,15	8,16			100,02	7,85				

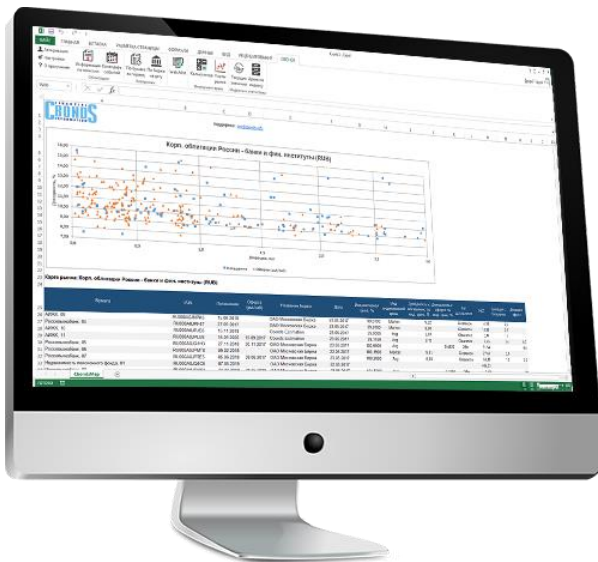




# Надстройка для MS Excel

## **CBONDS** ADD-IN

данные Cbonds  
прямо в Excel



### Информация по облигации

параметры выпуска, котировки участников рынка, денежный поток и оферты



### Информация по акции

параметры бумаги, биржевые котировки, дивиденды



### Биржевые котировки

по каждой из 150 000 бумаг за период по каждой из 150 бирж на дату



### Индексы

250 региональных индексов семейства Cbonds и статистика долговых рынков



### Watchlist

мониторинг избранных эмиссий по 30 параметрам



### Калькулятор

расчет доходности и дюрации, выпуклости и стоимости одного б.п.



### Календарь событий

размещения, выплаты купонов и амортизация, оферты и погашения



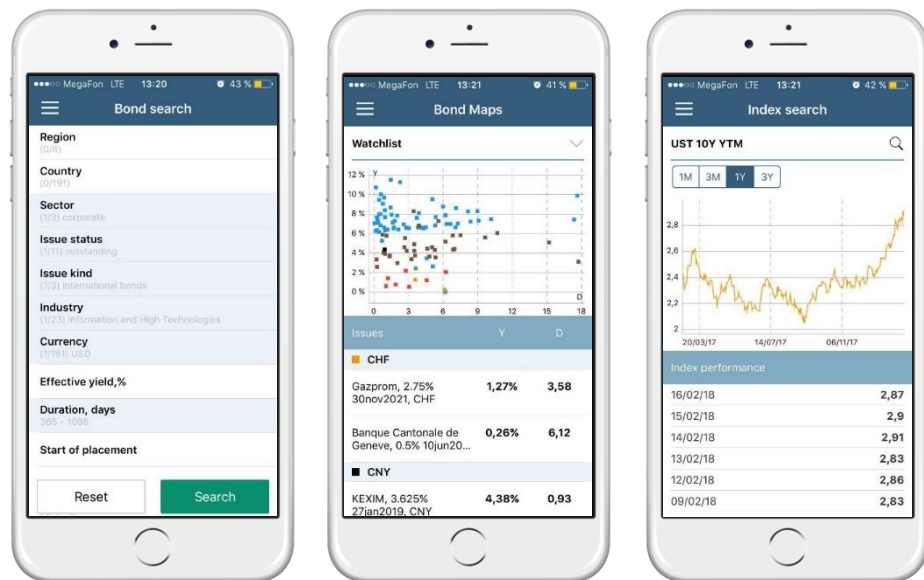
### Карты рынка

130 различных карт по странам, секторам и отраслям

Подробнее: [страница продукта](#), [руководство пользователя](#)



# Мобильное приложение Cbonds



- ✓ Быстрый поиск облигаций и еврооблигаций (более 200 тысяч) по наименованию эмитента/эмиссии
- ✓ Информация по эмиссии: параметров выпуска, графики архивных котировок и доходностей «Cbonds Estimation», биржевых и внебиржевых котировок от участников рынка
- ✓ Расширенный поиск эмиссий облигаций по региону, стране, сектору, отрасли, валюте, эмитенту, по доходности и дюрации, по дате размещения и погашения
- ✓ Watchlist (включая карту рынка по эмиссиям WL на стартовой странице)
- ✓ 130 предустановленных карт рынка по рынкам облигаций и еврооблигаций в координатах Доходность/Дюрация
- ✓ Графики, текущие и архивные значения по более чем 5000 индексам и индикаторам долговых рынков
- ✓ Индексы рынка облигаций Cbonds (IFX-Cbonds, Cbonds-Muni, Euro-Cbonds) и статистика по долговым рынкам (объемы рынков, новые выпуски и др)



## Контакты:

Елена Скурихина

Руководитель группы развития проектов Cbonds

тел.: +7 (812) 336 9721 (доб. 118)

e-mail: sea@cbonds.info

[www.cbonds.ru](http://www.cbonds.ru)

