

Дополнительные ценовые параметры

| Название поля | Формат данных | Описание поля |
|-----------------------------|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Базовые параметры | | |
| val_date | string | Дата оценки |
| name | string | Наименование инструмента |
| issuer | string | Общепринятое наименование эмитента |
| nsd_code | string | Код НРД |
| reg_number | string | Код регистрации инструмента |
| isin | string | Код ISIN |
| type | string | Тип инструмента, соответствует методике оценки |
| industry | string | Сектор экономики |
| coupon_type | string | Текущий тип купона (fix/float) |
| maturity | date | Дата погашения |
| duration | number | Дюрация |
| mod_duration | number | Модифицированная дюрация |
| convexity | number | Выпуклость. Чувствительность дюрации к изменению процентных ставок |
| pvbp | number | Стоимость базисного пункта. Изменение цены облигации (в % от номинала) при изменении ее доходности на один базисный пункт |
| call_option_maturity_date | date | Дата call-опциона (при наличии) |
| put_option_maturity_date | date | Дата put-опциона (при наличии) |
| akra_rating | string | Кредитный рейтинг. АКРА |
| expert_rating | string | Кредитный рейтинг. Эксперт РА |
| ncr_rating | string | Кредитный рейтинг. НКР |
| nra_rating | string | Кредитный рейтинг. НРА |
| Параметры доходности | | |
| current_yield | number | Текущая доходность |
| yield_call | number | Доходность до call-оферты |
| yield_put | number | Доходность до put-оферты |
| yield_maturity | number | Эффективная доходность до погашения |
| Z-spread | number | Z-спред |
| G-spread | number | Спред между YTM и соответствующим по дюрации значением КБД |
| Параметры флоатеров | | |
| base_coupon_index | string | Базовая ставка купона для бумаг с плавающим купоном(для флоатеров) |
| nominal_margin | number | Спред к базовой ставке для бумаг с плавающим купоном (для флоатеров) |
| simple_margin | number | Эффективный простой спред к базовой ставке купона исходя из текущей оценки бумаги (для флоатеров) |
| discount_margin | number | Эффективный спред к базовой ставке купона для бумаг с плавающим купоном (для флоатеров). |

| | | |
|------------------------------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | Разница между номиналом и текущей рыночной ценой, представленная в виде эффективной надбавки к базовой ставке с учетом временной структуры выплат по бумаге |
| Параметры ликвидности | | |
| mode_trade_volume | number | Характерный объем сделки, ед. Главная мода распределения объемов сделок в стакане |
| average_repo_ck_volume | number | Средний объем сделок РЕПО с ЦК с выпуском |
| average_trade_ndm_volume | number | Средний объем сделок в РПС, ед. |
| quantile_005_trade_volume | number | Квантиль 5% распределения объема сделок |
| quantile_025_trade_volume | number | Квантиль 25% распределения объема сделок |
| quantile_050_trade_volume | number | Квантиль 50% распределения объема сделок |
| quantile_075_trade_volume | number | Квантиль 75% распределения объема сделок |
| quantile_095_trade_volume | number | Квантиль 95% распределения объема сделок |
| quantile_005_trade_count | number | Квантиль 5% распределения кол-ва сделок |
| quantile_025_trade_count | number | Квантиль 25% распределения кол-ва сделок |
| quantile_050_trade_count | number | Квантиль 50% распределения кол-ва сделок |
| quantile_075_trade_count | number | Квантиль 75% распределения кол-ва сделок |
| quantile_095_trade_count | number | Квантиль 95% распределения кол-ва сделок |
| Рыночные параметры | | |
| market_price_3 | number | Рыночная цена 3 |
| legal_close_price | number | Цена аукциона закрытия на дату оценки |
| wa_price | number | Средневзвешенная цена основой сессии на дату оценки |
| evening_session_last_price | number | Цена последней сделки во время вечерней сессии на дату оценки |
| evening_session_wa_price | number | Средневзвешенная цена вечерней сессии на дату оценки |