

Задание по Bloomberg. НИС 4 курс

По заданной стране в Эксель сделать файл с выгрузкой данных из Bloomberg и необходимыми расчетами.

Лист 1. «Индекс акций. Облиг. рынок». Представить информацию о дневных котировках фондового индекса с 2016 по 2020 гг. Дать график динамики значений фондового индекса. Показать в таблице по каждому году: годовую доходность индекса, среднюю и медианную дневную доходность за год, волатильность дневной доходности, волатильность годовой доходности.

Показать объем обращающихся корпоративных облигаций в национальной валюте на сентябрь 2020 гг. Показать объем размещений корпоративных облигаций в национальной валюте за 2018-2020 гг. по каждому году.

Лист 2. Макропоказатели. Выгрузить макропоказатели за 2014-2020 гг:

Темп роста реального ВВП; Темп инфляции; Уровень безработицы; Приток ПИИ (% ВВП).

Лист 3. Крупнейшие нефинансовые компании. Найти 10 крупнейших по рыночной капитализации компаний реального сектора. Показать их название, отраслевую принадлежность, рыночную капитализацию.

Для крупнейшей нефинансовой компании выгрузить данные по дневной доходности акций за 2016-2020 гг. Для каждого года в отдельности показать годовую доходность акций, среднюю дневную доходность, волатильность дневной доходности, волатильность годовой доходности. Рассчитать значение бета-коэффициента по отношению к фондовому индексу страны за 2016-2020 гг. на основе месячных данных. Выгрузить дневные данные по бид-аск спреду за 2016-2020 гг.

Лист 4. Облиг. займы. Для крупнейшей нефинансовой компании найти 3 обращающихся облигационных выпуска. Для каждого облигационного выпуска должны быть заполнены следующие поля:

- Issuer Name;
- ISIN;
- Идентификатор в базе Bloomberg;
- Issue Date;
- Maturity (Date);
- Coupon;
- Principal Currency;
- Country of Risk;
- Yield to Maturity, на текущую дату;
- Duration to Maturity, на текущую дату;
- Amount Outstanding;

Для каждого облигационного выпуска выгрузить историческую доходность к погашению (дневные данные) за июнь 2020 года.

Примечание. Если у крупнейшей компании нет обращающихся облигационных займов, следует рассмотреть вторую, третью и т.д. крупнейшие компании.

Лист 5. Фин показатели. Для топ-3 крупнейших по капитализации нефинансовых компаний выгрузить следующие финансовые показатели за 2018-2019 гг. и прогноз на 2020 г.:

Total Revenue; EBITDA; ROE; Total assets.

Также необходимо показать текущие значения рыночных мультипликаторов.