

Подсказки по выполнению заданий

Блок 1. Макроэкономические показатели

Задание А. Найти и выгрузить из базы один из следующих макроэкономических показателей по данной стране в период с 2011 по 2021 год:

Темп роста реального ВВП. Темп инфляции. Уровень безработицы. Приток ПИИ в страну.

Возможный алгоритм выполнения

1. В командной строке указать ECST.
2. В поле страны выбрать страну, например, Russia.
3. В панели слева со списком показателей выбрать показатель:
 - a) National Accounts → Real GDP (by Expenditure, by Industry)
 - b) Prices → Consumer Prices,
 - c) Labor Market → Unemployment Rate,
 - d) Intl Trade & BoP → Foreign Direct Investment,
4. В полях Range выбрать период 2011-2021.



5. Для экспорта можно выбрать строку с показателем и нажать правую клавишу мыши. Из появившегося меню выбрать GP – Price Graph.



6. Появится график, следует выбрать пункт меню Edit→Copy Data to Clipboard. Далее вставить скопированные данные в Excel.



Блок 2. Финансовые показатели и рыночные мультипликаторы по компаниям. Поиск аналогов

Задание А. Найти и выгрузить из базы один из следующих показателей / коэффициентов по заданной компании. Необходимо найти исторические (с 2011 по 2020) значения заданного показателя: Выручка. Чистая прибыль. EBIT. EBITDA. Активы. Долгосрочный долг. ROE. ROA. D/EBITDA. FCF. Рыночная капитализация. Enterprise Value.

Примечание. По ряду компаний могут быть доступны не все из перечисленных выше прогнозных показателей (например, может не быть долгосрочного долга и т.д.).

Задание Б. Найти и выгрузить из базы один из следующих показателей / коэффициентов по заданной компании. Необходимо найти прогнозные (с 2021 по 2023) значения заданного показателя: Выручка. Чистая прибыль. EBIT. EBITDA. Активы. ROE. ROA. FCF. Рыночная капитализация. Enterprise Value.

Задание В. По заданной компании найти 2 компании-аналога из развивающихся стран (подбор аналогов произвести автоматически из карточки заданной компании в базе Bloomberg). Выгрузить для них текущие и будущие (следующего года) значения одного из следующих мультипликаторов: P/E; EV/EBITDA; EV/Sales.

Возможный алгоритм выполнения

1. Пусть дана компания GAZPROM. В командной строке начинаем набирать ее название.
2. Выбираем пункт GAZP RM Equity. Появляется меню:



Задание А - продолжение.

3. Выбираем пункт Company Analysis → Financial Analysis. Отображается финансовая отчетность и ряд расчетных финансовых показателей.

	2010 Y	2011 Y	2012 Y	2013 Y	2014 Y	2015 Y	2016 Y	2017 Y	2018 Y	2019 Y*
In Millions of USD										
12 Months Ending	12/31/2010	12/31/2011	12/31/2012	12/31/2013	12/31/2014	12/31/2015	12/31/2016	12/31/2017	12/31/2018	12/31/2019
Market Capitalization	145695.325	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000	122,000.000
- Cash & Equivalents	20947.699	21991.377	19778.647	26829.369	21471.734	22040.069	19642.386	20296.960	18642.754	29996.744
+ Preferred & Other	9386.278	9258.210	10119.022	9568.924	5209.576	4457.127	5672.891	6711.742	6865.445	8234.016
+ Total Debt	41007.794	47942.786	49107.159	54779.172	46159.276	47202.125	46218.753	56739.934	55711.837	66268.393
Enterprise Value	175141.690	157763.844	147652.598	134436.705	81297.656	72498.032	88106.718	93312.324	92908.042	142223.143
Revenue, Adj	118497.019	158100.583	153654.385	164932.740	148037.452	100200.843	91722.794	112253.889	131537.646	118436.057
Growth %, YoY	20.263	28.914	2.791	10.143	6.473	8.650	0.621	7.120	25.634	-6.865
Gross Profit, Adj										
Margin %										
EBITDA, Adj	45355.116	66117.526	53062.767	63116.442	50667.015	30925.463	20644.556	25054.929	41604.923	27314.183
Margin %	38.275	41.820	34.534	38.268	34.226	30.863	22.508	22.320	31.630	23.062
Net Income, Adj	30290.935	44721.268	38160.960	35942.791	7249.218	14593.085	15210.953	11926.892	23589.189	18719.984
Margin %	25.563	28.287	24.836	21.792	4.897	14.564	16.584	10.625	17.933	15.806
EPS, Adj	1.323	1.953	1.666	1.570	0.315	0.634	0.673	0.540	1.067	0.832
Growth %, YoY	42.050	47.639	-14.669	-5.813	-79.919	101.306	6.079	-19.816	97.768	-22.035
Cash from Operations	45379.658	53356.394	45242.616	53011.432	48882.481	31625.363	22626.133	18882.009	24470.114	25072.616
Capital Expenditures	-34347.544	-52953.223	-43490.507	-43894.235	-33425.815	-27074.490	-20548.556	-24106.451	-26221.779	-27460.009
Free Cash Flow	11032.114	403.171	1752.110	9117.197	15456.665	4550.873	2077.577	-5224.442	-1751.665	-2387.393

4. Выбираем требуемый финансовый показатель:

- ✓ Зкладка Key Stats → Revenue, Adj (либо закладка I/S → Revenue).
- ✓ Зкладка Key Stats → Net Income, Adj (либо закладка I/S → Net Income).
- ✓ EBIT (зкладка I/S → EBIT).
- ✓ Зкладка Key Stats → EBITDA, Adj (либо закладка I/S → EBITDA).
- ✓ Активы (зкладка B/S → Total Assets).
- ✓ Долгосрочный долг (зкладка B/S → LT Debt).
- ✓ ROE (зкладка Ratios → Return on Common Equity).
- ✓ ROA (зкладка Ratios → Return on Assets).

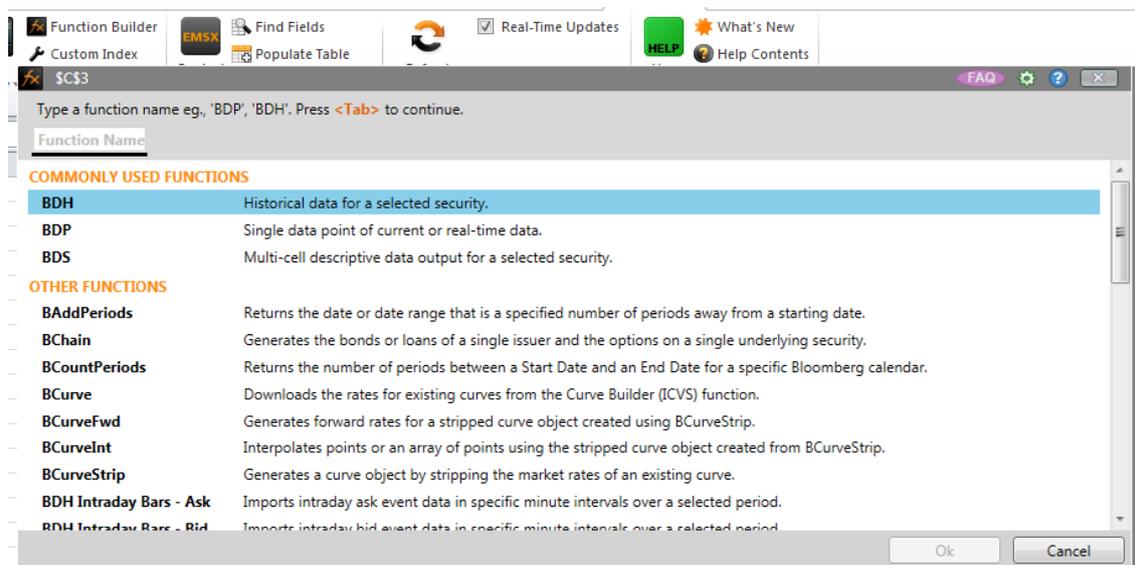
5. Для экспорта в Эксель выбираем пункт верхнего меню Export → Excel → Current Template (выгружаются данные за последние 10 лет, вся вкладка).

Либо кликаем на показателе, отображается его график непосредственно. Затем правой кнопкой мыши Copy / Export Option → Copy Data to Clipboard, далее вставка в Эксель.

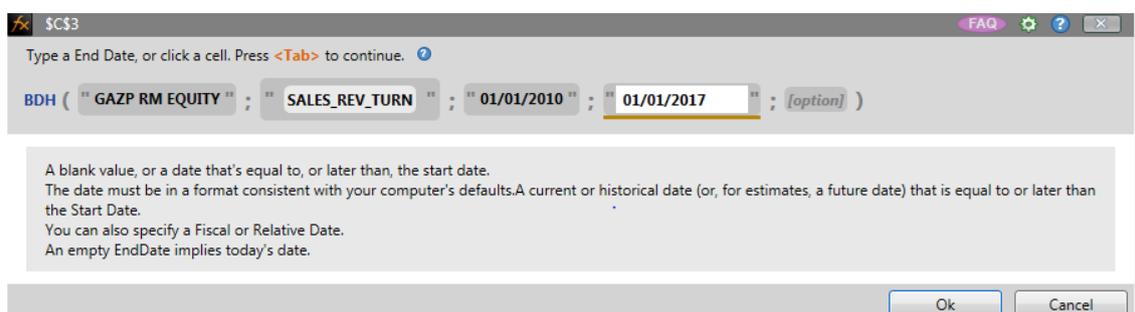


6. Если необходимо выгрузить данные за более ранние периоды, не отображаемые на вкладке в терминале, в Эксель:

- ✓ В Эксель переходим на закладку Bloomberg. Вызываем Function Builder. Выбираем функцию BDH – исторические данные.



- ✓ Вводим название компании (в формате GAZP RM Equity). Выбираем финансовый показатель (например, SALES_REV_TURN для выручки) и даты начала и окончания периода. Нажимаем ОК.



Можно также задать период выгрузки показателя (например, для выгрузки годовых или квартальных показателей), для этого в поле option указать «Period = Y» или «Period = Q»:

The screenshot shows the Microsoft Excel interface with a Bloomberg data table and a dialog box for overriding the Period parameter.

The data table contains the following information:

	A	B	C	D
1	31.03.2010	12,4841		
2	30.06.2010	12,0277		
3	30.09.2010	11,4652		
4	31.12.2010	11,0068		
5	31.03.2011	12,3055		
6	30.06.2011	13,6504		
7	30.09.2011	13,2051		
8	31.12.2011	12,9815		
9	31.03.2012	11,647		
10	30.06.2012	9,9571		
11	30.09.2012	11,163		
12	31.12.2012	10,714		
13	31.03.2013	10,6663		
14	30.06.2013	10,762		
15	30.09.2013	10,2597		
16	31.12.2013	8,973		
17	31.03.2014	7,5647		
18	30.06.2014	7,6507		
19	30.09.2014	6,217		
20	31.12.2014	1,1114		
21				

The dialog box shows the following information:

Type an override, or click a cell. Press <Tab> to continue.

BDH ("GAZP RM EQUITY" ; "RETURN_ON_ASSET" ; "01/01/2010" ; "01/01/2020" ; "Period" = "Y" ; [option])

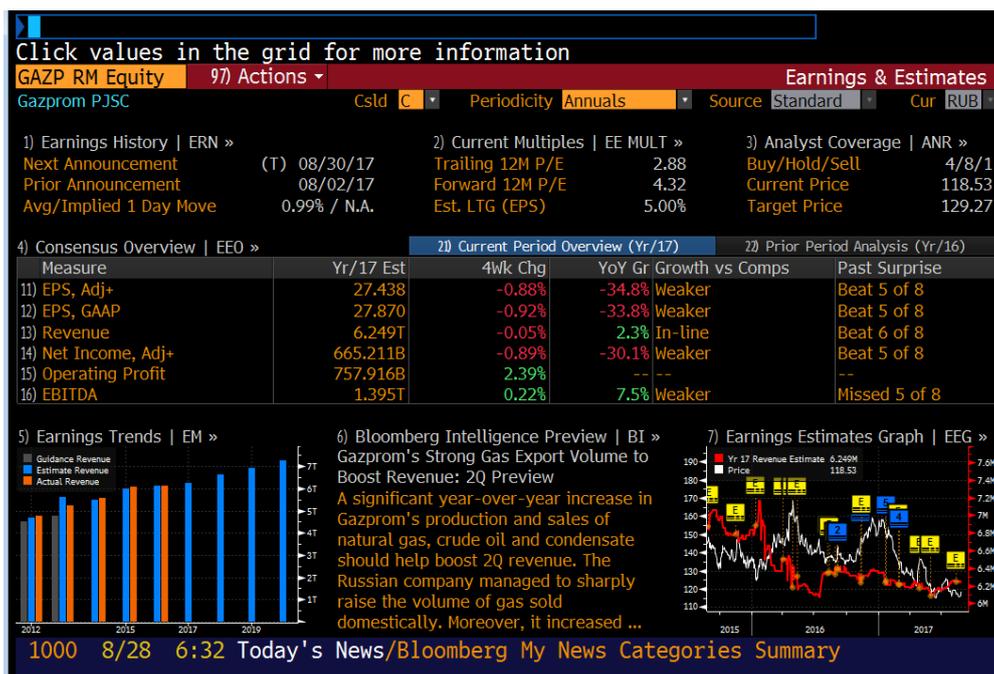
Function Overrides Field Overrides Both (Ctrl-Tab to toggle)

Name	Description
Period	Periodicity. The base periods are D (Daily), W (weekly), M (monthly), Q (quarterly), S (semi), Y (Yearly)

Buttons: Ok, Cancel

Задание Б – продолжение.

- В основном меню в карточке компании (акции) выбираем пункт меню Research and Estimates-Earnings and Estimates.



- Нажимаем «4) Financials / MOFD >>>».

Print Failed: rc=-2 err=1223

GAZP RM Equity Actions Export Settings Consensus Overview

Gazprom PJSC Cslid C Periodicity Annuals Source Standard Cur RUB

1) Values 2) Growth 3) Oil & Gas

	FY 2019 Act	FY 2020 Est	FY 2021 Est	FY 2022 Est	FY 2023 Est
12 Months Ending	12/31/2019	12/31/2020	12/31/2021	12/31/2022	12/31/2023
20) Net Debt	2.250T	3.778T ↑	4.095T ↑	4.158T ↑	3.831T ↑
21) BPS	596.525	653.426	688.686	734.903	678.480 ↓
22) CPS	72.068	52.803	62.915 ↑	77.864 ↑	72.430 ↑
23) DPS	15.240	8.379	15.739	23.196	22.050 ↑
24) Return on Equity %	8.779	2.162 ↓	5.070 ↓	6.936 ↓	8.000
25) Return on Assets %	5.635	1.800	4.700	5.200	1.500
26) Depreciation	715.229B	801.939B	781.911B	809.467B	583.781B ↑
27) Free Cash Flow	-154.400B	-195.934B	22.848B ↓	386.858B ↑	-1.386T
28) CAPEX	-1.776T	-1.244T ↓	-1.233T	-1.456T ↓	-1.386T
29) Net Asset Value		14.992T	16.083T	16.943T	

Current Multiples

	Last 4 Qtrs Act	Next 4 Qtrs Est	FY 2020	FY 2021	FY 2022
Price/EPS, Adj+	9.84	5.18	11.39	5.02	3.54
Price/Book	0.30	0.27	0.27	0.26	0.24
Price/Cash Flow	3.78	2.83	3.35	2.81	2.27
EV/Revenue	1.20	1.21	1.06	0.98	
EV/EBITDA	7.07	4.27	6.25	4.45	3.48
EV/EBIT	23.17	9.90	18.65	8.45	6.00
EV/OPP	23.17	16.37	16.37	8.09	5.57
Dividend Yield		4.73	8.89		13.10

*Period Notes << < More Periods > >> Reported, Estimated

Suggested Functions DES Study in-depth information on a security EQRV See who's trading rich or cheap

- Делаем выгрузку в Эксель – выбираем в меню Export.

Задание В. - продолжение.

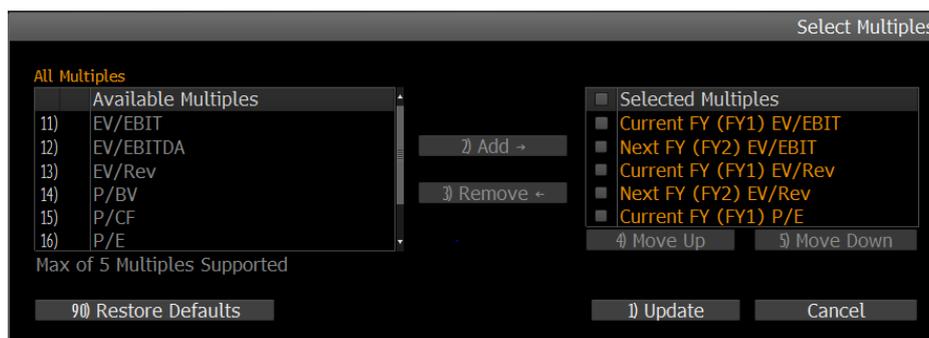
- В основном меню в карточке компании (акции) выбираем пункт Comparative Analytics → Equity Relative Valuation. Отображается следующая закладка:



- В поле Region выбираем Global (Emerging).
- При необходимости выбираем фильтр по рыночной капитализации для поиска аналогов в поле Mkt Cap (поле доступно, если в поле Comp Source выбрано BICS Best Fit (Algo)).
- Настраиваем список мультипликаторов для отображения. Для этого выбираем пункт меню Settings → Select Multiples for (GAZP RM...).

С помощью кнопок Add и Remove в блоке Selected Multiples выбираем текущие значения мультипликаторов (вида Current FY EV/EBIT или P/E) и значения будущего года (вида Next FY EV/EBIT или P/E).

Нажимаем кнопку Update.



- После отображения требуемых мультипликаторов осуществляем выгрузку в Эксель с помощью пункта меню Export to Excel → vs Comps Current Multiples.

Блок 3. Финансовые инструменты

Задание А. По заданной компании найти и выгрузить доходность ее акций за 2016-2021 гг. Выгрузить или рассчитать бета-коэффициент (на основе месячных и недельных данных за 2016-2021 гг.) по отношению к фондовому индексу страны.

Возможный алгоритм выполнения

1. Пусть дана компания GAZPROM. В командной строке набираем GAZP RM Equity, нажимаем Enter. Появляется меню компании.
2. Выбираем пункт Charting and Reporting – Line Chart. Отображается закладка с графиком цены акции.

Выбираем период, за который нужно отобразить цену акции, например 01/01/2016-09/01/2021.

Выбираем поле Last Price для отображения цены (можно выбрать Percent Change для отображения доходности).

Указываем валюту.

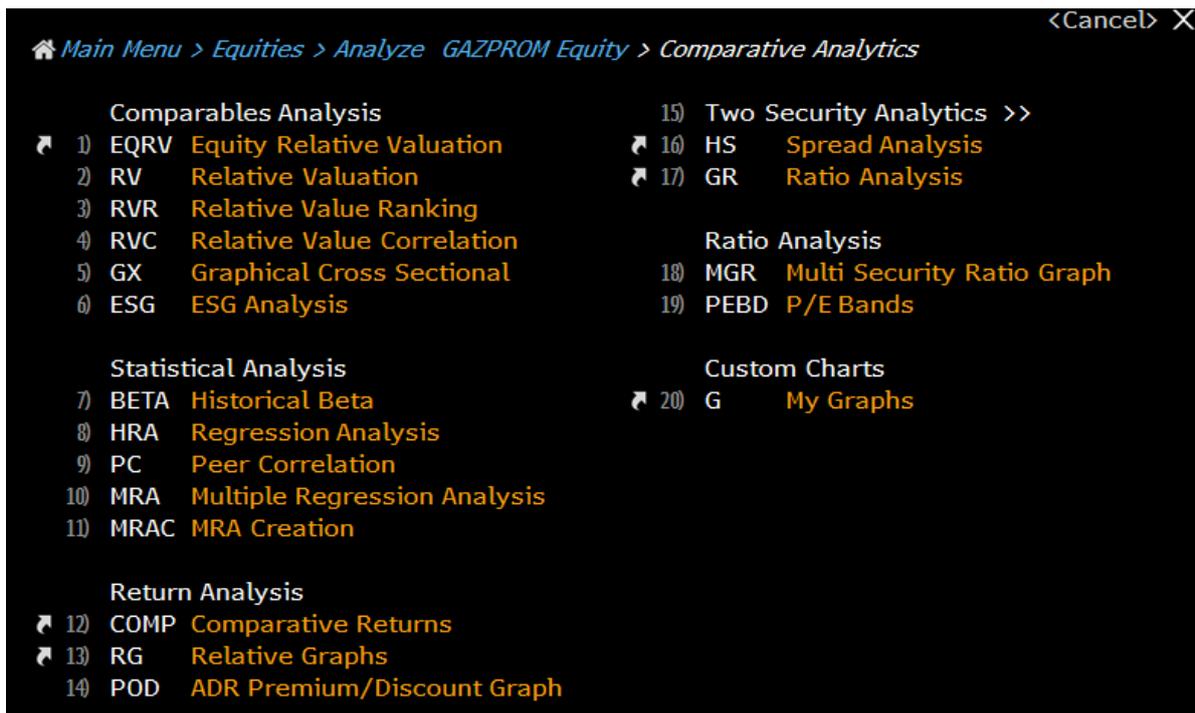
Задаем период отображения – например, Weekly или Monthly.



3. Далее выделяем правой кнопкой мыши график цены. Выбираем пункт меню Edit → Copy Data to Clipboard и вставляем в Эксель. Доходность можно рассчитать вручную в Эксель.



- Чтобы рассчитать значение бета-коэффициента по отношению к индексу страны, в основном меню для компании выбираем пункт Comparative Analytics → Statistical Analysis → Historical Beta.

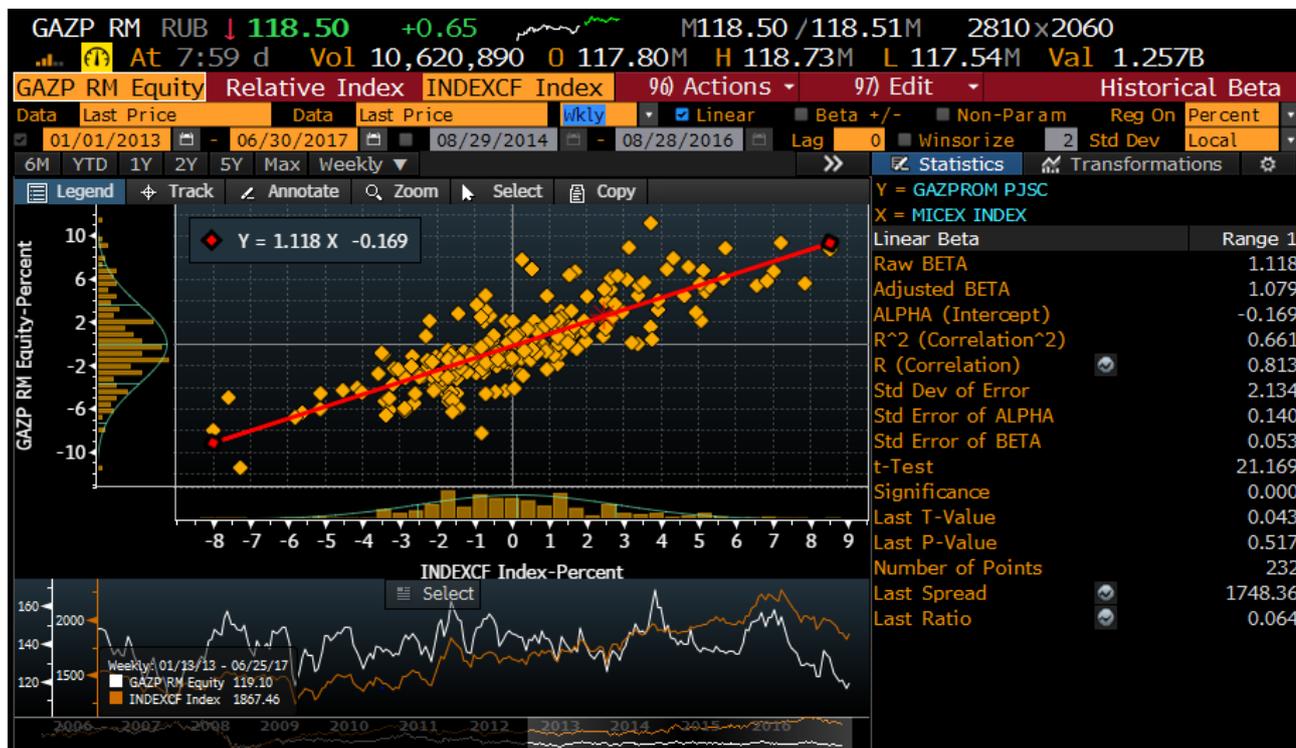


- На закладке расчета бета-коэффициента указываем период расчета, например, 01/01/2016-09/01/2021.

Выбираем интервал расчета, например Wkly или Monthly.

При необходимости выбираем требуемый фондовый индекс.

Получаем график регрессии и статистику по расчету бета.



Задание Б. Для заданной страны (и биржи) найти три крупнейшие по рыночной капитализации компании. Выгрузить или рассчитать бета-коэффициенты (на основе месячных данных за 2016-2021 гг.) по отношению к фондовому индексу страны.

Возможный алгоритм выполнения.

1. В командной строке указать функцию EQS для работы со списком акций.



2. Выбрать страну (и конкретную биржу) в поле Exchanges. Нажать Update.



3. Далее нажать кнопку See Results. Отобразится список компаний, отсортированных по величине рыночной капитализации.

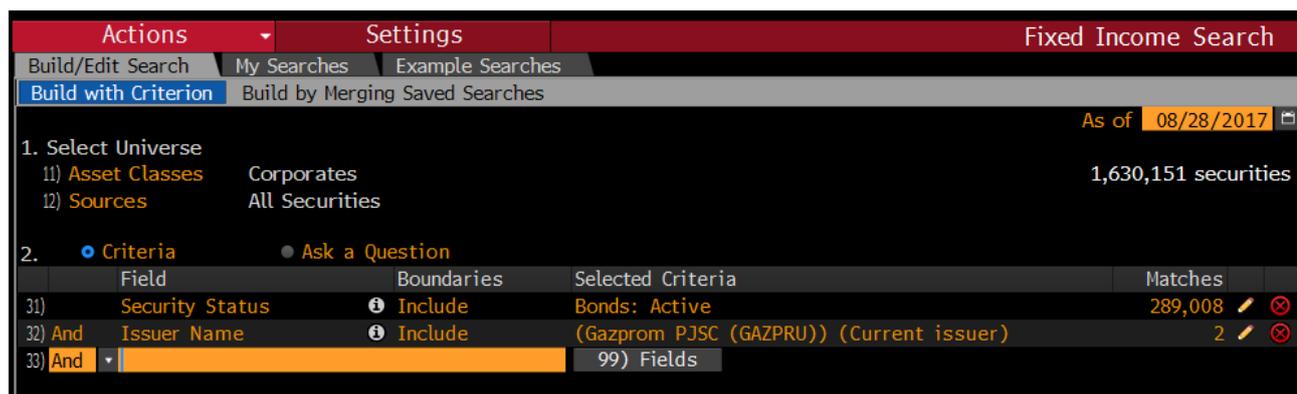
При необходимости можно этот список выгрузить в Эксель, выбрав Actions → Output → Excel (All Securities), но тогда лучше ограничить список, задав на предыдущем шаге фильтр по капитализации.

4. Далее для трех крупнейших компаний найти бета (по аналогии с заданием А).

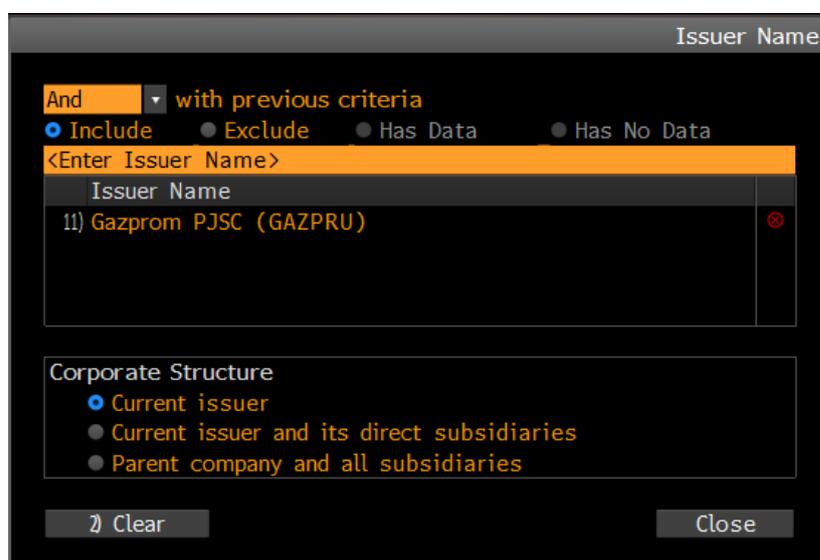
Задание В. По заданной компании найти и выгрузить данные (ISIN, объем, валюта, дата погашения, ставка купона) по ее обращающимся облигациям в национальной валюте (можно ограничиться выгрузкой данных по 10 крупнейшим по объему облигациям). Выгрузить историческую доходность к погашению по 3 крупнейшим по объему облигациям за 2016-2020 гг.

Возможный алгоритм выполнения.

1. В командной строке указать функцию SRCH для работы со списком облигаций.



2. Задаем параметры фильтрации: Asset Classes = Corporates, Security Status = Active, Issuer Name = Название эмитента (например, GAZPRU для Газпром), Currency = Национальная валюта. Ниже показан интерфейс выбора эмитента:

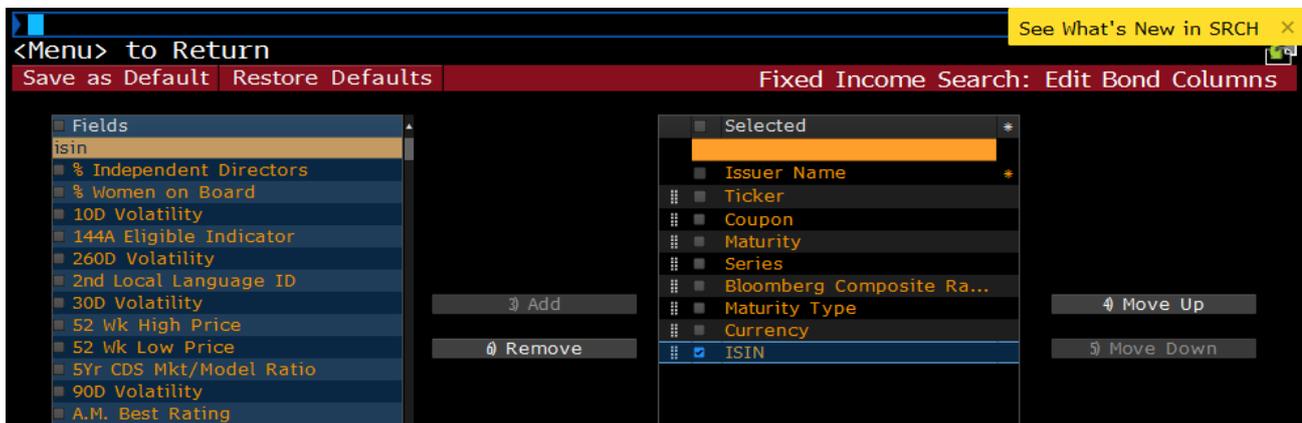


3. После задания параметров фильтрации данных по облигациям нажимаем кнопку Results. Появляется список облигаций эмитента.

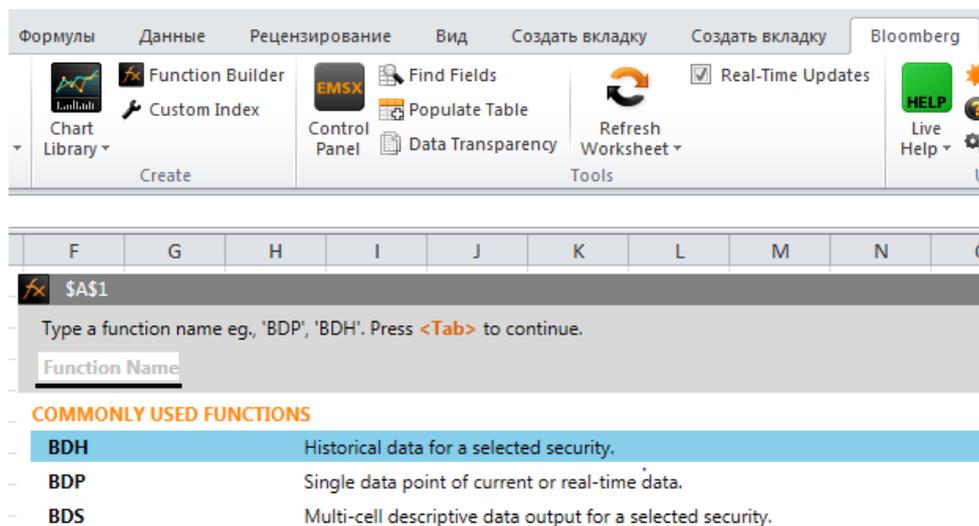
The screenshot shows the 'Fixed Income Search: Results' window. The search name is 'Unsaved Search' and the currency is 'USD'. The results are displayed in a table with columns: Issuer Name, Ticker, Cpn, Maturity, Series, BBG Composite, Maturity Type, and Curr. The table shows two rows for 'Gazprom PJSC' with a 5.100 coupon and maturity of 10/21/2043. The first row has series 'B019' and the second has series 'A20'. Both are 'AT MATURITY' in 'RUB'.

	Issuer Name	Ticker	Cpn	Maturity	Series	BBG Composite	Maturity Type	Curr
Average			5.100					
31)	Gazprom PJSC	GAZPRU	5.100	10/21/2043	B019		AT MATURITY	RUB
32)	Gazprom PJSC	GAZPRU	5.100	10/21/2043	A20		AT MATURITY	RUB

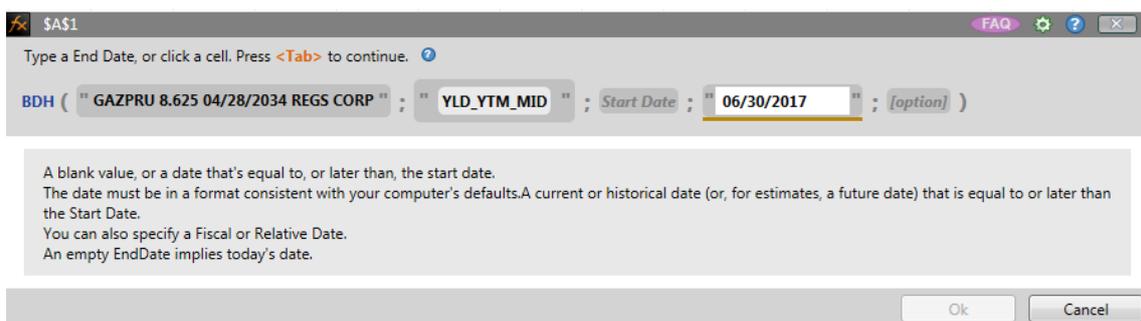
4. В списке можно настроить отображаемые столбцы, выбрав пункт меню Settings→Edit Columns (для возврата в список облигаций нажать <Menu> to Return).



- Для выгрузки списка облигаций в Эксель нажать Actions → Export to Excel.
- В Эксель для выгрузки исторической доходности к погашению нужно перейти на закладку Bloomberg. Выбрать Function Builder и функцию BDH.



- В функции BDH выбрать тикер требуемой облигации, поле YLD_YTM_MID (доходность к погашению), задать даты начала и окончания периода (Start Date и End Date). Нажать OK.



Задание Г. Для заданной страны найти и выгрузить объем новых размещений корпоративных облигаций в национальной валюте по годам за период с 2018 по 2020 гг. Выгрузить историческую доходность к погашению по 3 крупнейшим по объему корпоративным облигациям в национальной валюте за 2018-2020 гг.

Возможный алгоритм выполнения.

- В командной строке указать функцию SRCH для работы со списком облигаций.
- Задаем параметры фильтрации: Asset Classes = Corporates, Security Status = All (т.е. включая Matured and Active), Country of Risk = Страна, Currency = Национальная валюта, Issue Date In the Range of 01/01/2018-12/31/2020.

После задания параметров фильтрации нажимаем кнопку Results.



3. Далее см. описание выполнения задания В. Находим крупнейшие выпуски и выгружаем YTM.

Задание Е. Для заданной страны найти и выгрузить значения фондового индекса, выгрузить (или рассчитать) его недельную доходность за 2018-2020 гг. Выгрузить значения мультипликатора P/E для фондового индекса за 2018-2020 гг.

1. Выбираем индекс, вводя в командную строку его название или тикер (например, Russian RTS \$ или S&P 500, SPX). Отображается карточка индекса.
2. Чтобы в интерфейсе посмотреть историю котировок индекса, переходим к основному меню (можно сделать через Related Functions Menu):



3. Далее в меню выбираем Charts, Tables and Technicals → Line Chart.



4. Можно задать период, выбрать валюту и выгрузить данные в Эксель (выделить график мышью, затем выбрать пункт меню Edit → Copy Data to Clipboard).
5. Если в основном меню карточки индекса выбрать пункт Multiple Index Analysis → Ratio Analysis, то можно посмотреть и выгрузить в Эксель исторические данные по P/E (либо воспользоваться вкладкой GP – Line Chart, и вместо Last Price указать P/E).



Задание Ж. По заданной компании найти и выгрузить дневную доходность ее акций, объем торгов и bid-ask спред за 2016-2021 гг.

Возможный алгоритм выполнения

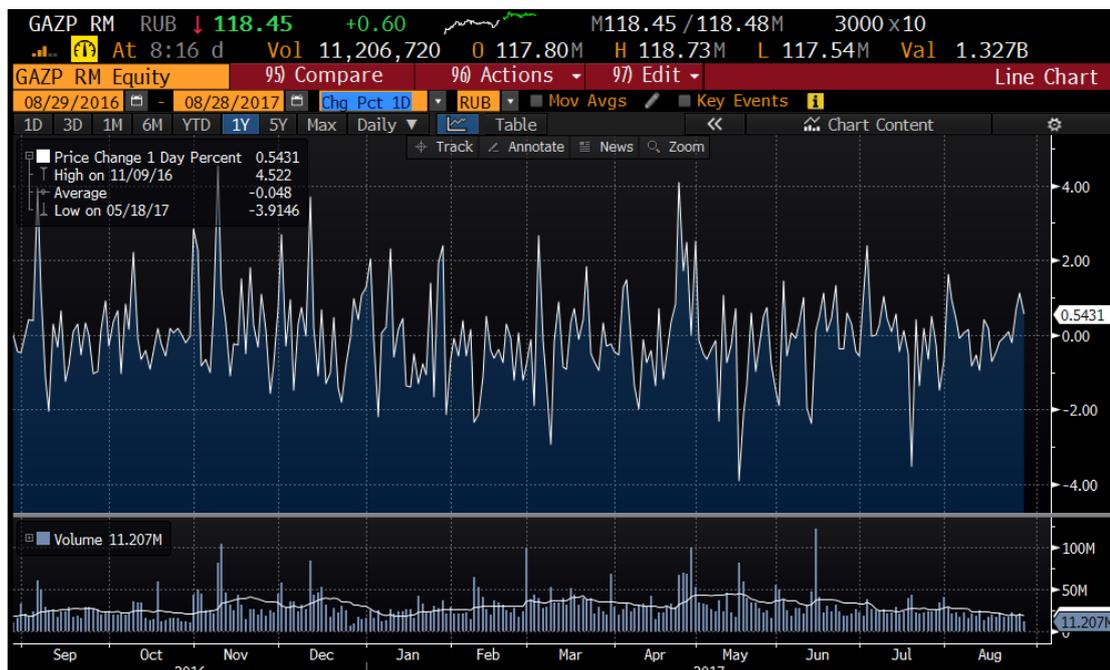
1. Пусть дана компания GAZPROM. В командной строке набираем GAZP RM Equity, нажимаем Enter. Появляется меню компании.
2. Выбираем пункт Charting and Reporting – Line Chart. Отображается закладка с графиком цены акции.

Выбираем период, за который нужно отобразить цену акции, например 01/01/2016-12/31/2021.

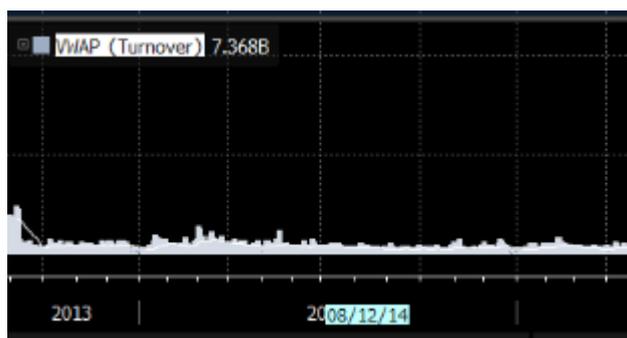
Выбираем поле Last Price для отображения цены (либо Bid Price и Ask Price для отображения цен Bid и Ask). Либо для отображения доходности можно выбрать Find Field → Price Change 1 Day Percent. Объем торгов отображается автоматически в низу страницы.

Указываем валюту.

Задаем период отображения – Daily.



3. Далее выделяем правой кнопкой мыши график. Выбираем пункт меню Edit→Copy Data to Clipboard и вставляем в Эксель. В случае выгрузки цены доходность можно рассчитать вручную в Эксель.
4. Объем торгов при этом также будет выгружен в Эксель. Отметим, что Volume – это объем торгов, измеряемый в количестве ценных бумаг, Number of Trades - количество сделок, VWAP (Turnover) – объем торгов, измеряемый в денежных единицах. По умолчанию отражается Volume. При необходимости можно выбрать другой показатель объема в левой нижней части вкладки:



5. Для выгрузки бид-аск спреда можно последовательно выгрузить в Эксель значения Bid Price и Ask Price, далее найти разность.

Задание 3. Найти и выгрузить данные по рыночной капитализации странового фондового индекса (за 2016-2021 гг.). Выгрузить в Эксель список компаний, входящих в состав данного фондового индекса.

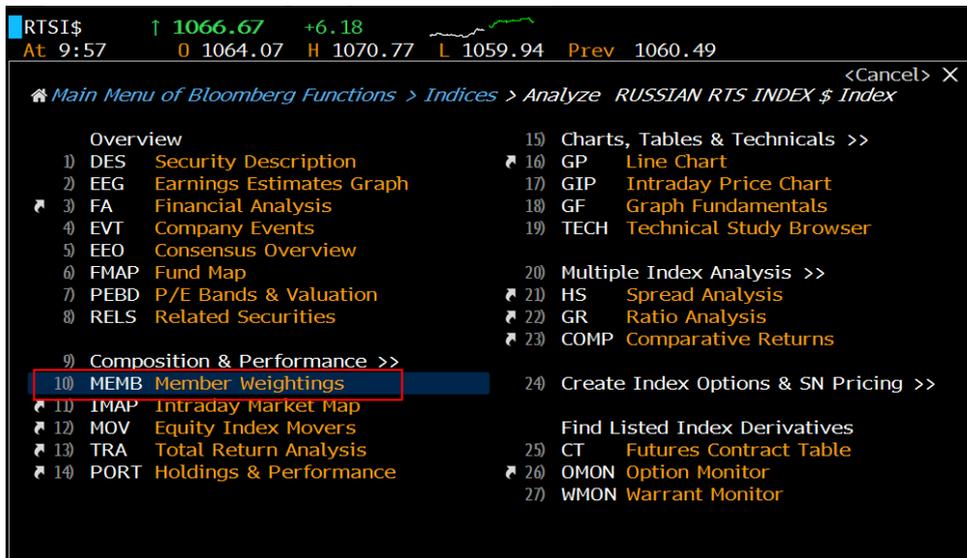
1. Выбираем индекс, введя его название или тикер в командную строку (например, Russian RTS \$). Отображается карточка индекса.
2. Чтобы в интерфейсе посмотреть историю котировок индекса, переходим к основному меню карточки индекса (можно через Related Functions Menu):



3. Выбираем пункт Multiple Index Analysis → Ratio Analysis для просмотра и выгрузки в Эксель исторических данных по рыночной капитализации.



4. Задаем период, выбираем для отображения поле Mkt Cap (Find Field → Market Capitalization) и выгружаем данные в Эксель (выделение графика мышью, затем выбор пункта меню Edit → Copy Data to Clipboard).
5. Для просмотра и выгрузки списка компаний, входящих в состав индекса, следует перейти к основному меню карточки индекса (Index, MEMB, Related Functions Menu).



6. Выбрать пункт меню Composition & Performance → Member Weightings. Далее выгрузить в Эксель список компаний, входящих в состав индекса. Для этого на вкладке Members нажать Output→Excel.

Ticker	Name	Weight (%)	Shares	Price
11) YNDX	RM Yandex NV	--	--	1,739.0000
12) CBOM	RM Credit Bank of Moscow PJSC	--	--	4.6100
13) DSKY	RM Detsky Mir PJSC	--	--	99.2000
14) POLY	RM Polymetal International PLC	--	--	713.9000
15) EPLN	RM SAFMAR Financial investment PJSC	--	--	783.0000
16) RUAL	RM United Co RUSAL PLC	--	--	38.9100
17) GAZP	RM Gazprom PJSC	--	--	118.2900
18) GMKN	RM MMC Norilsk Nickel PJSC	--	--	9,274.0000
19) LKOH	RM LUKOIL PJSC	--	--	2,916.0000
20) CHMF	RM Severstal PJSC	--	--	874.0000
21) ROSN	RM Rosneft Oil Co PJSC	--	--	300.0000

7. Если необходимо найти крупнейшие по капитализации компании в составе индекса, то задаем в командной строке EQS и указываем в критериях фильтрации Indices = Требуемый индекс.

Selected Screening Criteria	Matches
Security Universe	913290
51) Trading Status: Active	257050
52) Indices: MICEX Index	50
53) Add screening criteria	

Блок 4. Отраслевые финансовые показатели и рыночные мультипликаторы

Задание А. Для заданной отрасли и страны найти и выгрузить текущие среднеотраслевые показатели ROA по публичным компаниям.

Возможный алгоритм выполнения.

1. В командной строке указать функцию EQS для работы со списком акций.
2. В критериях фильтрации указываем Sectors = Отрасль и Country of Domicile = Страна. Нажимаем кнопку See Results.



3. Далее выгружаем результаты поиска в Эксель, нажав Export → Excel All Securities (можно ограничить выборку крупнейшими компаниями на предыдущем шаге, задав фильтр по капитализации).



4. В Эксель выгрузится список акций компаний.

Ticker	Name	Market Cap	Price:D-1	P/E	Total Return YTD	Revenue T12M	EPS T12M
---	None (17 securities)						
UKUZ RM Equity	SOUTHERN KUZBASS PJSC	28526282752	790	3,662222385	-8,775981524	27894482944	217,0812988
KBTK RM Equity	KUZBASSKAYA TOPLIVNAYA CO	13598394368	137	13,24481201	69,14924923	30867000320	10,3436729
BLNG RM Equity	BELON OJSC	3415500032	2,970000029		-39,1393451		
UKUZ RU Equity	SOUTHERN KUZBASS PJSC			3,662222385		27894482944	217,0812988
PRUG RU Equity	PRIMORSKUGOL-BRD					4738000000	-83,97286987

5. Далее для каждой компании с помощью функции Functions Builder → BDP можно выгрузить текущие значения ROA, ROE, финансового левериджа (как параметры функции задать ссылку на ячейку с тикером акции и выбрать нужное поле, например, RETURN_ON_ASSETS для ROA). Потом можно вручную рассчитать среднеотраслевые значения.

\$155

Type an override, or click a cell. Press <Tab> to continue. [?](#)

BDP (SAS\$; " RETURN_ON_ASSET " ; " Override Name " = " ")

Function Overrides Field Overrides Both (Ctrl-Tab to toggle)

Name	Description
------	-------------

Блок 5. Риски инвестирования

Задание А. Для заданной компании выгрузить (или рассчитать) недельную доходность ее акций за 2018-2020 гг. Для каждого годового отрезка (2018, 2019, 2020) выгрузить (или рассчитать) волатильность недельной доходности. Найти волатильность годовой доходности.

Возможный алгоритм выполнения.

1. Пусть дана компания GAZPROM. В командной строке набираем GAZP RM Equity, нажимаем Enter. Появляется меню:

GAZP RM RUB ↑ 118.51 +0.66 M118.49 / 118.51 3220x5720
At 7:39 d Vol 10,495,600 O 117.80M H 118.73M L 117.54M Val 1.242B

Main Menu of Bloomberg Functions > Equities > Analyze GAZPROM Equity

- 1) Company Overview >>
- 2) DES Security Description
- 3) CF Company Filings
- 4) CN Company News
- 5) Company Analysis >>
- 6) FA Financial Analysis
- 7) OWN Ownership Summary
- 8) CRPR Credit Rating Profile
- 9) Research & Estimates >>
- 10) EE Earnings & Estimates
- 11) BRC Research Portal: Single Sec
- 12) BICO BI Company Primer
- 13) GNR Legal, Reg, & Govt Analysis
- 14) Comparative Analytics >>
- 15) EQRV Equity Relative Valuation
- 16) RV Relative Valuation
- 17) Charting & Reporting >>
- 18) GP Line Chart
- 19) GF Graph Fundamentals
- 20) Security Surveillance >>
- 21) EVT Company Events
- 22) BQ Bloomberg Quote
- 23) Trade Analytics >>
- 24) IOIA IOI & Advert Overview
- 25) MDM Market Depth Monitor
- 26) VWAP Price and Volume Dashboard
- 27) RANK Broker Rankings
- 28) TP Trading Performance
- 29) Derivatives >>
- 30) OMON Option Monitor

<Cancel> X

MORE

ies
es (BFLP) excep
vides BFLP wi
able sources,
ommodities.
6751000

2. Выбираем пункт Charting and Reporting – Line Chart. Отображается закладка с графиком цены акции.

Выбираем период, за который нужно отобразить цену акции, например 01/01/2018-09/30/2020.

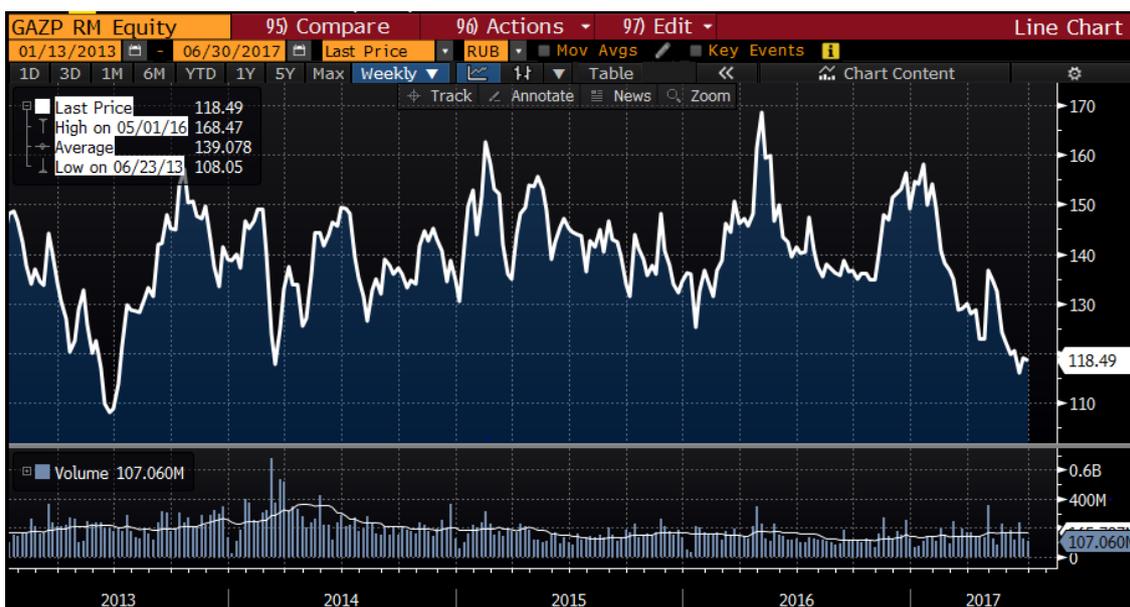
Выбираем поле Last Price для отображения цены.

Указываем валюту.

Задаем период отображения – например, Weekly или Monthly.



3. Далее выделяем правой кнопкой мыши график. Выбираем пункт меню Edit→Copy Data to Clipboard и вставляем в Эксель. Доходность и волатильность можно рассчитать вручную в Эксель.



Задание Б. Найти и выгрузить значения индекса волатильности VIX для заданной развивающейся страны за 2018-2020 гг. Сопоставить с индексом волатильности VIX по США.

Возможный алгоритм выполнения.

1. В командной строке набираем VIX, далее пункт Securities→More Securities (либо можно использовать команду SECF).

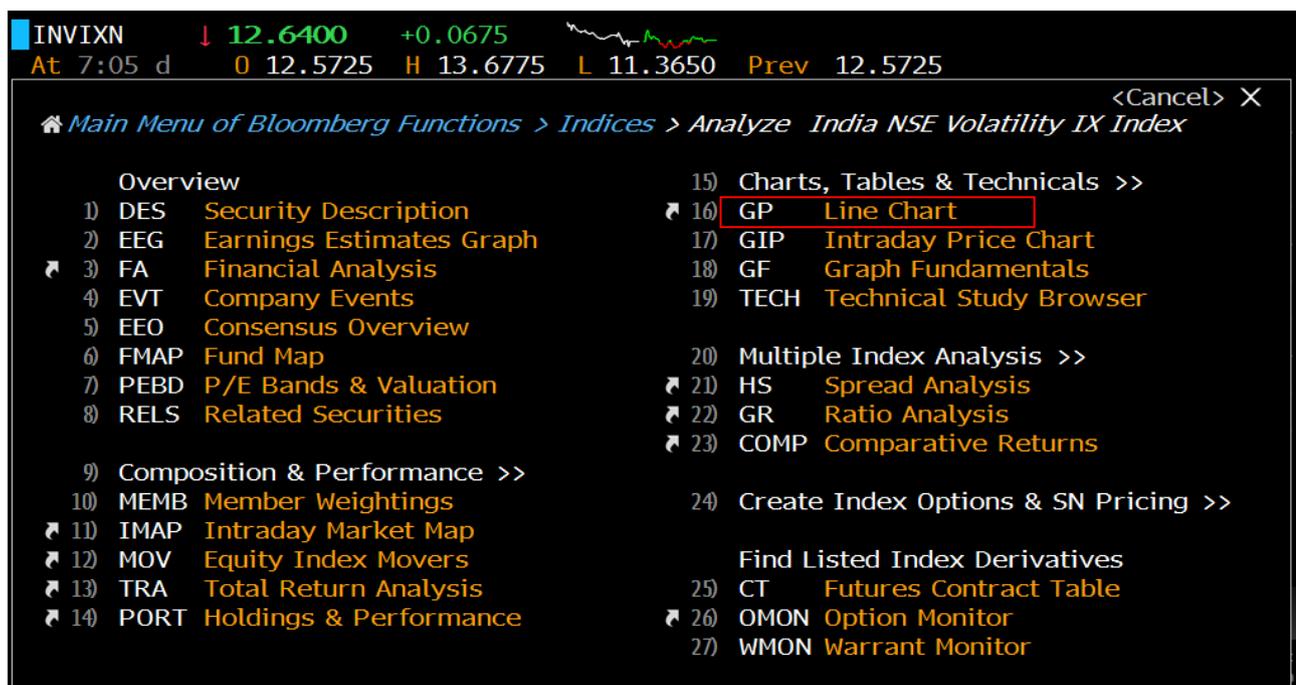


2. В списке различных индексов VIX выбираем параметры сортировки: Category = Index/Stats, Sub-category = Equity Index.



3. Далее для примера можно выбрать India NSE Volatility Index (или другой индекс – по тем странам, где подобный индекс рассчитывается).

4. В командной строке указываем название выбранного индекса. Появляется меню:



5. Выбираем пункт Charts, Tables & Technicals → Line Chart. Отображаются значения индекса.



6. Задаем период отображения значений индекса.

7. Для экспорта выделяем график и выбираем пункт меню Edit → Copy to Clipboard.

Блок 6. Банковский сектор. Процентные ставки

Задание А. Для заданной страны найти и выгрузить средневзвешенные ставки межбанковских кредитов в национальной валюте на срок 1 месяц за 2018-2021 гг. (например, MIBOR 1M для РФ).

Возможный алгоритм выполнения

1. В командной строке набираем SECF для поиска финансовых инструментов.
2. Выбираем параметры сортировки Category = Index / Stats, Sub-Categories = Miscellaneous Indices.

Выбираем уточняющие параметры, например, Moscow или interbank или MIACR в поле Description.

Security	Description	Category	Sub-Category
	interbank	Index/Stats	Miscellaneous In
1) MXIBTIIE Index	Mexico Interbank TIIE 28 Day	Index/Stats	Miscellaneous In
2) RP07 Index	China InterBank Repo Rate 7 Days	Index/Stats	Miscellaneous In
3) STIB3M Index	Stockholm Interbank Offered Rates 3 Month	Index/Stats	Miscellaneous In
4) JIBA3M Index	SAFE South Africa Johannesburg Interbank Agreed Rate 3 Mon...	Index/Stats	Miscellaneous In
5) NIBOR3M Index	Oslo Bors Norway Interbank Offered Rate Fixing 3 Month	Index/Stats	Miscellaneous In
6) BZDIOVRA Index	Brazil Cetip DI Interbank Deposit Rate	Index/Stats	Miscellaneous In
7) STBB3M Index	STIBOR Interbank Offered Rate 3M	Index/Stats	Miscellaneous In
8) HICNHON Index	TMA ON CNH Hong Kong InterBank Offered Rate (CNH Hibor) F...	Index/Stats	Miscellaneous In
9) SAIB3M Index	Saudi Riyal Interbank Average Offered Rate 3 Month	Index/Stats	Miscellaneous In
10) HICNH3M Index	TMA 3M CNH Hong Kong InterBank Offered Rate (CNH Hibor) F...	Index/Stats	Miscellaneous In
11) JISDOR Index	Bank Indonesia Jakarta Interbank Spot Dollar Rate	Index/Stats	Miscellaneous In
12) CHBM7D Index	CFETS China Interbank Repo 7 Day VWAP (Volume Weight Aver...	Index/Stats	Miscellaneous In
13) JIIN3M Index	Bank Indonesia Jakarta Interbank Offering Rate 3 Month	Index/Stats	Miscellaneous In
14) IN000/N Index	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outr...	Index/Stats	Miscellaneous In
15) EIBO3M Index	Emirates Interbank Offer Rate 3 Month Ask	Index/Stats	Miscellaneous In
16) HICNH1M Index	TMA 1M CNH Hong Kong InterBank Offered Rate (CNH Hibor) F...	Index/Stats	Miscellaneous In

3. Далее по требуемому инструменту выгружаем значения (по аналогии с другими индексами, описано выше).

