

Как я ищу ликвидные облигации на Московской бирже

Написал свой скрипт в гугл-таблице и очень доволен

05.08.20 👁 31K 💬 80 📖 158



Когда не можешь купить определенную облигацию на бирже из-за отсутствия ликвидности, это обидно. Особенно если потратил время на ее анализ и подбор.

**Михаил Шардин**

кандидат технических наук

При этом обычно получается именно так: выбираешь через сервисы бумагу, подходящую по доходности, погашению и другим параметрам, а про ликвидность узнаешь только потом, когда собираешься покупать.

Совсем отказываться от облигаций при этом не вариант: это отличный инструмент, особенно на фоне падающих процентов по вкладам. Поэтому я радикально решил проблему и теперь подбираю облигации [через собственную гугл-таблицу](#). В статье расскажу, как ей пользоваться.

Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже [SilverFir] ☆ 📄 ☁							
Файл Правка Вид Вставка Формат Данные Инструменты Дополнения Справка Поиск облигаций v.3							
fx Полное наименование							
	A	B	C	D	E	F	G
1	Полное наименование	Код ценной бумаги	Цена, %	Объем сделок за n дней, шт.	Доходность	Дюрация, месяцев	Есть льгота?
2	ВсеИнструменты.ру ООО БО-01	RU000A0ZZXT0	100,76	9923	9,33	4,36	да
3							

Моя таблица в «Гугл-документах»

Какие сервисы я использовал

До создания таблицы я пробовал разные сервисы: Smart-lab, Cbonds, Rusbonds, bonds.finam.ru, анализ облигаций от УК «Доходъ» и сервис поиска от Московской биржи.

На мой взгляд, в некоторых из них требуется слишком много исходных параметров, а их указание не ведет к желаемым результатам. У меня есть четкое представление о том, что для меня важно, и этих пунктов всего пять. К тому же на этапе покупки может оказаться, что торгов по бумаге не было уже несколько дней. Только в одном сервисе из шести — Rusbonds — можно в явном виде указать желаемый оборот бумаг, в остальных эта информация недоступна.

Инвестник — рассылка для инвесторов

Самое важное из мира инвестиций, чтобы научиться вкладывать деньги и быть в курсе последних новостей

Электронная почта

Подписаться

Какие параметры для меня важны

Мне было важно иметь возможность указать определенные параметры, какие-то — диапазоном, какие-то — минимальным порогом.

Диапазон текущей доходности. В Т—Ж уже есть [хорошая статья про доходность облигаций](#). От себя добавлю, что для поиска парковки денег на несколько месяцев доходность — один из важных параметров.

Диапазон текущих цен. Обычно я ищу варианты именно для парковки денег на несколько месяцев и держу облигации до погашения. Для этого случая слишком высокая цена скорее отпугивает, ведь эмитент при погашении заплатит только 100% номинала. Поэтому при поиске указываю не более 101% от номинала.

Диапазон дюрации. Дюрация — это эффективный срок до погашения облигации. Учитываю, чтобы видеть только те облигации, что погасятся в нужные мне сроки.

[Что такое дюрация облигаций](#)

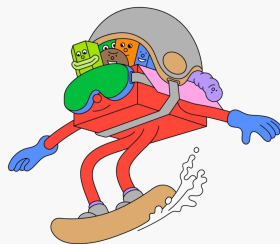
Минимальный объем сделок за последние несколько дней. Это самый важный параметр, из-за которого и был написан скрипт. Я хотел иметь возможность указать пороговый средний объем сделок за последние 15 дней, чтобы сервис показывал только то, что проходит фильтр.

Есть ли налоговая льгота для корпоративных облигаций. На текущий момент еще действуют льготы по налогу на купонный доход с облигаций федерального займа (ОФЗ), муниципальных и субфедеральных облигаций, а также выпущенных после 1 января 2017 года корпоративных облигаций со ставкой не выше ставки ЦБ + 5 п. п. Пока что этот параметр тоже важен.

Что делать? 10.07.18

[Какие есть налоговые льготы для инвесторов?](#)

Все эти критерии я учел в своей таблице со встроенным поиском.



УЧЕБНИК

Инвестиции — это не сложно

Пройдите наш бесплатный курс по инвестициям для новичков. Короткие и нескучные уроки о том, как вкладывать с умом, когда все вокруг без ума.

Погнали!

Как работает таблица

Если посложнее: таблица работает за счет [программного интерфейса к информационно-статистическому серверу Московской биржи \(ИСС/ISS\)](#). По ссылке есть описание работы сервиса.

Если попроще: я уже во всем разобрался. Вникать в программный код, чтобы воспользоваться таблицей, вам не придется.

Чтобы таблица была не просто очередным безымянным шаблоном, я дал ей собственное имя: [Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже 🔍 \[SilverFir 🌲\]](#). Название говорит о том, что делает эта таблица, а silver fir отсылает к разновидности вечнозеленых деревьев: ведь некоторые облигации торгуются не только в рублях.

Сам код скрипта можно посмотреть через панель «Инструменты» → «Редактор скриптов». Расскажу вкратце, что делает скрипт:

1. Подключается к [внешнему сервису Московской биржи](#), перебирая укрупненные группы разных режимов торгов облигациями. Их три: «T0: Основной режим — безадрес», «T+ : Основной режим — безадрес», «T+ : Основной режим (USD) — безадрес».
2. Далее скрипт ищет внутри этих ответов с сервера Мосбиржи бумаги, удовлетворяющие заданному диапазону текущей доходности и диапазону текущих цен.
3. Когда такие бумаги найдены, это сразу уменьшает выборку с полутора тысяч всех доступных на Мосбирже облигаций до максимум нескольких десятков.

4. Среди найденных вариантов происходит дальнейшая фильтрация по суммарным оборотам за последние несколько дней.
5. Если бумага проходит и этот фильтр, то она попадает в конечную выборку и для нее определяется наличие налоговой льготы для корпоративных облигаций, выпущенных с 1 января 2017 года.
6. После этого массив найденных бумаг записывается в таблицу на вкладку «Результат», а перед этим вся вкладка очищается от любых записей.
7. Разрешение на отображение и выполнение внешнего веб-контента требуется только для того, чтобы через дополнительный пункт меню отобразить ссылку на эту статью в Т—Ж.

Работа скрипта полностью зависит от сервера Московской биржи

Это означает, что если Мосбиржа поменяет формат выдачи, или организует другие режимы торгов, или изменит что-то в существующей системе, то для корректной работы скрипта потребуется его доработка.

Пошаговое руководство по использованию

[По ссылке откроется сразу ваша копия таблицы](#) — можно редактировать данные прямо в ней.

После корректировки параметров скрипту необходимо авторизоваться для работы. Для этого перейдите на вкладку меню «Инструменты» → «Макросы» и выберите любой из двух пунктов: «Открыть описание работы таблицы» или «Искать по параметрам».

Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже [SilverFir] ☆ 📁 ☁

Файл Правка Вид Вставка Формат Данные Инструменты Дополнения Справка Поиск облигаций v.3

100% р. % .0 .00 123 По

fx Параметры поиска:

	A	B	C
1	Параметры поиска:		
2			
3	9	< Доходность, % <	12
4	97	< Цена, % <	101
5	4	< Дюрация, мес. <	11
6		Объем сделок за n дней, шт. >	3500

Добавить строки внизу (1000).

Макросы

- Записать макрос
- Настроить макросы
- Импортировать
- 1. Открыть описание работы таблицы
- 2. Искать по параметрам

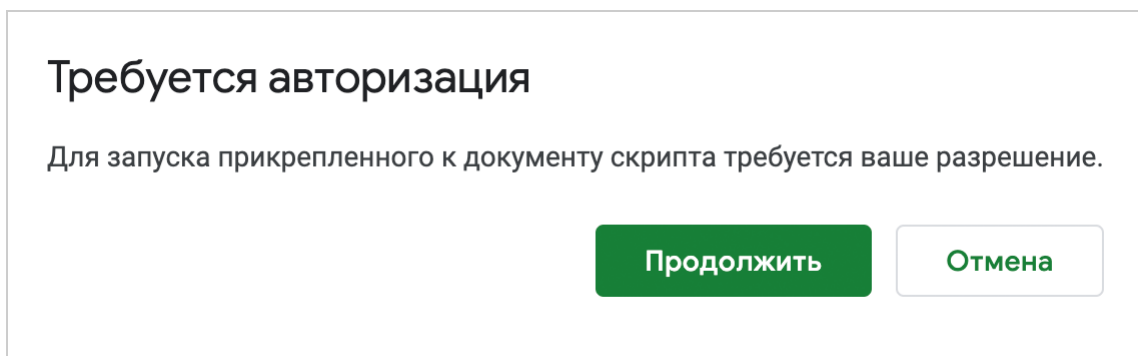
Параметры Результат

Инициализация работы скрипта

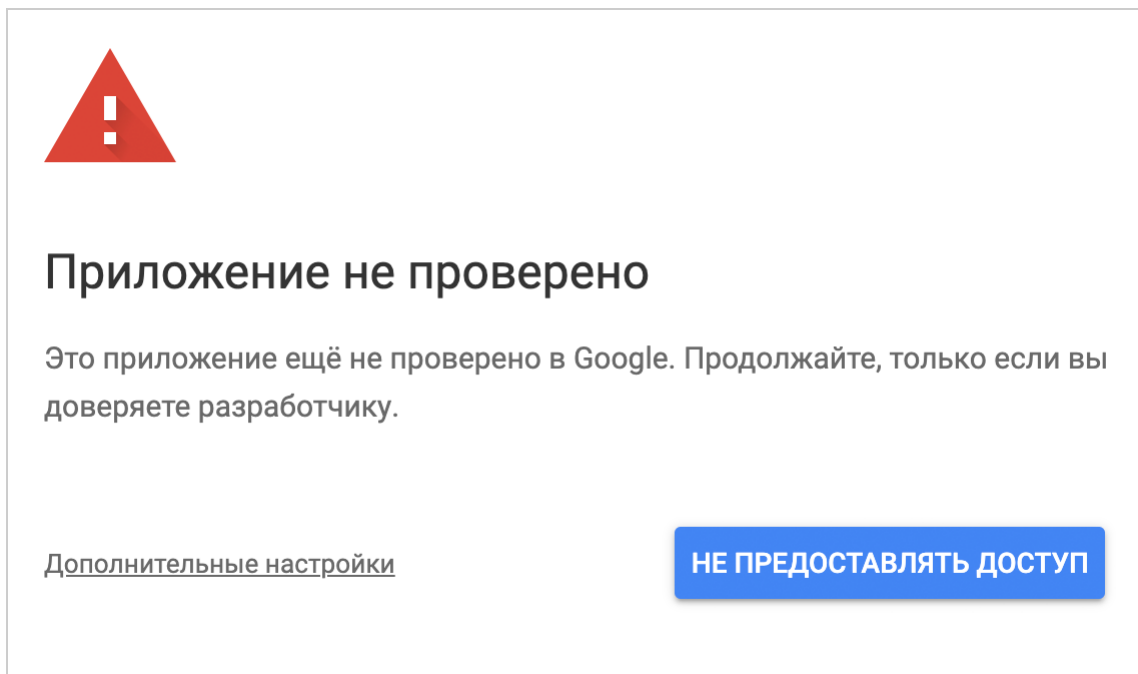
Далее потребуется разрешить такие действия:

1. Просмотр, создание, изменение и удаление таблиц на «Гугл-диске».
2. Подключение к внешнему сервису.
3. Отображение и выполнение внешнего веб-контента в уведомлениях и на боковых панелях приложений «Гугла».

Выглядит это разрешение так.



Диалоговое окно «Гугл-таблиц»



«Гугл-таблицы» предупреждают, что приложение не проверено, но если нажать на ссылку «Дополнительные настройки», то появится еще одна ссылка — переход на страницу. Жмем на нее

Приложение "

Поиск ликвидных облигаций
на Мосбирже 🔍 [T—Ж release.
SilverFir 🌲]







" запрашивает разрешение на
доступ к вашему аккаунту
Google

 truetnoth@gmail.com

Приложение "

Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже 🔍
[T—Ж release. SilverFir 🌲]

" сможет выполнять следующие действия:

-  Просмотр, создание, изменение и удаление таблиц на Google Диске 
-  Подключение к внешнему сервису 
-  Отображение и выполнение внешнего веб-контента в уведомлениях и на боковых панелях приложений Google 

Убедитесь в надежности сервиса "Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже 🔍 [T—Ж release. SilverFir 🌲]"

Этот сайт или приложение сможет получить доступ к конфиденциальной информации. Ознакомьтесь с условиями использования и политикой конфиденциальности сервиса "Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже 🔍 [T—Ж release. SilverFir 🌲]", чтобы узнать, как будут обрабатываться ваши данные. Посмотреть или удалить приложения и сайты с доступом к вашему аккаунту можно на странице [Аккаунт Google](#).

[Подробнее об угрозах безопасности...](#)

[Отмена](#)

Разрешить

После появится вот такое окно — жмем «Разрешить». Готово, скрипт авторизован

Посмотреть список всех приложений, которые уже имеют доступ к вашему аккаунту, [можно здесь](#). При необходимости можно закрыть доступ или изменить его настройки.

После авторизации можно пользоваться таблицей: указать на листе с вводными данными свои требования к облигациям.

В меню этой гугл-таблицы появится новый пункт «Поиск облигаций v. 3», а в нем кнопка «Искать по параметрам». Она запустит работу скрипта, который закончит свою работу примерно за минуту, вставив результаты работы на лист «Результат».

Поиск ликвидных облигаций на Мосбирже [SilverFir] ☆ 📁 🔄							
Файл Правка Вид Вставка Формат Данные Инструменты Дополнения Справка Поиск облигаций v.3							
100% р. % .0 .00 123 По умолча... 10 B I S A 🔍 📊 📈 📉 📊 📈 📉 🔍 📊 📈 📉 📊 📈 📉 🔍 📊 📈 📉 📊 📈 📉							
fx	Полное наименование						
	A	B	C	D	E	F	G
1	Полное наименование	Код ценной бумаги	Цена, %	Объем сделок за n дней, шт.	Доходность	Дюрация, месяцев	Есть льгота?
2	Ренессанс Страхование 001P-01R	RU000A100X69	100,4	50173	8,81	13,76	да
3	ЛЕГЕНДА БО 001P-01	RU000A0ZZCV0	101,47	44169	12,27	6,7	да
4	Калужская сбытовая комп 1P 01	RU000A0ZZYL5	100,03	39943	13,3	15,63	да
5	Первое кол.бюро НАО БО-01	RU000A0JWWG0	101,58	38162	13,21	8,3	нет
6	АО ЭталонЛенСпецСМУ БО-001P-02	RU000A0ZYA66	101,79	21497	7,54	12,93	да
7	АВТОБАН-Финанс АО БО-П02	RU000A100733	101,6	19325	8,46	7,6	да
8	ПР-Лизинг ООО БО 001P-02	RU000A0ZZX35	101,4	11471	9,97	15,4	да
9	ВсеИнструменты.ру ООО БО-01	RU000A0ZZXT0	100,76	9923	9,27	4,36	да
10	АО ЛК Европлан БО-05	RU000A1004K1	101,5	7125	7,08	6,73	да
11	ЭБИС БО-П01	RU000A100VY0	101,58	6785	13,46	7,8	
12	ГК Пионер БО 001P-03	RU000A0ZZ547	101	6670	10,99	8,66	да
13	Элемент Лизинг БО 001P-01	RU000A0ZZ0L6	100,79	5292	8,34	4,93	да
14	АО ЛК Европлан БО-06	RU000A100DG5	101,7	4923	7,34	9,73	да
15							
16	Данные обновлены 29.07.2020 в 15:58:02.						
17							
+ ≡ Параметры ▼ Результат ▼							

Результат работы скрипта

Запомнить надо две вещи

1. Скрипт делает предварительную механическую работу по подбору подходящих облигаций.
2. Решение о дальнейшей покупке конкретных найденных бумаг должен принимать сам человек после знакомства с эмитентом.

👍 6 💬 158

05.08.20 © 31K Тэги: инвестиции, облигации Иллюстратор — Егор Шатохин

VK f 🐦 📌 🌐

**Михаил Шардин**

05.08.20, 14:15

А как вы ищете облигации?

Ваш ответ



80

По рейтингу По порядку



Еще 76 мнений



УЧЕБНИК

Как улучшить жизнь с помощью «Экселя»

Узнайте из нашего курса, как таблицы помогут планировать бюджет, считать расходы и структурировать бытовые дела. Даже если с «Экселем» на вы.

[Начать учиться](#)

Сообщество Т—Ж

[См. все](#)

Angelina Vershinina

**Как сервисы
электронного ч
книг получают
публикации?**

**Как студенту-магистру
из региона найти
подработку в Москве?**

04.02 1K 4 4

**Как разделить деньги
от продажи общей
машины после развода?**

04.02 139 1

04.02 54

Лучшее за неделю

[См. все](#)

Что изменилось в пенсионной системе с 2021 года

01.02  181K  40  28

Как прогулять полдня на работе, уволиться и получить за это 100 000 ₽

01.02  133K  120  23

Грузия открыла границы для туристов из РФ правила въезда

29.01  104K  129  16

Инвестник — рассылка для инвесторов

Самое важное из мира инвестиций, чтобы научиться вкладывать деньги и быть в курсе последних новостей



Подписаться




Вот что еще мы писали по этой теме

См. все

Как устроена фондовая

Что такое фондовые

Популярные

биржа16.01.20  72K  69  52**индексы**11.06.19  28K  8  35**заблуждения****об инвестициях**
27.11.15  755K  32  53**Вакансии Т—Ж**[См. все](#)**Системный инженер**

13.02.20, 22:20

Построить техническую инфраструктуру Тинькофф-журнала

 [Почитать вакансию](#)**Фронтендер**

23.02.20, 15:00

Сделать показатели поисковых систем вновь великими

 [Почитать вакансию](#)**HR-редактор соцсетей**

26.01, 17:00

Писать о работе и образе в Тинькофф

 [Почитать вакансию](#)**Съешь еще этих мягких французских булок**

Мне зачислили годовую премию. Что с ней делать прямо сейчас?

27.12.16  87K  6  2

Насколько хорошо вы спите по сравнению с другими россиянами?

21.05.20  69K  68  11

Что посмотреть в Хельсинки за один день

24.01.19  42K  27  6