

**Михаил Шардин**

личный блог



13 марта 2025, 09:09

[+ Подписаться](#)

Где можно получить исторические фундаментальные данные по российским компаниям через API?

Добрый день!

Ищу решение для автоматизированного получения **исторических фундаментальных данных** по российским компаниям. Нужна история изменения P/E, P/S, ROE, EPS, выручки и других показателей за несколько лет для построения скринера и проведения фундаментального анализа.

Проанализировал два доступных API, но везде есть ограничения:

T-Invest API

- **Плюсы:** Хороший набор текущих фундаментальных показателей
- **Минусы:** Отсутствует история фундаментальных данных, выдаёт только актуальные показатели
- **Запрос:** https://github.com/RussianInvestments/invest-python/blob/main/examples/get_asset_fundamentals.py
- **Ответ:**

```
GetAssetFundamentalsResponse(fundamentals=[  
StatisticResponse(asset_uid='40d89385-a03a-4659-bf4e-d3ecba011782',  
currency='RUB',  
market_capitalization=6878249241240.0,  
high_price_last_52_weeks=330.45,  
low_price_last_52_weeks=219.2,  
average_daily_volume_last_10_days=65639361.43,  
average_daily_volume_last_4_weeks=60348494.76,  
beta=0.8,  
free_float=0.48,  
forward_annual_dividend_yield=0.0,  
shares_outstanding=21586948000.0,  
revenue_ttm=8676400000000.0
```

Введите текст комментария

```
free_cash_flow_ttm=0.0,
five_year_annual_revenue_growth_rate=0.0,
three_year_annual_revenue_growth_rate=33.48,
pe_ratio_ttm=4.35,
price_to_sales_ttm=0.79,
price_to_book_ttm=0.96,
price_to_free_cash_flow_ttm=0.0,
total_enterprise_value_mrq=0.0,
ev_to_ebitda_mrq=0.0,
net_margin_mrq=0.0,
net_interest_margin_mrq=0.0,
roe=23.36,
roa=2.81,
roic=0.0,
total_debt_mrq=0.0,
total_debt_to_equity_mrq=0.0,
total_debt_to_ebitda_mrq=0.0,
free_cash_flow_to_price=0.0,
net_debt_to_ebitda=0.0,
current_ratio_mrq=0.0,
fixed_charge_coverage_ratio_fy=0.0,
dividend_yield_daily_ttm=10.45,
dividend_rate_ttm=33.3,
dividends_per_share=33.3,
five_years_average_dividend_yield=8.36,
five_year_annual_dividend_growth_rate=0.0,
dividend_payout_ratio_fy=45.49,
buy_back_ttm=0.0,
one_year_annual_revenue_growth_rate=55.49,
domicile_indicator_code="",
adr_to_common_share_ratio=0.0,
number_of_employees=0.0,
ex_dividend_date=datetime.datetime(2024,7,11,0,0,tzinfo=datetime.timezone.utc),
fiscal_period_start_date=datetime.datetime(1970,1,1,0,0,tzinfo=datetime.timezone.utc),
fiscal_period_end_date=datetime.datetime(1970,1,1,0,0,tzinfo=datetime.timezone.utc),
revenue_change_five_years=181.25,
```

**ВЫХОДИТ НА IPO**ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

FinanceMarker.ru API

- **Плюсы:** Есть фундаментальные показатели
- **Минусы:** Ограничение в 400 запросов в день для частных лиц
- **Запрос:** /fm/v2/stocks/{exchange}:{code} Получить данные по компании
- **Ответ:**

```
«ratios»: [
  {
    «active»: true,
    «capex_revenue»: 0,
    «capital»: 0,
    «changed_at»: «2025-03-13T06:04:44.836Z»,
    «code»: «GAZP»,
    «current_ratio»: 0,
    «debt_equity»: 0,
    «debt_ratio»: 0,
    «debtebitda»: 0,
    «dpr»: 0,
    «ebitda_margin»: 0,
    «ev_ebit»: 0,
    «evebitda»: 0,
    «evs»: 0,
    «exchange»: «MOEX»,
    «gross_margin»: 0,
    «interest_coverage»: 0,
    «month»: 0,
    «net_margin»: 0,
    «net_working_capital»: 0,
    «netdebt_ebitda»: 0,
    «operation_margin»: 0,
    «pbv»: 0,
    «pcf»: 0,
    «pe»: 0,
    «period»: «string»,
    «pfcf»: 0,
    «pffo»: 0
```

```

«roic»: 0,
«ros»: 0,
«type»: «string»,
«year»: 0
}
],

```

Пробовал смотреть в сторону:

1. MOEX ISS API — но там только рыночные данные и котировки
2. Парсинг сайтов — но это сложнее поддерживать, тем более я частное лицо.

Вопросы к сообществу:

1. Какие еще API предоставляют исторические фундаментальные данные по российским компаниям?
2. Возможно ли где-то получить поквартальную/годовую историю изменения ключевых показателей?
3. Как вы решаете задачу фундаментального скрининга по историческим данным?
4. Может быть какие-то платные решения с разумной ценой?

Буду благодарен за любые идеи и рекомендации!

API

торговые роботы

торговый софт

1К  1 20 8

Михаил Шар...

 Пермь

 106  860

 с 23 января 2019

 homeinv

+ Подписаться

20 КОММЕНТАРИЕВ

Сначала старые 



Alexide

13 марта 2025, 09:27



 Jetlend

ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

**Михаил Шардин**

13 марта 2025, 09:40



Alexide, с дневными котировками нет проблем можно по API с Мосбиржи получать. Как и почти все показатели по облигациям например

**Alexide**

13 марта 2025, 09:49



Михаил Шардин, да, я получаю текущие котировки через API Мосбиржи. Но нет истории котировок.

**Михаил Шардин**

13 марта 2025, 09:50



Alexide, история котировок дневных во всяком случае есть на API мосбиржи

**Кактус**

18 марта 2025, 08:49



Alexide,

Через iss и history можно за любую дату, за любой диапазон, начиная с любой даты получить. Потом функция importxml загружает это в google-spreadsheet. Аналогично для excel/openoffice

Примеры

История рпс сделок за определенную дату

iss.moex.com/iss/history/engines/otc/markets/ndm/securities.html?date=2024-04-18

История курсов валют за период

iss.moex.com/iss/history/engines/currency/markets/selt/boards/cets/securities/USD000UTSTOM.HTML?from=2020-02-15&till=2020-02-25

История курсов валют с заданной даты

<https://iss.moex.com/iss/history/engines/currency/markets/selt/boards/cets/securities/USD000UTSTOM?from=2020-02-15>



rudata.info/rd-apiconomy.ru/partnership**Михаил Шардин**

14 марта 2025, 04:59



Replikant_mih, спасибо!

**Кактус**

13 марта 2025, 22:49



„Как вы решаете задачу фундаментального скрининга по историческим данным? “

tradingview

Базовые показатели и основные строки из отчетности встроены в сервис. Остальное — через скрипт все что угодно можно придумать.

**Михаил Шардин**

14 марта 2025, 06:52



Кактус, вы имеете в виду язык Pine — это язык программирования, разработанный TradingView и используемый для написания собственных индикаторов и стратегий?

**Кактус**

14 марта 2025, 07:27



Михаил Шардин,

Да. Но там и без него много встроенных возможностей.

На график можно вывести практически любую строчку из отчетности, любой макроэкон. показатель. Например,

Search

- My scripts
- Technicals
- Financials**
- Community Scripts

Income statement | Balance sheet | Cash flow | Statistics

SCRIPT NAME

Total revenue

Cost of goods sold

- Depreciation and amortization
- Depreciation
- Amortization of intangibles
- Amortization of deferred charges
- Other cost of goods sold

Gross profit

Operating expenses (excl. COGS)

- Selling/general/admin expenses, total
- Research & development
- Selling/general/admin expenses, other
- Other operating expenses, total

А скрипт, например, нужен, когда какую-то строчку в отчете в долларах посмотреть (для котировок акций это можно прямо вверху в формуле прописать, а вот когда какую-нибудь строчку в отчете захотим поделить на курс доллара, на цену нефти и т.д., то уже скрипт).

Пример скрипта tradingview что бы вывести капитал сбера в долларах_с_учетом_инфляции (CPI)

```
//@version=5
indicator(«Мой скрипт»)
book = request.financial('MOEX:SBER','BOOK_VALUE_PER_SHARE','FQ')
usdrub = request.currency_rate('usd', 'rub')
uscpi = request.economic('US', 'CPI')

plot(book /(usdrub*uscpi/308))
```



Михаил Шардин

14 марта 2025, 07:25



Кактус, спасибо вам за пример!

Михаил Шардин,



Просто я не верю, что стандартных r/bv , roe , goa достаточно. Да они уже и реализованы на куче скринингов. А чтобы искать более тонкие индикаторы, как раз tradingview хорош.



Фёдор Г.

16 марта 2025, 09:41



Кактус, а такую табличку с данными, по которой строится график, можно оттуда как то скачать?



Кактус

17 марта 2025, 09:36



Фёдор Г.,

Да

ru.tradingview.com/support/solutions/43000537255/



Напишите комментарий...



ОТПРАВИТЬ

Установите приложение Смартлаба:



О смартлабе

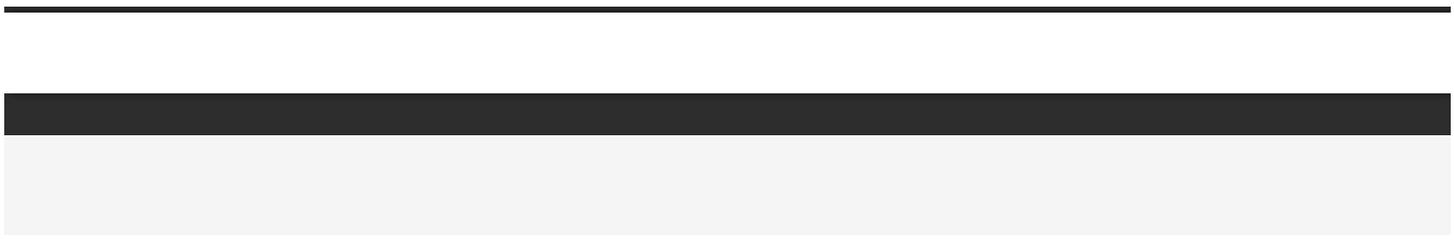
Реклама

Полная версия



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ