



РЕЗУЛЬТАТЫ
СТАНДАРТНЫХ
ИНВЕСТИЦИОННЫХ
СТРАТЕГИЙ

09 апреля 2024 г.
г. Москва

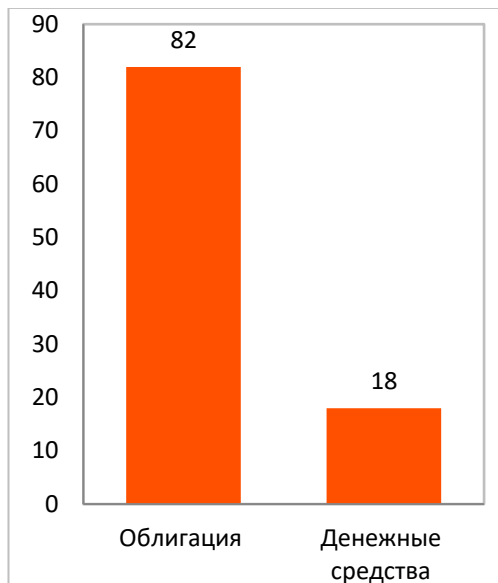
Оглавление

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД..... 3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС..... 5
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ 7
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС..... 9

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

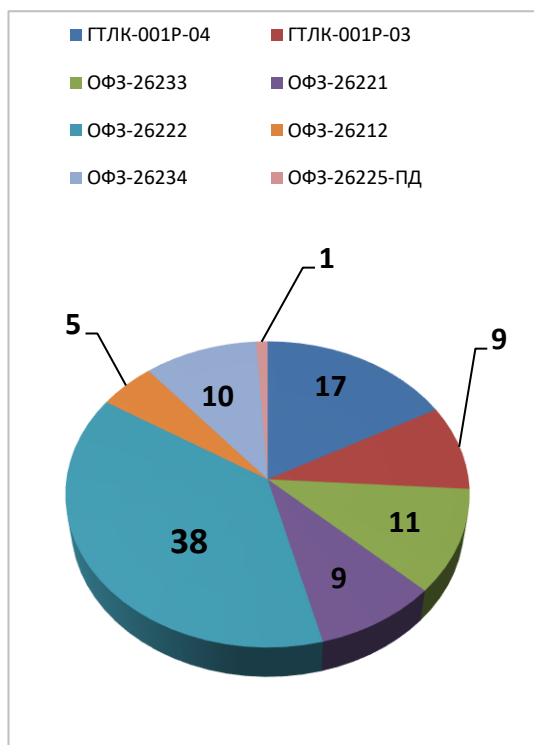
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	82%
Денежные средства*	18%
ИТОГО	100%



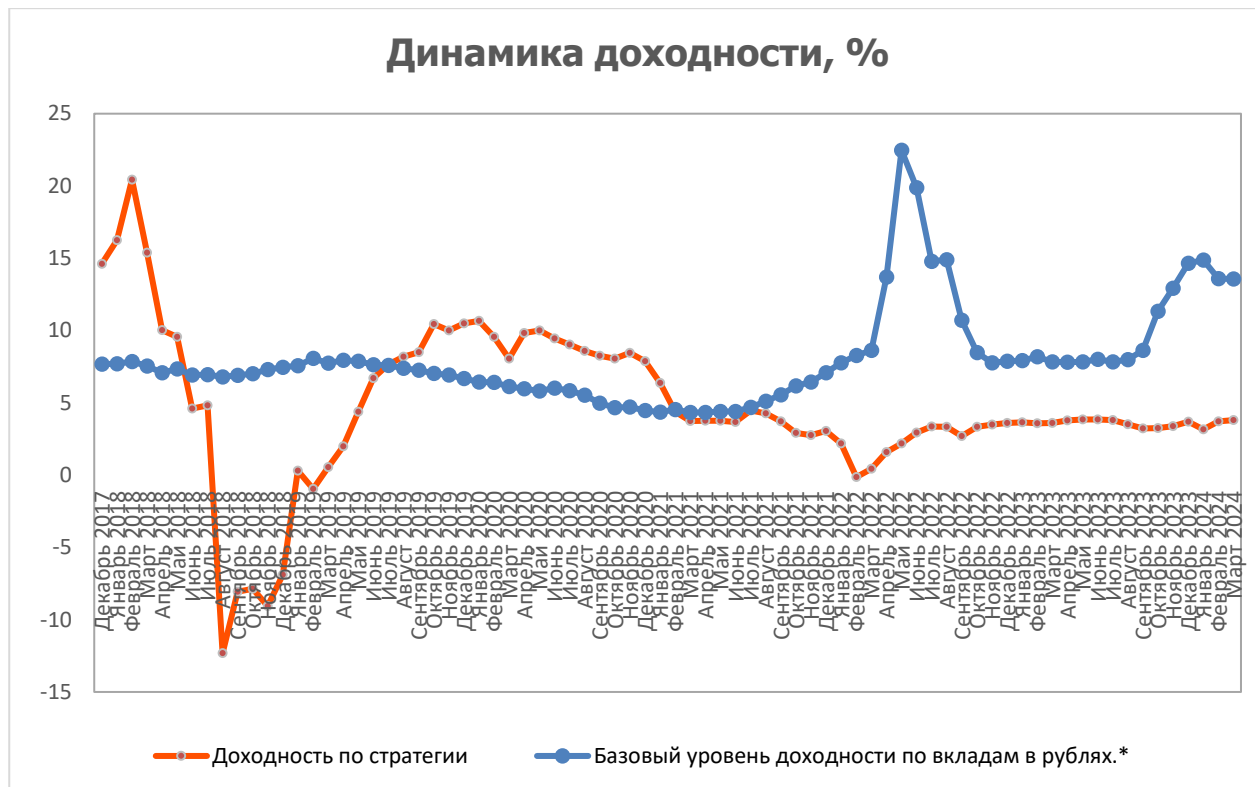
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001Р-04, 4B02-04-32432-Н-001Р, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	17
ГТЛК-001Р-03, 4B02-03-32432-Н-001Р, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	9
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	11
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	38
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	9
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	5
ОФЗ-26234-ПД, 26234RMFS, RU000A101QE0	Государственная облигация	10
ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7	Государственная облигация	1
ИТОГО		100%



* - если значение доли денежных средств отрицательное, то данный показатель, взятый по модулю, отражает объем привлеченных денежных средств в РЕПО.

3. Динамика доходности:



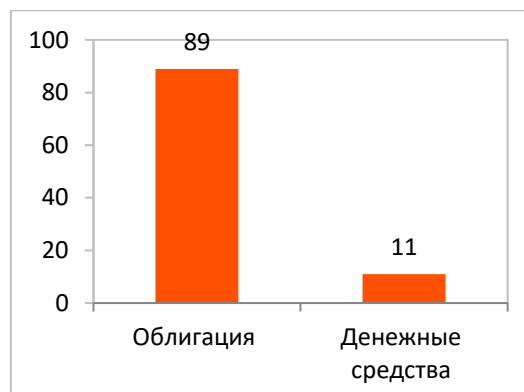
*Расчёт осуществлён на основе сведений о средних максимальных процентных ставках по вкладам по срокам привлечения за март 2024г.
http://cbr.ru/press/pr/?file=638469772574446488BANK_SECTOR.htm

Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными предпринимателями, и подлежащие обязательному страхованию в соответствии с Федеральным законом «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации».

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС

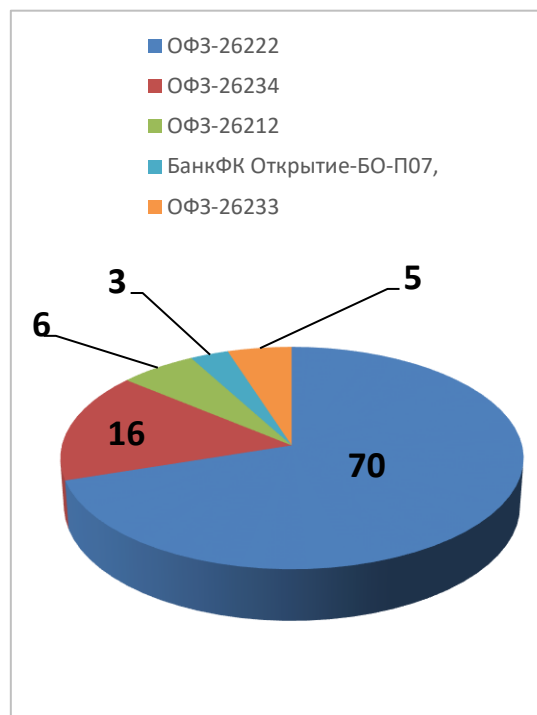
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	89%
Денежные средства*	11%
ИТОГО	100%



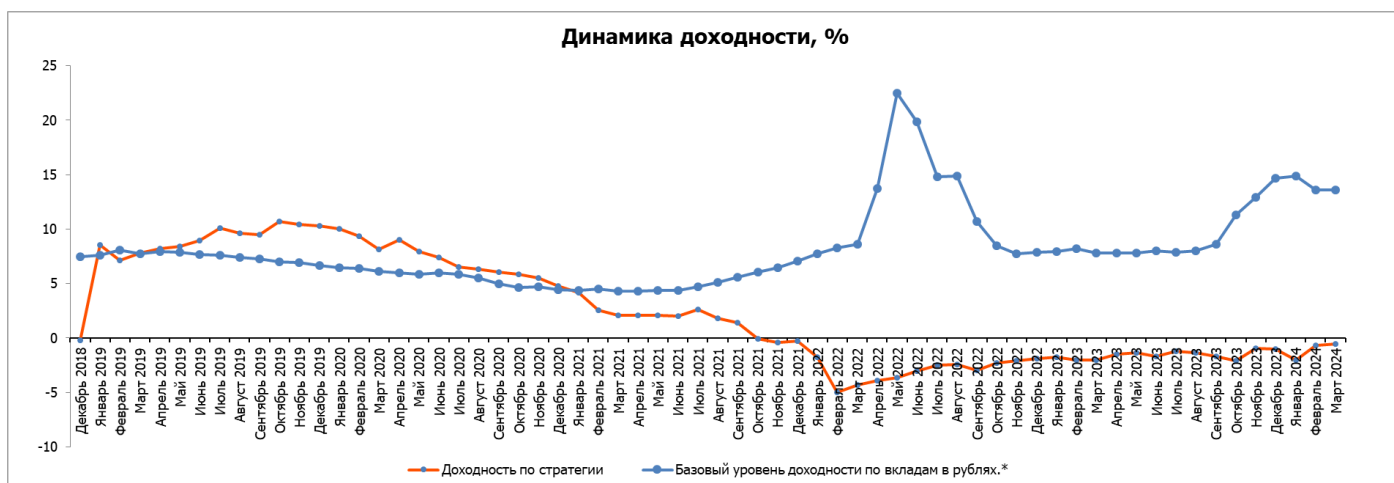
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	70
ОФЗ-26234-ПД, 26234RMFS, RU000A101QE0	Государственная облигация	16
БанкФК Открытие-БО-П07, 4B02-14-02209-B-001P, RU000A102R73	Корпоративная облигация	3
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	6
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	5
ИТОГО		100%



* - если значение доли денежных средств отрицательное, то данный показатель, взятый по модулю, отражает объем привлеченных денежных средств в РЕПО.

2. Динамика доходности:



*Расчёт осуществлён на основе сведений о средних максимальных процентных ставках по вкладам по срокам привлечения за март 2024г.

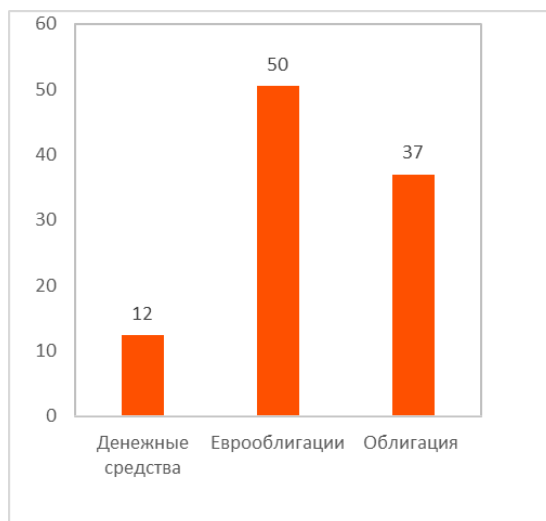
http://cbr.ru/press/pr/?file=638469772574446488BANK_SECTOR.htm

Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными предпринимателями, и подлежащие обязательному страхованию в соответствии с Федеральным законом «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации».

ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

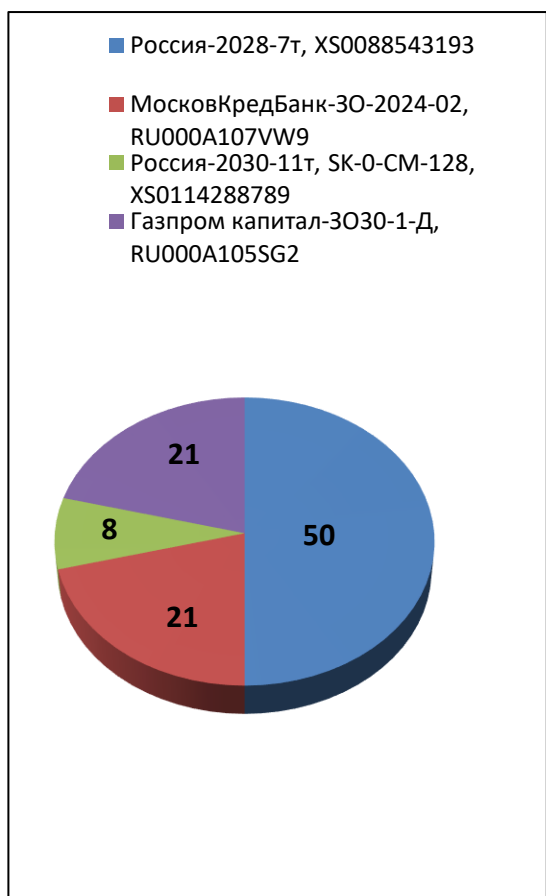
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	12%
Еврооблигации	50%
Облигация	37%
ИТОГО	100%



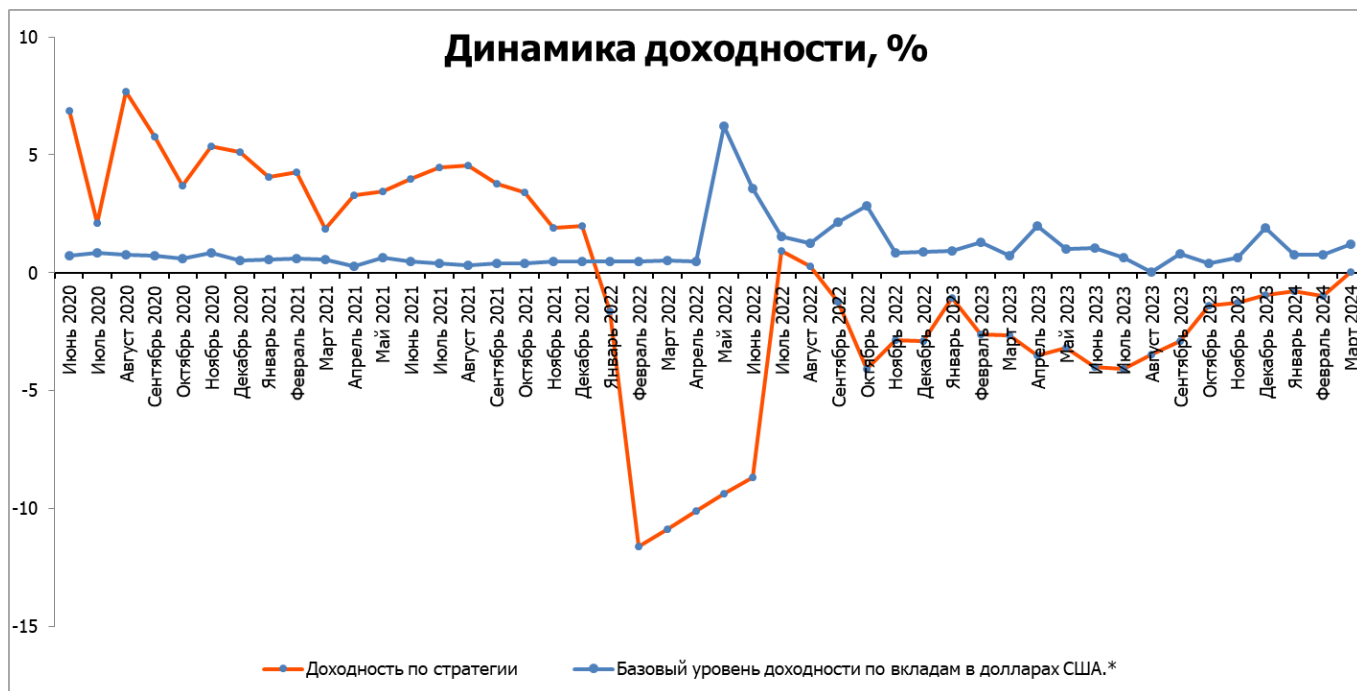
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	50
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	8
Облигации		
Газпром капитал-3030-1-Д, 4-13-36400-R-003P, RU000A105SG2	Корпоративная облигация	21
МосковКредБанк-30-2024-02, 4-20-01978-В, RU000A107VW9	Корпоративная облигация	21
ИТОГО		100%



ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Динамика доходности:



*Расчёт осуществлён на основе сведений о средних максимальных процентных ставках по вкладам по срокам привлечения за март 2024г.

http://cbr.ru/statistics/bank_sector/pdco_sub/#a_96809link

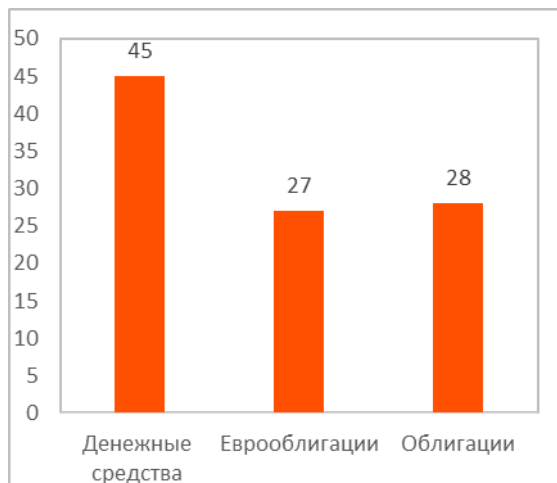
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными предпринимателями, и подлежащие обязательному страхованию в соответствии с Федеральным законом «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации».

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

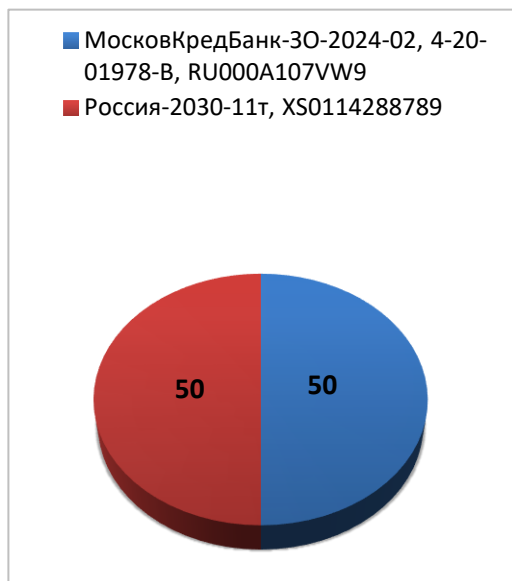
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	45%
Еврооблигации	27%
Облигации	28
ИТОГО	100%

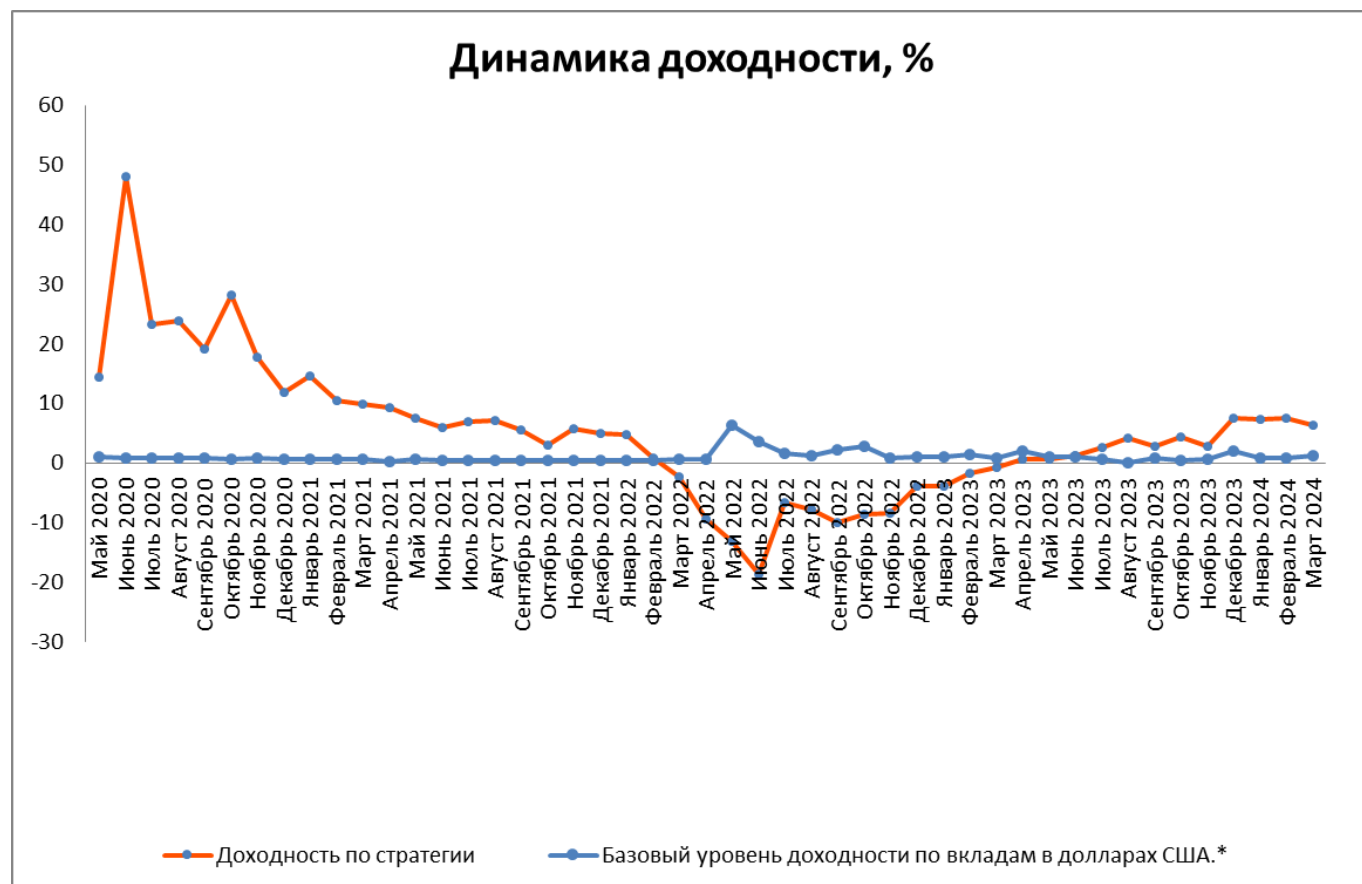


2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
МосковКредБанк-30-2024-02, 4-20-01978-B, RU000A107VW9	Корпоративная облигация	50
Еврооблигации		
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	55
ИТОГО		100%



3.Динамика доходности:



*Расчёт осуществлён на основе сведений о средних максимальных процентных ставках по вкладам по срокам привлечения за март 2024г.

http://cbr.ru/statistics/bank_sector/pdko_sub/#a_96809link

Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными предпринимателями, и подлежащие обязательному страхованию в соответствии с Федеральным законом «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации».