ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АТБ Азиатско-Тихоокеанский Банк

РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

10 января 2022 г.
г. Москва

Оглавление

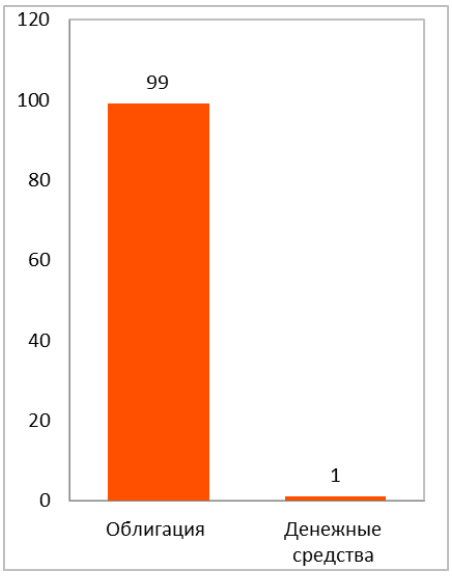
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД 3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС 5
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ 7
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС 9

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

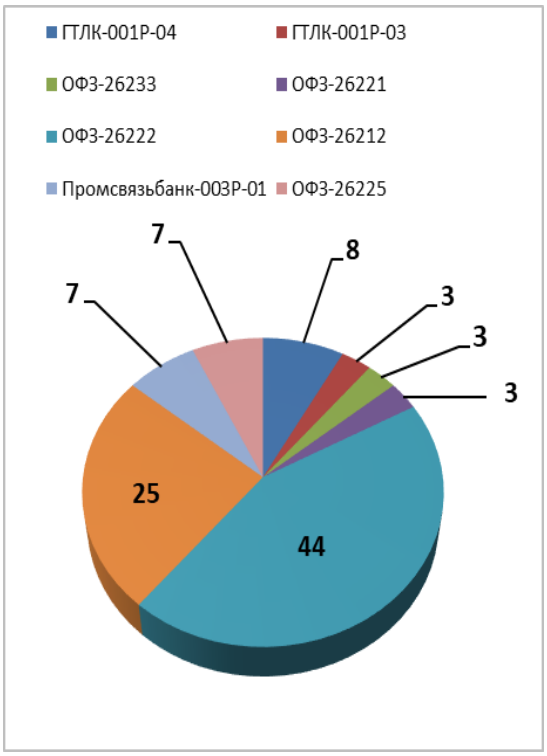
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	99%
Денежные средства*	1%
ИТОГО	100%



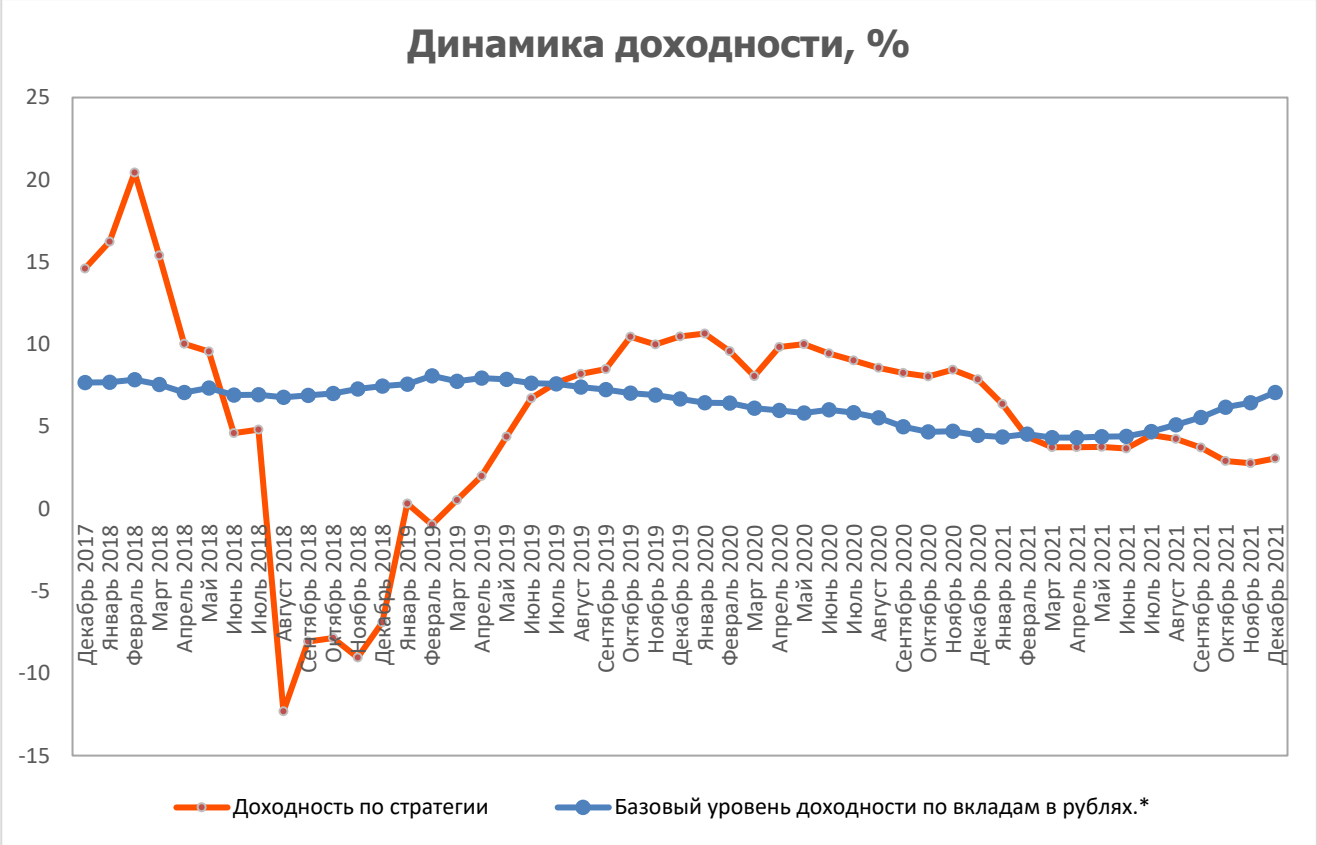
2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001Р-04, 4В02-04-32432-Н-001Р, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	8
ГТЛК-001Р-03, 4В02-03-32432-Н-001Р, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	3
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	3
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	44
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	3
ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7	Государственная облигация	7
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	25
Промсвязьбанк-003Р-01, 4В02-01-03251-В-003Р, RU000A101U38	Корпоративная облигация	7
ИТОГО		100%



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

3. Динамика доходности:



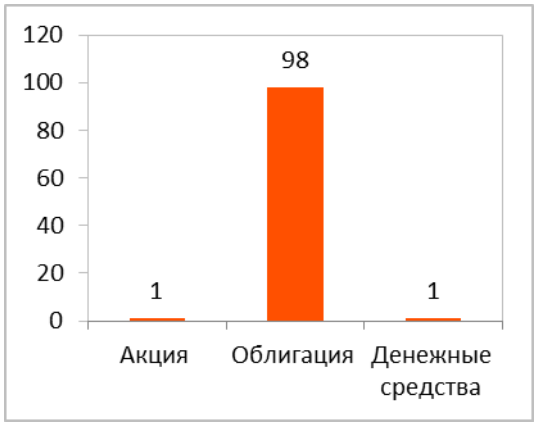
**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.11.2021.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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

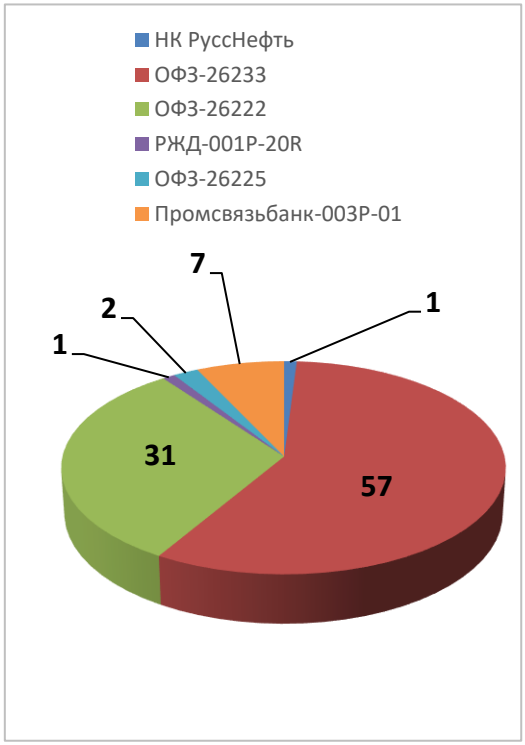
1.Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Акции	1
Облигации	98%
Денежные средства*	1%
ИТОГО	100%



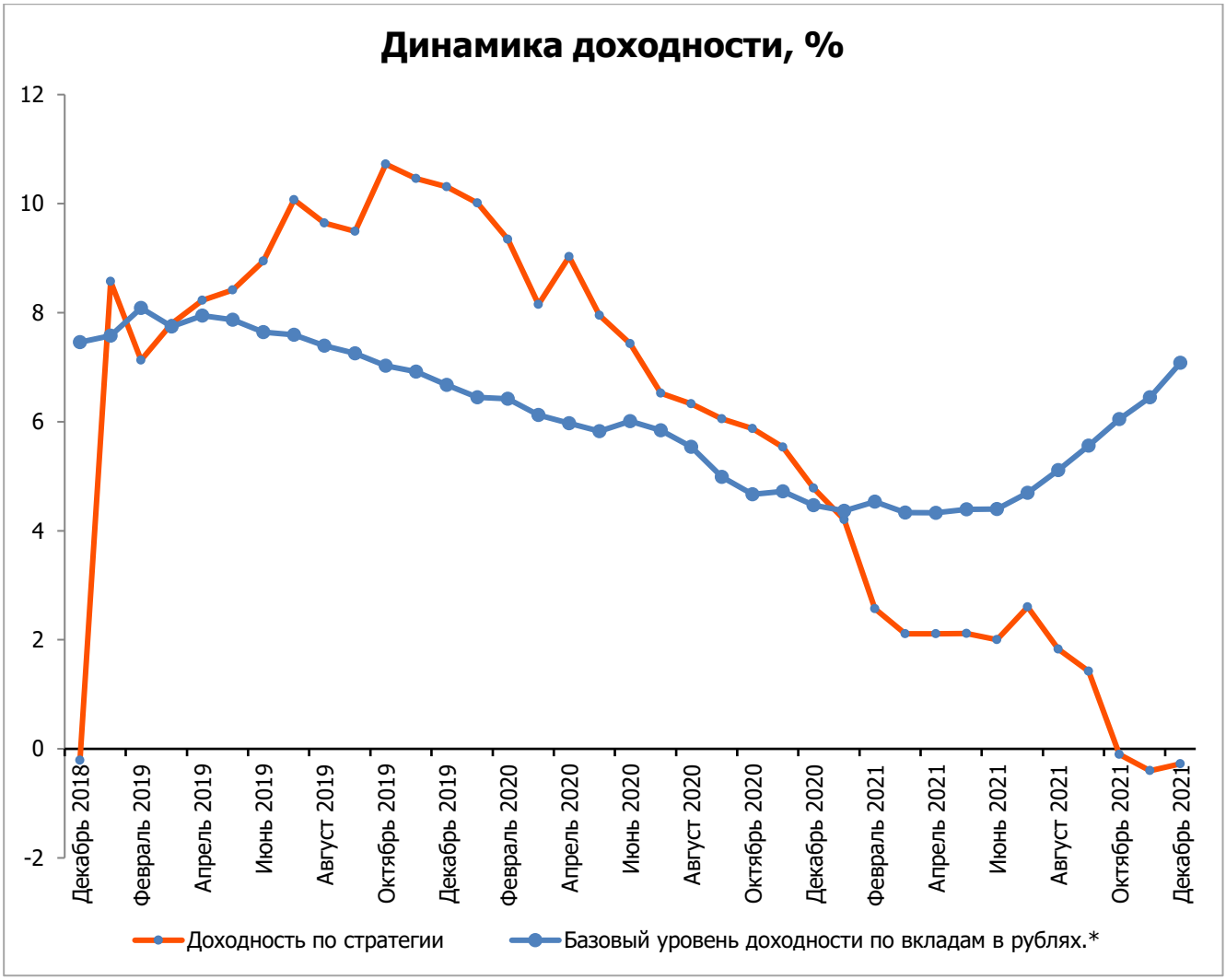
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Акции		
НК РуссНефть, ПАО ао02, 1-02-39134-Н, RU000A0JSE60	Акция обыкновенная	1
Облигации		
ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	57
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	31
ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7	Государственная облигация	2
Промсвязьбанк-003Р-01, 4В02-01-03251-В-003Р, RU000A101U38	Корпоративная облигация	7
РЖД-001Р-20R, 4В02-20-65045-D-001Р, RU000A101M04	Корпоративная облигация	1
ИТОГО		100%



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

2. Динамика доходности:



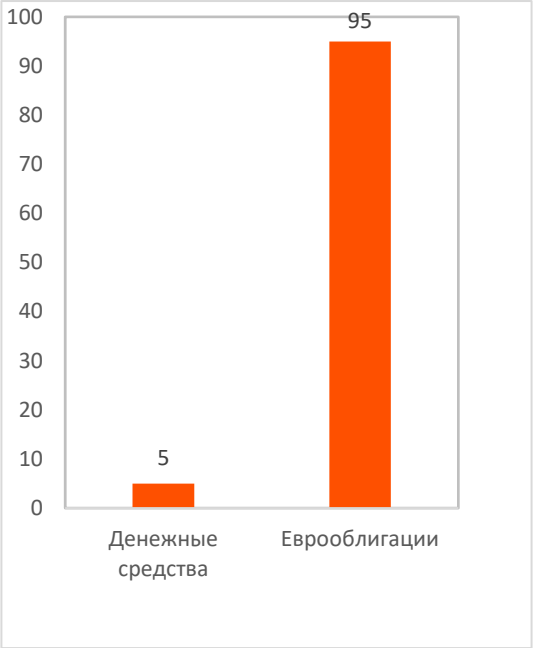
**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.11.2021.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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

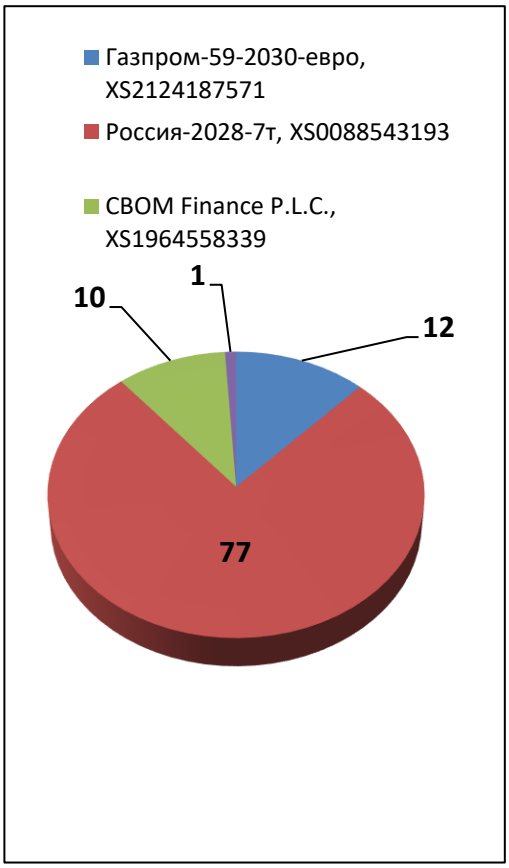
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	5%
Еврооблигации	95%
ИТОГО	100%

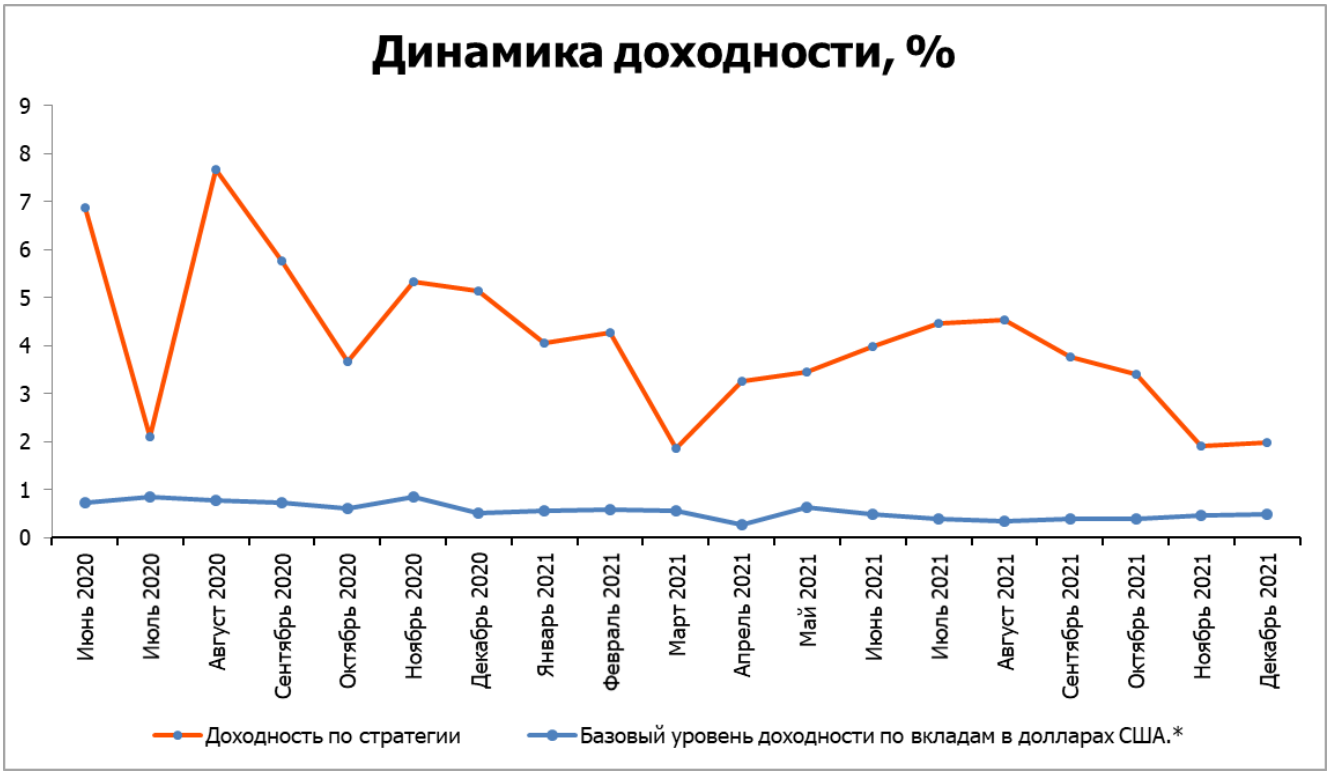


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	77
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	10
Газпром-59-2030-евро, XS2124187571	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	12
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	1
ИТОГО		100%



3.Динамика доходности:



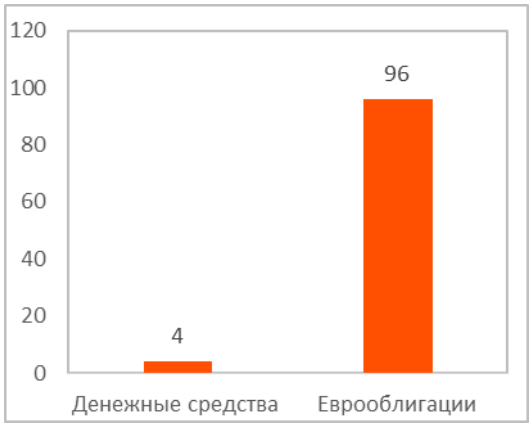
**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.11.2021.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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 ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

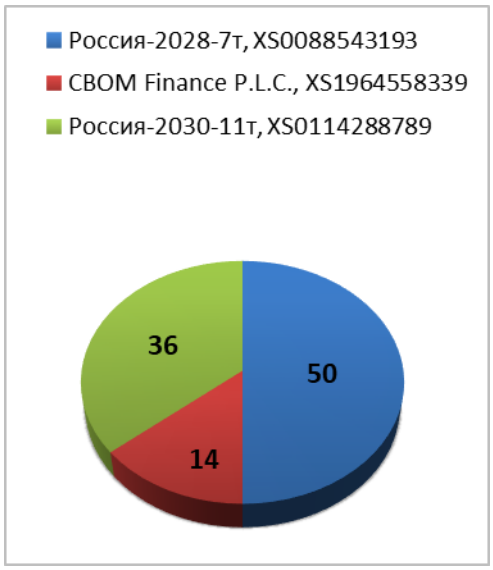
1.Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	4%
Еврооблигации	96%
ИТОГО	100%

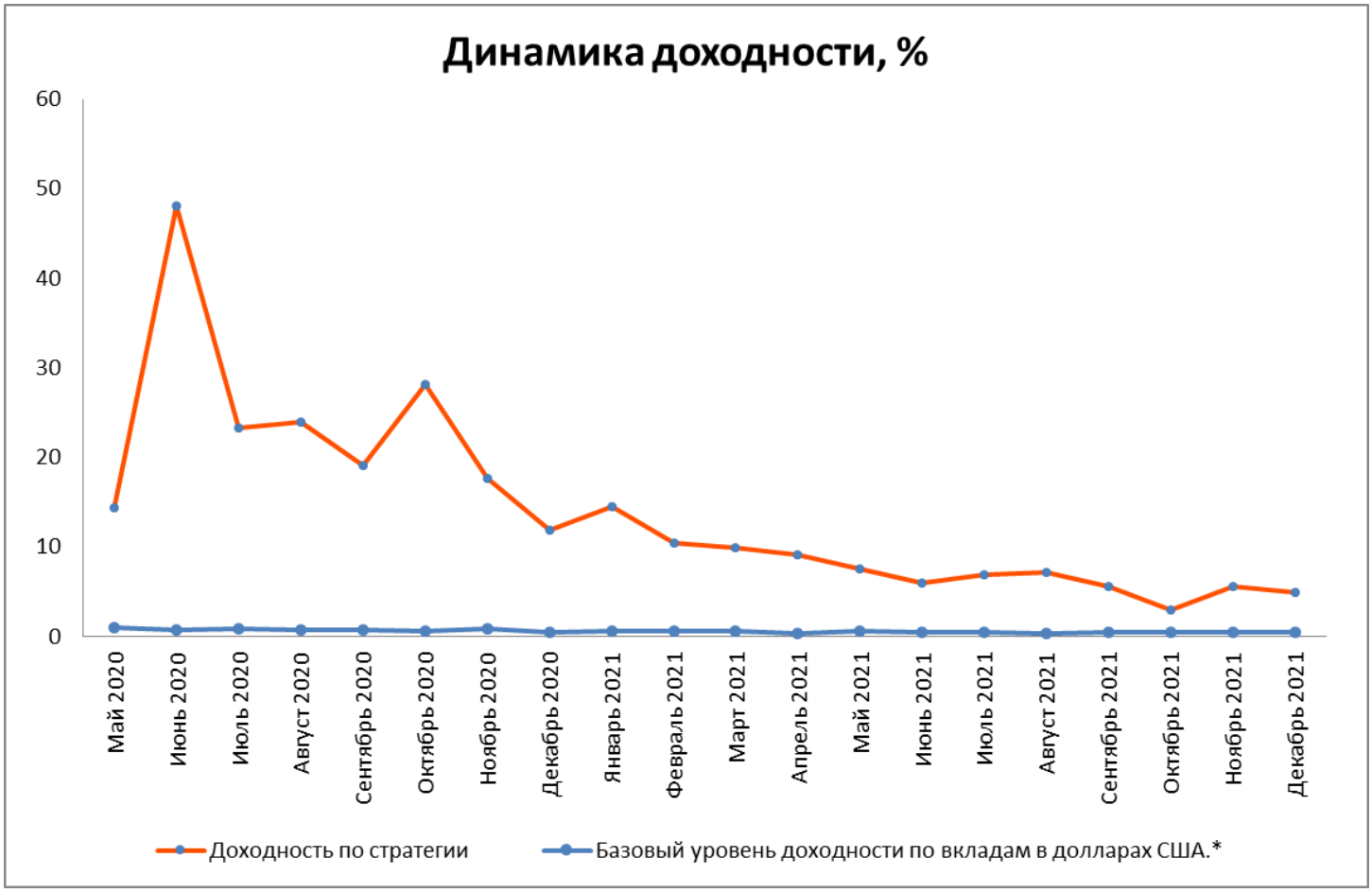


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (государственная РФ)	50
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	14
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	36
ИТОГО		100%



3.Динамика доходности:



**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.11.2021.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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».