



РЕЗУЛЬТАТЫ
СТАНДАРТНЫХ
ИНВЕСТИЦИОННЫХ
СТРАТЕГИЙ

12 октября 2020 г.
г. Москва

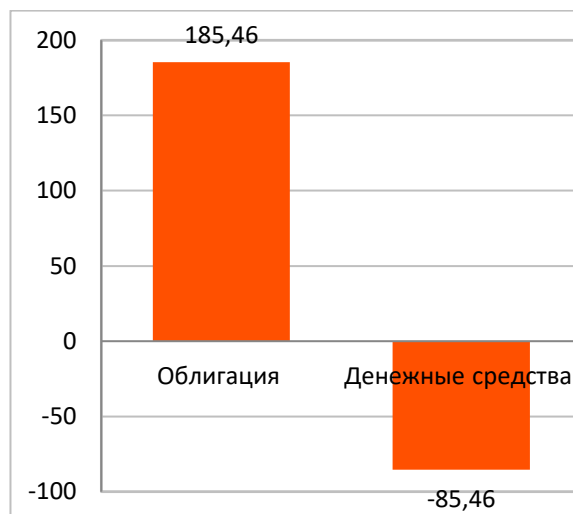
Оглавление

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД	3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС	5
АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ	7
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ.....	8
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС	10

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

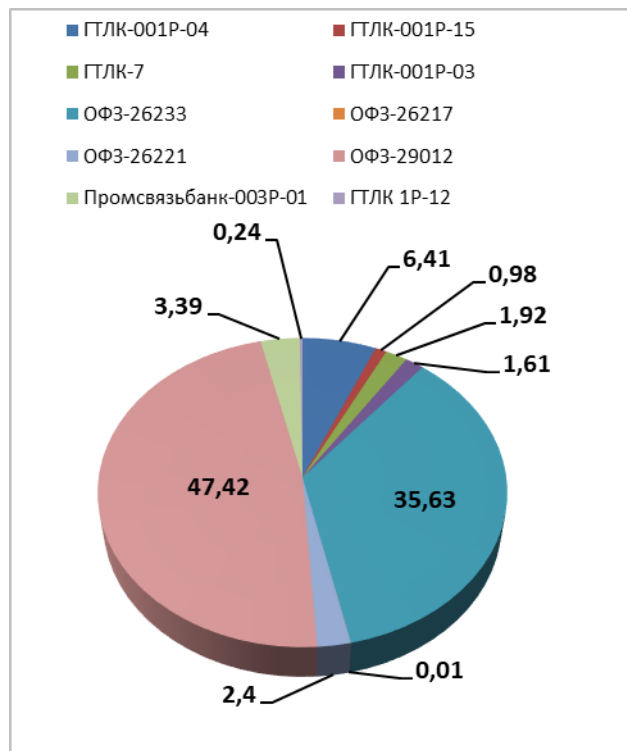
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	185,46%
Денежные средства*	-85,46%
ИТОГО	100.00%



2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001P-04, 4B02-04-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	6,41
ГТЛК-001P-15, 4B02-15-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	0,98
ГТЛК-7, 4B02-07-32432-H, RU000A0JW1P8	Корпоративная облигация	1,92
ГТЛК-001P-03, 4B02-03-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	1,61
ГТЛК 1P-12, 4B02-12-32432-H-001P, RU000A0ZZV11	Корпоративная облигация	0,24
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	35,63
ОФЗ-26217, 26217RMFS, RU000A0JVW30	Государственная облигация	0,01
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	2,40
ОФЗ-29012, 29012RMFS, RU000A0JX0H6	Государственная облигация	47,42
Промсвязьбанк-003P-01, 4B02-01-03251-B-	Корпоративная облигация	3,39
ИТОГО		100



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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

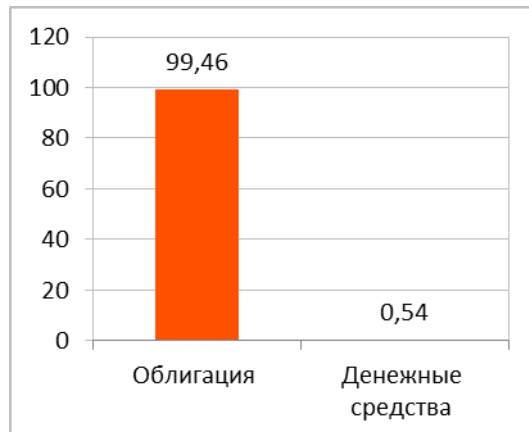
3. Динамика доходности:



ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС

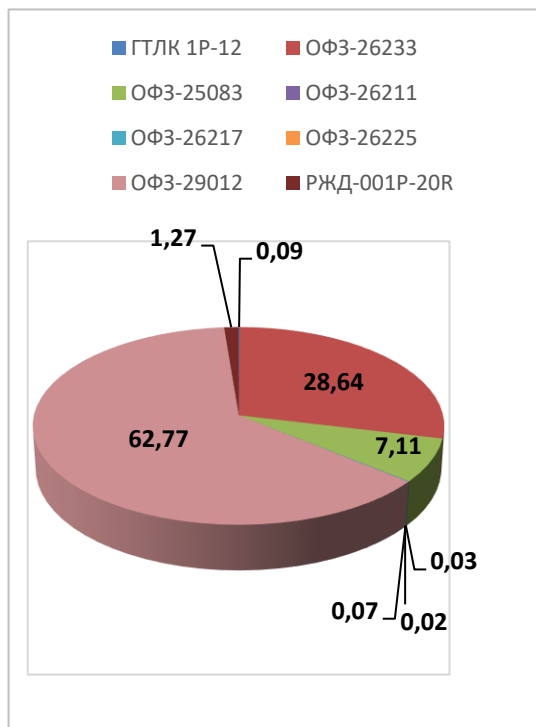
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	99,46%
Денежные средства*	0,54%
ИТОГО	100.00%



2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Структура портфеля Облигаций		
ГТЛК 1P-12, 4B02-12-32432-H-001P, RU000A0ZZV11	Корпоративная облигация	0,09
ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	28,64
ОФЗ-25083-ПД, 25083RMFS, RU000A0ZYCK6	Государственная облигация	7,11
ОФЗ-26211-ПД, 26211RMFS, RU000A0JTJL3	Государственная облигация	0,03
ОФЗ-26217-ПД, 26217RMFS, RU000A0JVW30	Государственная облигация	0,07
ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7	Государственная облигация	0,02
ОФЗ-29012-ПК, 29012RMFS, RU000A0JX0H6	Государственная облигация	62,77
РЖД-001P-20R, 4B02-20-65045-D-001P, RU000A101M04	Корпоративная облигация	1,27
ИТОГО		100.00%



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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

2. Динамика доходности:



1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	99,26%
Акции	0,74%
ИТОГО	100.00%

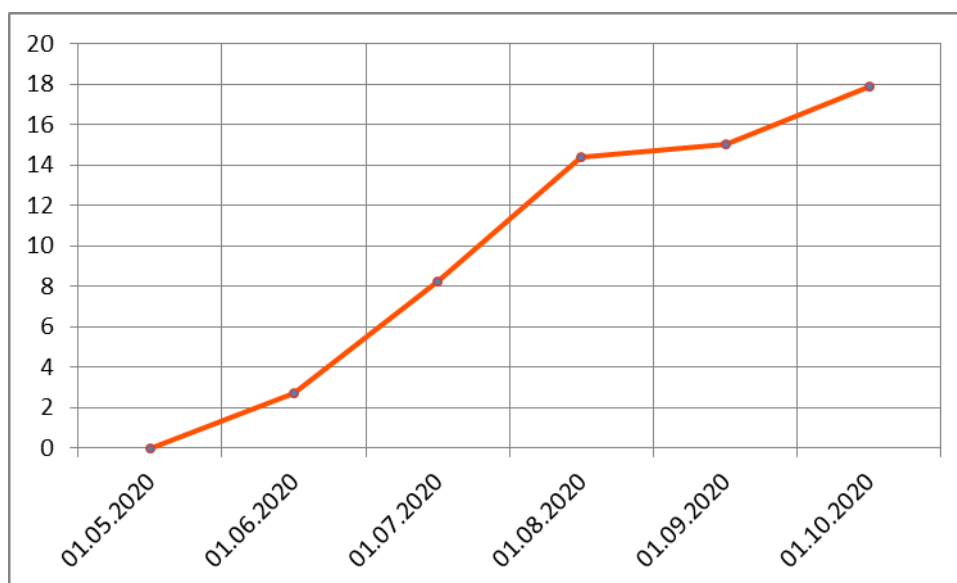


2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Структура портфеля Акции		
Сбербанк, ап, 20301481В, RU0009029557	Акция привилегированная	69,50
АПИ Сургутнефтегаз, Выпуск №2-01-00155-А, 2-01-00155-А, RU0009029524	Акция привилегированная	30,50
ИТОГО		100.00



3. Динамика доходности:

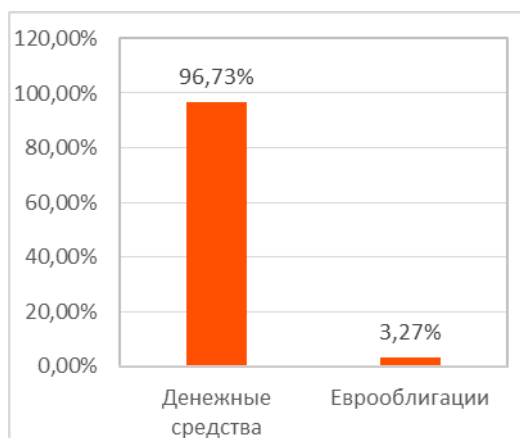


ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

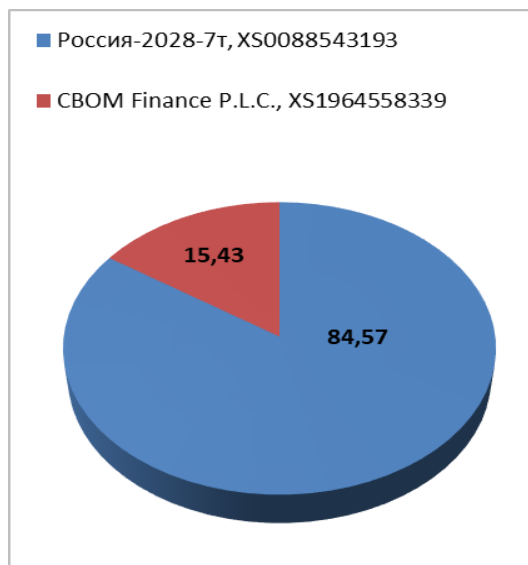
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	96,73%
Еврооблигации	3,27%
ИТОГО	100.00%



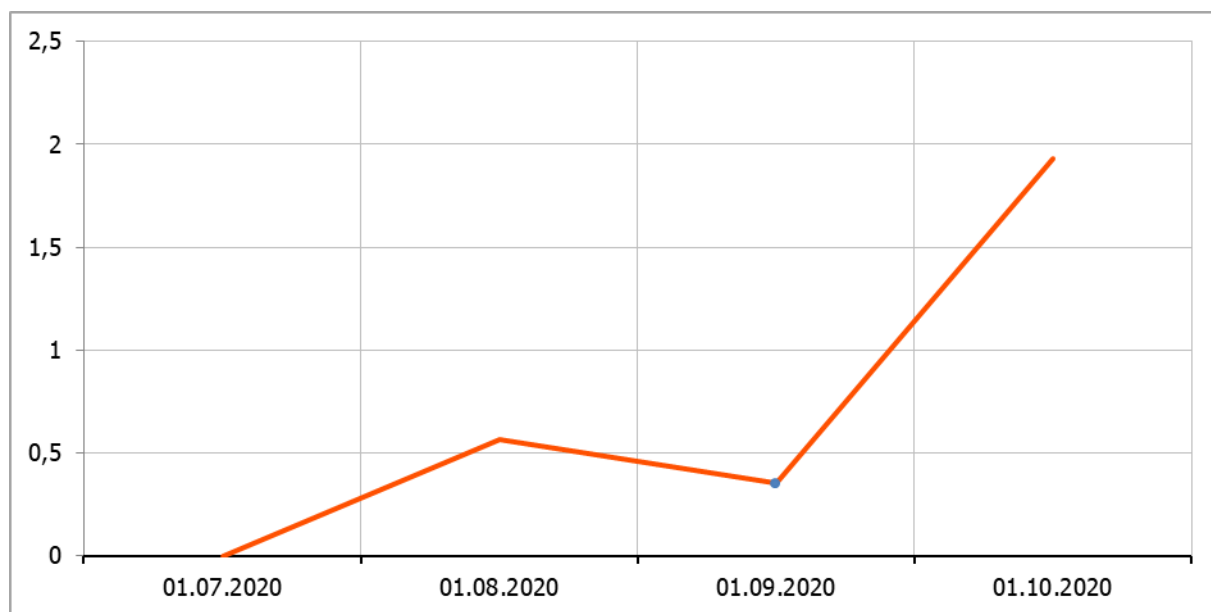
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	84,57
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	15,43
ИТОГО		100.00



ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

3. Динамика доходности:

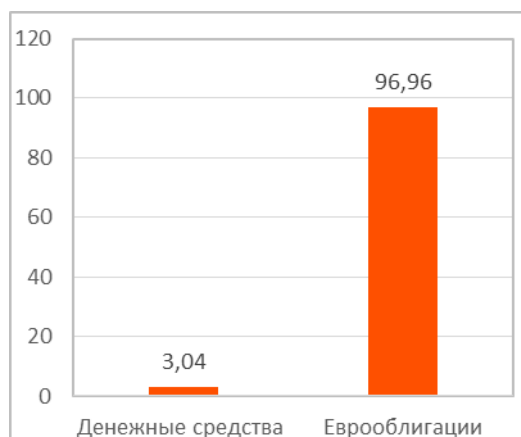


ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	3.04%
Еврооблигации	96.96%
ИТОГО	100.00%



2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигация		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (государственная РФ)	57,88
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	14,79
Россия-2030-11т, СК-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	27,33
ИТОГО		100.00



3. Динамика доходности:

