ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ



РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

11 января 2021 г.
г. Москва

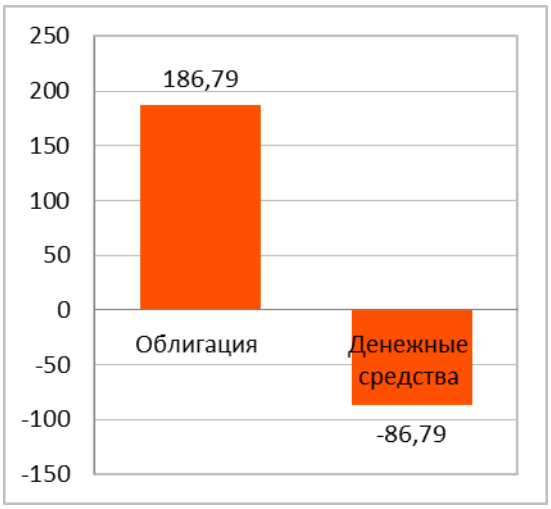
Оглавление

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД 3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС 5
АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ 7
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ 9
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС 11

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

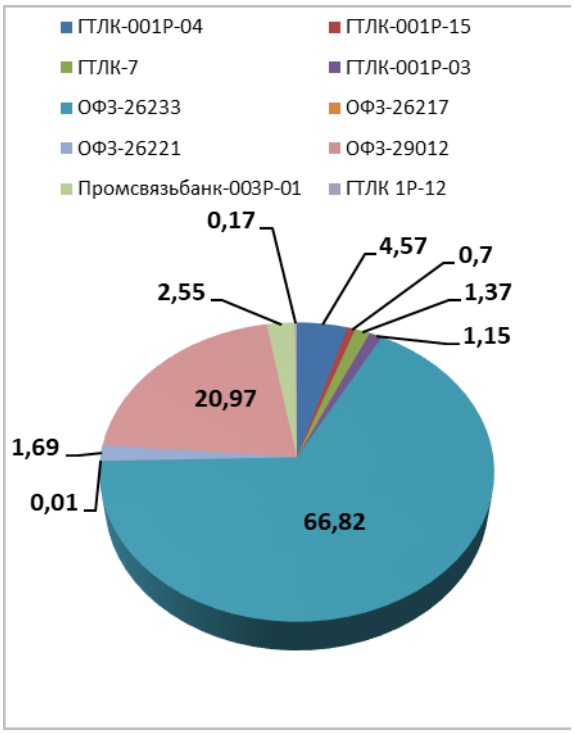
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	186,79%
Денежные средства*	-86,79%
ИТОГО	100.00%



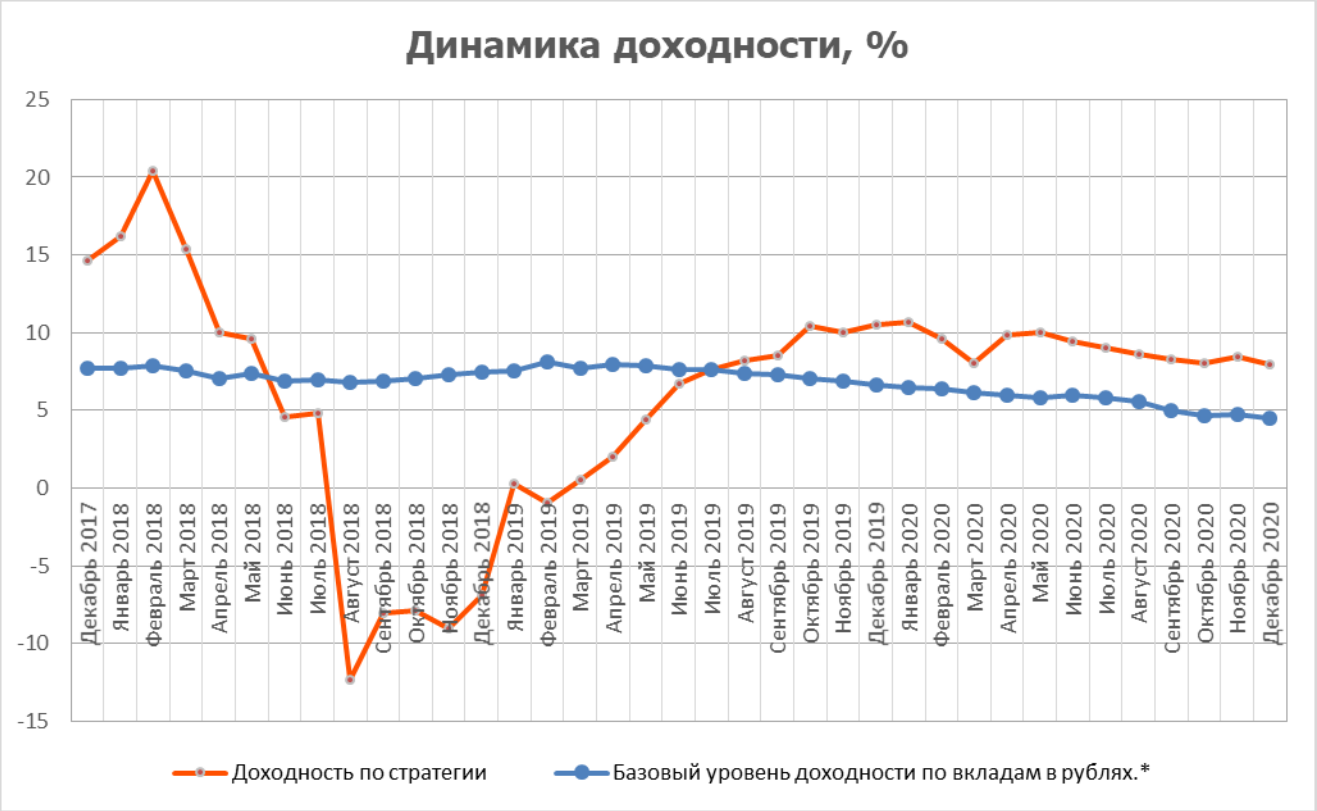
2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001Р-04, 4B02-04-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	4,57
ГТЛК-001Р-15, 4B02-15-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	0,7
ГТЛК-7, 4B02-07-32432-H, RU000A0JW1P8	Корпоративная облигация	1,37
ГТЛК-001Р-03, 4B02-03-32432-H-001P,	Корпоративная облигация	1,15
ГТЛК 1Р-12, 4B02-12-32432-H-001P, RU000A0ZZV11	Корпоративная облигация	0,17
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	66,82
ОФЗ-26217, 26217RMFS, RU000A0JVW30	Государственная облигация	0,01
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	1,69
ОФЗ-29012, 29012RMFS, RU000A0JX0H6	Государственная облигация	20,97
Промсвязьбанк-003Р-01, 4B02-01-03251-B-	Корпоративная облигация	2,55
ИТОГО		100



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

3. Динамика доходности:

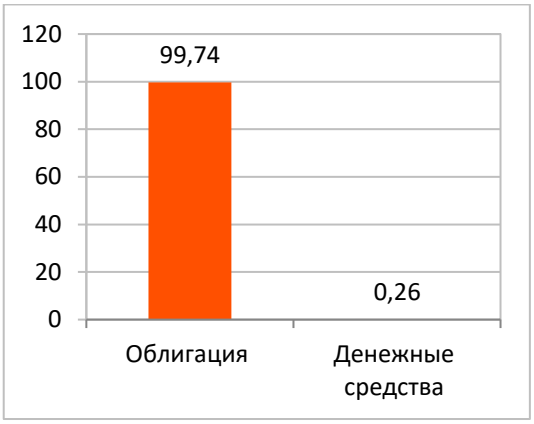


*****_Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.11.2020._
http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;
Под вкладами 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

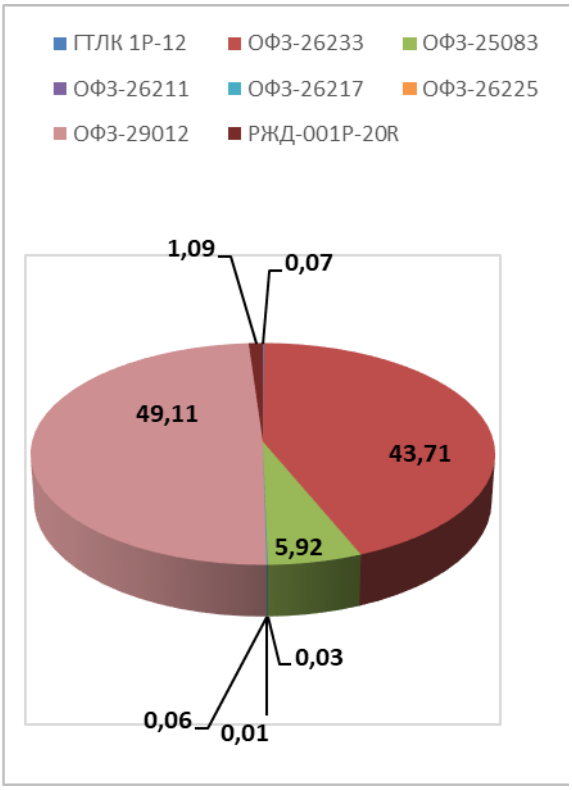
1. Структура портфеля:

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



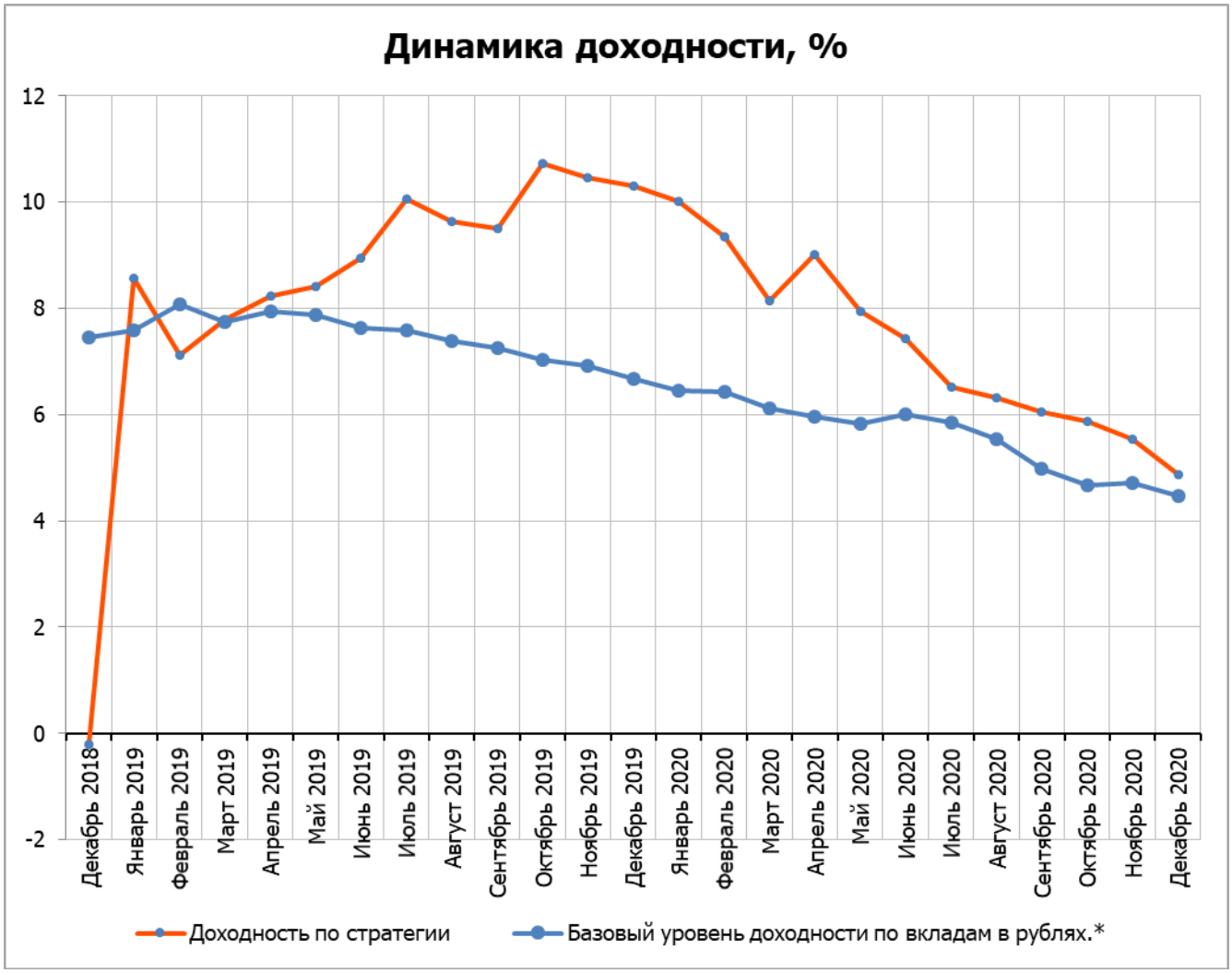
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Структура портфеля Облигаций		
ГТЛК 1Р-12, 4B02-12-32432-H-001P, RU000A0ZZV11	Корпоративная облигация	0,07
ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	43,71
ОФЗ-25083-ПД, 25083RMFS, RU000A0ZYCK6	Государственная облигация	5,92
ОФЗ-26211-ПД, 26211RMFS, RU000A0JTJL3	Государственная облигация	0,03
ОФЗ-26217-ПД, 26217RMFS, RU000A0JVW30	Государственная облигация	0,06
ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7	Государственная облигация	0,01
ОФЗ-29012-ПК, 29012RMFS, RU000A0JX0H6	Государственная облигация	49,11
РЖД-001Р-20R, 4B02-20-65045-D-001P, RU000A101M04	Корпоративная облигация	1,09
ИТОГО		100.00%



** - 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 01.11.2020.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

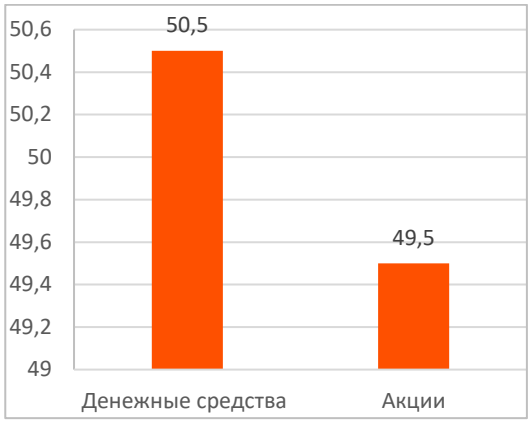
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ

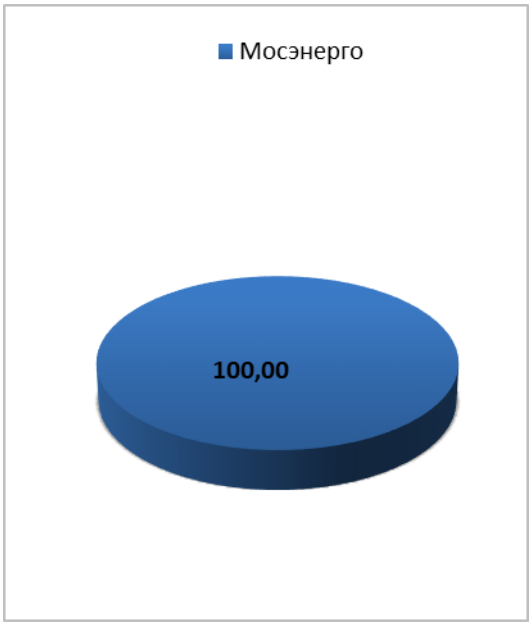
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	50,50%
Акции	49,50%
ИТОГО	100.00%

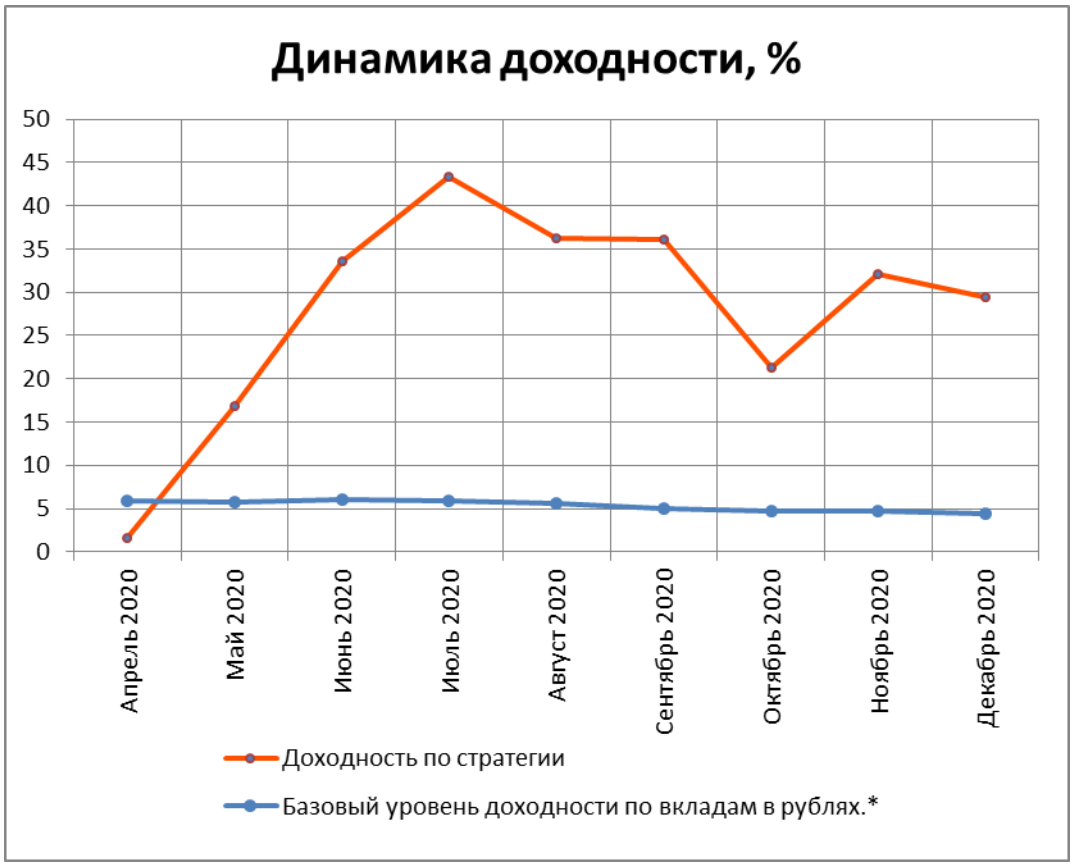


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Структура портфеля Акций		
АО Мосэнерго, 1-01-00085-А, RU0008958863	Акция обыкновенная	100
ИТОГО		100.00



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 01.11.2020.* 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».

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

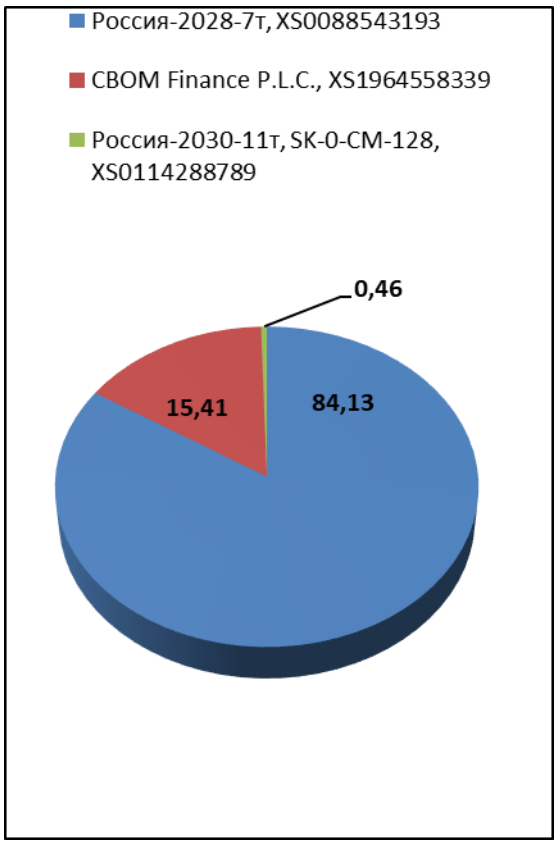
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	7,39%
Еврооблигации	92,61%
ИТОГО	100.00%

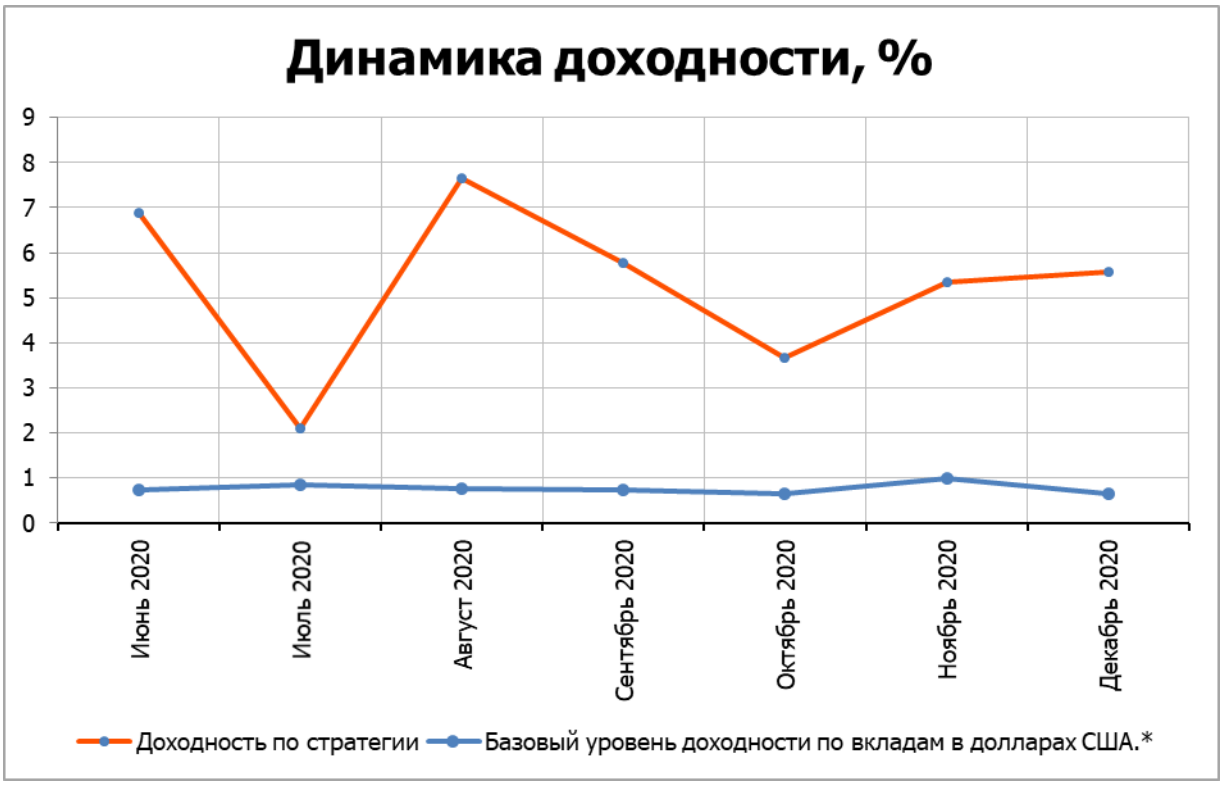


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	84,13
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	15,41
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	0,46
ИТОГО		100.00



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 01.11.2020._
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	12,52%
Еврооблигации	87,48%
ИТОГО	100.00%

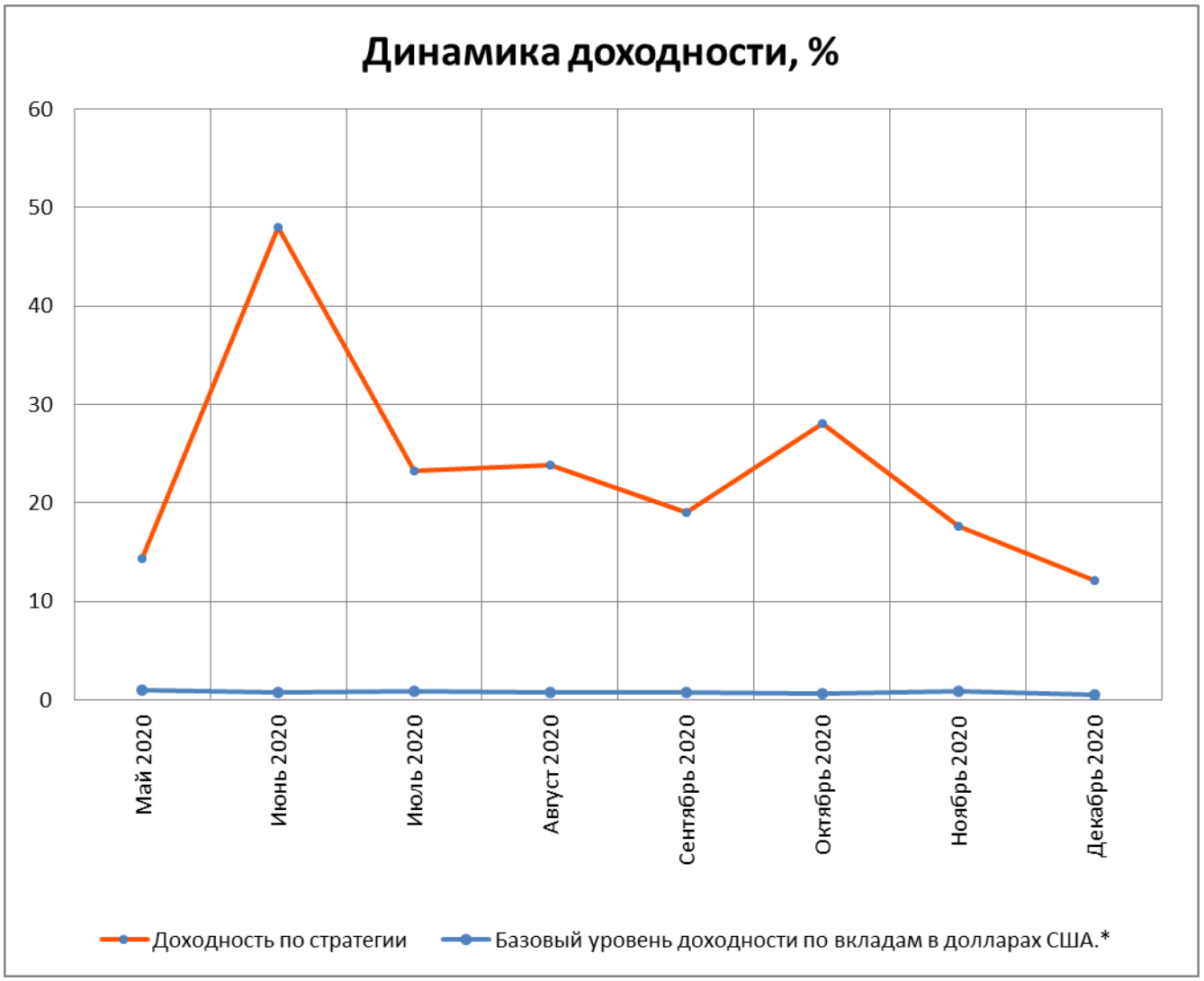


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигация		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (государственная РФ)	54,84
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	14,28
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	30,88
ИТОГО		100.00



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 01.11.2020.* 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».