



РЕЗУЛЬТАТЫ
СТАНДАРТНЫХ
ИНВЕСТИЦИОННЫХ
СТРАТЕГИЙ

04 марта 2021 г.
г. Москва

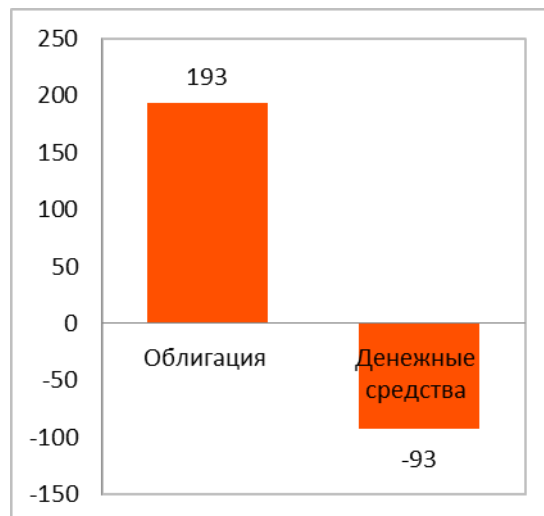
Оглавление

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

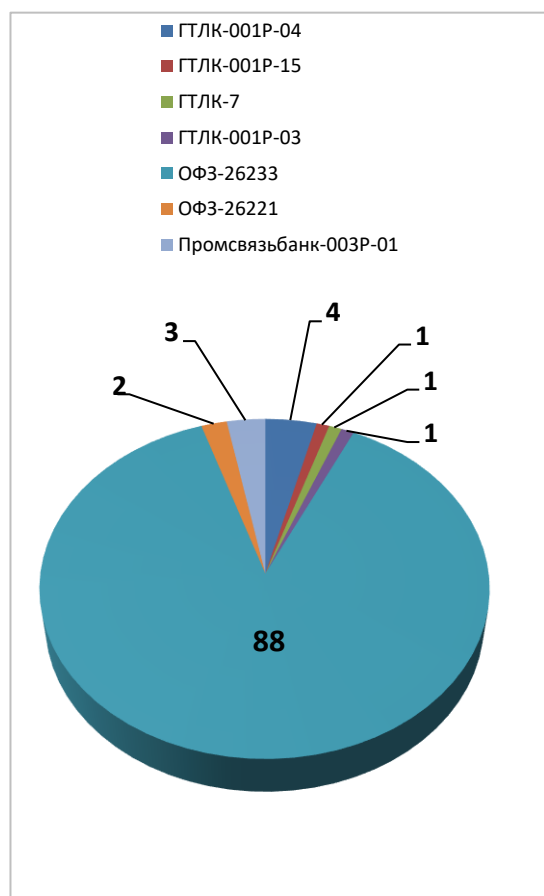
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	193%
Денежные средства*	-93%
ИТОГО	100%



2. Структура портфеля инструментов:

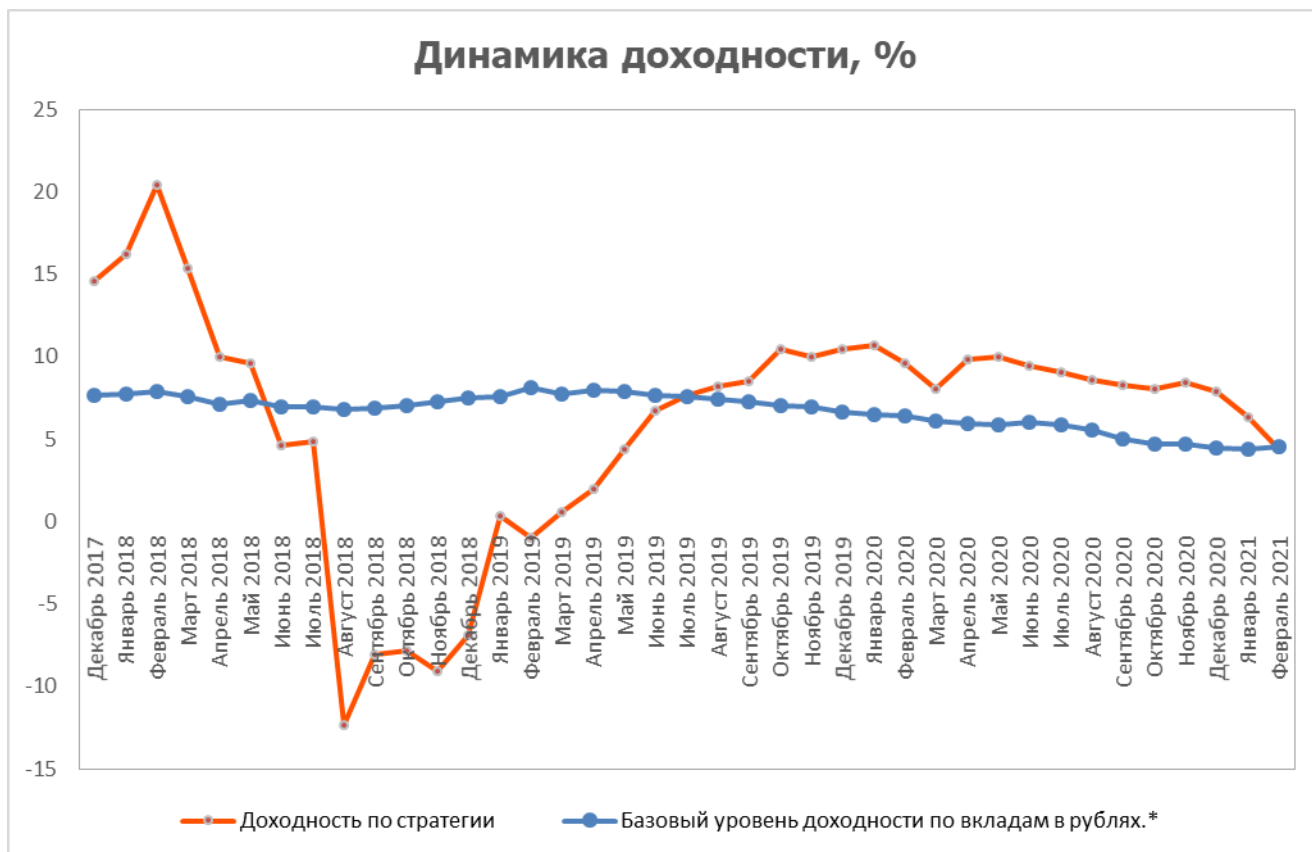
Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001P-04, 4B02-04-32432-H-001P, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	4
ГТЛК-001P-15, 4B02-15-32432-H-001P, RU000A100Z91	Корпоративная облигация	1
ГТЛК-7, 4B02-07-32432-H, RU000A0JW1P8	Корпоративная облигация	1
ГТЛК-001P-03, 4B02-03-32432-H-001P, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	1
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	88
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	2
Промсвязьбанк-003P-01, 4B02-01-03251-B-003P, RU000A101U38	Корпоративная облигация	3
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:



*Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлёкшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2021.

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

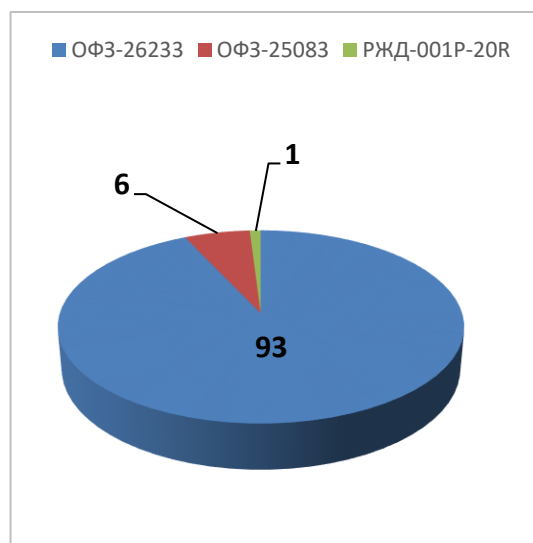
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	100%
Денежные средства*	0%
ИТОГО	100%



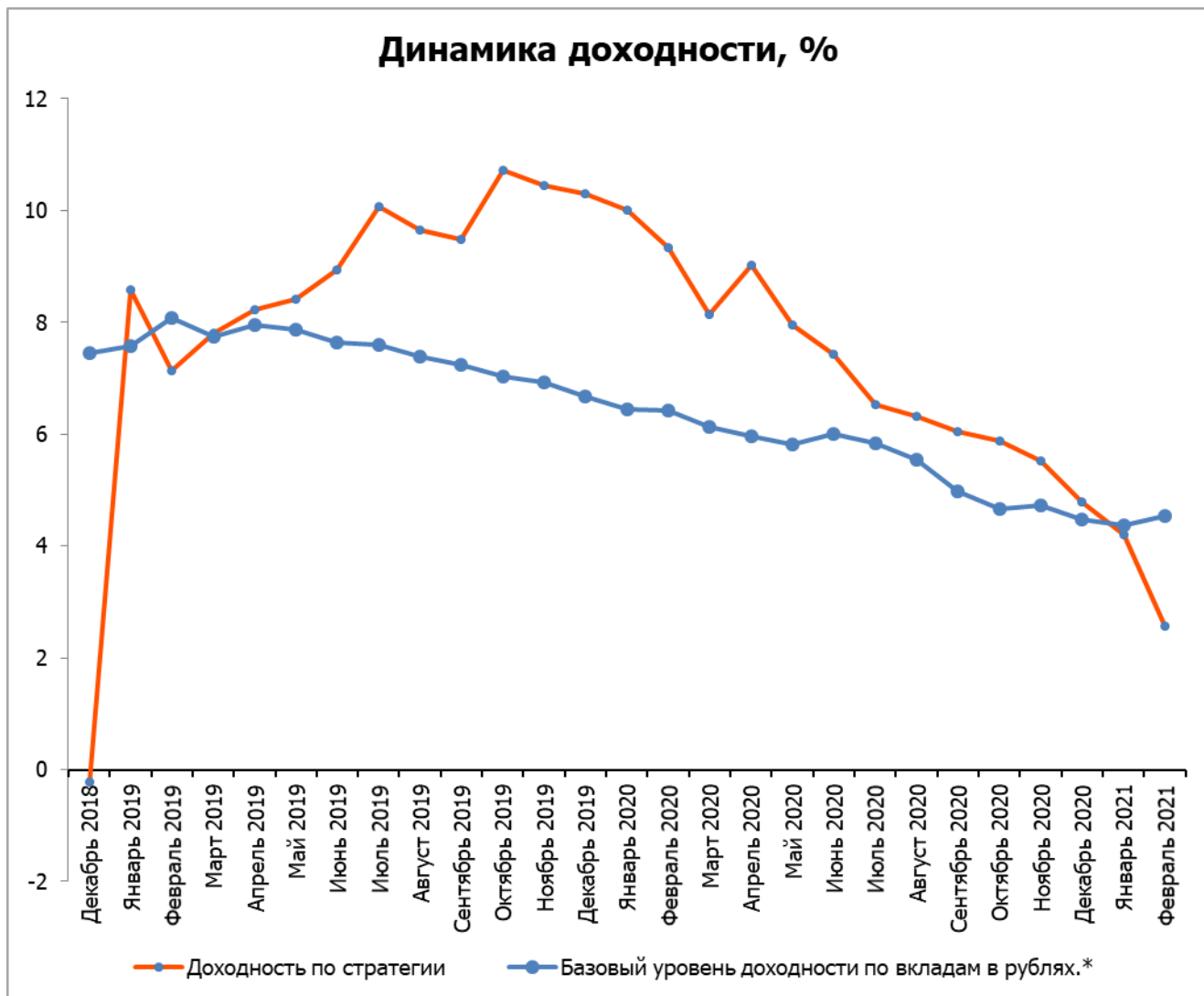
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	93
ОФЗ-25083-ПД, 25083RMFS, RU000A0ZYCK6	Государственная облигация	6
РЖД-001P-20R, 4B02-20-65045-D-001P, 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, привлёкшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2021.

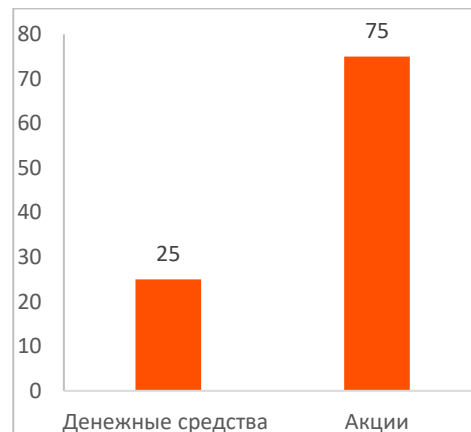
http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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».

АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ

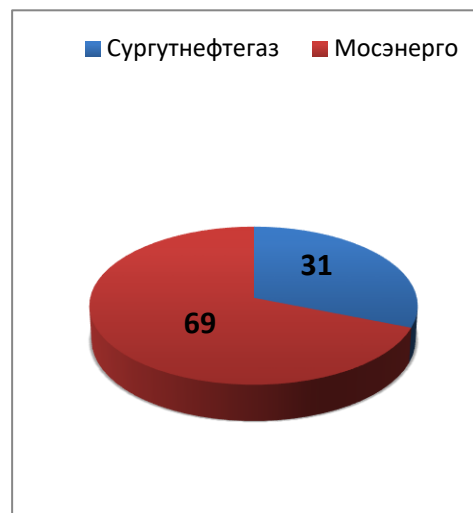
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	25%
Акции	75%
ИТОГО	100%

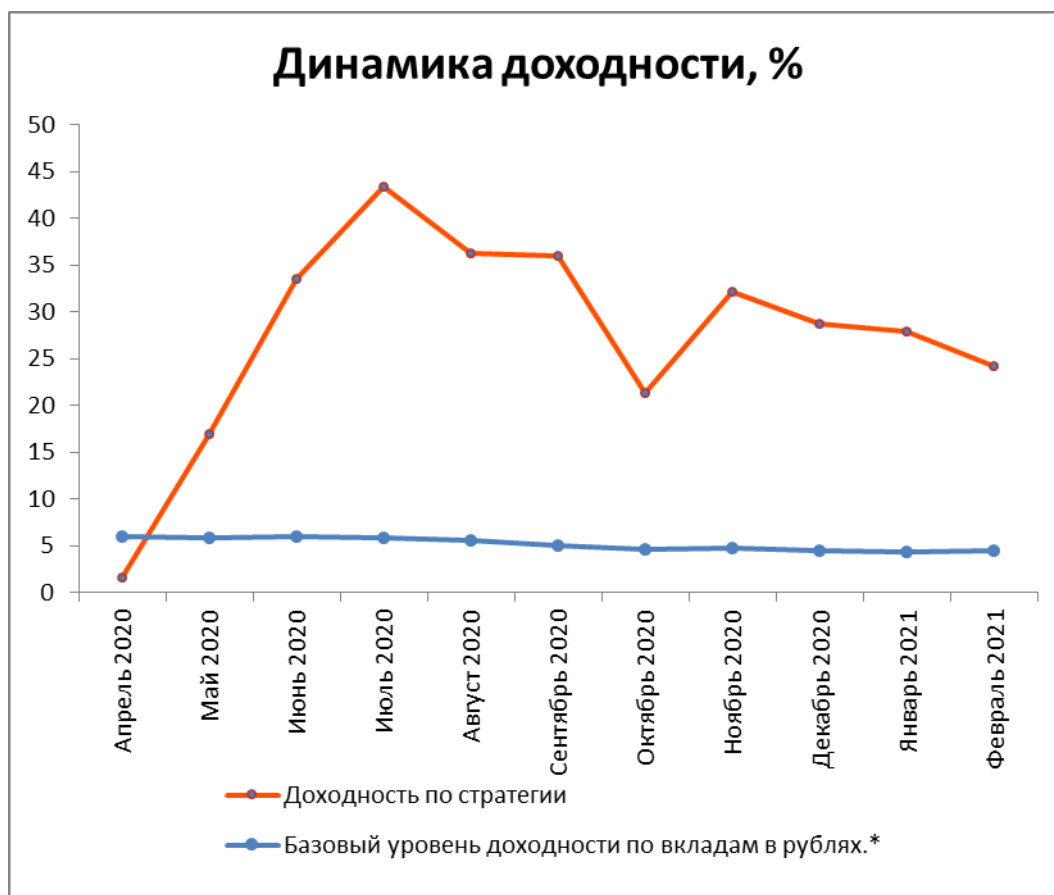


2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Акции		
АПИ Сургутнефтегаз, 2-01-00155-А, RU0009029524	Акция привилегированная	31
АО Мосэнерго, 1-01-00085-А, RU0008958863	Акция обыкновенная	69
ИТОГО		100%



3. Динамика доходности:



*Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлёкшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2021.

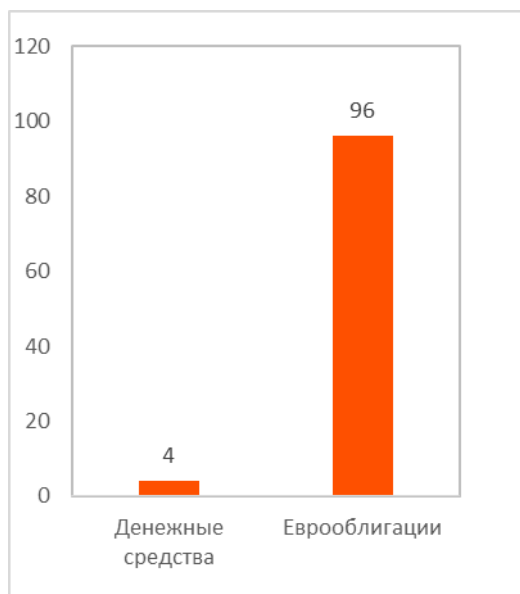
http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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

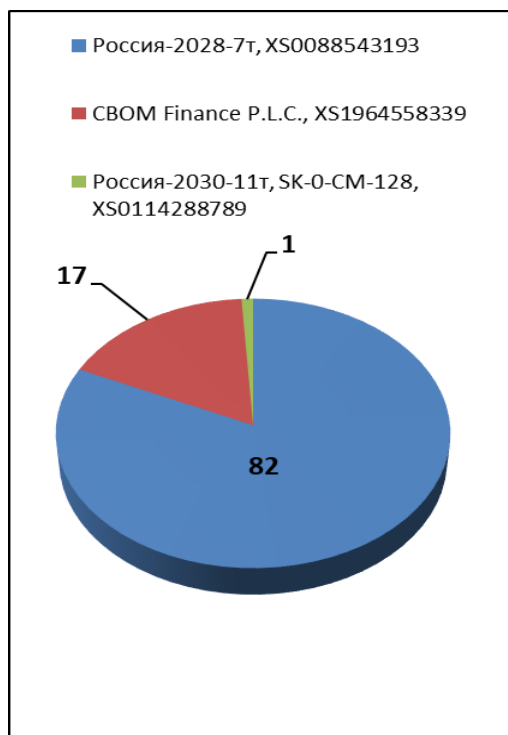
1. Структура портфеля:

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

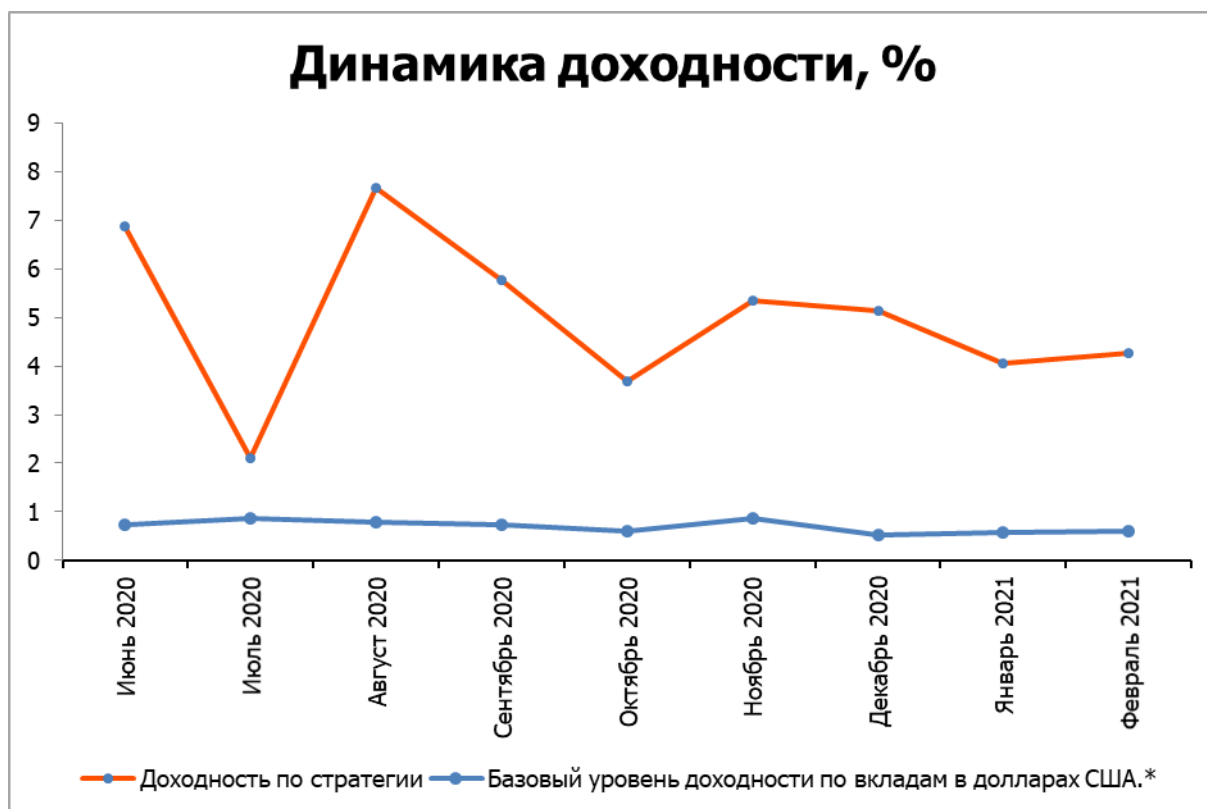


2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	82
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	17
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, привлёкшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2021.*

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

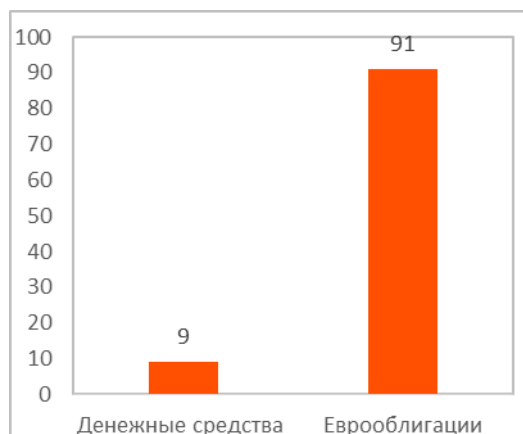
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

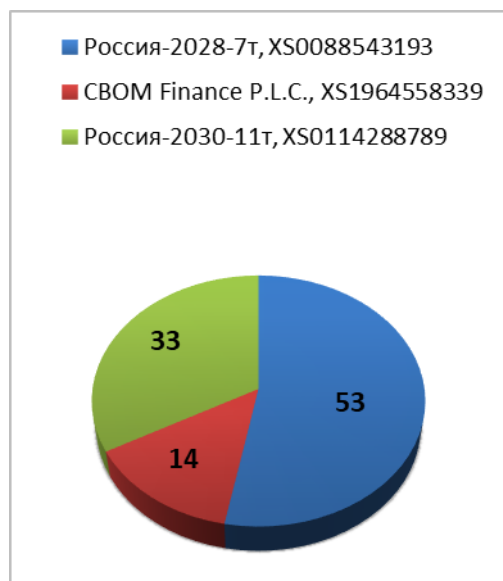
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	9%
Еврооблигации	91%
ИТОГО	100%

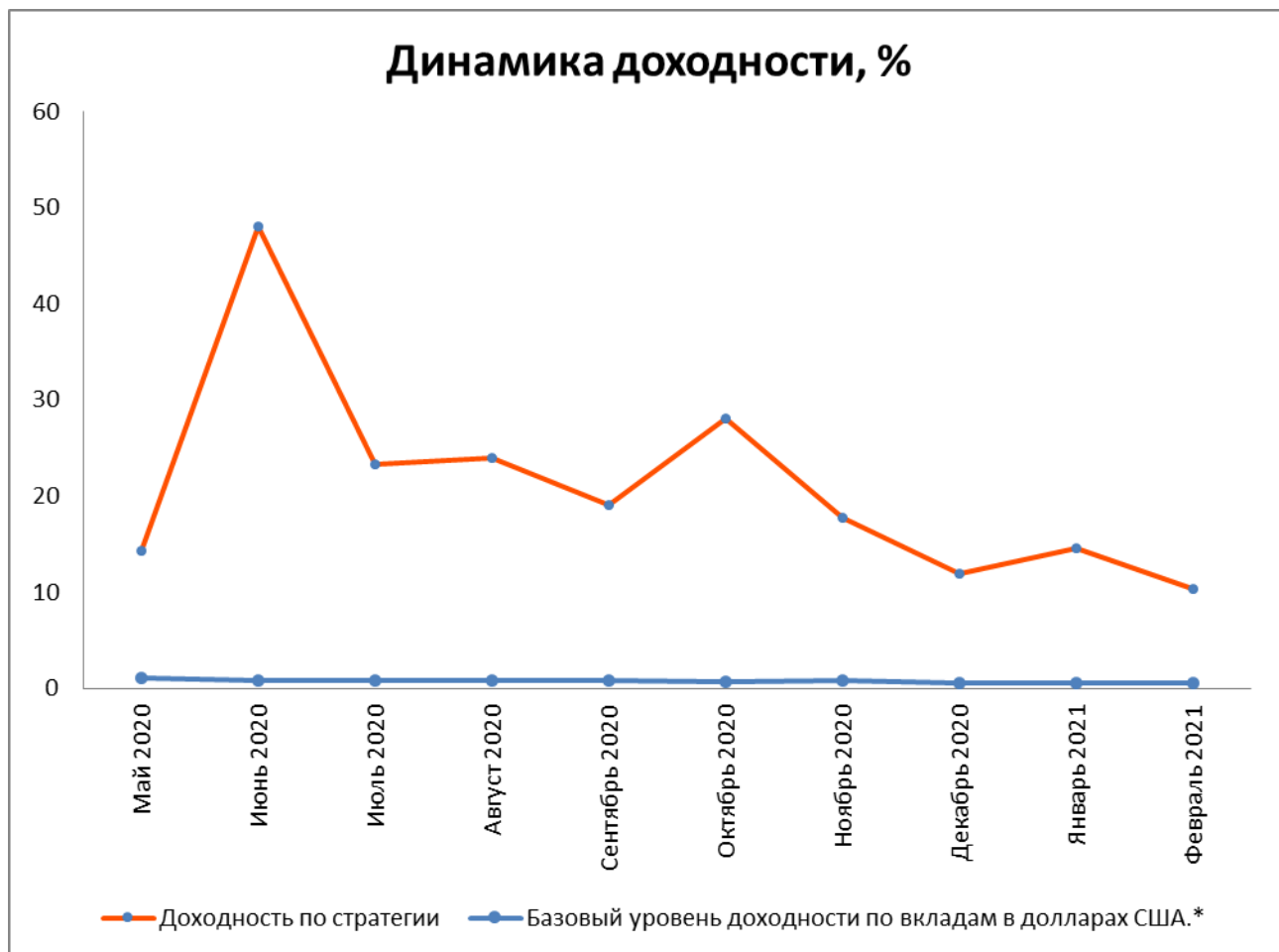


2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (государственная РФ)	53
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	14
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	33
ИТОГО		100%



3.Динамика доходности:



*Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлёкшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2021.

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».