



РЕЗУЛЬТАТЫ  
СТАНДАРТНЫХ  
ИНВЕСТИЦИОННЫХ  
СТРАТЕГИЙ

06 апреля 2021 г.  
г. Москва

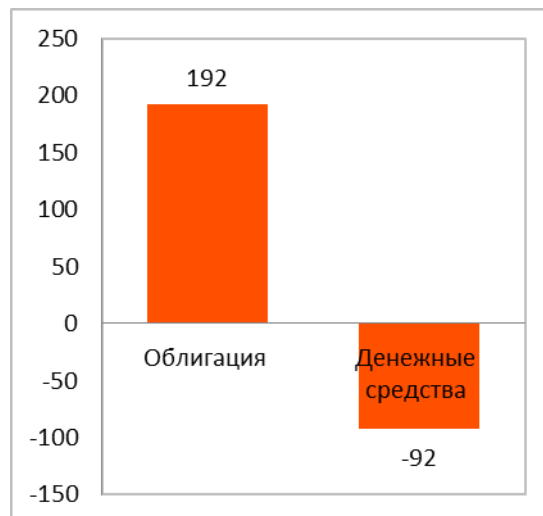
## Оглавление

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

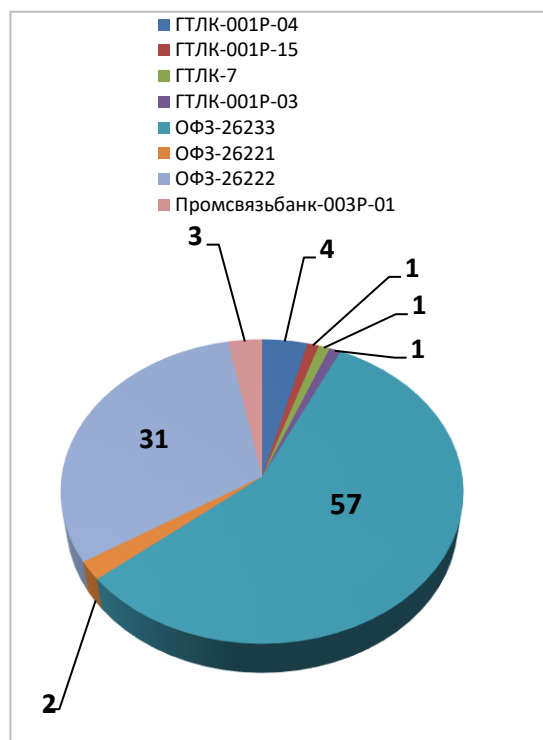
## 1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	192%
Денежные средства*	-92%
<b>ИТОГО</b>	<b>100%</b>



## 2. Структура портфеля инструментов:

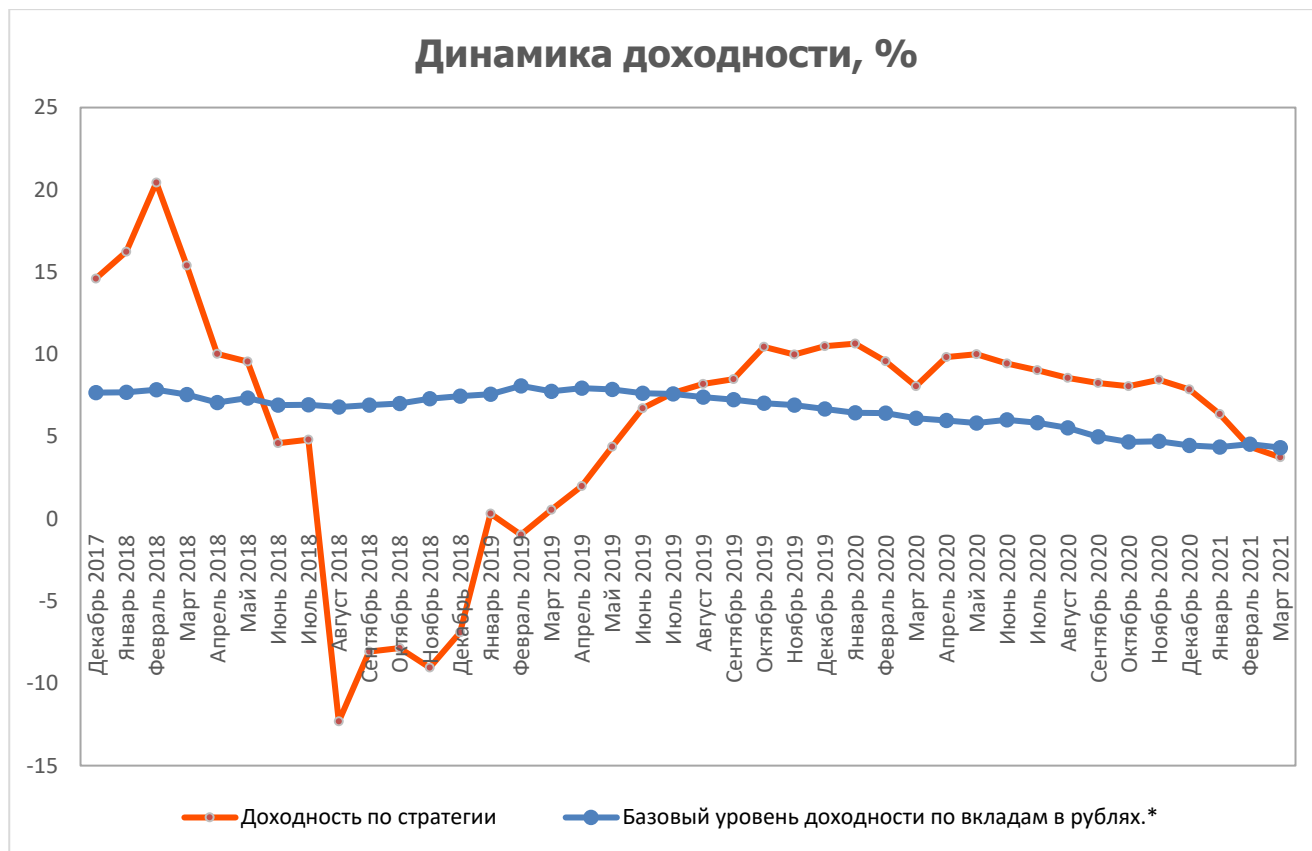
Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001P-04, 4B02-04-32432-H-001P, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	4
ГТЛК-001P-15, 4B02-15-32432-H-001P, RU000A100Z91	Корпоративная облигация	1
ГТЛК-7, 4B02-07-32432-H, RU000A0JW1P8	Корпоративная облигация	1
ГТЛК-001P-03, 4B02-03-32432-H-001P, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	1
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	57
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	31
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	2
Промсвязьбанк-003P-01, 4B02-01-03251-B-003P, RU000A101U38	Корпоративная облигация	3
<b>ИТОГО</b>		<b>100%</b>



\* - 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 01.02.2021.

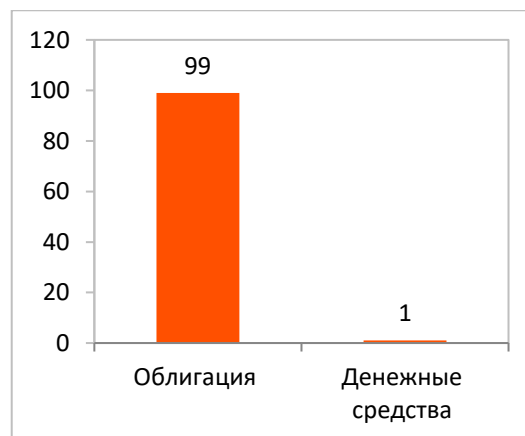
[http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv\\_2020-10.pdf](http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf);

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

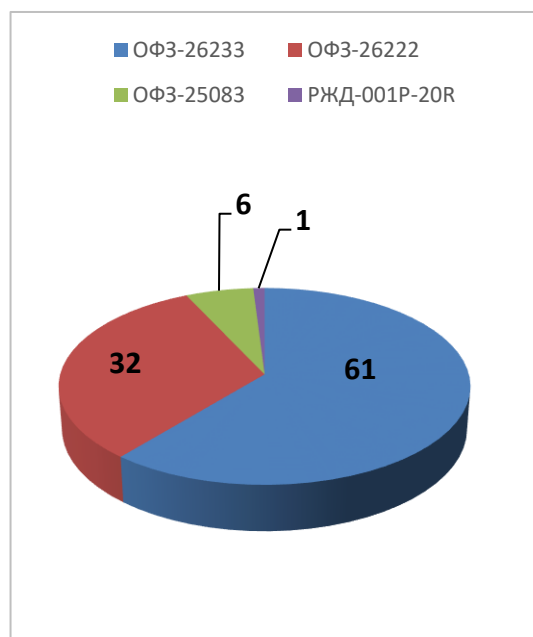
### 1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	99%
Денежные средства*	1%
<b>ИТОГО</b>	<b>100%</b>



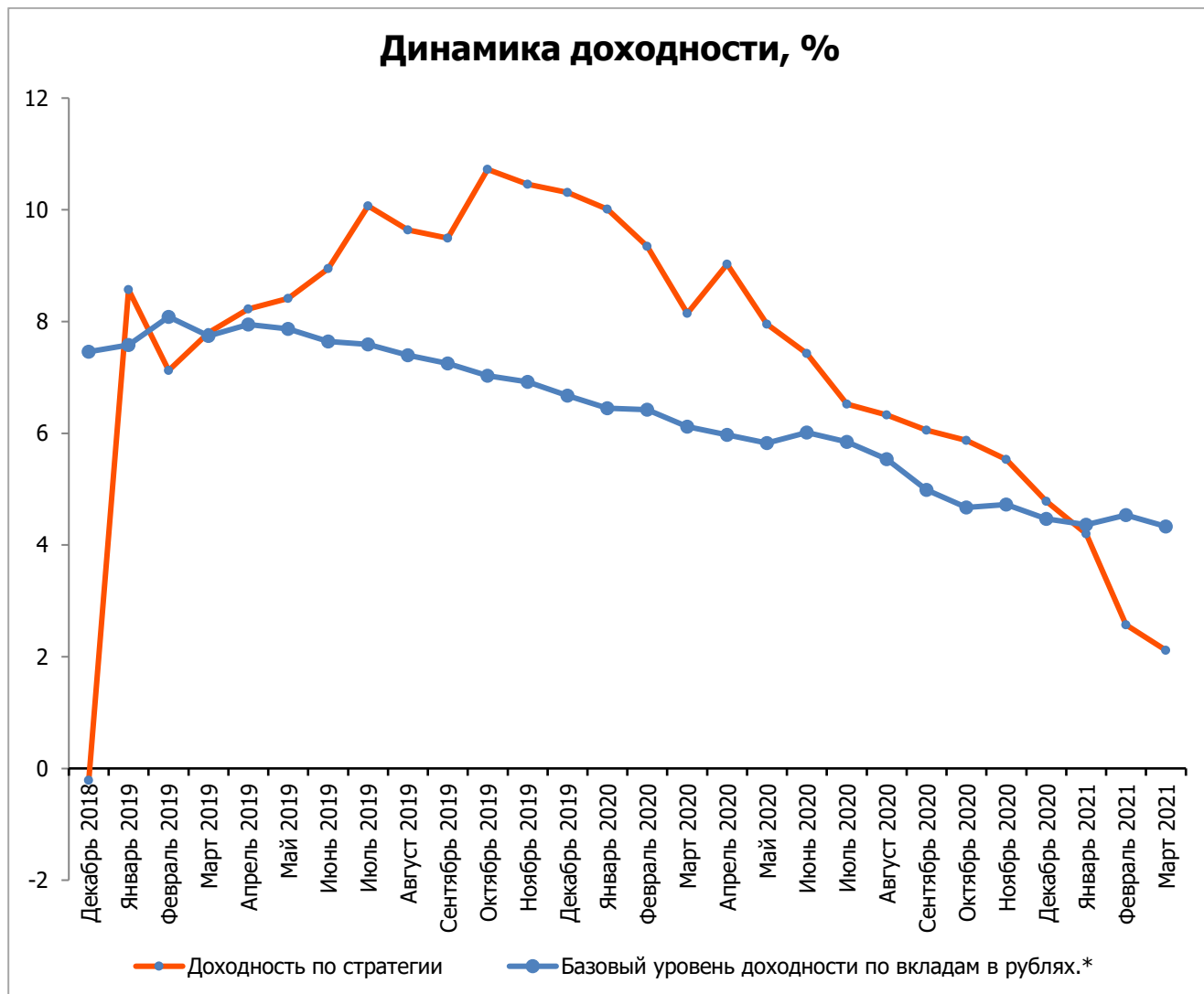
### 2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	61
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	32
ОФЗ-25083-ПД, 25083RMFS, RU000A0ZYCK6	Государственная облигация	6
РЖД-001P-20R, 4B02-20-65045-D-001P, RU000A101M04	Корпоративная облигация	1
<b>ИТОГО</b>		<b>100%</b>



\* - 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 01.02.2021.

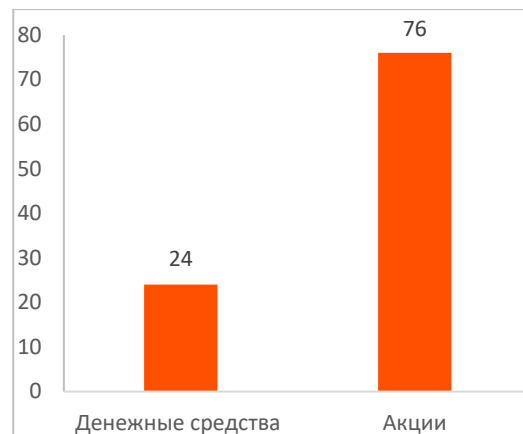
[http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budy\\_2020-10.pdf](http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budy_2020-10.pdf)

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

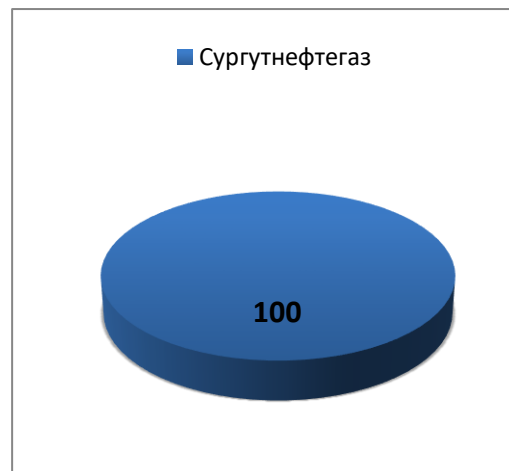
### 1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	24%
Акции	76%
<b>ИТОГО</b>	<b>100%</b>

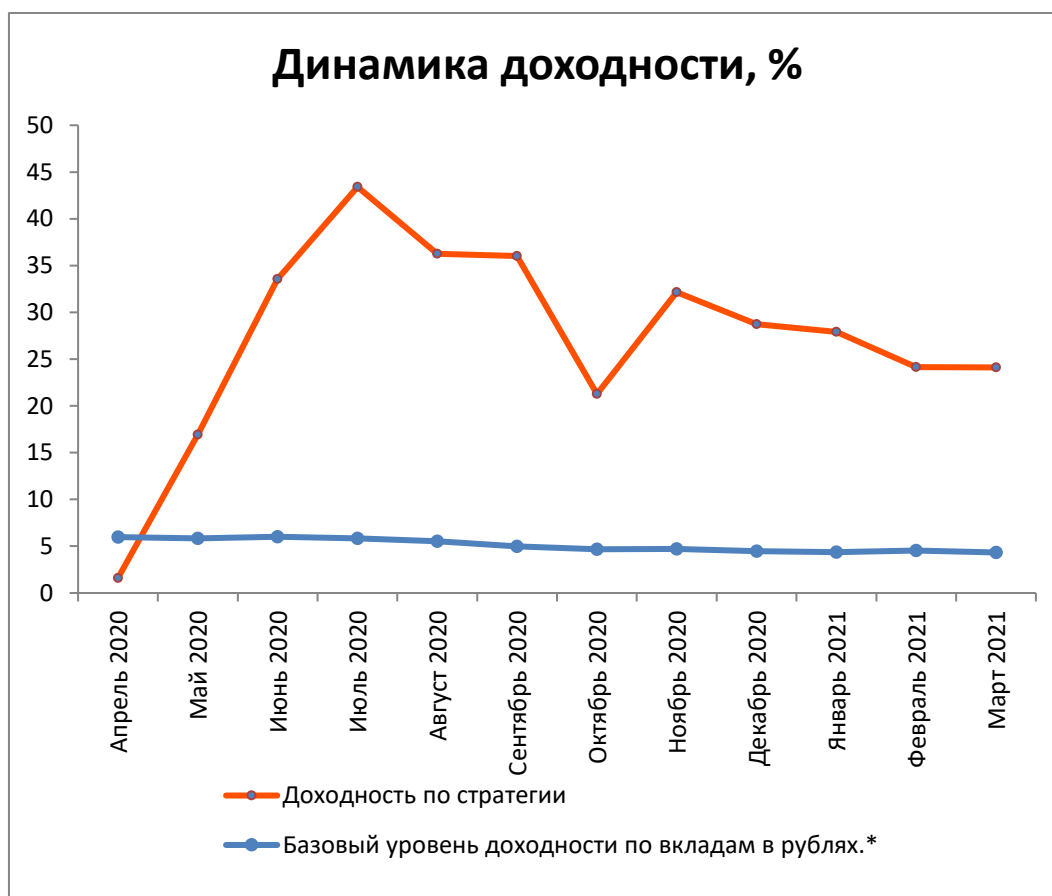


### 2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Акции		
АПИ Сургутнефтегаз, 2-01-00155-А, RU0009029524	Акция привилегированная	100
<b>ИТОГО</b>		<b>100%</b>



### 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 01.02.2021.

[http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv\\_2020-10.pdf](http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf);

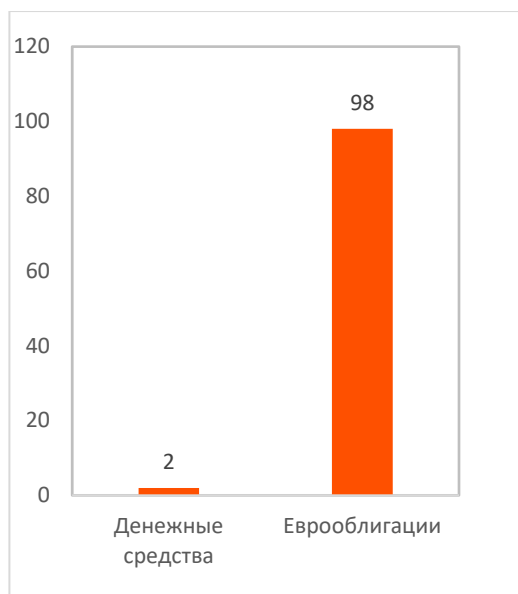
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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



## ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

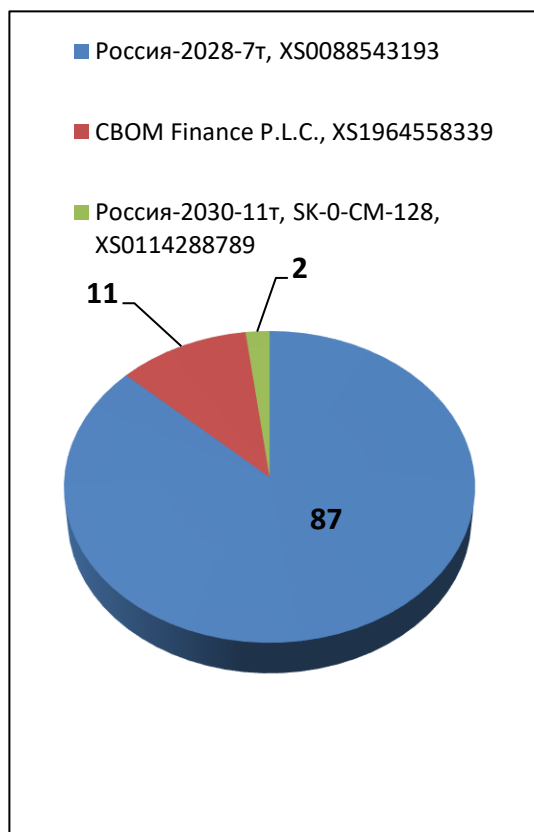
## 1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	2%
Еврооблигации	98%
<b>ИТОГО</b>	<b>100%</b>

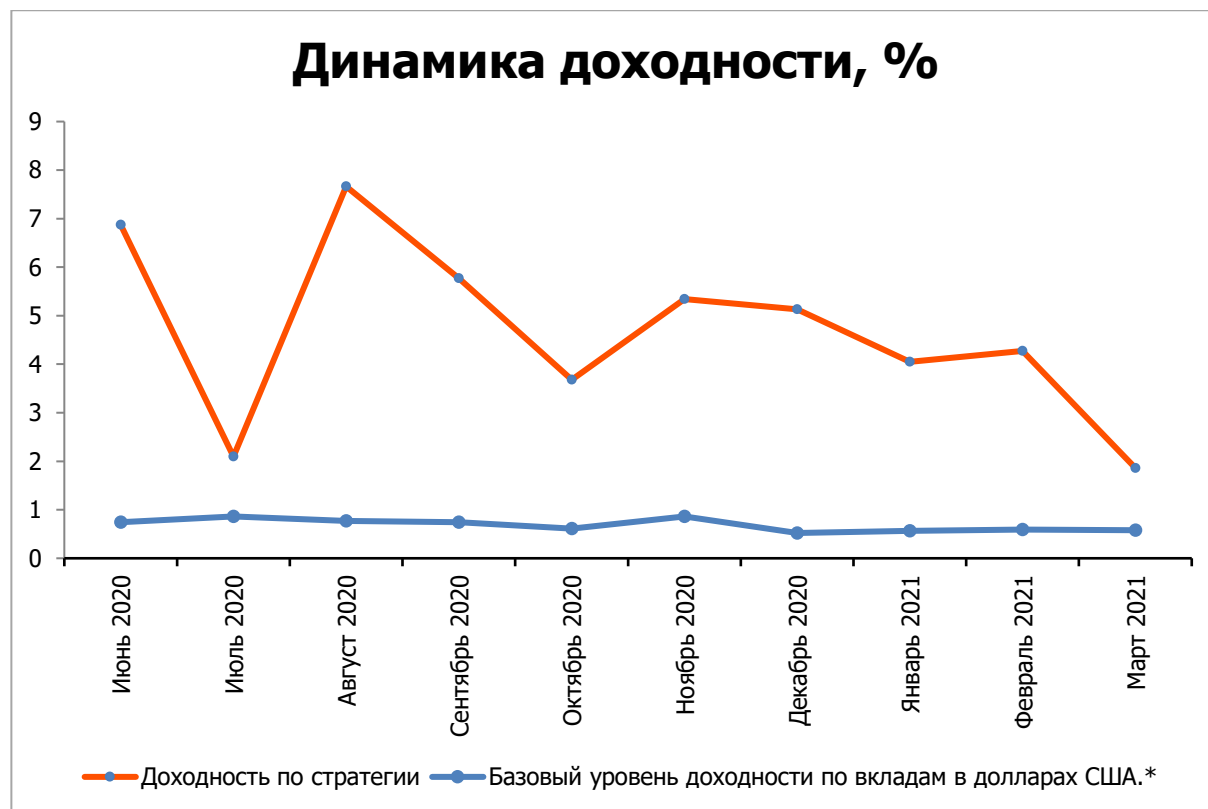


## 2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	87
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	11
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	2
<b>ИТОГО</b>		<b>100%</b>



### 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 01.02.2021.*

[http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv\\_2020-10.pdf](http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf)

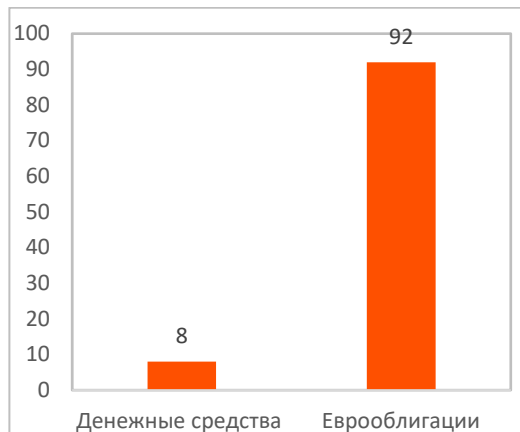
*Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными 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	8%
Еврооблигации	92%
<b>ИТОГО</b>	<b>100%</b>

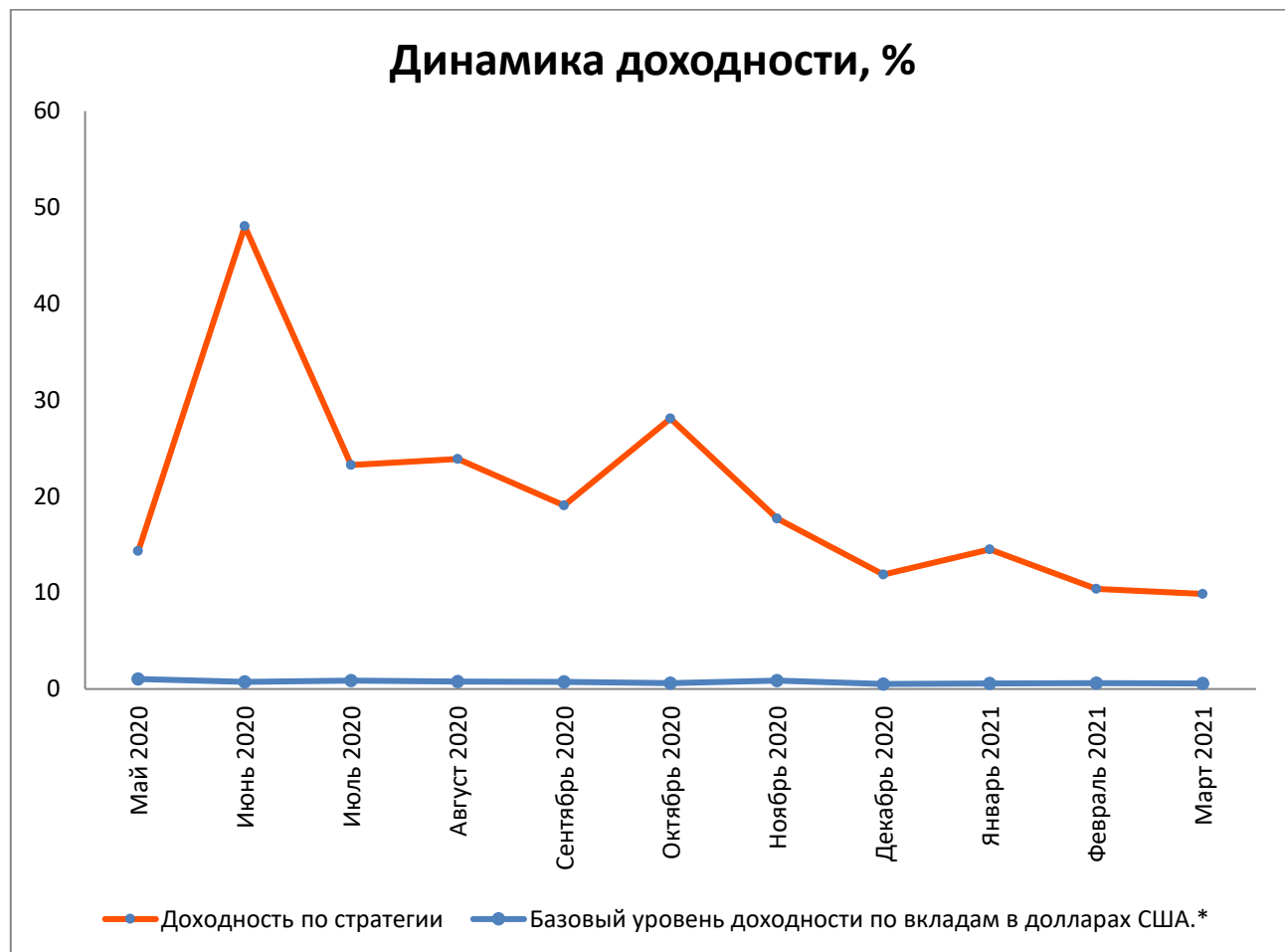


#### 2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193	Еврооблигация (государственная РФ)	57
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	15
Россия-2030-11т, SK-0-СМ-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	28
<b>ИТОГО</b>		<b>100%</b>



### 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 01.02.2021.  
[http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv\\_2020-10.pdf](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».