ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АТБ Азиатско-Тихоокеанский Банк

РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

08 декабря 2023 г.
г. Москва

Оглавление

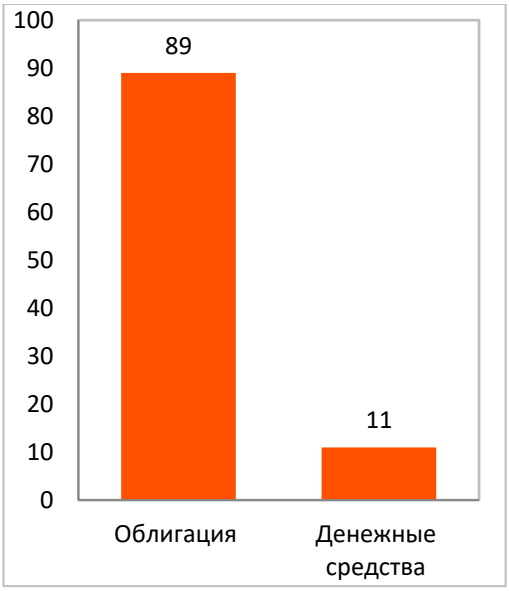
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД 3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС 5
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ 7
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС 9

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

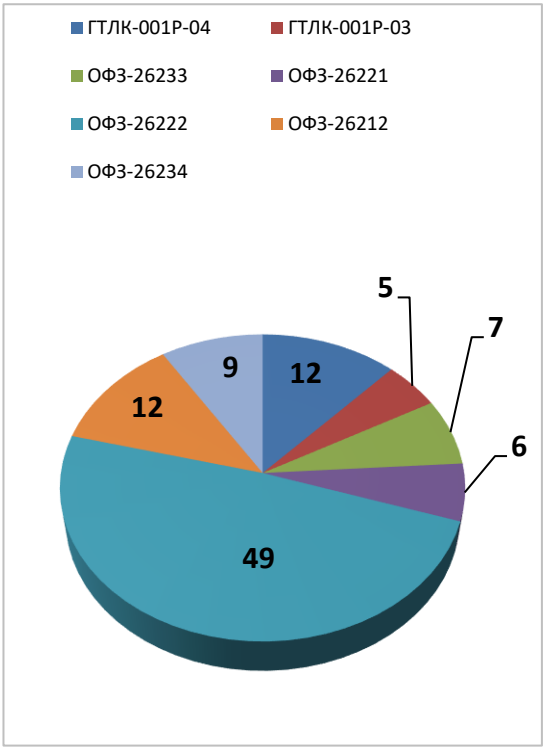
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	89%
Денежные средства*	11%
ИТОГО	100%



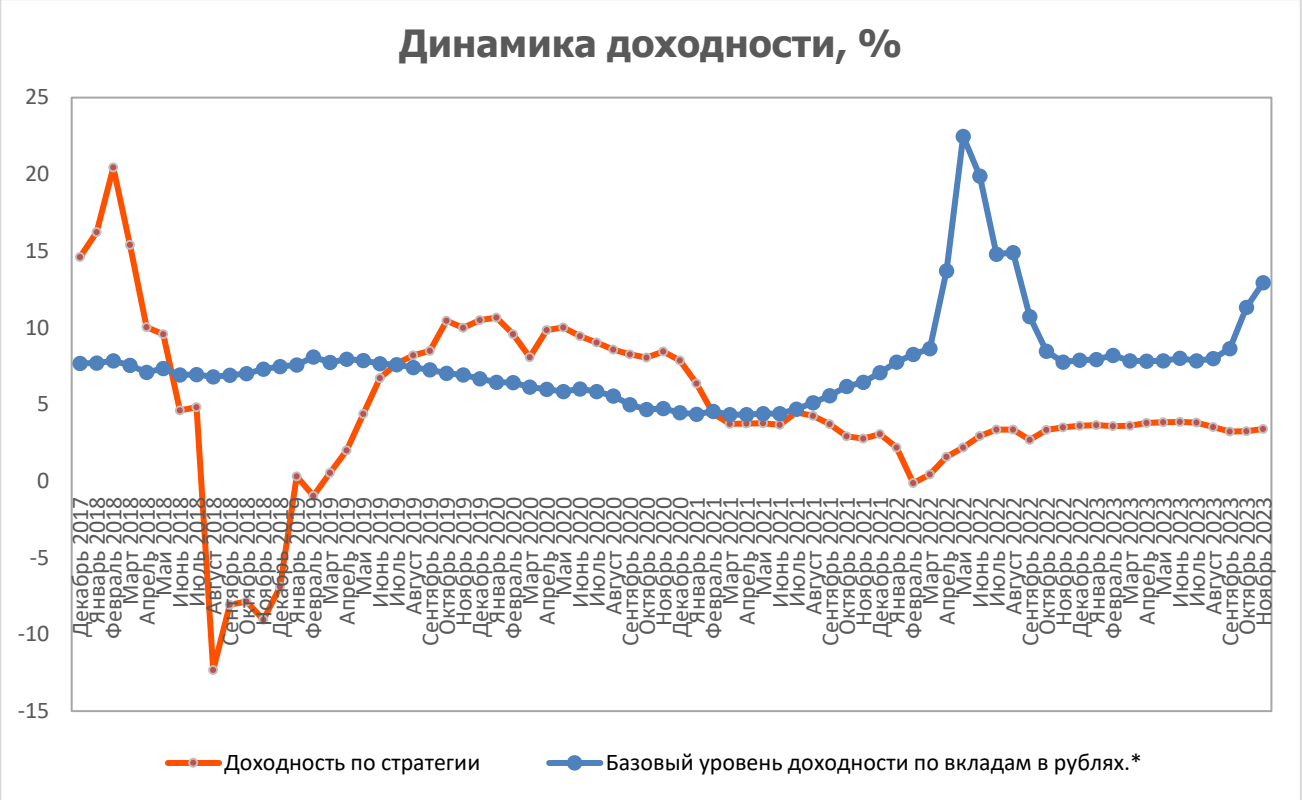
2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001Р-04, 4В02-04-32432-Н-001Р, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	12
ГТЛК-001Р-03, 4В02-03-32432-Н-001Р, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	5
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	7
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	49
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	6
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	12
ОФЗ-26234-ПД, 26234RMFS, RU000A101QE0	Государственная облигация	9
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 01.10.2023.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

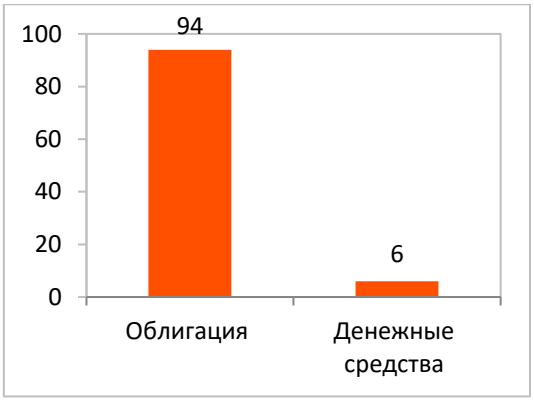
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС

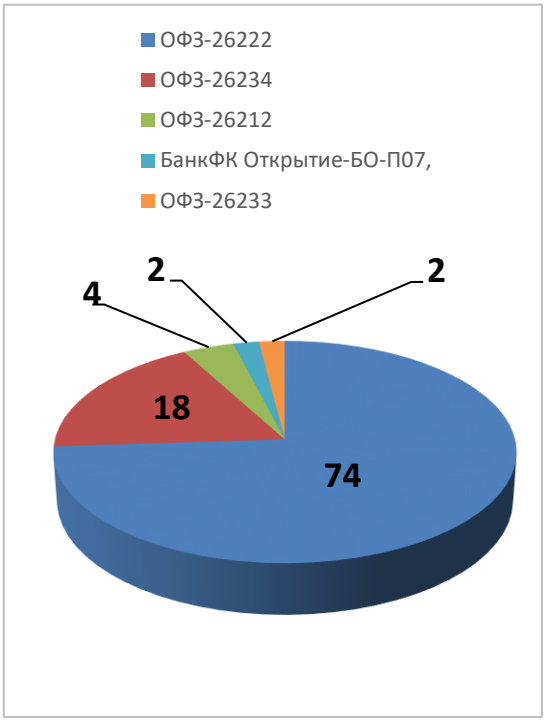
1.Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	94%
Денежные средства*	6%
ИТОГО	100%



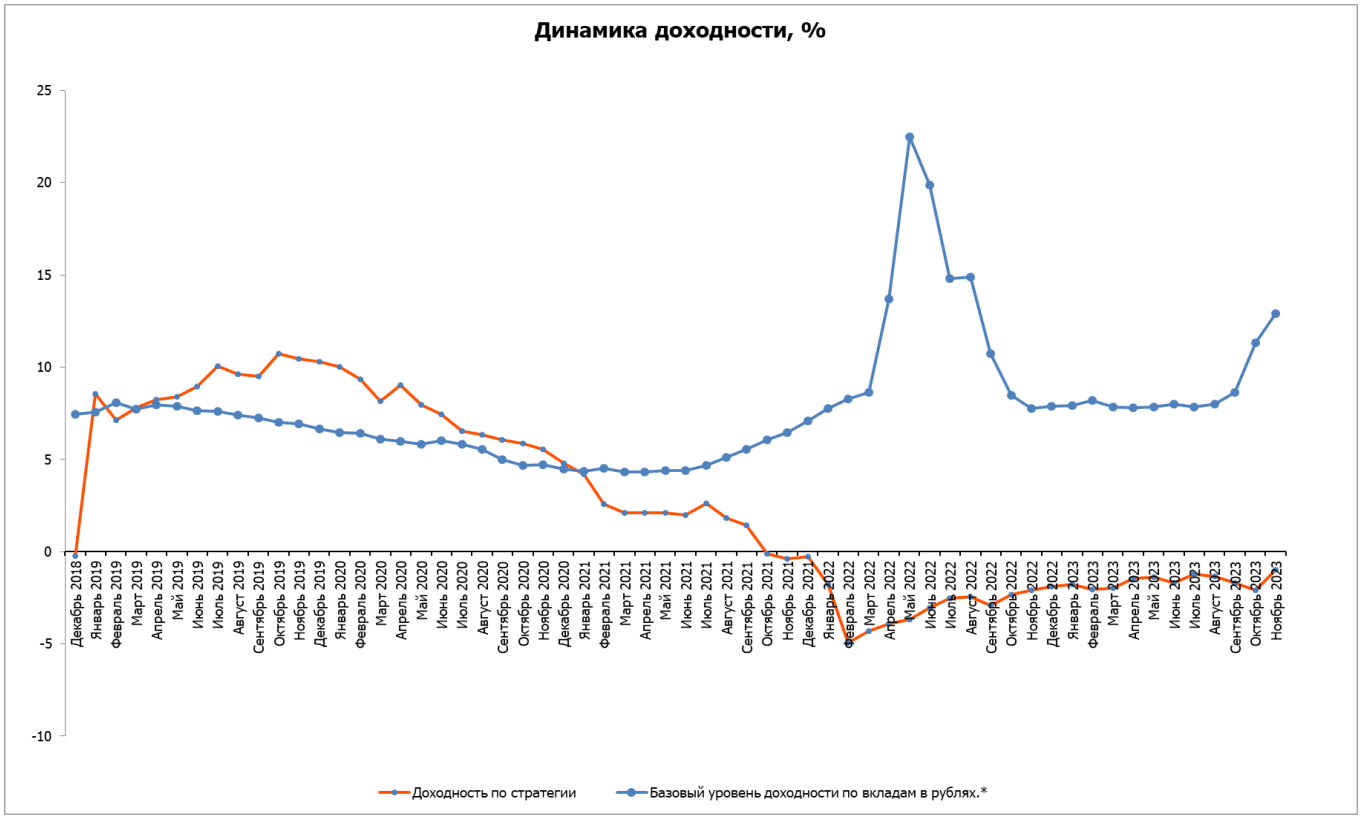
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	74
ОФЗ-26234-ПД, 26234RMFS, RU000A101QE0	Государственная облигация	18
БанкФК Открытие-БО-П07, 4B02-14-02209-B-001P, RU000A102R73	Корпоративная облигация	2
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	4
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	2
ИТОГО		100%



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

2. Динамика доходности:



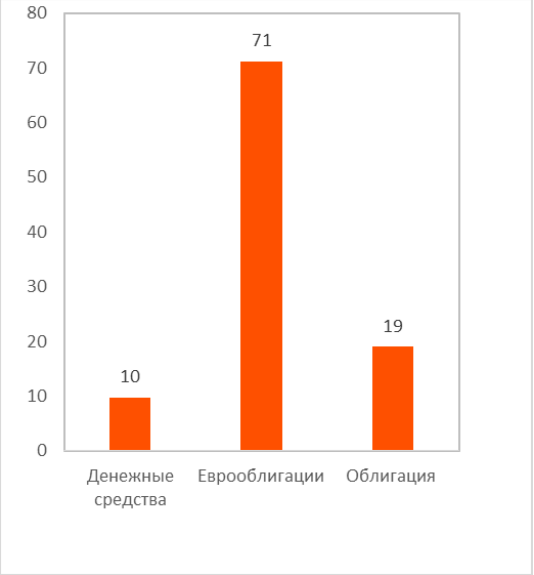
*****_Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.10.2023._ http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

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

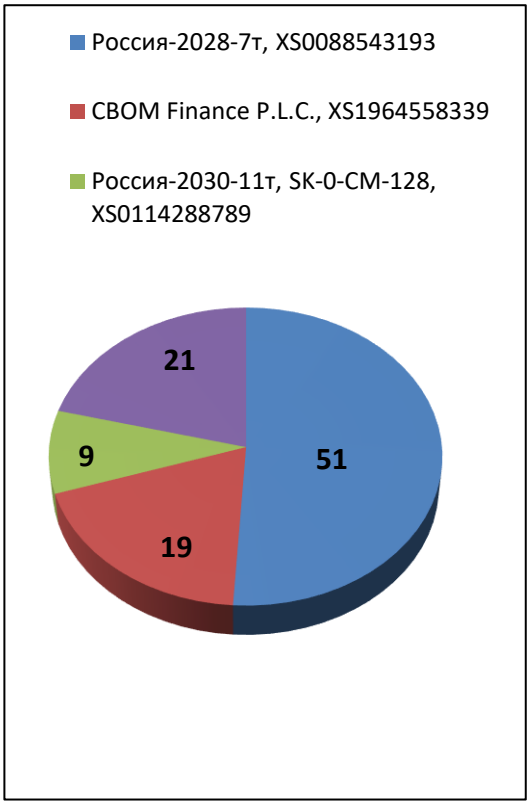
1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	10%
Еврооблигации	71%
Облигация	19%
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.)	51
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	19
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	9
Облигации		
Газпром капитал-ЗО30-1-Д, 4-13-36400-R-003P, RU000A105SG2	Корпоративная облигация	21
ИТОГО		100%



ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

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 01.10.2023.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

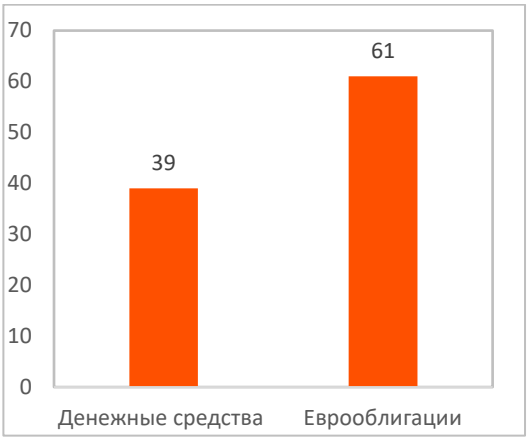
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными 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

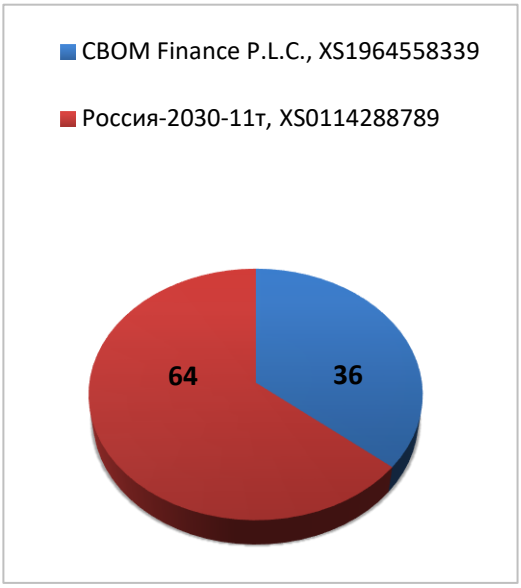
1.Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	39%
Еврооблигации	61%
ИТОГО	100%

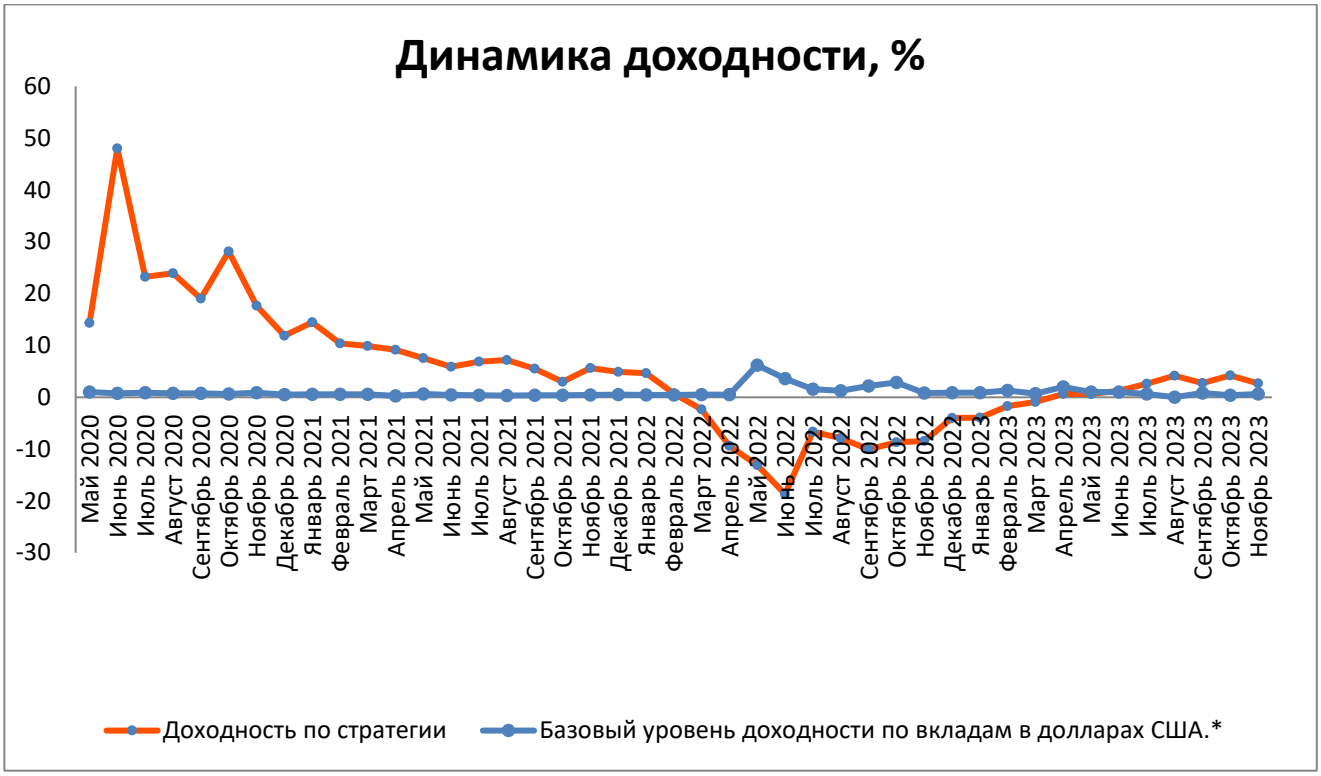


2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Еврооблигации		
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	36
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	64
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 01.10.2023.* 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».