ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АТБ Азиатско-Тихоокеанский Банк

РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

05 декабря 2022 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

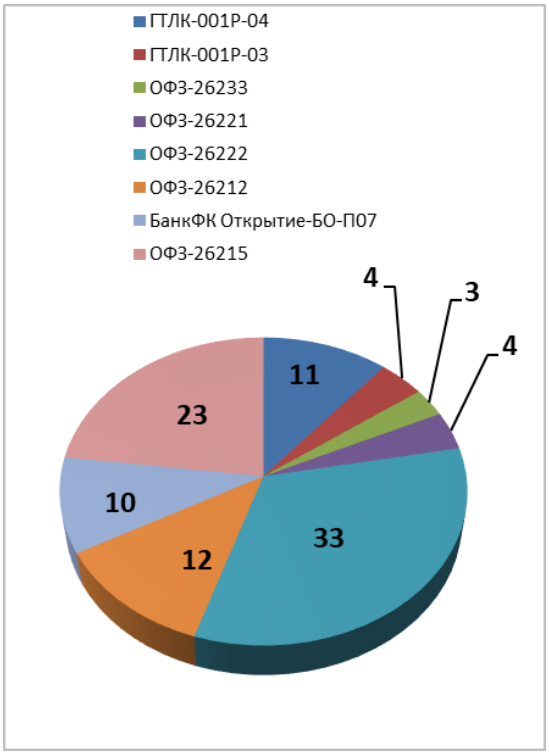
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Облигации	97%
Денежные средства*	3%
ИТОГО	100%

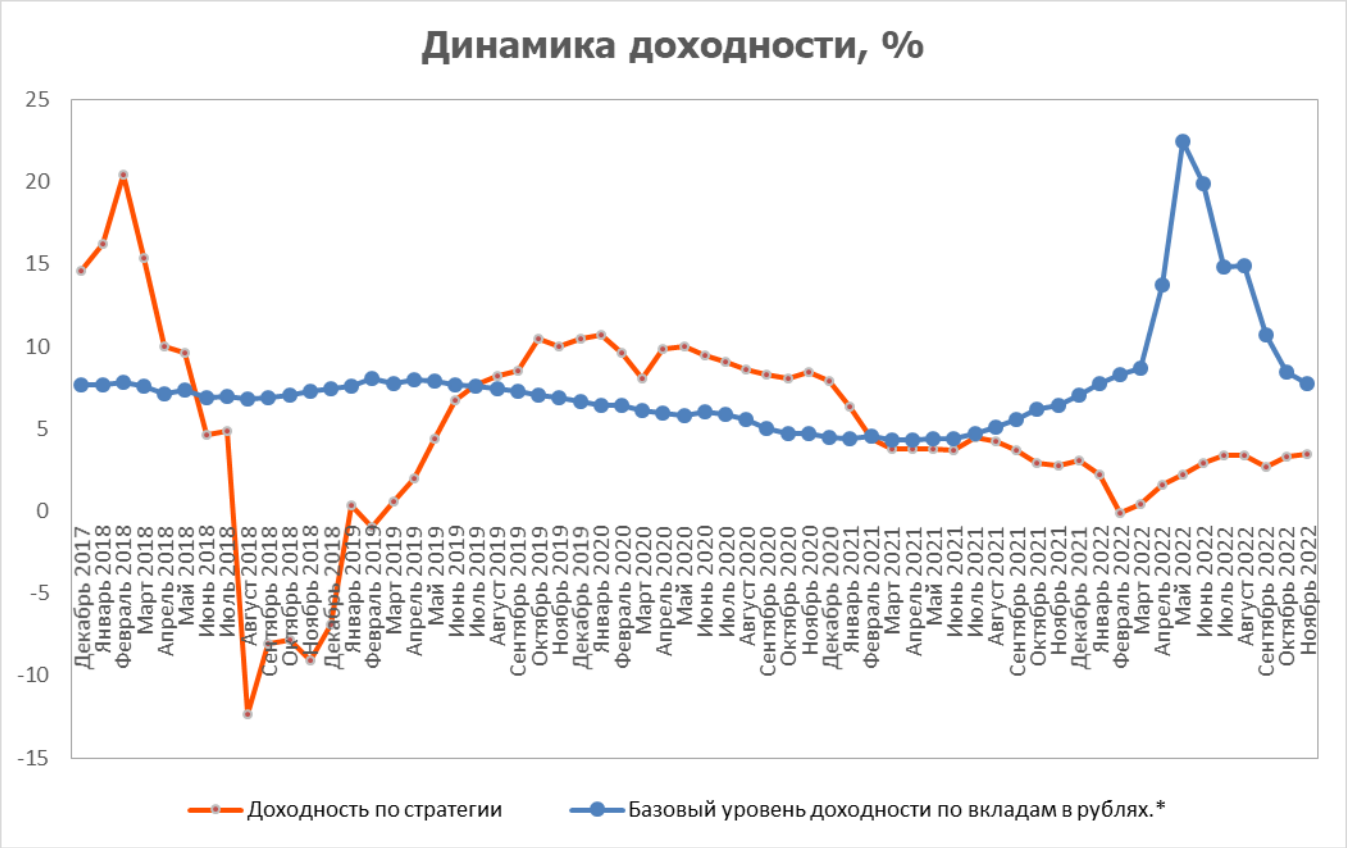
2.Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Облигации		
ГТЛК-001Р-04, 4В02-04-32432-Н-001Р, RU000A0JXPG2	Корпоративная облигация	11
ГТЛК-001Р-03, 4В02-03-32432-Н-001Р, RU000A0JXE06	Корпоративная облигация	4
ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94	Государственная облигация	3
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	33
ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1	Государственная облигация	4
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	12
БанкФК Открытие-БО-П07, 4В02-14-02209-В-001Р, RU000A102R73	Корпоративная облигация	10
ОФЗ-26215-ПД, 26215RMFS, RU000A0JU4L3	Государственная облигация	23
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 01.10.2022.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

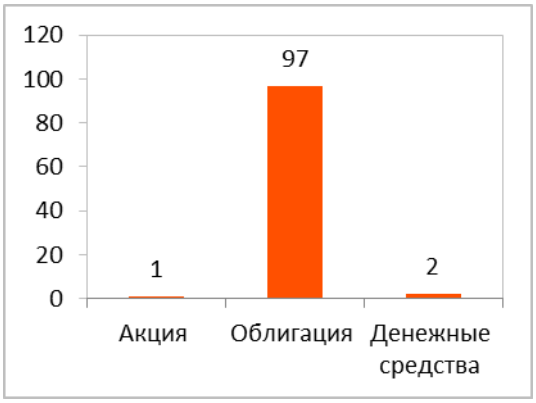
Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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

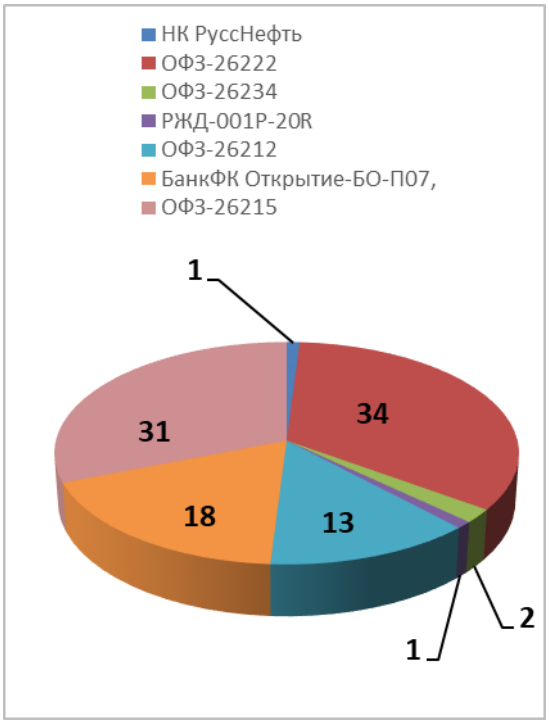
1.Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Акции	1%
Облигации	97%
Денежные средства*	2%
ИТОГО	100%



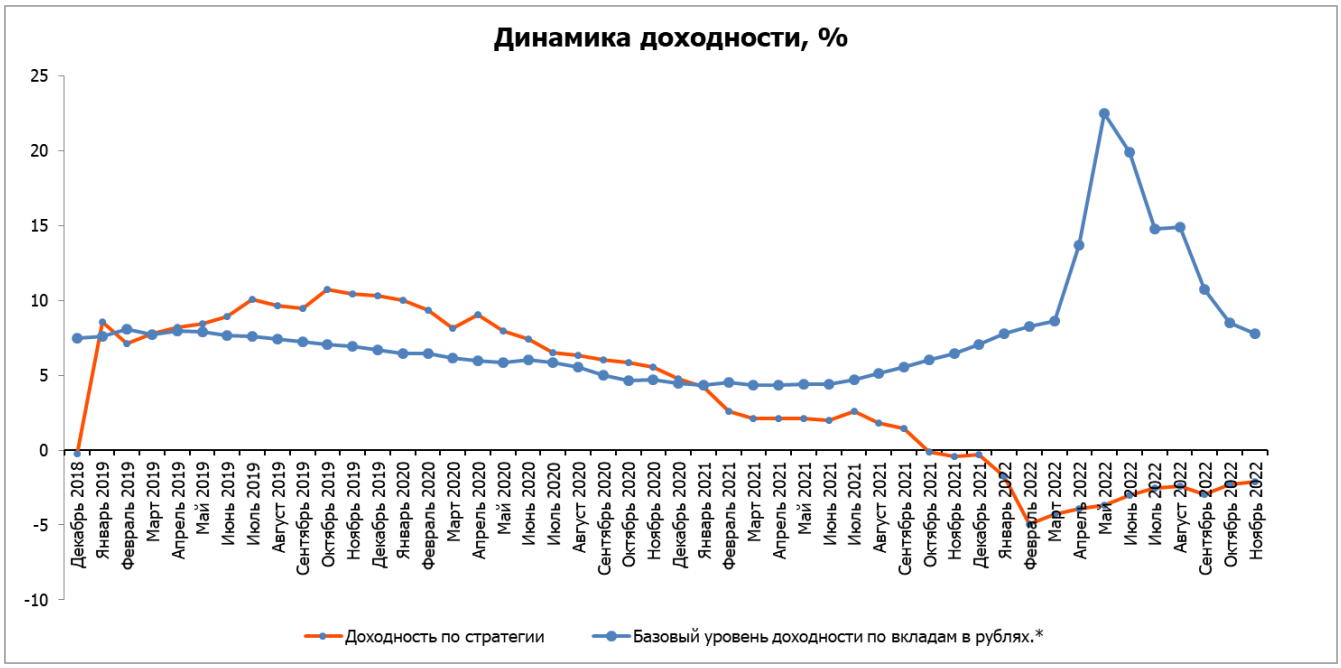
2. Структура портфеля инструментов:

Код инструмента, номер гос. рег, ISIN	Тип/Вид	Доля, %
Акции		
НК РуссНефть, ПАО ао02, 1-02-39134-Н, RU000A0JSE60	Акция обыкновенная	1
Облигации		
ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2	Государственная облигация	34
ОФЗ-26234-ПД, 26234RMFS, RU000A101QE0	Государственная облигация	2
РЖД-001Р-20R, 4В02-20-65045-D-001Р, RU000A101M04	Корпоративная облигация	1
ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38	Государственная облигация	13
БанкФК Открытие-БО-П07, 4В02-14-02209-В-001Р, RU000A102R73	Корпоративная облигация	18
ОФЗ-26215-ПД, 26215RMFS, RU000A0JU4L3	Государственная облигация	31
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 01.10.2022.* 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

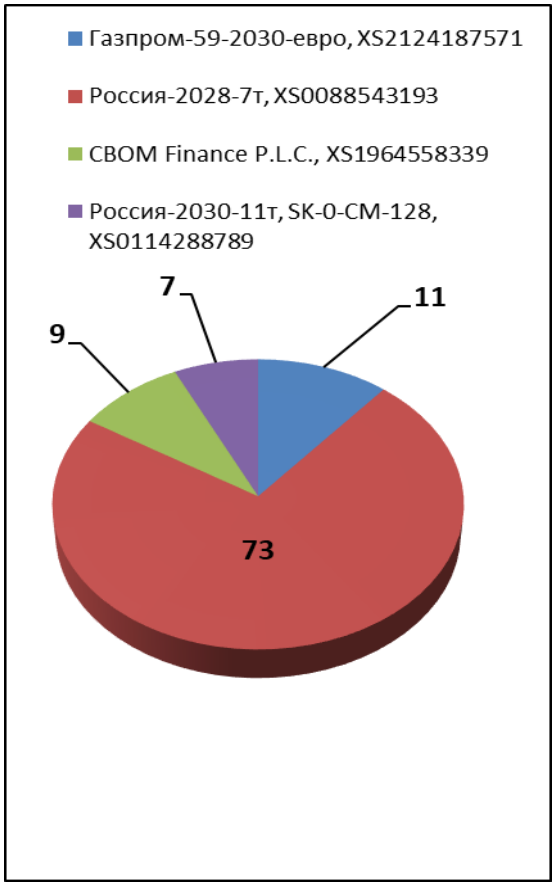
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

1. Структура портфеля:

Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	2%
Еврооблигации	98%
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.)	73
CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	9
Газпром-59-2030-евро, XS2124187571	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	11
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (корпоративная нерез.)	7
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 01.10.2022.* 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».

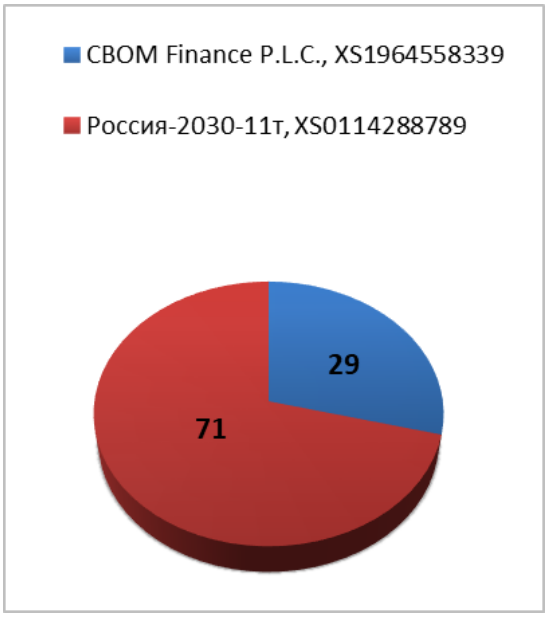
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

1.Структура портфеля:

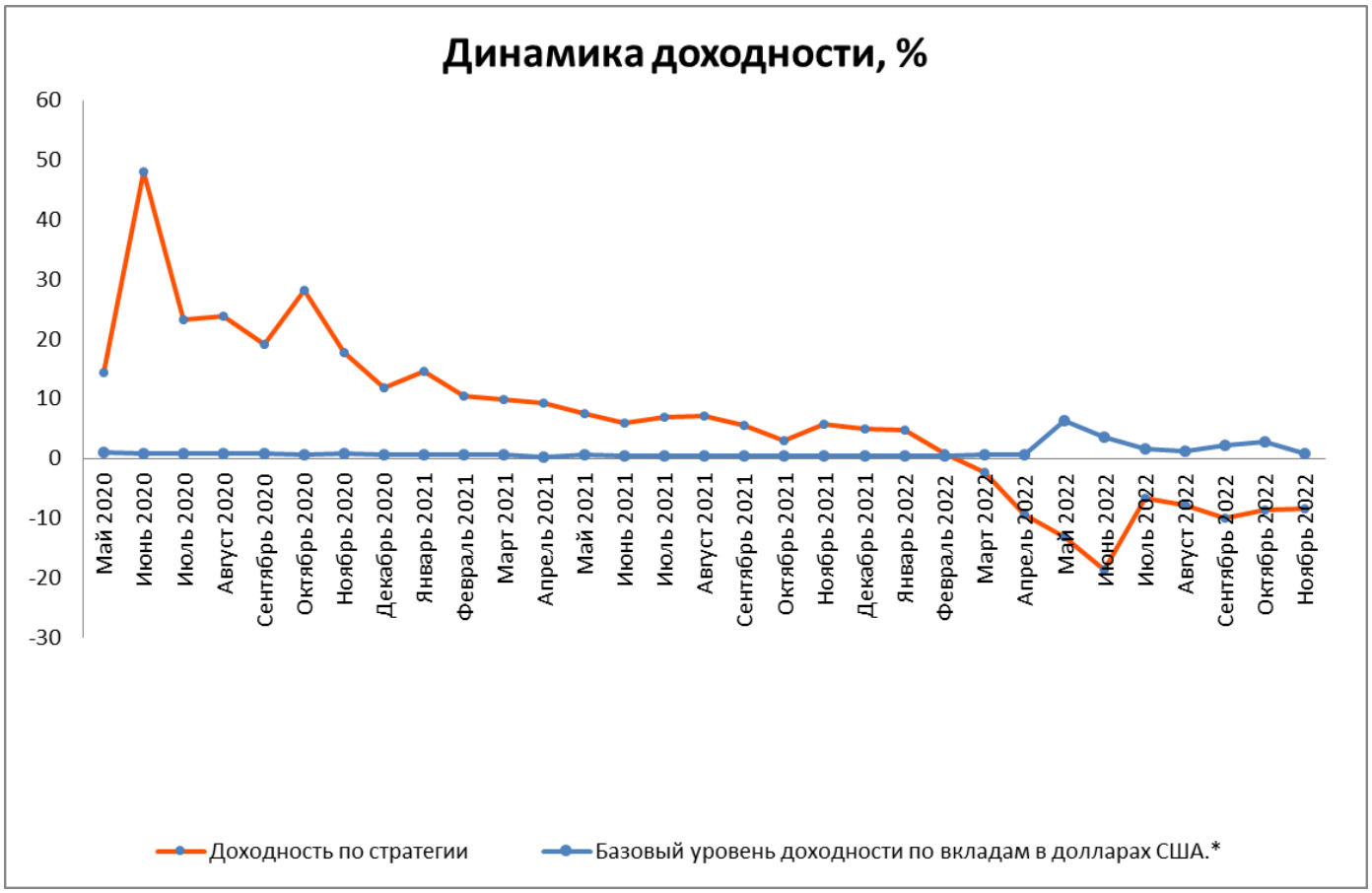
Вид актива	Доля в портфеле, %
Денежные средства	28%
Еврооблигации	72%
ИТОГО	100%

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.)	29
Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789	Еврооблигация (государственная РФ)	71
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 01.10.2022.* 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».