ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АТБ Азиатско-Тихоокеанский Банк

# РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

10 марта 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

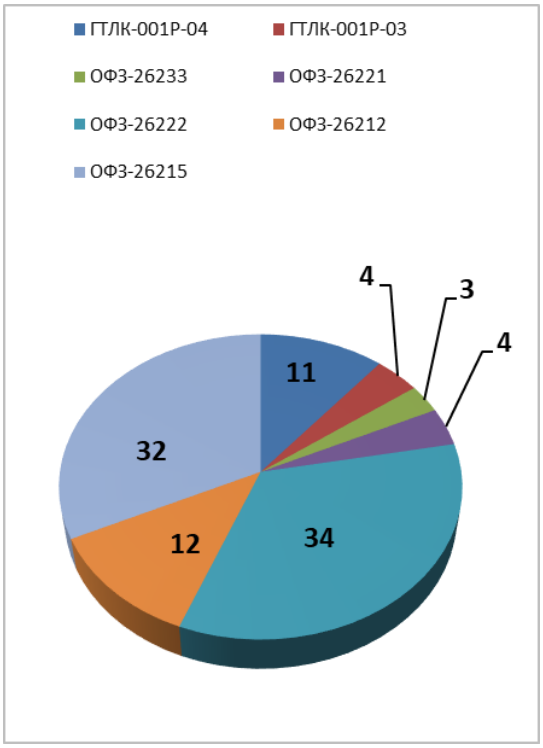
## ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

1. Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Облигации | 95% |
| Денежные средства* | 5% |
| **ИТОГО** | 100% |

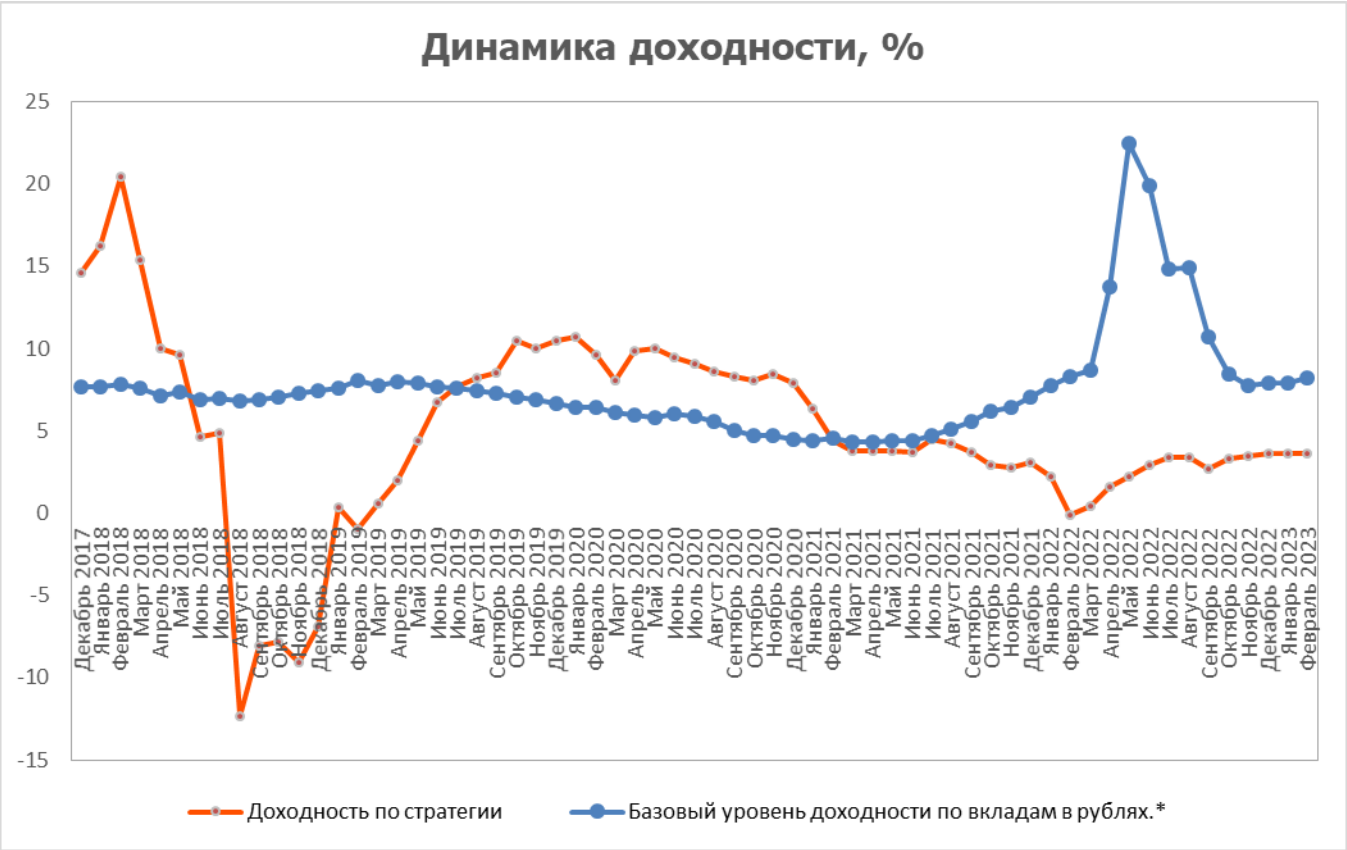
2.Структура портфеля инструментов:

| 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 | 34 |
| ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1 | Государственная облигация | 4 |
| ОФЗ-26212-ПД, 26212RMFS, RU000A0JTK38 | Государственная облигация | 12 |
| ОФЗ-26215-ПД, 26215RMFS, RU000A0JU4L3 | Государственная облигация | 32 |
| **ИТОГО** | | 100% |




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

3. Динамика доходности:



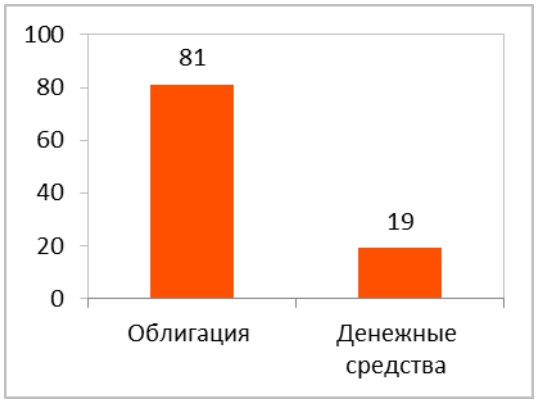

**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2023.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

*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».*

## ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС

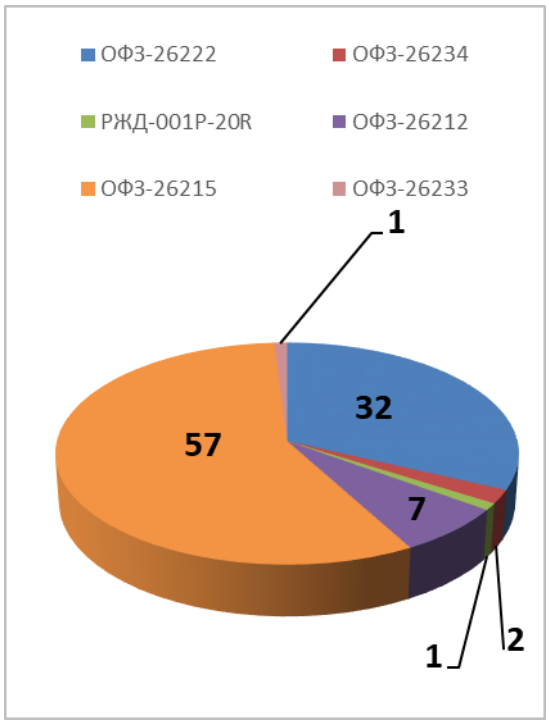
1.Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Облигации | 81% |
| Денежные средства* | 19% |
| **ИТОГО** | 100% |



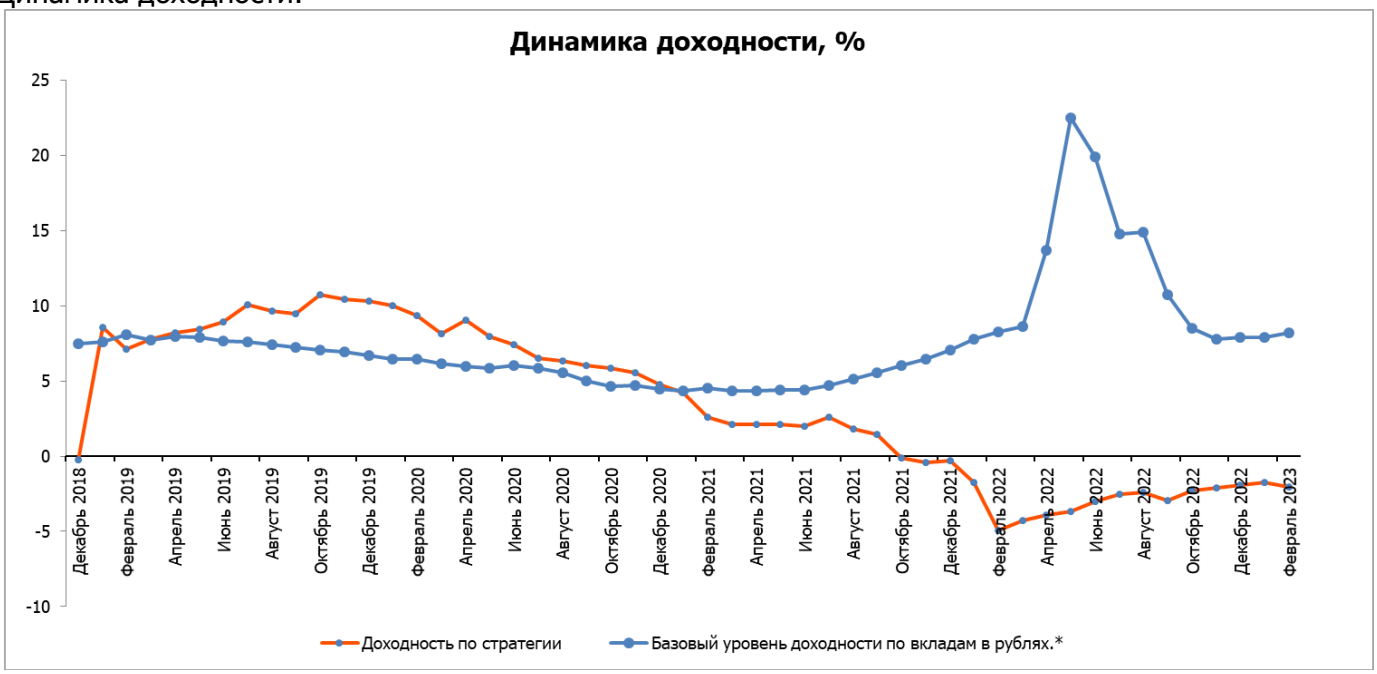

2. Структура портфеля инструментов:

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Облигации | | |
| ОФЗ-26222-ПД, 26222RMFS, RU000A0JXQF2 | Государственная облигация | 32 |
| 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 | 7 |
| ОФЗ-26215-ПД, 26215RMFS, RU000A0JU4L3 | Государственная облигация | 57 |
| ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94 | Государственная 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, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2023.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

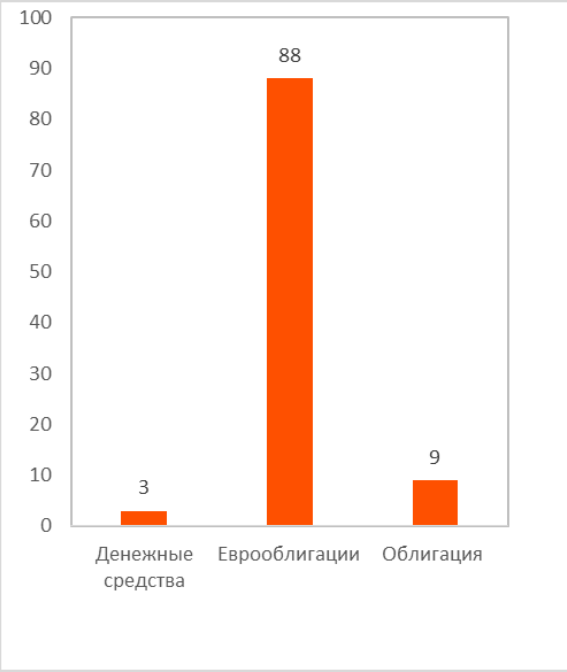
*Под вкладами понимаются денежные средства, привлекаемые по договорам банковского вклада (счета), заключенным кредитными организациями, имеющими право на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, с физическими лицами, в том числе индивидуальными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

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

## ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

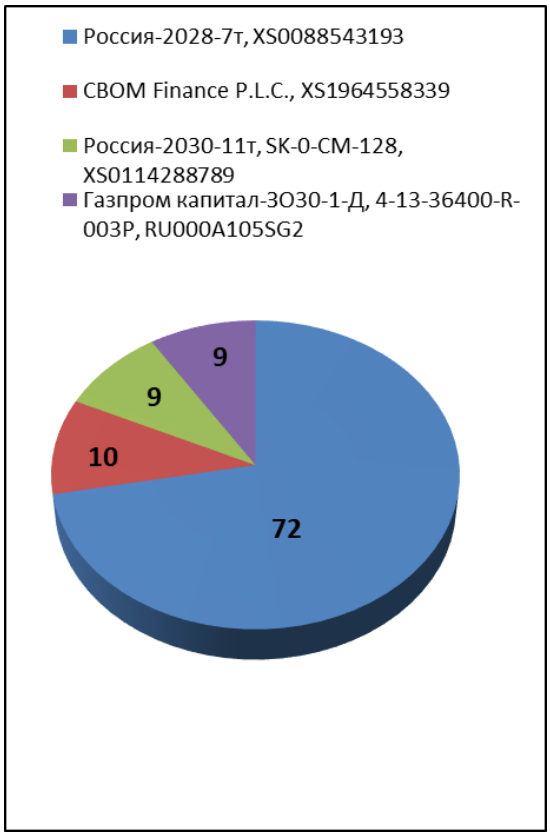
1. Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Денежные средства | 3% |
| Еврооблигации | 88% |
| Облигация | 9% |
| **ИТОГО** | 100% |

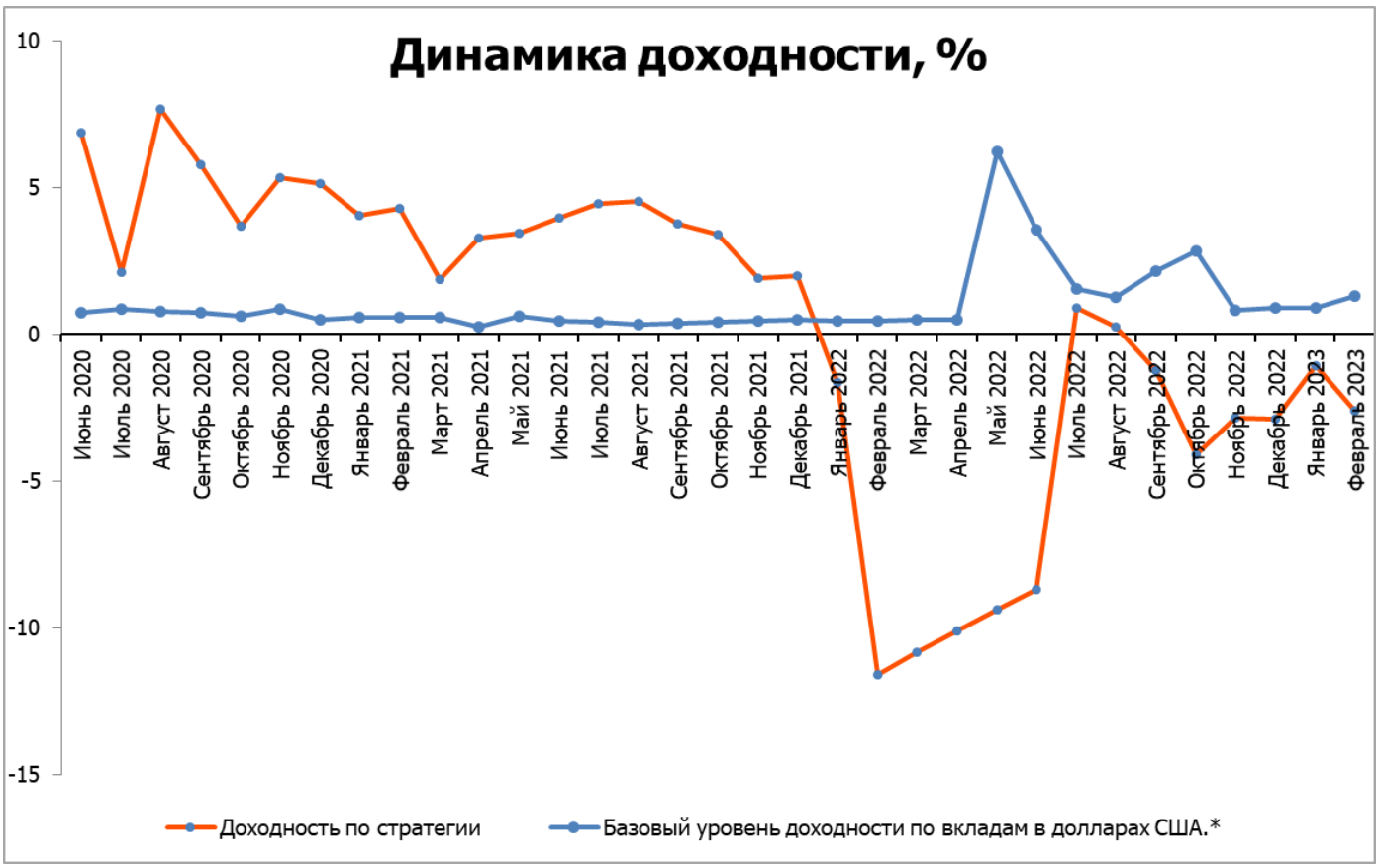



2.Структура портфеля инструментов:

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Еврооблигации | | |
| Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 72 |
| CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 10 |
| 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 | 9 |
| **ИТОГО** | | 100% |



3.Динамика доходности:



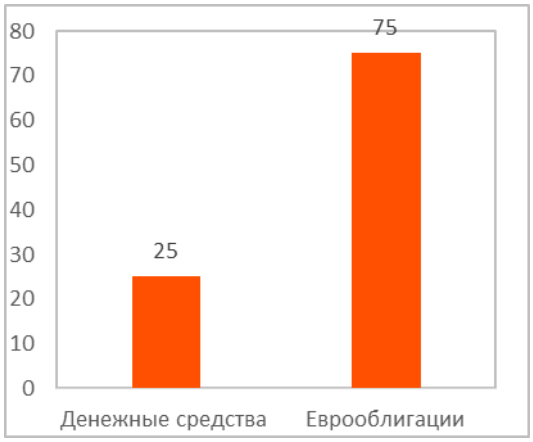

**Расчёт осуществлён на основе значений максимальных процентных ставок по вкладам, рассчитанных банками, привлекшими в совокупности две трети общего объёма вкладов населения в банках России по состоянию на 01.01.2023.* http://cbr.ru/Collection/Collection/File/29244/budv_2020-10.pdf;

*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 ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

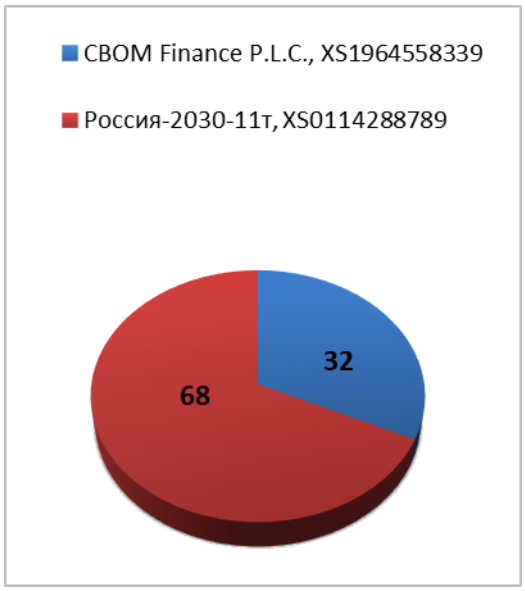
1.Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Денежные средства | 25% |
| Еврооблигации | 75% |
| **ИТОГО** | 100% |

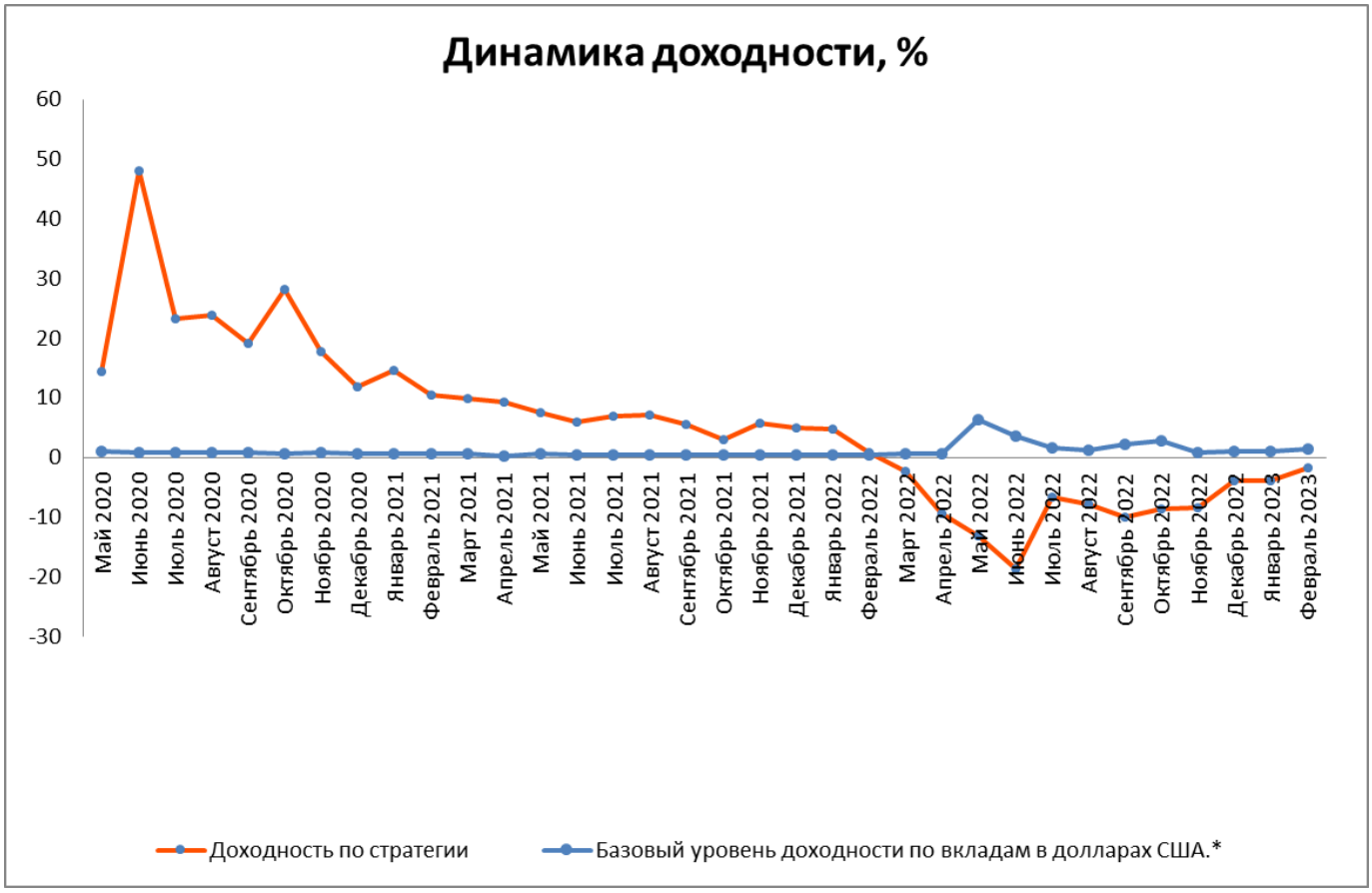



2.Структура портфеля инструментов:

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Еврооблигации | | |
| CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 32 |
| Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789 | Еврооблигация (государственная РФ) | 68 |
| **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 01.01.2023._
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»._