ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

АТБ Азиатско-Тихоокеанский Банк

# РЕЗУЛЬТАТЫ СТАНДАРТНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ СТРАТЕГИЙ

07 сентября 2020 г.
г. Москва

# Оглавление

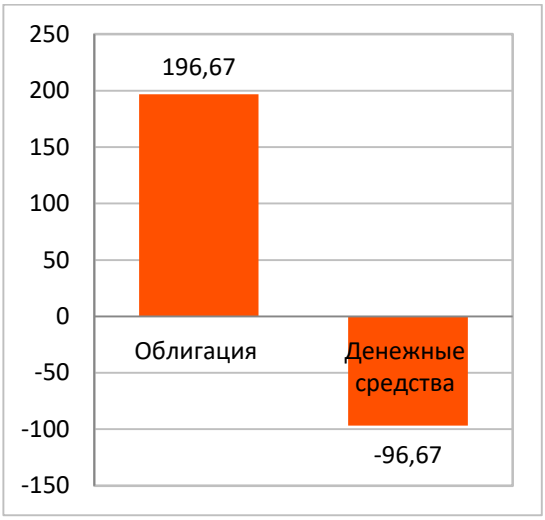
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ..... 3
ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС ..... 5
АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ ..... 7
ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ ..... 8
ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС ..... 9

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

## ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД

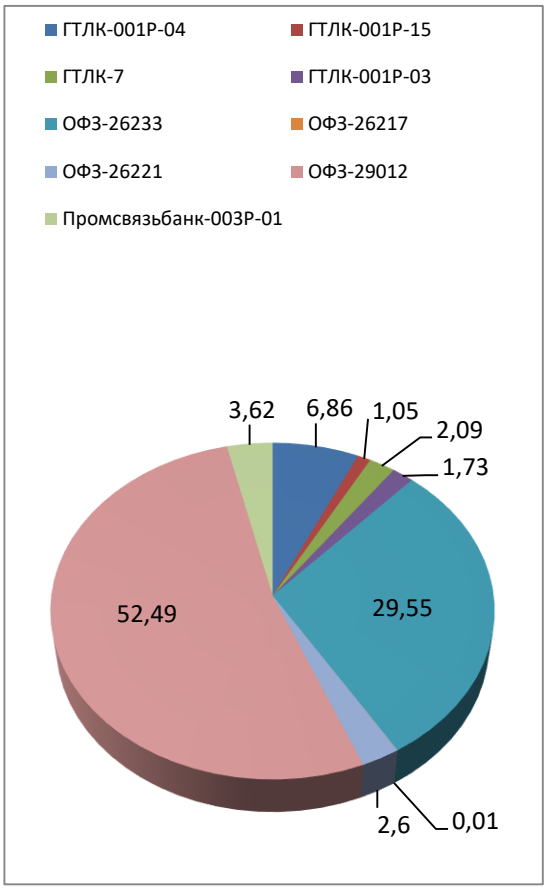
1. Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Облигации | 196,67% |
| Денежные средства* | -96,67% |
| **ИТОГО** | 100.00% |




Структура портфеля инструментов.

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Облигации | | |
| ГТЛК-001Р-04, 4В02-04-32432-Н-001Р, RU000A0JXPG2 | Корпоративная облигация | 6,86 |
| ГТЛК-001Р-15, 4В02-15-32432-Н-001Р, RU000A100Z91 | Корпоративная облигация | 1,05 |
| ГТЛК-7, 4В02-07-32432-Н, RU000A0JW1P8 | Корпоративная облигация | 2,09 |
| ГТЛК-001Р-03, 4В02-03-32432-Н-001Р, RU000A0JXE06 | Корпоративная облигация | 1,73 |
| ОФЗ-26233, 26233RMFS, RU000A101F94 | Государственная облигация | 29,55 |
| ОФЗ-26217, 26217RMFS, RU000A0JVW30 | Государственная облигация | 0,01 |
| ОФЗ-26221, 26221RMFS, RU000A0JXFM1 | Государственная облигация | 2,60 |
| ОФЗ-29012, 29012RMFS, RU000A0JX0H6 | Государственная облигация | 52,49 |
| Промсвязьбанк-003Р-01, 4В02-01-03251-В- | Корпоративная облигация | 3,62 |
| **ИТОГО** | | 100 |




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

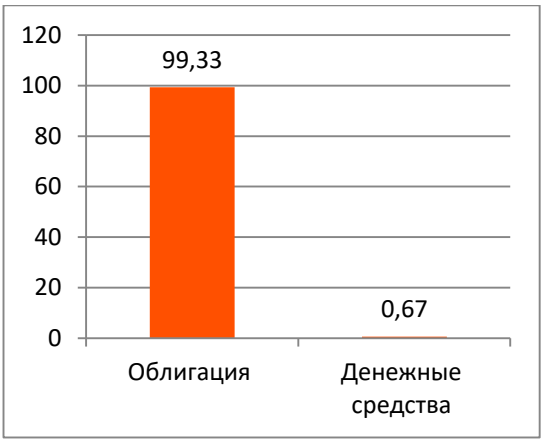
2. Динамика доходности:

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

## ОБЛИГАЦИОННЫЙ РУБЛЕВЫЙ ДОХОД ДЛЯ ИИС

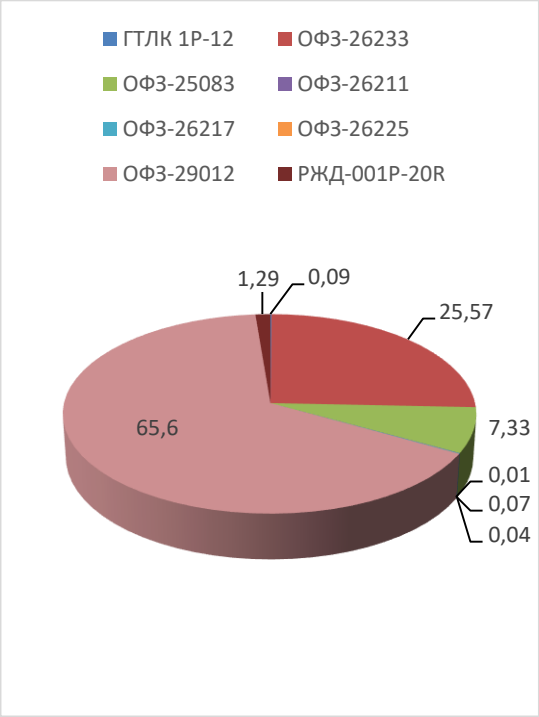
1. Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Облигации | 99,33% |
| Денежные средства* | 0,67% |
| **ИТОГО** | 100.00% |




Структура портфеля инструментов

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Структура портфеля Облигаций | | |
| ГТЛК 1Р-12, 4В02-12-32432-Н-001Р, RU000A0ZZV11 | Корпоративная облигация | 0,09 |
| ОФЗ-26233-ПД, 26233RMFS, RU000A101F94 | Государственная облигация | 25,57 |
| ОФЗ-25083-ПД, 25083RMFS, RU000A0ZYCK6 | Государственная облигация | 7,33 |
| ОФЗ-26211-ПД, 26211RMFS, RU000A0JTJL3 | Государственная облигация | 0,04 |
| ОФЗ-26217-ПД, 26217RMFS, RU000A0JVW30 | Государственная облигация | 0,07 |
| ОФЗ-26225-ПД, 26225RMFS, RU000A0ZYUB7 | Государственная облигация | 0,01 |
| ОФЗ-29012-ПК, 29012RMFS, RU000A0JX0H6 | Государственная облигация | 65,6 |
| РЖД-001Р-20R, 4В02-20-65045-D-001Р, RU000A101M04 | Корпоративная облигация | 1,29 |
| **ИТОГО** | | 100.00% |




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

3. Динамика доходности:

ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

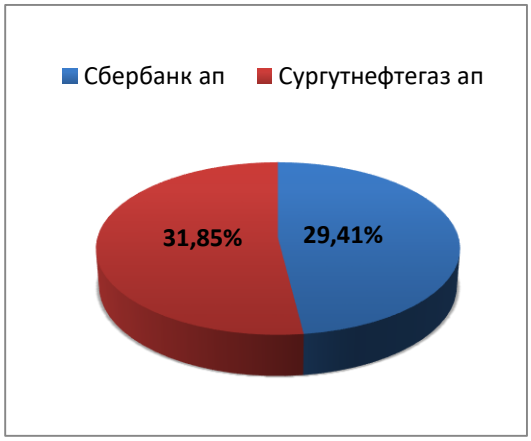
## АКТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ

1. Структура портфеля:

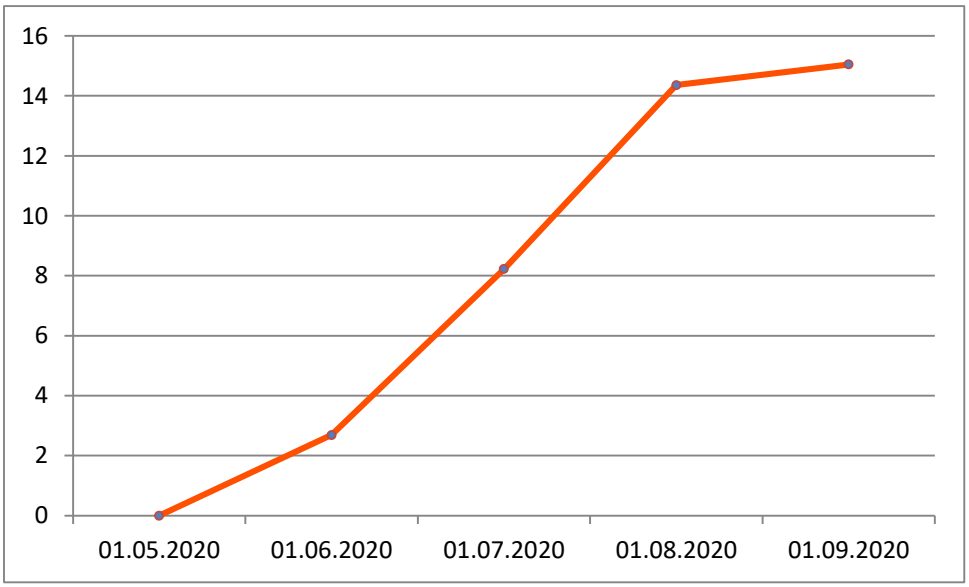
| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Денежные средства | 81,75% |
| Акции | 18,25% |
| **ИТОГО** | 100.00% |

Структура портфеля инструментов

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Структура портфеля Акций | | |
| Сбербанк, ап, 20301481B, RU0009029557 | Акция привилегированная | 63.98 |
| АПИ Сургутнефтегаз, Выпуск №2-01-00155-А, 2-01-00155-А, RU0009029524 | Акция привилегированная | 36.02 |
| **ИТОГО** | | 100.00 |



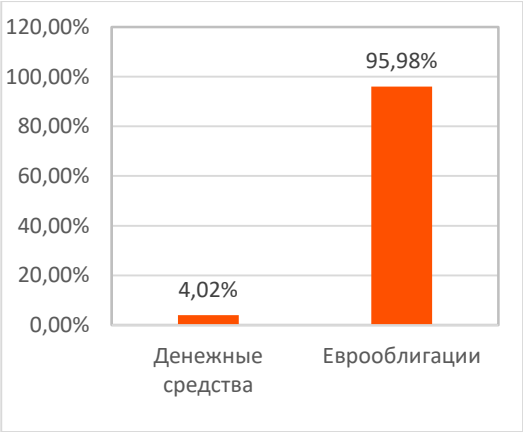

2. Динамика доходности:



## ЕВРООБЛИГАЦИИ С ПЛЕЧОМ

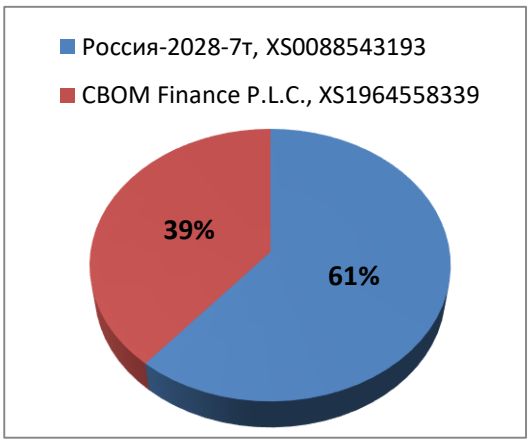
5. 1. Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Денежные средства | 4.02% |
| Еврооблигации | 95.98% |
| **ИТОГО** | 100.00% |

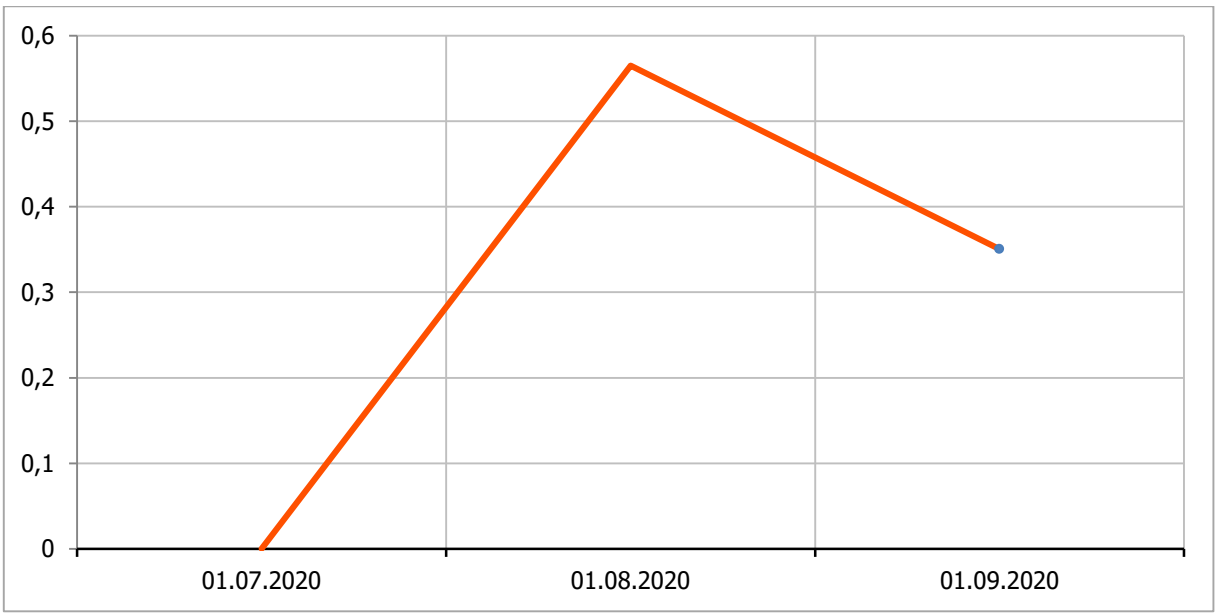



Структура портфеля инструментов

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Еврооблигации | | |
| Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 61.1 |
| CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 38.9 |
| **ИТОГО** | | 100.00 |




2. 2. Динамика доходности:

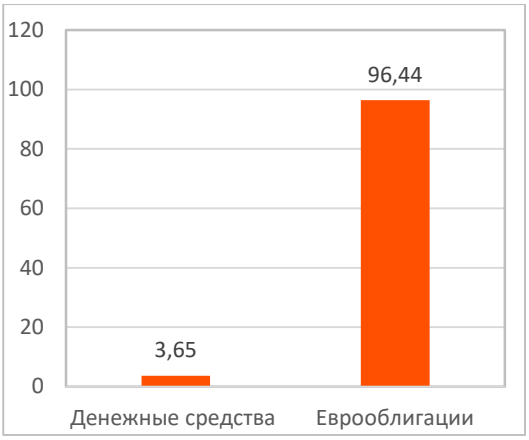


ДЕПАРТАМЕНТ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

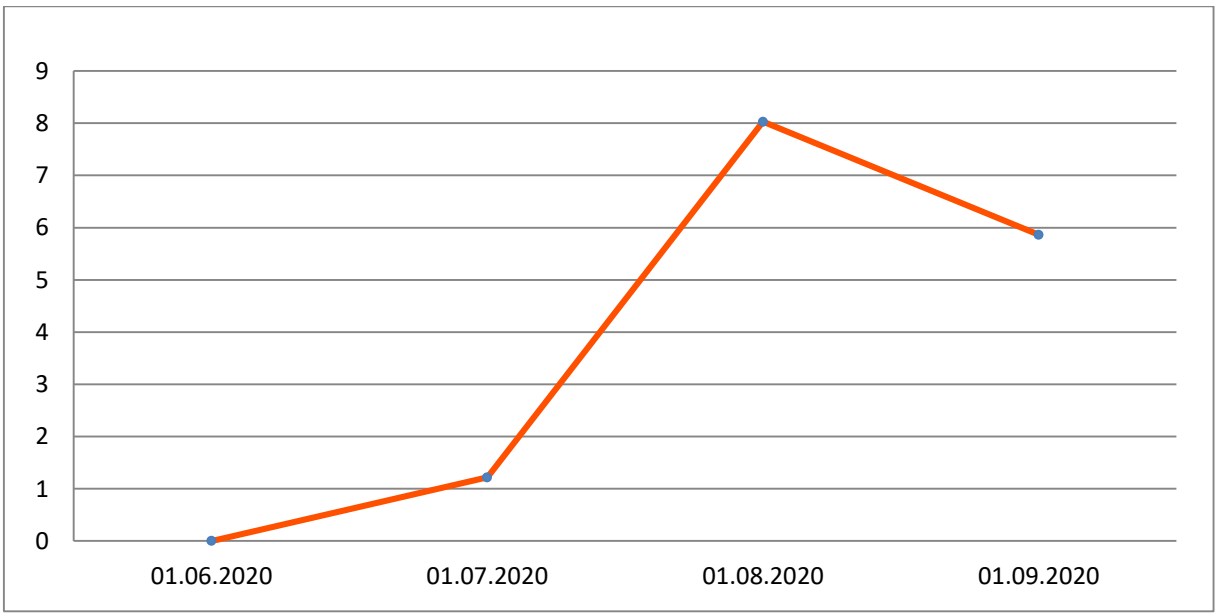
## ЕВРООБЛИГАЦИИ ЗА РУБЛИ ДЛЯ ИИС

1.Структура портфеля:

| Вид актива | Доля в портфеле, % |
|---|---|
| Денежные средства | 3.56% |
| Еврооблигации | 96.44% |
| **ИТОГО** | 100.00% |




Структура портфеля инструментов

| Код инструмента, номер гос. рег, ISIN | Тип/Вид | Доля, % |
|---|---|---|
| Еврооблигация | | |
| Россия-2028-7т, МК-0-СМ-119, XS0088543193 | Еврооблигация (государственная РФ) | 59,08 |
| CBOM Finance P.L.C. 7.121 25/06/24, XS1964558339 | Еврооблигация (корпоративная нерез.) | 15,05 |
| Россия-2030-11т, SK-0-CM-128, XS0114288789 | Еврооблигация (государственная РФ) | 25,87 |
| **ИТОГО** | | 100.00 |

3. Динамика доходности: