

GAMA новых возможностей для управления портфелями

Критические факторы успеха

- ✓ Бухгалтерия
- ✓ Бэк-офис
- ✓ ЭДО
- ✓ Торговый терминал
- ✓ ...



Критические факторы успеха

- ✓ Бухгалтерия
- ✓ Бэк-офис
- ✓ ЭДО
- ✓ Торговый терминал
- ✓ ...

Уникальные конкурентные преимущества

- ✓ Технический анализ
- ✓ Фундаментальный анализ
- ✓ Портфельный анализ



Мониторинг состояния портфелей

Мониторинг состояния портфелей

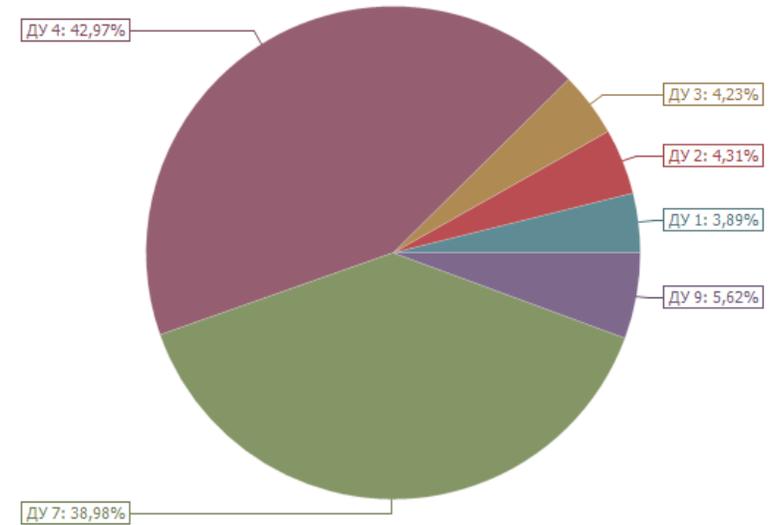
Портфели УК

- (Все)
- ДУ 1
- ДУ 2
- ДУ 3
- ДУ 4
- ДУ 7
- ДУ 9

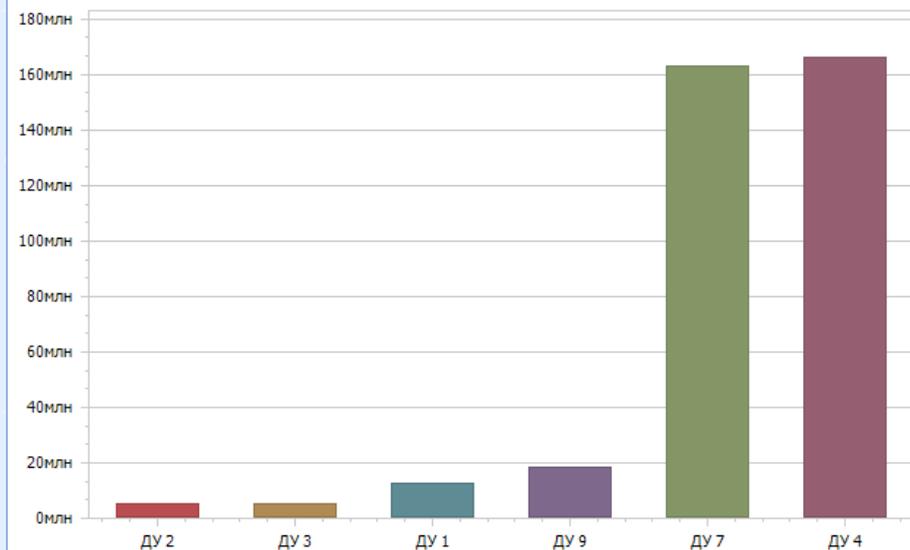
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конечную дату (БВ) (Сумма) к Стоимости об...

<p>ДУ 9</p> <p>1 005 60... -21,7млн</p> <p>▼ -2,11%</p>	<p>ДУ 7</p> <p>6 971 05... -161млн</p> <p>▼ -2,26%</p>	<p>ДУ 4</p> <p>7 684 90... -194млн</p> <p>▼ -2,47%</p>
<p>ДУ 3</p> <p>756 690 89... +18,2млн</p> <p>▲ +2,46%</p>	<p>ДУ 2</p> <p>770 323 52... -5,37млн</p> <p>▼ -0,69%</p>	<p>ДУ 1</p> <p>696 471 37... +15,3млн</p> <p>▲ +2,24%</p>

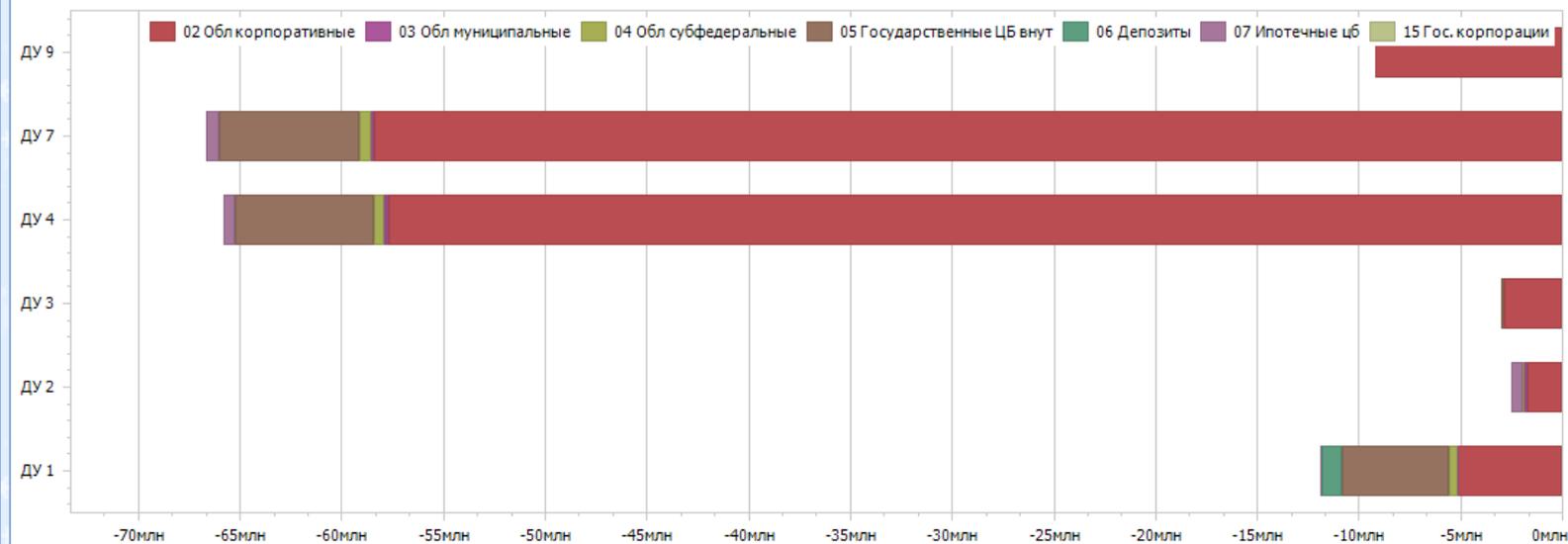
Доля портфеля в активах (%)



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по модифицированной дюрации)



Мониторинг портфелей

Мониторинг портфелей

Фильтр портфелей

- (Все)
- Денежный 1
- Денежный 2
- Денежный 3
- Деньги и акции

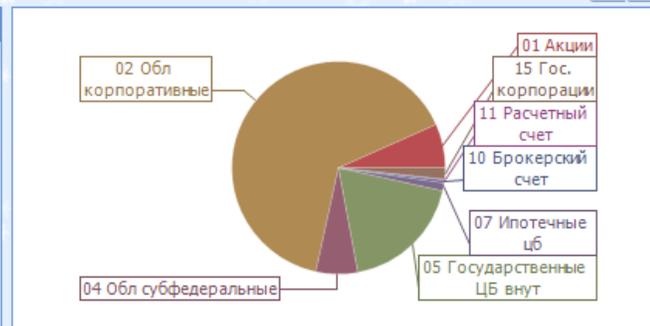
Категория актива

- (Все)
- 01 Акции
- 02 Обл корпоративные
- 04 Обл субфедеральные

Портфели

Портфель	Балансовая с...	Рыночная стоимость с ...	+/- нереализован...	+/- реализован...	+/- итоговый (БВ) ...	Среднеинвестиро...	Доходность (М...
Собственный 2	37 403 501,27 Р	43 237 593,77 Р	↑ 5 834 092,50	0,00 Р	5,83млн	37,4млн	15,60%
Портфель 2 УК1	299 164 931,5...	297 524 733,70 Р	↓ -5 319 771,81	7 469 281,43 Р	2,15млн	290млн	0,74%
Портфель 6 Собствен...	518 038 691,7...	513 902 045,17 Р	↓ -10 267 422,39	13 855 881,38 Р	3,59млн	487млн	0,74%
Портфель 4 УК2	875 874 601,5...	872 611 889,00 Р	↓ -13 971 985,42	19 508 793,18 Р	5,54млн	834млн	0,66%
Портфель 5 Собствен...	379 634 290,6...	375 893 294,78 Р	↓ -8 085 251,96	10 453 851,98 Р	2,37млн	372млн	0,64%
Портфель 7 Собствен...	780 423 080,0...	777 667 504,47 Р	↓ -12 599 164,95	16 476 677,30 Р	3,88млн	725млн	0,54%
Портфель 3 УК2	18 547 667,02 Р	18 426 673,82 Р	↓ -326 073,77	379 832,53 Р	53,8тыс.	16,3млн	0,33%
Портфель 1 УК1	22 490 512 21...	22 330 869 741,67 Р	↓ -465 759 870,38	521 674 700,46 Р	55,5млн	22,2млрд	0,25%
Денежный 1	324 056,51 Р	324 056,51 Р	→ 0,00	0,00 Р	0	324тыс.	0,00%

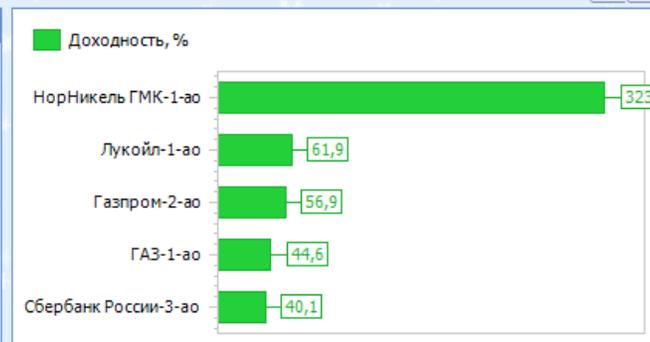
Доля актива в портфеле



Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ЦБ	+/- нереализованный	Доходность (МВУ)	+/- итоговый	СИК
Портфель 1 УК1	ОФЗ-26222-ПД	05 Государственные ...	Государственные активы	1 405	↓ -84 665,30	1,57%	160 923,56	10 251 645,78
Портфель 3 УК2	СИБУР Холдинг-10-об	02 Обл корпоративные		0	→ 0,00	1,53%	1 701,60	111 325,35
Портфель 4 УК2				5 631	↓ -108 149,68	1,50%	61 850,21	4 134 878,45
Портфель 5 Со...				9 550	↓ -183 418,48	1,50%	104 896,02	7 012 624,62
Портфель 6 Со...	ХМАО-Югра-35001-об	04 Обл субфедераль...	Административные	29 249	↓ -561 759,92	1,50%	321 267,39	21 477 723,30
Портфель 1 УК1				410 000	↓ -7 874 510,84	1,50%	4 503 389,16	301 065 559,67
Портфель 3 УК2				127	↓ -2 439,18	1,50%	1 394,95	93 256,89
Портфель 6 Со...	ОФЗ-26205-ПД			0	→ 0,00	1,48%	90 674,52	6 122 689,21
Портфель 8 Со...	ОФЗ-52002-ИН	05 Государственные ...	Государственные активы	168 598	↑ 2 053 056,17	1,47%	2 950 984,74	200 634 937,43
Портфель 1 УК1				259 496	↑ 3 159 941,80	1,46%	4 257 609,88	290 728 731,03
Портфель 6 Со...	Элемент Лизинг-001Р-	02 Обл корпоративные	Финансовые компании	9 400	↓ -107 094,50	1,42%	67 181,50	4 726 858,34
Портфель 2 УК1	ОФЗ-26205-ПД	05 Государственные ...	Государственные активы	4 300	↓ -49 729,65	1,42%	30 938,35	2 185 991,08
Портфель 6 Со...	Саха Респ-35008-об	04 Обл субфедераль...		0	→ 0,00	1,35%	57 439,67	4 252 444,81
Портфель 7 Со...				1 000	↓ -20 900,00	1,34%	13 690,00	1 020 876,85
Портфель 4 УК2	Банк Зенит-001Р-05-6			41 000	↓ -856 900,00	1,34%	561 290,00	41 855 950,88
Портфель 2 УК1				9 250	↓ -193 325,00	1,34%	126 632,50	9 443 110,87
Портфель 1 УК1				390 150	↓ -8 154 135,00	1,34%	5 341 153,50	398 295 103,35
Портфель 6 Со...				12 900	↓ -288 960,00	1,34%	178 536,00	13 345 650,10
Портфель 2 УК1	РН Банк-001Р-03	02 Обл корпоративные	Банки	9 900	↓ -221 760,00	1,34%	137 016,00	10 242 010,54
Портфель 1 УК1				82 800	↓ -1 854 720,00	1,34%	1 145 952,00	85 660 451,80
Портфель 6 Со...				1 599	↓ -14 710,80	1,31%	21 154,77	1 618 406,82
Портфель 5 Со...	РСХБ-15-об			6 700	↓ -61 640,00	1,31%	88 641,00	6 781 316,90
Портфель 4 УК2				8 400	↓ -77 280,00	1,31%	111 132,00	8 501 949,55

Лучшие по доходности



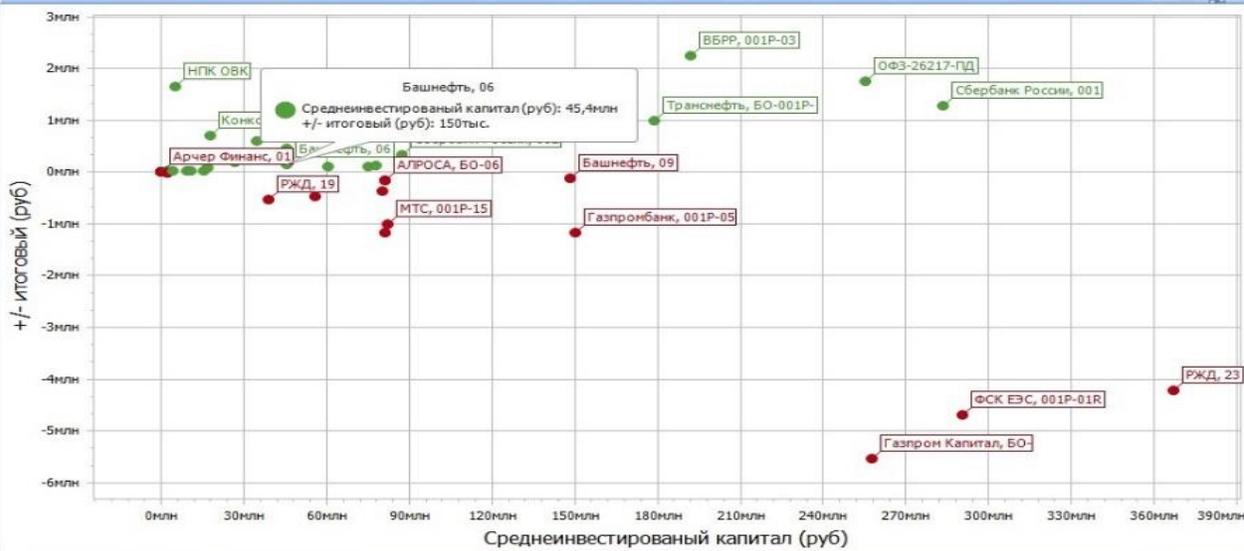
Худшие по доходности



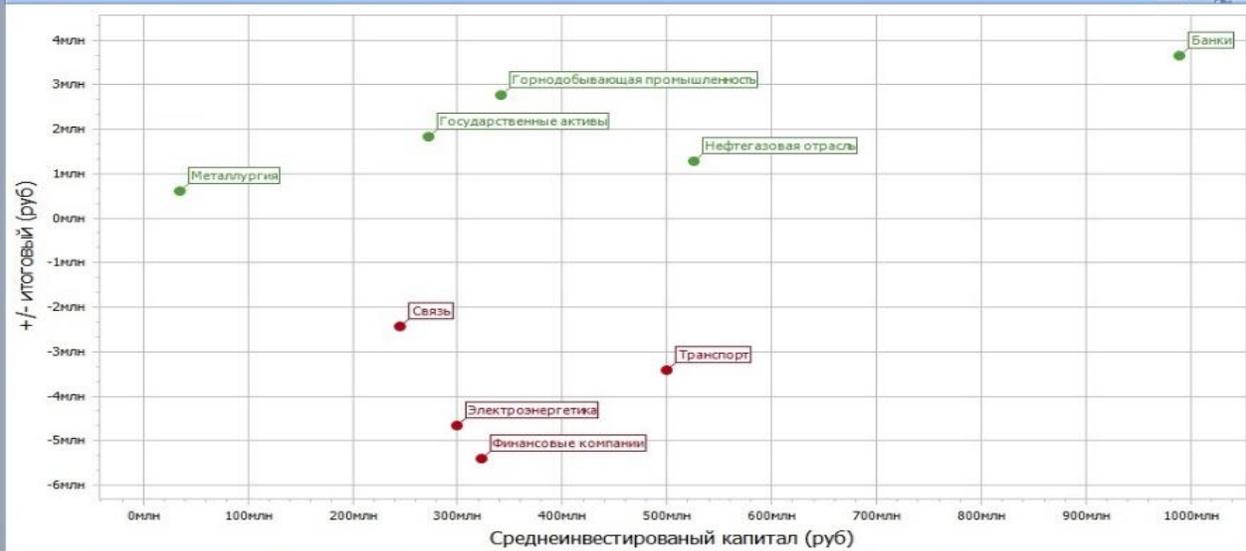
ВЛИЯНИЕ ПОЗИЦИЙ И КАТЕГОРИЙ АКТИВОВ НА РЕЗУЛЬТАТ ПОРТФЕЛЯ

Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

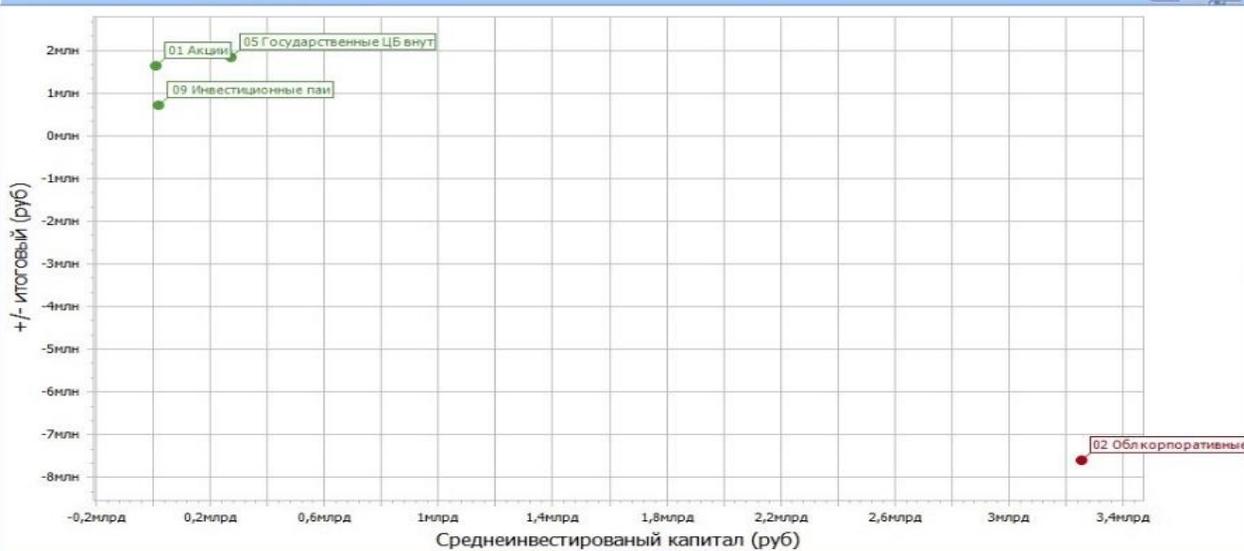
Влияние позиции на доходность портфеля



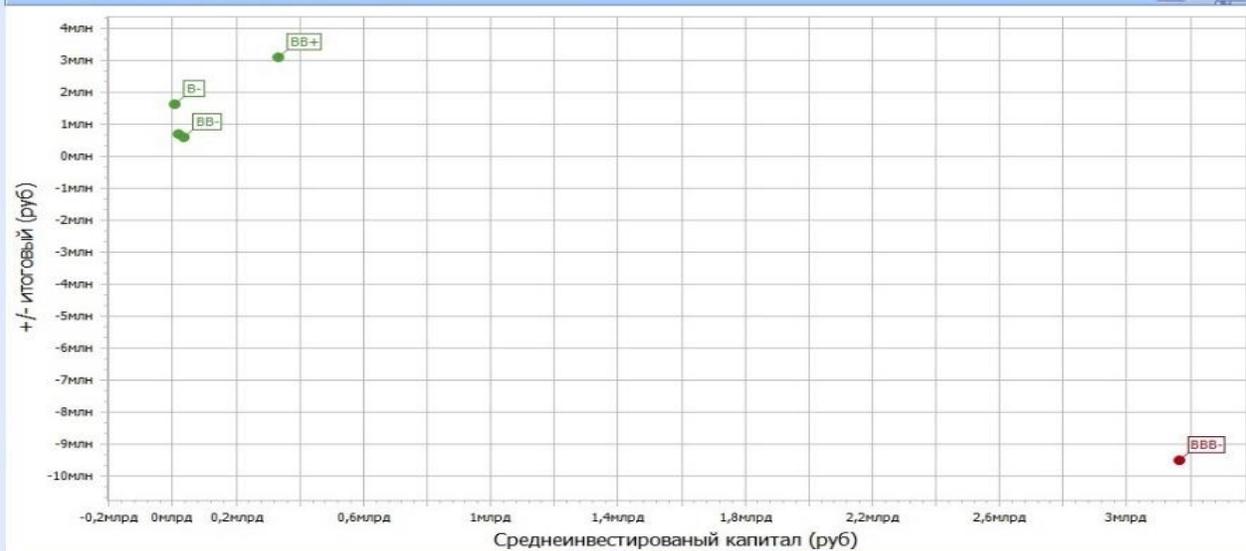
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



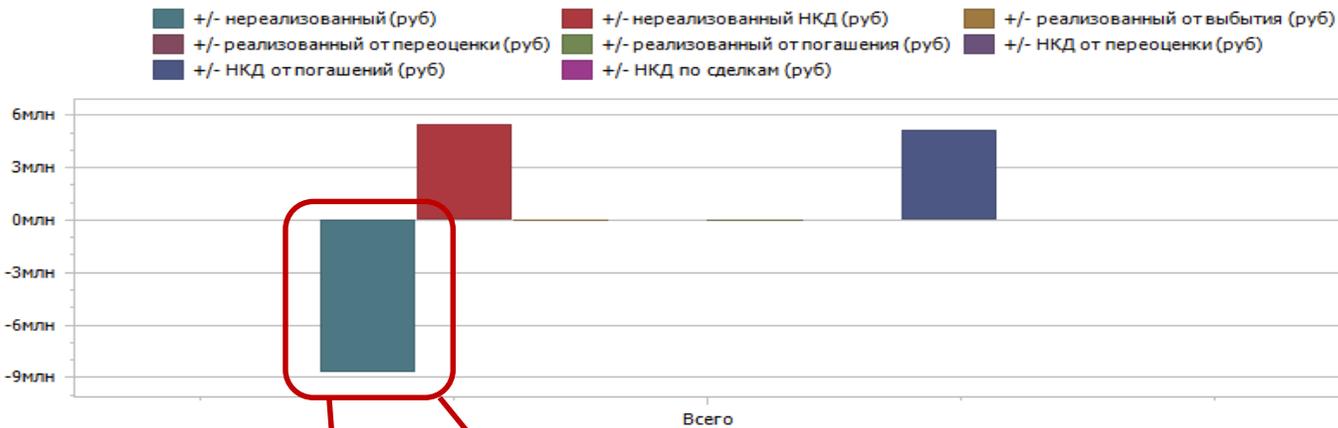
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



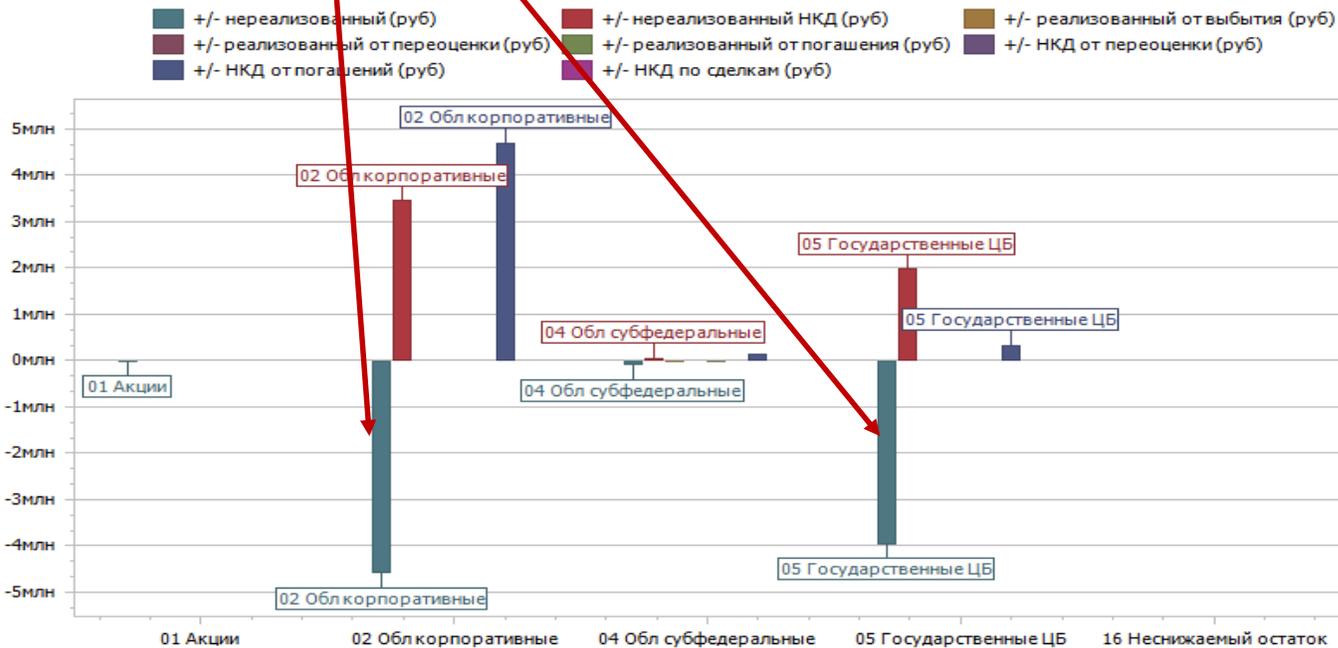
ФАКТОРНЫЙ АНАЛИЗ

Источники финансового результата от управления активами

Составляющие финансового результата от управления активами



Составляющие финансового результата от управления активами



Источники финансового результата ВСЕГО

Реализованная прибыль/убыток

+/- реализованный от выбытия акт...	+/- реализованный от переоцен...	+/- реализованный от погашения акт...
-42 700,00	0	-42 700,00

Нереализованная прибыль/убыток

+/- нереализованный (руб)	+/- нереализованный НКД (руб)
-8 688 488,15	5 501 250,28

Прибыль/убыток от накопленного дохода (НКД)

+/- НКД от переоценки (руб)	+/- НКД от погашений (руб)	+/- НКД по сделкам (руб)
0,00	5 190 688,93	0,00

Источники финансового результата по группам активов

Реализованная прибыль/убыток

Категория баланс...	+/- реализованный от выб...	+/- реализованный от п...	+/- реализованный от погаш...
01 Акции	0,00	0	0,00
02 Обл корпорати...	0,00	0	0,00
04 Обл субфедера...	-42 700,00	0	-42 700,00
05 Государственн...	0,00	0	0,00

Нереализованная прибыль/убыток

Категория балансового учета	+/- нереализованный (руб)	+/- нереализованный НКД (руб)
01 Акции	-28 043,75	0,00
02 Обл корпоративные	-4 593 807,50	3 456 428,07
04 Обл субфедеральные	-97 952,21	59 114,20
05 Государственные ЦБ	-3 968 684,69	1 985 708,01
16 Неснижаемый остаток	0,00	0,00

Прибыль/убыток от накопленного дохода (НКД)

Категория балансового у...	+/- НКД от переоценки (р...	+/- НКД от погашений (р...	+/- НКД по сделкам (р...
01 Акции	0,00	0,00	0,00
02 Обл корпоративные	0,00	4 707 860,61	0,00
04 Обл субфедеральные	0,00	143 733,72	0,00
05 Государственные ЦБ	0,00	339 094,60	0,00
16 Неснижаемый остаток	0,00	0,00	0,00

РАСПРЕДЕЛЕНИЕ РИСКОВ ПО КАТЕГОРИЯМ АКТИВОВ

Распределение кредитного и рыночного риска по активам

Вкладка 1

Распределение кредитного и рыночного риска

Вкладка 3

Доля кредитного и рыночного риска в объеме позиции

Эмитент	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эмитента в стоимости порт...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
РСХБ	9 510 164,70	0,28%	-14,14%	-1 222 239,94	-1 222 239,94	-122 142,08
МТС	72 216 494,64	2,15%	-4,85%	-3 505 755,71	-369 853,56	-3 135 902,15
АЛРОСА	308 081 030,12	9,18%	-3,84%	-11 821 893,74	-1 201 141,04	-10 620 752,70
Россети	244 334 973,85	7,28%	-3,50%	-8 554 627,14	-773 569,88	-8 167 842,20
РЖД	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Ростелеком	48 359 001,24	1,44%	-3,40%	-1 643 327,44	-426 277,44	-1 217 050,00
Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69
Банк ГПБ	132 209 061,67	3,94%	-1,98%	-2 623 086,28	-522 210,10	-2 100 876,18
Транснефть	144 125 026,50	4,30%	-1,91%	-2 753 054,17	-1 133 787,83	-1 619 266,34
Роснефть НК	94 503 961,20	2,82%	-1,90%	-1 796 861,26	-164 701,40	-1 632 159,86

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля отрасли в стоимости портф...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Горнодобывающая промышлен...	308 081 030,12	9,18%	-3,84%	-11 821 893,74	-1 201 141,04	-10 620 752,70
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89
Банки	567 847 834,71	16,93%	-2,86%	-16 226 704,75	-4 830 715,10	-11 395 989,65
Нефтегазовая отрасль	480 473 465,74	14,32%	-1,82%	-8 757 456,19	-2 410 321,90	-6 347 134,29

Доля кредитного и рыночного риска в дюрации

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости порт...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41

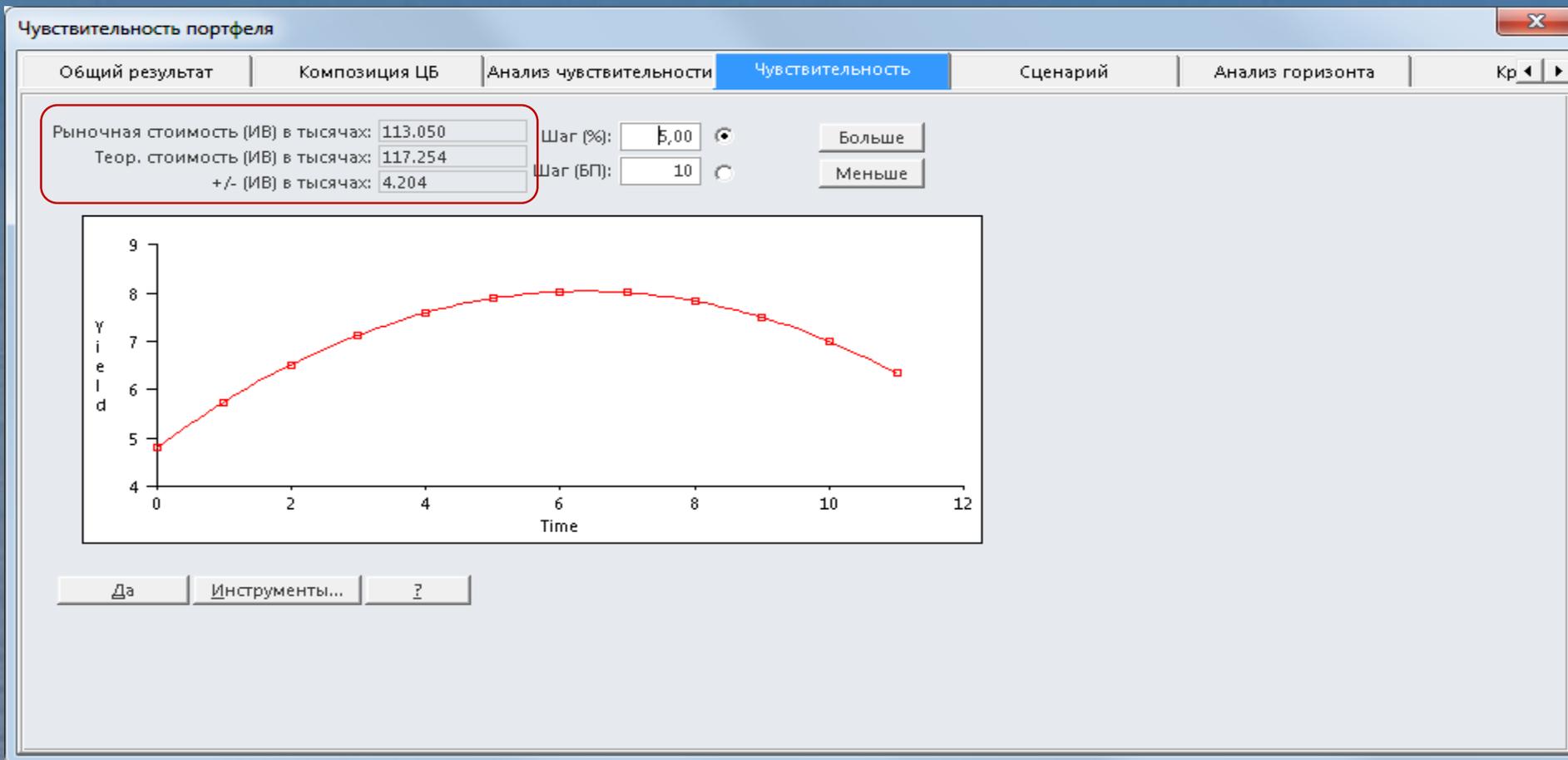
Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери (руб)	Риск позиции по MD (руб)
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15

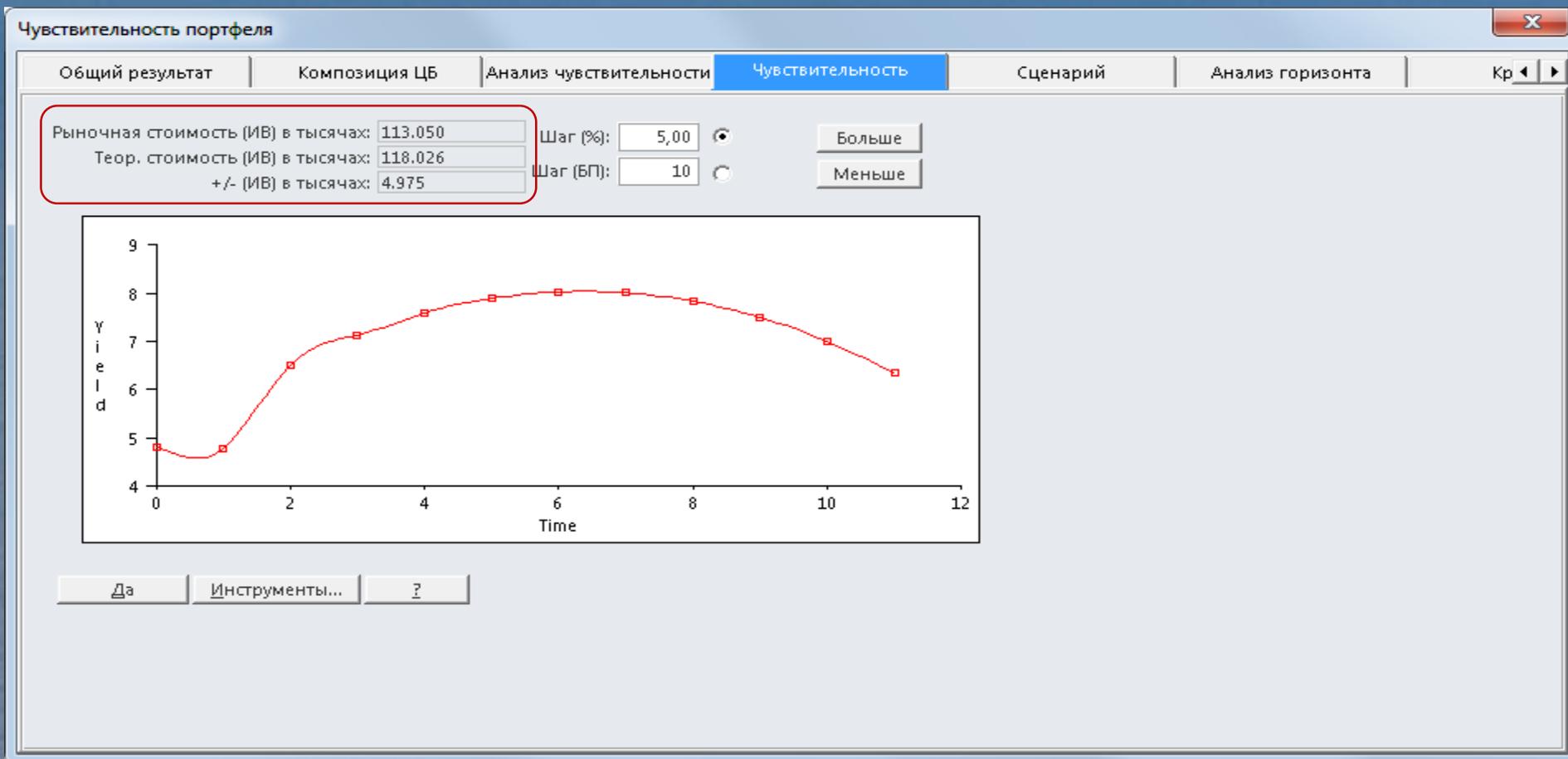
МОДЕЛИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЕЙ



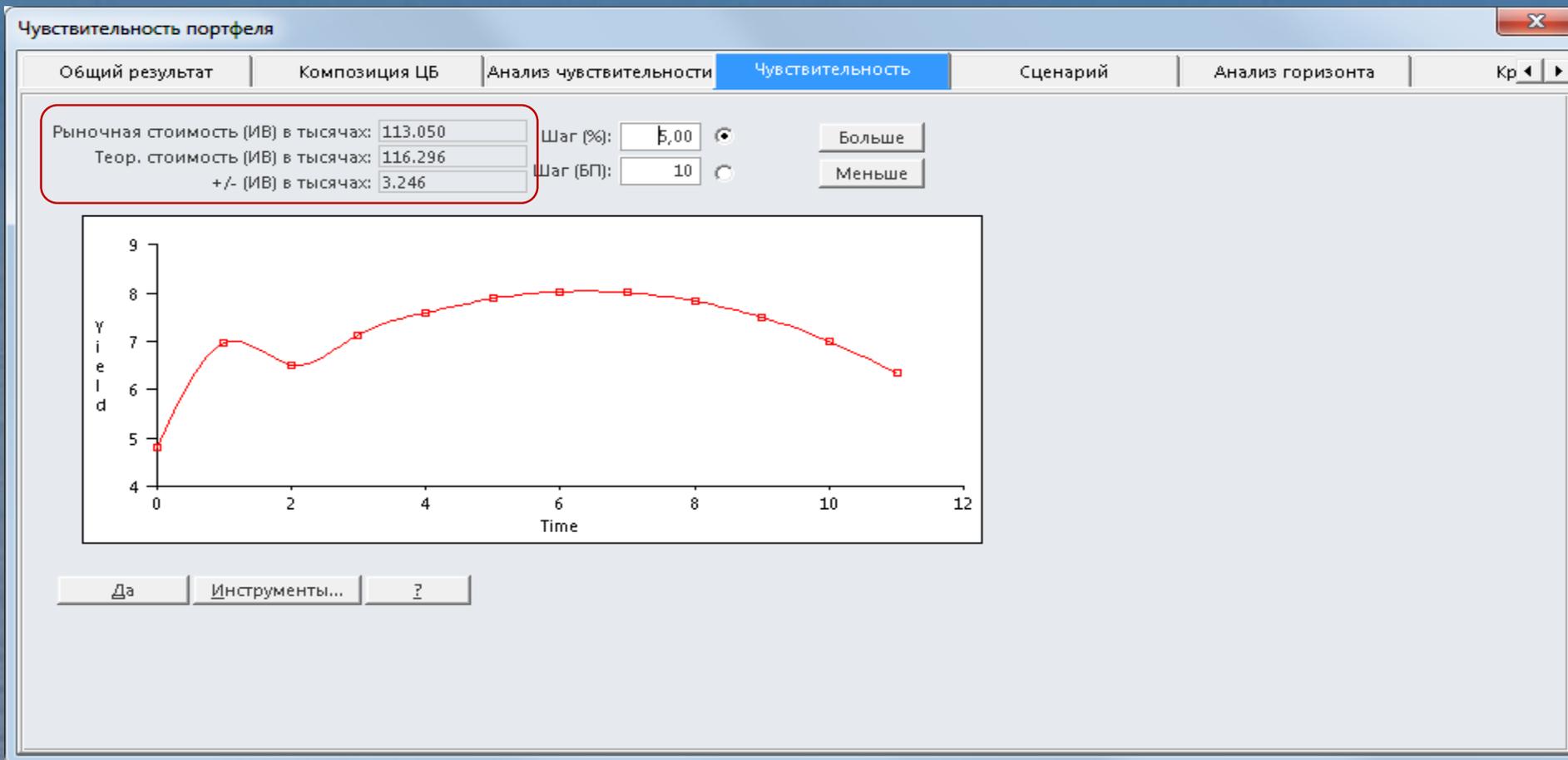
ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



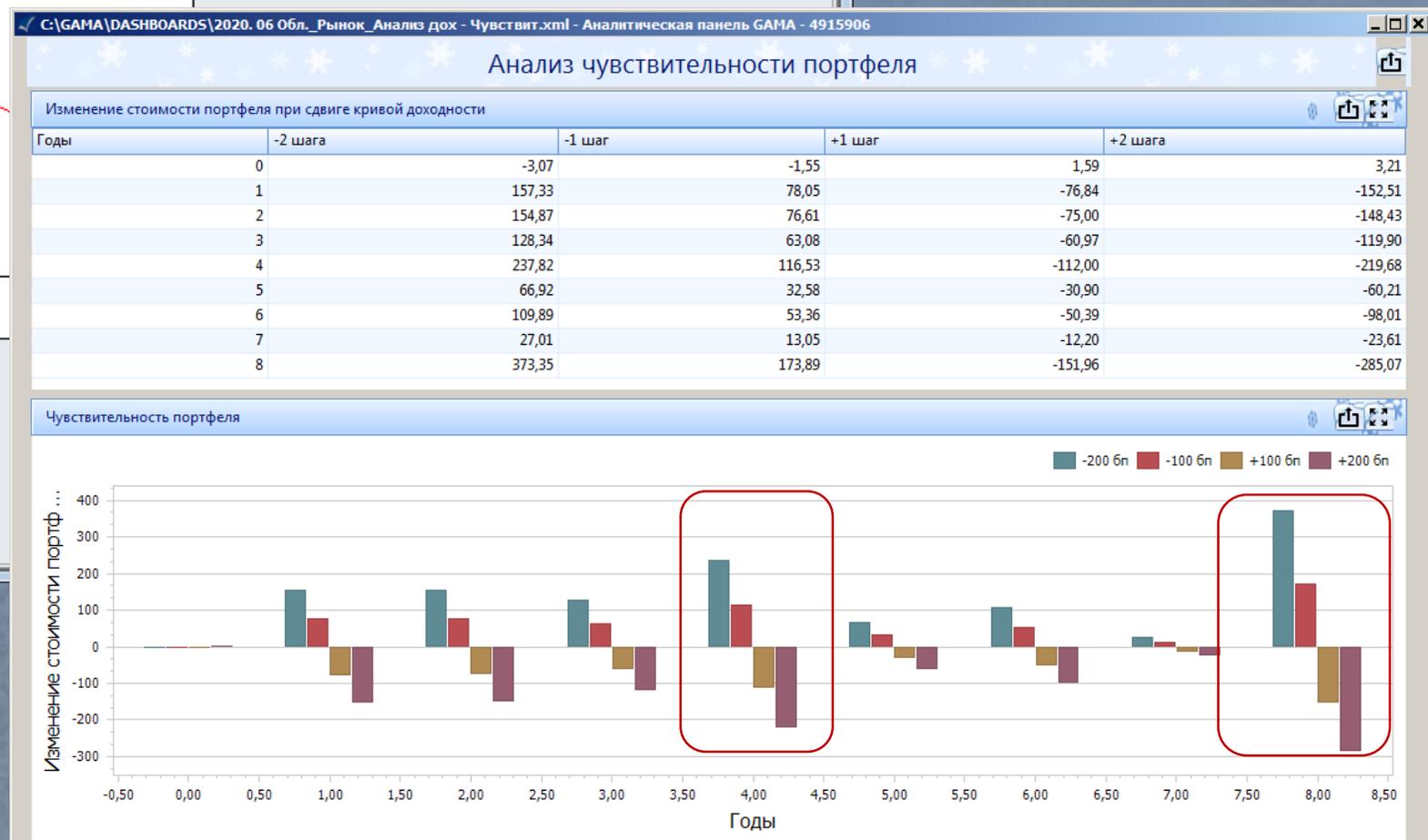
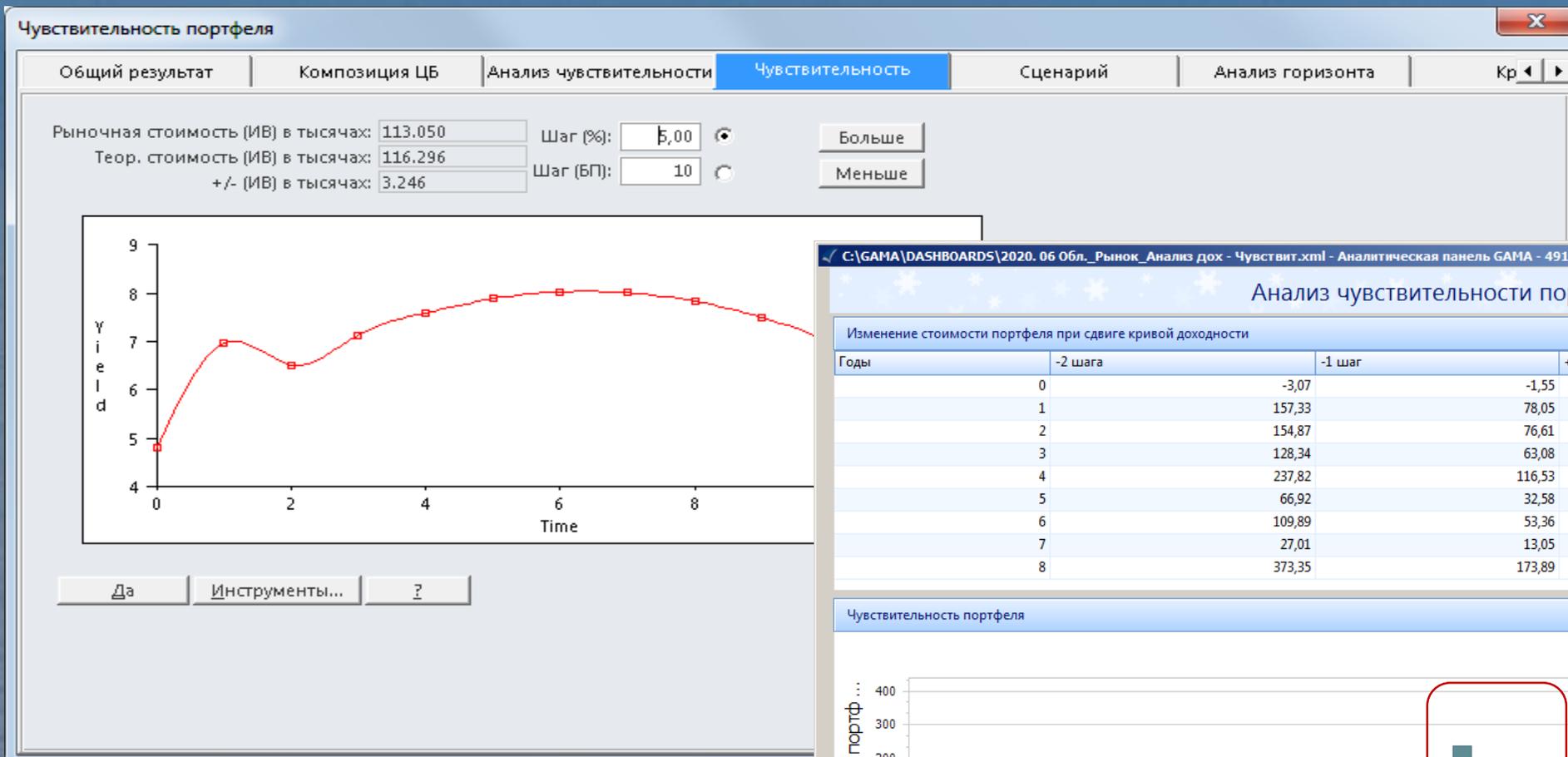
ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ПОДБОР ИНСТРУМЕНТОВ ПО ЗАДАНЫМ КРИТЕРИЯМ

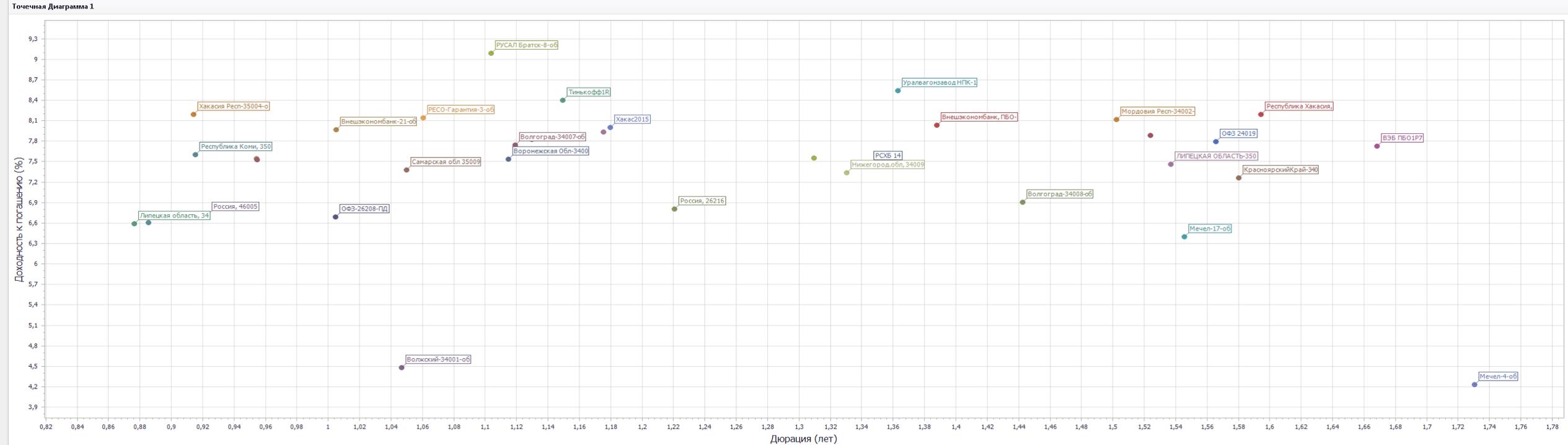


Таблица 1

Название цб	Тип актива	Сектор экономики	Агрегированный ...	Цена закр...	Цена средняя за 60...	Рейтинг э...	Рейтинг эмитента Moo...	Рейтинг эмитента Fit...	Рейтинг выпуска Fitc...	Рейтинг выпуска Mood...	Рейтинг выпуска SP...
БашкортостанРесп-340	04 Обл субфедеральные	Административные		104,39	104						
Внешэкономбанк, ПБО-	02 Обл корпоративные	Банки	1	103,06	103	BBB-	Ba1	BBB-			
Внешэкономбанк-21-об	02 Обл корпоративные	Банки	4	102,40	102	BBB-	Ba1	BBB-			
Волгоград-34007-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	105,35	105	Отозван	B2	BB-			
Волгоград-34008-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	110,29	110	Отозван	B2	BB-			
Волжский-34001-об	03 Обл муниципальные	Административные	4	111,30	111		B1	BB-			
Воронежская Обл-3400	03 Обл муниципальные	Административные	4	104,90	105		B1	BB-			
ВЭБ ПБО1Р7	02 Обл корпоративные	Банки	1	102,45	102	BBB-	Ba1	BBB-			
ЕвразХолдинг Финанс-	02 Обл корпоративные	Финансовые компа...	4	107,05	107	BB-					
КрасноярскийКрай-340	02 Обл корпоративные	Административные		107,40	107						
Липецкая область, 34	04 Обл субфедеральные	Административные	3	103,59	104	Отозван		BB	BB		
ЛИПЕЦКАЯ ОБЛАСТЬ-350	04 Обл субфедеральные	Административные	2	100,35	100	Отозван		BB+	BB		
Мечел-17-об	02 Обл корпоративные	Металлургия	7	93,51	93,5	B-	B3				
Мечел-4-об	02 Обл корпоративные	Металлургия	7	95,00	95	B-	B3	Отозван			
Мордовия Респ-34002-	04 Обл субфедеральные	Административные		108,80	109				B+		
Нижегород.обл, 34009	04 Обл субфедеральные	Административные	3	100,88	101	BB	B1	BB			
Нижегородская област	04 Обл субфедеральные	Административные	3	108,82	109	BB	B1	BB			
ОФЗ 24019	05 Государственные ЦБ	Государственные э...	1	102,27	102	BBB-	Ba1	BBB-	BBB-		
ОФЗ-26208-ПД	05 Государственные ЦБ	Государственные э...	1	100,90	101	BBB-	Ba1	BBB-	BBB-	Ba1	BBB-
РЕСО-Гарантия-3-об	02 Обл корпоративные	Финансовые компа...	1	104,00	104	BB-	Ba1	BBB-			
Республика Коми, 350	04 Обл субфедеральные	Административные	1	103,31	103	BBB-	B1	BB	BB		
Республика Хакасия,	04 Обл субфедеральные	Административные	1	100,72	101	BBB-	Ba1	BB-			
Роснефть, БО-01	02 Обл корпоративные	Нефтегазовая отра...	1	101,40	101	BB+	Baa3	BBB-			

Контрольный уровень

- (Все)
- Уровень 1
- Уровень 2
- Уровень 3

Тип актива

- (Все)
- 02 Обл корпоративные
- 03 Обл муниципальные
- 04 Обл субфедеральные
- 05 Государственные ЦБ

Агрегированный ре...

- (Все)
- 1
- 2
- 3
- 4
- 7

Сектор экономики

- (Все)
- Административные
- Банки
- Государственные активы
- Машиностроение и металлообработка
- Металлургия
- Нефтегазовая отрасль
- Финансовые компании

АНАЛИЗ ИЗМЕНЕНИЯ ПРОЦЕНТНЫХ СТАВОК

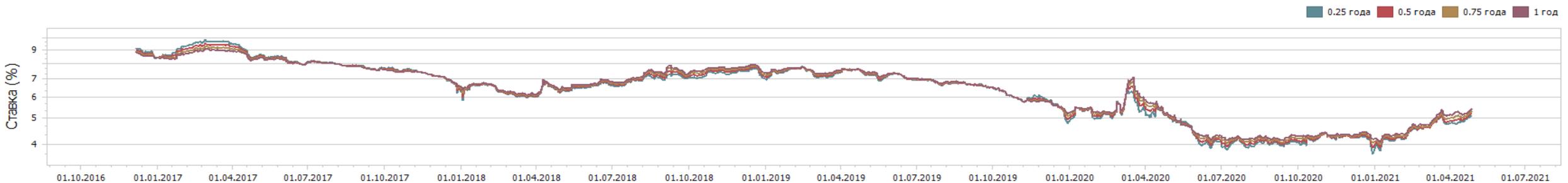
C:\GAMA\DASHBOARDS\Demonstration\Облиг_Рынок_Анализ дох_Ставки с фильтром.xml - Аналитическая панель GAMA - 6227276

История изменения процентных ставок G-кривой

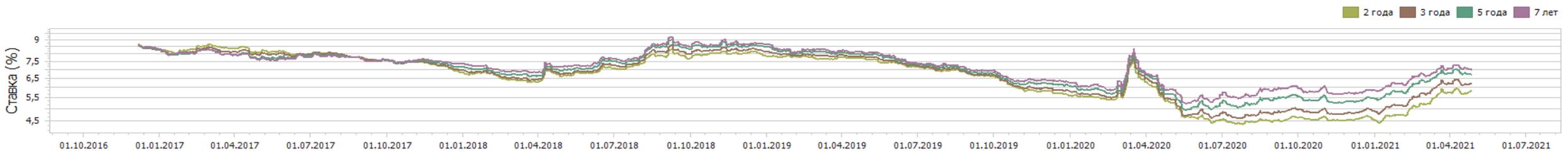
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837

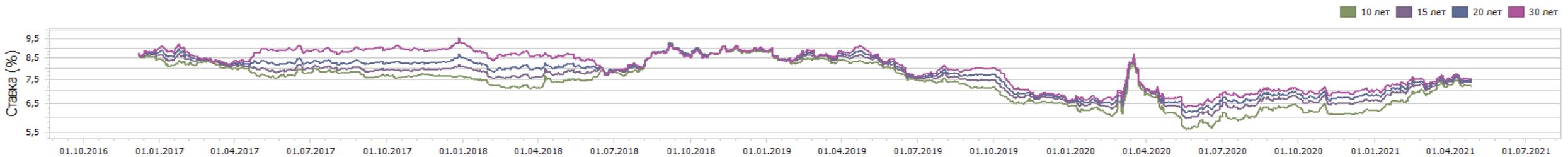
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Фильтр дат

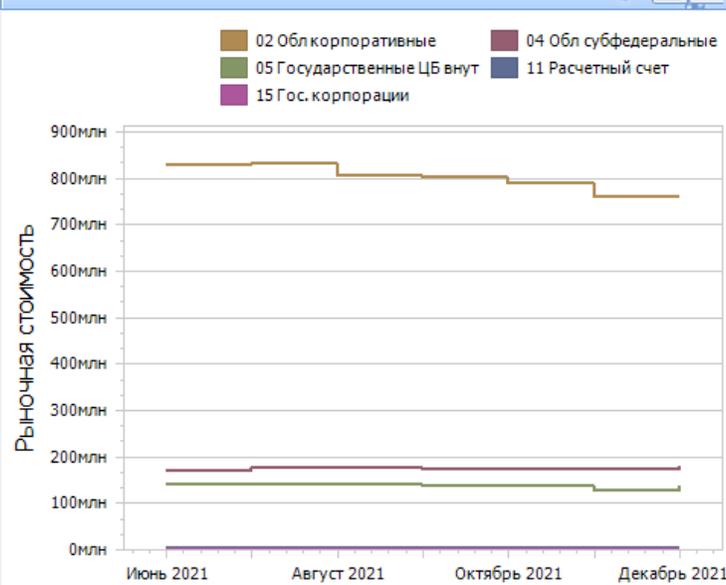
07.12.2016 11.03.2017 13.06.2017 15.09.2017 19.12.2017 23.03.2018 25.06.2018 28.09.2018 31.12.2018 04.04.2019 07.07.2019 10.10.2019 12.01.2020 15.04.2020 19.07.2020 21.10.2020 23.01.2021 28.04.2021

Сценарный анализ

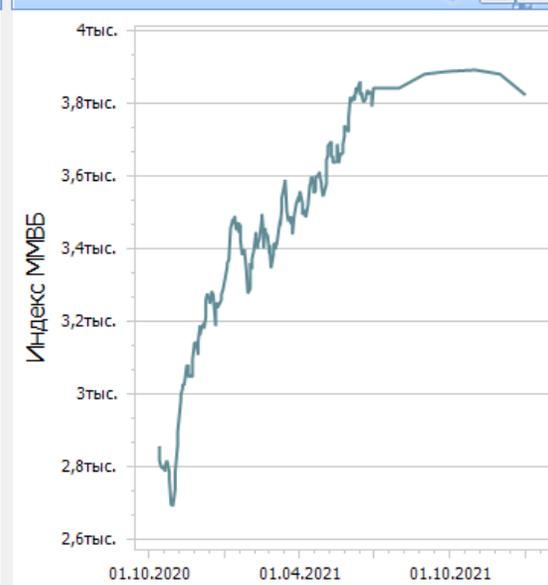
Прогнозная стоимость портфелей

	2021		2021 Всего				
	3 кв. 2021	4 кв. 2021	Рын стоимость	Доля в РС	Отклонение РС	Рын стоимость	Доля
Денежный 1	↑	200,00%	972 169,53	0,03%	→	0,00%	2 268 395,57
Денежный 2	↑	200,00%	3 776 775,27	0,11%	→	0,00%	8 812 475,63
Портфель 2 УК1	↑	196,16%	842 680 075,47	23,57%	↓	-4,36%	2 021 344 278,29
Портфель 3 УК2	↑	204,22%	55 477 888,57	1,55%	↓	-1,04%	129 962 959,49
Портфель 5 Собственный	↑	204,59%	1 140 978 993,07	31,91%	↓	-0,35%	2 661 807 707,27
Портфель 6 Собственн...	↑	204,30%	1 531 617 283,99	42,84%	↓	-2,06%	3 609 335 818,38
+	↑	Ошибка	56 168 334,67	1,57%	↑	122,15%	81 452 469,65
+ 01 Акции	↑	201,87%	77 442 878,45	2,17%	↓	-0,65%	181 219 040,79
- 02 Обл корпоратив...	↑	197,36%	1 015 947 751,35	28,41%	↓	-4,51%	2 437 729 052,84
Альфа-Банк, 002Р...	↑	198,78%	3 654 853,90	0,10%	↑	1,68%	8 452 530,83
Газпром Нефть-0...	↑	207,47%	13 465 692,35	0,38%	↑	0,32%	31 253 505,03
Гр Черкизово-1Р-...	↑	196,61%	39 837 916,98	1,11%	↑	0,81%	92 679 426,69
Группа ЛСР-БО-0...	↑	208,04%	74 550 948,12	2,09%	↑	0,81%	172 507 996,81

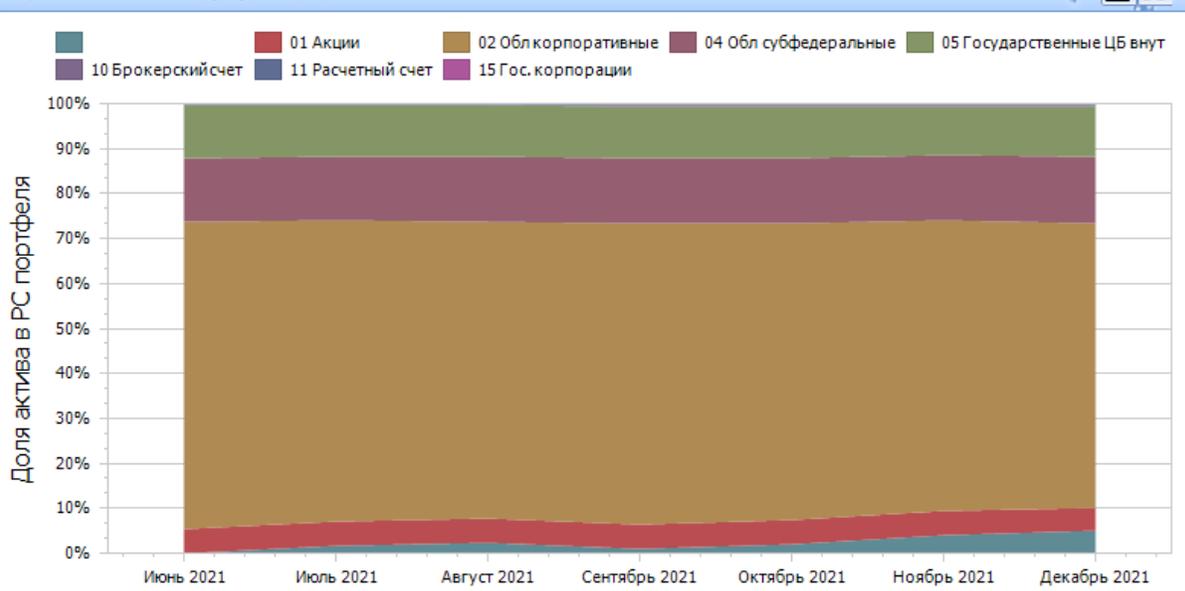
График изменения стоимости облигаций с учетом прогноза сдвига G-кр...



Индекс ММВБ (история+прогноз)



Прогноз изменения структуры портфелей



Изменение прогнозной стоимости портфелей

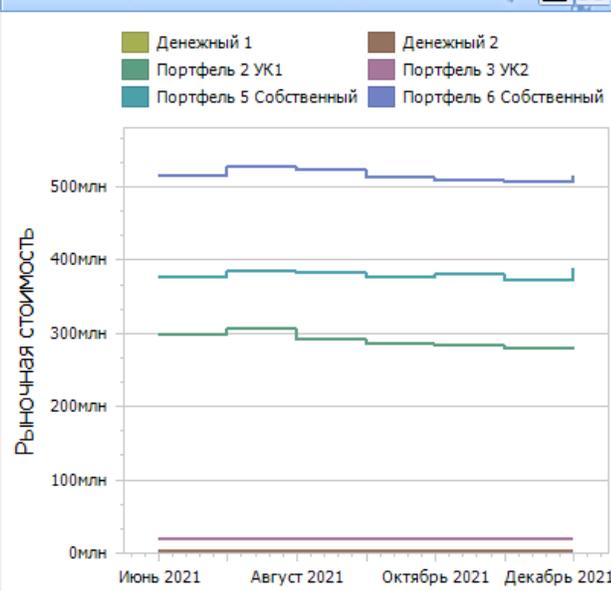
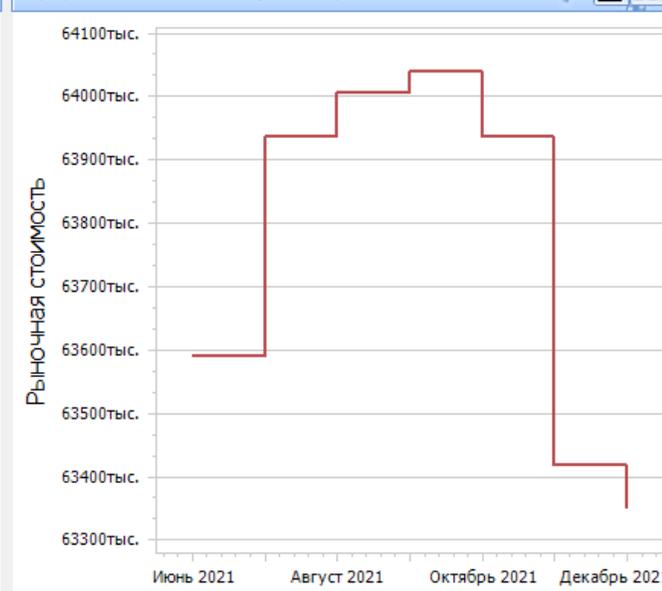


График стоимости акций с учетом прогноза индекса



НАЧАЛЬНЫЕ ДАННЫЕ ДЛЯ ПОРТФЕЛЬНОГО АНАЛИЗА



АГЕНТ GAMA



АГЕНТ ГАМА

- ✓ Освободить время для выполнения более интеллектуальных задач
- ✓ Сократить количество ошибок в работе за счет ее автоматизации
- ✓ Выполнять работы в нерабочее время
- ✓ Обеспечить оперативное обновление данных в системе



EUR ↑ 1.0734 - .0006

BGN 1.0734 / 1.0735 BGN

At 17:27 Op 1.0735 Hi 1.0739 Lo 1.0722 Close 1.0741 Value 11/12/15

EUR BGN Currency

Bloomberg Quote

EURUSD Spot Exchange Rate - Price of 1 EUR in USD

1) All Composite Quotes (ALLQ)

Time	Bid Src	Bid / Ask	Ask Src
Best Bid/Ask			
17:27	ANON	1.0735 / 1.0735	ANON
Quote Recap			
17:27	ZFXH	1.0733 / 1.0736	ZFXH
17:27	ALFN	1.0733 / 1.0736	ALFN
17:27	RZBM	1.0734 / 1.0735	RZBM
17:27	ZFXH	1.0733 / 1.0736	ZFXH

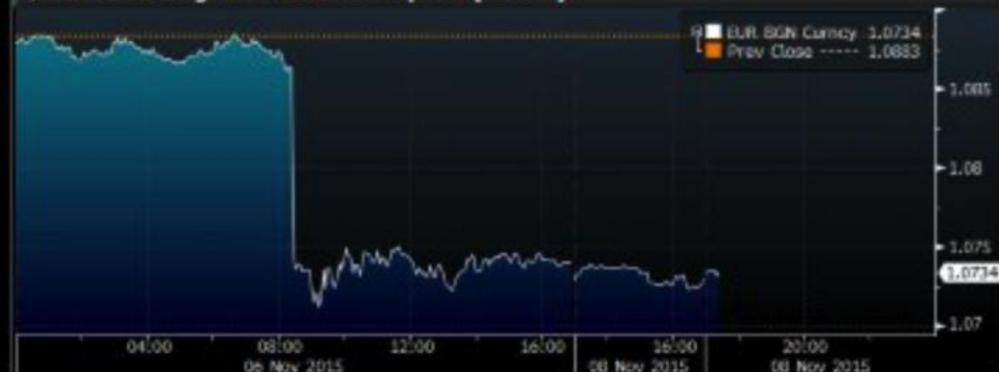
3) Spot & Forward Rates (FRD)

	EUR/USD		EUR/JPY	
	Bid	Ask	Bid	Ask
SP	1.0735	1.0735	132.31	132.34
1M	4.38	4.61	1.82	2.59
2M	13.39	13.89	-5.20	-4.16
3M	21.10	21.70	-3.74	-2.47
6M	47.03	47.40	-9.37	-6.63
12M	117.35	118.35	-18.11	-14.73

4) Open/High/Low/Close Graph (GPC)



5) Intraday Price Graph (GIP)



6) FX News (CN)

- BN** 7:58 Cameron Warns EU Not to Ignore British Renegotiation Demands (1)
- BFW** 15:01 Portuguese Communists Reaffirm Socialist Party Can Form Govt
- BFW** 11/07 U.K. Passenger Plane Avoided Missile Above Egypt in August: Mail

ГАМА ТЕРМИНАЛ



Мониторинг портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор руководителя

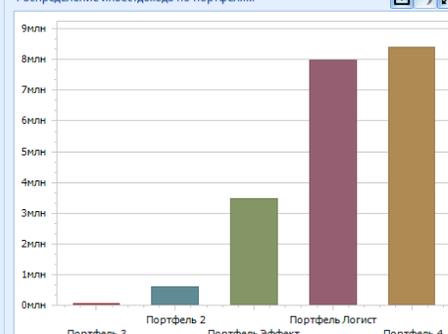
Портфели УК

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...

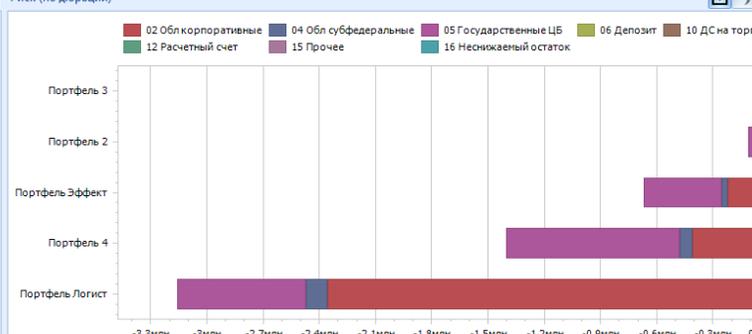
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффе...



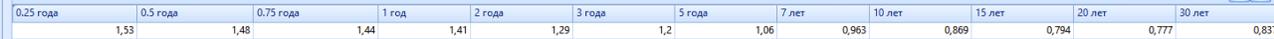
Распределение инвестодохода по портфелям



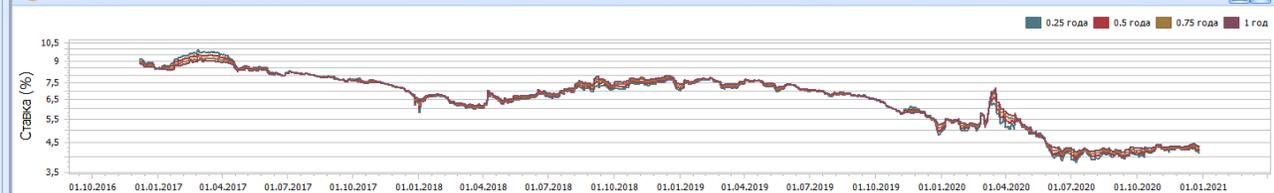
Риск (по дорации)



Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 P	0,00	880 901,53 P	1 362 817,45 P	67 791 418...	2,01%
Портфель ...	155 019 962...	156 001 775,88 P	17 511,69	2 381 934...	3 363 748,27 P	152 585 739...	2,20%
Портфель 4	178 673 772...	179 905 481,80 P	0,00	2 732 462...	3 964 171,42 P	184 772 800...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 P	2 474 021,82 P	0,00	22 996,47 P	36 972,88 P	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 P	0,00	167 810,58 P	260 633,17 P	13 501 551...	1,93%

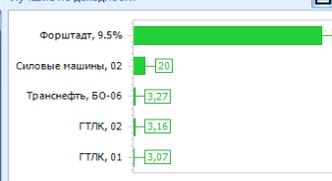
Доля актива в портфеле



Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	0,00
	Нижегород.обл...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	0,00
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001P...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00	
ВЭБ 09	04 Обл субфед...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	0,00	
Волгоград.обл 35...	04 Обл субфед...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	0,00	
Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00	
Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00	
Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00	

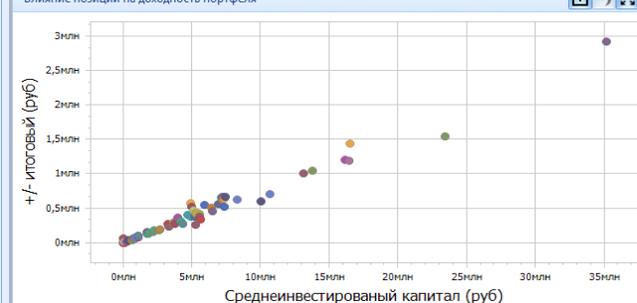
Лучшие по доходности



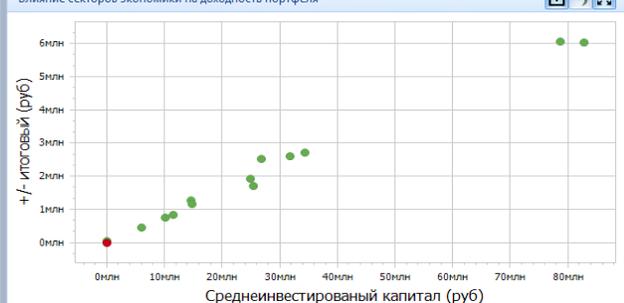
Худшие по доходности



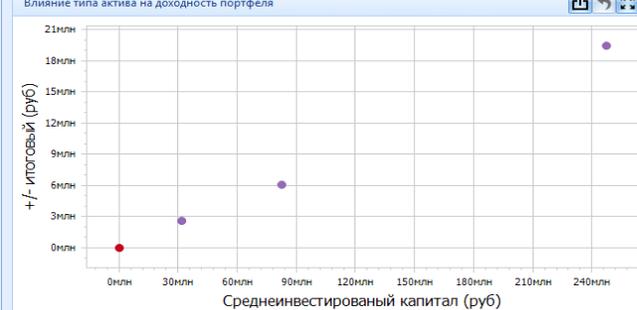
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



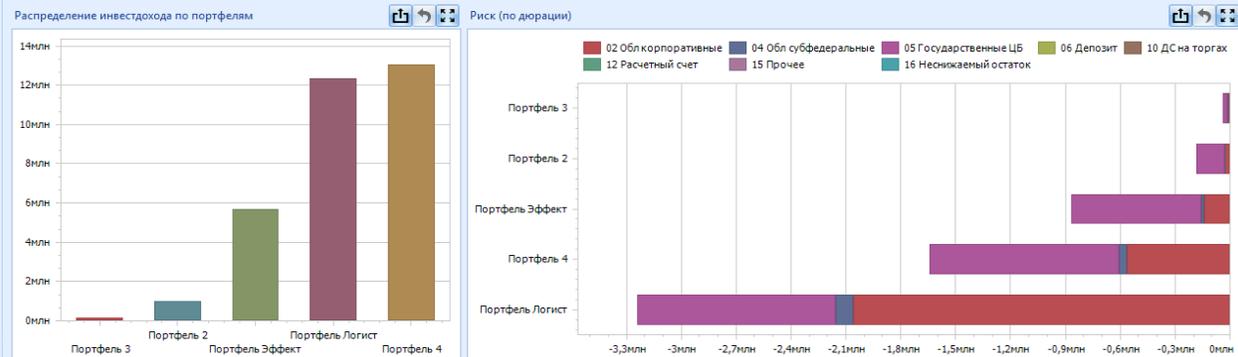
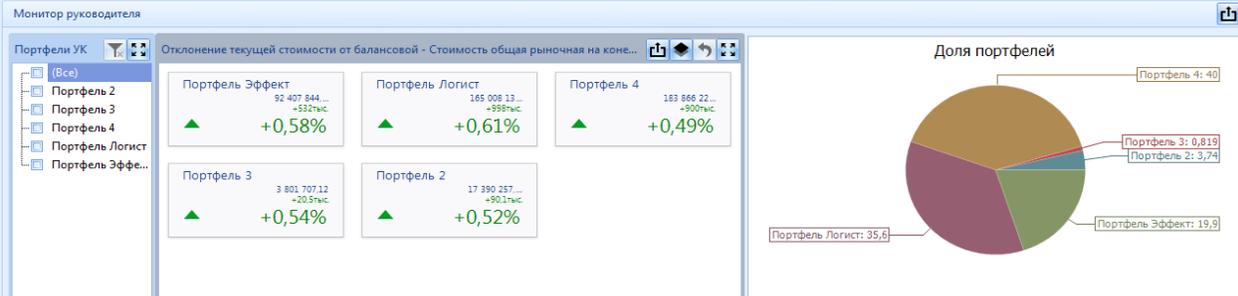
Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



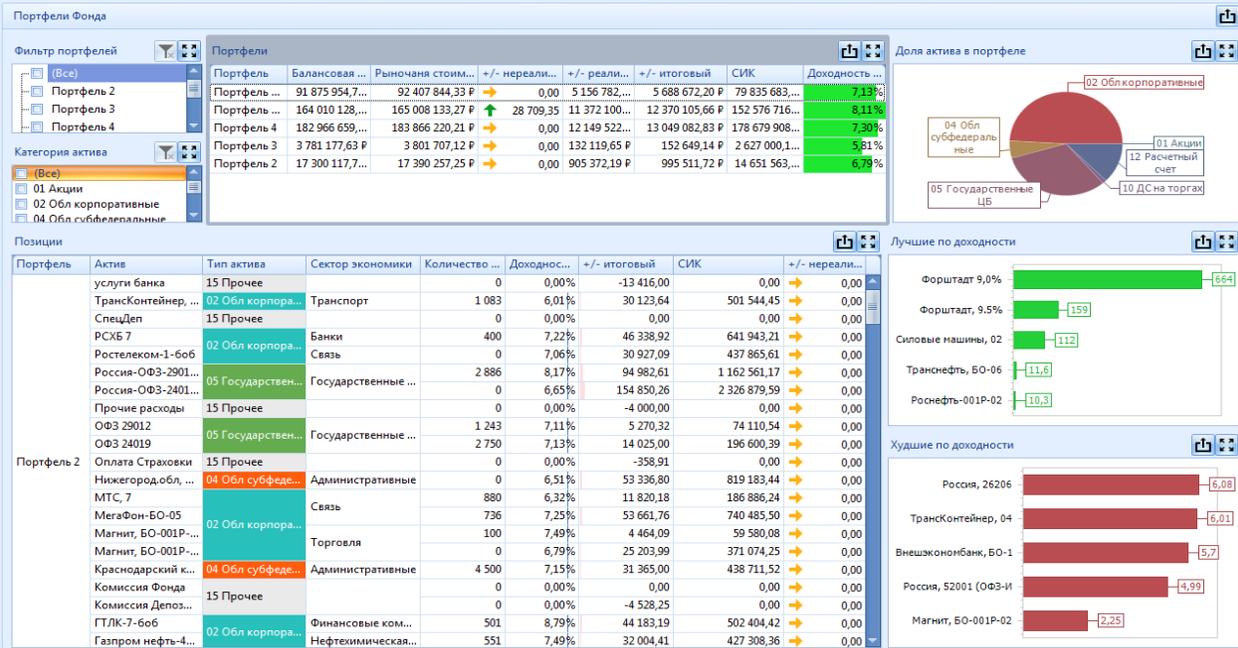
Мониторинг портфелей



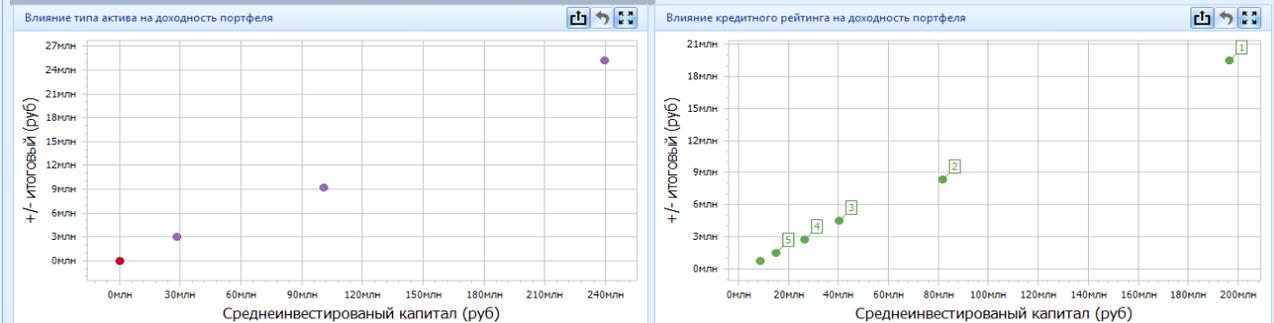
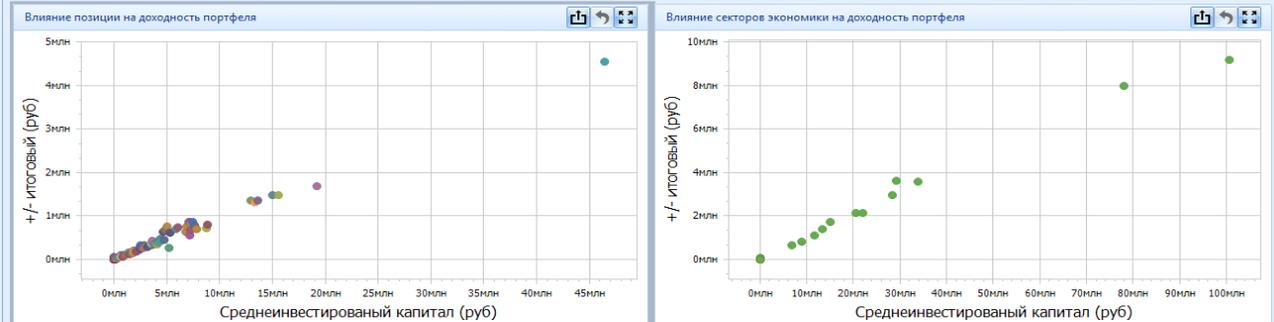
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



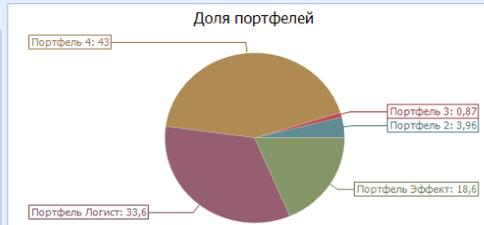
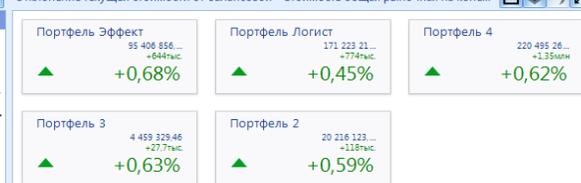
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

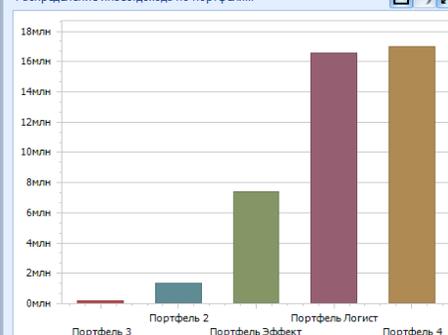
Портфели УК

- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эфф...

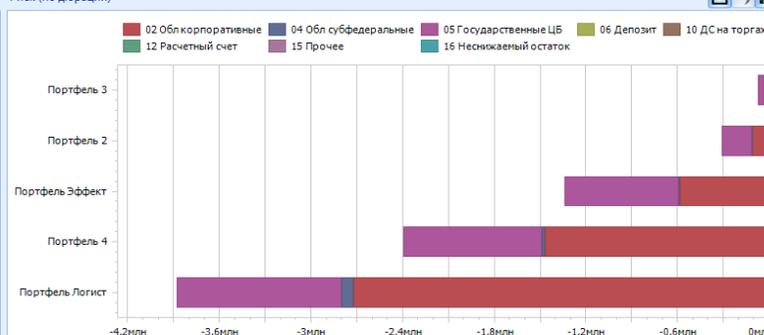
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на коне...



Распределение инвестдохода по портфелям



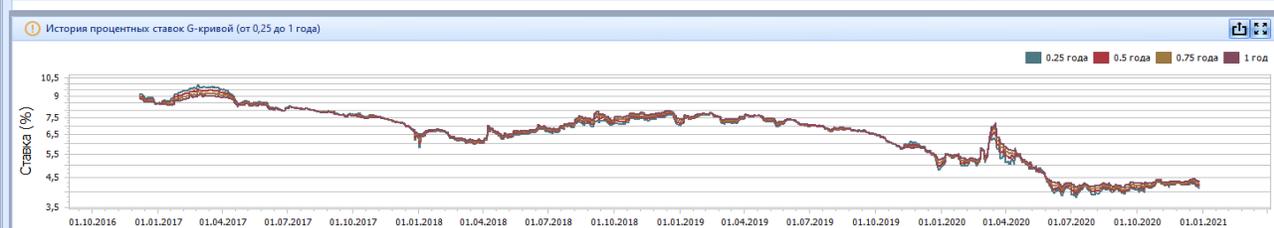
Риск (по дорации)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	1,53	0,5 года	1,48	0,75 года	1,44	1 год	1,41	2 года	1,29	3 года	1,2	5 года	1,06	7 лет	0,963	10 лет	0,869	15 лет	0,794	20 лет	0,777	30 лет	0,837
-----------	------	----------	------	-----------	------	-------	------	--------	------	--------	-----	--------	------	-------	-------	--------	-------	--------	-------	--------	-------	--------	-------



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	94 762 414,4...	95 406 856,52 P	87 456,02	6 785 014,...	7 429 456,95 P	81 573 960,...	9,11%
Портфель ...	170 449 538,...	171 223 211,75 P	-47 607,50	15 811 510,...	16 585 184,14 P	152 896 086,...	10,85%
Портфель 4	219 140 442,...	220 495 261,27 P	300 312,49	15 651 439,...	17 006 258,29 P	179 454 395,...	9,48%
Портфель 3	4 431 608,00 P	4 459 329,46 P	3 238,42	192 452,94 P	220 174,40 P	2 963 963,5...	7,43%
Портфель 2	20 097 743,2...	20 216 123,91 P	2 737,54	1 230 434,...	1 348 815,90 P	15 486 548,...	8,71%

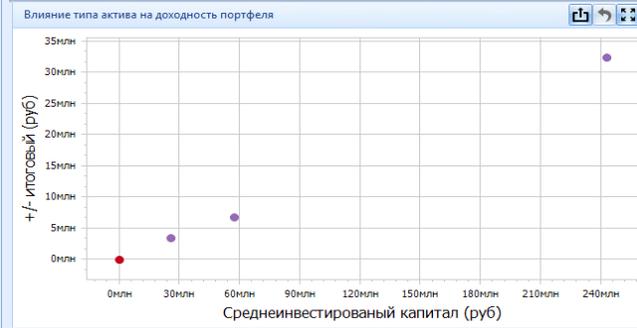


Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-20 155,00	0,00	→ 0,00
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	8,20%	35 766,07	436 214,32	→ 0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСХБ 9	02 Обл корпора...	Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	↑ 2 183,70
	РСХБ 7	02 Обл корпора...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	→ 0,00
	Ростелеком-1-6об	04 Обл субфедер...	Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государствен...	Государственные ...	2 886	9,62%	155 704,05	1 618 888,91	↑ 9 494,94
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...		0	9,11%	154 850,26	1 699 553,44	→ 0,00
	РоснефтьБ7	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	1 552	7,40%	16 011,58	216 297,87	↓ -1 157,71
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→ 0,00
	ОФЗ 29012	05 Государствен...	Государственные ...	2 362	8,72%	59 312,51	679 955,04	↑ 3 306,80
	ОФЗ 24019	05 Государствен...		3 230	7,63%	65 916,32	863 771,39	↑ 3 272,50
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→ 0,00
	Нижегород, обл, ...	04 Обл субфедер...	Административные	0	8,91%	53 336,80	598 629,71	→ 0,00
	МТС_7	04 Обл субфедер...		0	8,47%	20 452,98	241 595,84	→ 0,00
МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	0	9,23%	54 611,20	591 358,34	→ 0,00	
Магнит, БО-001P-...	02 Обл корпора...		0	9,07%	6 196,29	68 279,99	→ 0,00	
Магнит, БО-001P-...	02 Обл корпора...	Торговля	0	9,30%	25 203,99	270 903,91	→ 0,00	
Краснодарский к...	04 Обл субфедер...	Административные	0	9,55%	35 820,00	374 976,00	→ 0,00	
Комиссия Фонда	04 Обл субфедер...		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00	
Комиссия Делоз...	15 Прочее		0	0,00%	-6 656,27	0,00	→ 0,00	



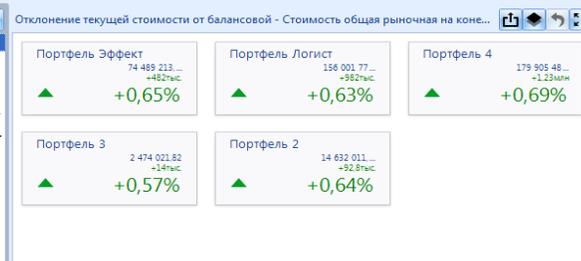
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



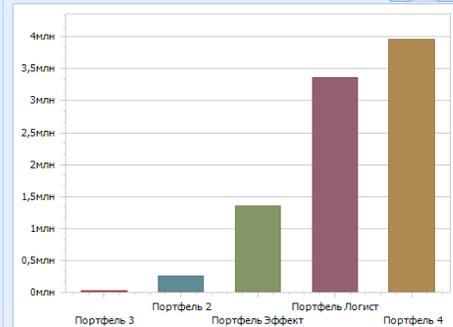
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

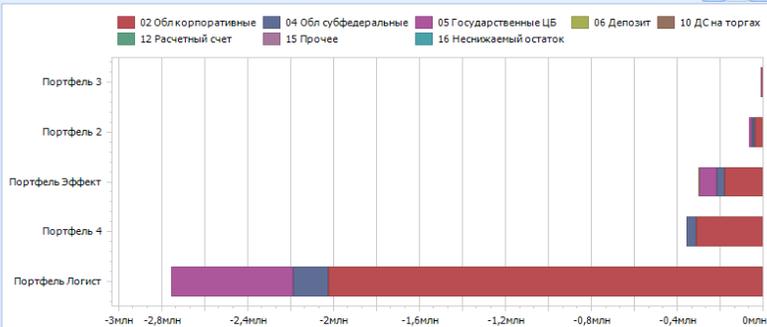
- Портфели УК
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
 - Портфель Логист
 - Портфель Эффе...



Распределение инвестдохода по портфелям



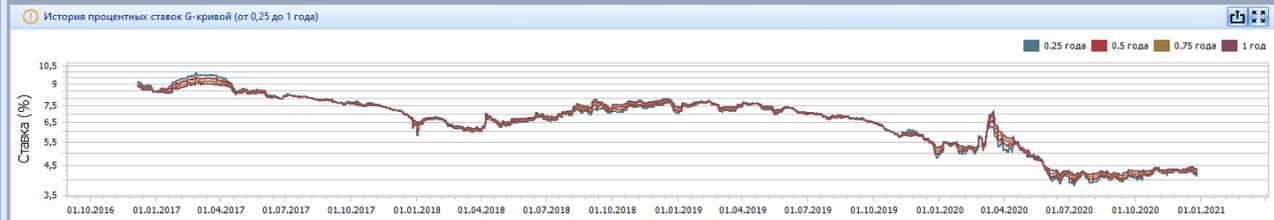
Риск (по дюрации)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837



Монитор портфелей

Портфели Фонда

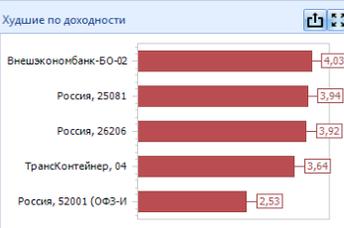
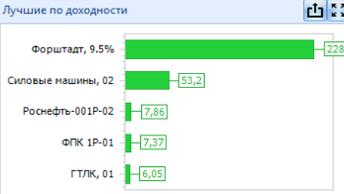
- Фильтр портфелей
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- нерели...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	→ 0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	↑ 3,84%	6 144,13	7 012 959...	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	→ 0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60 Р	2 797 888,24 Р	→ 0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	→ 0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,48%

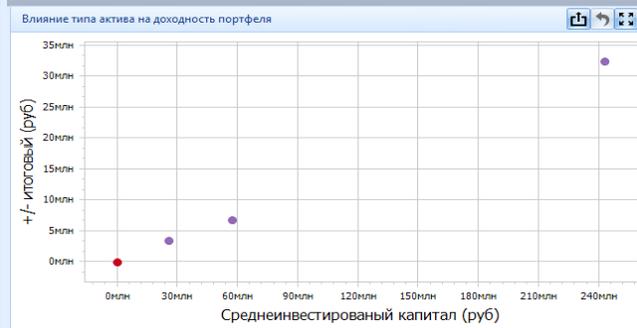
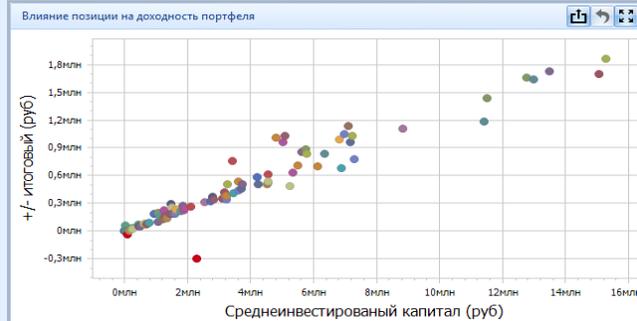


Позиции

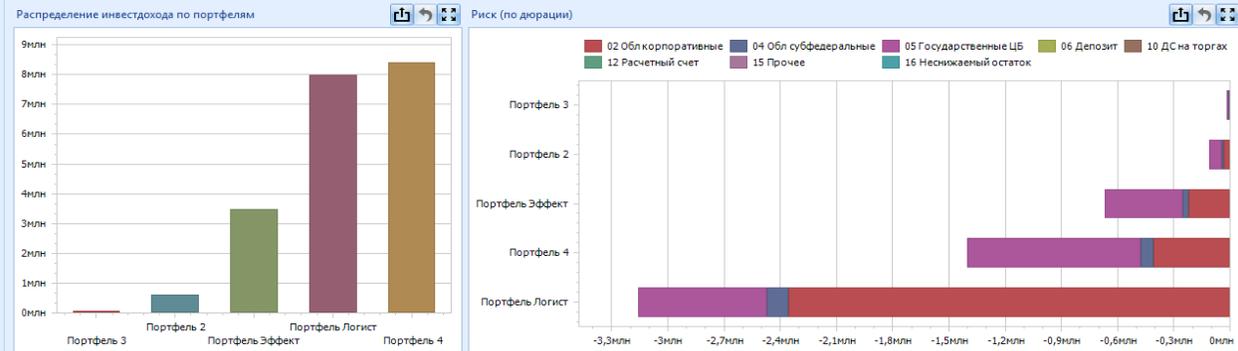
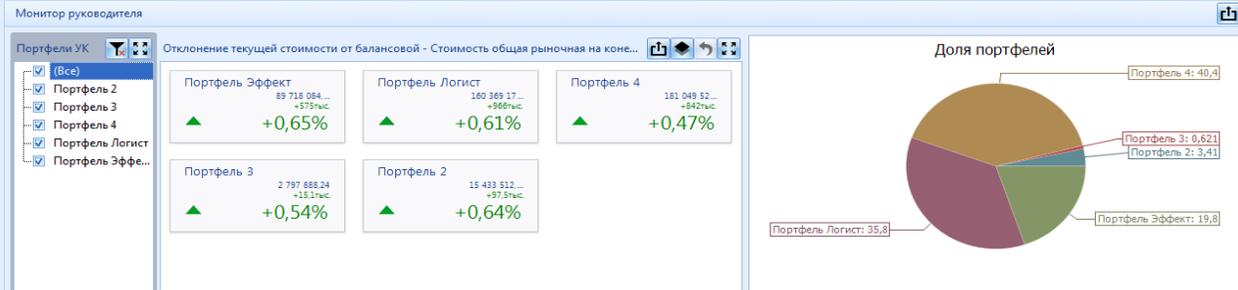
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- нерелизо...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	→ 0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,89%	41 606,08	887 125,31	→ 0,00
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	4,94%	30 927,09	681 531,88	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...			2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	→ 0,00
	Прочие расходы			0	0,00%	-3 000,00	0,00	→ 0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	→ 0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,88%	41 404,99	924 001,09	→ 0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	736	4,81%	34 569,92	749 458,07	→ 0,00
	Маяк, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	→ 0,00
	Маяк, БО-001Р...			0	4,37%	25 203,99	577 049,37	→ 0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	→ 0,00
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-3 044,62	0,00	→ 0,00	
ГТЛК-7-60б		Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	→ 0,00	
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	→ 0,00	
Газпром нефть, 12	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	→ 0,00	
Газпром Капитал...		Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	→ 0,00	
ВЭБ 09		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	→ 0,00	



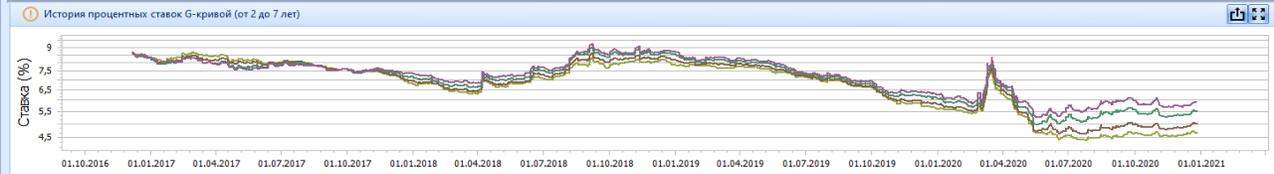
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



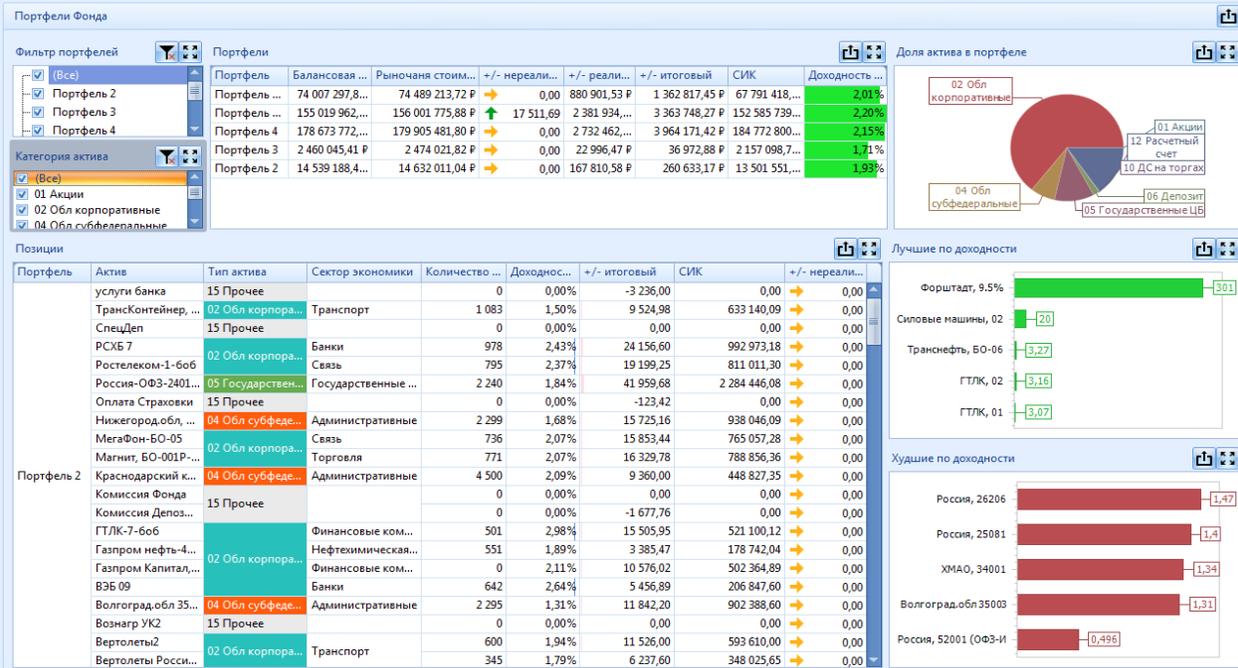
Мониторинг портфелей



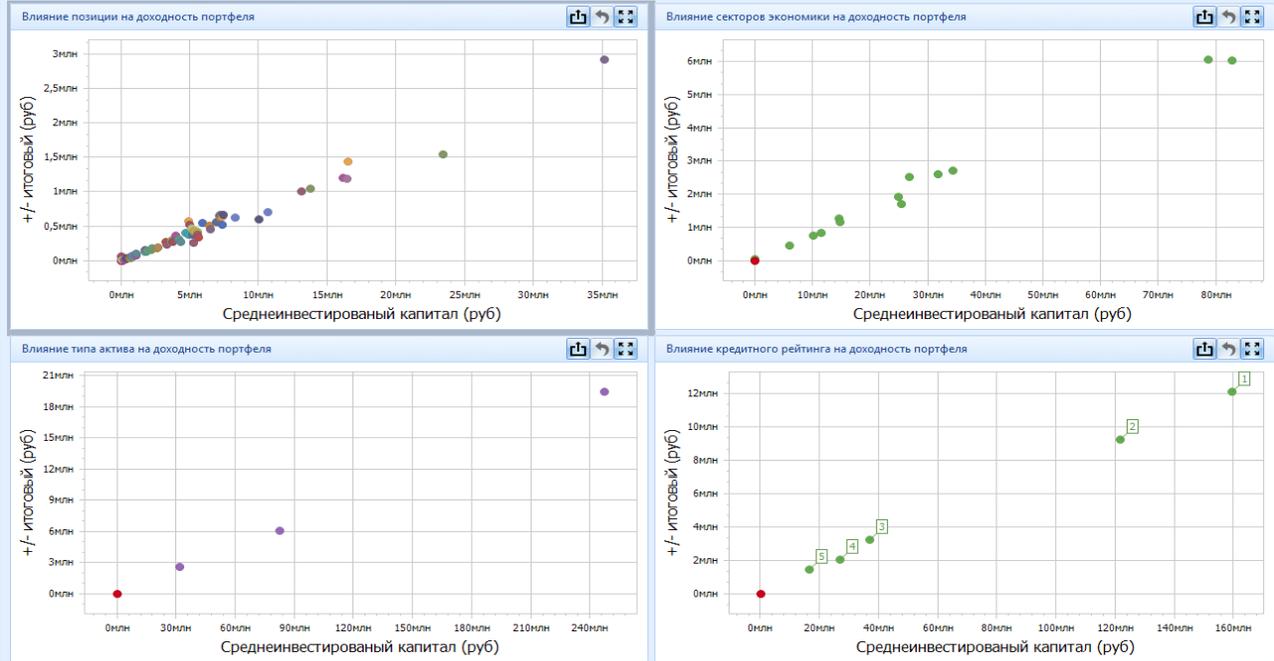
История изменения процентных ставок G-кривой



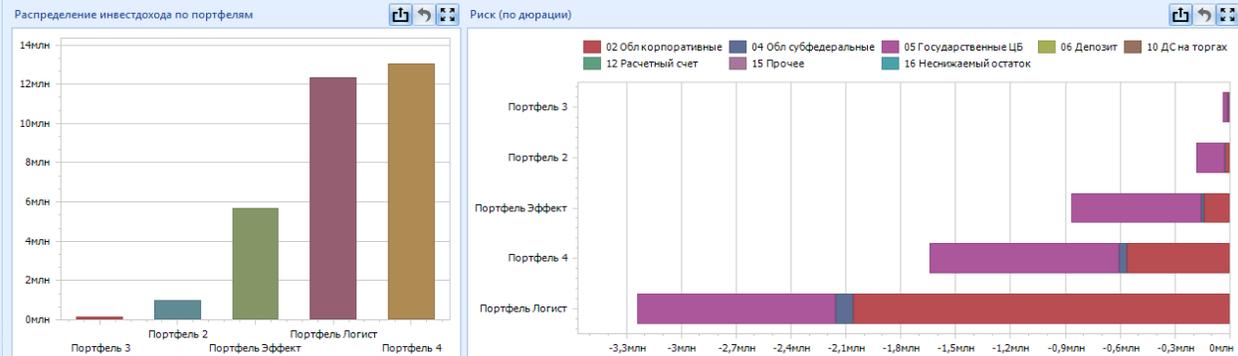
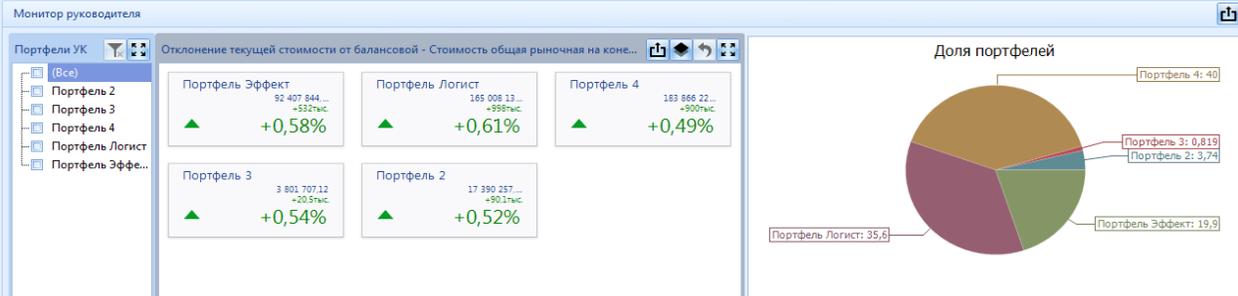
Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



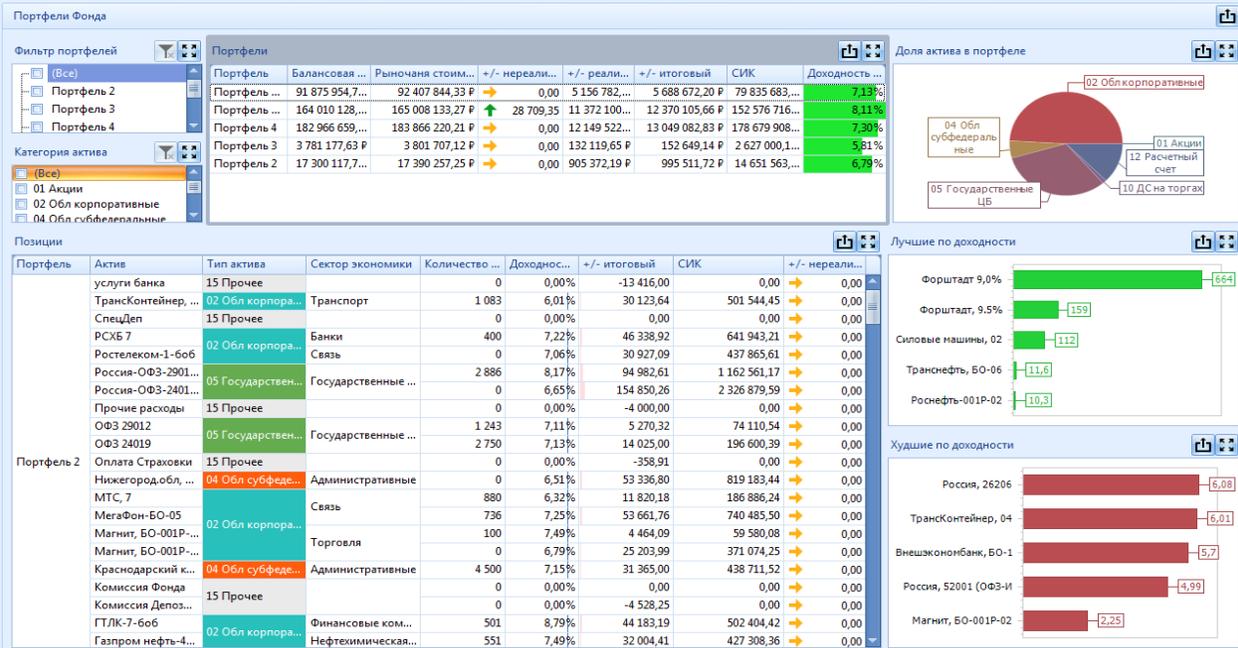
Мониторинг портфелей



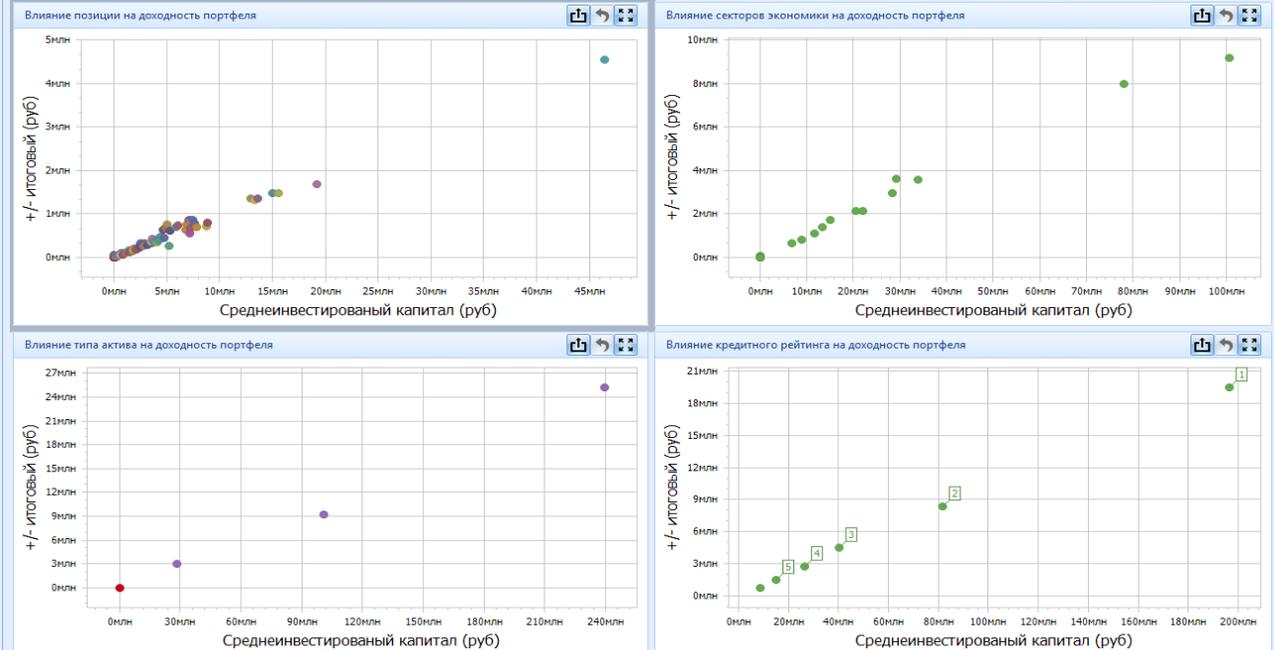
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой

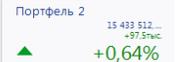
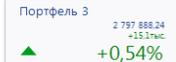


Монитор руководителя

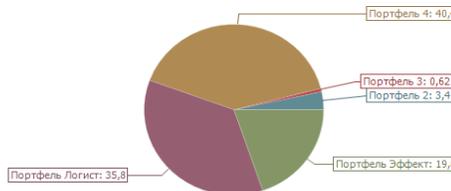
Портфели УК

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...

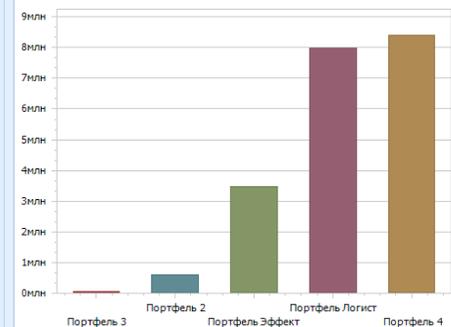
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффе...



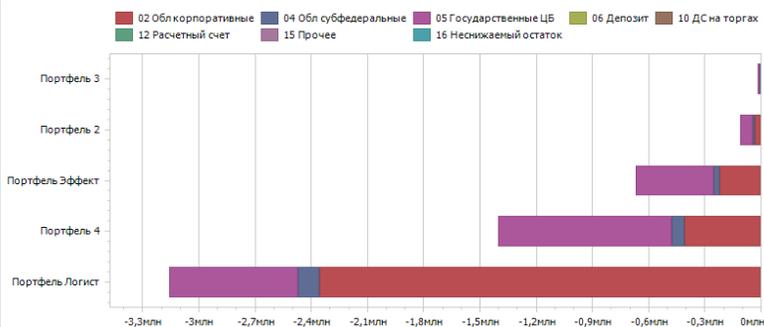
Доля портфелей



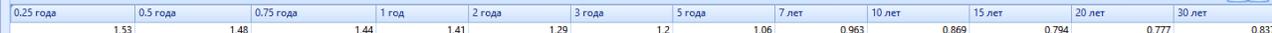
Распределение инвестодохода по портфелям



Риск (по дорации)



Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



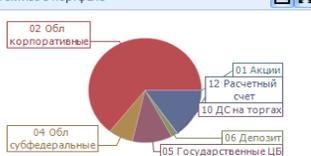
Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 Р	0,00	880 901,53 Р	1 362 817,45 Р	67 791 418...	2,01%
Портфель ...	155 019 962...	156 001 775,88 Р	17 511,69	2 381 934...	3 363 748,27 Р	152 585 739...	2,20%
Портфель 4	178 673 772...	179 905 481,80 Р	0,00	2 732 462...	3 964 171,42 Р	184 772 800...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 Р	2 474 021,82 Р	0,00	22 996,47 Р	36 972,88 Р	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 Р	0,00	167 810,58 Р	260 633,17 Р	13 501 551...	1,93%

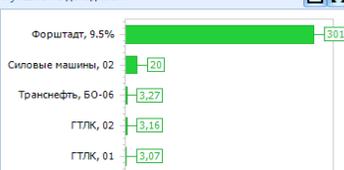
Доля актива в портфеле



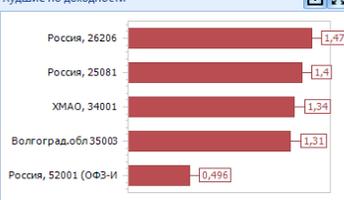
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	0,00
	Нижегород.обл...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	0,00
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
	Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00
	ВЭБ 09	02 Обл корпора...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	0,00
	Волгоград.обл 35...	04 Обл субфед...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	0,00
	Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00
	Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00

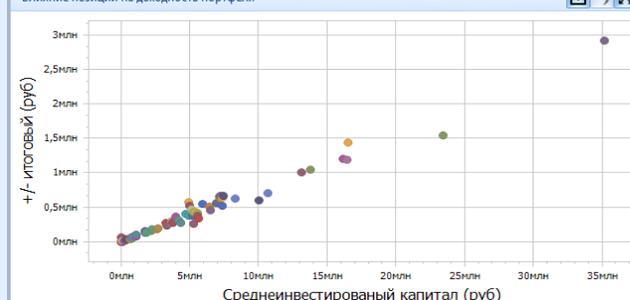
Лучшие по доходности



Худшие по доходности



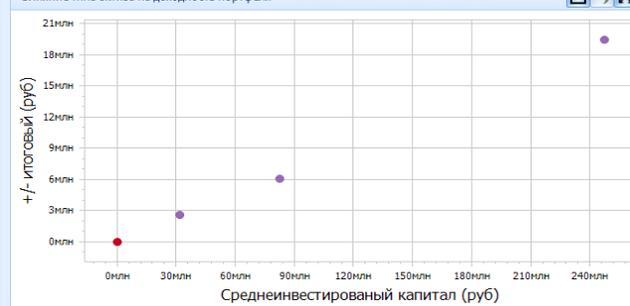
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



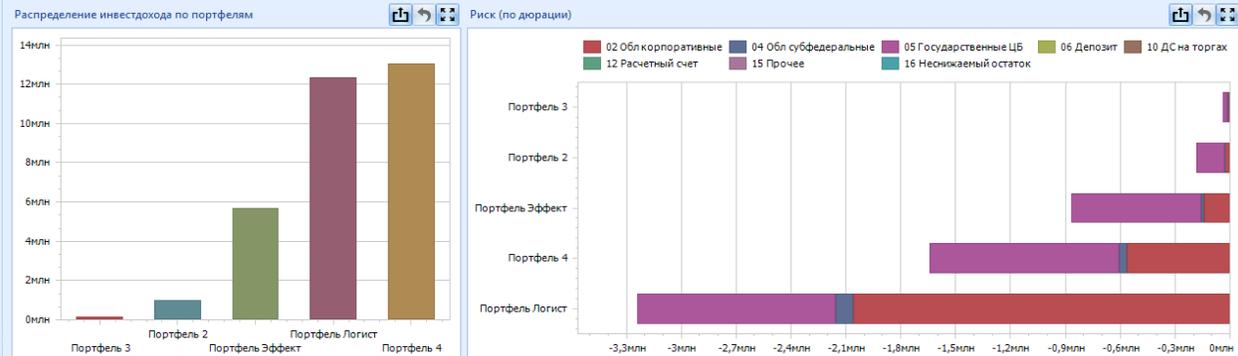
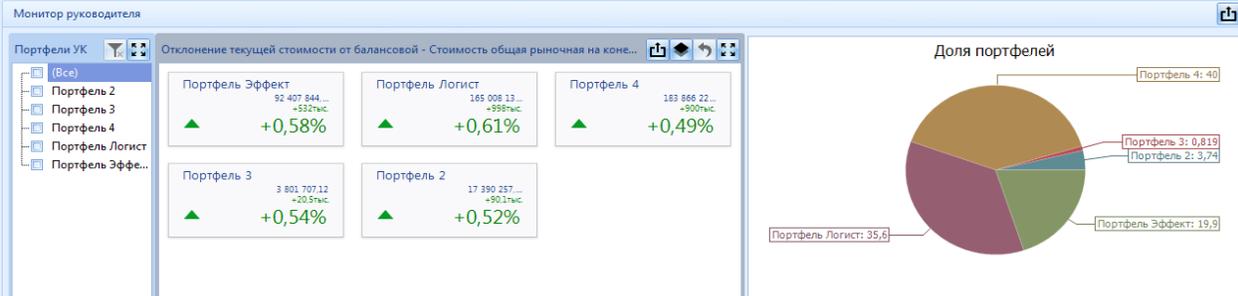
Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



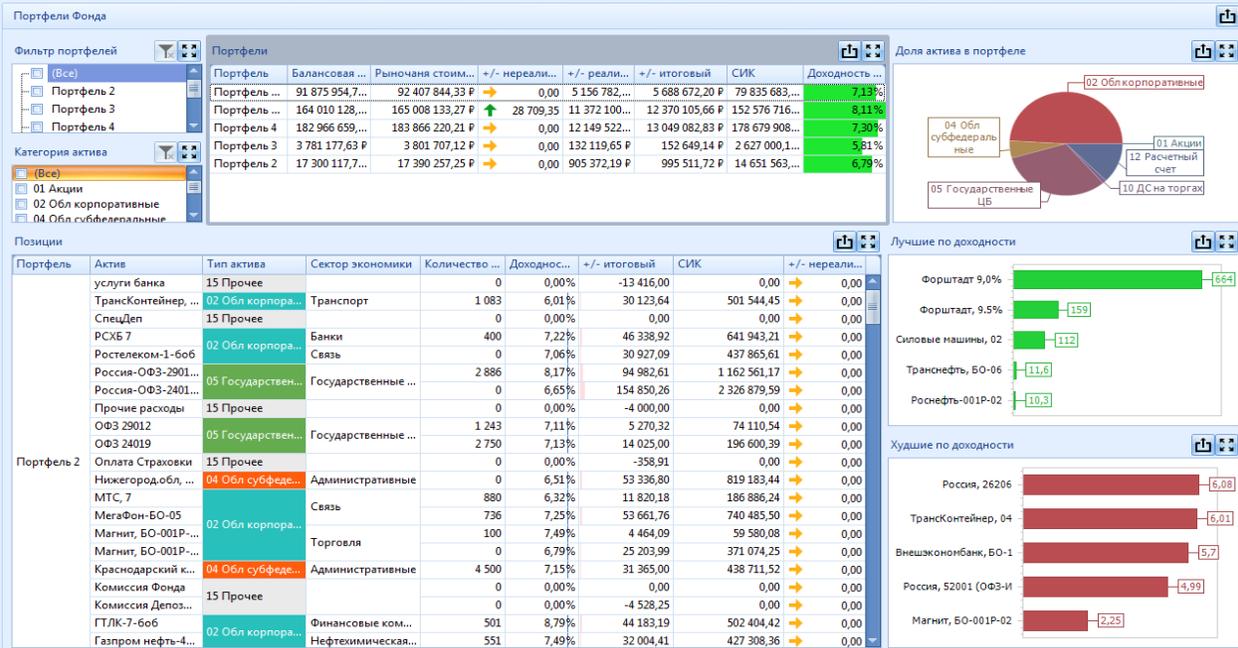
Мониторинг портфелей



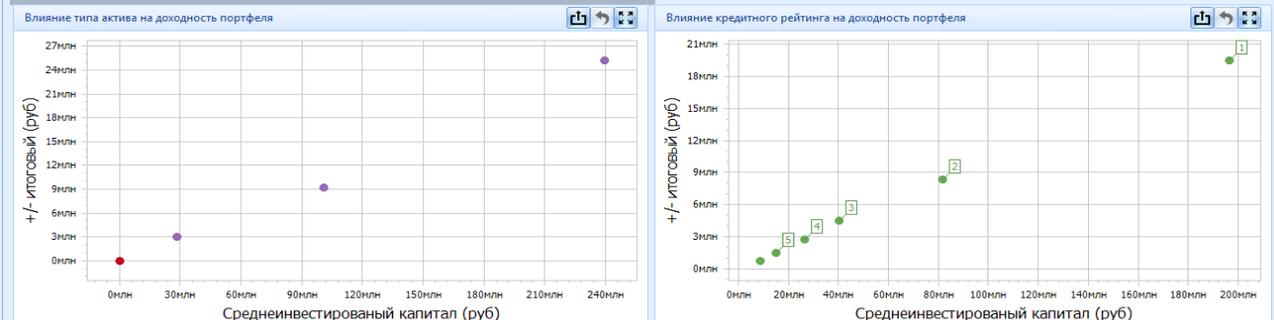
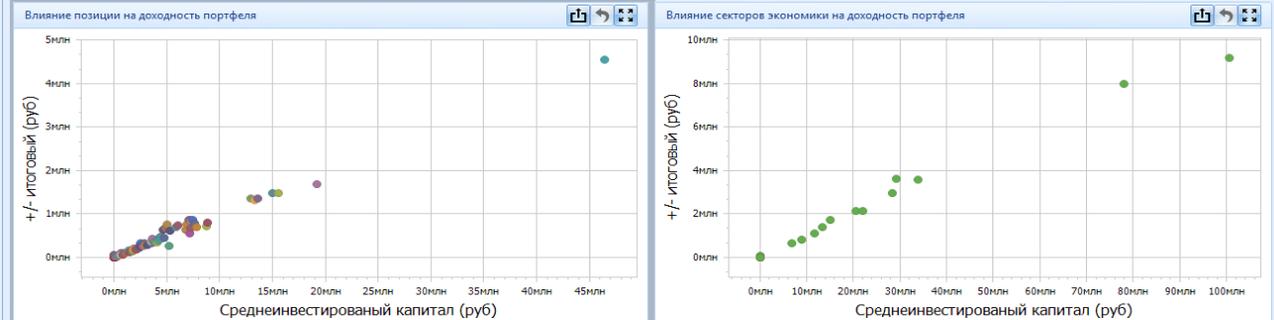
История изменения процентных ставок G-кривой



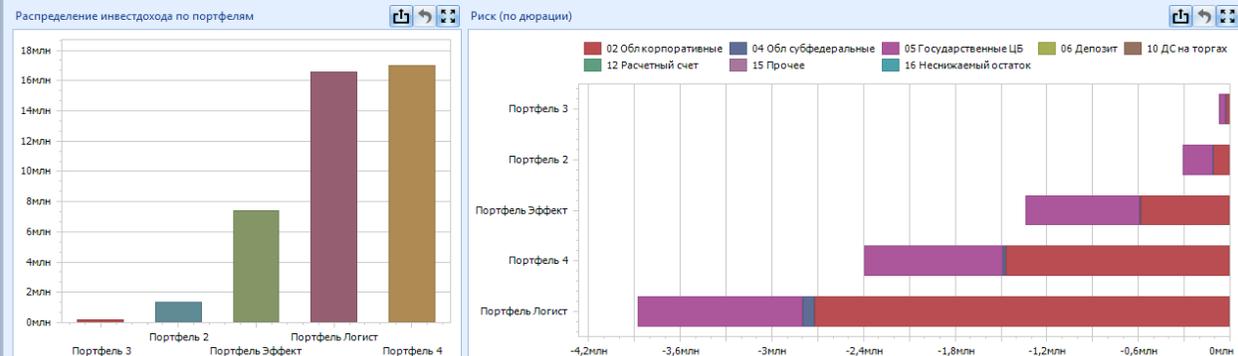
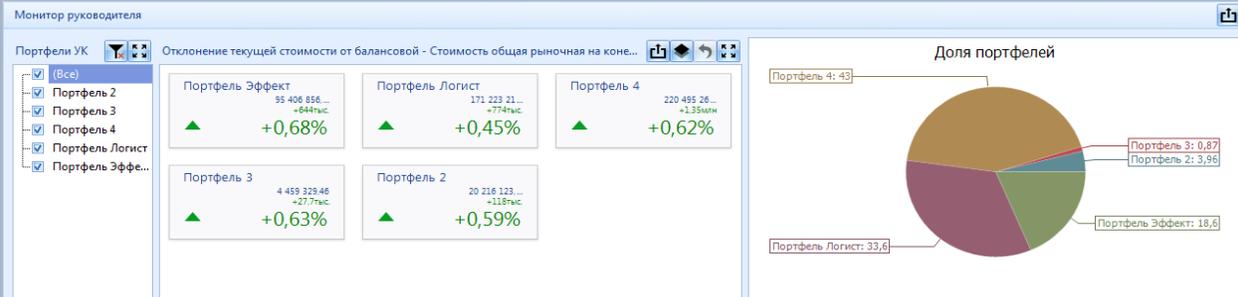
Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



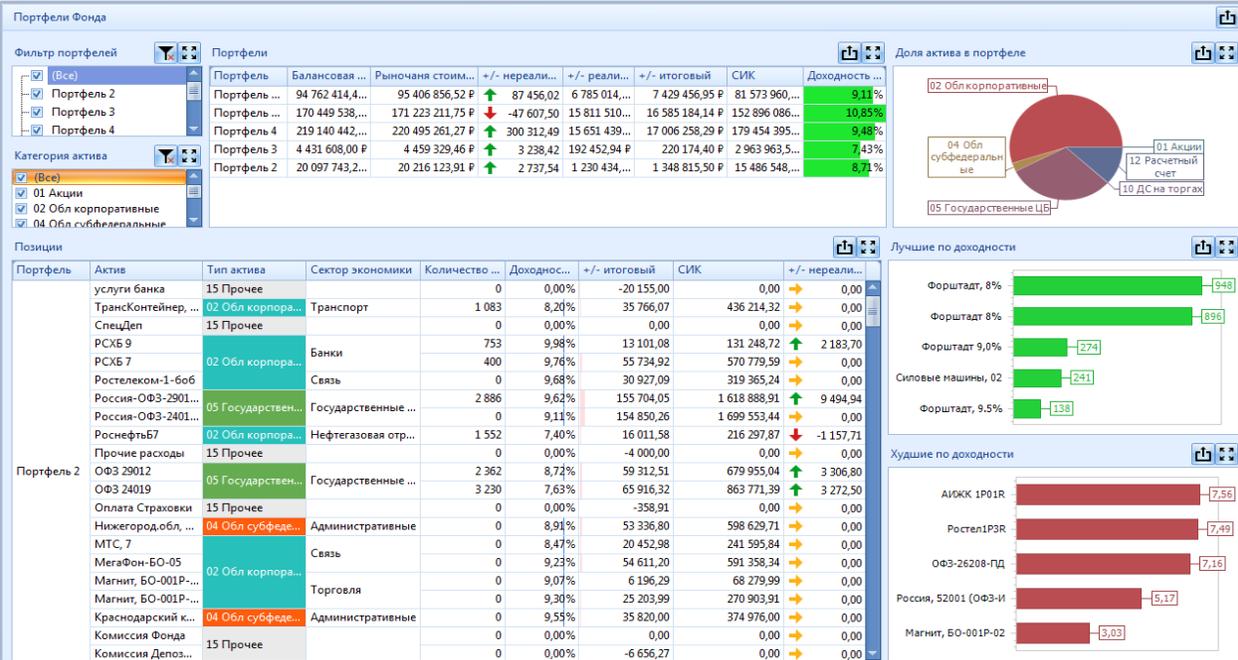
Мониторинг портфелей



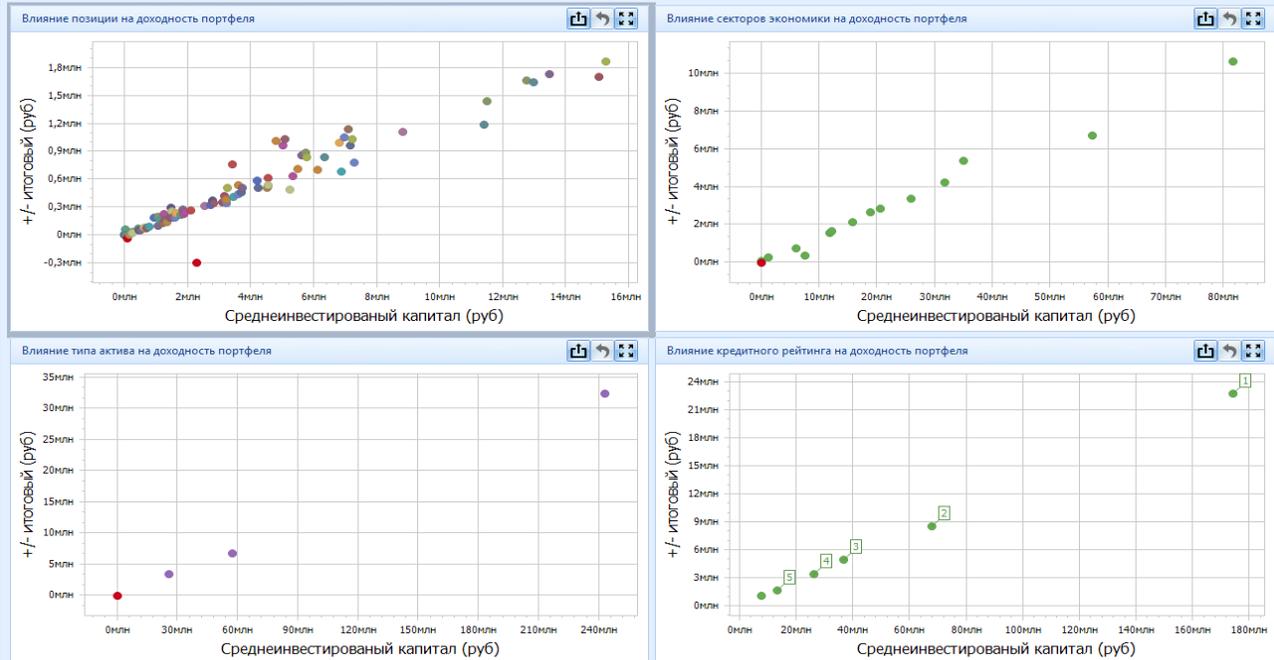
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



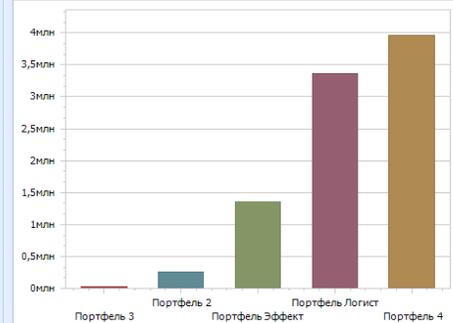
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

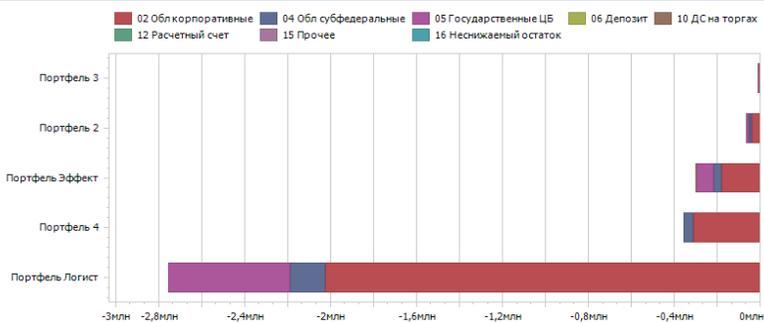
- Портфели УК
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
 - Портфель Логист
 - Портфель Эффе...



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837



Монитор портфелей

Портфели Фонда

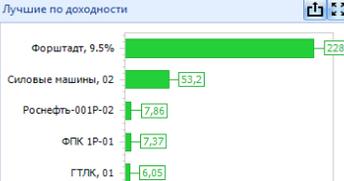
- Фильтр портфелей
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- нерели...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	→ 0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	↑ 3,84%	6 144,13	7 012 959...	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	→ 0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60 Р	2 797 888,24 Р	→ 0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	→ 0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,48%

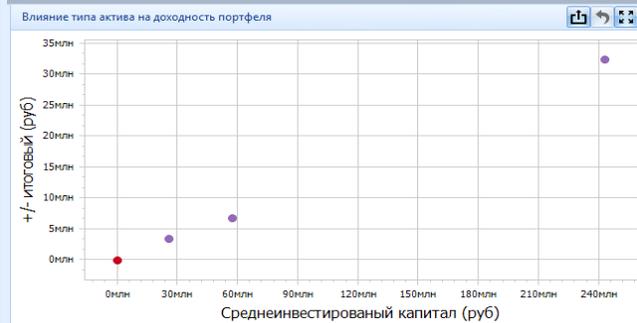
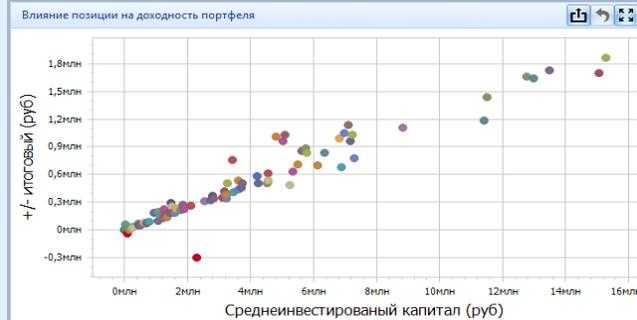


Позиции

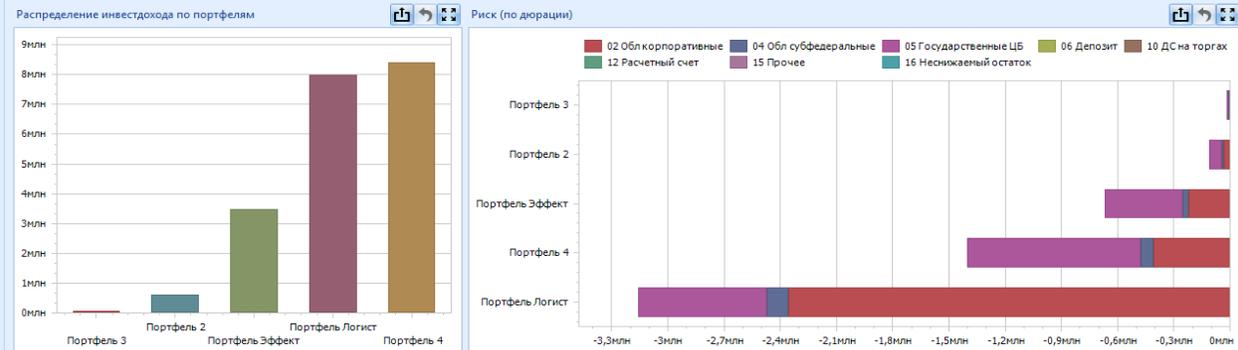
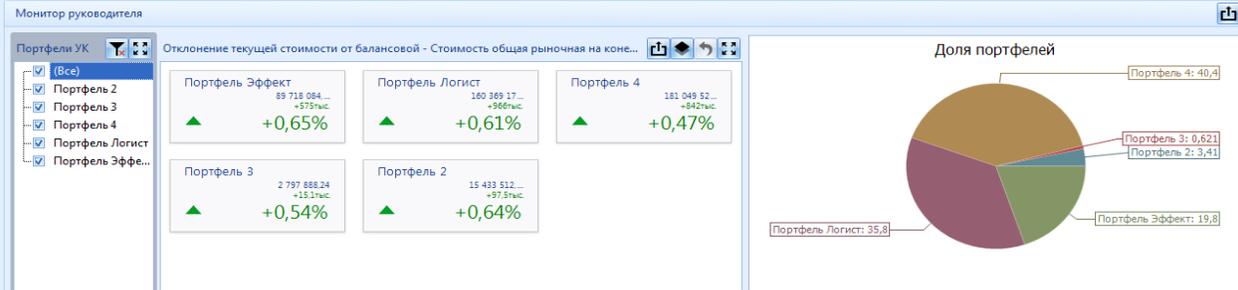
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- нерелизо...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочие		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	0,00
	СпецДеп	15 Прочие		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,89%	41 606,08	887 125,31	0,00
	Ростелеком-1-606		Связь	0	4,94%	30 927,09	681 531,88	0,00
	Россия-ОФЗ-2901...			2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	0,00
	Прочие расходы			0	0,00%	-3 000,00	0,00	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочие		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,88%	41 404,99	924 001,09	0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	736	4,81%	34 569,92	749 458,07	0,00
	Маяк, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	0,00
	Маяк, БО-001Р...			0	4,37%	25 203,99	577 049,37	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	0,00
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	0,00
Комиссия Депоз...	15 Прочие		0	0,00%	-3 044,62	0,00	0,00	
ГТЛК-7-606		Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	0,00	
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	0,00	
Газпром нефть, 12	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	0,00	
Газпром Капитал...		Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	0,00	
ВЭБ О9		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	0,00	



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 Р	→ 0,00	880 901,53 Р	1 362 817,45 Р	67 791 418,...	2,01%
Портфель ...	155 019 962,...	156 001 775,88 Р	↑ 17 511,69	2 381 934,...	3 363 748,27 Р	152 585 739,...	2,20%
Портфель 4	178 673 772,...	179 905 481,80 Р	→ 0,00	2 732 462,...	3 964 171,42 Р	184 772 800,...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 Р	2 474 021,82 Р	→ 0,00	22 996,47 Р	36 972,88 Р	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 Р	→ 0,00	167 810,58 Р	260 633,17 Р	13 501 551,...	1,93%

Категория актива

Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	→ 0,00
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 114,09	→ 0,00
	СпецДел	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	→ 0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	→ 0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	→ 0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфедер...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	→ 0,00
	МегаФон-ЕО-05	04 Обл субфедер...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	→ 0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	→ 0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфедер...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	→ 0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	→ 0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	→ 0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	→ 0,00
Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	→ 0,00	
ВЭБ 09	02 Обл корпора...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	→ 0,00	
Волгоград.обл 35...	04 Обл субфедер...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	→ 0,00	
Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00	
Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	→ 0,00	
Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	→ 0,00	

Доля актива в портфеле

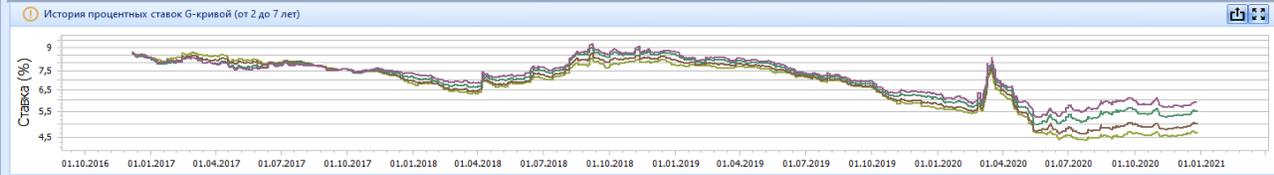
Лучшие по доходности

- Форштат, 9,5% [301]
- Силовые машины, 02 [20]
- Транснефть, БО-06 [3,27]
- ГТЛК, 02 [3,16]
- ГТЛК, 01 [3,07]

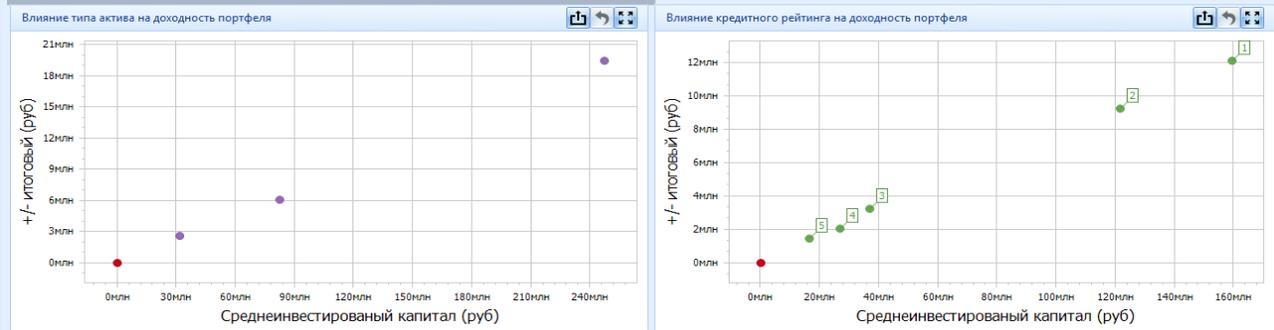
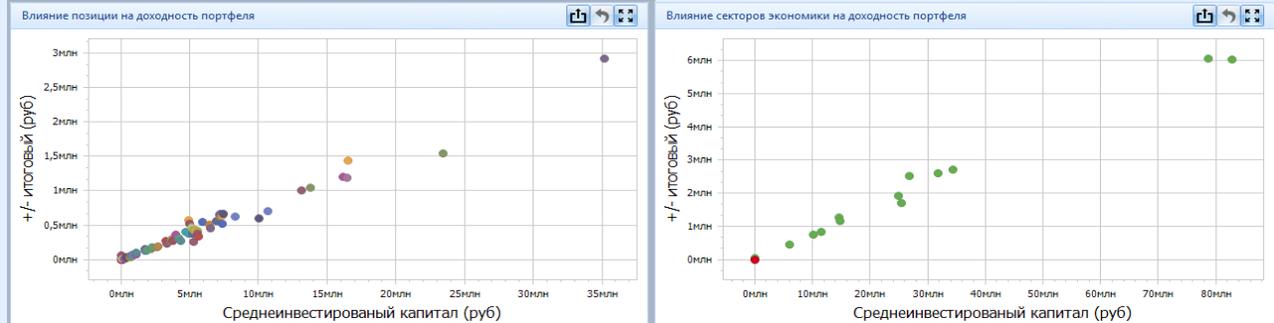
Худшие по доходности

- Россия, 26206 [-1,47]
- Россия, 25081 [-1,4]
- УМАО, 34001 [-1,34]
- Волгоград.обл 35003 [-1,31]
- Россия, 52001 (ОФЗ-И [-0,496]

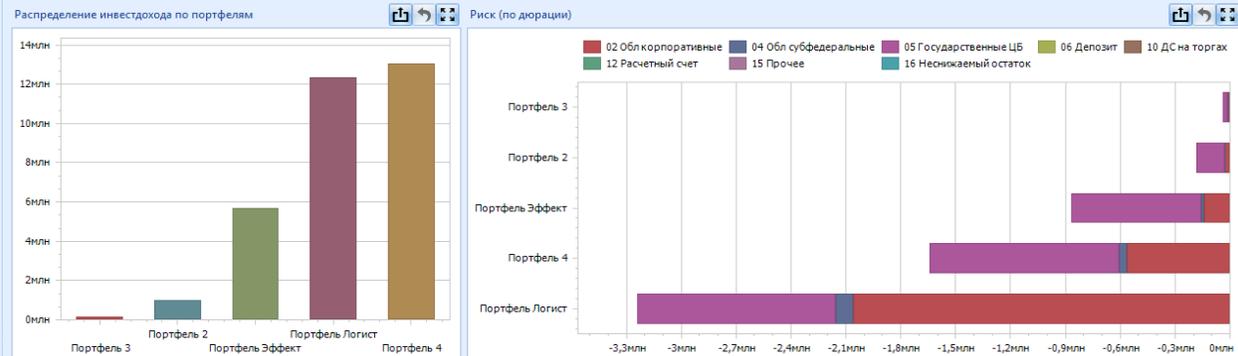
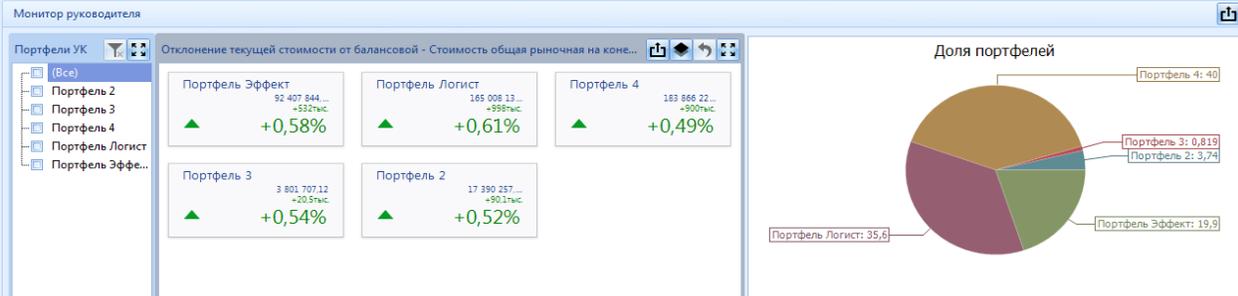
История изменения процентных ставок G-кривой



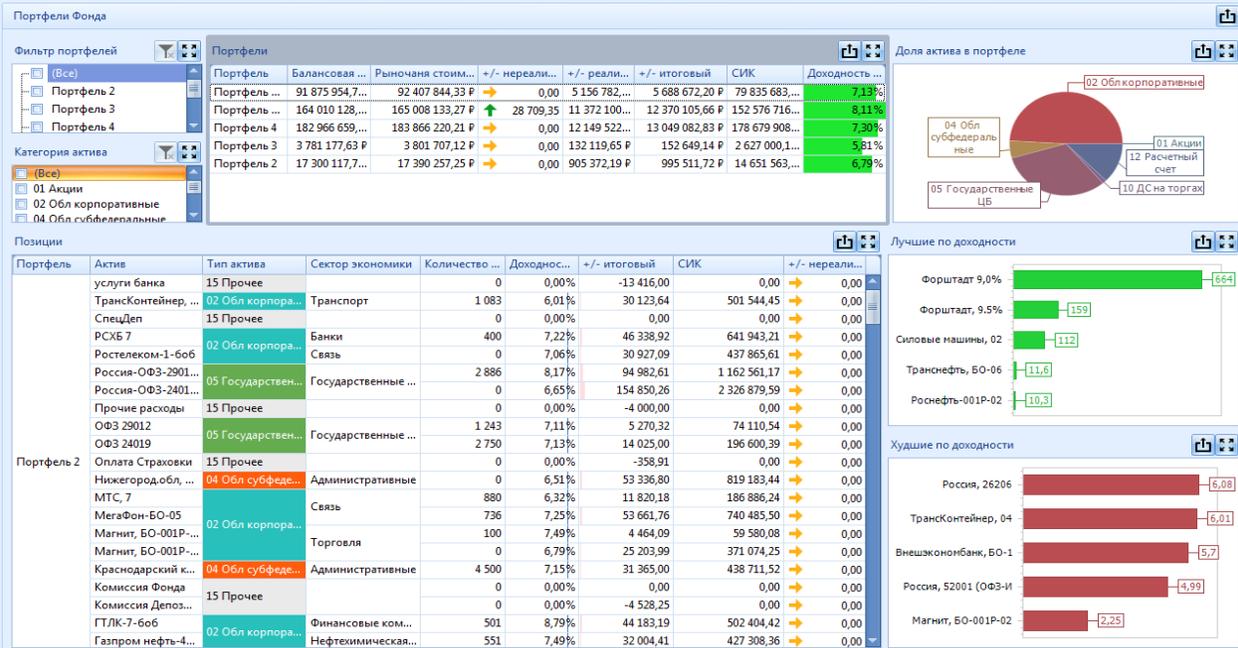
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



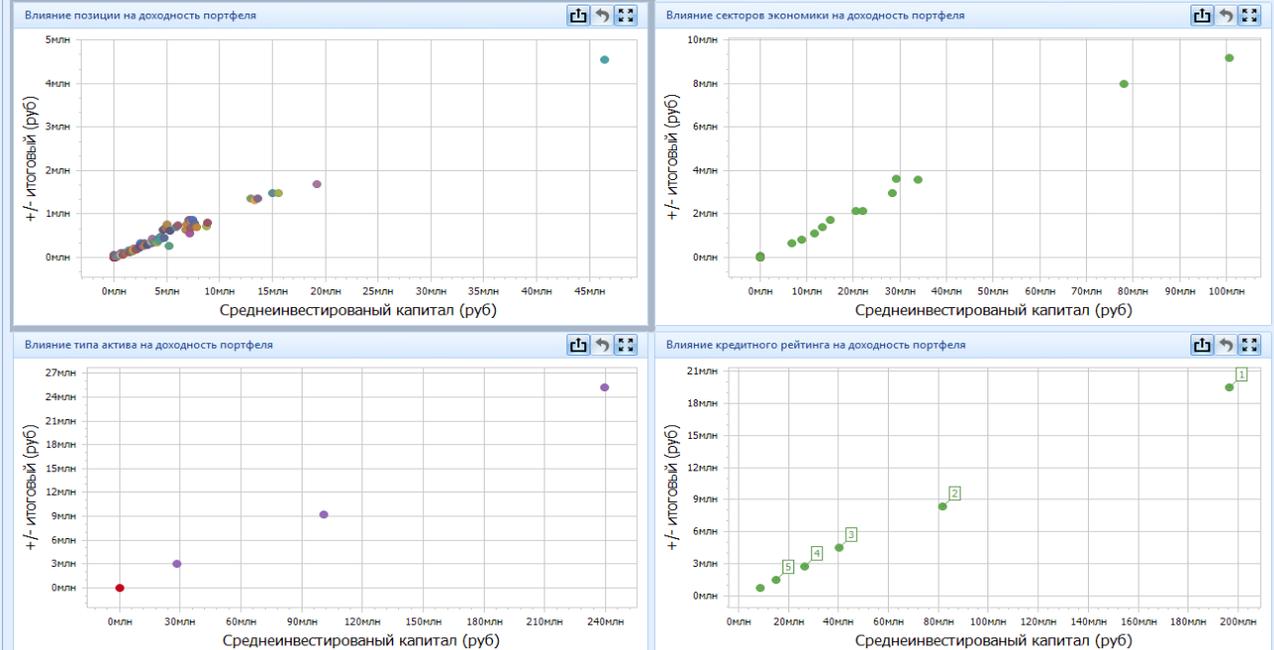
Монитор портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор руководителя

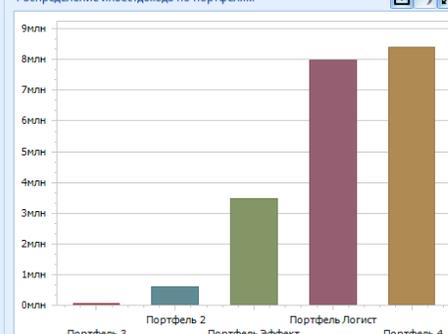
Портфели УК

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...

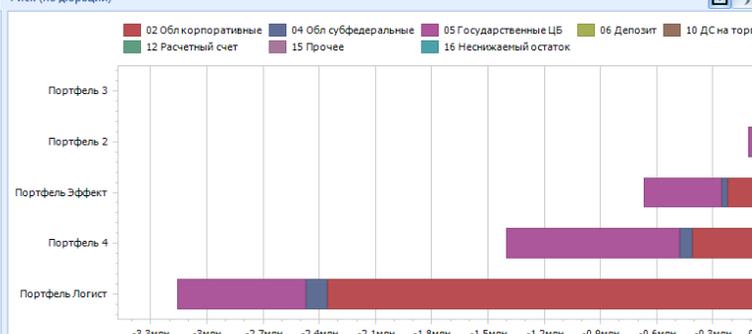
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффе...



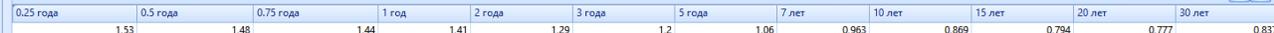
Распределение инвестодохода по портфелям



Риск (по дорации)



Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 P	0,00	880 901,53 P	1 362 817,45 P	67 791 418...	2,01%
Портфель ...	155 019 962...	156 001 775,88 P	17 511,69	2 381 934...	3 363 748,27 P	152 585 739...	2,20%
Портфель 4	178 673 772...	179 905 481,80 P	0,00	2 732 462...	3 964 171,42 P	184 772 800...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 P	2 474 021,82 P	0,00	22 996,47 P	36 972,88 P	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 P	0,00	167 810,58 P	260 633,17 P	13 501 551...	1,93%

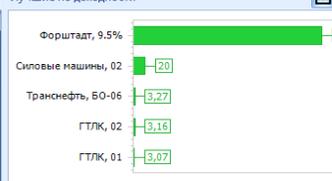
Доля актива в портфеле



Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	0,00
	Нижегород.обл...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	0,00
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001P...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00	
ВЭБ 09	02 Обл корпора...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	0,00	
Волгоград.обл 35...	04 Обл субфед...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	0,00	
Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00	
Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00	
Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00	

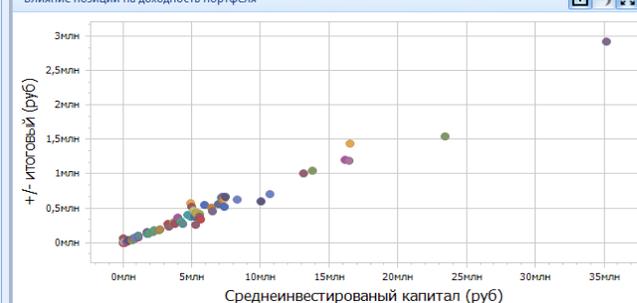
Лучшие по доходности



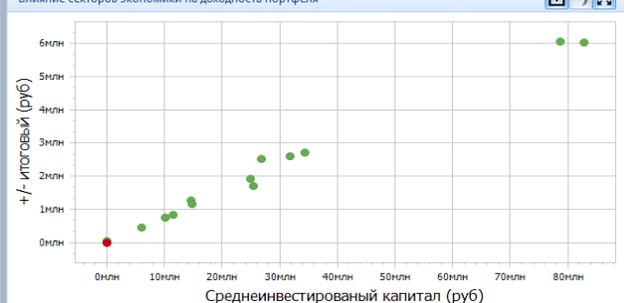
Худшие по доходности



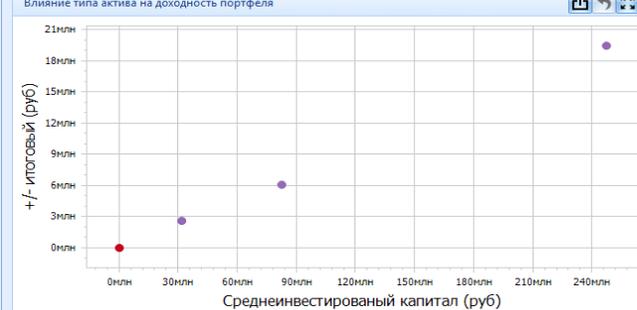
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



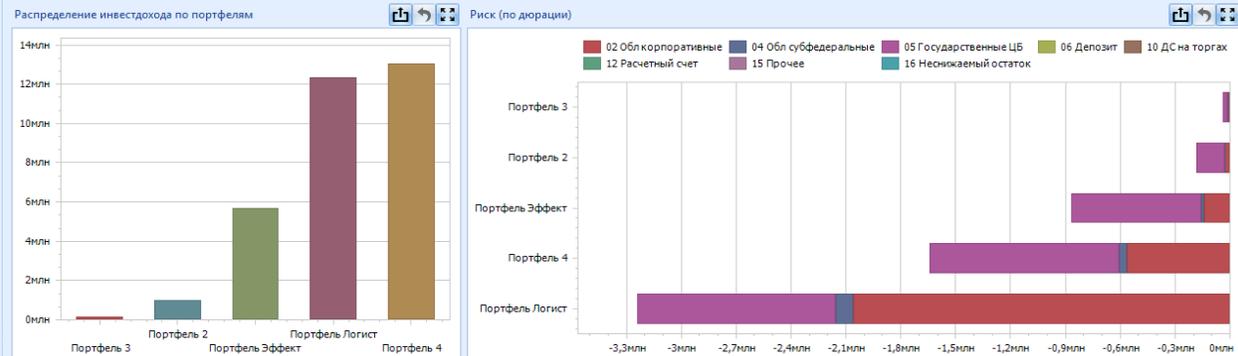
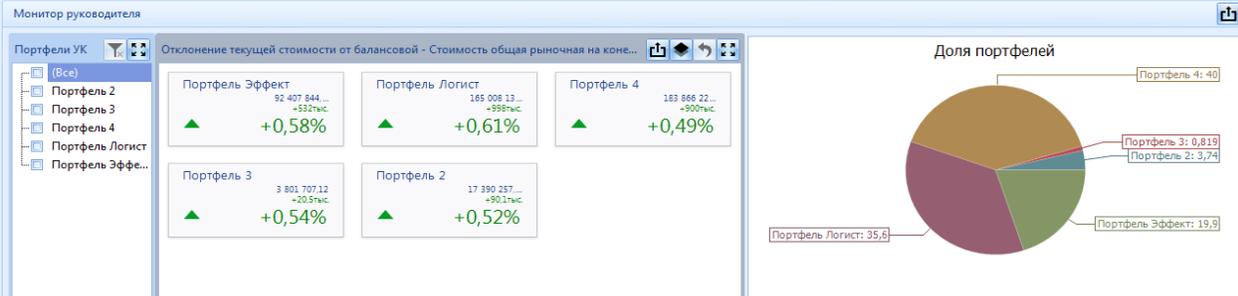
Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



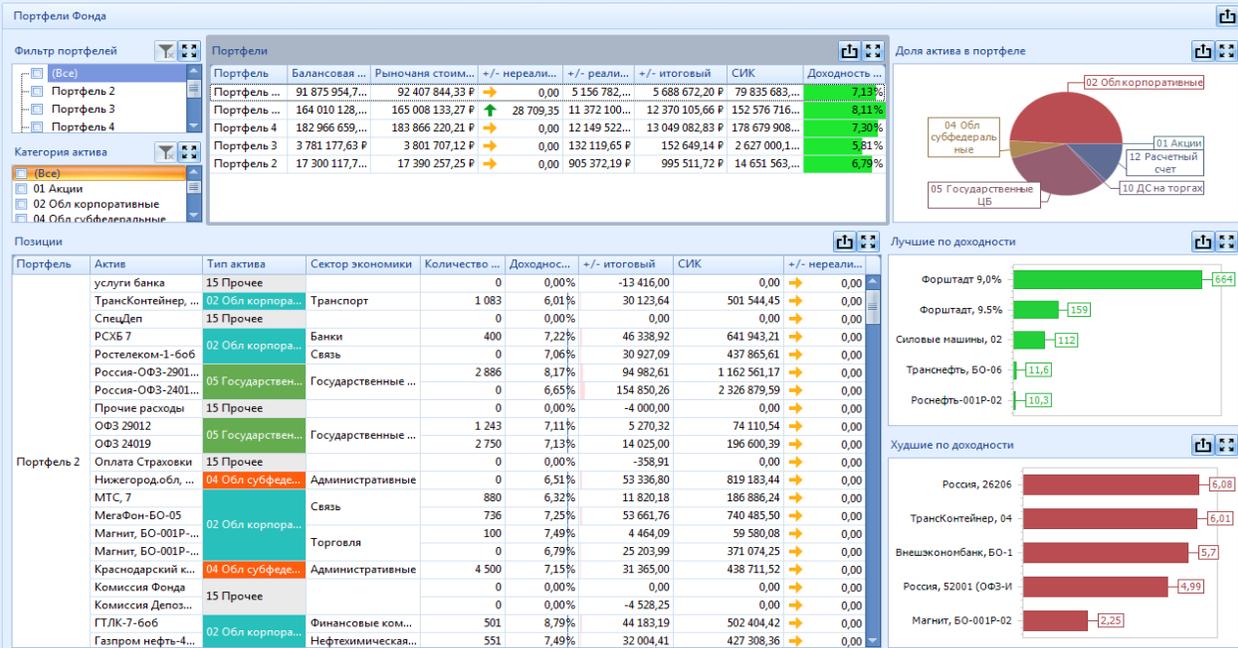
Мониторинг портфелей



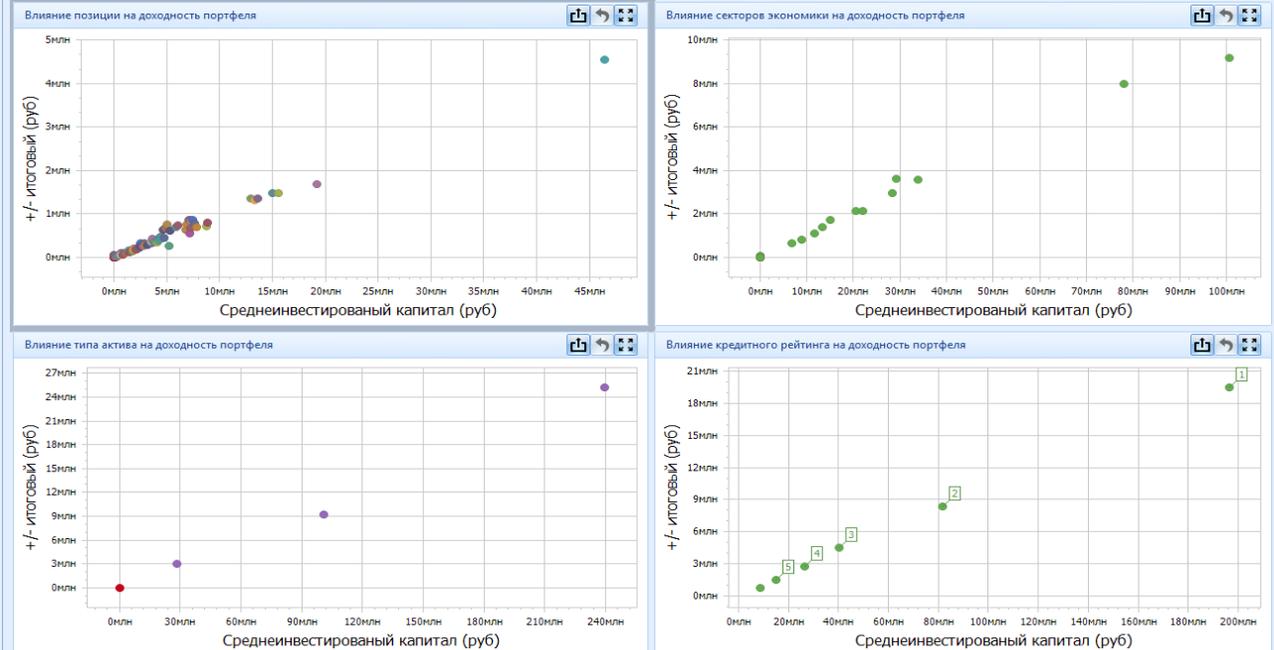
История изменения процентных ставок G-кривой



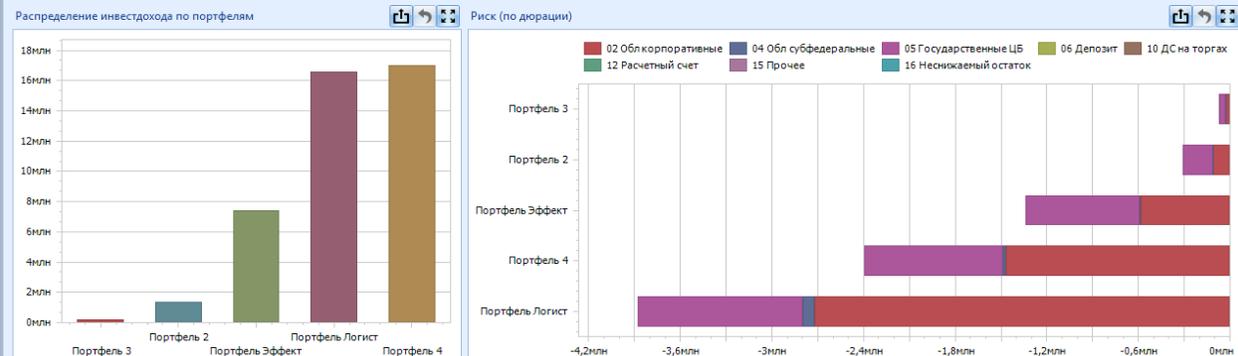
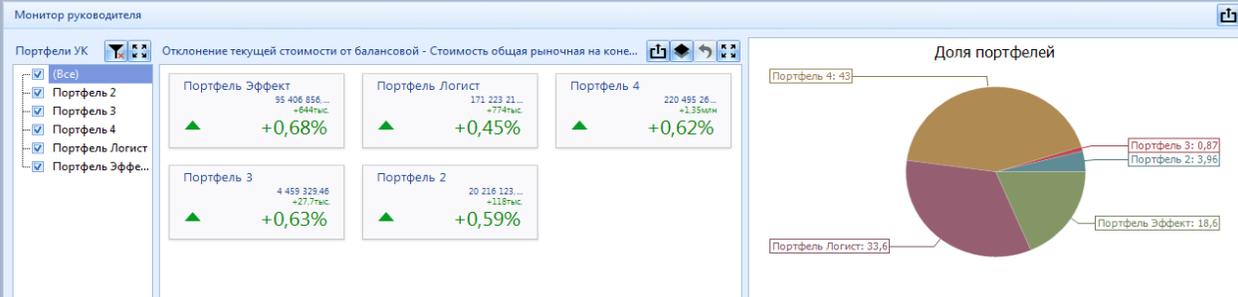
Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



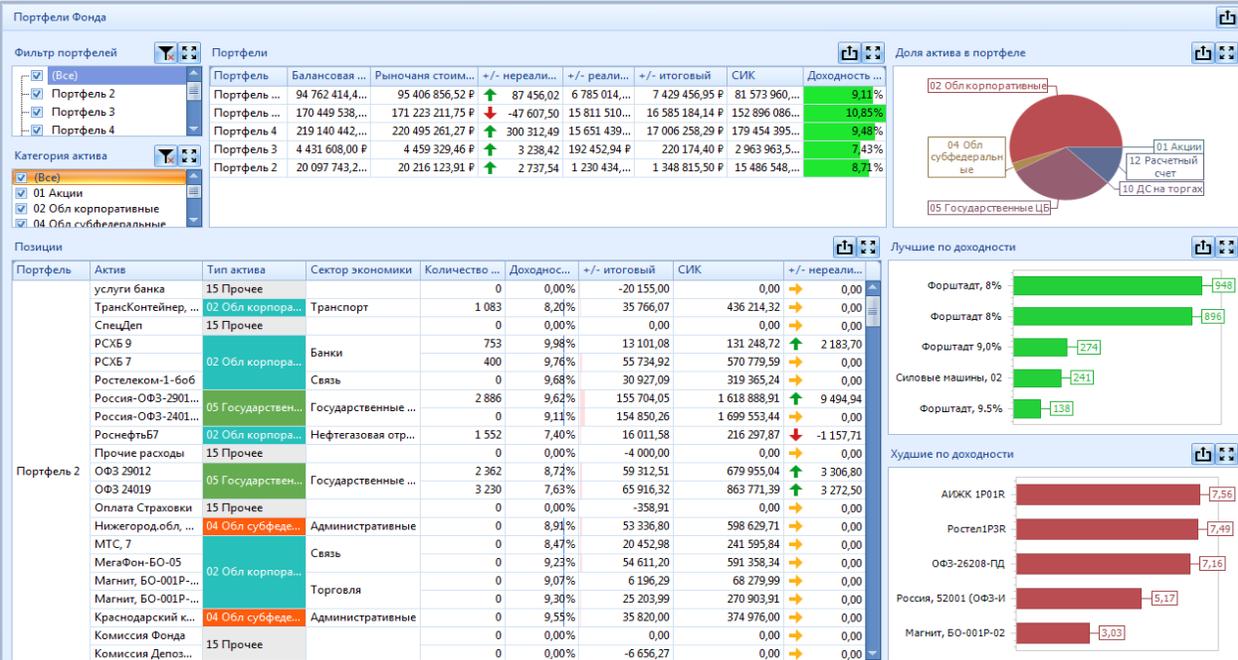
Мониторинг портфелей



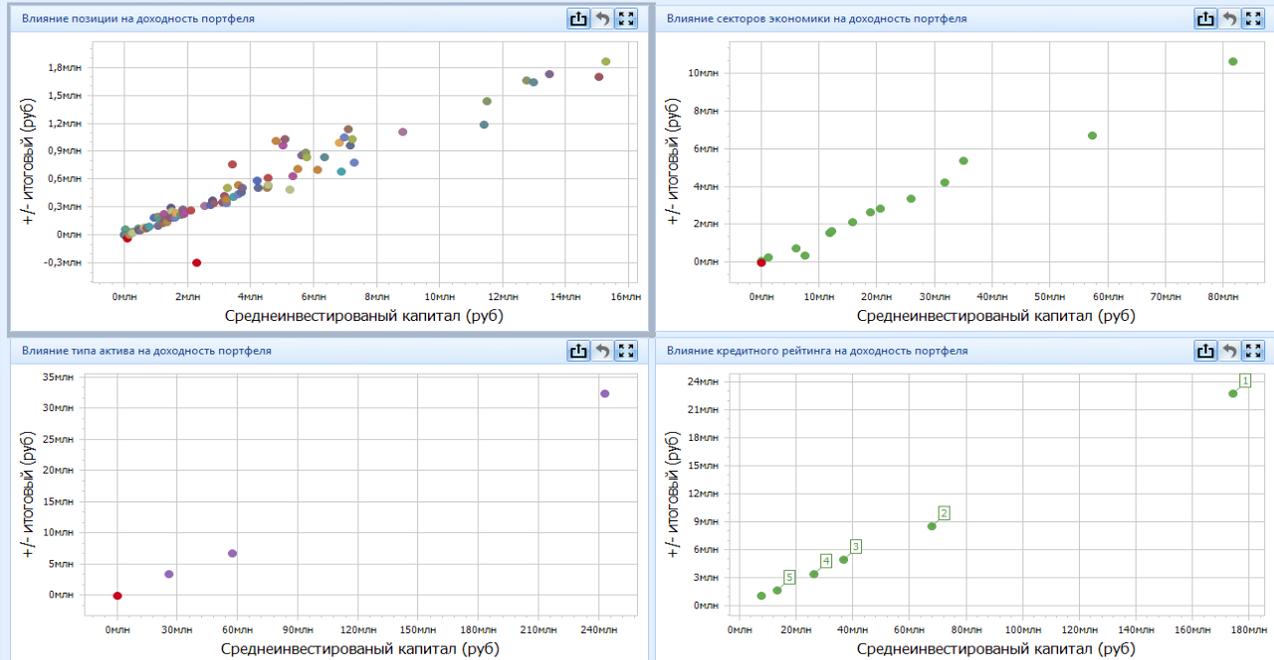
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



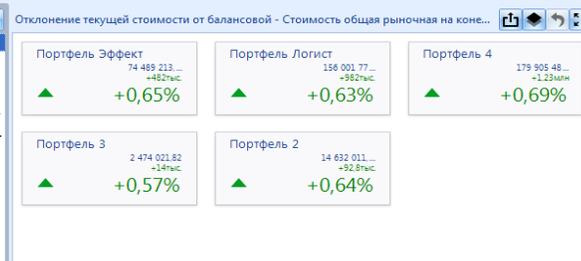
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



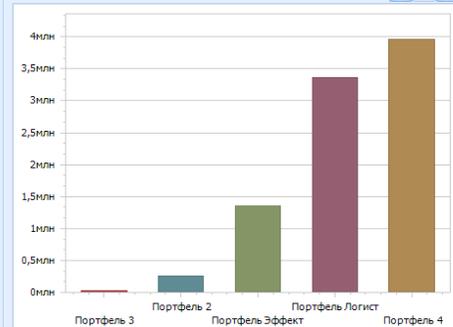
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

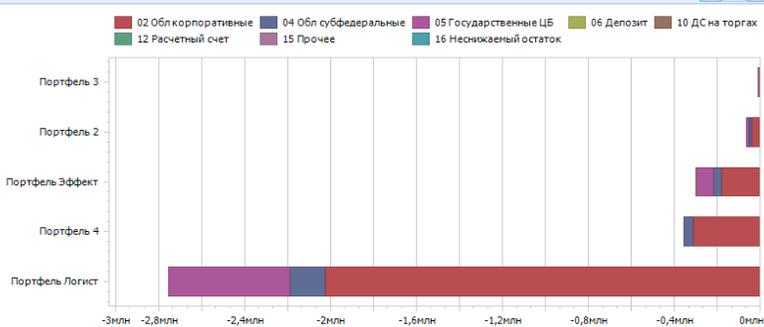
- Портфели УК
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
 - Портфель Логист
 - Портфель Эффе...



Распределение инвестдохода по портфелям



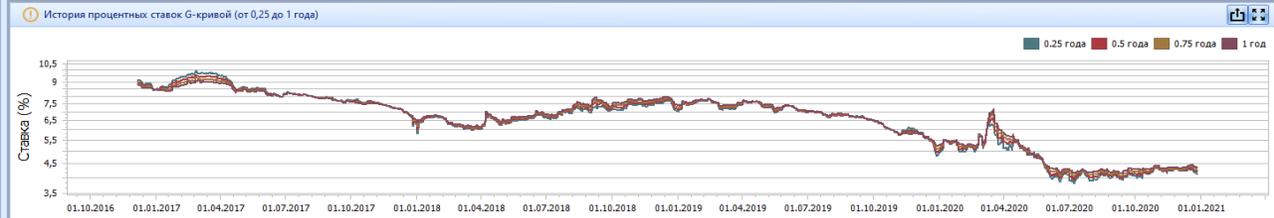
Риск (по дюрации)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837



Монитор портфелей

Портфели Фонда

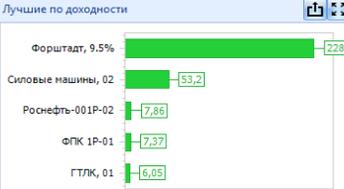
- Фильтр портфелей
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- нерели...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	→ 0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	↑ 6 144,13	7 012 959...	7 978 821,91 Р	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	→ 0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60 Р	2 797 888,24 Р	→ 0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	→ 0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,48%

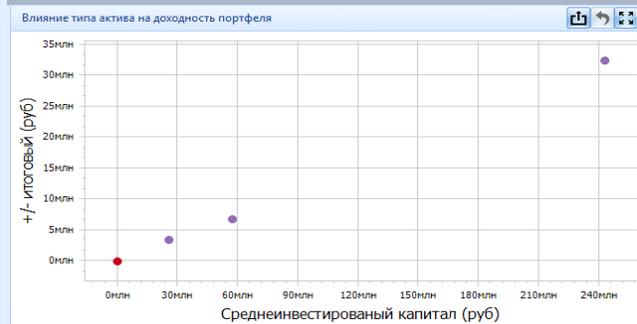
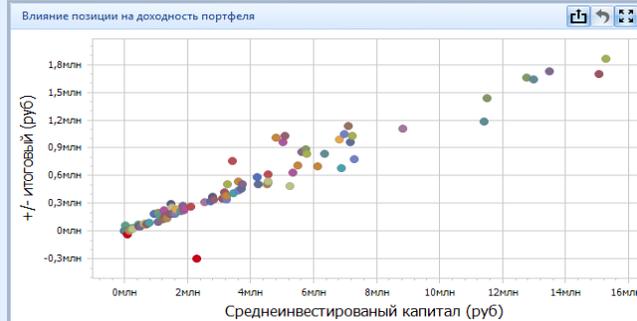


Позиции

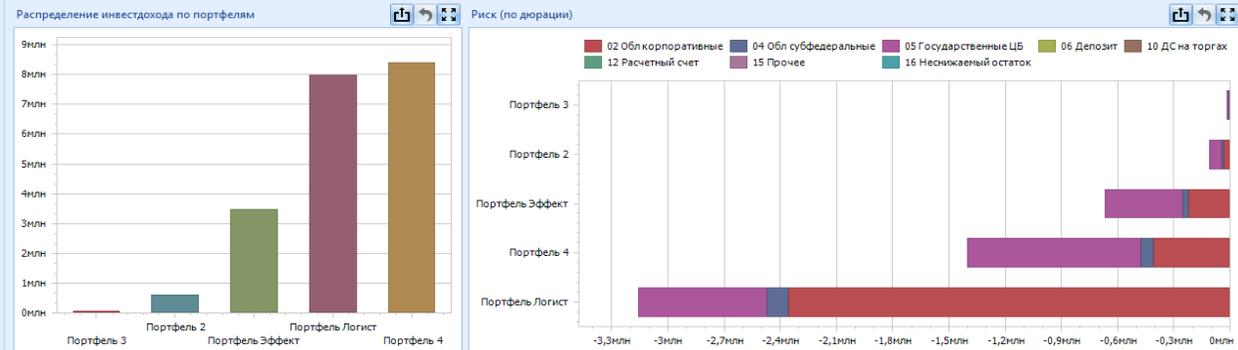
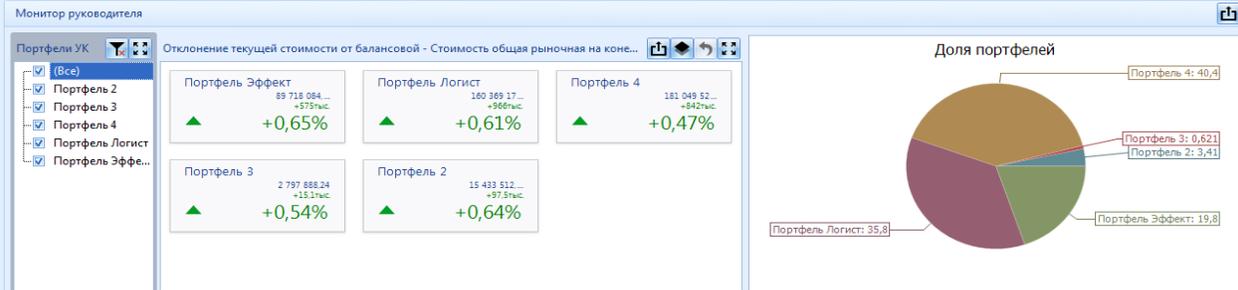
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- нерелизо...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	ТрансКонтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	→ 0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,89%	41 606,08	887 125,31	→ 0,00
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	4,94%	30 927,09	681 531,88	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...			2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	→ 0,00
	Прочие расходы			0	0,00%	-3 000,00	0,00	→ 0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	→ 0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,88%	41 404,99	924 001,09	→ 0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	736	4,81%	34 569,92	749 458,07	→ 0,00
	Маяк, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	→ 0,00
	Маяк, БО-001Р...			0	4,37%	25 203,99	577 049,37	→ 0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	→ 0,00
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-3 044,62	0,00	→ 0,00	
ГТЛК-7-60б		Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	→ 0,00	
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	→ 0,00	
Газпром нефть, 12	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	→ 0,00	
Газпром Капитал...		Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	→ 0,00	
ВЭБ 09		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	→ 0,00	



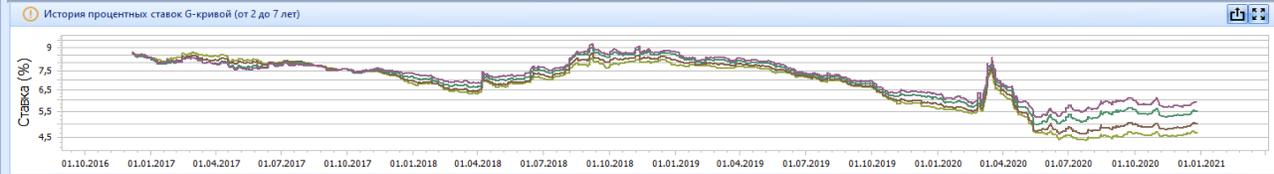
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



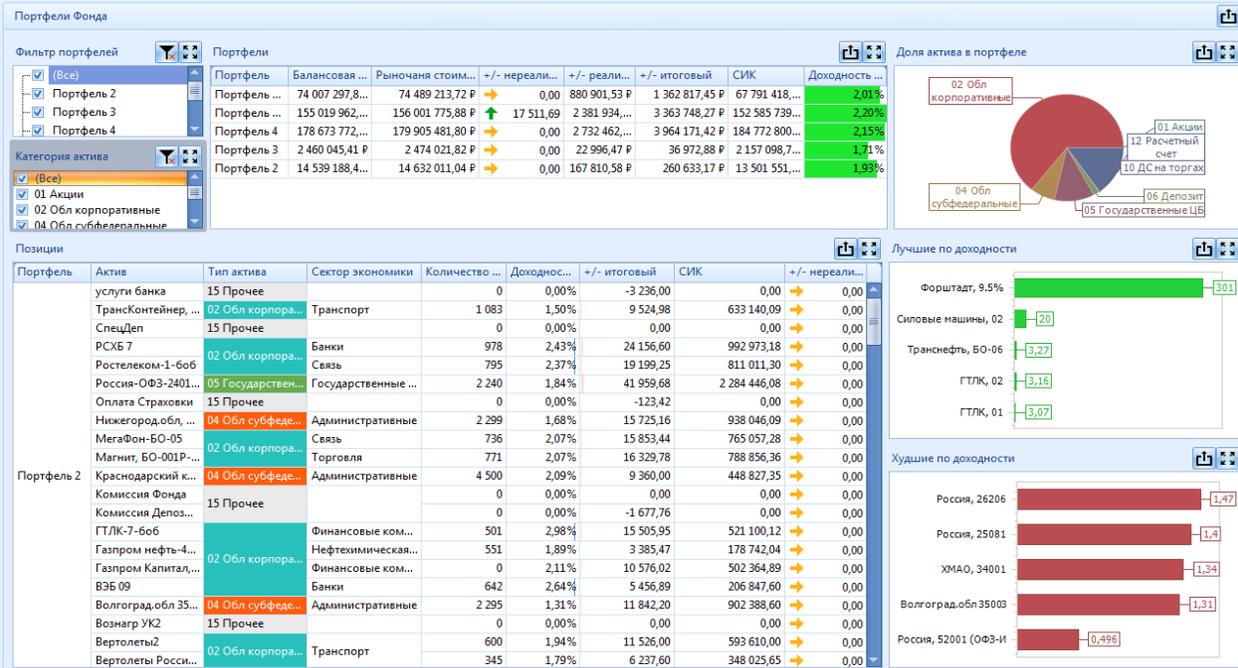
Мониторинг портфелей



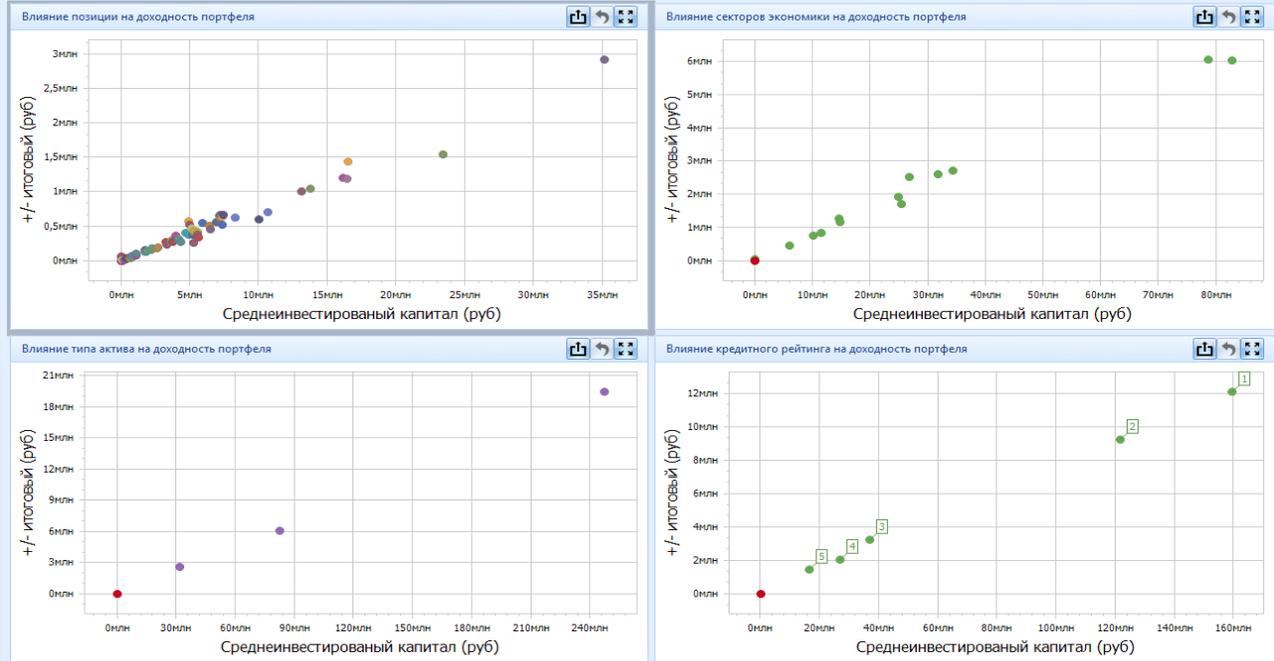
История изменения процентных ставок G-кривой



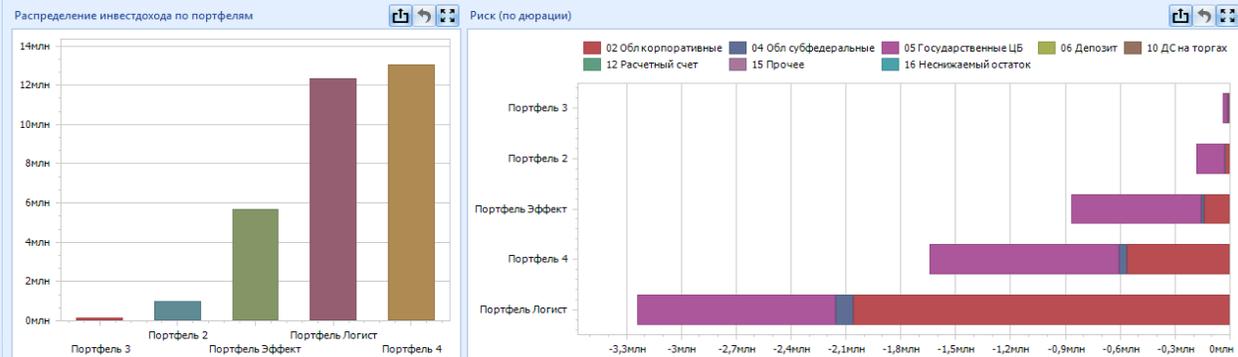
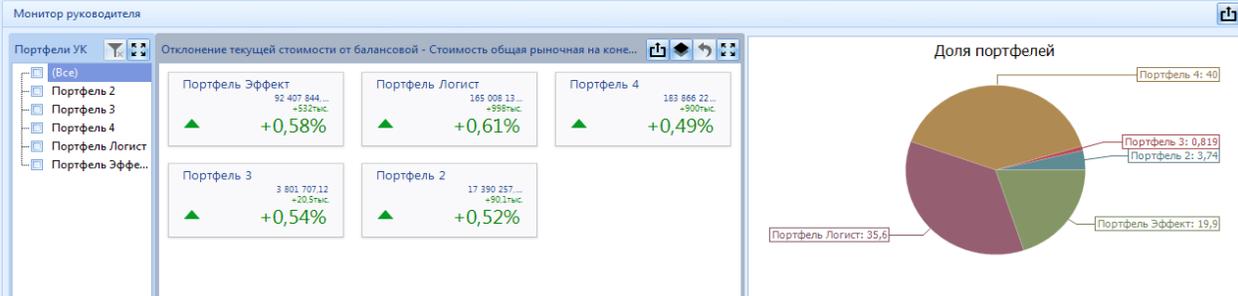
Монитор портфелей



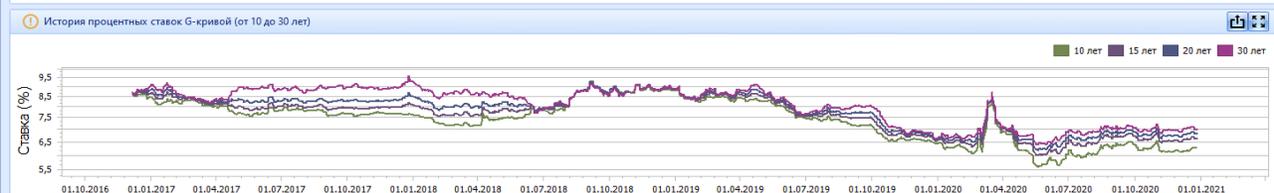
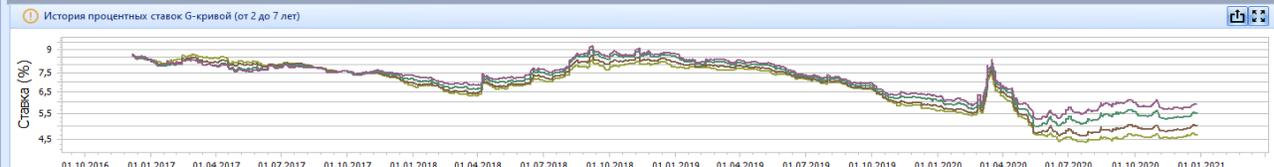
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



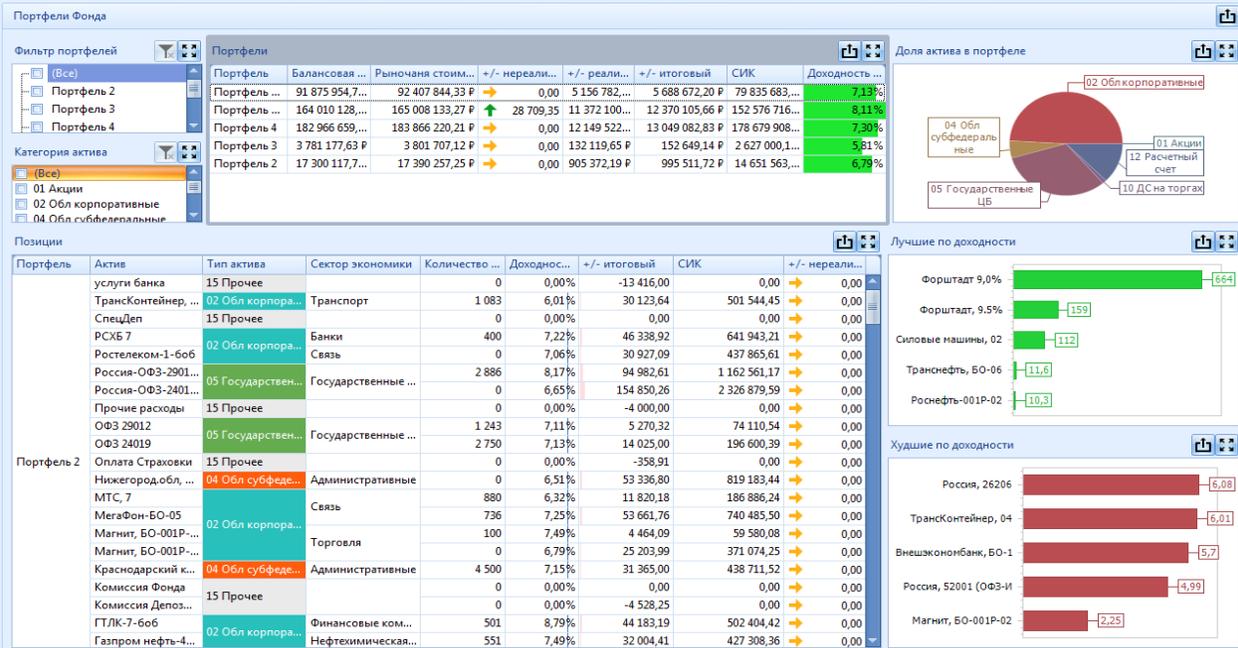
Мониторинг портфелей



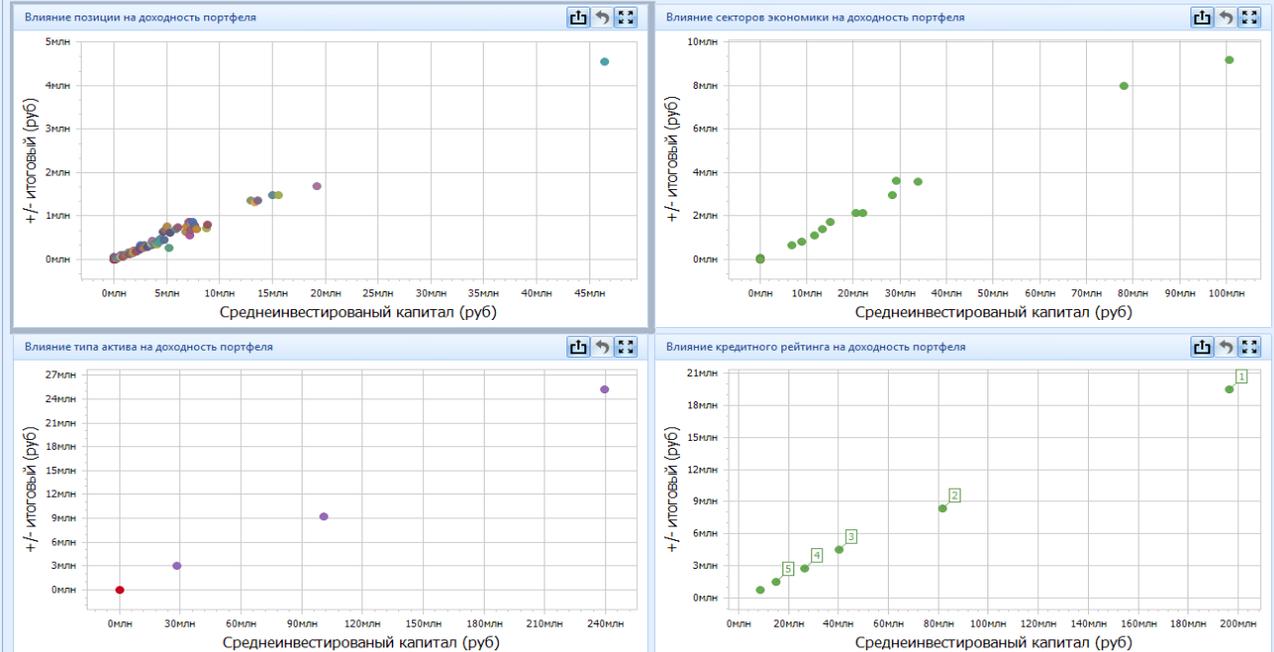
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой

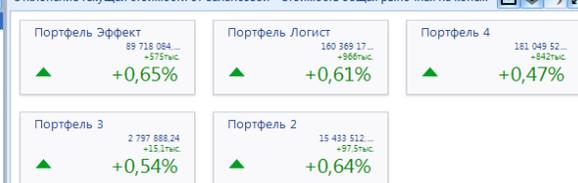


Монитор руководителя

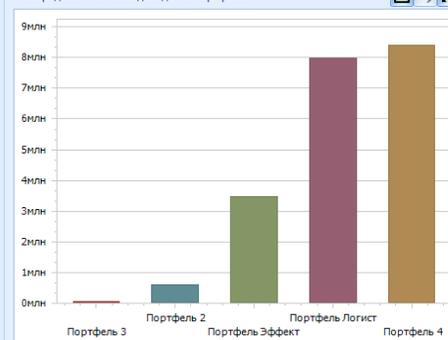
Портфели УК

Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...

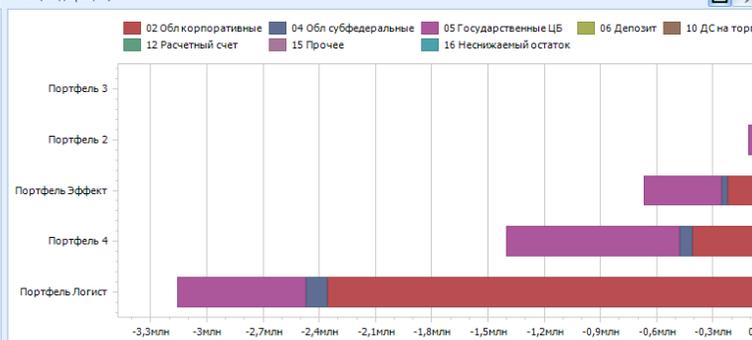
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффе...



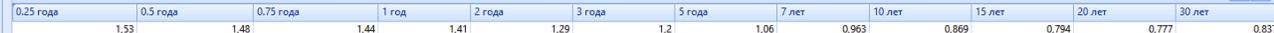
Распределение инвестодохода по портфелям



Риск (по дорации)



Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



История процентных ставок G-кривой (от 2 до 7 лет)



История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	74 007 297,8...	74 489 213,72 P	0,00	880 901,53 P	1 362 817,45 P	67 791 418...	2,01%
Портфель ...	155 019 962,...	156 001 775,88 P	17 511,69	2 381 934,...	3 363 748,27 P	152 585 739...	2,20%
Портфель 4	178 673 772,...	179 905 481,80 P	0,00	2 732 462,...	3 964 171,42 P	184 772 800...	2,15%
Портфель 3	2 460 045,41 P	2 474 021,82 P	0,00	22 996,47 P	36 972,88 P	2 157 098,7...	1,71%
Портфель 2	14 539 188,4...	14 632 011,04 P	0,00	167 810,58 P	260 633,17 P	13 501 551,...	1,93%

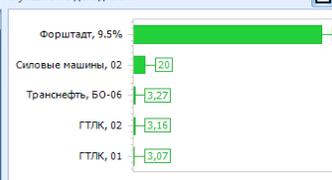
Доля актива в портфеле



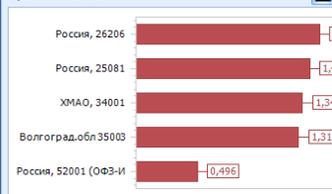
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- реали...
	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-6об	02 Обл корпора...	Связь	795	2,37%	19 199,25	811 011,30	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 240	1,84%	41 959,68	2 284 446,08	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-123,42	0,00	0,00
	Нижегород.обл...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	0,00
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001P...	02 Обл корпора...	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	2,09%	9 360,00	448 827,35	0,00
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-1 677,76	0,00	0,00
	ГТЛК-7-6об	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпора...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
	Газпром Капитал...	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00
	ВЭБ 09	02 Обл корпора...	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	0,00
	Волгоград.обл 35...	04 Обл субфед...	Административные	2 295	1,31%	11 842,20	902 388,60	0,00
	Вознар УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Вертолеты2	02 Обл корпора...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00
	Вертолеты Росси...	02 Обл корпора...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00

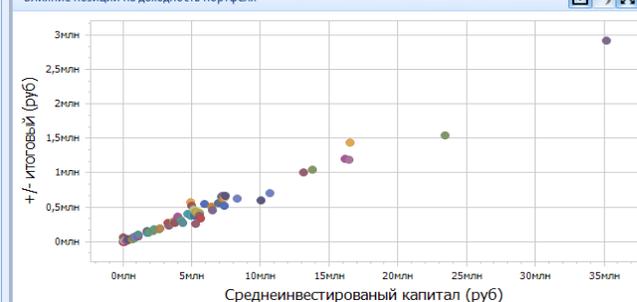
Лучшие по доходности



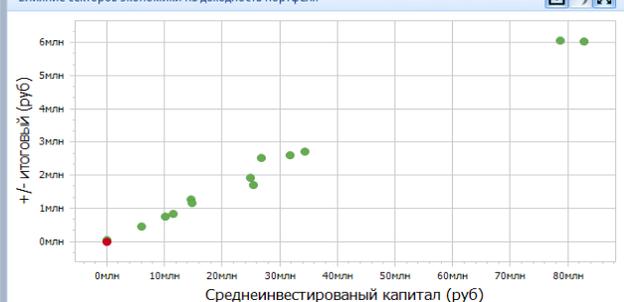
Худшие по доходности



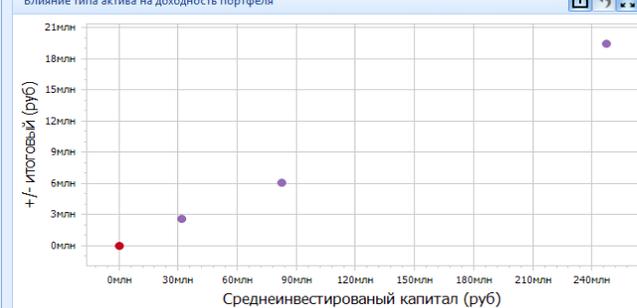
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



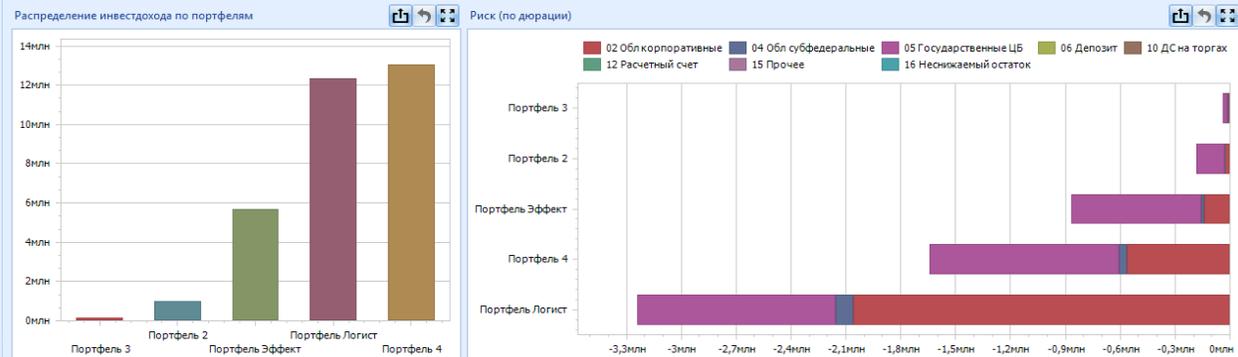
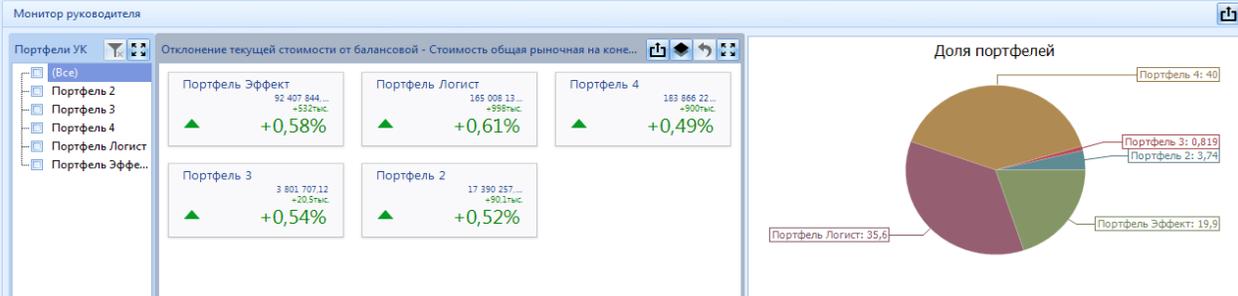
Влияние типа актива на доходность портфеля



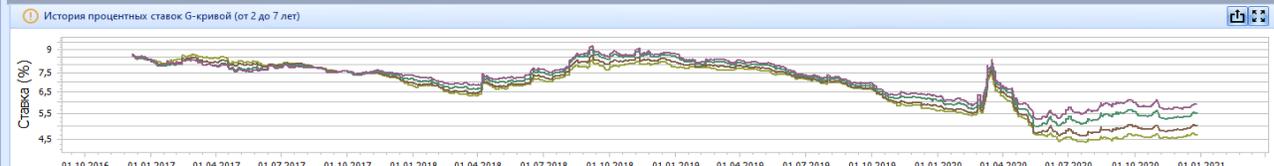
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



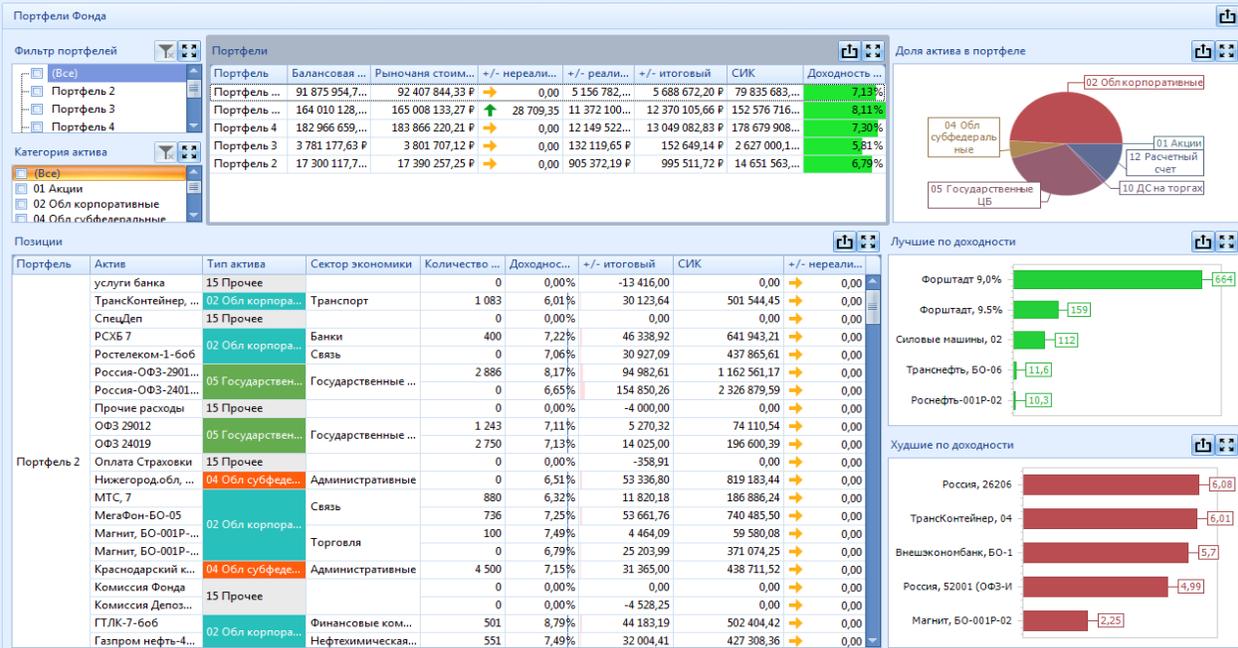
Мониторинг портфелей



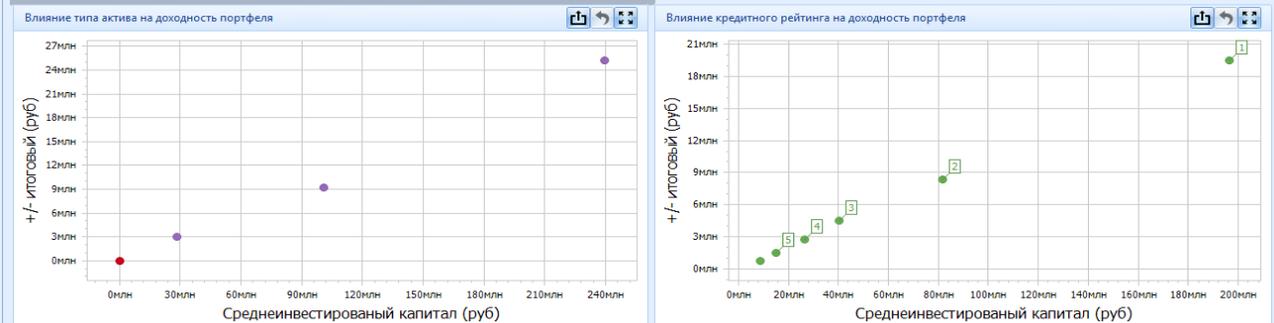
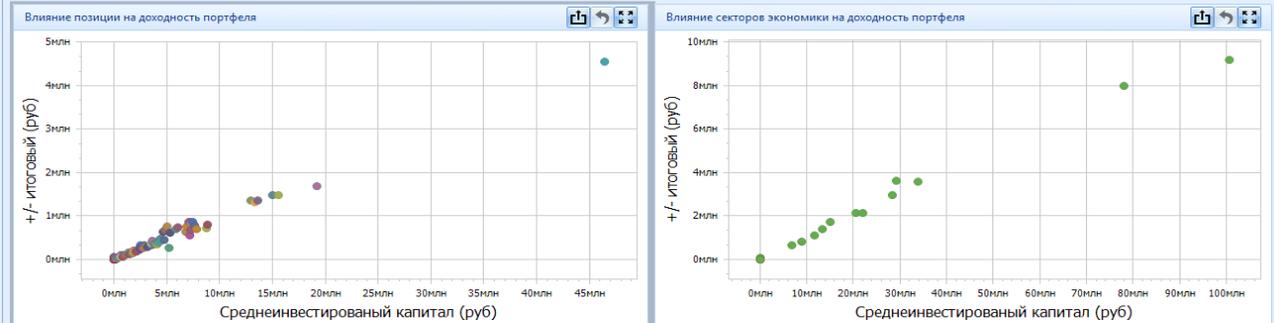
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



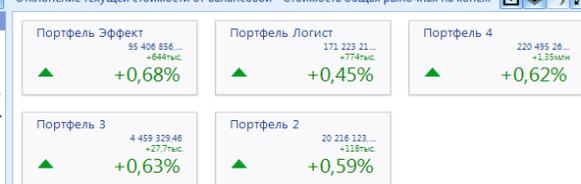
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

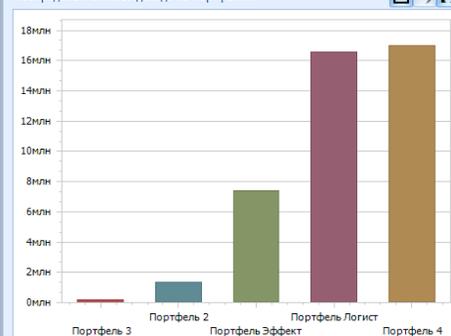
Портфели УК

- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эфф...

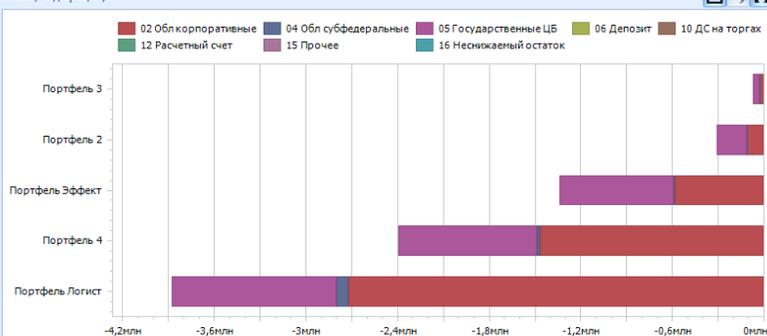
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на коне...



Распределение инвестдохода по портфелям



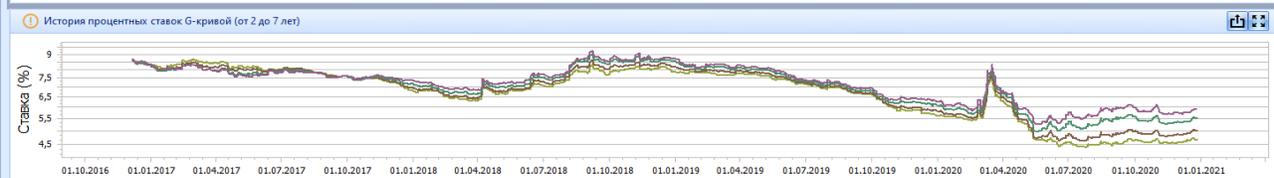
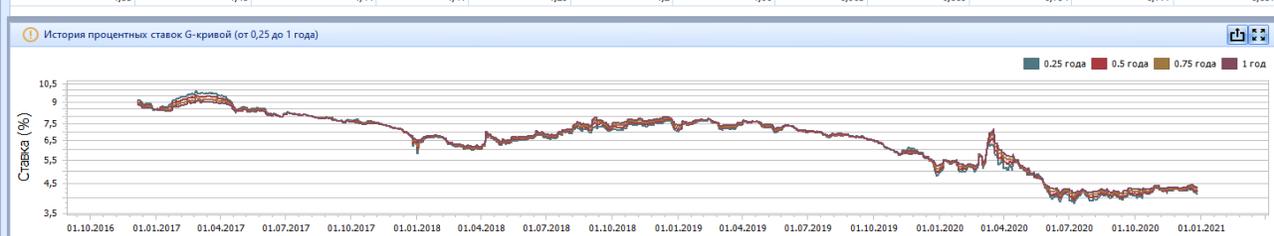
Риск (по дорации)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	1,53	0,5 года	1,48	0,75 года	1,44	1 год	1,41	2 года	1,29	3 года	1,2	5 года	1,06	7 лет	0,963	10 лет	0,869	15 лет	0,794	20 лет	0,777	30 лет	0,837
-----------	------	----------	------	-----------	------	-------	------	--------	------	--------	-----	--------	------	-------	-------	--------	-------	--------	-------	--------	-------	--------	-------



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4

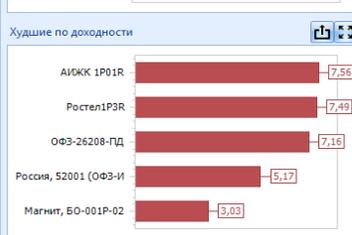
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	94 762 414,4...	95 406 856,52 P	87 456,02	6 785 014,...	7 429 456,95 P	81 573 960,...	9,11%
Портфель ...	170 449 538,...	171 223 211,75 P	-47 607,50	15 811 510,...	16 585 184,14 P	152 896 086,...	10,85%
Портфель 4	219 140 442,...	220 495 261,27 P	300 312,49	15 651 439,...	17 006 258,29 P	179 454 395,...	9,48%
Портфель 3	4 431 608,0 P	4 459 329,46 P	3 238,42	192 452,94 P	220 174,40 P	2 963 963,5,...	7,43%
Портфель 2	20 097 743,2...	20 216 123,91 P	2 737,54	1 230 434,...	1 348 815,90 P	15 486 548,...	8,71%

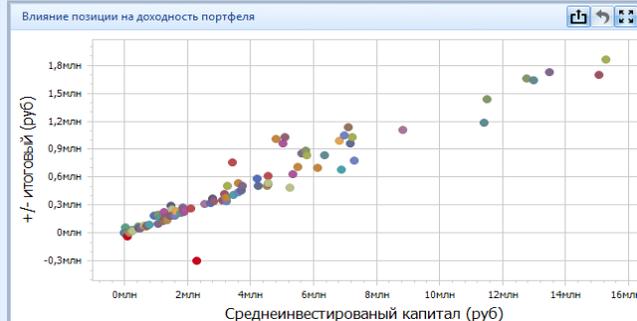


Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-20 155,00	0,00	→ 0,00
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	8,20%	35 766,07	436 214,32	→ 0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСХБ 9	02 Обл корпора...	Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	↑ 2 183,70
	РСХБ 7	02 Обл корпора...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	→ 0,00
	Ростелеком-1-6об	04 Обл субфедер...	Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государствен...	Государственные ...	2 886	9,62%	155 704,05	1 618 888,91	↑ 9 494,94
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...		0	9,11%	154 850,26	1 699 553,44	→ 0,00
	РоснефтьБ7	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	1 552	7,40%	16 011,58	216 297,87	↓ -1 157,71
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→ 0,00
	ОФЗ 29012	05 Государствен...		2 362	8,72%	59 312,51	679 955,04	↑ 3 306,80
	ОФЗ 24019	05 Государствен...		3 230	7,63%	65 916,32	863 771,39	↑ 3 272,50
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→ 0,00
	Нижегород, обл, ...	04 Обл субфедер...	Административные	0	8,91%	53 336,80	598 629,71	→ 0,00
	МТС_7	04 Обл субфедер...		0	8,47%	20 452,98	241 595,84	→ 0,00
МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...	Связь	0	9,23%	54 611,20	591 358,34	→ 0,00	
Магнит, БО-001P-...	02 Обл корпора...		0	9,07%	6 196,29	68 279,99	→ 0,00	
Магнит, БО-001P-...	02 Обл корпора...	Торговля	0	9,30%	25 203,99	270 903,91	→ 0,00	
Краснодарский к...	04 Обл субфедер...	Административные	0	9,55%	35 820,00	374 976,00	→ 0,00	
Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00	
Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-6 656,27	0,00	→ 0,00	



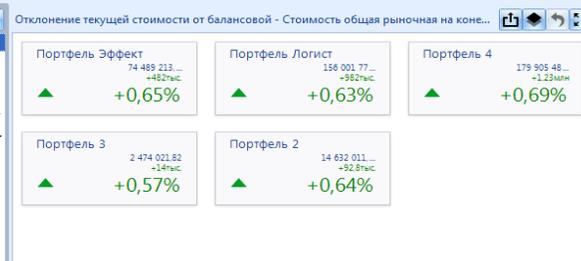
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



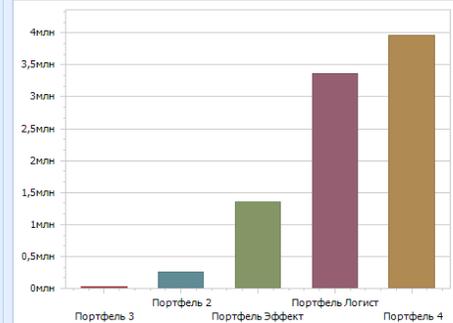
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

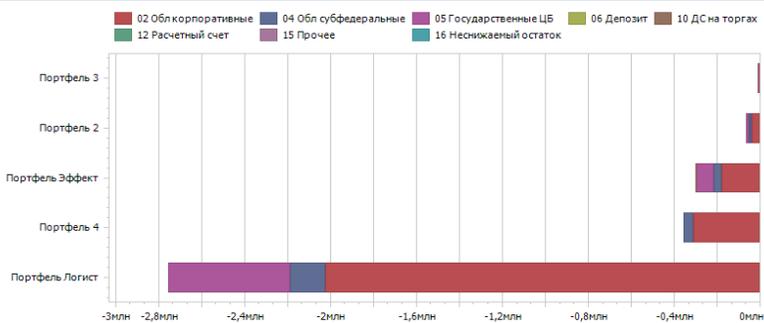
- Портфели УК
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
 - Портфель Логист
 - Портфель Эффе...



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по доражии)



История изменения процентных ставок G-кривой

Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

0,25 года	0,5 года	0,75 года	1 год	2 года	3 года	5 года	7 лет	10 лет	15 лет	20 лет	30 лет
1,53	1,48	1,44	1,41	1,29	1,2	1,06	0,963	0,869	0,794	0,777	0,837



Монитор портфелей

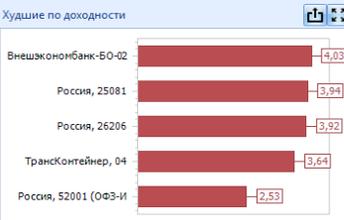
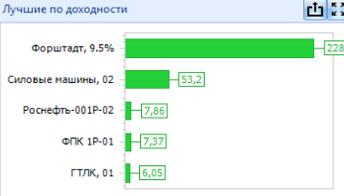
Портфели Фонда

- Фильтр портфелей
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

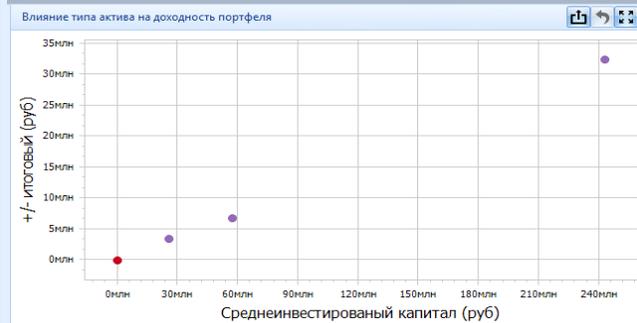
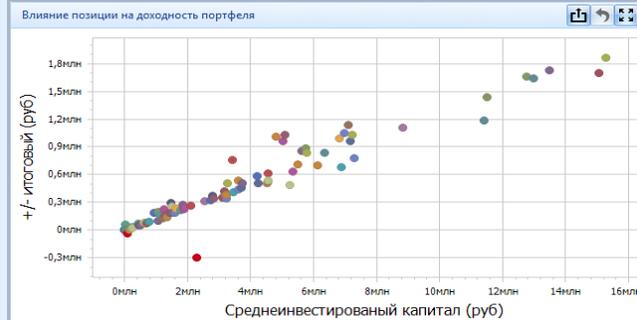
Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- нерели...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	→ 0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель ...	159 403 309...	160 369 171,72 Р	↑ 3,84%	6 144,13	7 012 959...	152 581 158...	5,23%
Портфель 4	180 207 704...	181 049 526,54 Р	→ 0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 3	2 782 779,60 Р	2 797 888,24 Р	→ 0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	→ 0,00	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,48%



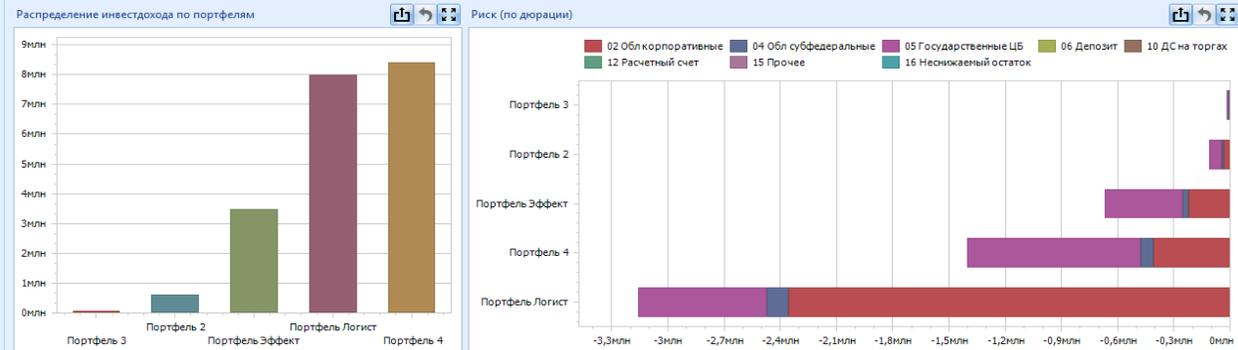
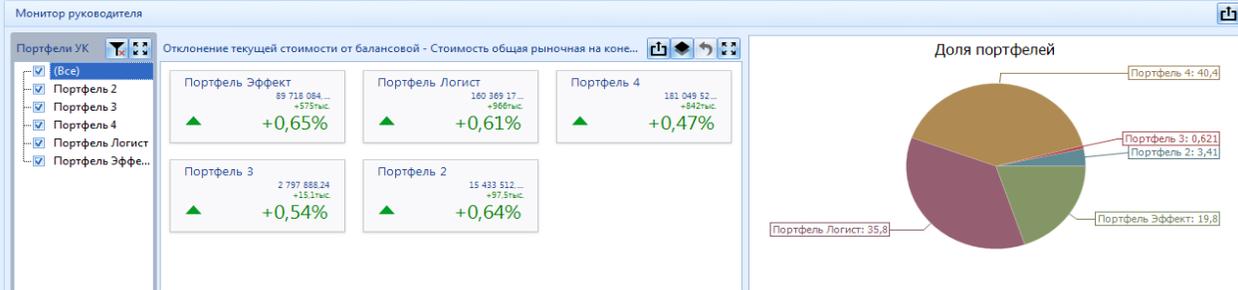
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- нерелизо...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,89%	41 606,08	887 125,31	0,00
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	4,94%	30 927,09	681 531,88	0,00
	Россия-ОФЗ-2901...			2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	0,00
	Прочие расходы			0	0,00%	-3 000,00	0,00	0,00
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,88%	41 404,99	924 001,09	0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	736	4,81%	34 569,92	749 458,07	0,00
	Маякит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	0,00
	Маякит, БО-001Р...			0	4,37%	25 203,99	577 049,37	0,00
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	0,00
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	0,00
Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-3 044,62	0,00	0,00	
ГТЛК-7-60б		Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	0,00	
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	0,00	
Газпром нефть, 12	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	0,00	
Газпром Капитал...		Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	0,00	
ВЭБ 09		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	0,00	



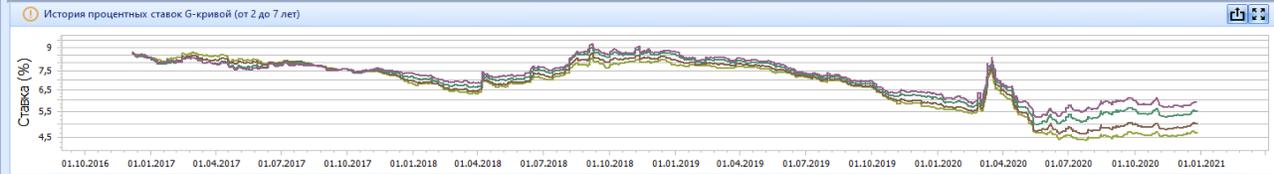
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



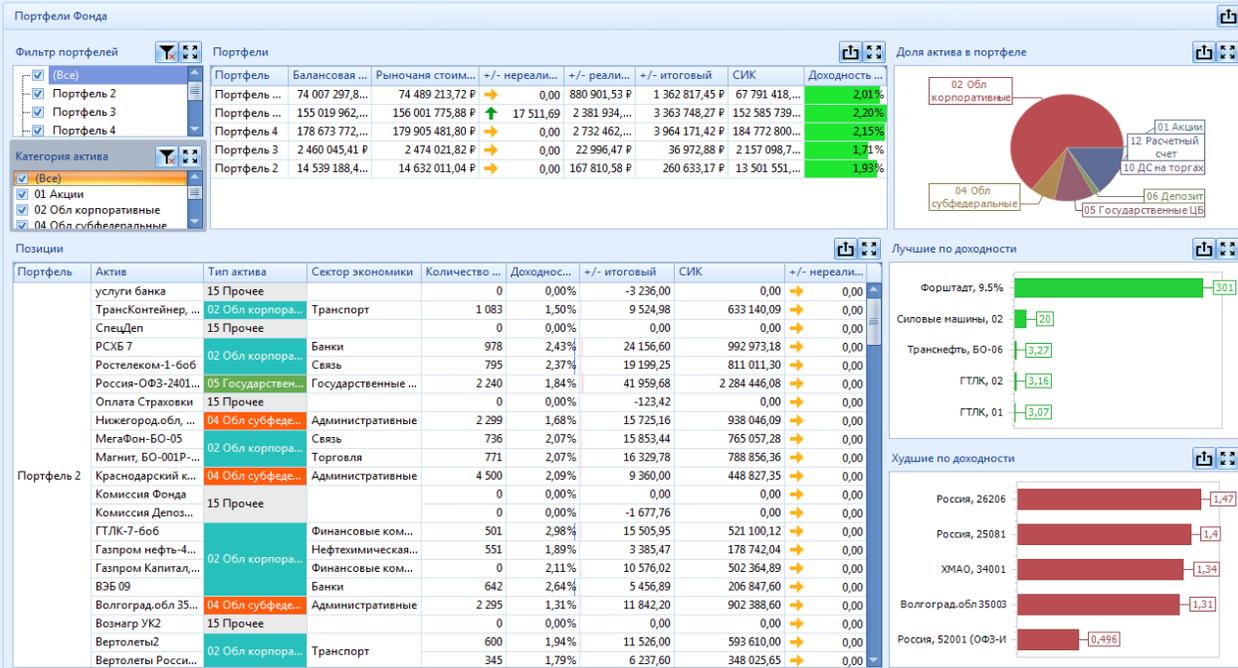
Мониторинг портфелей



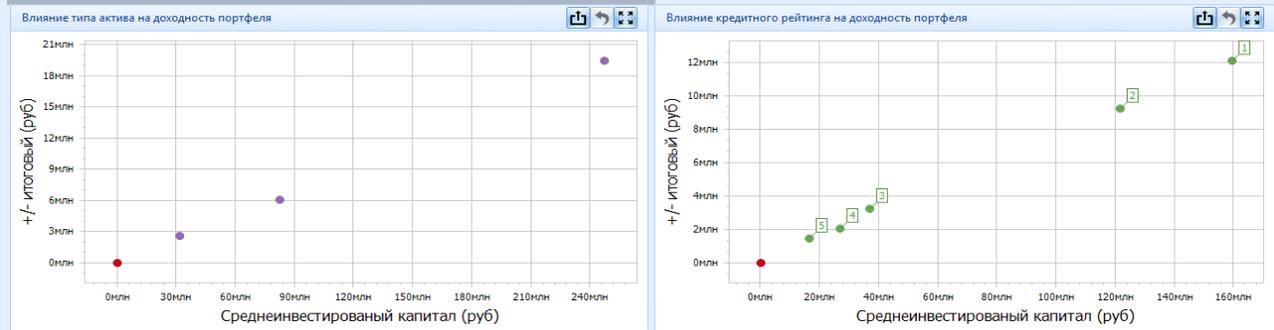
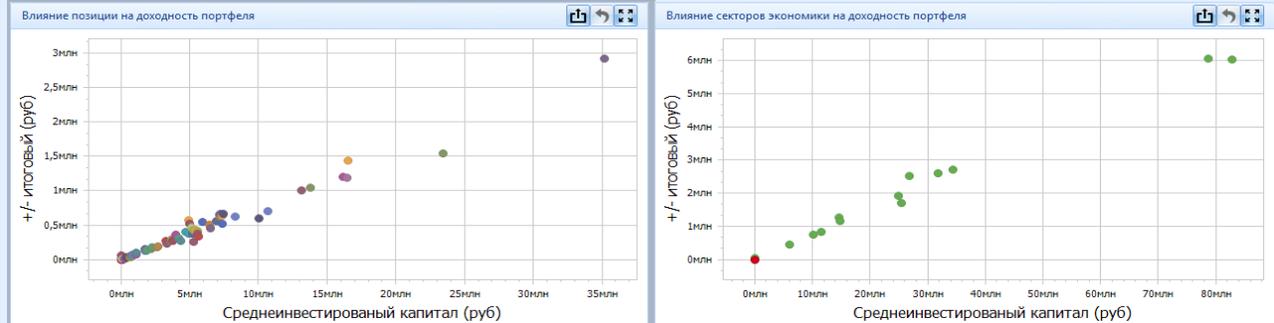
История изменения процентных ставок G-кривой



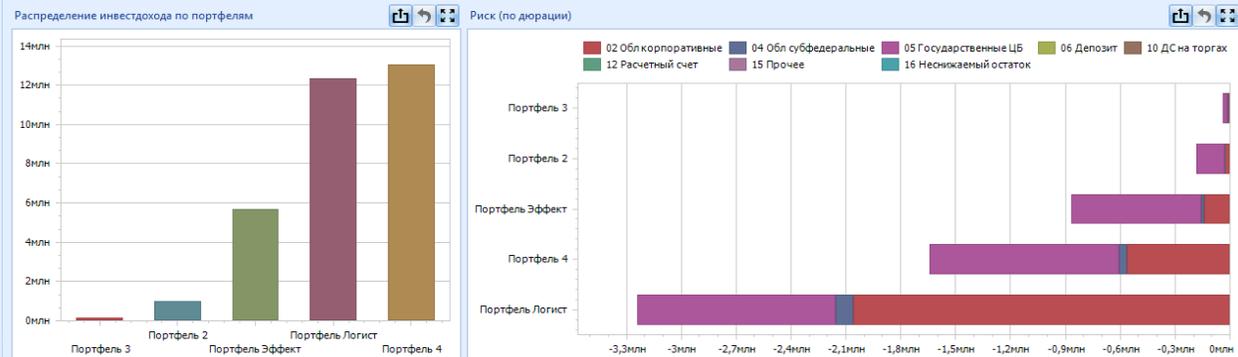
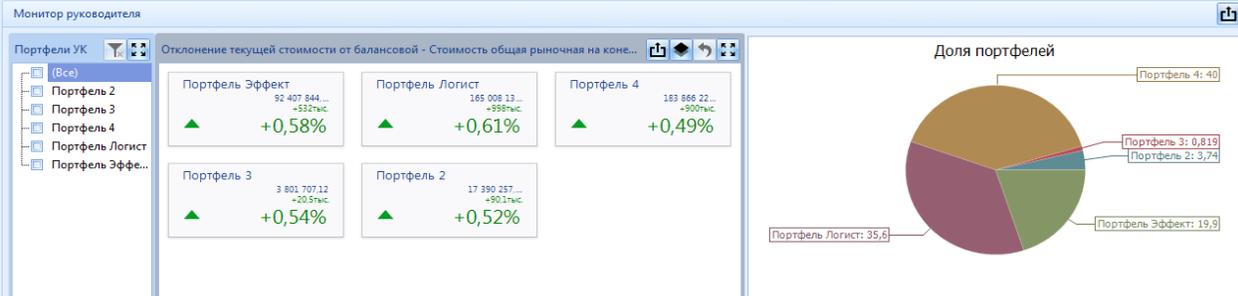
Монитор портфелей



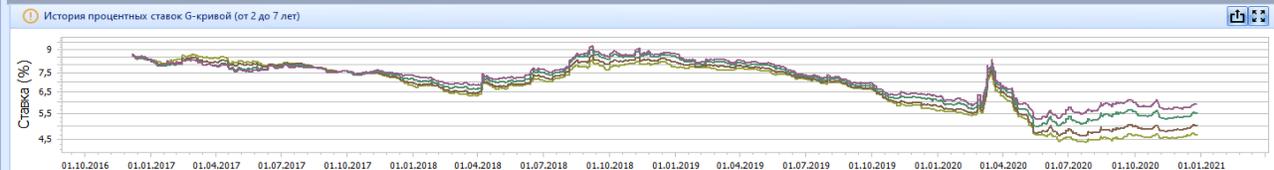
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



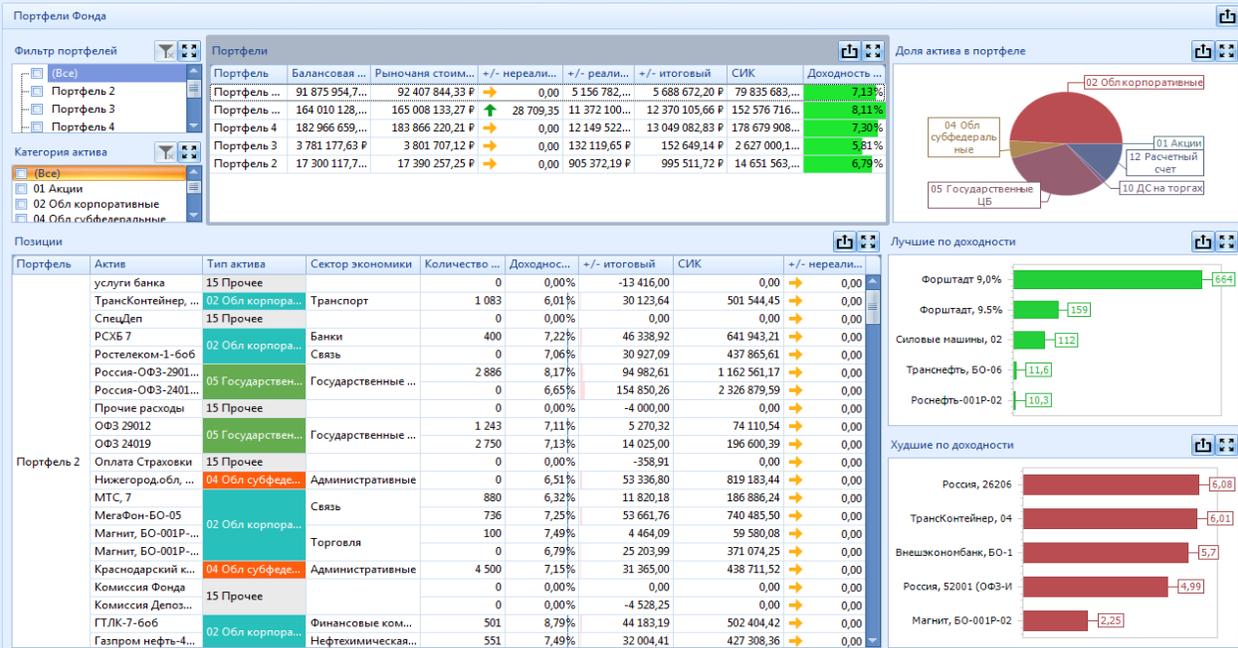
Мониторинг портфелей



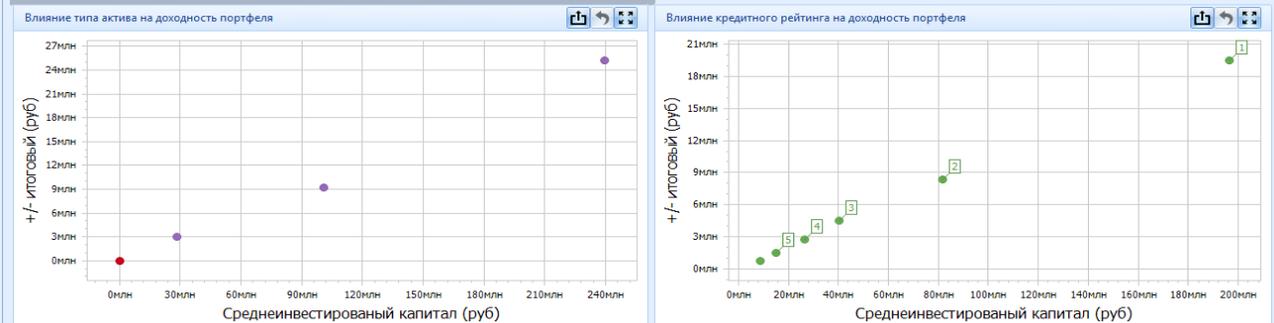
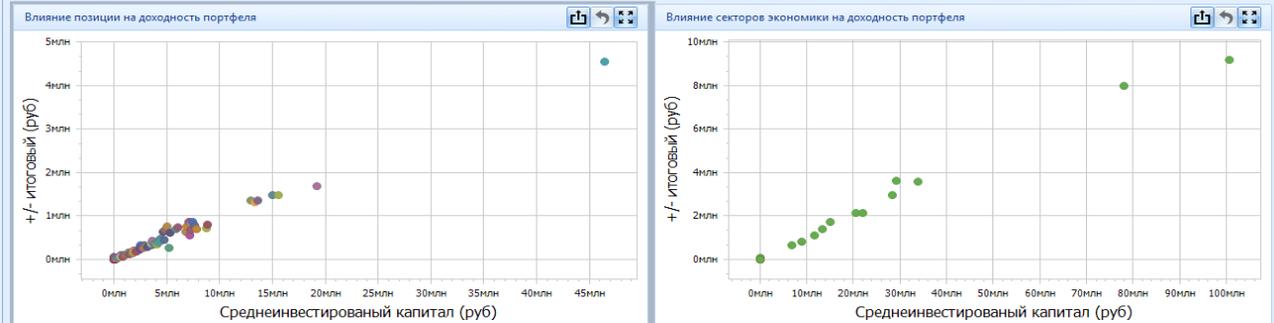
История изменения процентных ставок G-кривой



Монитор портфелей



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

Портфели

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель 1	89 142 819,6...	89 718 084,69 Р	0,00	2 915 933...	3 491 198,44 Р	76 470 662...	4,57%
Портфель 2	159 403 309...	160 369 171,72 Р	↑ 6 144,13	7 012 959...	7 978 821,91 Р	152 581 158...	5,23%
Портфель 3	180 207 704...	181 049 526,54 Р	0,00	7 566 393...	8 408 216,16 Р	180 829 153...	4,65%
Портфель 4	2 782 779,60...	2 797 888,24 Р	0,00	74 209,03 Р	89 317,67 Р	2 319 537,8...	3,85%
Портфель 2	15 335 974,7...	15 433 512,48 Р	↑	528 079,45 Р	625 617,16 Р	14 123 355...	4,4%

Доля актива в портфеле

Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходность (MWY)	+/- итог...	СИК	+/- не реализо...
Портфель 1	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	0,00
Портфель 1	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,64%	21 199,72	582 853,81	0,00
Портфель 1	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
Портфель 1	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,69%	41 606,08	887 125,31	0,00
Портфель 1	Ростелеком-1-606	02 Обл корпора...	Связь	0	4,54%	30 927,09	681 531,88	0,00
Портфель 1	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государств...	Государственные ...	2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	0,00
Портфель 1	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государств...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	0,00
Портфель 1	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-3 000,00	0,00	0,00
Портфель 1	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	0,00
Портфель 1	Нижегород.обл, ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,48%	41 404,99	924 001,09	0,00
Портфель 2	МегаФон-Б.О.О.	04 Обл субфед...	Сеть	736	4,81%	34 560,07	760 458,07	0,00

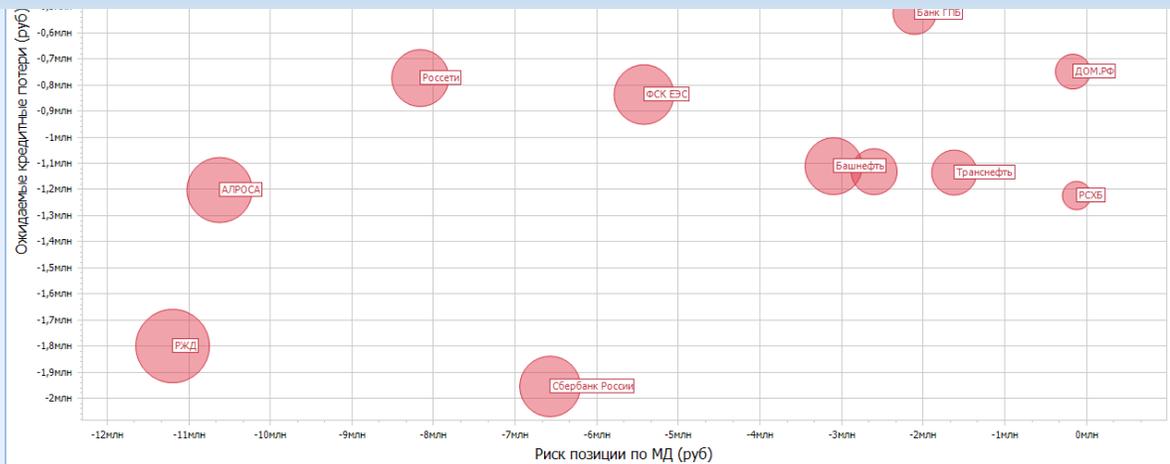
Лучшие по доходности

- Форштадт, 9,5%
- Силовые машины, 02 -53,2
- Роснефть-001P-02 -17,86
- ФПК 1P-01 -17,37
- ГТЛК, 01 -16,05

Худшие по доходности



GAMA Terminal



Газпром Капитал	222 841 923,61	6,64%	-3,27%	-7 281 725,87	-362 641,09	-6 919 084,78
Сбербанк России	271 957 760,24	8,11%	-3,13%	-8 521 176,57	-1 953 908,15	-6 567 268,42
Банк ФК Открытие	154 170 848,10	4,60%	-2,42%	-3 738 059,88	-1 132 356,91	-2 605 702,97
ФСК ЕЭС	264 122 867,50	7,87%	-2,37%	-6 262 345,24	-835 988,55	-5 426 356,69

Доля кредитного и рыночного риска по секторам экономики

Сектор экономики	Стоимость позиции с НКД (ру...)	Доля отрасли в стоимости портфе...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (р...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
Связь	120 575 495,88	3,59%	-4,27%	-5 149 083,15	-796 131,00	-4 352 952,15
Транспорт	373 937 582,30	11,15%	-3,47%	-12 993 660,47	-1 797 714,66	-11 195 945,81
Финансовые компании	281 348 393,96	8,39%	-2,91%	-8 198 871,13	-1 109 865,47	-7 089 005,66
Электроэнергетика	508 457 841,35	15,16%	-2,91%	-14 816 972,38	-1 609 558,43	-13 594 198,89

Доля кредитного и рыночного риска в дюрации

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (р...	Доля дюрации в стоимости портфеля	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (р...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
до 0,25	81 099 412,68	2,42%	-1,15%	-935 604,51	-782 364,84	-153 239,67
от 0,25 до 0,75	228 944 057,88	6,82%	-0,76%	-1 742 381,05	-909 244,64	-833 136,41
от 0,75 до 0,9	37 772 493,63	1,13%	-1,55%	-584 579,04	-378 180,42	-206 398,62
от 1 до 3	1 765 116 947,85	52,61%	-2,12%	-37 394 165,46	-8 178 046,28	-29 216 119,18
от 3 до 5	1 242 057 295,68	37,02%	-3,63%	-45 125 734,36	-3 120 826,48	-42 004 907,88

Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

Эшелон ликвидности	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля эшелона ликвидности в сто...	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (ру...	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (р...
Низколиквидная	183 541 111,76	5,47%	-4,15%	-7 619 096,51	-796 995,73	-6 822 100,78
Среднеликвидная	980 988 613,00	29,24%	-3,33%	-32 693 684,76	-4 825 957,87	-28 254 511,83
Высоколиквидная	2 190 460 482,96	65,29%	-2,08%	-45 469 683,15	-8 132 494,00	-37 337 189,15

GAMA

Вы умеете инвестировать,
мы умеем считать.



www.infostroy.ru