

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...

ДУ 9

1 005 60...

-21,7млн

-2,11%

ДУ 7

6 971 05...

-161млн

-2,26%

ДУ 4

7 684 90...

-194млн

-2,47%

ДУ 3

756 690 89...

+18,2млн

+2,46%

ДУ 2

770 323 52...

-5,37млн

-0,69%

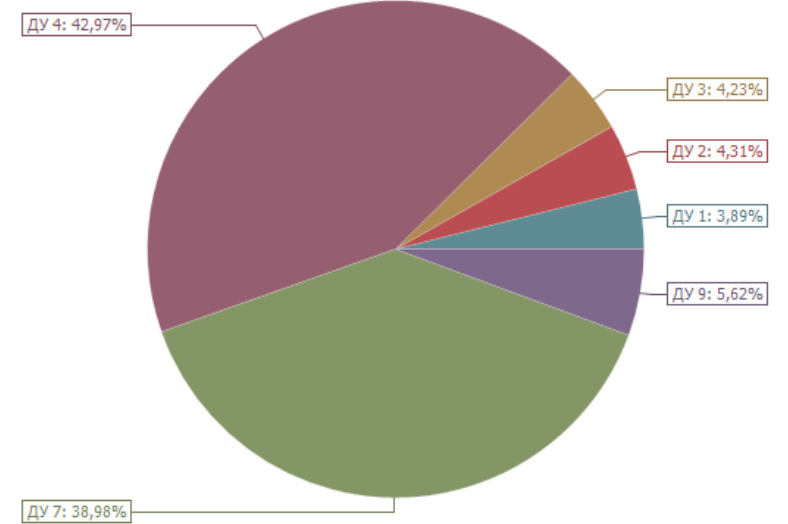
ДУ 1

696 471 37...

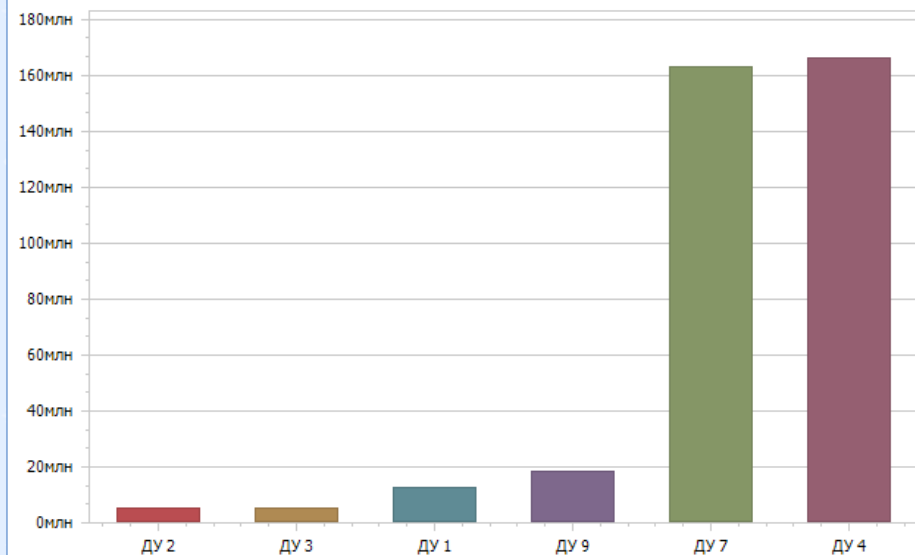
+15,3млн

+2,24%

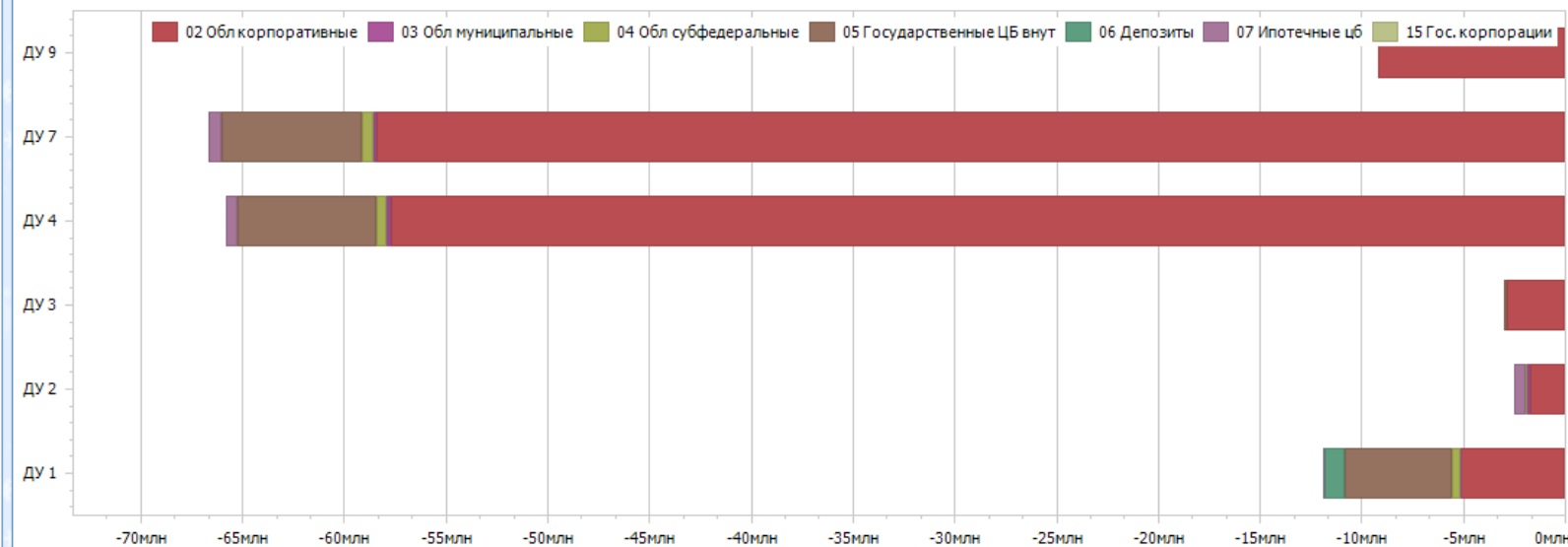
Доля портфеля в активах (%)



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по модифицированной дюрации)



Мониторинг портфелей



Мониторинг портфелей

Фильтр портфелей



Портфели

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

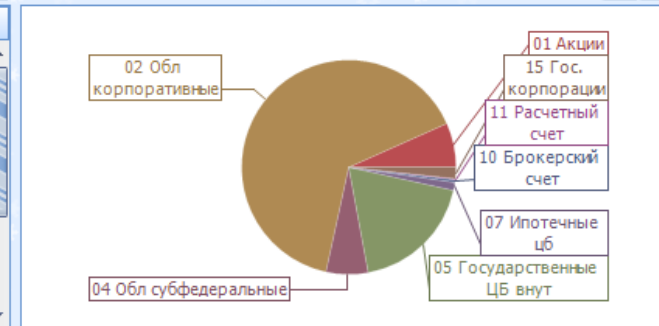
Категория актива



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

Портфель	Балансовая с...	Рыночная стоимость с ...	+/- не реализован...	+/- 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%

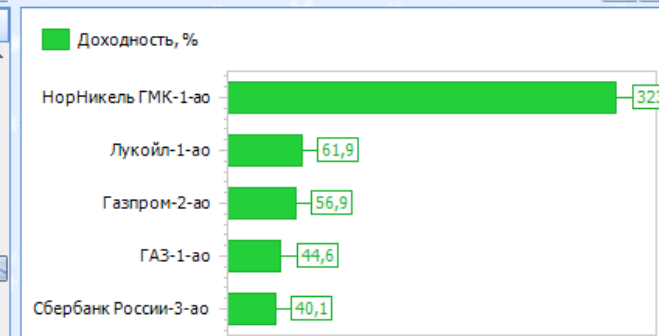
Доля актива в портфеле



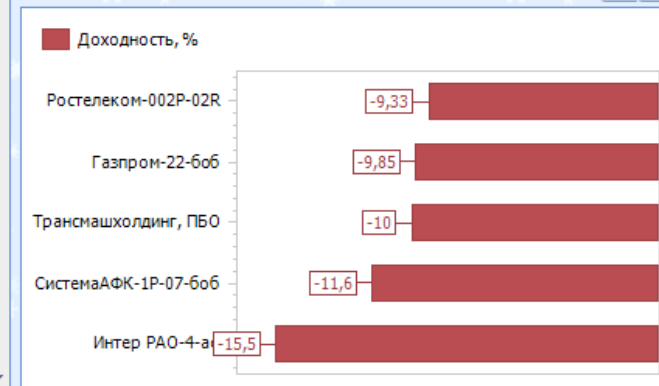
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ЦБ	+/- не реализованный	Доходность (MWY)	+/- 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-о6	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-о6	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-о6	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-о6			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



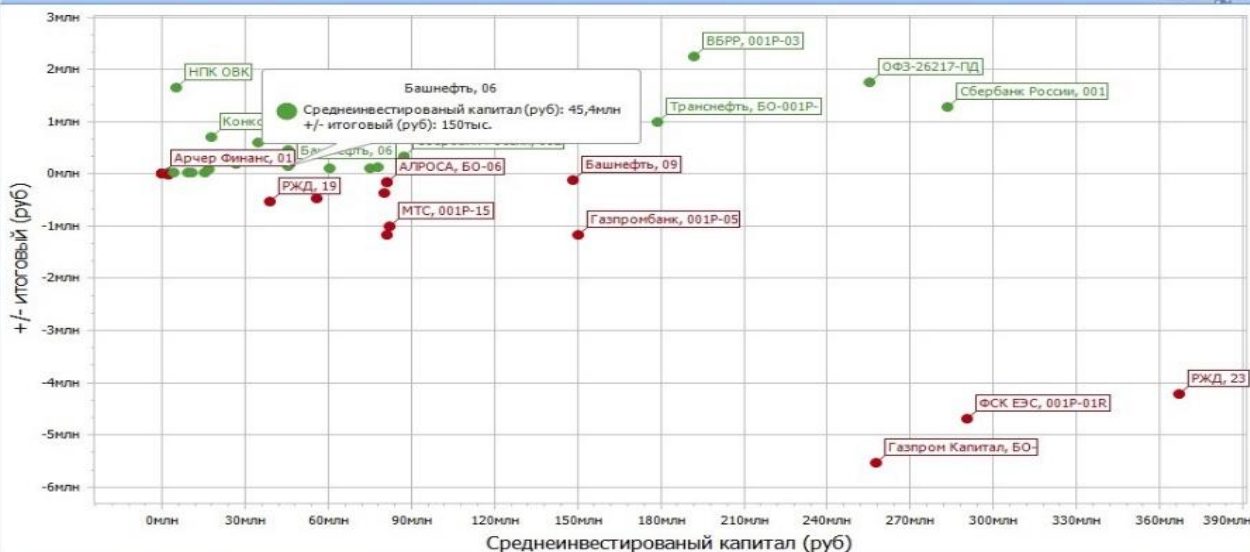
Худшие по доходности



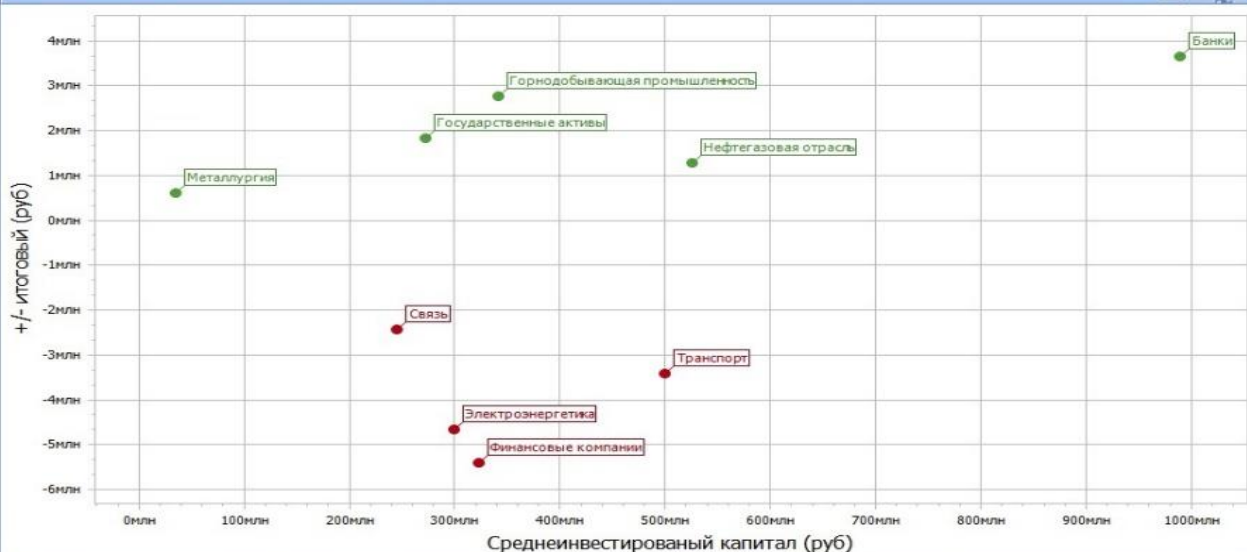
ВЛИЯНИЕ ПОЗИЦИЙ И КАТЕГОРИЙ АКТИВОВ НА РЕЗУЛЬТАТ ПОРТФЕЛЯ

Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

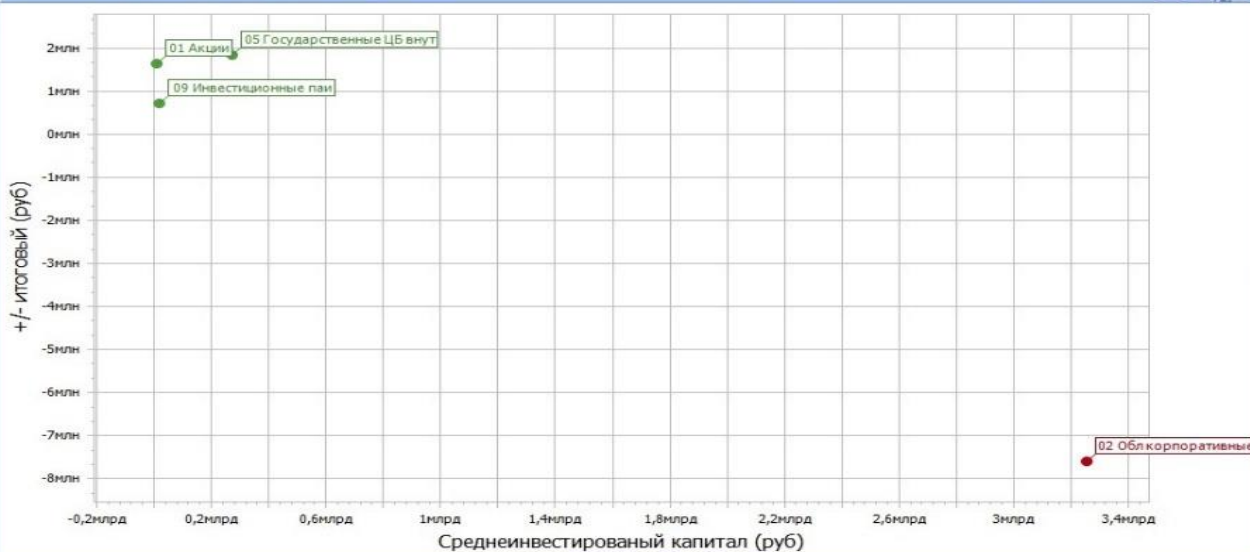
Влияние позиции на доходность портфеля



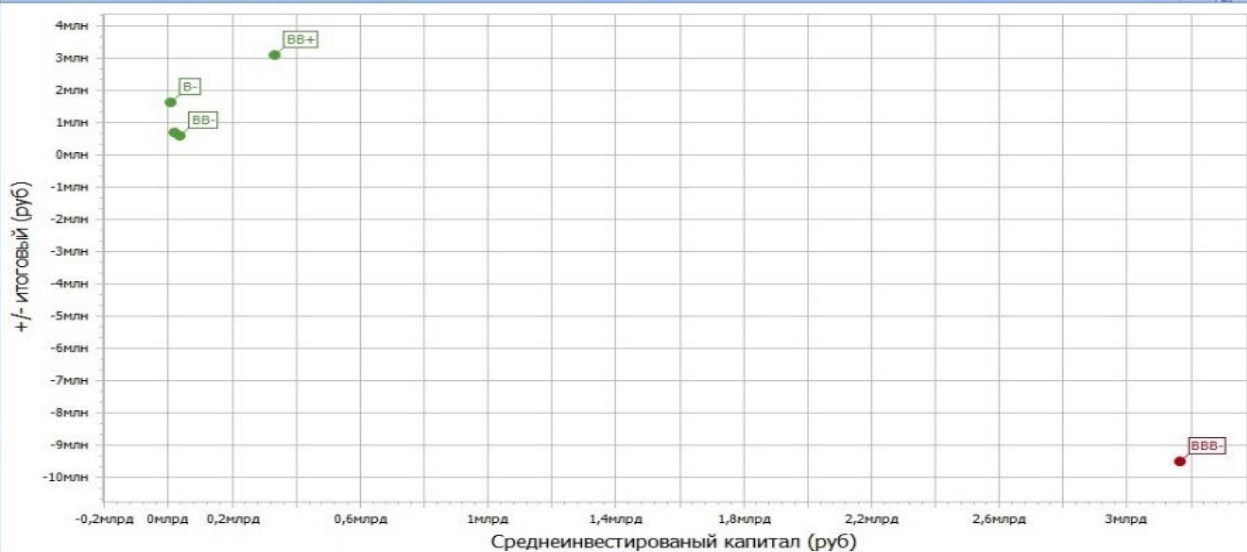
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



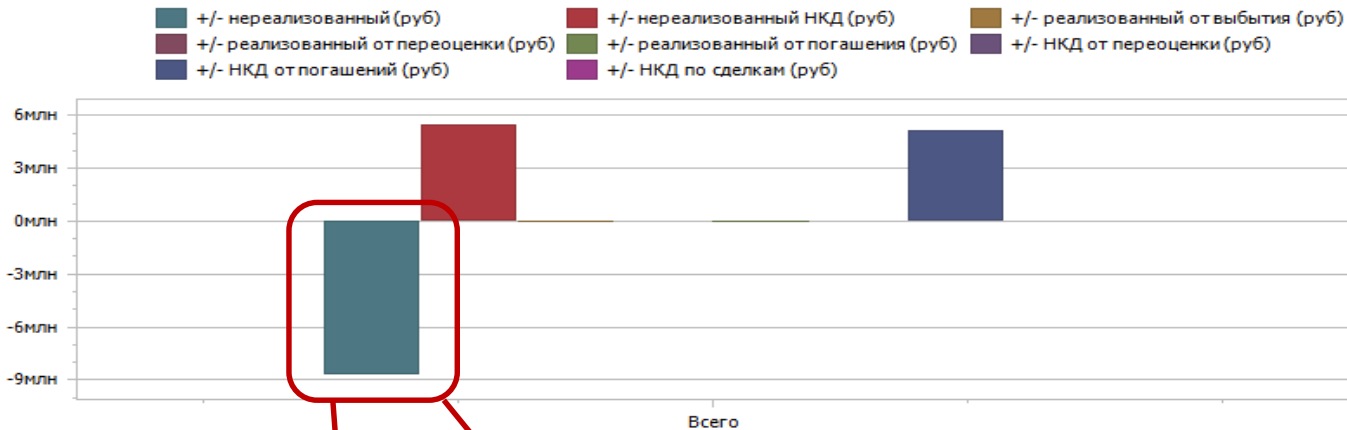
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



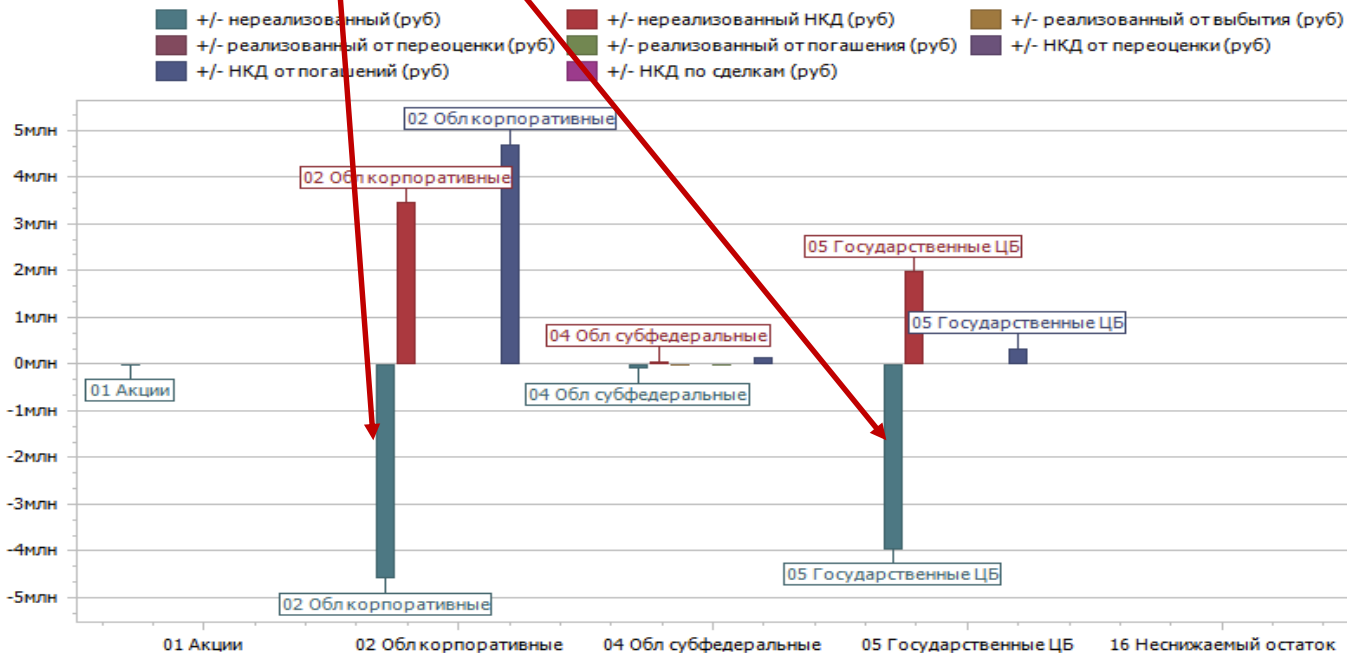
ФАКТОРНЫЙ АНАЛИЗ

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%	-1 344 382,02	-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

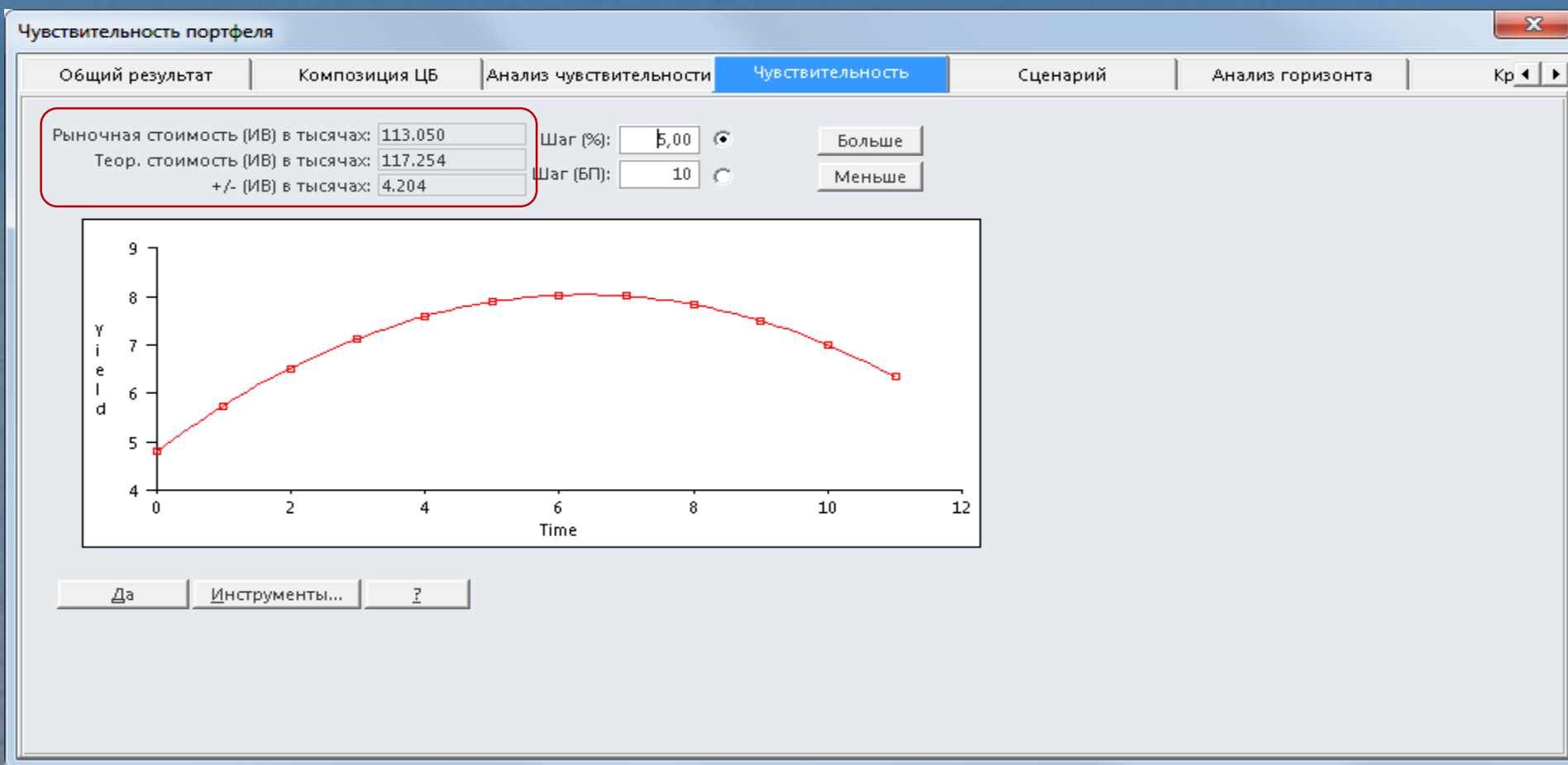
Доля кредитного и рыночного риска в эшелонах ликвидности

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

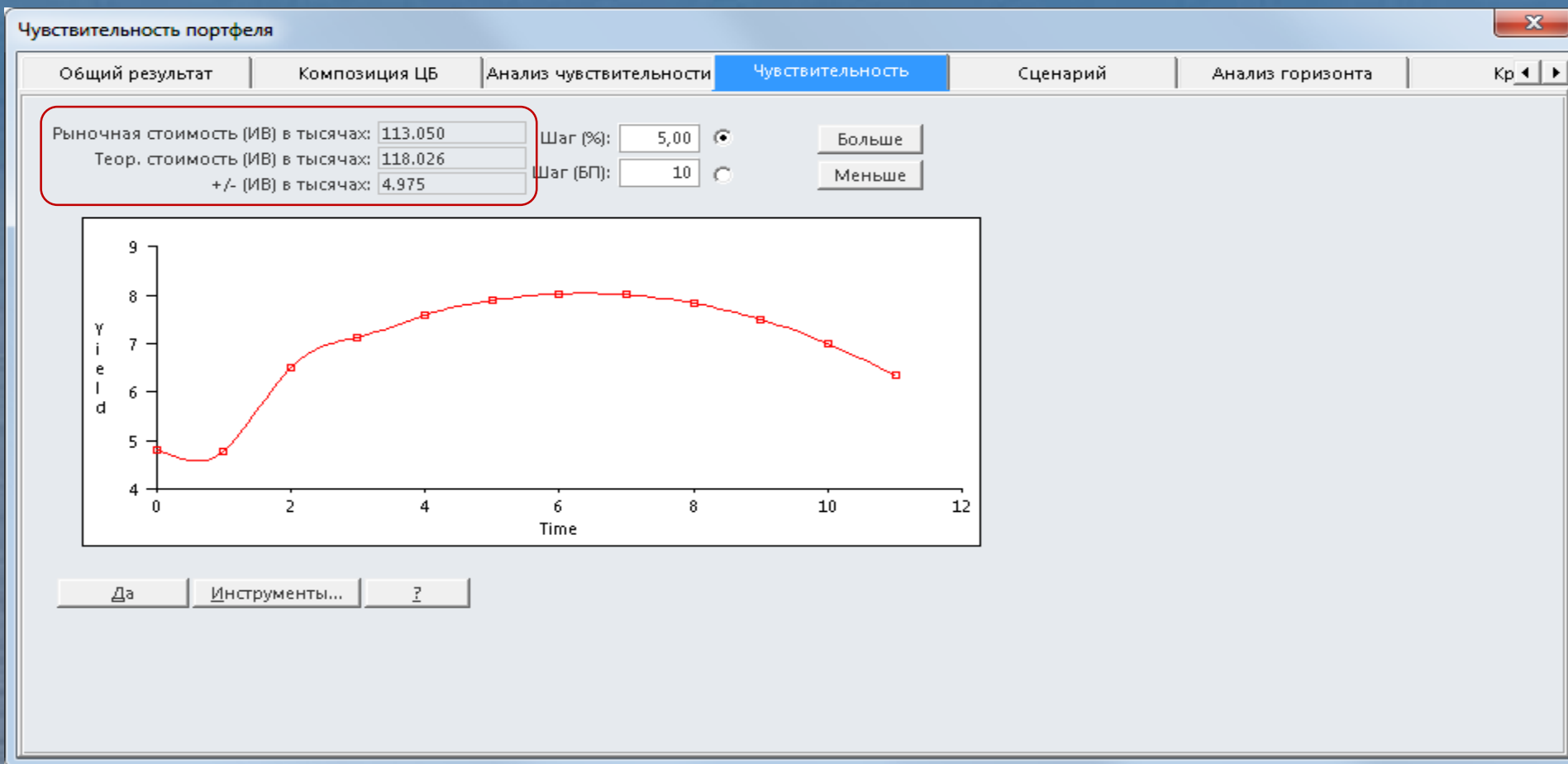
МОДЕЛИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЕЙ



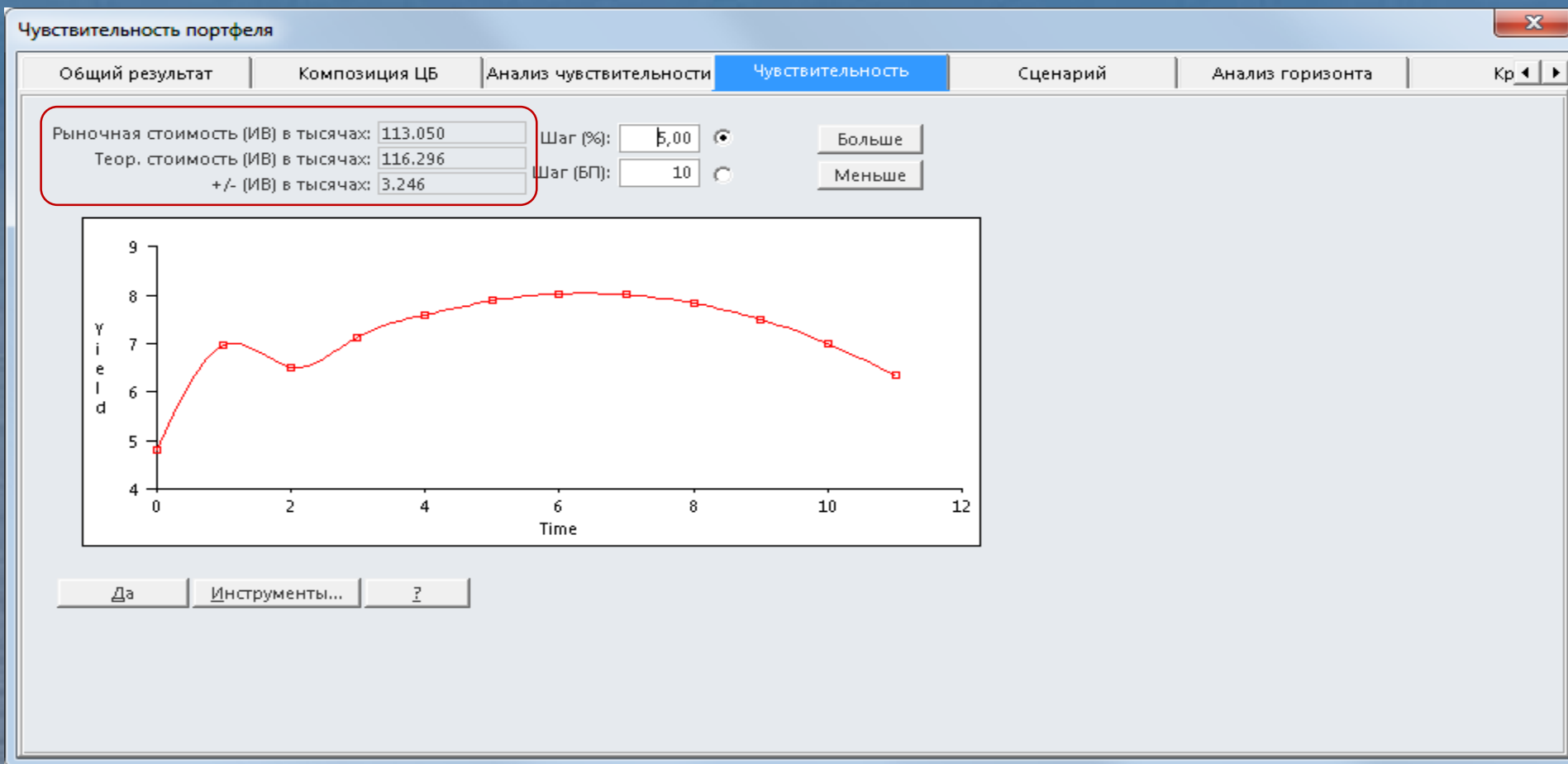
ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



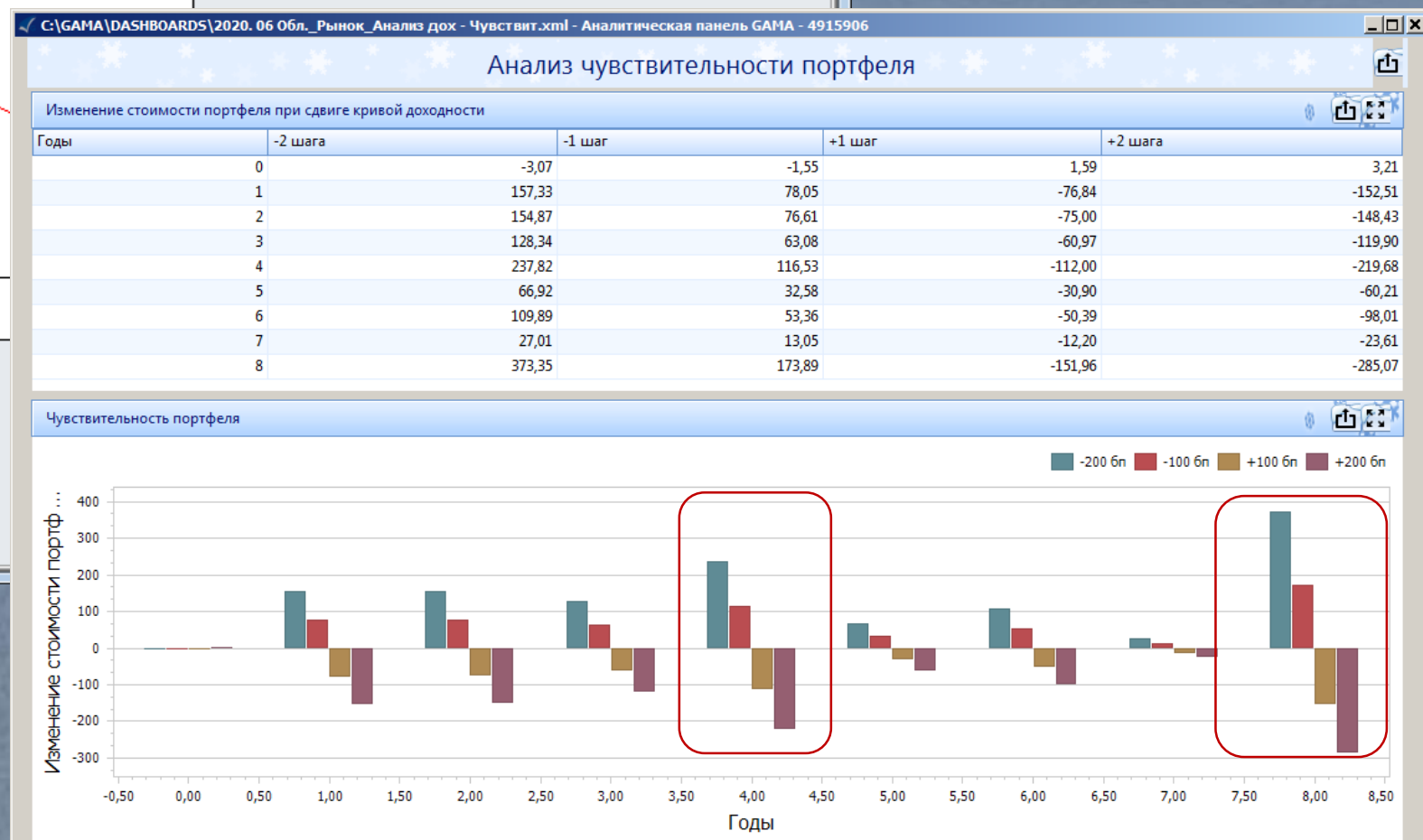
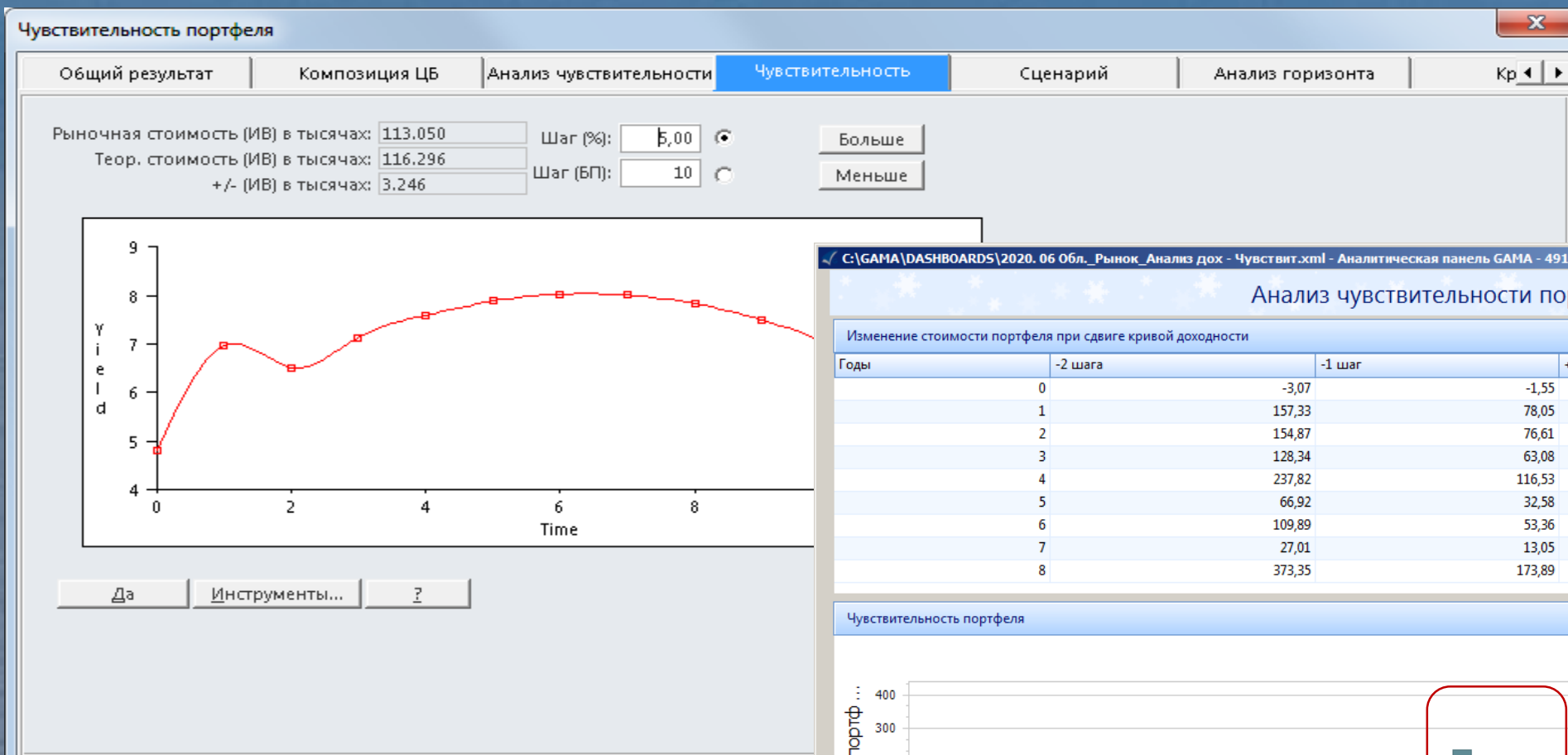
ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТЬ ПОРТФЕЛЯ



ПОДБОР ИНСТРУМЕНТОВ ПО ЗАДАНЫМ КРИТЕРИЯМ

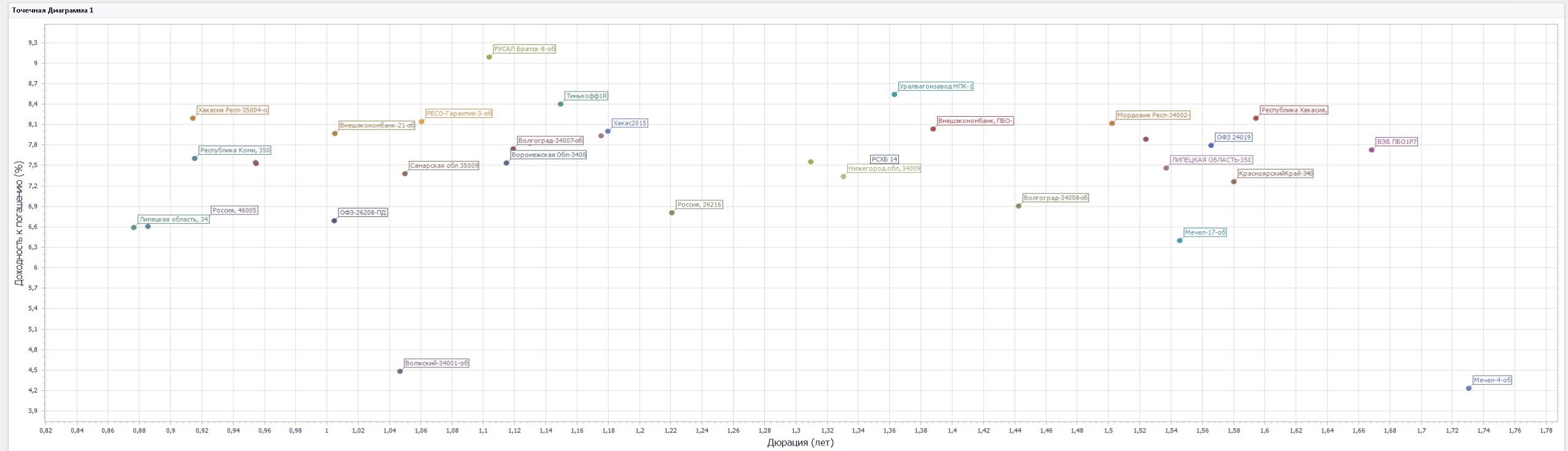
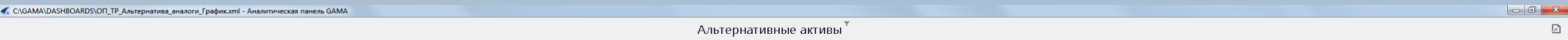


Таблица 1												Котировальный уровень			Тип актива			Агрегированный ре...		Сектор экономики									
Название цб	Тип актива	Сектор экономики	Агрегированный ...	Цена закр...	Цена средняя за 60...	Рейтинг э...	Рейтинг эмитента Moo...	Рейтинг эмитента Fit...	Рейтинг выпуска Fitc...	Рейтинг выпуска Mood...	Рейтинг выпуска SP...	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 1	<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 2	<input checked="" type="checkbox"/> Уровень 3	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> 02 Обл корпоративные	<input checked="" type="checkbox"/> 03 Обл муниципальные	<input checked="" type="checkbox"/> 04 Обл субфедеральные	<input checked="" type="checkbox"/> 05 Государственные ЦБ	<input checked="" type="checkbox"/> (Все)	<input checked="" type="checkbox"/> Административные	<input checked="" type="checkbox"/> Банки	<input checked="" type="checkbox"/> Государственные активы	<input checked="" type="checkbox"/> Машиностроение и металлообработка	<input checked="" type="checkbox"/> Металлургия	<input checked="" type="checkbox"/> Нефтегазовая отрасль	<input checked="" type="checkbox"/> Финансовые компании	
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	1	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	Отозван		BB-																					
Воронежская Обл-3400	03 Обл муниципальные	Административные	4	104,90	105		B1	BB-																					
ВЗБ ПБО1P7	02 Обл корпоративные	Банки	1	102,45	102	BBB-	Ba1	BBB-																					
ЕвразХолдинг Финанс-	02 Обл корпоративные	Финансовые комп...	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	Отозван																					
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	BB																				
Нижегородская область	04 Обл субфедеральные	Административные	3	108,82	109	BB	B1	BB	BB																				
ОФЗ 24019	05 Государственные ЦБ	Государственные а...	1	102,27	102	BBB-	Ba1	BBB-	BBB-																				
ОФЗ-26208-ПД	05 Государственные ЦБ	Государственные а...	1	100,90	101	BBB-	Ba1	BBB-	BBB-	Ba1	BBB-																		
РЕСО-Гарантия-3-об	02 Обл корпоративные	Финансовые комп...	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 отря...	1	101,40	101	BB+	Baa3	BBB-																					

АНАЛИЗ ИЗМЕНЕНИЯ ПРОЦЕНТНЫХ СТАВОК

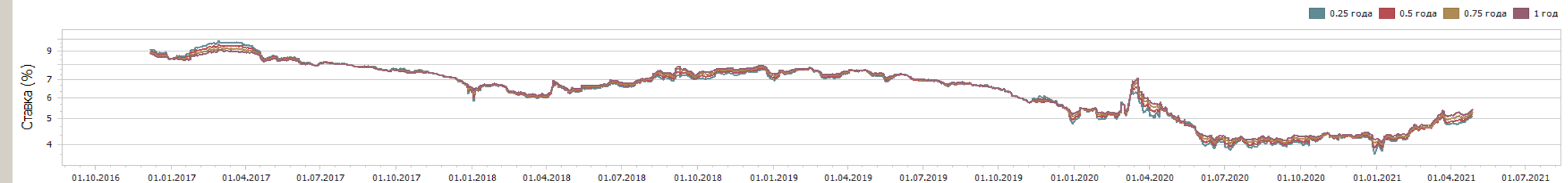
C:\GAMA\DASHBOARDS\Demonstration\Облиг_Рынок_Анализ дох_Ставки с фильтром.xml - Аналитическая панель GAMA - 6227276

История изменения процентных ставок G-кривой

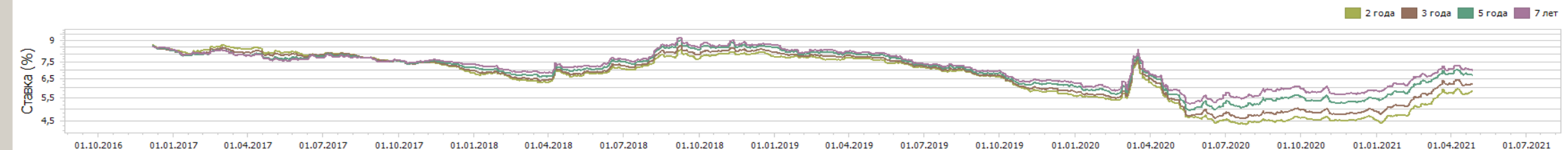
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

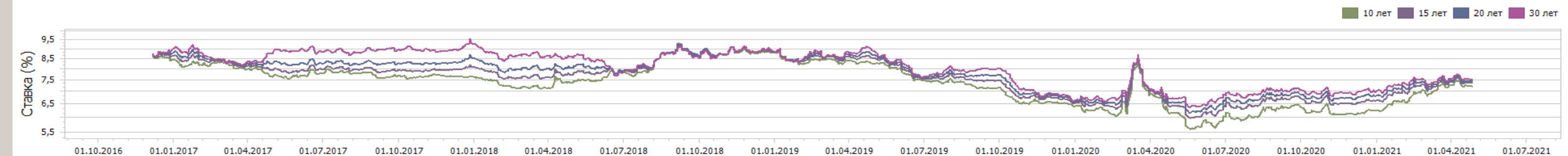
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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				
	Отклонение РС	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

Прогноз изменения структуры портфелей

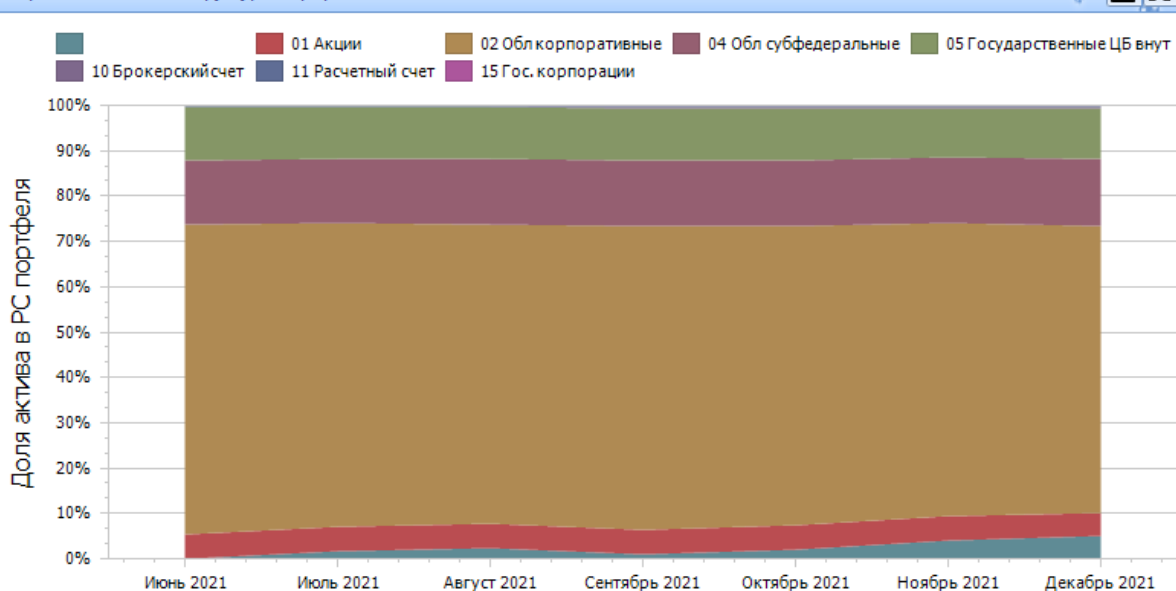
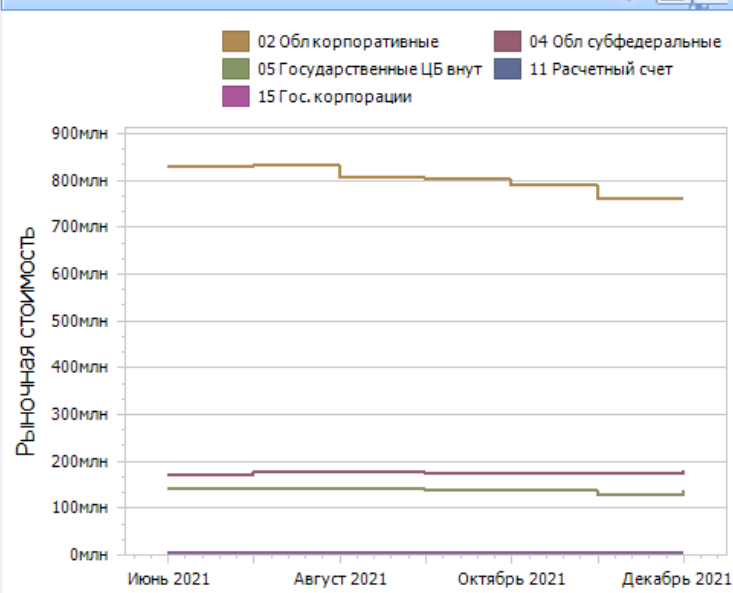
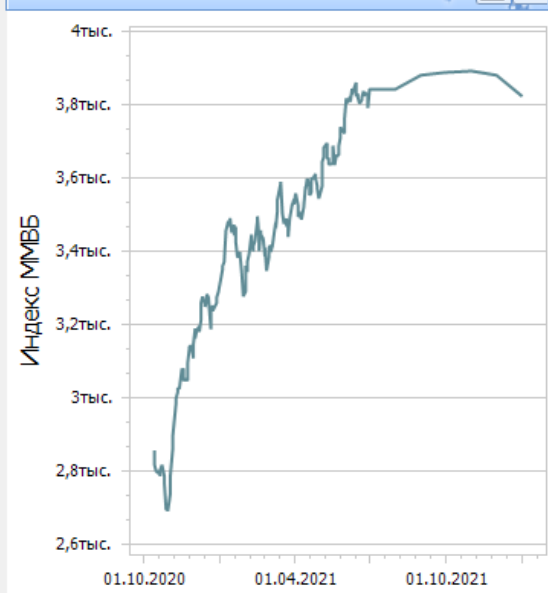


График изменения стоимости облигаций с учетом прогноза сдвига G-кр...



Индекс ММВБ (история+прогноз)



Изменение прогнозной стоимости портфелей

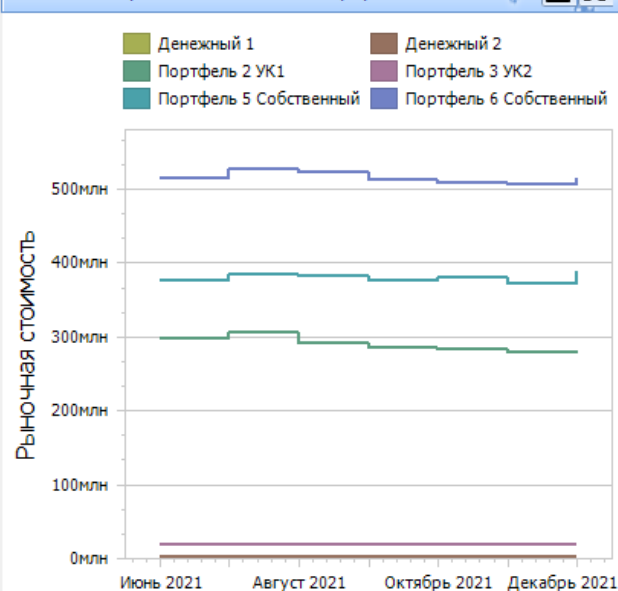
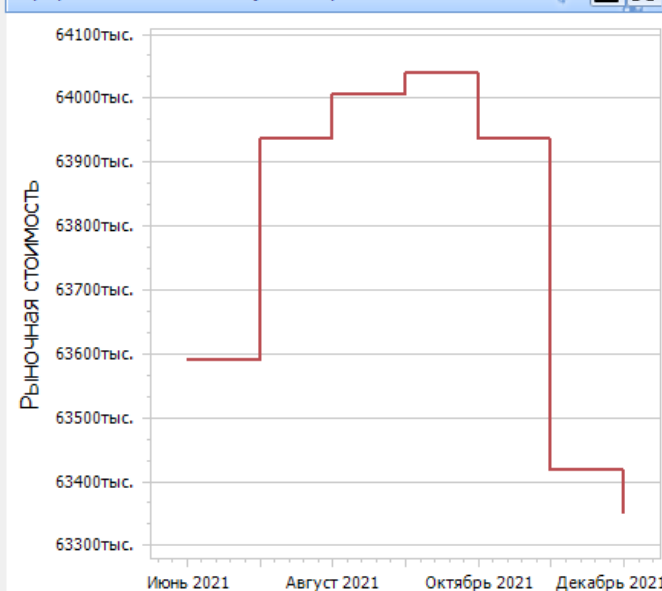


График стоимости акций с учетом прогноза индекса



НАЧАЛЬНЫЕ ДАННЫЕ ДЛЯ ПОРТФЕЛЬНОГО АНАЛИЗА



АГЕНТ GAMA



АГЕНТ GAMA

- ✓ 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
-------	------	-----------------	------

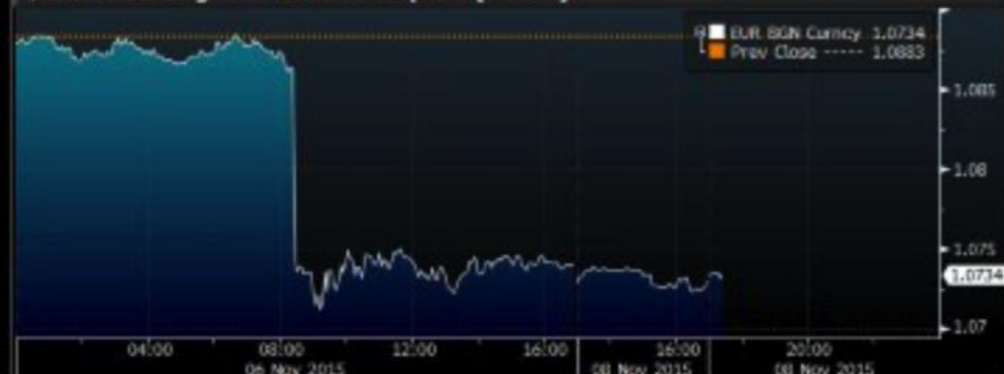
4) Open/High/Low/Close Graph (GPC)



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

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

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 2395 9000 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2015 Bloomberg Finance L.P.
SN 247141 EST GMT-5:00 G447-4722-0 08-Nov-2015 17:27:07

ГАМА ТЕРМИНАЛ



Мониторинг портфелей

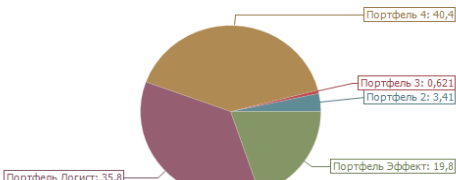
Монитор руководителя

Портфели УК

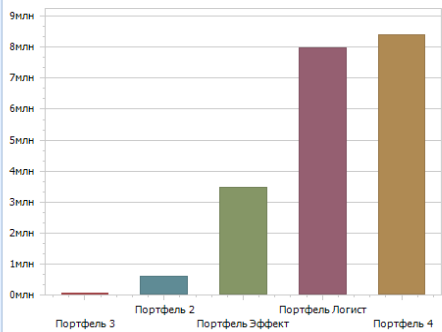
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффект...



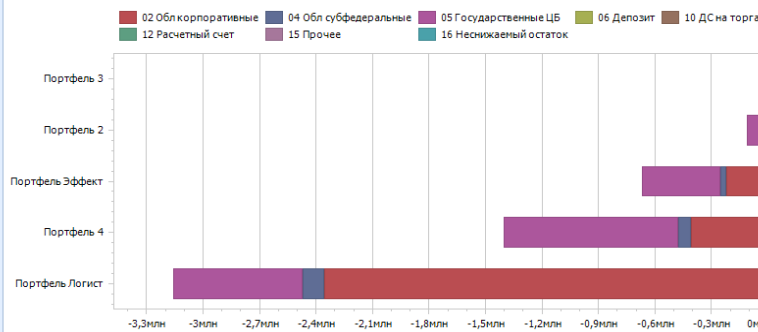
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дорации)



Монитор портфелей

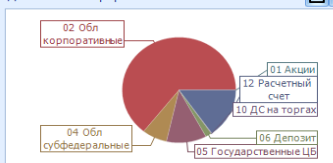
Портфели Фонда

Фильтр портфелей

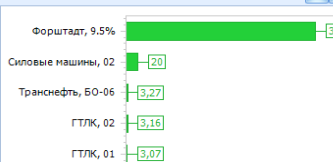
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	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%

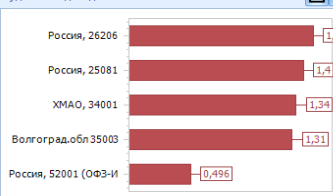
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности

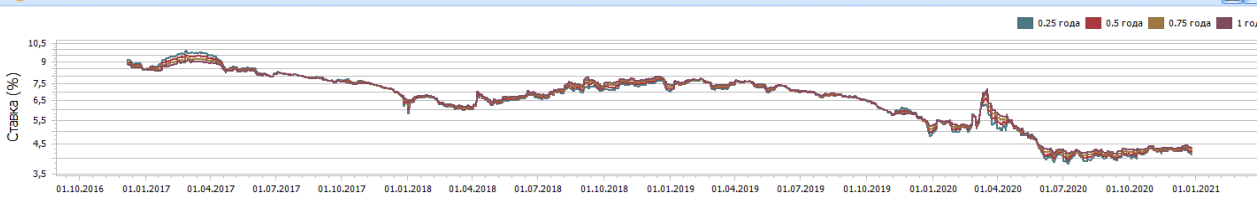


История изменения процентных ставок G-кривой

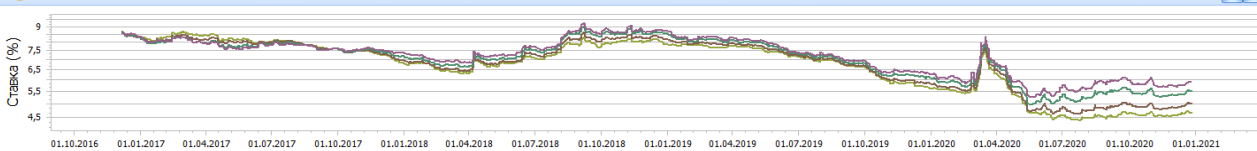
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

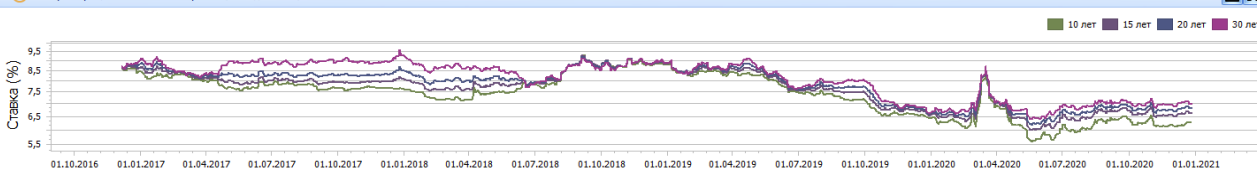
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

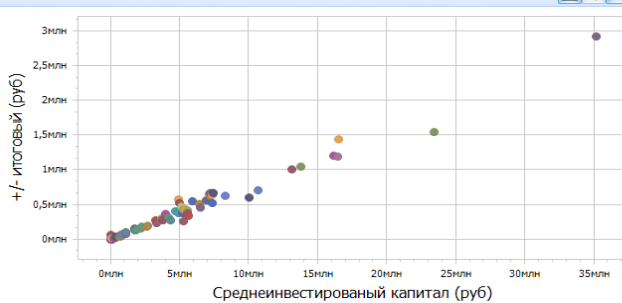


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

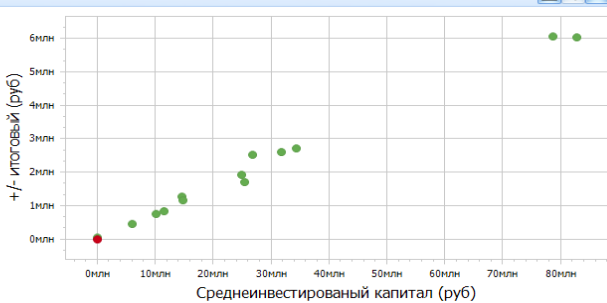


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

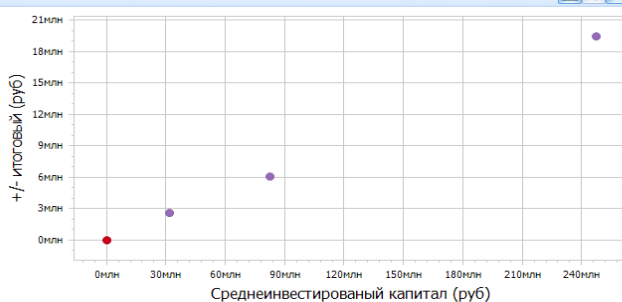
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



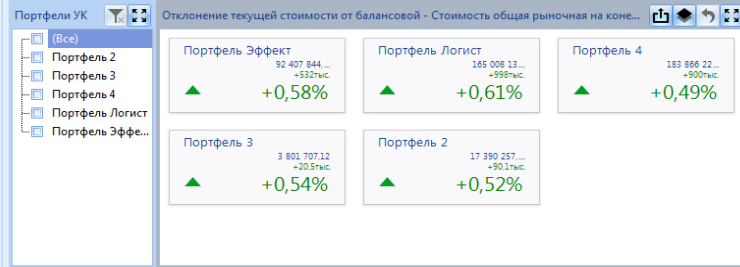
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



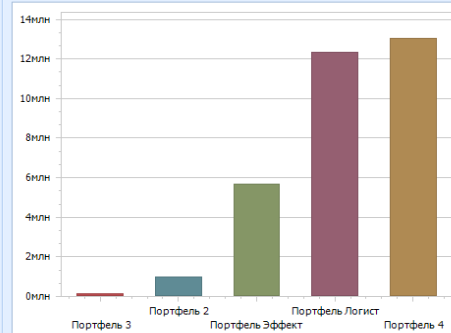
Мониторинг портфелей



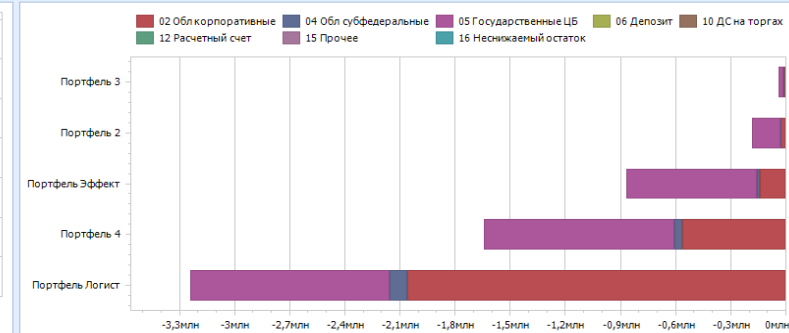
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей

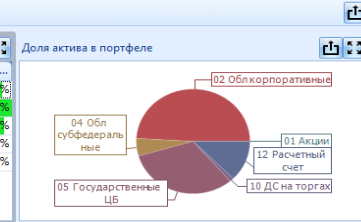



Портфели Фонда

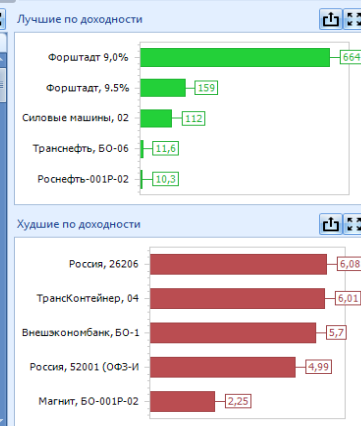
Фильтр портфелей

Портфели

Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 P	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 P	79 835 683...	7,13%
Портфель ...	164 010 128...	165 008 133,27 P	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 P	152 576 716...	8,11%
Портфель 4	182 966 659...	183 866 220,21 P	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 P	178 679 908...	7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 P	3 801 707,12 P	0,00	132 119,65 P	152 649,14 P	2 627 000,1...	5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 P	0,00	905 372,19 P	995 511,72 P	14 651 563...	6,78%



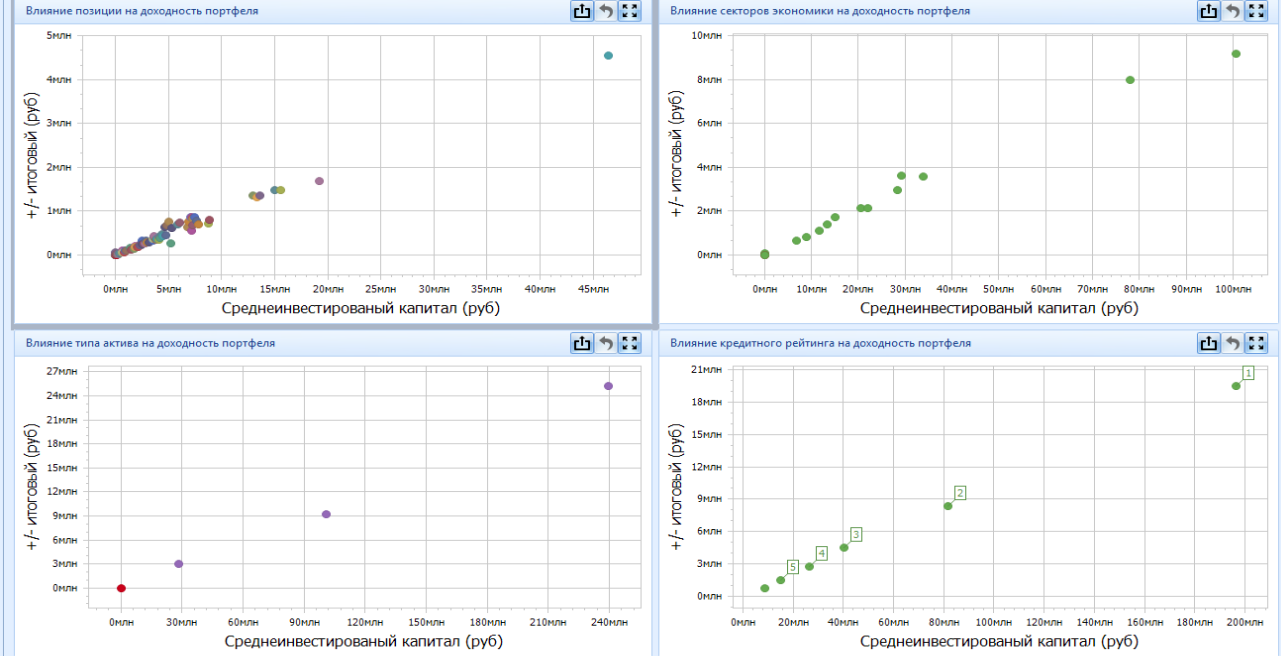
Позиции									
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...	
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-13 416,00	0,00	0,00	
	Трансконтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	6,01%	30 123,64	501 544,45	0,00	
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00	
	РСБ 7	02 Обл корпора...	Банки	400	7,22%	46 338,92	641 943,21	0,00	
	Ростелеком-1-боб		Связь	0	7,06%	30 927,09	437 865,61	0,00	
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государствен...	Государственные ...	2 886	8,17%	94 982,61	1 162 561,17	0,00	
	Россия-ОФЗ-2401...			0	6,65%	154 850,26	2 326 879,59	0,00	
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	0,00	
	ОФЗ 29012	05 Государствен...	Государственные ...	1 243	7,11%	5 270,32	74 110,54	0,00	
	ОФЗ 24019			2 750	7,13%	14 025,00	196 600,39	0,00	
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	0,00	
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	0	6,51%	53 336,80	819 183,44	0,00	
	МТС, 7		Связь	880	6,32%	11 820,18	186 886,24	0,00	
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...		736	7,25%	53 661,76	740 485,50	0,00	
	Магнит, БО-001P...		Торговля	100	7,49%	4 464,09	59 580,08	0,00	
	Магнит, БО-001P...			0	6,79%	25 203,99	371 074,25	0,00	
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	7,15%	31 365,00	438 711,52	0,00	
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00	
	Комиссия Депоз...			0	0,00%	-4 528,25	0,00	0,00	
	ГТЛК-7-боб	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	8,79%	44 183,19	502 404,42	0,00	
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	7,49%	32 004,41	427 308,36	0,00		



История изменения процентных ставок G-кривой



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

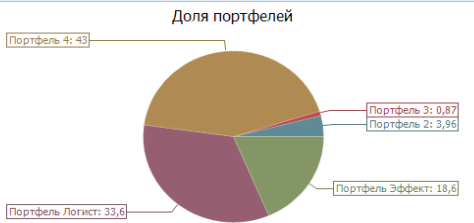


Монитор руководителя

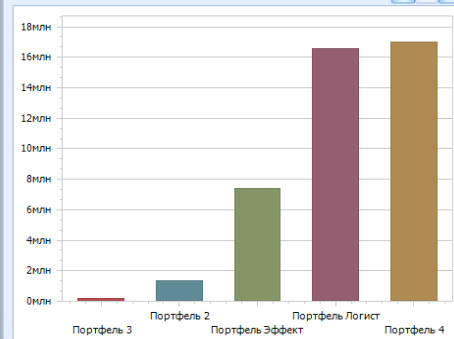
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект...

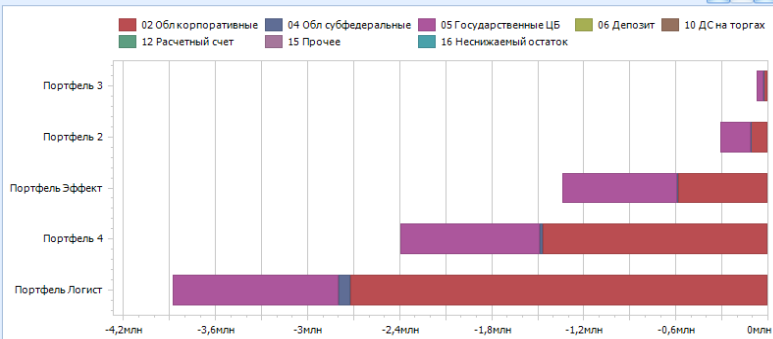
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на коне...



Распределение инвестдохода по портфелям



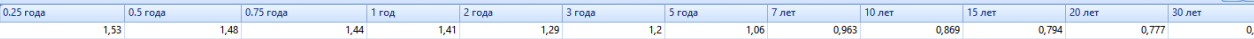
Риск (по дюрации)



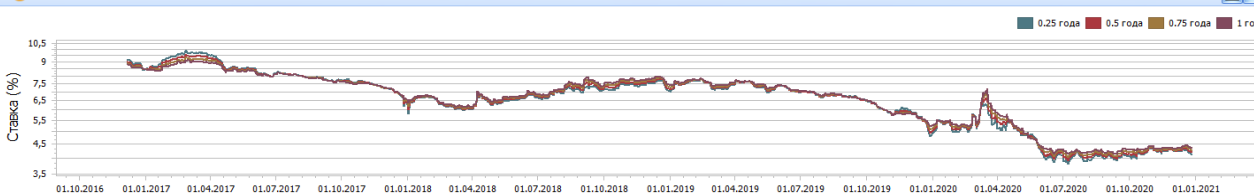
История изменения процентных ставок G-кривой



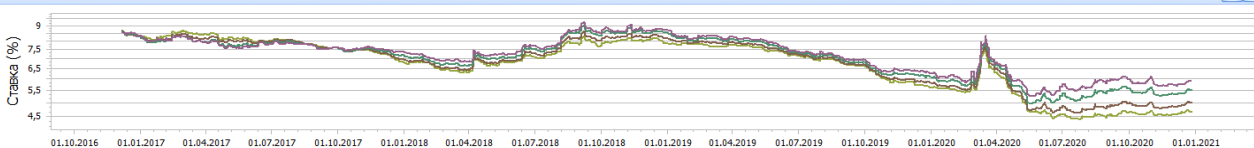
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



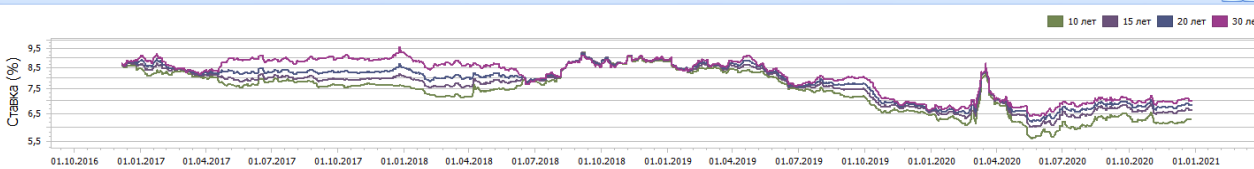
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



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



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

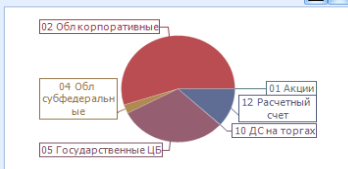
Категория актива

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

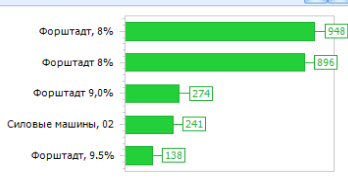
Позиции

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 корпор...	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
	РСКБ 9		Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	↑ 2 183,70
	РСКБ 7	02 Обл корпор...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	→ 0,00
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...		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
	Роснефть67	02 Обл корпор...	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		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 субфед...	Административные	0	8,91%	53 336,80	598 629,71	→ 0,00
	МТС_7			0	8,47%	20 452,98	241 595,84	→ 0,00

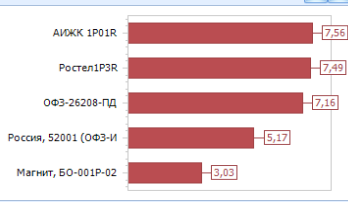
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



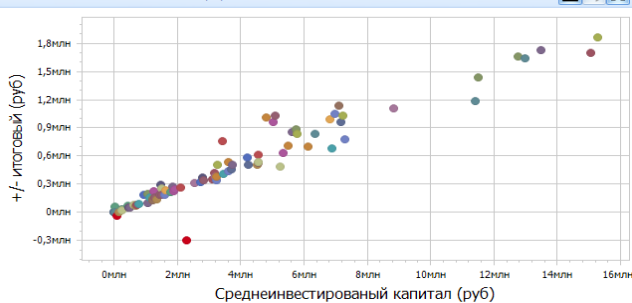
Худшие по доходности



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



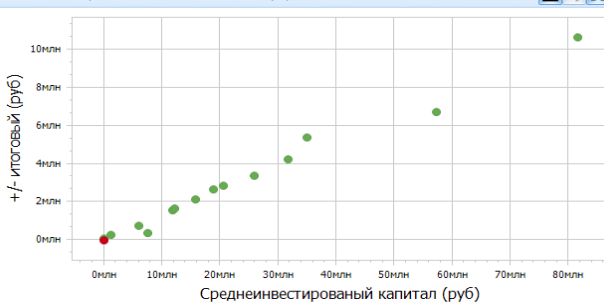
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

Портфель УК

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

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



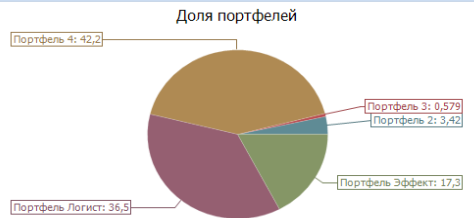
Портфель Эффект
74 489 213
+852тыс
▲ +0,65%

Портфель Логист
158 001 771
+392тыс
▲ +0,63%

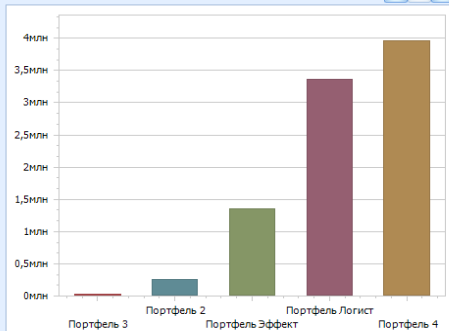
Портфель 4
179 805 481
+1,23млн
▲ +0,69%

Портфель 3
2 474 021,82
+14тыс
▲ +0,57%

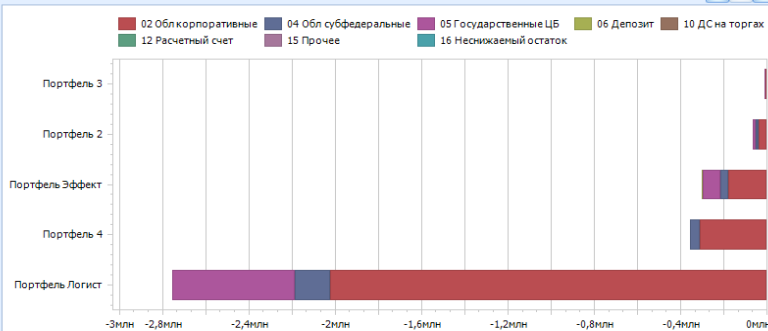
Портфель 2
14 632 011
+92,8тыс
▲ +0,64%



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

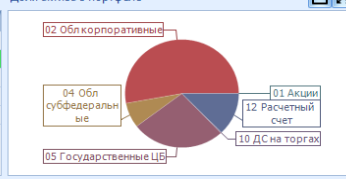
Категория актива

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

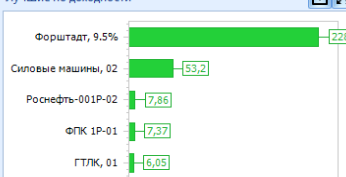
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- не...
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
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	0,00
	Магнит, 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
Портфель 2	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 О9		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	0,00

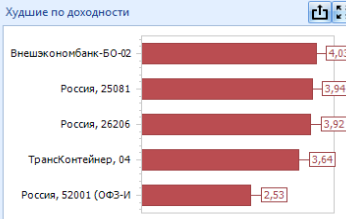
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



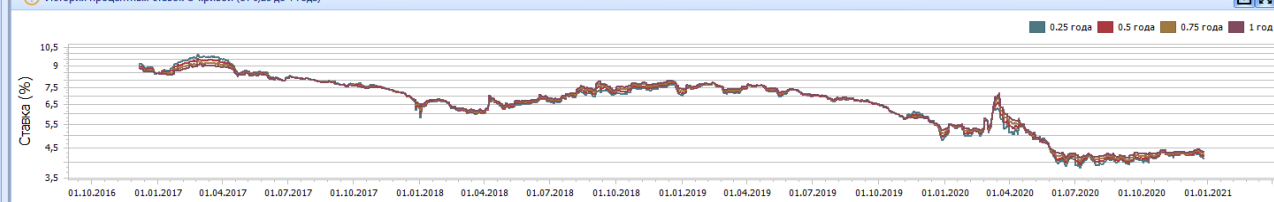
История изменения процентных ставок G-кривой



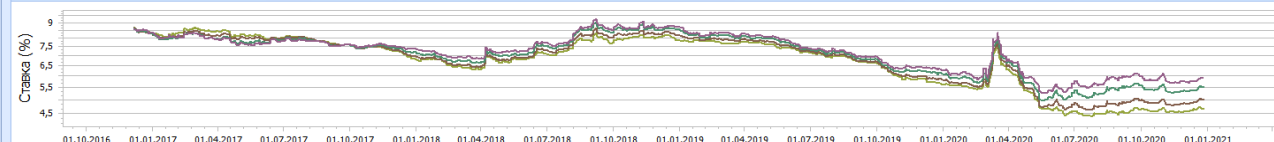
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

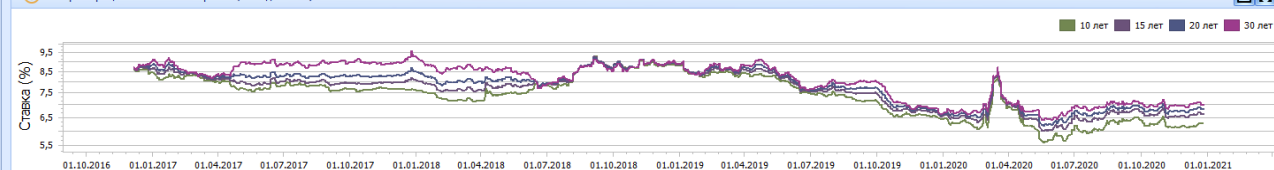
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



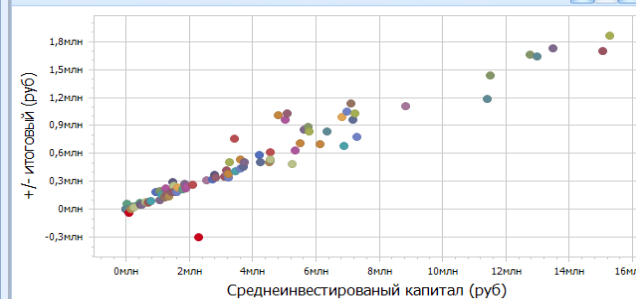
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



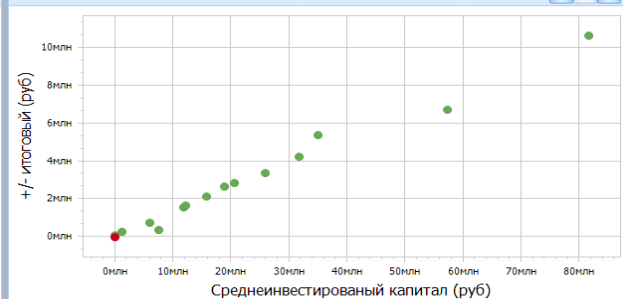
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



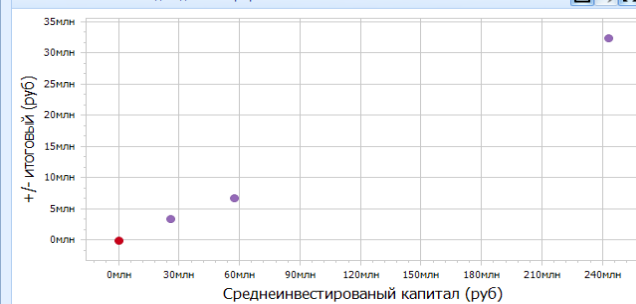
Влияние позиции на доходность портфеля



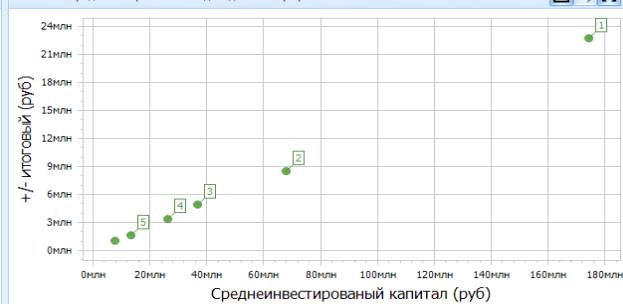
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



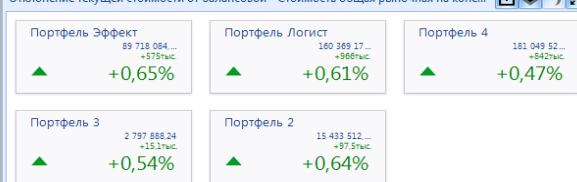
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

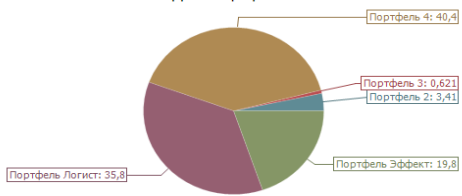
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

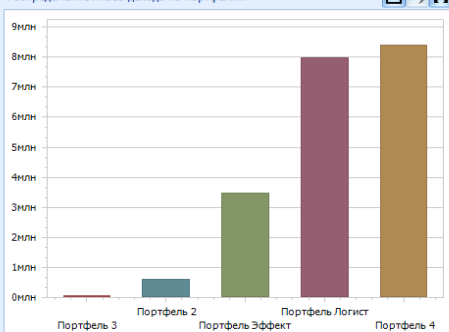
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конец...



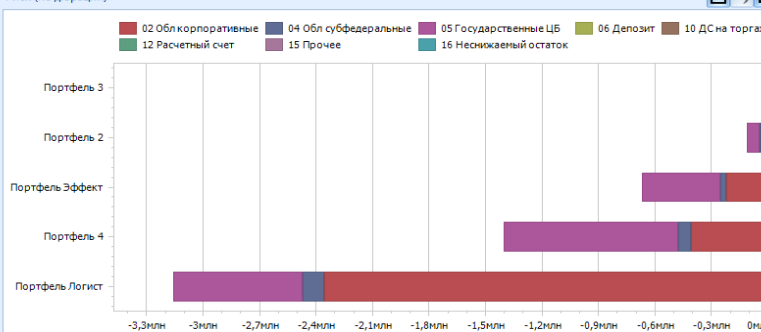
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

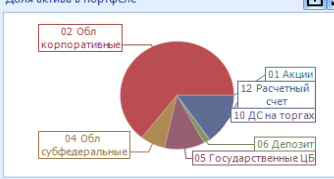
Категория актива

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

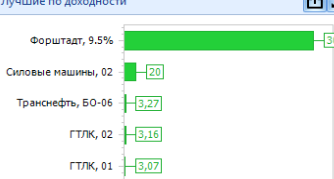
Позиции

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

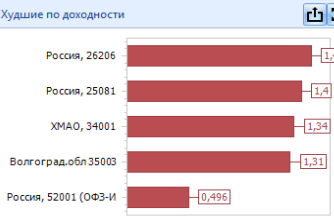
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности

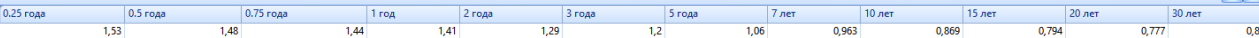


Худшие по доходности

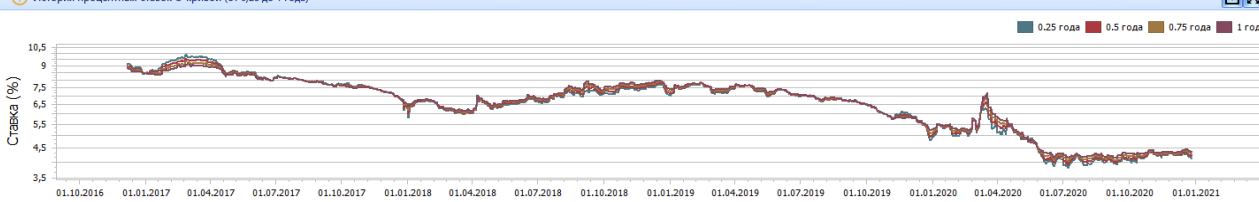


История изменения процентных ставок G-кривой

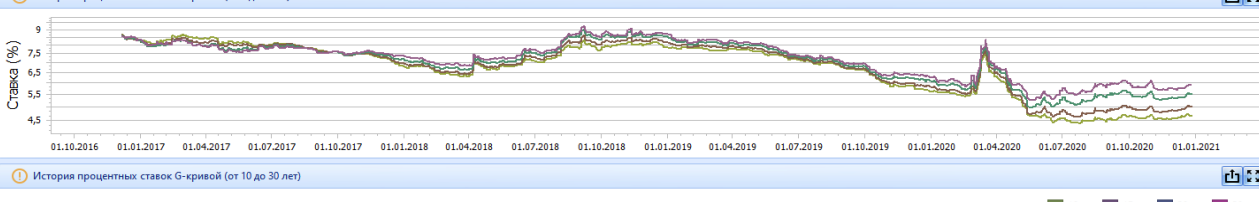
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



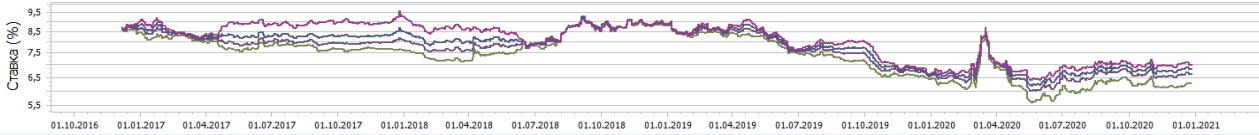
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

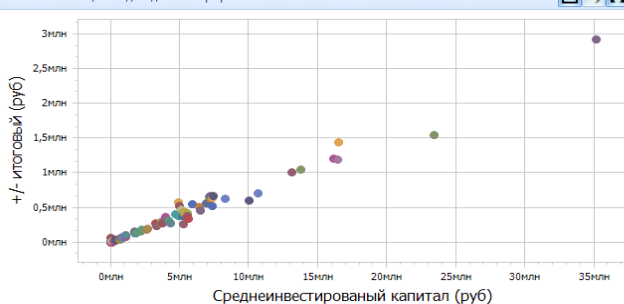


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

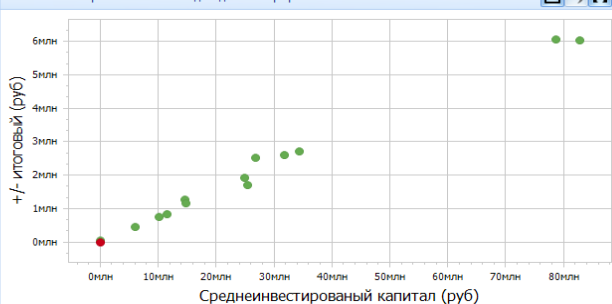


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

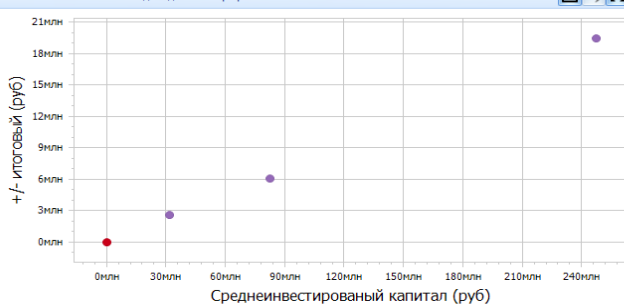
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



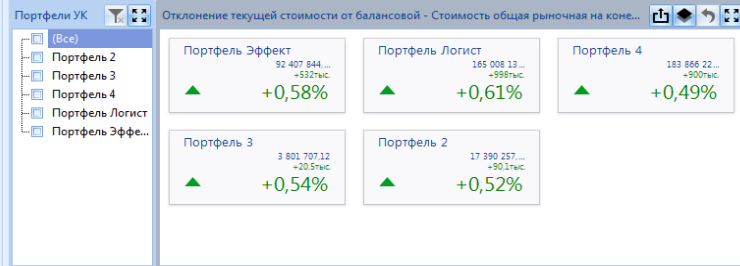
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



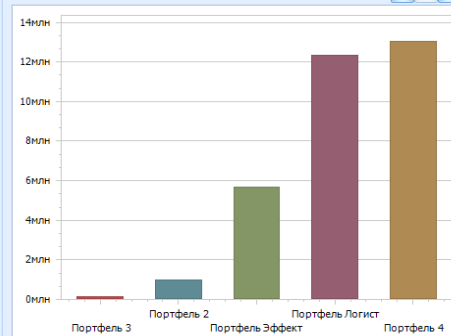
Мониторинг портфелей



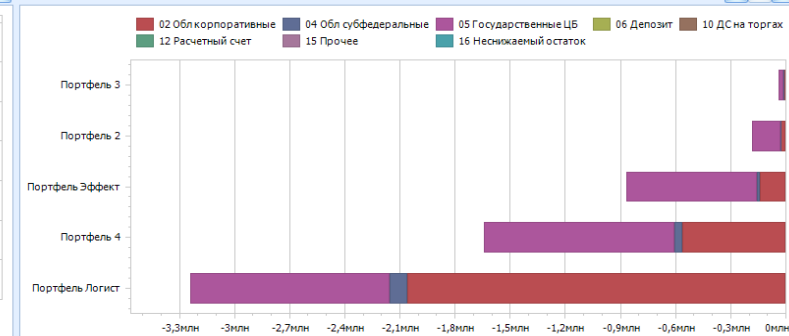
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей

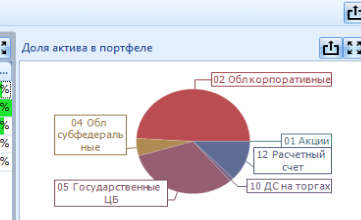


Портфели Фонда

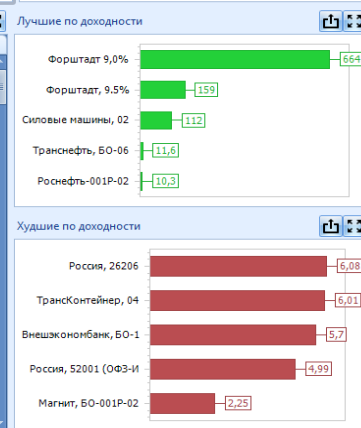
Фильтр портфелей

Портфели

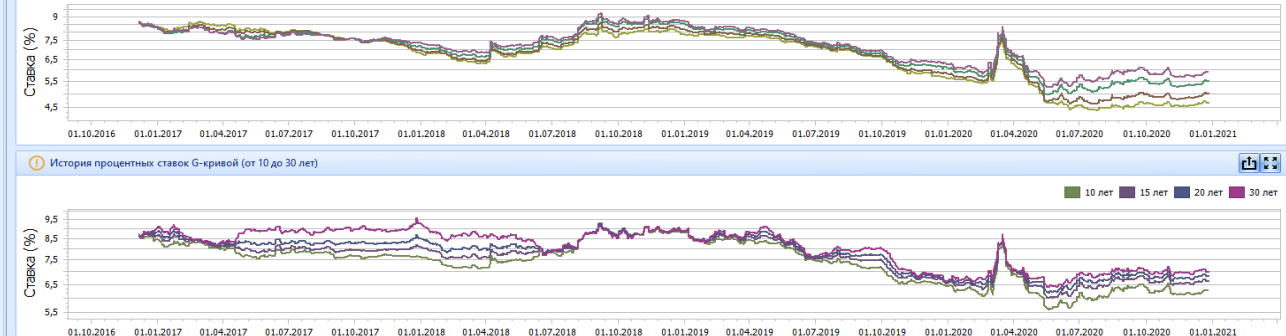
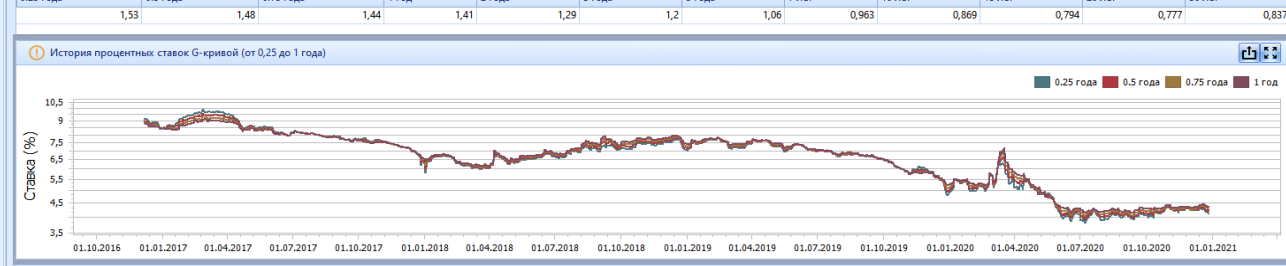
Портфель	Балансовая...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 P	→	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 P	7,13%
Портфель ...	164 010 128...	165 008 133,27 P	↑	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 P	8,11%
Портфель 4	182 966 659...	183 866 220,21 P	→	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 P	7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 P	3 801 707,12 P	→	0,00	132 119,65 P	152 649,14 P	5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 P	→	0,00	905 372,19 P	995 511,72 P	6,78%



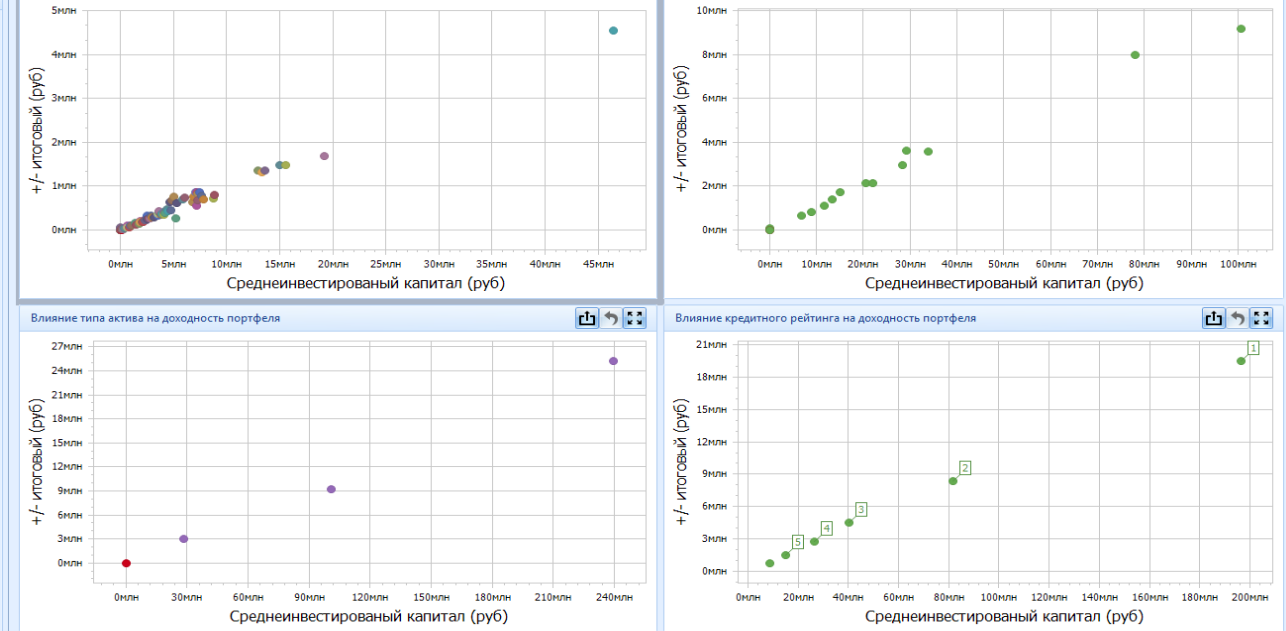
Позиции								
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-13 416,00	0,00	→
	Трансконтейнер, ...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	6,01%	30 123,64	501 544,45	→
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	РСКБ 7	02 Обл корпора...	Банки	400	7,22%	46 338,92	641 943,21	→
	Ростелеком-1-боб		Связь	0	7,06%	30 927,09	437 865,61	→
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государствен...	Государственные ...	2 886	8,17%	94 982,61	1 162 561,17	→
	Россия-ОФЗ-2401...			0	6,65%	154 850,26	2 326 879,59	→
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→
	ОФЗ 29012	05 Государствен...	Государственные ...	1 243	7,11%	5 270,32	74 110,54	→
	ОФЗ 24019			2 750	7,13%	14 025,00	196 600,39	→
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	0	6,51%	53 336,80	819 183,44	→
	МТС, 7		Связь	880	6,32%	11 820,18	186 886,24	→
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпора...		736	7,25%	53 661,76	740 485,50	→
	Магнит, БО-001P...		Торговля	100	7,49%	4 464,09	59 580,08	→
	Магнит, БО-001P...			0	6,79%	25 203,99	371 074,25	→
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	7,15%	31 365,00	438 711,52	→
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	Комиссия Депоз...			0	0,00%	-4 528,25	0,00	→
	ГТЛК-7-боб	02 Обл корпора...	Финансовые ком...	501	8,79%	44 183,19	502 404,42	→
Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	7,49%	32 004,41	427 308,36	→	



История изменения процентных ставок G-кривой



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

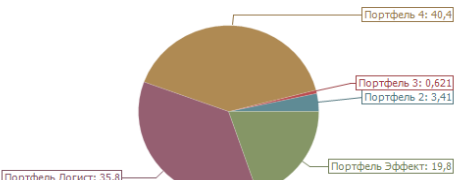
Монитор руководителя

Портфели УК

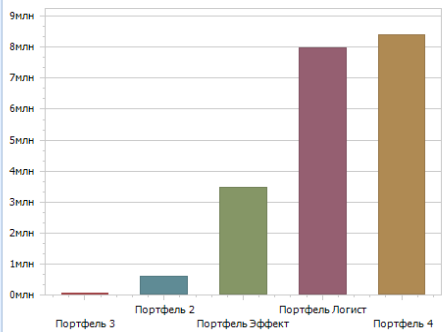
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффект...



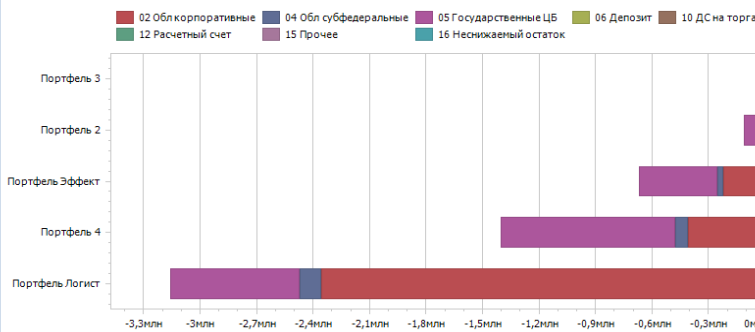
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дорации)



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

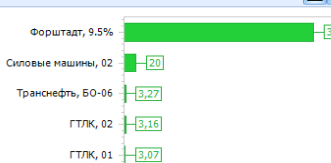
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	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%

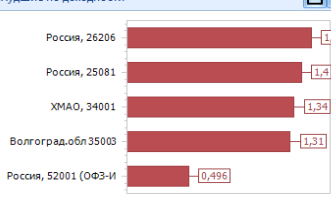
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности

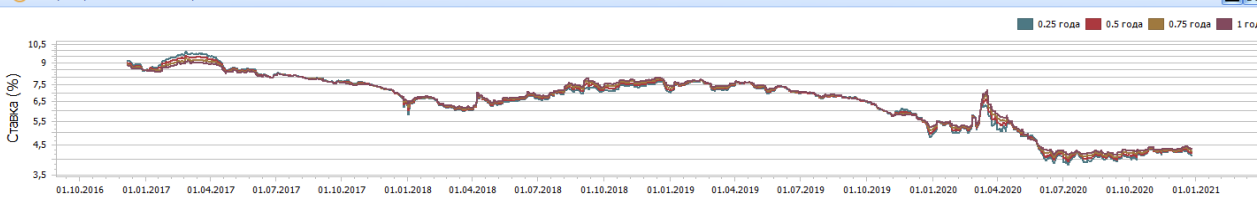


История изменения процентных ставок G-кривой

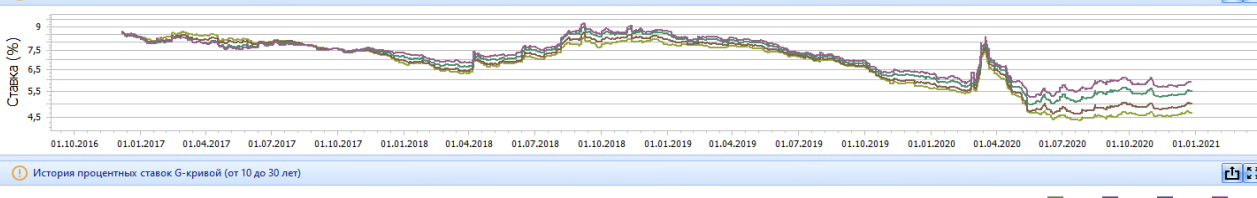
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

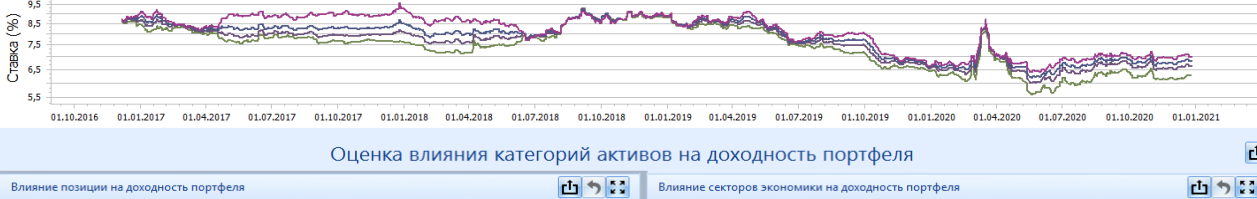
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

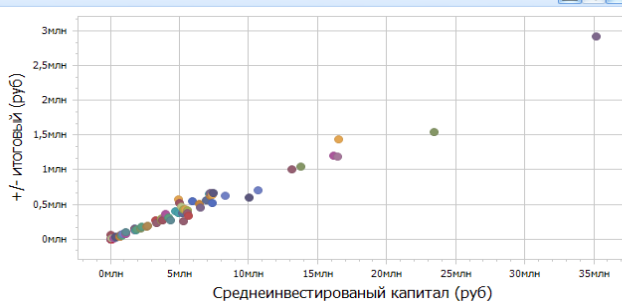


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

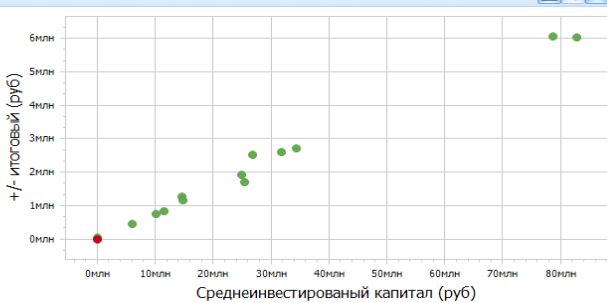


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

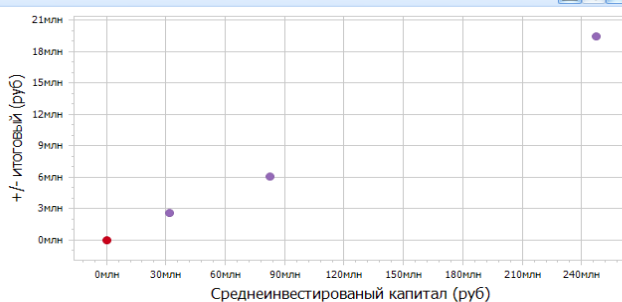
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Доля портфелей

Портфель	Доля
Портфель 4	40
Портфель 3	0,819
Портфель 2	3,74
Портфель Эффект	19,9
Портфель Логист	35,6

04 Obl subfederalnye 05 Государственные ЦБ 06 Депозит 10 ДС на торгах
15 Прочее 16 Несоклаемый остаток

Category	Amount (млн)
04 Obl subfederalnye	-1,5
05 Государственные ЦБ	-0,6
06 Депозит	-0,3
10 ДС на торгах	-0,3
15 Прочее	-0,1
16 Несоклаемый остаток	-0,1

Доля актива в портфеле

Код	Наименование
02	Обл корпоративные
01	Акции
12	Расчетный счет
10	ДС на торгах
05	Государственные ЦБ
04	Обл субфедеральные

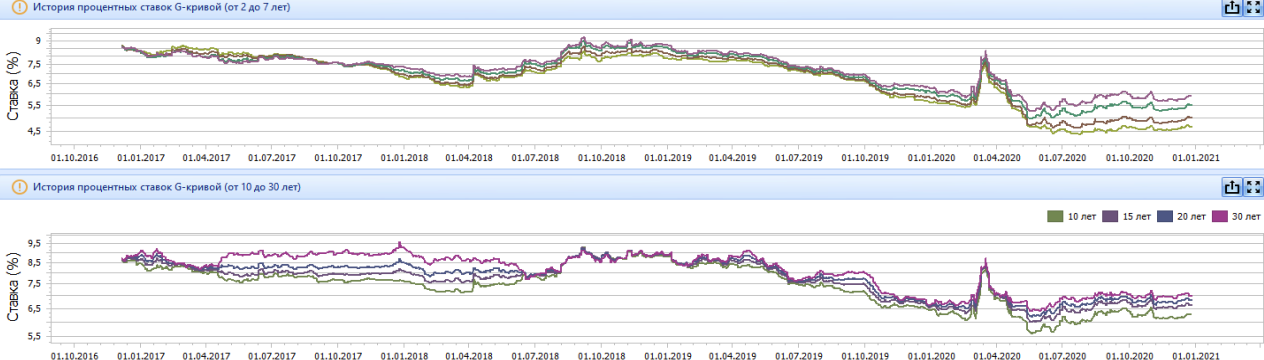
Лучшие по доходности

Фонд	Доходность	Количество
Форштадт	9,0%	664
Форштадт	9,5%	159
Силовые машины, 02		112
Транснефть, БО-06	11,6	
Роснефть-001P-02	10,3	

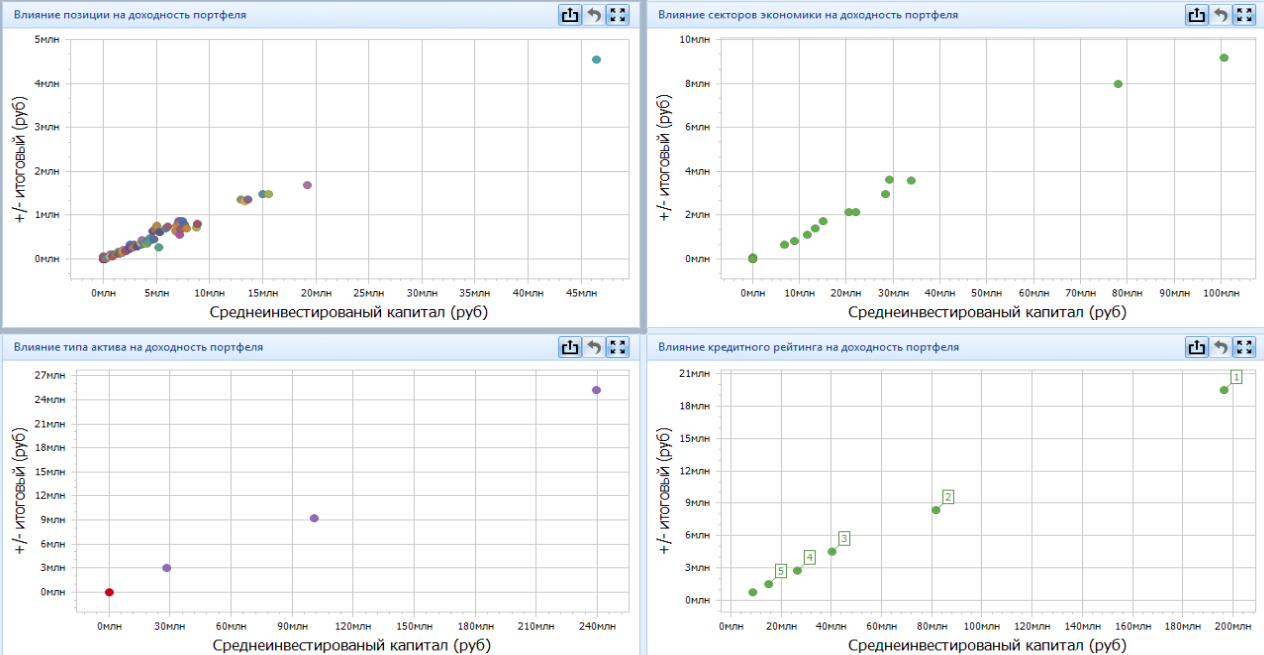
Худшие по доходности

Фонд	Доходность	Количество
Россия, 26206	6,08	
ТрансКонтейнер, 04	6,01	
Внешэкономбанк, БО-1	5,7	
Россия, S2001 (ОФЗ-И	4,99	
Магнит, БО-001P-02	2,25	

↑



0



Мониторинг портфелей

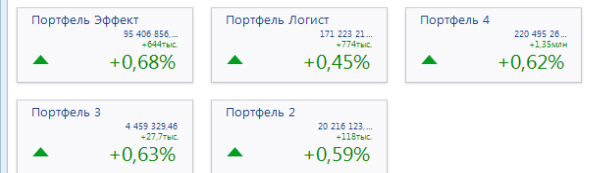


Монитор руководителя

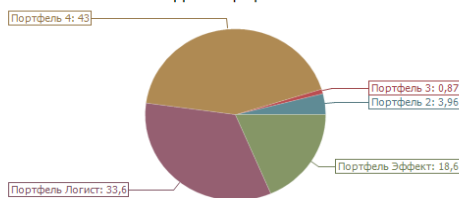
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект...

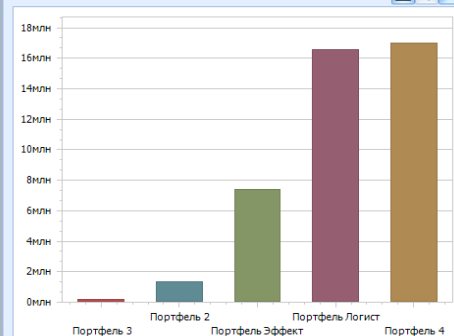
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на коне...



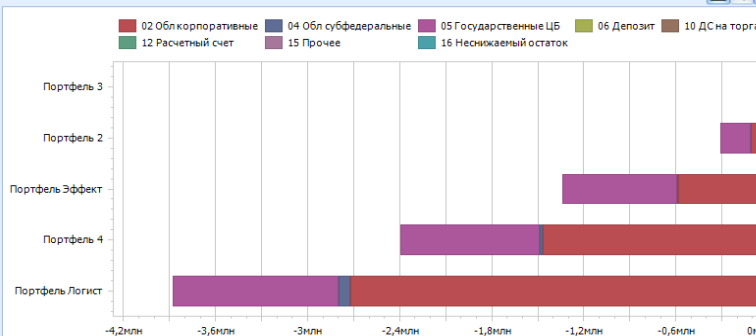
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

Категория актива

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

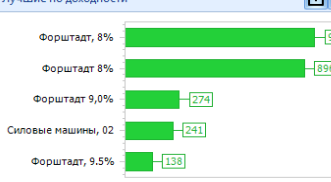
Позиции

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	→
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпор...	Транспорт	1 083	8,20%	35 766,07	436 214,32	→
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	РСКБ 9		Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	↑
	РСКБ 7	02 Обл корпор...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	→
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	→
	Россия-ОФЗ-2901...		Государственные ...	2 886	9,62%	155 704,05	1 618 888,91	↑
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...		0	9,11%	154 850,26	1 699 553,44	→
	Роснефть67	02 Обл корпор...	Нефтегазовая отр...	1 552	7,40%	16 011,58	216 297,87	↓
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→
	ОФЗ 29012		Государственные ...	2 362	8,72%	59 312,51	679 955,04	↑
	ОФЗ 24019	05 Государствен...		3 230	7,63%	65 916,32	863 771,39	↑
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфедер...	Административные	0	8,91%	53 336,80	598 629,71	→
	МТС_7			0	8,47%	20 452,98	241 595,84	→
Портфель 3	МегаФон-БО-05	02 Обл корпор...	Связь	0	9,23%	54 611,20	591 358,34	→
	Магнит, БО-001Р...		Торговля	0	9,07%	6 196,29	68 279,99	→
	Магнит, БО-001Р...			0	9,30%	25 203,99	270 903,91	→
	Краснодарский к...	04 Обл субфедер...	Административные	0	9,55%	35 820,00	374 976,00	→
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	→
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-6 656,27	0,00	→
				0	0,00%	-6 656,27	0,00	→

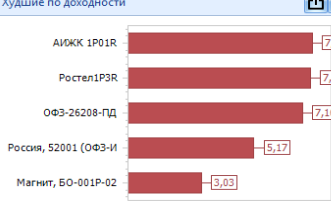
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



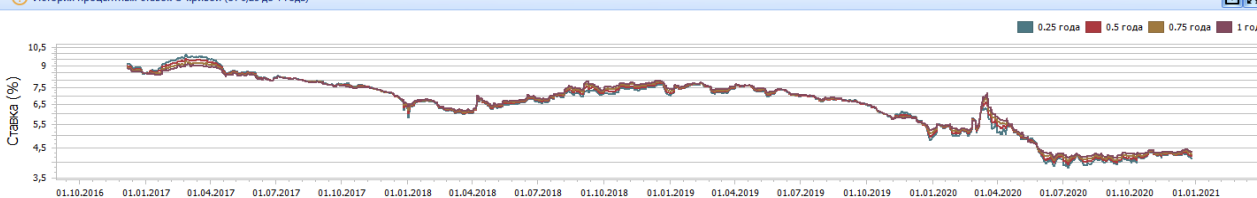
История изменения процентных ставок G-кривой



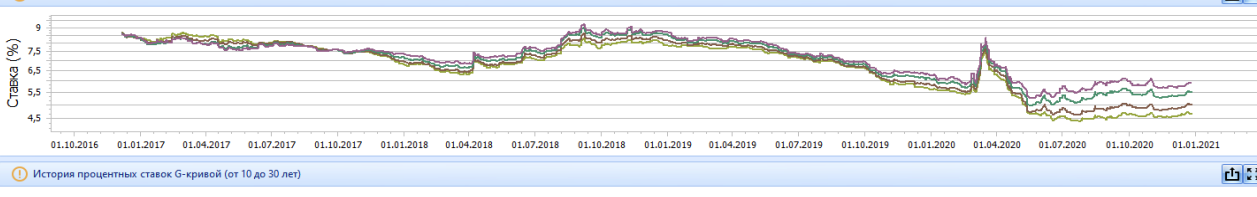
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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)



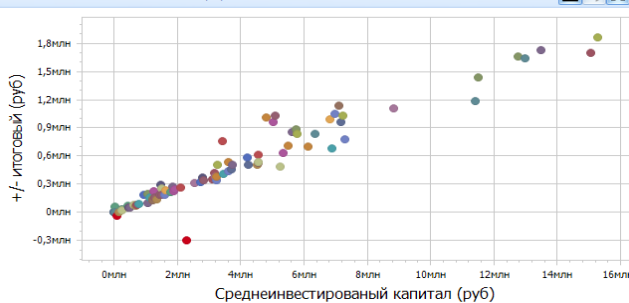
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



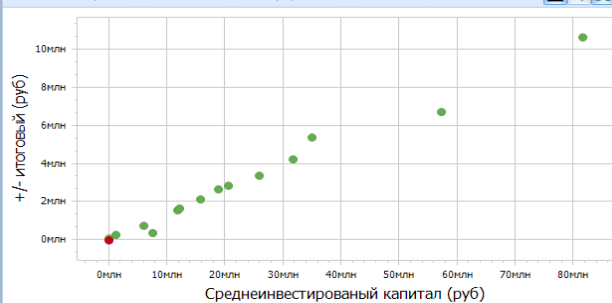
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



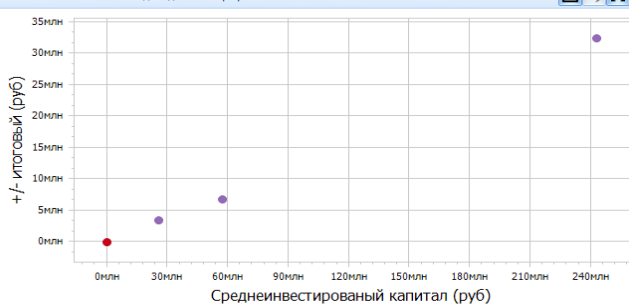
Влияние позиции на доходность портфеля



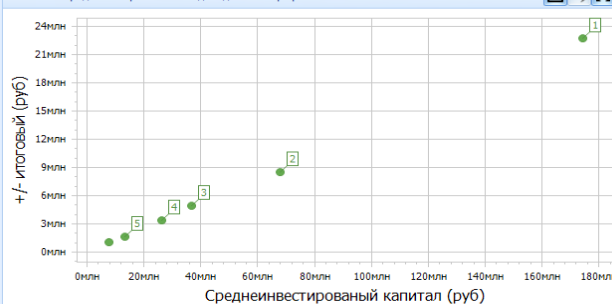
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

Портфели УК

(Все)

- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

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

Портфель Эффект

74 489 213
+482тыс

▲ +0,65%

Портфель Логист

158 001 771
+392тыс

▲ +0,63%

Портфель 4

179 805 481
+1,23млн

▲ +0,69%

Портфель 3

2 474 021,82
+14тыс

▲ +0,57%

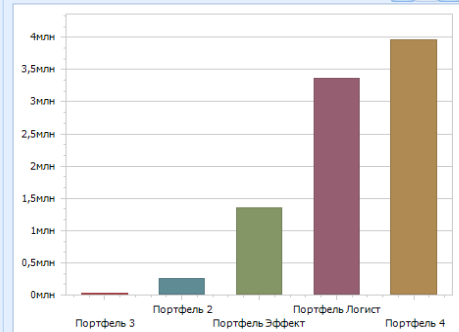
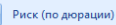
Портфель 2

14 632 011
+92,8тыс

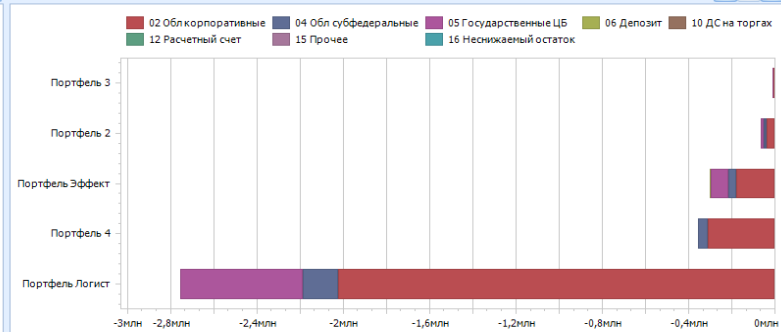
▲ +0,64%



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

(Все)

- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4

Категория актива

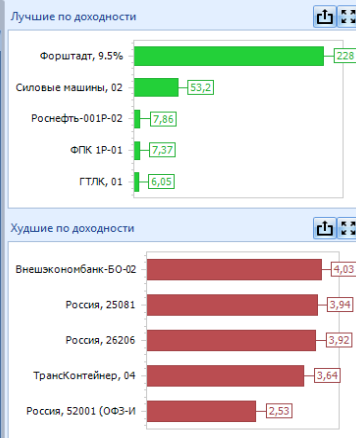
(Все)

- ☒ 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%



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



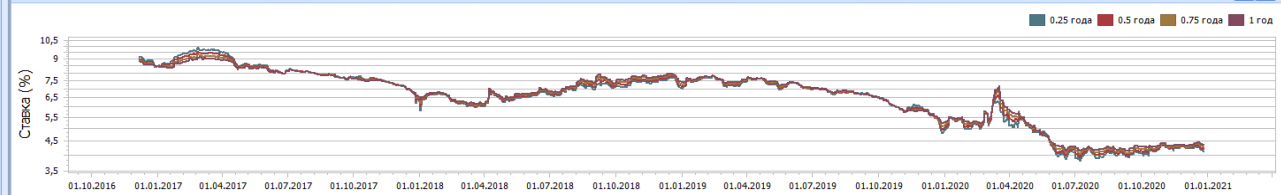
История изменения процентных ставок G-кривой



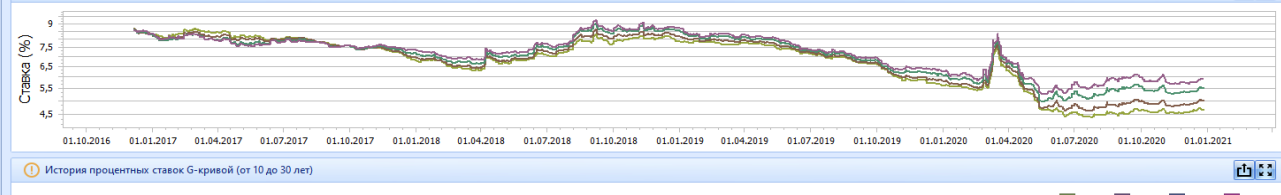
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

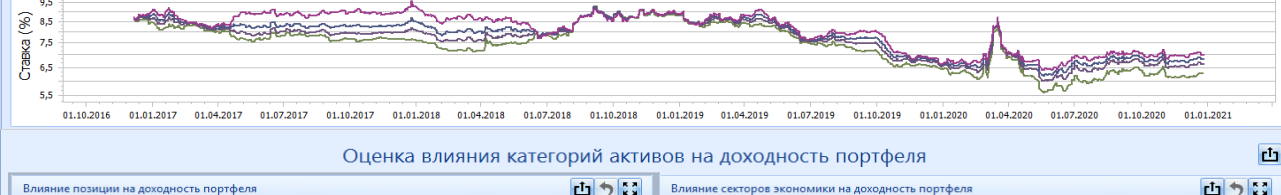
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



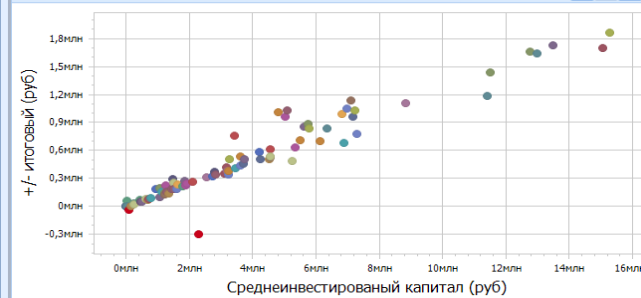
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



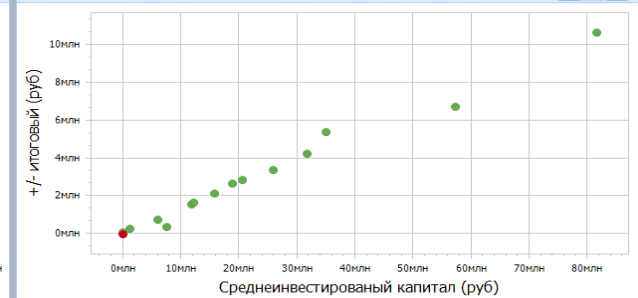
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Влияние позиции на доходность портфеля



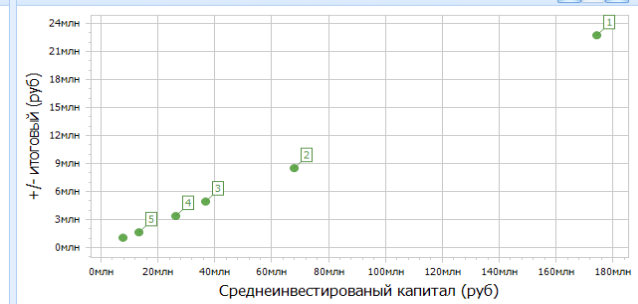
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



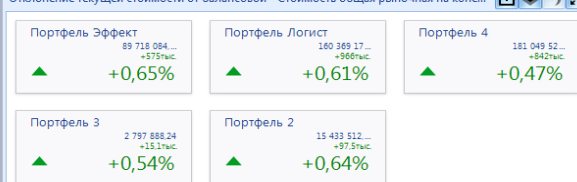
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

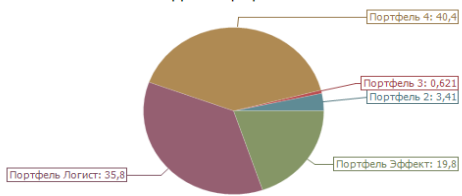
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

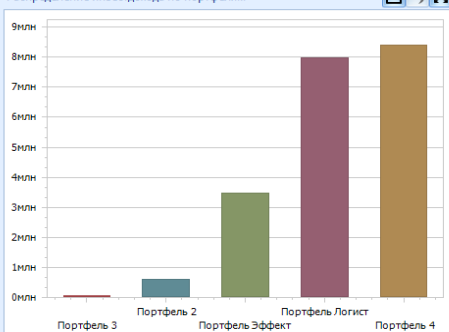
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конец...



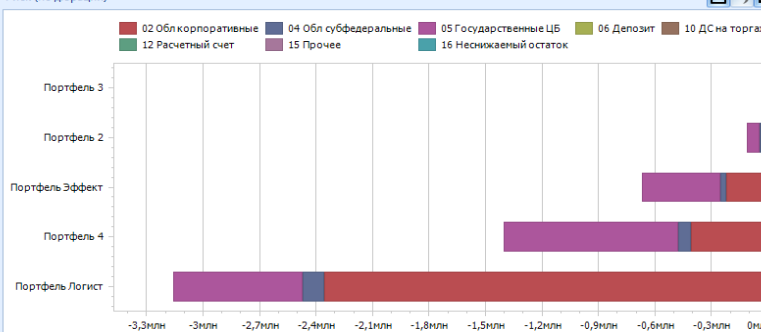
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по диверсии)



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

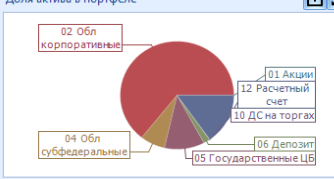
Категория актива

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

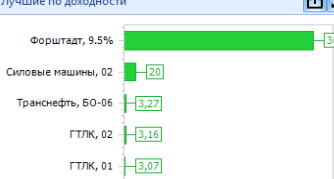
Позиции

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

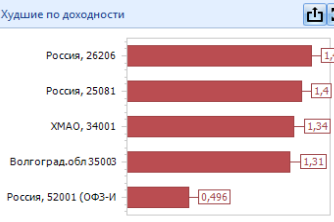
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности

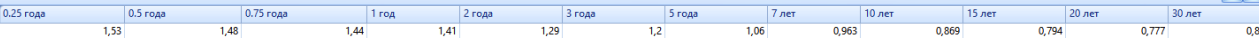


Худшие по доходности

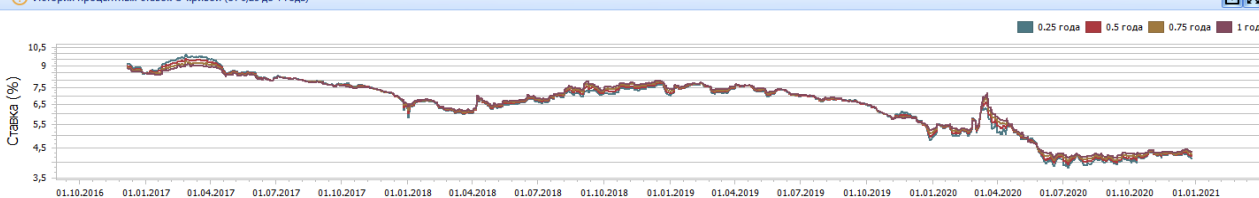


История изменения процентных ставок G-кривой

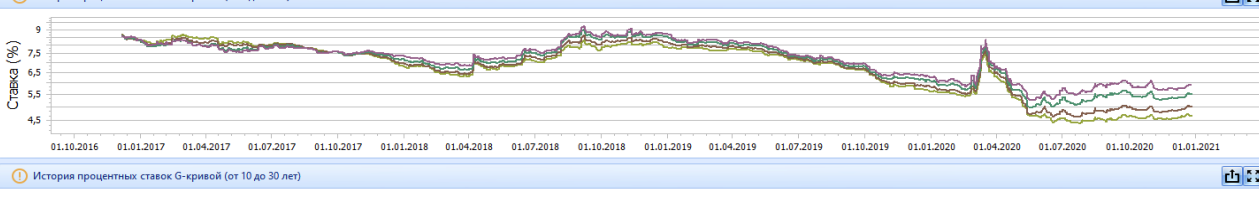
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



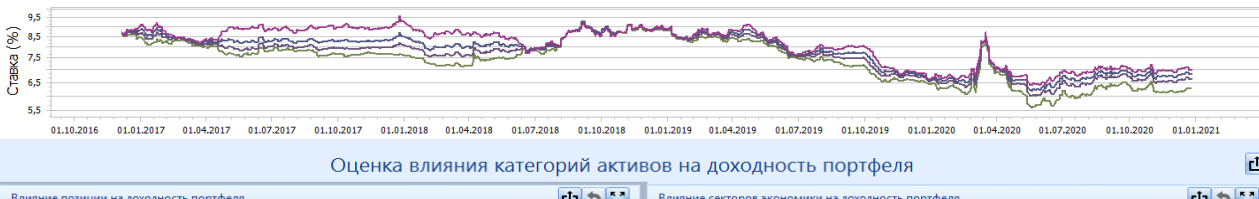
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

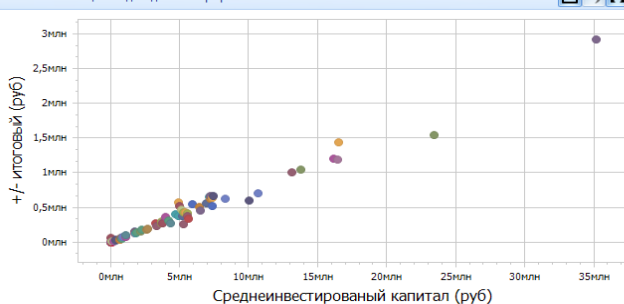


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

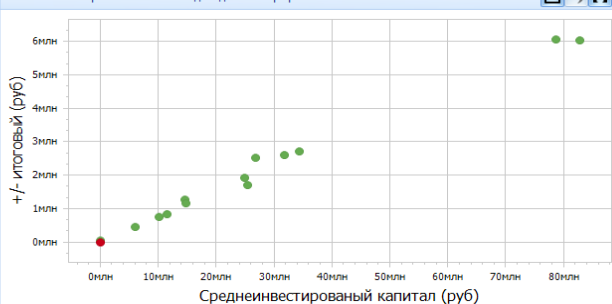


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

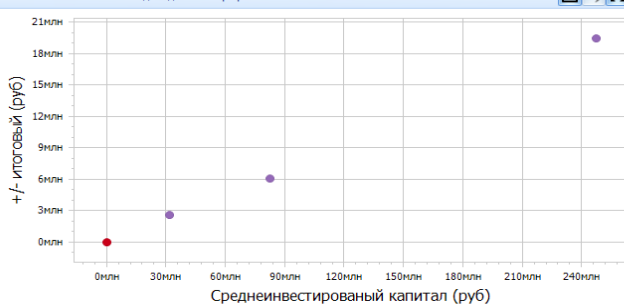
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



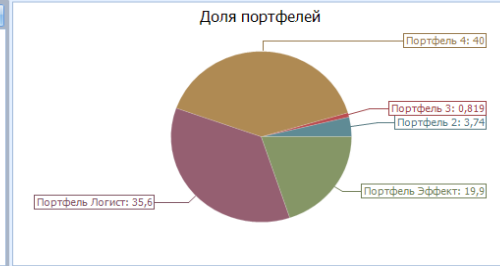
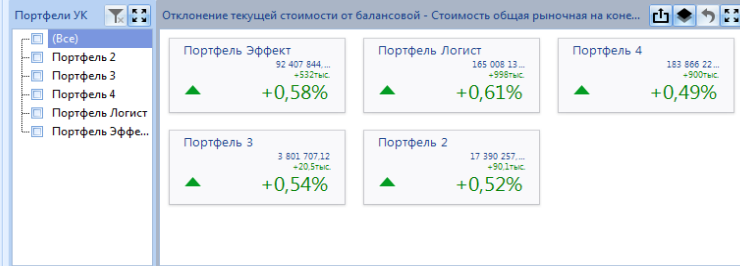
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



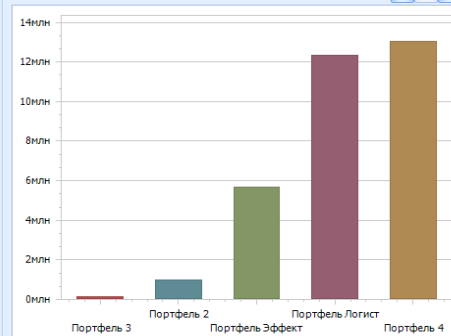
Мониторинг портфелей



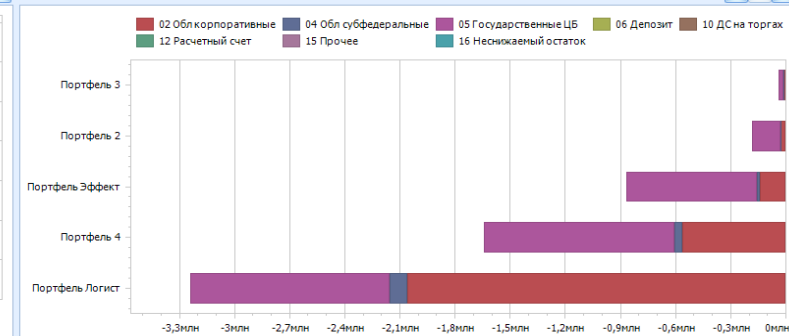
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

(Все)

Портфель 2

Портфель 3

Портфель 4

Категория актива

(Все)

01 Акции

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

Портфели

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 Р	→	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 Р	7,13%
Портфель ...	164 010 128,...	165 008 133,27 Р	↑	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 Р	8,11%
Портфель 4	182 966 659,...	183 866 220,21 Р	→	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 Р	7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 Р	3 801 707,12 Р	→	0,00	132 119,65 Р	152 649,14 Р	5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 Р	→	0,00	905 372,19 Р	995 511,72 Р	6,78%

Доля актива в портфеле

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

05 Государственные ЦБ

12 Расчетный счет

10 ДС на торгах

Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-13 416,00	0,00	→
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпоративные	Транспорт	1 083	6,01%	30 123,64	501 544,45	→
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	РСКБ 7	02 Обл корпоративные	Банки	400	7,22%	46 338,92	641 943,21	→
	Ростелеком-1-боб	02 Обл корпоративные	Связь	0	7,06%	30 927,09	437 865,61	→
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государственные ЦБ	Государственные ...	2 886	8,17%	94 982,61	1 162 561,17	→
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государственные ЦБ	Государственные ...	0	6,65%	154 850,26	2 326 879,59	→
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→
	ОФЗ 29012	05 Государственные ЦБ	Государственные ...	1 243	7,11%	5 270,32	74 110,54	→
	ОФЗ 24019	05 Государственные ЦБ	Государственные ...	2 750	7,13%	14 025,00	196 600,39	→
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфедеральные	Административные	0	6,51%	53 336,80	819 183,44	→
	МТС, 7	02 Обл корпоративные	Связь	880	6,32%	11 820,18	186 886,24	→
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпоративные	Связь	736	7,25%	53 661,76	740 485,50	→
	Магнит, БО-001Р...	04 Обл субфедеральные	Торговля	100	7,49%	4 464,09	59 580,08	→
Магнит, БО-001Р...	04 Обл субфедеральные	Торговля	0	6,79%	25 203,99	371 074,25	→	
Краснодарский к...	04 Обл субфедеральные	Административные	4 500	7,15%	31 365,00	438 711,52	→	
Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→	
Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-4 528,25	0,00	→	
ГТЛК-7-боб	02 Обл корпоративные	Финансовые ком...	501	8,79%	44 183,19	502 404,42	→	
Газпром нефть-4...	02 Обл корпоративные	Нефтехимическая...	551	7,49%	32 004,41	427 308,36	→	

Лучшие по доходности

Форштадт 9,0%

Форштадт, 9,5%

Силовые машины, 02

Транснефть, БО-06

Роснефть-001Р-02

Худшие по доходности

Россия, 26206

ТрансКонтейнер, 04

Внешэкономбанк, БО-1

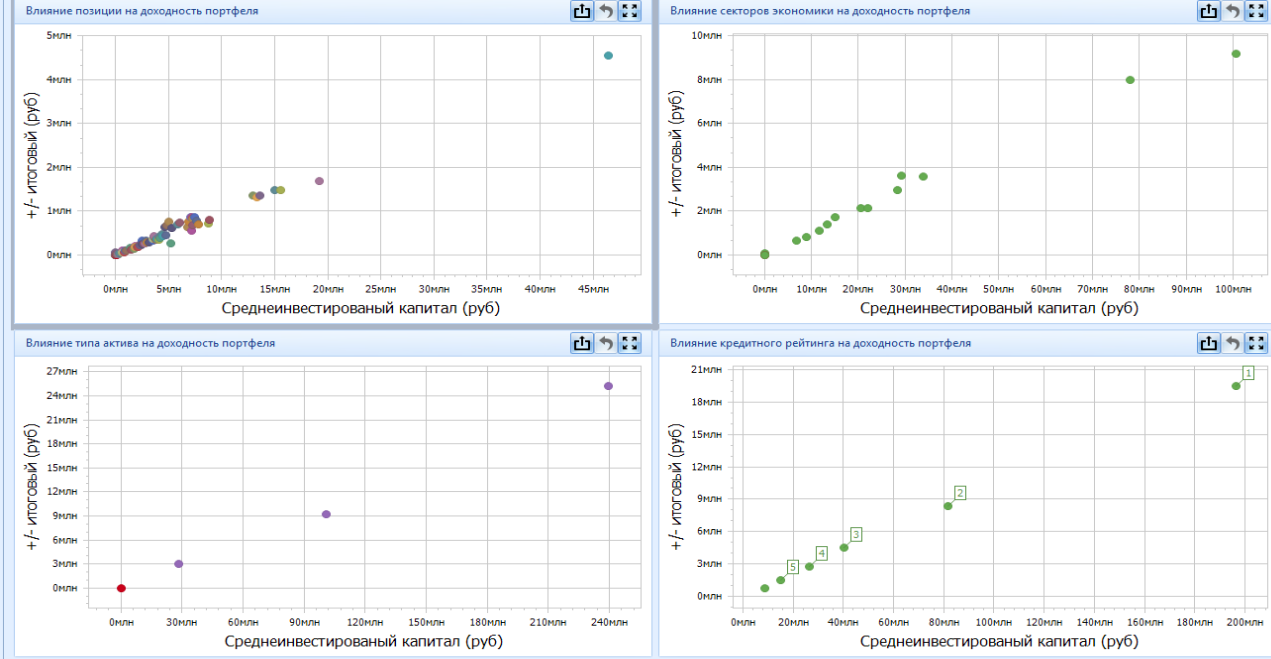
Россия, 52001 (ОФЗ-И

Магнит, БО-001Р-02

История изменения процентных ставок G-кривой



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

Портфели УК

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

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

Портфель Эффект
89 718 064...
+575%
+0,65%

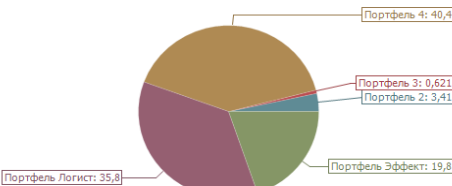
Портфель Логист
160 369 17...
+942%
+0,61%

Портфель 4
181 049 52...
+842%
+0,47%

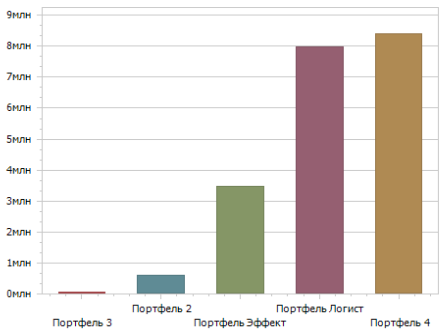
Портфель 3
2 797 888 24...
+151%
+0,54%

Портфель 2
15 493 512...
+975%
+0,64%

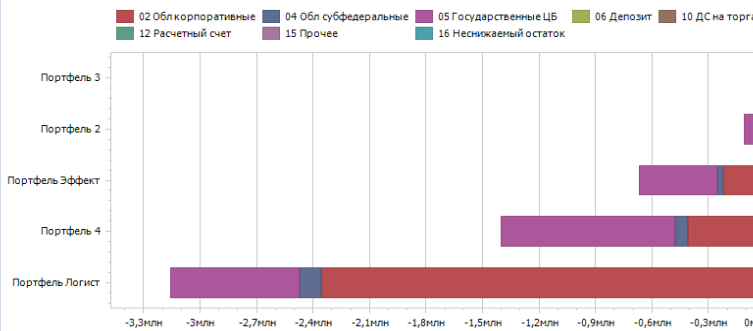
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дорации)



Монитор портфелей

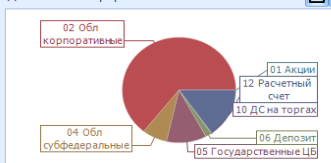
Портфели Фонда

Фильтр портфелей

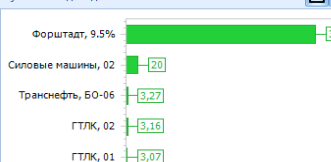
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	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%

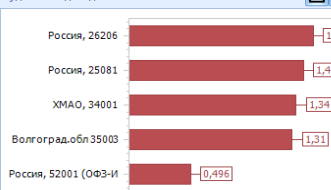
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



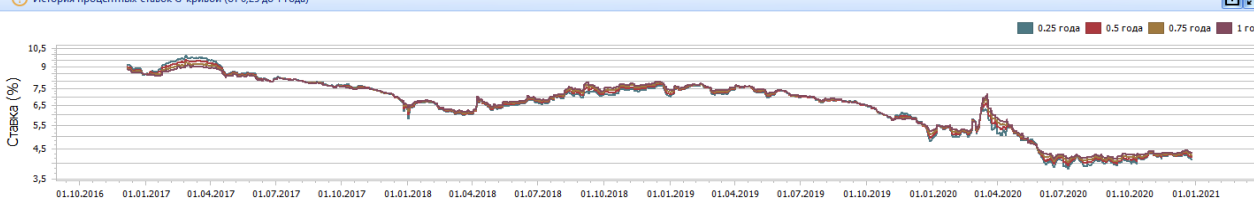
Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-3 236,00	0,00	0,00
	ТрансКонтейнер...	02 Обл корпор...	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	0,00
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	РСКБ 7	02 Обл корпор...	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	0,00
	Ростелеком-1-606	02 Обл корпор...	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 корпор...	Связь	736	2,07%	15 853,44	765 057,28	0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпор...	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-7-606	02 Обл корпор...	Финансовые ком...	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпор...	Нефтехимическая...	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	0,00
	Газпром Капитал...	02 Обл корпор...	Финансовые ком...	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	0,00
	ВЭБ 09	02 Обл корпор...	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
	Вознагр УК2	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Вертолеты2	02 Обл корпор...	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	0,00
	Вертолеты Росси...	02 Обл корпор...	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	0,00

История изменения процентных ставок G-кривой

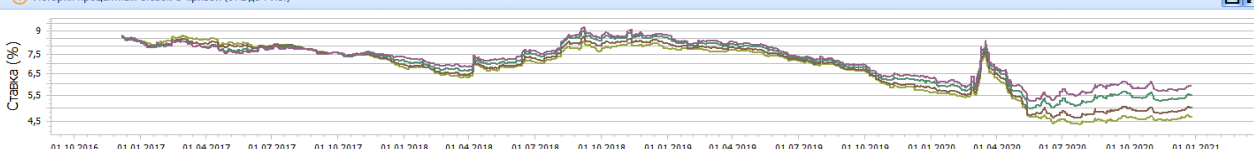
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

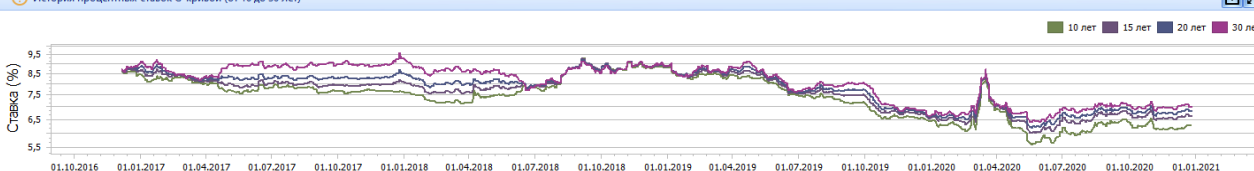
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

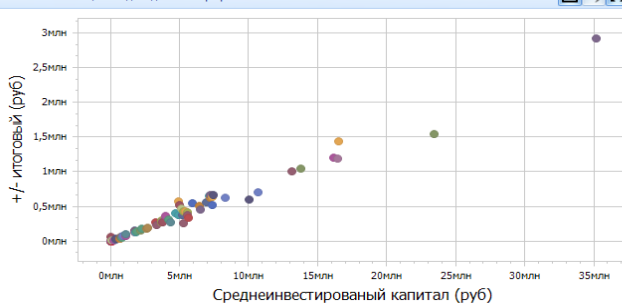


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

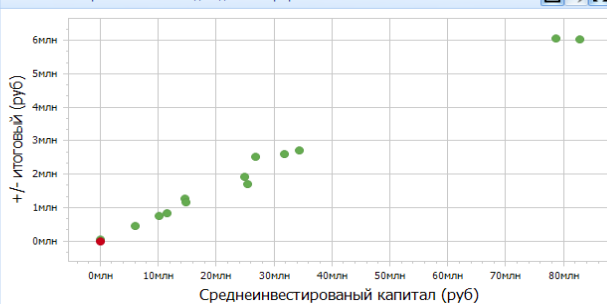


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

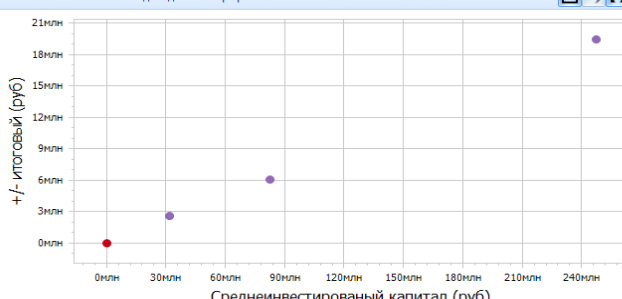
Влияние позиции на доходность портфеля



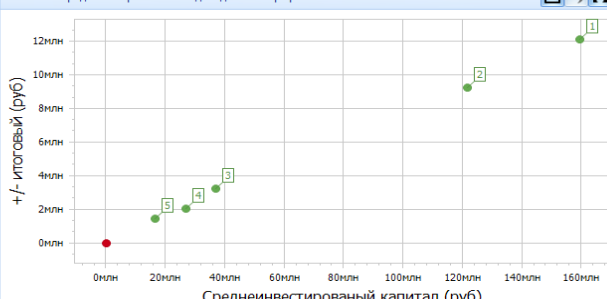
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



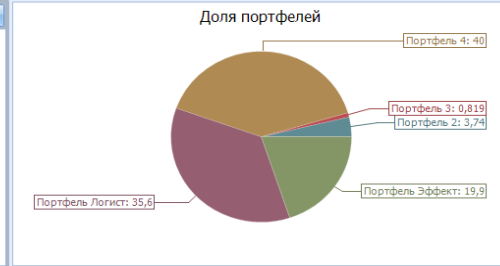
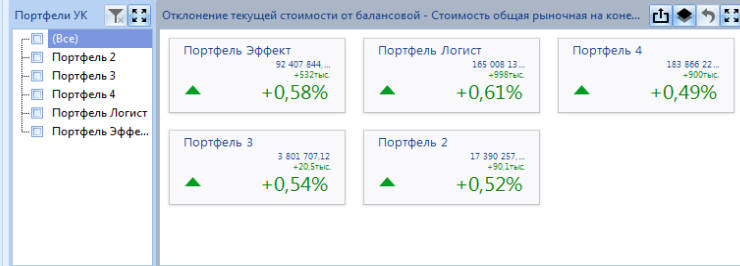
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



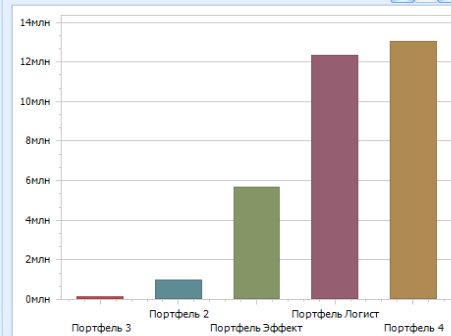
Мониторинг портфелей



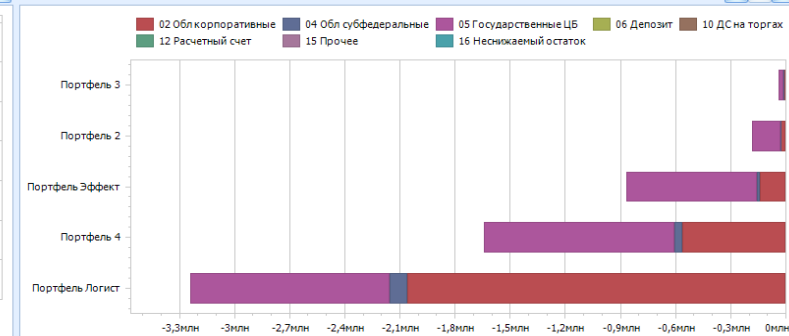
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

(Все)

Портфель 2

Портфель 3

Портфель 4

Категория актива

(Все)

01 Акции

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

Позиции

Портфель

Актив

Тип актива

Сектор экономики

Количество ...

Доходнос...

+/- итоговый

СИК

+/- не реали...

Портфель ...

услуги банка

15 Прочее

0

0,00%

-13 416,00

0,00

→

0,00

Трансконтейнер, ...

02 Обл корпоративные

Транспорт

1 083

6,01%

30 123,64

501 544,45

→

0,00

СпецДеп

15 Прочее

0

0,00%

0,00

0,00

→

0,00

РСКБ 7

02 Обл корпоративные

Банки

400

7,22%

46 338,92

641 943,21

→

0,00

Ростелеком-1-боб

02 Обл корпоративные

Связь

0

7,06%

30 927,09

437 865,61

→

0,00

Россия-ОФЗ-2901...

05 Государственные ЦБ

Государственные ...

2 886

8,17%

94 982,61

1 162 561,17

→

0,00

Россия-ОФЗ-2401...

05 Государственные ЦБ

Государственные ...

0

6,65%

154 850,26

2 326 879,59

→

0,00

Прочие расходы

15 Прочее

0

0,00%

-4 000,00

0,00

→

0,00

ОФЗ 29012

05 Государственные ЦБ

Государственные ...

1 243

7,11%

5 270,32

74 110,54

→

0,00

ОФЗ 24019

05 Государственные ЦБ

Государственные ...

2 750

7,13%

14 025,00

196 600,39

→

0,00

Оплата Страховки

15 Прочее

0

0,00%

-358,91

0,00

→

0,00

Нижегород.обл. ...

04 Обл субфедеральные

Административные

0

6,51%

53 336,80

819 183,44

→

0,00

МТС, 7

02 Обл корпоративные

Связь

880

6,32%

11 820,18

186 886,24

→

0,00

МегаФон-БО-05

02 Обл корпоративные

Связь

736

7,25%

53 661,76

740 485,50

→

0,00

Магнит, БО-001Р...

04 Обл субфедеральные

Торговля

100

7,49%

4 464,09

59 580,08

→

0,00

Магнит, БО-001Р...

04 Обл субфедеральные

Торговля

0

6,79%

25 203,99

371 074,25

→

0,00

Краснодарский к...

04 Обл субфедеральные

Административные

4 500

7,15%

31 365,00

438 711,52

→

0,00

Комиссия Фонда

15 Прочее

0

0,00%

0,00

0,00

→

0,00

Комиссия Депоз...

15 Прочее

0

0,00%

-4 528,25

0,00

→

0,00

ГТЛК-7-боб

02 Обл корпоративные

Финансовые ком...

501

8,79%

44 183,19

502 404,42

→

0,00

Газпром нефть-4...

02 Обл корпоративные

Нефтехимическая...

551

7,49%

32 004,41

427 308,36

→

0,00

Портфели

Портфель

Балансовая ...

Рыночная стоим...

+/- не реали...

+/- реали...

+/- итоговый

СИК

Доходность ...

Портфель ...

91 875 954,7...

92 407 844,33 P

→

0,00

5 156 782...

5 688 672,20 P

79 835 683...

7,13%

Портфель ...

164 010 128...

165 008 133,27 P

↑

28 709,35

11 372 100...

12 370 105,66 P

152 576 716...

8,11%

Портфель 4

182 966 659...

183 866 220,21 P

→

0,00

12 149 522...

13 049 082,83 P

178 679 908...

7,30%

Портфель 3

3 781 177,63 P

3 801 707,12 P

→

0,00

132 119,65 P

152 649,14 P

2 627 000,1...

5,81%

Портфель 2

17 300 117,7...

17 390 257,25 P

→

0,00

905 372,19 P

995 511,72 P

14 651 563...

6,78%

Доля актива в портфеле

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

05 Государственные ЦБ

12 Расчетный счет

10 ДС на торгах

Лучшие по доходности

Форштадт, 9,0%

159

Форштадт, 9,5%

112

Силовые машины, 02

11,6

Транснефть, БО-06

10,3

Роснефть-001Р-02

10,3

Худшие по доходности

Россия, 26206

6,08

ТрансКонтейнер, 04

6,01

Внешэкономбанк, БО-1

5,7

Россия, 52001 (ОФЗ-И

4,99

Магнит, БО-001Р-02

2,25

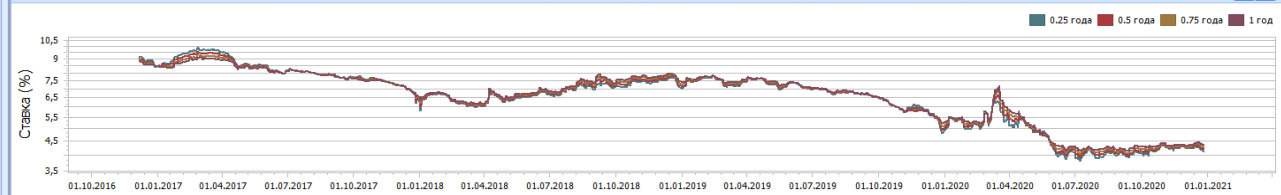
История изменения процентных ставок G-кривой



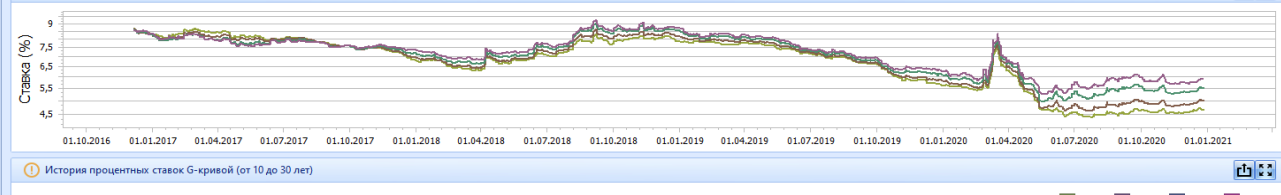
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

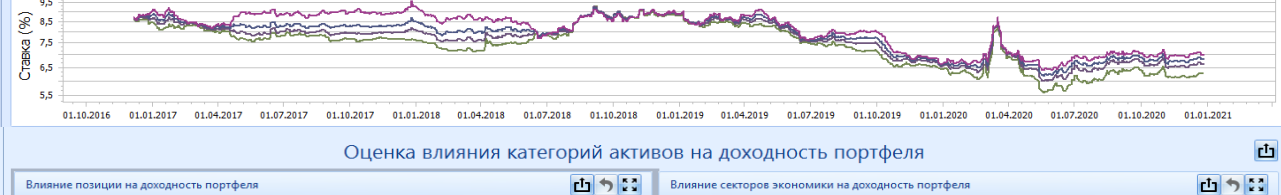
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



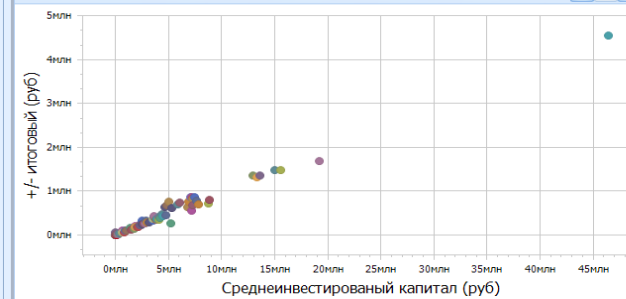
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



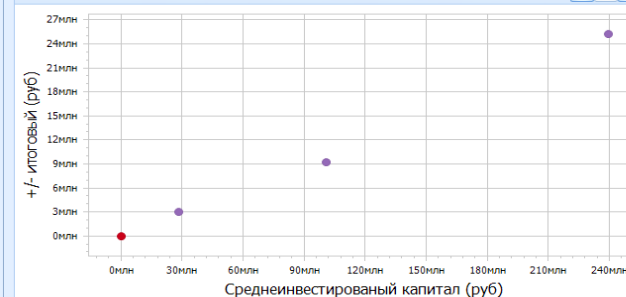
Влияние позиции на доходность портфеля



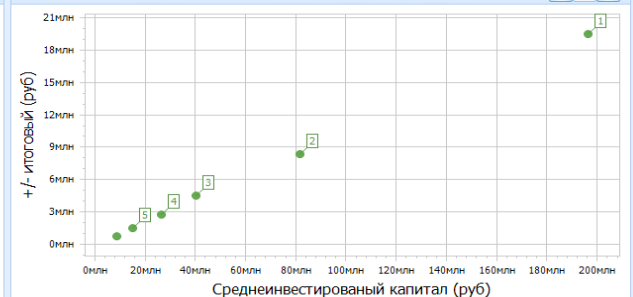
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

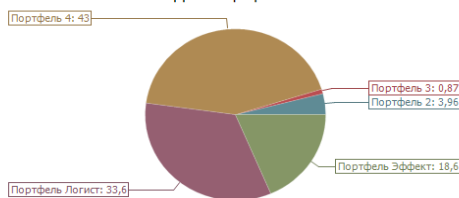
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект...

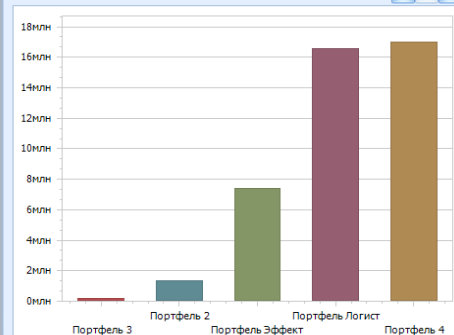
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на коне...



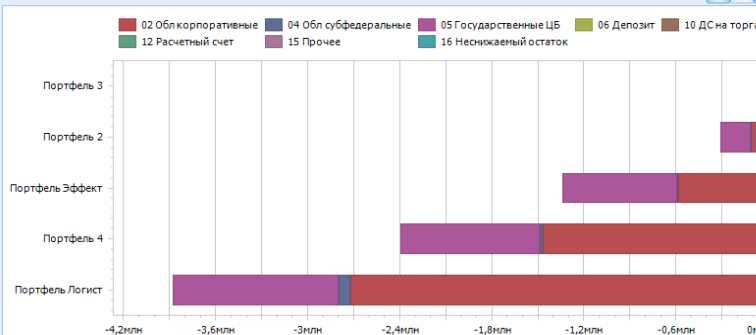
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



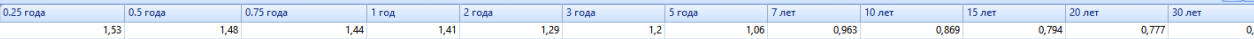
Риск (по дюрации)



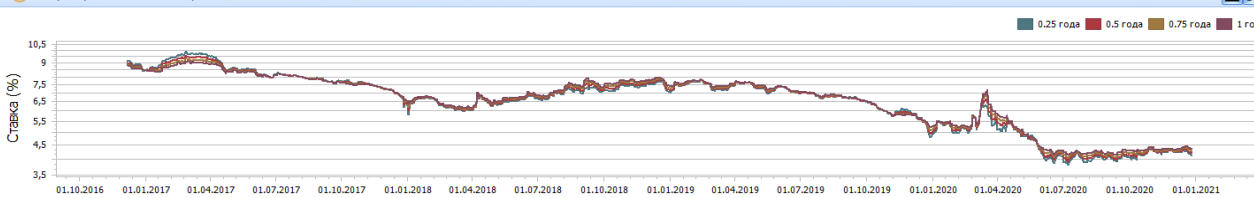
История изменения процентных ставок G-кривой



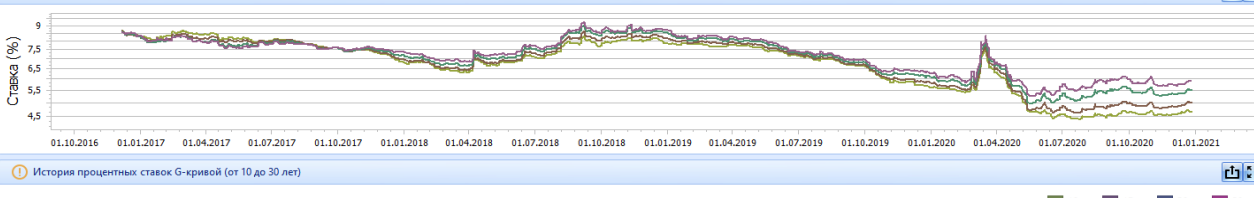
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



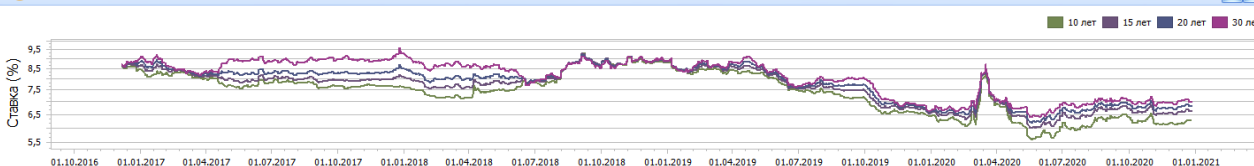
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



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



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

Категория актива

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

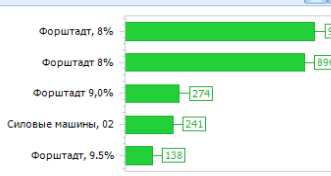
Позиции

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 корпор...	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
	РСКБ 9		Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	↑ 2 183,70
	РСКБ 7	02 Обл корпор...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	→ 0,00
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2901...		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
	Роснефть67	02 Обл корпор...	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		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			0	8,47%	20 452,98	241 595,84	→ 0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	0	9,23%	54 611,20	591 358,34	→ 0,00
	Магнит, БО-001Р...		Торговля	0	9,07%	6 196,29	68 279,99	→ 0,00
	Магнит, БО-001Р...			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			0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-6 656,27	0,00	→ 0,00

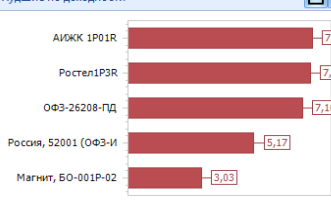
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



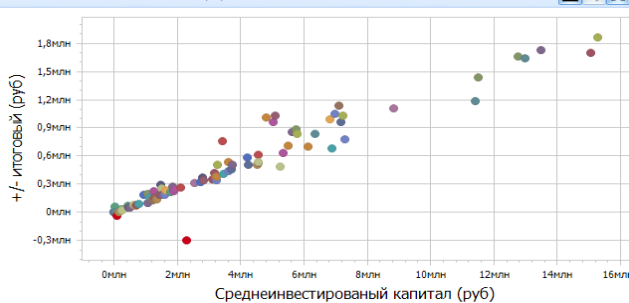
Худшие по доходности



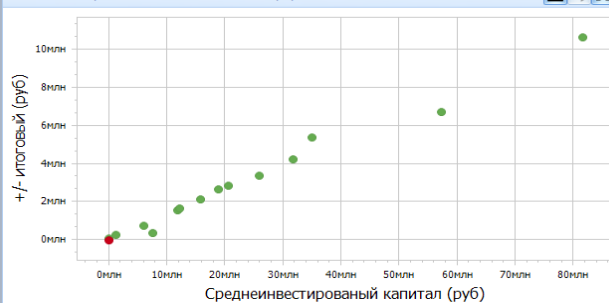
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



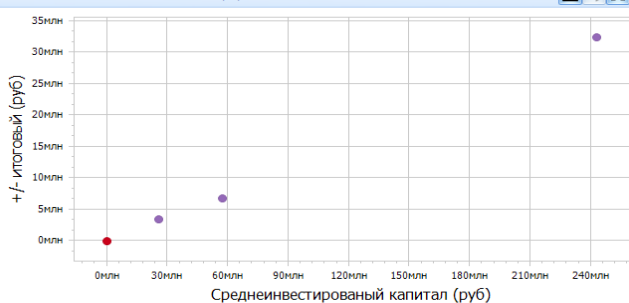
Влияние позиции на доходность портфеля



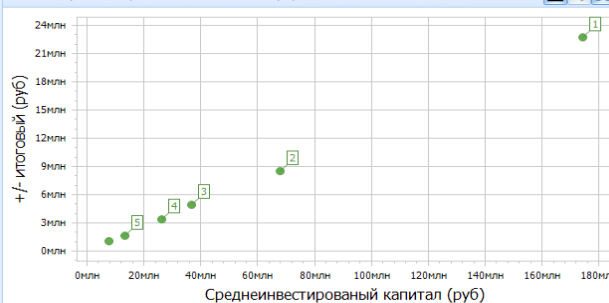
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

Портфель УК

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

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



Портфель Эффект
74 489 213
+852тыс
▲ +0,65%

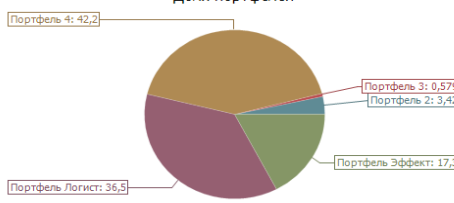
Портфель Логист
136 001 77...
+392тыс
▲ +0,63%

Портфель 4
179 805 48...
+1,23млн
▲ +0,69%

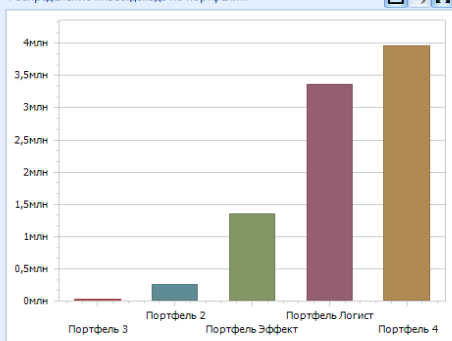
Портфель 3
2 474 021,82
+14тыс
▲ +0,57%

Портфель 2
14 632 011...
+92,8тыс
▲ +0,64%

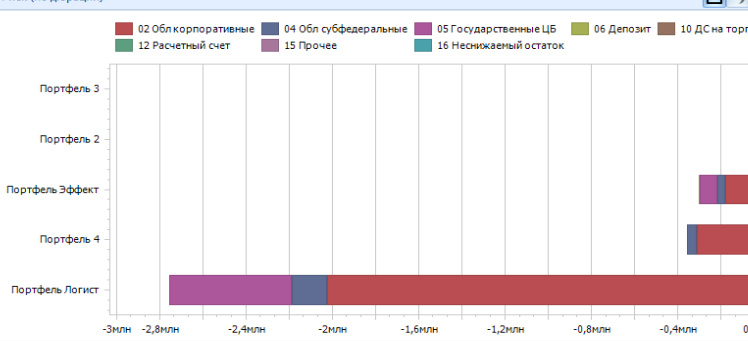
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

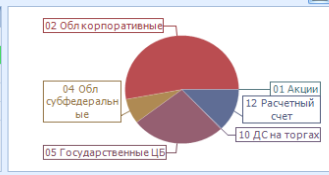
Категория актива

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

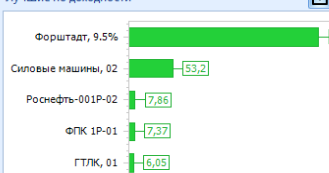
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество	Доходность (MWY)	+/- итогов...	СИК	+/- не...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-8 403,00	0,00	→
	ТрансКонтейнер...	02 Обл корпора...	Транспорт	1 083	3,84%	21 199,72	582 853,81	→
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	РСХБ 7	02 Обл корпора...	Банки	0	4,89%	41 606,08	887 125,31	→
	Ростелеком-1-60б		Связь	0	4,94%	30 927,09	681 531,88	→
	Россия-ОФЗ-2901...			2 486	5,02%	12 180,80	242 563,83	→
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	2 855	4,37%	105 143,41	2 405 507,...	→
	Прочие расходы			0	0,00%	-3 000,00	0,00	→
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-327,54	0,00	→
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	2 299	4,88%	41 404,99	924 001,09	→
	МегаФон-БО-05		Связь	736	4,81%	34 569,92	749 458,07	→
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	→
	Магнит, БО-001Р...			0	4,37%	25 203,99	577 049,37	→
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	5,10%	22 635,00	443 764,83	→
	Комиссия Фонда			0	0,00%	0,00	0,00	→
Портфель 2	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-3 044,62	0,00	→
	ГТЛК-7-60б		Финансовые ком...	501	6,02%	30 821,52	511 733,12	→
	Газпром нефть-4...		Нефтехимическая...	551	5,44%	20 064,24	368 642,68	→
	Газпром нефть, 12	02 Обл корпора...	Нефтегазовая отр...	325	5,07%	7 726,19	152 374,69	→
	Газпром Капитал...		Финансовые ком...	0	4,49%	10 576,02	235 751,54	→
	ВЭБ О9		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	→

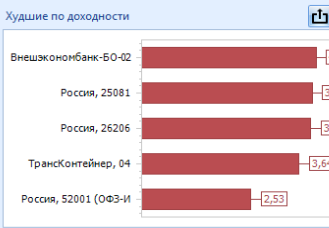
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



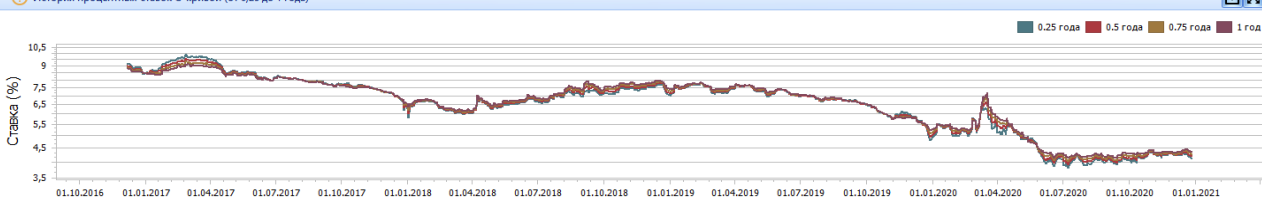
История изменения процентных ставок G-кривой



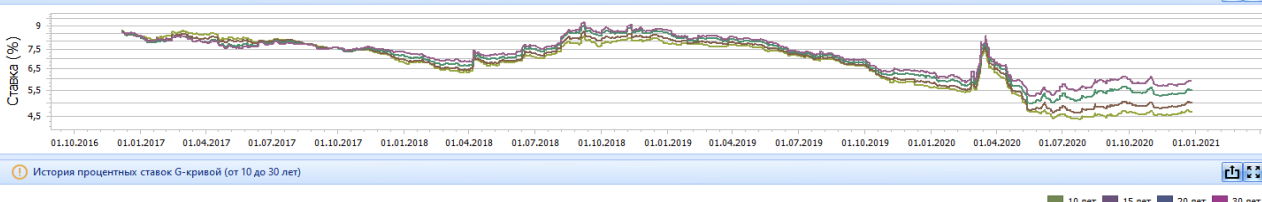
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

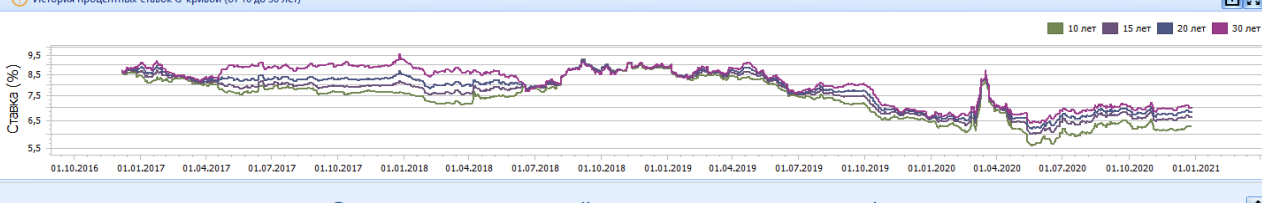
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



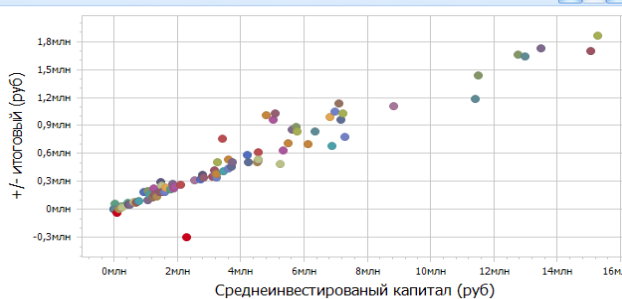
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



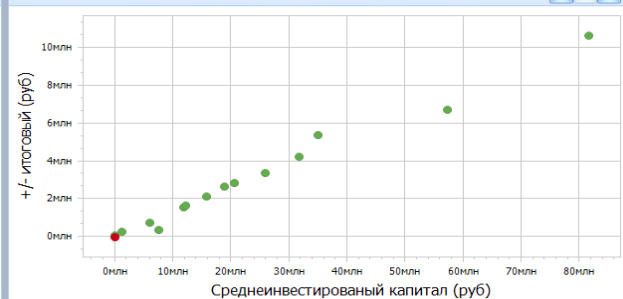
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



Влияние позиции на доходность портфеля



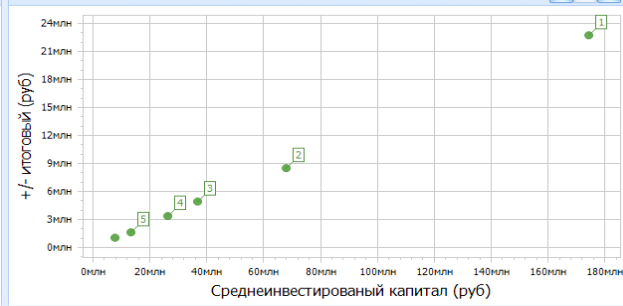
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

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

Портфель Эффект
89 718 084 ...
+375тыс
+0,65%

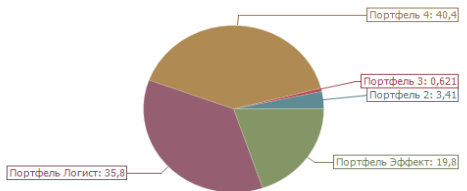
Портфель Логист
180 969 17 ...
+942тыс
+0,61%

Портфель 4
181 049 52 ...
+842тыс
+0,47%

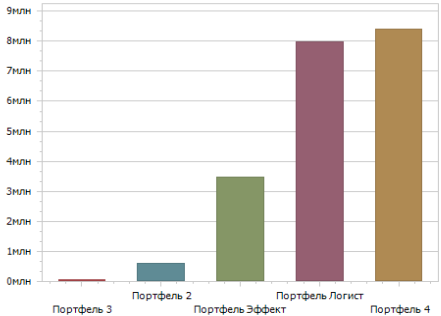
Портфель 3
2 797 888,24 ...
+15,1тыс
+0,54%

Портфель 2
15 433 512 ...
+97,5тыс
+0,64%

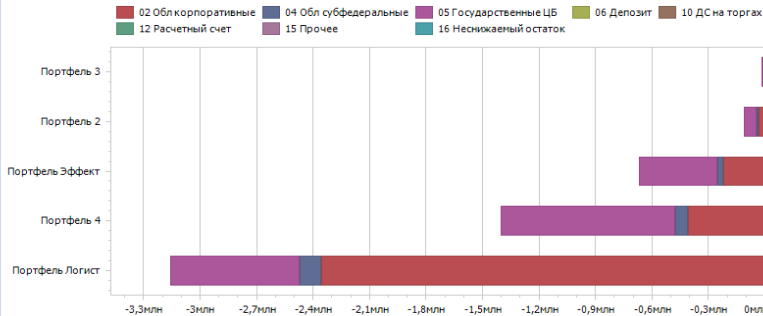
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

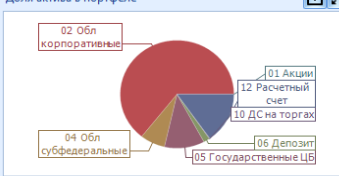
Категория актива

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

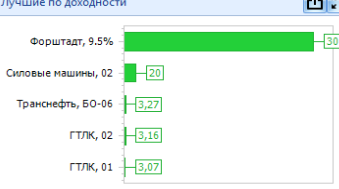
Позиции

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 корпоративные	Транспорт	1 083	1,50%	9 524,98	633 140,09	→ 0,00
	СпецДел	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→ 0,00
	РСКБ 7	02 Обл корпоративные	Банки	978	2,43%	24 156,60	992 973,18	→ 0,00
	Ростелеком-1-60б	Связь		795	2,37%	19 199,25	811 011,30	→ 0,00
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государственные облигации	Государственные облигации	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
	Нижнегород.обл. ...	04 Обл субфедеральные	Административные	2 299	1,68%	15 725,16	938 046,09	→ 0,00
	МегаФон-БО-05	Связь		736	2,07%	15 853,44	765 057,28	→ 0,00
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпоративные	Торговля	771	2,07%	16 329,78	788 856,36	→ 0,00
Портфель 2	Краснодарский к...	04 Обл субфедеральные	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-7-60б	02 Обл корпоративные	Финансовые компании	501	2,98%	15 505,95	521 100,12	→ 0,00
	Газпром нефть-4...	02 Обл корпоративные	Нефтегазовая	551	1,89%	3 385,47	178 742,04	→ 0,00
	Газпром Капитал...	02 Обл корпоративные	Финансовые компании	0	2,11%	10 576,02	502 364,89	→ 0,00
	ВЭБ 09	02 Обл корпоративные	Банки	642	2,64%	5 456,89	206 847,60	→ 0,00
	Волгоград.обл 35...	04 Обл субфедеральные	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 корпоративные	Транспорт	600	1,94%	11 526,00	593 610,00	→ 0,00
Портфель 2	Вертолеты Росси...	02 Обл корпоративные	Транспорт	345	1,79%	6 237,60	348 025,65	→ 0,00

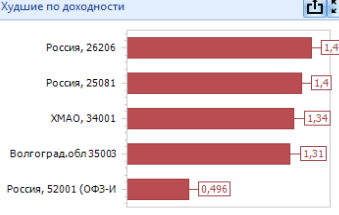
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности

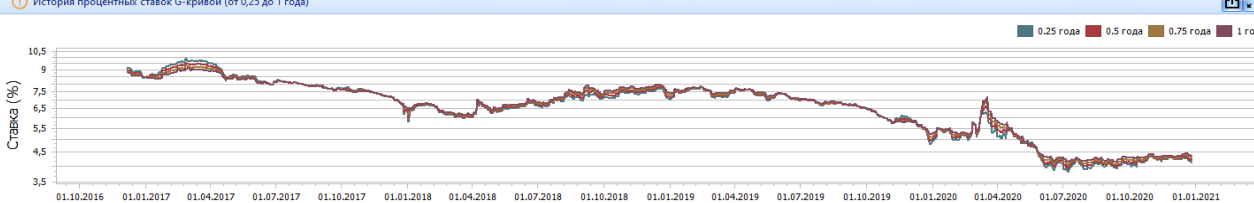


История изменения процентных ставок G-кривой

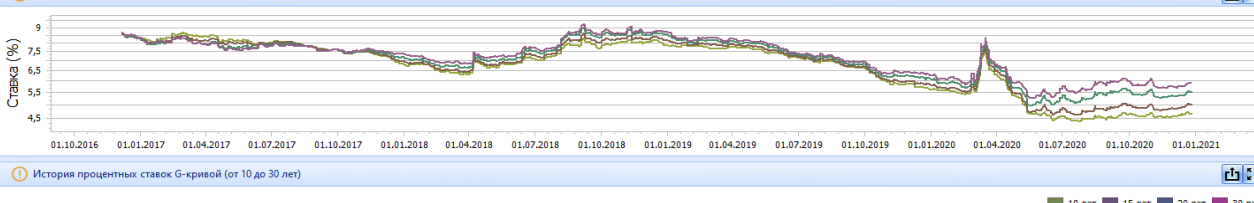
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

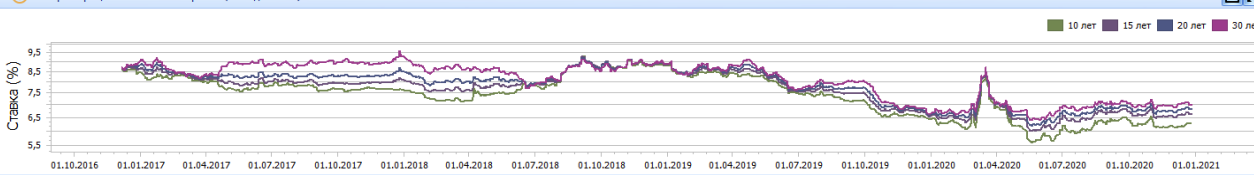
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

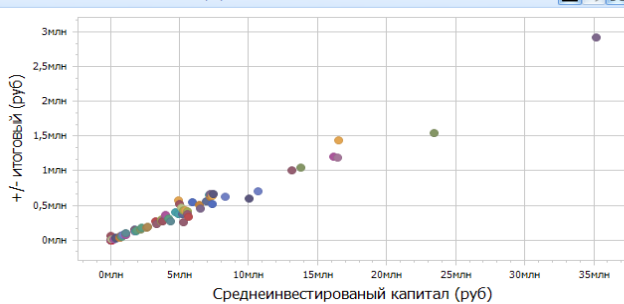


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

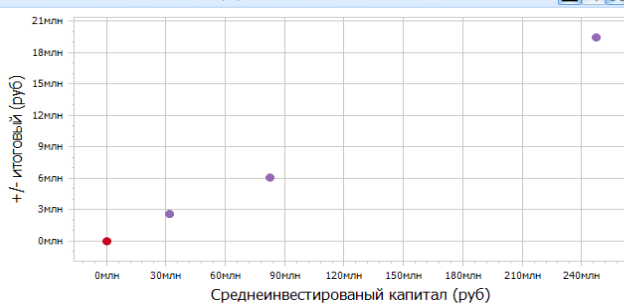


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

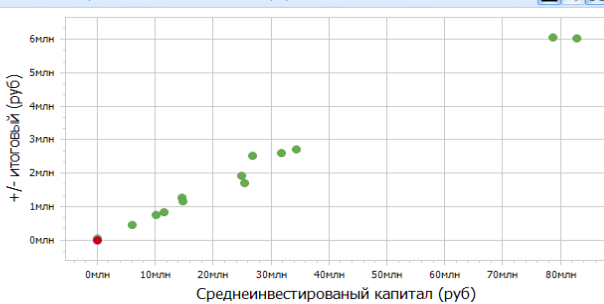
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



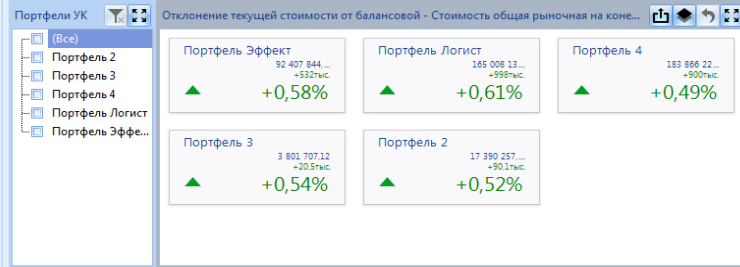
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



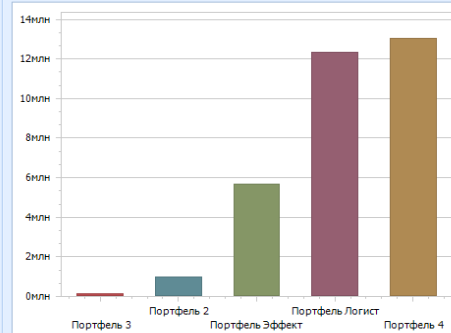
Мониторинг портфелей



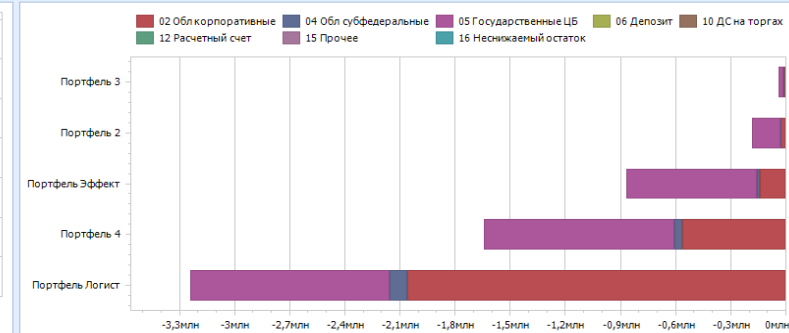
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

(Все)

Портфель 2

Портфель 3

Портфель 4

Категория актива

(Все)

01 Акции

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

Портфели

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 P	→	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 P	7,13%
Портфель ...	164 010 128...	165 008 133,27 P	↑	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 P	8,11%
Портфель 4	182 966 659...	183 866 220,21 P	→	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 P	7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 P	3 801 707,12 P	→	0,00	132 119,65 P	152 649,14 P	5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 P	→	0,00	905 372,19 P	995 511,72 P	6,78%

Доля актива в портфеле

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

05 Государственные ЦБ

12 Расчетный счет

10 ДС на торгах

Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество ...	Доходнос...	+/- итоговый	СИК	+/- не реали...
Портфель 2	услуги банка	15 Прочее		0	0,00%	-13 416,00	0,00	→
	ТрансКонтейнер, ...	02 Обл корпоративные	Транспорт	1 083	6,01%	30 123,64	501 544,45	→
	СпецДеп	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	РСКБ 7	02 Обл корпоративные	Банки	400	7,22%	46 338,92	641 943,21	→
	Ростелеком-1-606	02 Обл корпоративные	Связь	0	7,06%	30 927,09	437 865,61	→
	Россия-ОФЗ-2901...	05 Государствен...	Государственные ...	2 886	8,17%	94 982,61	1 162 561,17	→
	Россия-ОФЗ-2401...	05 Государствен...	Государственные ...	0	6,65%	154 850,26	2 326 879,59	→
	Прочие расходы	15 Прочее		0	0,00%	-4 000,00	0,00	→
	ОФЗ 29012	05 Государствен...	Государственные ...	1 243	7,11%	5 270,32	74 110,54	→
	ОФЗ 24019	05 Государствен...	Государственные ...	2 750	7,13%	14 025,00	196 600,39	→
	Оплата Страховки	15 Прочее		0	0,00%	-358,91	0,00	→
	Нижегород.обл. ...	04 Обл субфед...	Административные	0	6,51%	53 336,80	819 183,44	→
	МТС, 7	02 Обл корпорат...	Связь	880	6,32%	11 820,18	186 886,24	→
	МегаФон-БО-05	02 Обл корпорат...	Связь	736	7,25%	53 661,76	740 485,50	→
	Магнит, БО-001P...	02 Обл корпорат...	Торговля	100	7,49%	4 464,09	59 580,08	→
	Магнит, БО-001P...	04 Обл субфед...	Торговля	0	6,79%	25 203,99	371 074,25	→
	Краснодарский к...	04 Обл субфед...	Административные	4 500	7,15%	31 365,00	438 711,52	→
	Комиссия Фонда	15 Прочее		0	0,00%	0,00	0,00	→
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-4 528,25	0,00	→
	ГТЛК-7-606	02 Обл корпорат...	Финансовые ком...	501	8,79%	44 183,19	502 404,42	→
Газпром нефть-4...	02 Обл корпорат...	Нефтехимическая...	551	7,49%	32 004,41	427 308,36	→	

Лучшие по доходности

Форштадт 9,0%

Форштадт, 9,5%

Силовые машины, 02

Транснефть, БО-06

Роснефть-001P-02

Худшие по доходности

Россия, 26206

ТрансКонтейнер, 04

Внешэкономбанк, БО-1

Россия, S2001 (ОФЗ-И

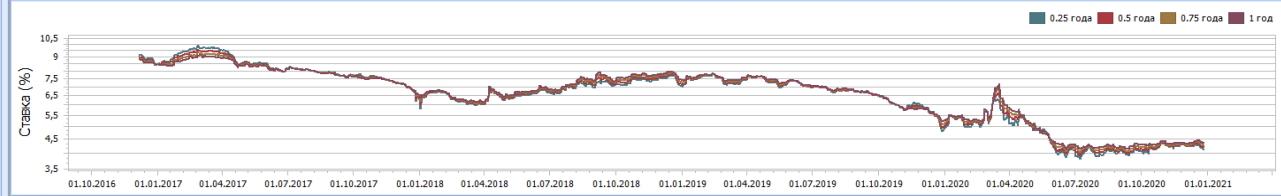
Магнит, БО-001P-02

История изменения процентных ставок G-кривой

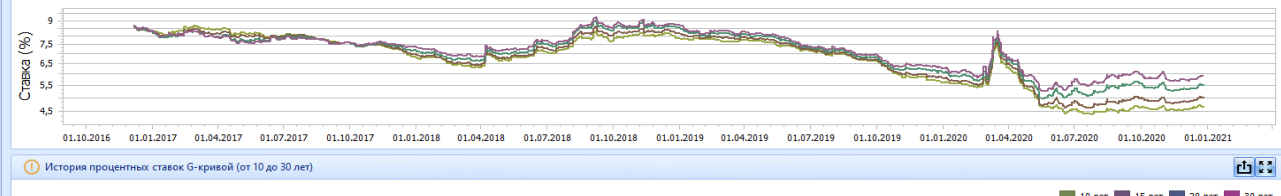
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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)

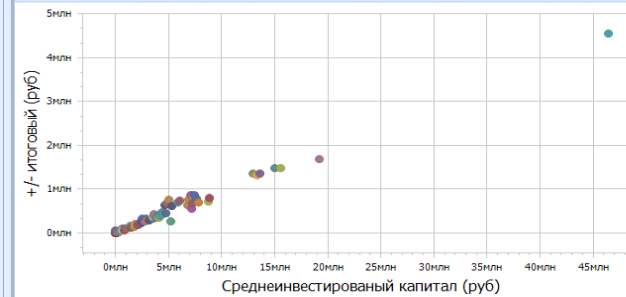


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

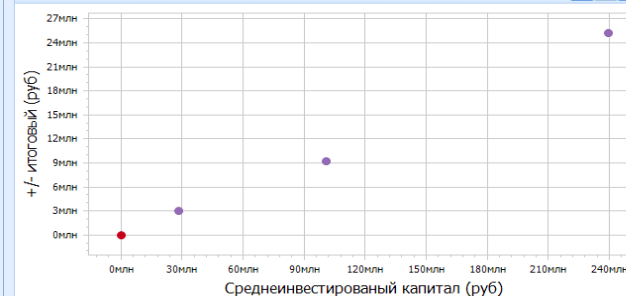
Влияние позиции на доходность портфеля



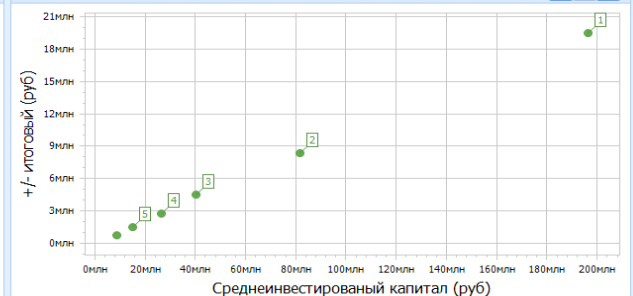
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

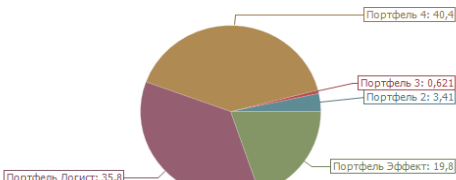
Монитор руководителя

Портфели УК

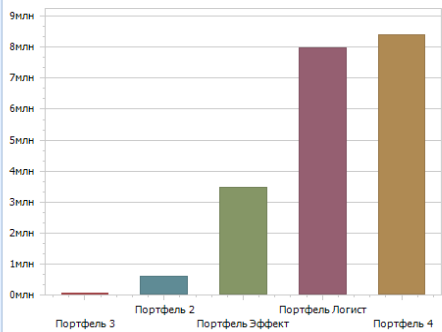
- (Все)
- Портфель 2
- Портфель 3
- Портфель 4
- Портфель Логист
- Портфель Эффект...



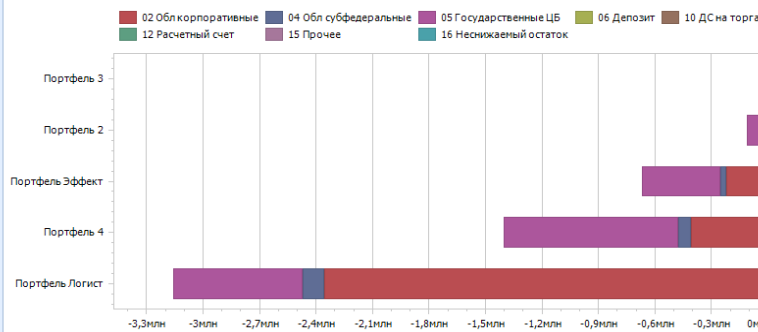
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дорации)



Монитор портфелей

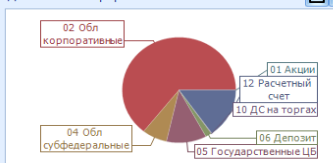
Портфели Фонда

Фильтр портфелей

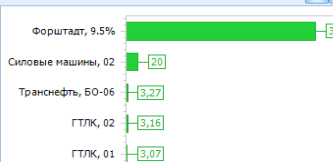
- (Все)
 - Портфель 2
 - Портфель 3
 - Портфель 4
- Категория актива
- (Все)
 - 01 Акции
 - 02 Обл корпоративные
 - 04 Обл субфедеральные

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	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%

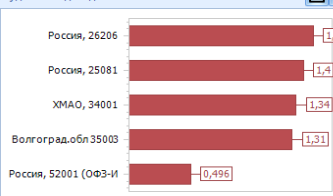
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности

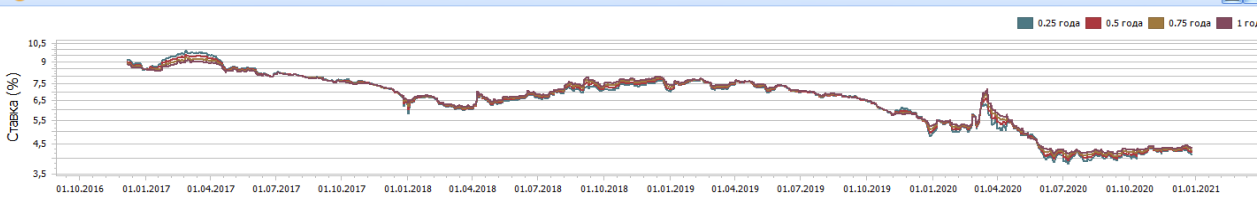


История изменения процентных ставок G-кривой

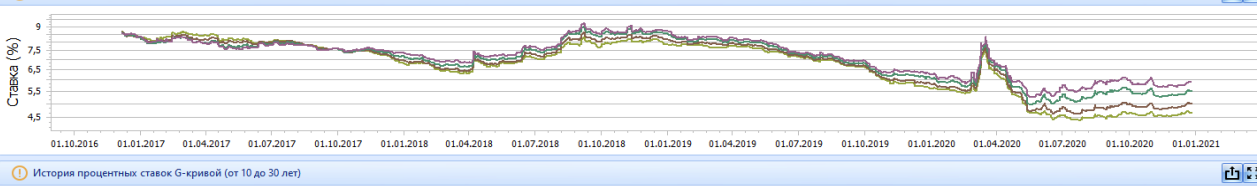
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

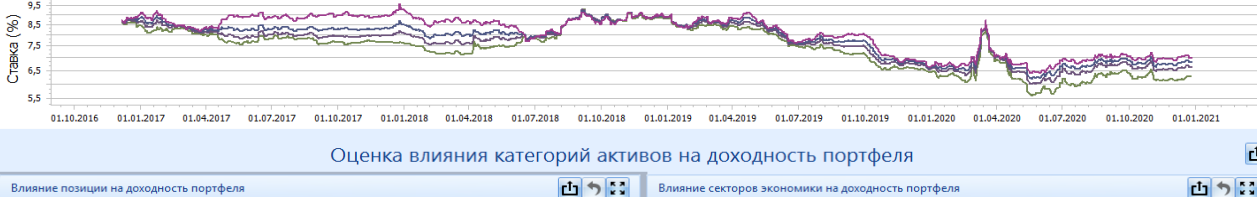
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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

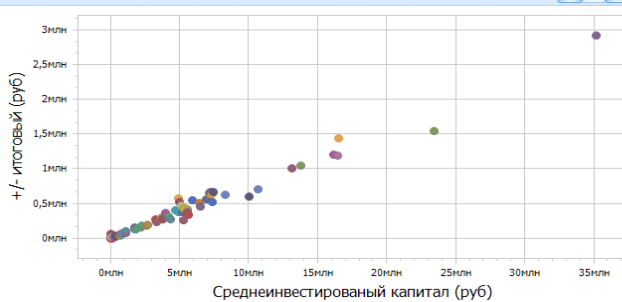


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

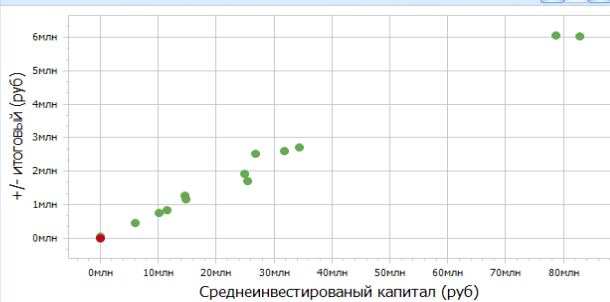


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

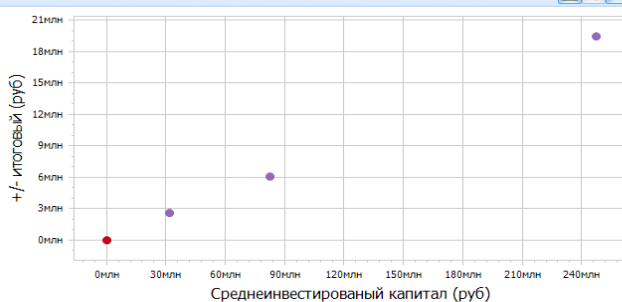
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей

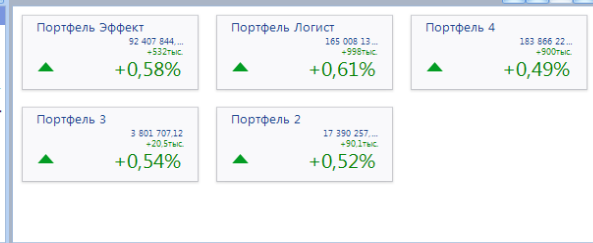


Монитор руководителя

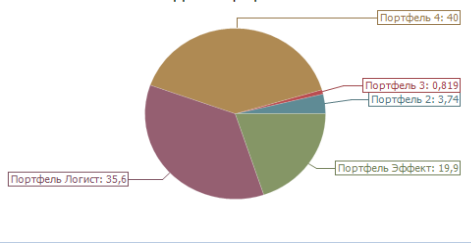
Портфели УК

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

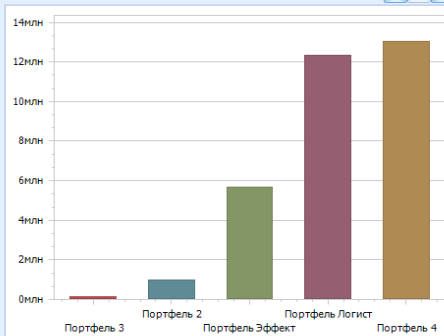
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на кон...



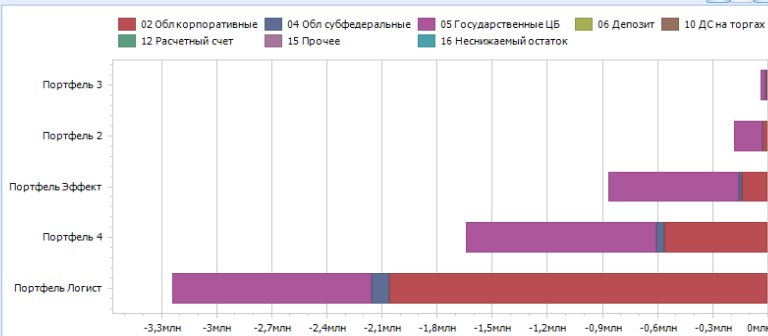
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

Категория актива

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

Позиции

Портфель

Актив

Тип актива

Сектор экономики

Количество ...

Доходнос...

+/- итоговый

СИК

+/- реали...

Портфель 2

услуги банка

15 Прочее

0

0,00%

-13 416,00

0,00

0,00

0,00

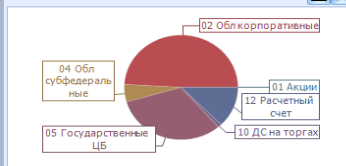
0,00

0,00

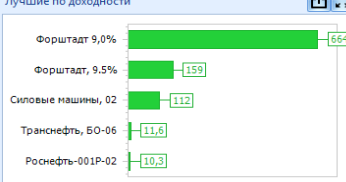
0,00

Портфель	Балансовая ...	Рыночная стоим...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 Р	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 Р	7,13%
Портфель ...	164 010 128...	165 008 133,27 Р	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 Р	8,11%
Портфель 4	182 966 659...	183 866 220,21 Р	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 Р	7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 Р	3 801 707,12 Р	0,00	132 119,65 Р	152 649,14 Р	5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 Р	0,00	905 372,19 Р	995 511,72 Р	6,78%

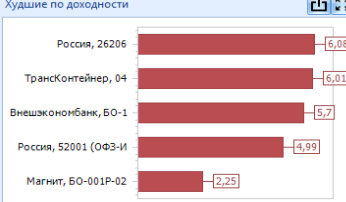
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



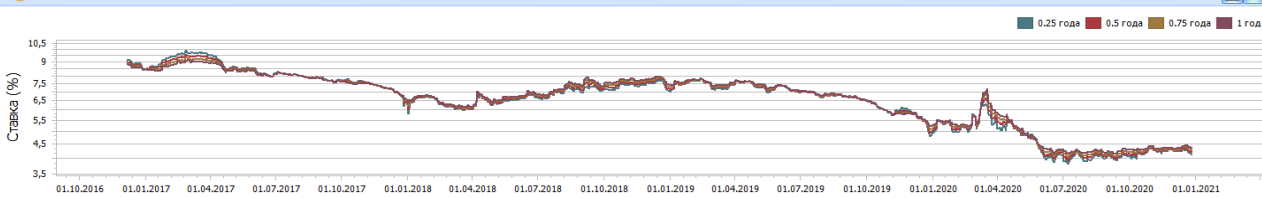
История изменения процентных ставок G-кривой



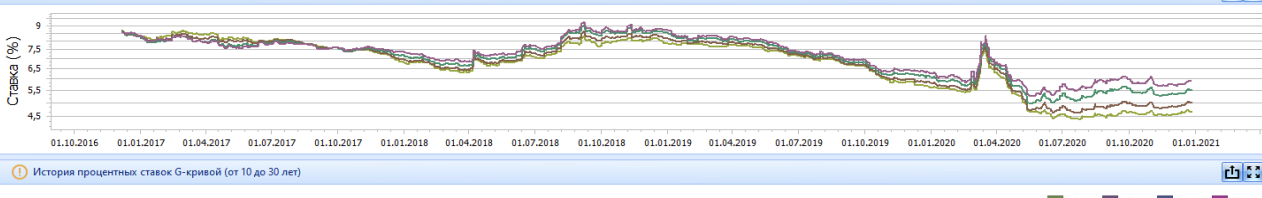
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

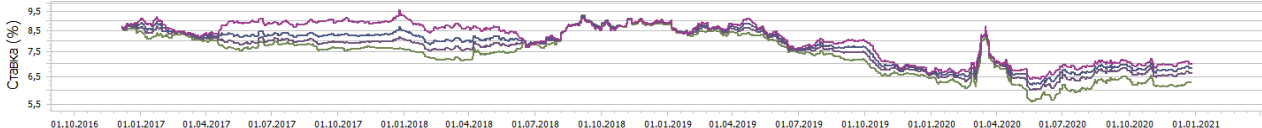
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



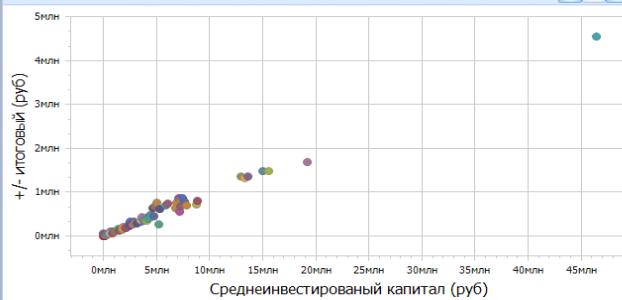
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



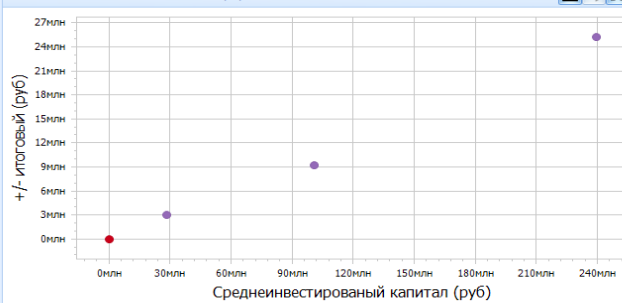
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект...

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



Портфель Эффект
95 406 856...
+644тыс
+0,68%

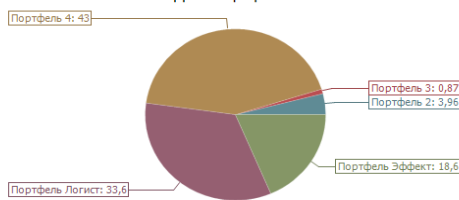
Портфель Логист
171 223 21...
+774тыс
+0,45%

Портфель 4
220 495 28...
+135тыс
+0,62%

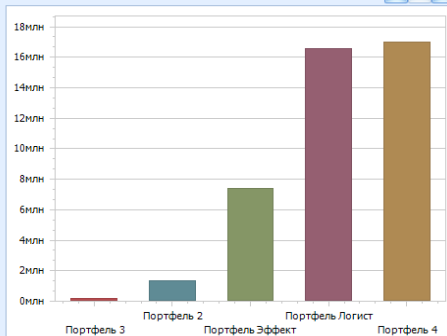
Портфель 3
4 459 329,46
+27,7тыс
+0,63%

Портфель 2
20 216 123...
+118тыс
+0,59%

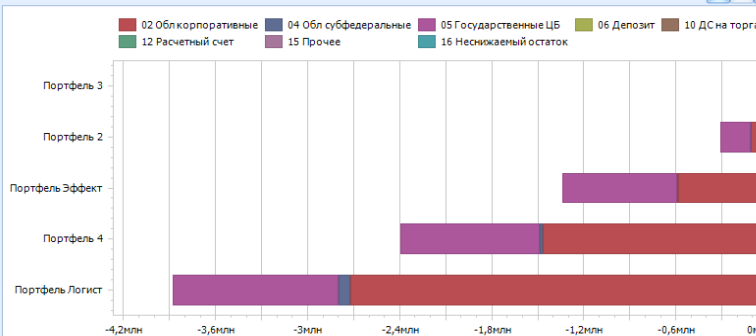
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



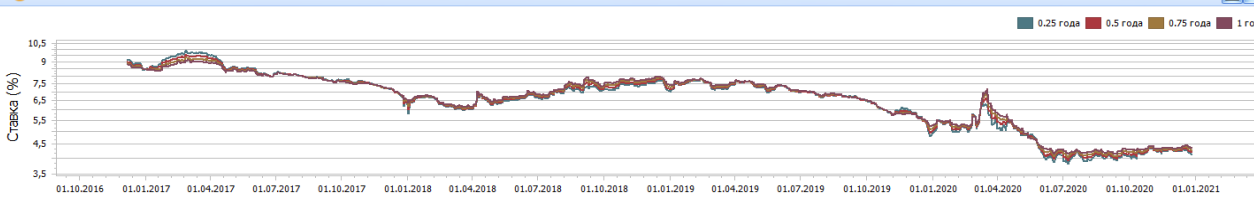
История изменения процентных ставок G-кривой



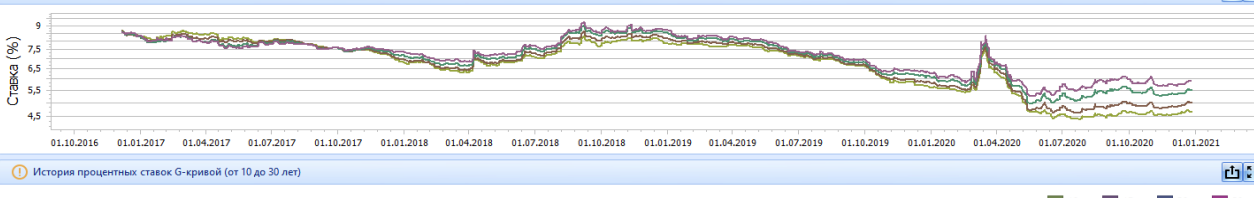
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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

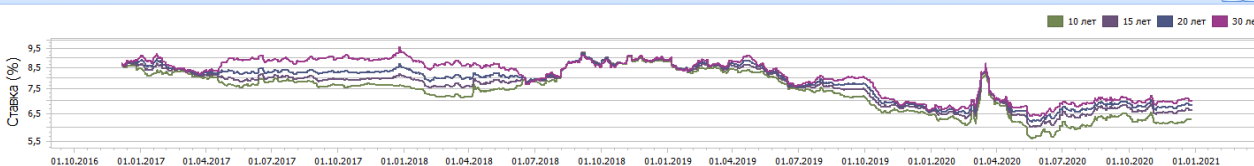
История процентных ставок G-кривой (от 0,25 до 1 года)



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



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



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

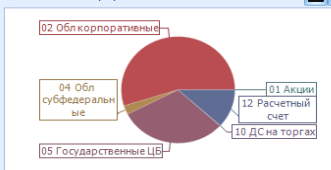
Категория актива

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

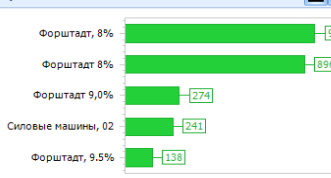
Позиции

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 корпор...	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
	РСКБ 9		Банки	753	9,98%	13 101,08	131 248,72	2 183,70
	РСКБ 7	02 Обл корпор...		400	9,76%	55 734,92	570 779,59	0,00
	Ростелеком-1-6об		Связь	0	9,68%	30 927,09	319 365,24	0,00
	Россия-ОФЗ-2901...		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
	Роснефть67	02 Обл корпор...	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		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			0	8,47%	20 452,98	241 595,84	0,00
	МегаФон-БО-05		Связь	0	9,23%	54 611,20	591 358,34	0,00
	Магнит, БО-001Р...		Торговля	0	9,07%	6 196,29	68 279,99	0,00
	Магнит, БО-001Р...			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			0	0,00%	0,00	0,00	0,00
	Комиссия Депоз...	15 Прочее		0	0,00%	-6 656,27	0,00	0,00

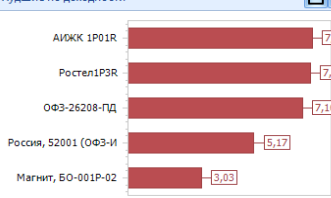
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



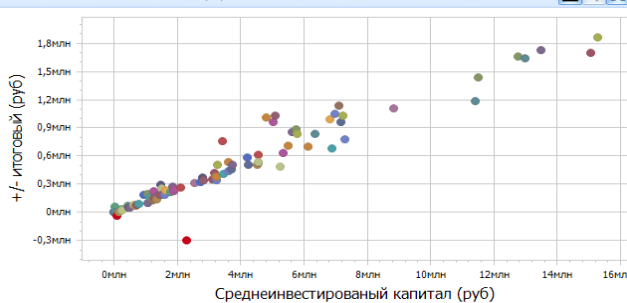
Худшие по доходности



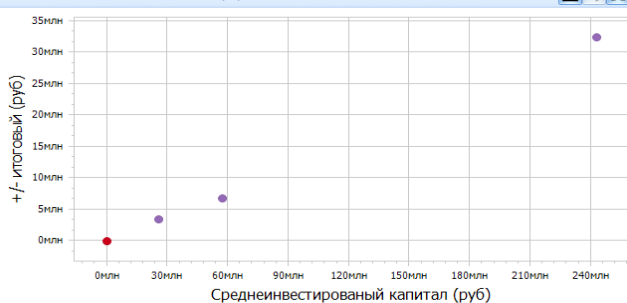
Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



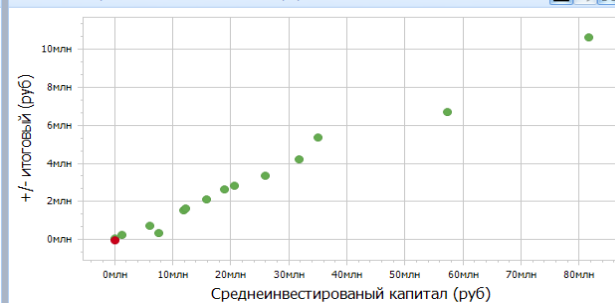
Влияние позиции на доходность портфеля



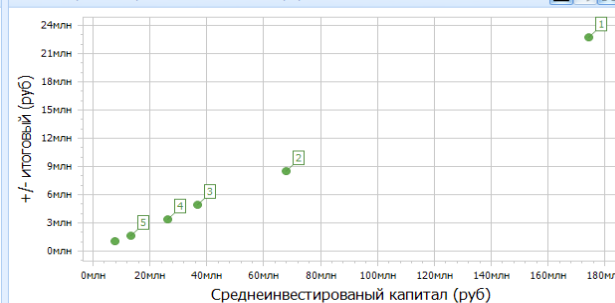
Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



Мониторинг портфелей



Монитор руководителя

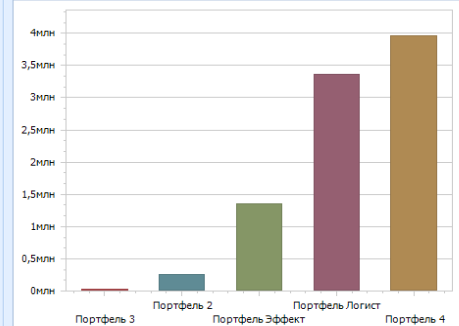
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

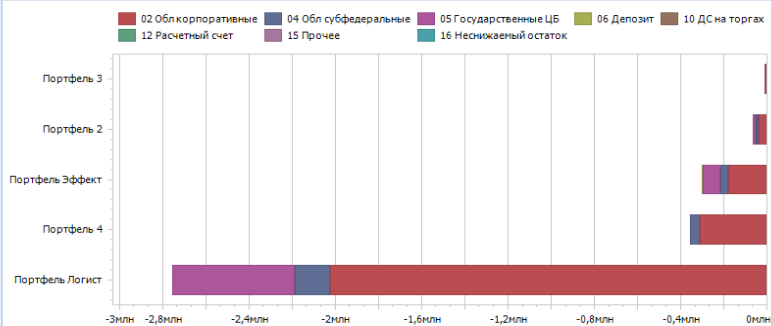
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конец...



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

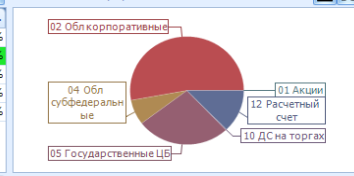
Категория актива

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

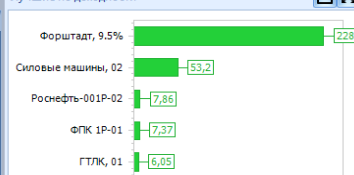
Позиции

Портфель	Актив	Тип актива	Сектор экономики	Количество	Доходность (MWY)	+/- итого...	СИК	+/- не...
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
	Магнит, БО-001Р...	02 Обл корпора...	Торговля	100	5,44%	2 134,09	39 212,00	0,00
	Магнит, 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 О9		Банки	1 037	5,02%	31 643,15	630 373,91	0,00

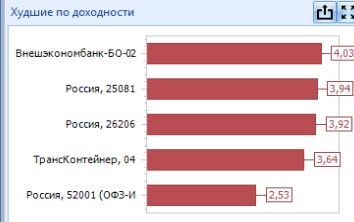
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности



Худшие по доходности



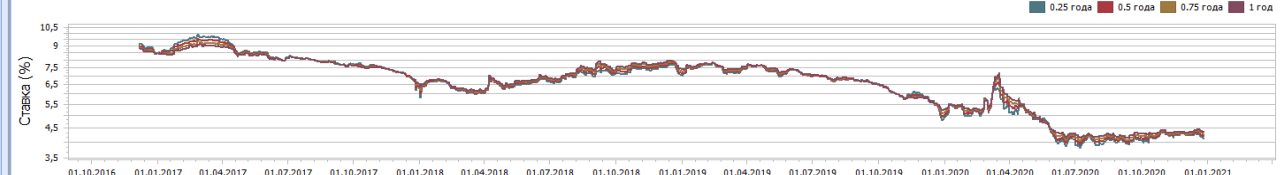
История изменения процентных ставок G-кривой



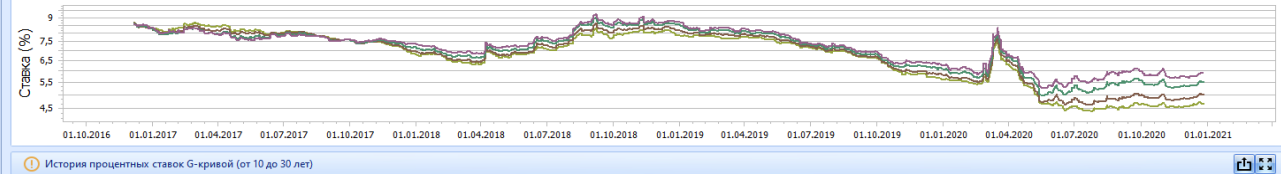
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок

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)



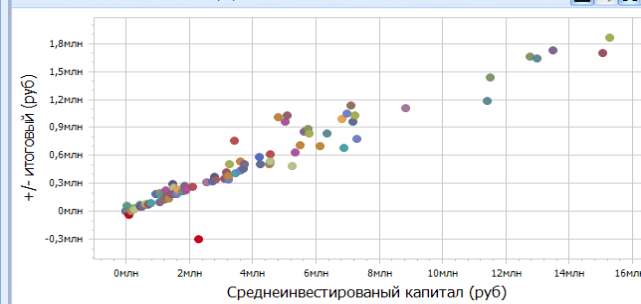
История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



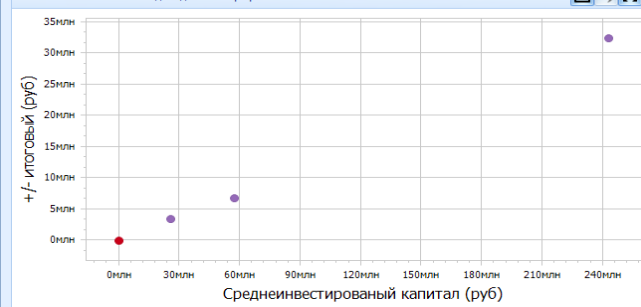
Влияние позиции на доходность портфеля



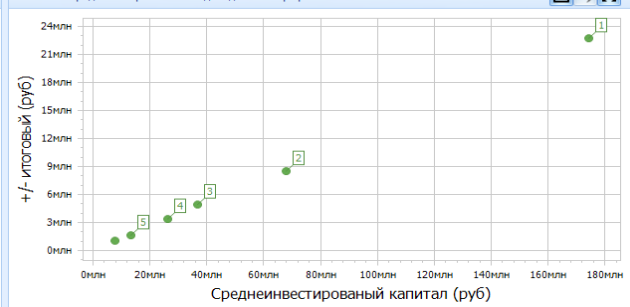
Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



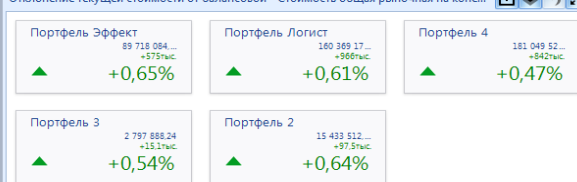
Мониторинг портфелей

Монитор руководителя

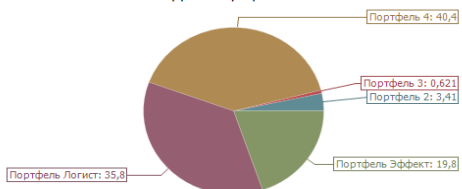
Портфели УК

- ☒ (Все)
- ☒ Портфель 2
- ☒ Портфель 3
- ☒ Портфель 4
- ☒ Портфель Логист
- ☒ Портфель Эффект

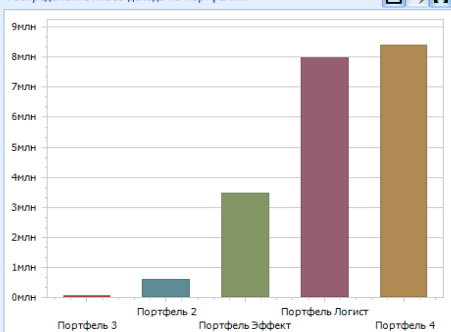
Отклонение текущей стоимости от балансовой - Стоимость общая рыночная на конец...



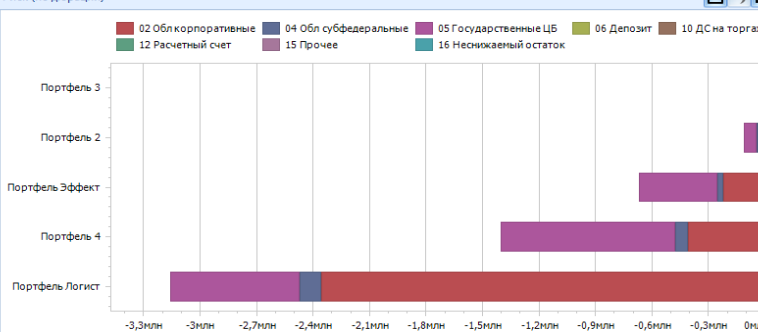
Доля портфелей



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей

Портфели Фонда

Фильтр портфелей

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

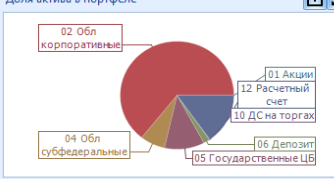
Категория актива

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

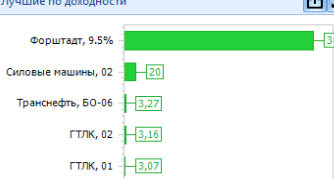
Позиции

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

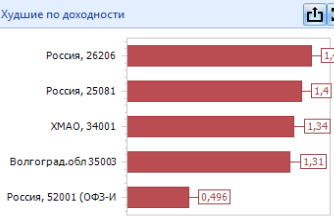
Доля актива в портфеле



Лучшие по доходности

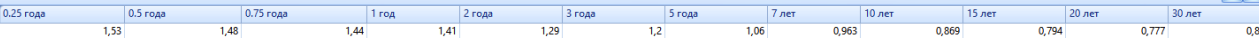


Худшие по доходности

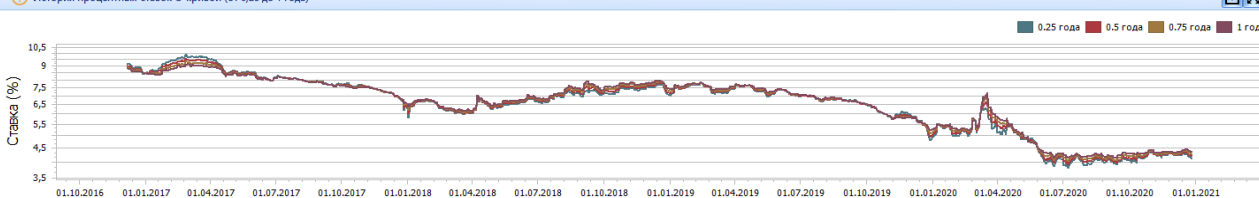


История изменения процентных ставок G-кривой

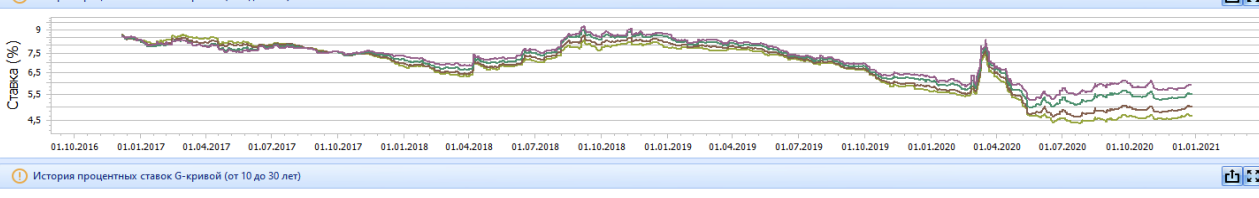
Среднеквадратичное отклонение процентных ставок



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



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

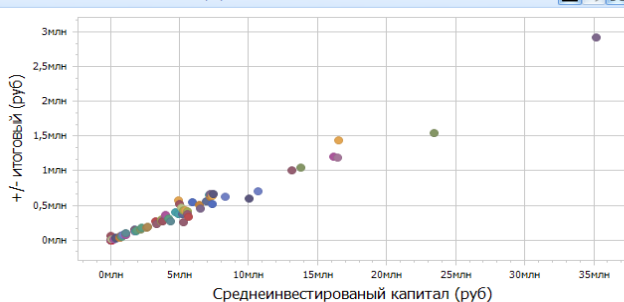


История процентных ставок G-кривой (от 10 до 30 лет)

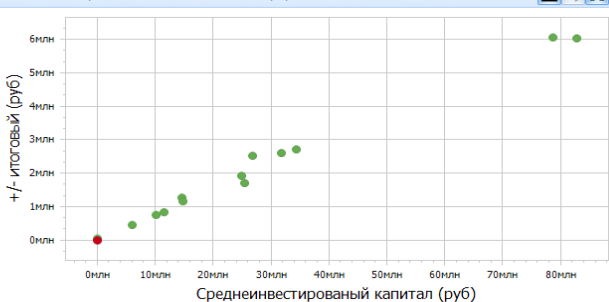


Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля

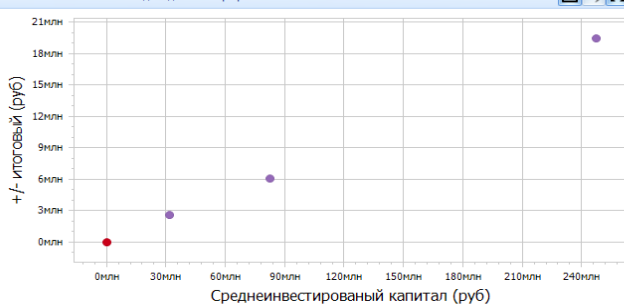
Влияние позиции на доходность портфеля



Влияние секторов экономики на доходность портфеля



Влияние типа актива на доходность портфеля



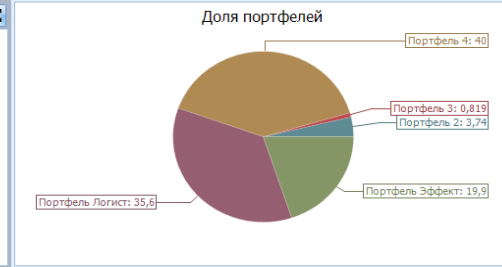
Влияние кредитного рейтинга на доходность портфеля



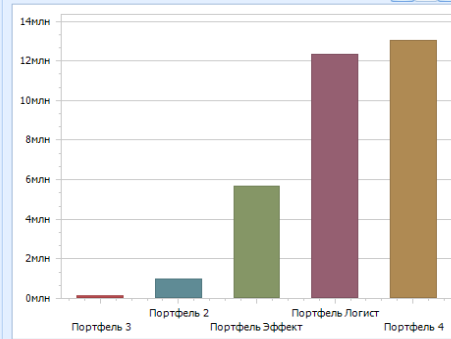
Мониторинг портфелей



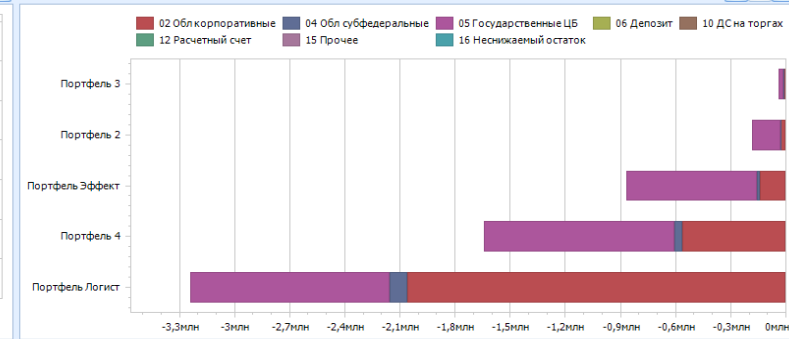
Монитор руководителя



Распределение инвестдохода по портфелям



Риск (по дюрации)



Монитор портфелей



Портфели Фонда

Фильтр портфелей

(Все)

Портфель 2

Портфель 3

Портфель 4

Категория актива

(Все)

01 Акция

02 Обл корпоративные

04 Обл субфедеральные

Позиции

Портфели

Портфель	Балансовая	Рыночная стоим...	+/- не реали...	+/- реали...	+/- итоговый	СИК	Доходность ...
Портфель ...	91 875 954,7...	92 407 844,33 P	→	0,00	5 156 782...	5 688 672,20 P	79 835 683... 7,13%
Портфель ...	164 010 128...	165 008 133,27 P	↑	28 709,35	11 372 100...	12 370 105,66 P	152 576 716... 8,11%
Портфель 4	182 966 659...	183 866 220,21 P	→	0,00	12 149 522...	13 049 082,83 P	178 679 908... 7,30%
Портфель 3	3 781 177,63 P	3 801 707,12 P	→	0,00	132 119,65 P	152 649,14 P	2 627 000,1... 5,81%
Портфель 2	17 300 117,7...	17 390 257,25 P	→	0,00	905 372,19 P	995 511,72 P	14 651 563... 6,79%

Доля актива в портфеле

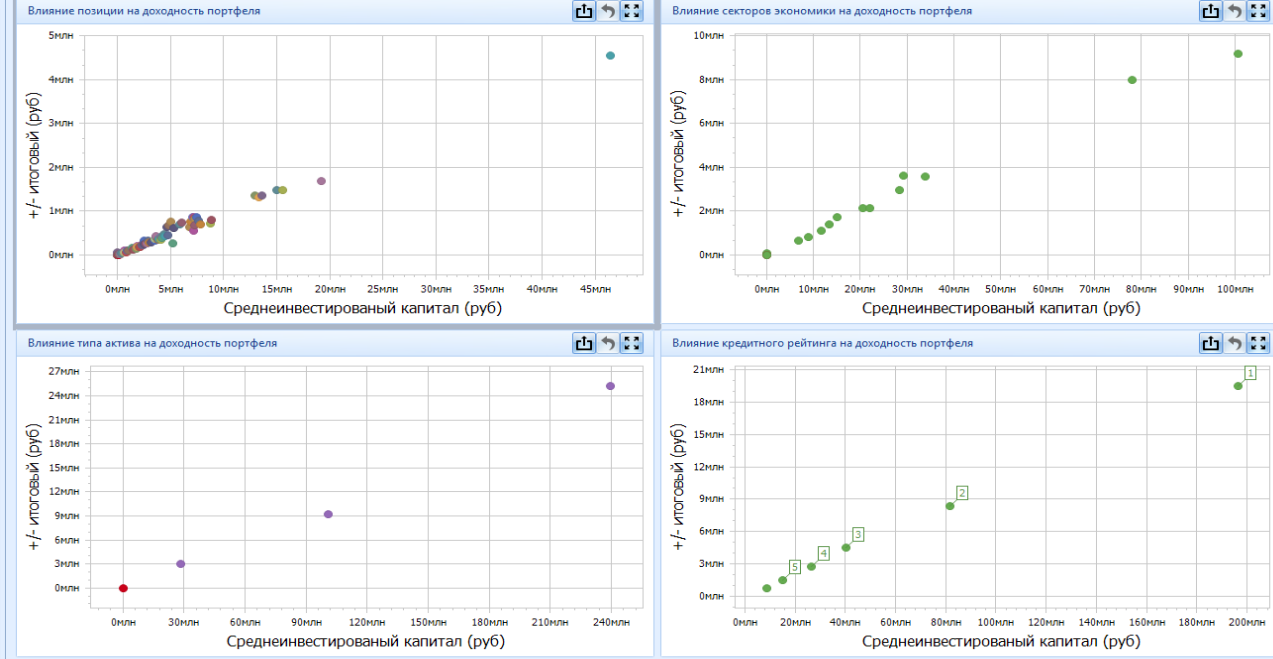
Лучшие по доходности

Худшие по доходности

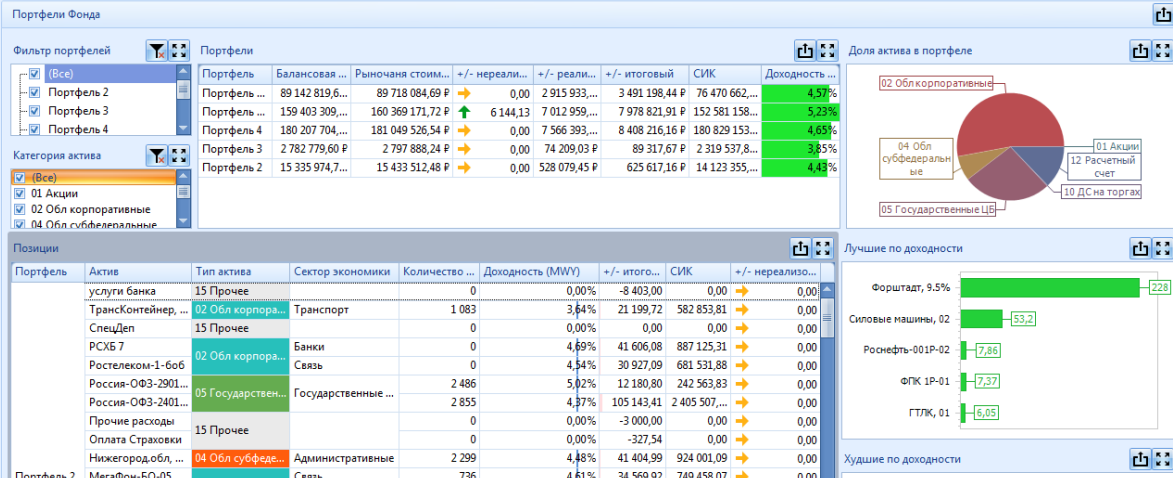
История изменения процентных ставок G-кривой



Оценка влияния категорий активов на доходность портфеля



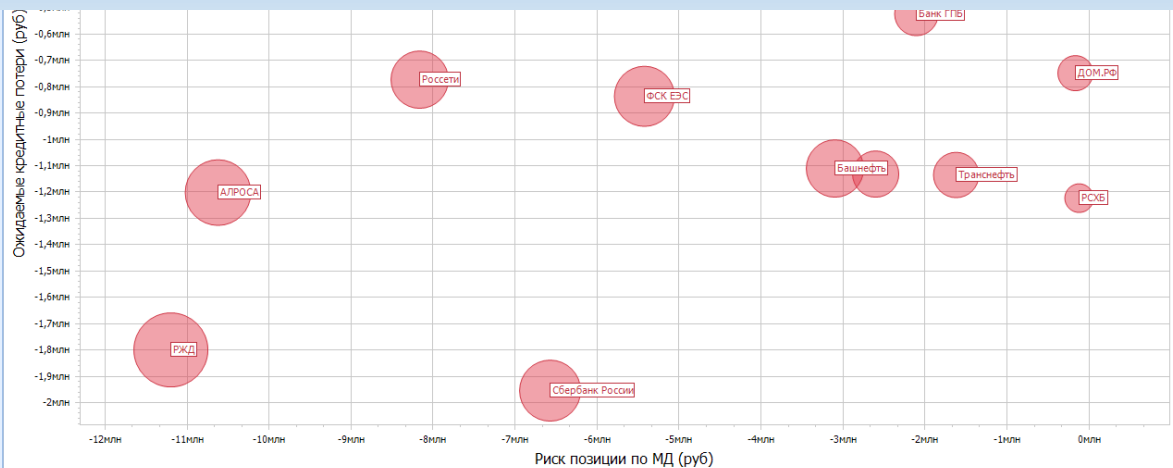
Монитор портфелей



История изменения процентных ставок G-кривой



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 (руб)	Доля отрасли в стоимости портфеля	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
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 дюрациях

Категория дюрации	Стоимость позиции с НКД (руб)	Доля дюрации в стоимости портфеля	Доля совокупного риска (%)	Совокупный риск (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (руб)
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 (руб)	Ожидаемые кредитные потери ...	Риск позиции по МД (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

GAMA

Вы умеете инвестировать,
мы умеем считать.



www.infostroy.ru