# Клиент:



**АО "УК УРАЛСИБ" "Д.У." НП "Саморегулируемая организация "Департамент развития и защиты малого и среднего бизнеса в области пожарной безопасности"**

## Договор: № УН2010ДУ-250 от 06.04.2010

**Стратегия "ИИ Индивидуальное ДУ"**

**ПАРАМЕТРЫ ОТЧЁТА**

Период отчёта

с **01.01.2018**

по **01.06.2018**





### ОТЧЕТ НА 01.06.2018 Г.

#### Клиент: АО "УК УРАЛСИБ" "Д.У." НП "Саморегулируемая организация "Департамент развития и защиты малого и среднего бизнеса в области пожарной безопасности"

Период:

**01.01.2018 – 01.06.2018**

Доходность, годовых:

**7,96**

Стоимость: Валюта:

**10 544 027.10 (Активы на конец периода) Российские рубли**

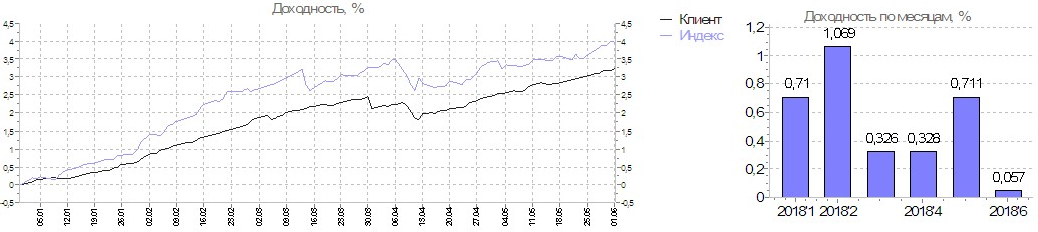
Дюрация, в годах: **2,07**

Доходность к погашению, %: **7,62**

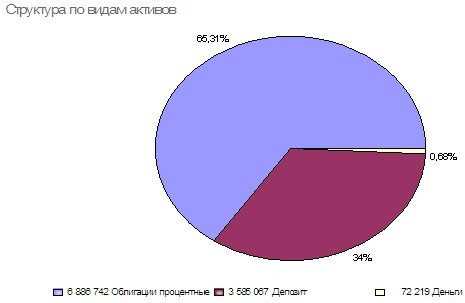
Курс банка России: **USD 62,0188 / EUR 72,5806**

Индекс: **RUXCbonds**

Средневзвешенный рейтинг: **BB**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **С 01.01.2018** | **Посл. квартал** | **Посл. 30 дней** |
| Изменение стоимости портфеля клиента TWRR, % | 3,24 | 1,37 | 0,69 |
| Изменение величины индекса RUXCbonds, % | 3,98 | 1,29 | 0,50 |
| Изменение стоимости портфеля клиента TWRR годовых, % | 7,96 | 5,53 | 8,79 |
| Изменение величины индекса RUXCbonds годовых, % | 9,82 | 5,22 | 6,28 |
| Прибыль/убытки (реализованная+нереализованная), RUR | 330 928,40 | 142 129,10 | 72 756,83 |
| Приток, RUR | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Отток, RUR | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Нетто, RUR | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

**СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 01.06.2018**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Наименование актива | Номинал | Погашение  купона | Купон,  дн. | Купон | Доходность | Дюрация, в годах | Количество | Котировка | НКД на бумагу | Сумма | Доля,% |
| ***Денежные средства***  **Депозиты** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | ***3 657 285,49 34,69***  **3 585 066,93 34,00** | |
|  | Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Договор №810/77/853 от 25.05.2018 | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5 066,93 | 1,000 | 0,00 | 5 066,93 | 0,05 |
| Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Российские рубли ДЕПОЗИТ | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3 580 000,00 | 1,000 | 0,00 | 3 580 000,00 | 33,95 |
| **Остатки на счетах** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **72 218,56 0,68** | |
|  | Министерство экономики и финансов Московской области / Московская Обл-35010-об | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14 195,40 | 1,000 | 0,00 | 14 195,40 | 0,13 |
| / Российские рубли БИРЖА | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 35 760,34 | 1,000 | 0,00 | 35 760,34 | 0,34 |
| Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Российские рубли Р/С | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4 152,42 | 1,000 | 0,00 | 4 152,42 | 0,04 |
| ПАО СБЕРБАНК / Сбербанк-19-боб | 0,00 |  |  | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18 110,40 | 1,000 | 0,00 | 18 110,40 | 0,17 |
| ***Облигации процентные***  **Государственные** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | ***6 886 741,61 65,31***  **1 719 816,75 16,31** | |
|  | Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29011-ПК | 1000,00 | 01.08.18 | 182 | 8,96 | 7,38 | 0,17 | 1 629 | 1 026,050 | 29,70 | 1 719 816,75 | 16,31 |
| **Субфедеральные** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **673 568,86 6,39** | |
|  | Министерство финансов Красноярского края / КрасноярскийКрай-34009-об | 600,00 | 01.10.18 | 182 | 11,50 | 7,10 | 0,33 | 44 | 610,200 | 11,34 | 27 347,76 | 0,26 |
| Министерство экономики и финансов Московской области / Московская Обл-35010-об | 1000,00 | 28.08.18 | 91 | 9,65 | 7,27 | 3,64 | 590 | 1 094,500 | 0,79 | 646 221,10 | 6,13 |
| **Металлургия и горнодобывающая** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **626 004,00 5,94** | |
|  | Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" / Металлоинвест, 02 | 1000,00 | 03.08.18 | 182 | 7,65 | 7,55 | 3,92 | 600 | 1 018,400 | 24,94 | 626 004,00 | 5,94 |
| **Нефтегазовая** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **1 120 543,70 10,63** | |
|  | Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал" / Газпром капитал-5-боб | 1000,00 | 15.08.18 | 182 | 8,90 | 7,40 | 4,52 | 730 | 1 074,900 | 26,09 | 803 722,70 | 7,62 |
| публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть" / Роснефть-001Р-04-боб | 1000,00 | 01.11.18 | 182 | 8,65 | 7,57 | 4,10 | 300 | 1 049,200 | 6,87 | 316 821,00 | 3,00 |
| **Потребительский сектор** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **140 705,10 1,33** | |
|  | Общество с ограниченной ответственностью "Лента" / Лента-3-об | 1000,00 | 28.08.18 | 182 | 11,75 | 6,66 | 0,24 | 135 | 1 012,000 | 30,26 | 140 705,10 | 1,33 |
| **Финансы** | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | **2 606 103,20 24,72** | |
|  | БАНК ГПБ (АО) / ГПБ-14-боб | 1000,00 | 19.09.18 | 184 | 8,40 | 7,11 | 2,11 | 840 | 1 023,100 | 17,03 | 873 709,20 | 8,29 |
| АО "КБ ДЕЛЬТАКРЕДИТ" / ДельтаКредит-8-боб | 1000,00 | 20.10.18 | 183 | 12,40 | 8,97 | 0,86 | 1 200 | 1 049,800 | 14,27 | 1 276 884,00 | 12,11 |
| ПАО СБЕРБАНК / Сбербанк-19-боб | 1000,00 | 30.11.18 | 184 | 8,30 | 7,11 | 2,72 | 440 | 1 034,800 | 0,45 | 455 510,00 | 4,32 |

**ДЕПОЗИТЫ и НСО**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Начало | Конец | Нач. сумма | Вал. | Ставка  ,% | Расчетные проценты | Тек. сумма | Тек. сумма | Банк |

Итого

6 880 000,00

288 866,93

3 580 000,00 3 868 866,93

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25.05.2017 | 25.05.2018 | 3 300 000,00 | RUR | 8,60 | 283 800,00 | 0,00 | 283 800,00 | ПАО "БАНК УРАЛСИБ" |
| 25.05.2018 | 27.05.2019 | 3 580 000,00 | RUR | 7,38 | 5 066,93 | 3 580 000,00 | 3 585 066,93 | ПАО "БАНК УРАЛСИБ" |

**БАЛАНС ДВИЖЕНИЯ**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Период | | | Баланс | | | | | Доходность | |
| В начале периода | Приток | Отток | P&L Gross | В конце периода | TWR | MWR |
| 2018-1 | 01.01.2018 | 31.03.2018 | 10 213 098,70 |  |  | 216 330,23 | 10 429 428,93 | 2,12 | 2,12 |
| 2018-2 | 01.04.2018 | 01.06.2018 | 10 429 428,93 |  |  | 114 598,17 | 10 544 027,10 | 1,10 | 1,10 |
| **Итого 2018** | **01.01.2018** | **01.06.2018** | **10 213 098,70** |  |  | **330 928,40** | **10 544 027,10** | **3,24** | **3,24** |

**ФИНАНСОВЫЙ РЕЗУЛЬТАТ**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Наименование актива | Текущая стоимость | Финансовый результат | ФР купон | ФР тело | Доходность, % |

**Итого**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **330 928,40** | **252 487,91** | **78 440,49** |
| 374 371,69 | 252 487,91 | 121 883,78 |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Денежные средства | Российские рубли | 3 652 218,56 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Облигации процентные | Газпром капитал-5-боб | 803 722,70 | 36 543,80 | 27 053,80 | 9 490,00 | 11,58 |
| Облигации процентные | ГПБ-14-боб | 873 709,20 | 29 215,20 | 29 383,20 | -168,00 | 8,32 |
| Облигации процентные | ДельтаКредит-8-боб | 1 276 884,00 | 61 968,00 | 61 968,00 | 0,00 | 12,13 |
| Облигации процентные | КрасноярскийКрай-34009-об | 27 347,76 | 957,88 | 1 264,12 | -306,24 | 8,62 |
| Облигации процентные | Лента-3-об | 140 705,10 | 4 108,05 | 6 605,55 | -2 497,50 | 7,22 |
| Облигации процентные | Металлоинвест-02-об | 626 004,00 | 35 334,00 | 19 794,00 | 15 540,00 | 14,71 |
| Облигации процентные | Московская Обл-35010-об | 646 221,10 | 28 026,10 | 23 990,60 | 4 035,50 | 10,72 |
| Облигации процентные | ОФЗ-29011-ПК | 1 719 816,75 | 35 642,52 | 62 814,24 | -27 171,72 | 5,12 |
| Облигации процентные | Роснефть-001Р-04-боб | 316 821,00 | 6 656,34 | 4 408,00 | 2 248,34 | 12,85 |
| Облигации процентные | Сбербанк-19-боб | 455 510,00 | 18 110,40 | 15 206,40 | 2 904,00 | 9,79 |
| Проценты по депозиту | Российские рубли | 5 066,93 | 117 809,40 | 0,00 | 117 809,40 | 8,05 |

-43 443,29 0,00 -43 443,29

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Вознаграждение управляющего | 0,00 | -38 277,99 | 0,00 | -38 277,99 |  |
|  | Дополнительный доход | 0,00 | 80,90 | 0,00 | 80,90 |  |
|  | Комиссия банка | 0,00 | -518,00 | 0,00 | -518,00 |  |
|  | Хозяйственные расходы | 0,00 | -4 728,20 | 0,00 | -4 728,20 |  |