

Акционерное общество «Управляющая компания УРАЛСИБ»

Клиентский отчет за период с 01.10.2020 по 31.10.2020

Отчет подготовлен для

По договору ДУ

Саморегулируемая организация Некоммерческое партнерство "Департамент развития и защиты малого и среднего бизнеса в области пожарной безопасности"

№ УН2010ДУ-250



Информация предоставлена за период 01.10.2020 - 31.10.2020
 Договор ДУ № УН2010ДУ-250

| Стратегия | Валюта | Период | Рыночная стоимость на начало периода тыс. | Рыночная стоимость на конец периода тыс. | Доходность за период, % | Финансовый результат за период, тыс. |
|------------------------------------|--------|-----------------------|--|---|----------------------------|---|
| 1 Стратегия "ИИ Индивидуальное ДУ" | RUB | 01.10.2020-31.10.2020 | 11 932,12 | 12 004,47 | 0,61 | 72,35 |

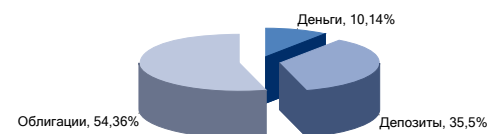
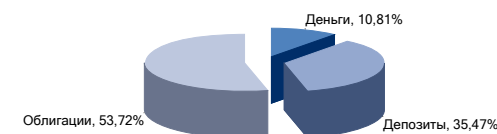
| КУРСЫ ВАЛЮТ | Начало периода | Конец периода |
|-------------|----------------|----------------|
| USD/RUB | 79,6845 | 79,3323 |
| EUR/RUB | 93,0237 | 92,6284 |

| | |
|------------------------------|-------------------|
| Начало управления стратегией | 14.05.2010 |
| Начало периода | 01.10.2020 |
| Конец периода | 31.10.2020 |
| Валюта | RUB |
| Риск-профиль | |

| АКТИВЫ | За период | С начала года | За 12 месяцев |
|--------------------------|------------------|----------------------|----------------------|
| Начало периода, тыс. rub | 11 932,12 | 11 456,39 | 11 379,31 |
| Конец периода, тыс. rub | 12 004,47 | 12 004,47 | 12 004,47 |

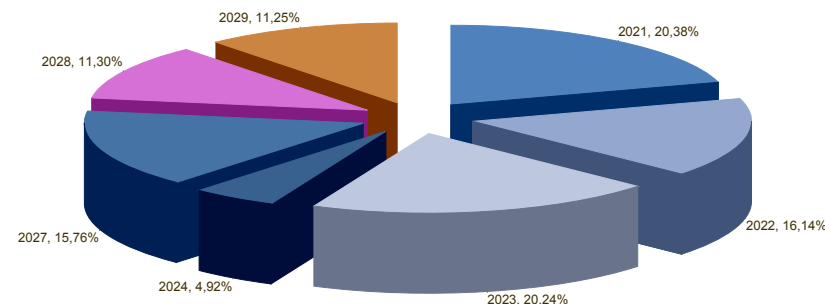
| САЛЬДО ЗАВОДОВ/ВЫВОДОВ | За период | С начала года | За 12 месяцев |
|-------------------------------|------------------|----------------------|----------------------|
| Завод, тыс. rub | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Вывод, тыс. rub | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Сальдо, тыс. rub | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| ДОХОДНОСТЬ | За период | С начала года | За 12 месяцев |
|-----------------------------------|------------------|----------------------|----------------------|
| Финансовый результат, тыс. rub | 72,35 | 548,08 | 625,16 |
| Доходность стратегии, % за период | 0,61 | 4,78 | 5,49 |
| Доходность стратегии, % годовых | 7,16 | 5,74 | 5,49 |
| Изменение курса USD/RUB, % | -0,44 | 28,15 | 24,20 |
| Изменение курса EUR/RUB, % | -0,42 | 33,58 | 30,45 |

Стратегия по классам активов, начало периода

Стратегия по классам активов, конец периода


| КУРСЫ ВАЛЮТ | Начало периода | Конец периода |
|--------------------|-----------------------|----------------------|
| USD/RUB | 79,6845 | 79,3323 |
| EUR/RUB | 93,0237 | 92,6284 |

| Класс активов | Начало периода 01.10.2020 | | Конец периода 31.10.2020 | | Изменение доли, |
|--|---------------------------|------------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| | Рыночная стоимость, | Доля в портфеле, | Рыночная стоимость, | Доля в портфеле, | |
| | тыс. руб | % | тыс. руб | % | % |
| Денежные средства | 1 209,90 | 10,14 | 1 297,32 | 10,81 | 0,67 |
| Депозиты | 4 236,40 | 35,50 | 4 257,49 | 35,47 | -0,03 |
| Облигации | 6 485,82 | 54,36 | 6 449,65 | 53,72 | -0,64 |
| ВСЕГО ПО СТРАТЕГИИ | 11 932,12 | | 12 004,47 | | |
| Доля активов по стратегии, % (в валюте RUB) | | | | 100,00 | |

Структура облигаций по срокам погашения

КУРСЫ ВАЛЮТ

| | Начало периода | Конец периода |
|---------|----------------|----------------|
| USD/RUB | 79,6845 | 79,3323 |
| EUR/RUB | 93,0237 | 92,6284 |

| Категория | Валюта инструмента | | | | | | Рыночная стоимость в валюте инструмента, тыс. | Рыночная стоимость, тыс. руб | Доля в портфеле, % | | | | |
|--|----------------------------------|----------------------------------|---|---|---|--|--|--|---|---------------|---|--------------------------|------|
| ДЕНЕЖНЫЕ СРЕДСТВА | | | | | | | | | | | | | |
| Денежные средства | | | | | | | | 1 342,19 | 11,18 | | | | |
| | в т.ч. RUB | | | | | | 1 342,19 | 1 342,19 | 11,18 | | | | |
| Кредиторская задолженность | | | | | | | | 44,86 | 0,37 | | | | |
| | в т.ч. RUB | | | | | | 44,86 | 44,86 | 0,37 | | | | |
| ИТОГ ПО ДЕНЕЖНЫМ СРЕДСТВАМ | | | | | | | | 1 297,32 | 10,81 | | | | |
| ДЕПОЗИТЫ | | | | | | | | | | | | | |
| Депозиты | в т.ч. RUB | ПАО "БАНК УРАЛСИБ" | | | | | 4 150,00 | 4 150,00 | 34,57 | | | | |
| Проценты по депозитам | в т.ч. RUB | ПАО "БАНК УРАЛСИБ" | | | | | 107,49 | 107,49 | 0,90 | | | | |
| | | | | | | | | 107,49 | 0,90 | | | | |
| ИТОГ ПО ДЕПОЗИТАМ | | | | | | | | 4 257,49 | 35,47 | | | | |
| | Валюта инструмента | Кол-во ЦБ на конец периода | Средневзве- шенная цена в валюте инструмента (% по облигациям) | ОКД в валюте инстру- мента, включая ОКД, | Стоимость позиции, в валюте инструмента, включая ОКД, | Стоимость позиции, включая ОКД, | Рыночная цена в валюте инструмента (% по облигациям) | НКД в валюте инстру- мента, включая НКД, | Рыночная стоимость позиции в валюте инструмента, включая НКД, | НКД, | Рыночная стоимость позиции, включая НКД, | Доля в портфеле, % | |
| Ценная бумага | | | | | тыс. | тыс. | тыс. руб | тыс. | тыс. | тыс. руб | тыс. руб. | % | |
| ОБЛИГАЦИИ | | | | | | | | | | | | | |
| RU000A0JTLJ3 | МЕТАЛЛОИНВЕСТ. ХК об02 | RUB | 600 | 100,800000 | 0,00 | 604,80 | 604,80 | 108,000000 | 11,57 | 659,57 | 11,57 | 659,57 | 5,49 |
| RU000A0JX0B9 | МЭФ Московской обл. оба10 | RUB | 590 | 103,600000 | 0,00 | 611,24 | 611,24 | 107,670000 | 10,45 | 645,70 | 10,45 | 645,70 | 5,38 |
| RU000A0JXFS8 | Газпром капитал об605 | RUB | 400 | 100,950000 | 0,00 | 403,80 | 403,80 | 110,150000 | 7,80 | 448,40 | 7,80 | 448,40 | 3,73 |
| RU000A0JXQK2 | Роснефть об6П04 | RUB | 530 | 101,834906 | 0,00 | 539,73 | 539,73 | 107,170000 | 0,25 | 568,25 | 0,25 | 568,25 | 4,73 |
| RU000A0ZYM21 | ДФФ об6П01 | RUB | 250 | 99,020000 | 0,00 | 247,55 | 247,55 | 101,220000 | 7,21 | 260,26 | 7,21 | 260,26 | 2,17 |
| RU000A0ZYV04 | ООО "Газпром капитал" вып.4 | RUB | 194 | 91,250000 | 0,00 | 177,03 | 177,03 | 104,070000 | 2,55 | 204,44 | 2,55 | 204,44 | 1,70 |
| RU000A0ZYX69 | ФПК об6П03 | RUB | 500 | 99,686000 | 0,00 | 498,43 | 498,43 | 103,680000 | 5,82 | 524,22 | 5,82 | 524,22 | 4,37 |
| RU000A0ZZGE7 | ООО "Фольксваген Банк РУС" вып.2 | RUB | 130 | 100,000000 | 0,00 | 130,00 | 130,00 | 102,450000 | 2,33 | 135,51 | 2,33 | 135,51 | 1,13 |
| RU000A100DG5 | Европлан, ЛК об606 | RUB | 200 | 100,804000 | 0,00 | 201,61 | 201,61 | 101,510000 | 8,14 | 211,16 | 8,14 | 211,16 | 1,76 |
| RU000A100F95 | ООО "РЕСО-Лизинг" вып.004 | RUB | 250 | 100,850000 | 0,00 | 252,13 | 252,13 | 101,550000 | 9,17 | 263,05 | 9,17 | 263,05 | 2,19 |
| RU000A100WC4 | МКБ об6П05 | RUB | 450 | 101,500000 | 0,00 | 456,75 | 456,75 | 103,870000 | 2,98 | 470,40 | 2,98 | 470,40 | 3,92 |
| RU000A100XU4 | РЕСО-Лизинг об6П07 | RUB | 300 | 100,700000 | 0,00 | 302,10 | 302,10 | 105,510000 | 1,07 | 317,60 | 1,07 | 317,60 | 2,65 |
| RU000A1011C3 | РУСАЛ Братск об6П04 | RUB | 500 | 101,400000 | 0,00 | 507,00 | 507,00 | 101,330000 | 8,06 | 514,71 | 8,06 | 514,71 | 4,29 |
| SU26205RMFS3 | ОФЗ-ПД205 | RUB | 900 | 102,700000 | 0,00 | 924,30 | 924,30 | 101,432000 | 3,19 | 916,07 | 3,19 | 916,07 | 7,63 |
| SU29012RMFS0 | ОФЗ-ПК012 | RUB | 300 | 102,490000 | 0,00 | 307,47 | 307,47 | 100,571000 | 8,60 | 310,31 | 8,60 | 310,31 | 2,58 |
| ИТОГ ПО ОБЛИГАЦИЯМ | | | | | | | | 89,18 | 6 449,65 | 53,72 | | | |
| ВСЕГО ПО СТРАТЕГИИ | | | | | | | | 89,18 | 12 004,47 | 100,00 | | | |
| Всего активы по стратегии, тыс. | | RUB | | | | | 12 004,47 | | 12 004,47 | | 100,00 | | |

ОКД – купонный доход, оплаченный по сделке

НКД – купонный доход, накопленный на отчетную дату

КУРСЫ ВАЛЮТ

USD/RUB

EUR/RUB

Начало периода

79,6845
93,0237

Конец периода

79,3323
92,6284