



**Клиент: АО "УК УРАЛСИБ" "Д.У." средствами
компенсационного фонда Ассоциации "СРО АУ
"Южный Урал"**

Договор: № УН2010ДУ-267 от 01.10.2010

Стратегия "ИИ Индивидуальное ДУ"

ПАРАМЕТРЫ ОТЧЁТА

Период отчёта	с	01.01.2017
	по	30.06.2017

Клиентский менеджер: **Арутюнов Николай Багратович**
Email: anb@uralsib.ru



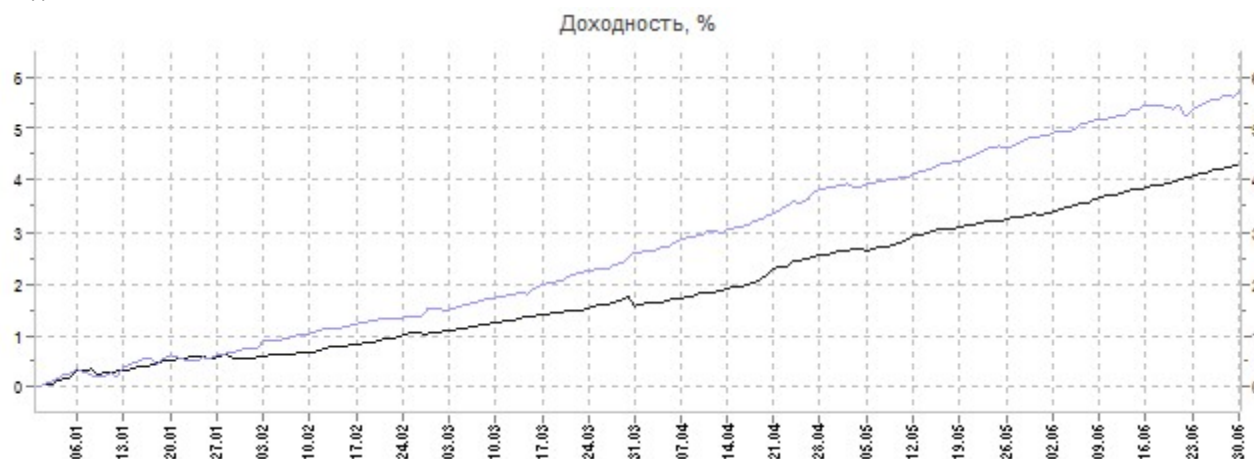
ОТЧЕТ НА 30.06.2017 Г.

Клиент: **АО "УК УРАЛСИБ" "Д.У." средствами компенсационного фонда Ассоциации "СРО АУ "Южный Урал"**
 Период: **01.01.2017 – 30.06.2017**
 Стоимость: **23 448 293.85 (Активы на конец периода)**
 Валюта: **Российские рубли**
 Курс банка России: **USD 59,0855 / EUR 67,4993**
 Индекс: **RUXCbonds**

 Доходность, годовых: **8,87**

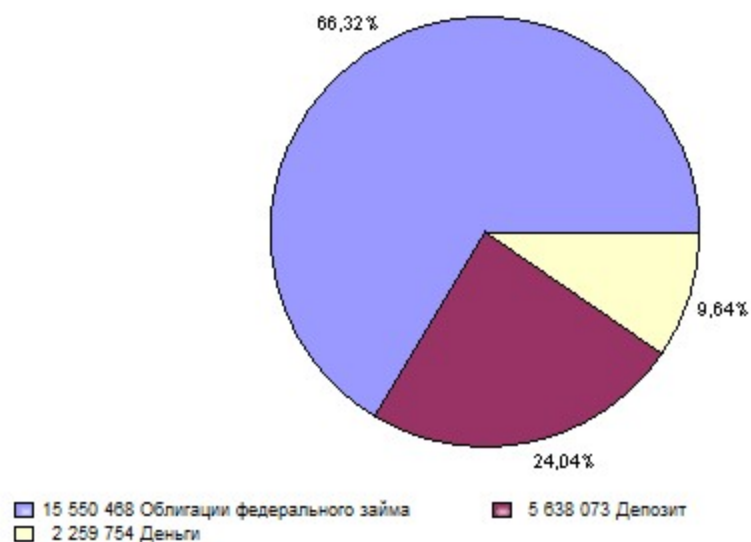
 Дюрация, в годах: **0,53**

 Доходность к погашению, %: **8,68**

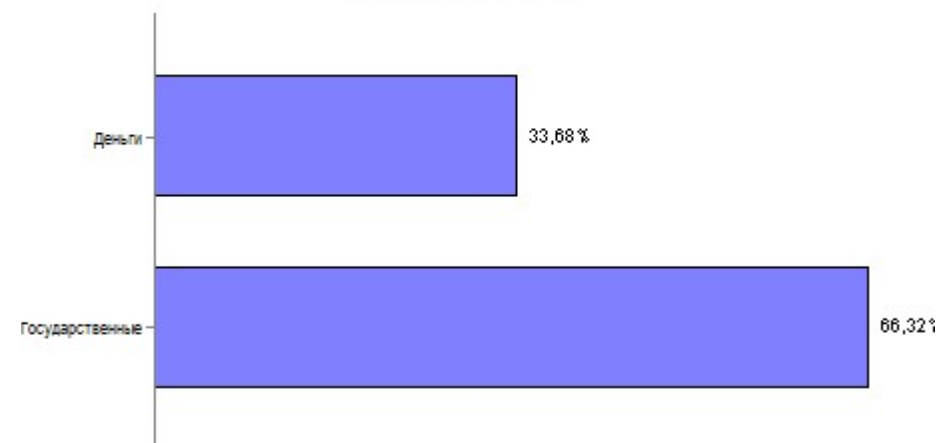
 Средневзвешенный рейтинг: **BB+**


	С 01.01.2017	Посл. квартал	Посл. 30 дней
Изменение стоимости портфеля клиента TWRR, %	4,30	2,50	0,95
Изменение величины индекса RUXCbonds, %	5,72	3,15	0,81
Изменение стоимости портфеля клиента TWRR годовых, % (Приказ № 07-37/пз-н)	8,68	9,93	11,59
Изменение стоимости портфеля клиента TWRR годовых, %	8,87	10,30	12,23
Изменение величины индекса RUXCbonds годовых, %	11,87	13,10	10,28
Прибыль/убытки (реализованная+нереализованная), RUR	944 069,06	572 154,50	221 286,66
Приток, RUR	5 406 566,69	10 000,00	10 000,00
Отток, RUR	-4 976 566,69	0,00	0,00
Нетто, RUR	430 000,00	10 000,00	10 000,00

Структура по видам активов



Структура по отраслям



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.06.2017

Наименование актива	Номинал	Погашение купона	Купон, дн.	Купон	Доходность	Дюрация, в годах	Количество	Котировка	НКД на бумагу	Сумма	Доля, %
Денежные средства										7 897 826,15	33,68
Депозиты										5 638 072,60	24,04
Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Договор №810/77/839 от 23.03.2017	0,00			0,00	0,00	0,00	138 072,60	1,000	0,00	138 072,60	0,59
Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Российские рубли ДЕПОЗИТ	0,00			0,00	0,00	0,00	5 500 000,00	1,000	0,00	5 500 000,00	23,46
Остатки на счетах										2 259 753,55	9,64
/ Российские рубли БИРЖА	0,00			0,00	0,00	0,00	2 259 324,56	1,000	0,00	2 259 324,56	9,64
Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Российские рубли Р/С	0,00			0,00	0,00	0,00	428,99	1,000	0,00	428,99	0,00
Облигации процентные										15 550 467,70	66,32
Государственные										15 550 467,70	66,32
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-24018-ПК	1000,00	27.12.17	182	10,46	8,07	0,49	3 012	1 011,830	0,57	3 049 348,80	13,00
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-26216-ПД	1000,00	15.11.17	182	6,70	8,01	1,78	1 500	980,980	8,08	1 483 590,00	6,33
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29006-ПК	1000,00	09.08.17	182	11,41	9,93	0,11	2 000	1 090,500	44,39	2 269 780,00	9,68
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29011-ПК	1000,00	02.08.17	182	11,18	9,33	0,09	2 000	1 046,260	45,64	2 183 800,00	9,31
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29012-ПК	1000,00	22.11.17	182	10,32	9,71	0,40	2 000	1 034,400	10,46	2 089 720,00	8,91
Министерство финансов Российской Федерации / Россия, 25081	1000,00	02.08.17	182	6,20	8,04	0,57	2 000	990,570	25,31	2 031 760,00	8,66
Министерство финансов Российской Федерации / Россия, 26204	1000,00	14.09.17	182	7,50	7,76	0,69	2 395	998,040	21,78	2 442 468,90	10,42

ДЕПОЗИТЫ и НСО

Начало	Конец	Нач. сумма	Вал.	Ставка %	Расчетные проценты	Тек. сумма	Тек. сумма	Банк
Итого		10 500 000,00			651 661,64	5 500 000,00	6 151 661,64	
24.03.2016	23.03.2017	5 000 000,00	RUR	10,30	513 589,04	0,00	513 589,04	Банк ВТБ (ПАО)
24.03.2017	24.03.2018	5 500 000,00	RUR	9,35	138 072,60	5 500 000,00	5 638 072,60	ПАО "БАНК УРАЛСИБ"

БАЛАНС ДВИЖЕНИЯ

Период			Баланс					Доходность	
			В начале периода	Приток	Отток	P&L Gross	В конце периода	TWR	MWR
2017-1	01.01.2017	31.03.2017	22 074 224,79	5 396 566,69	-4 976 566,69	331 856,33	22 826 081,12	1,57	1,56
2017-2	01.04.2017	30.06.2017	22 826 081,12	10 000,00		612 212,73	23 448 293,85	2,68	2,68
Итого 2017	01.01.2017	30.06.2017	22 074 224,79	5 406 566,69	-4 976 566,69	944 069,06	23 448 293,85	4,30	4,31