



**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	29.12.2017

Клиентский менеджер: **Исыченко Елизавета Сергеевна**
Email: **IsychenkoES@uralsib.ru**



ОТЧЕТ НА 29.12.2017 Г.

Клиент: **АО "УК УРАЛСИБ" "Д.У." средствами компенсационного фонда Ассоциации "СРО АУ "Южный Урал"**
 Период: **01.01.2017 – 29.12.2017**
 Стоимость: **20 500 620.09 (Активы на конец периода)**
 Валюта: **Российские рубли**
 Курс банка России: **USD 57,6291 / EUR 68,7861**
 Индекс: **RUXCbonds**

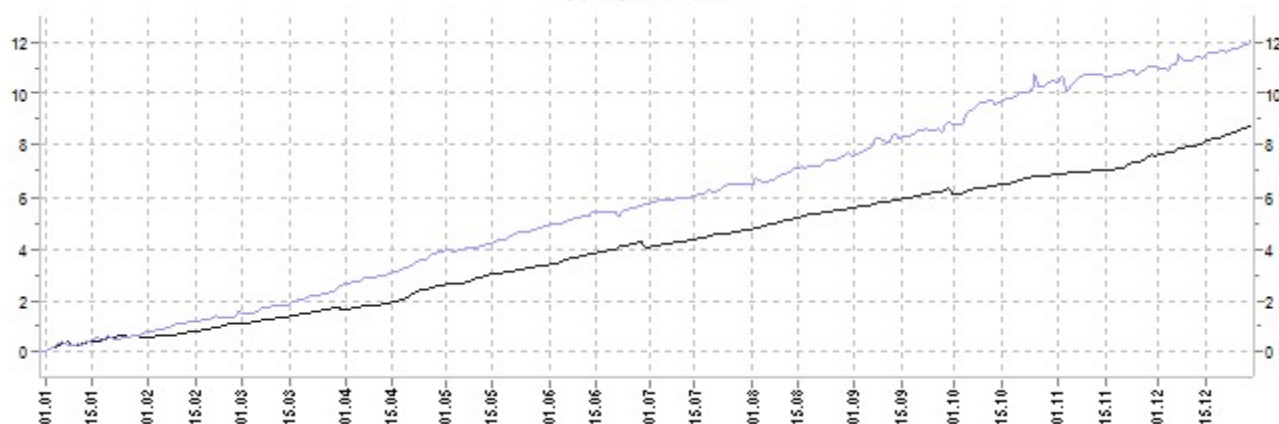
Доходность, годовых: **8,80**

Дюрация, в годах: **2,24**

Доходность к погашению, %: **7,91**

Средневзвешенный рейтинг: **BB+**

Доходность, %

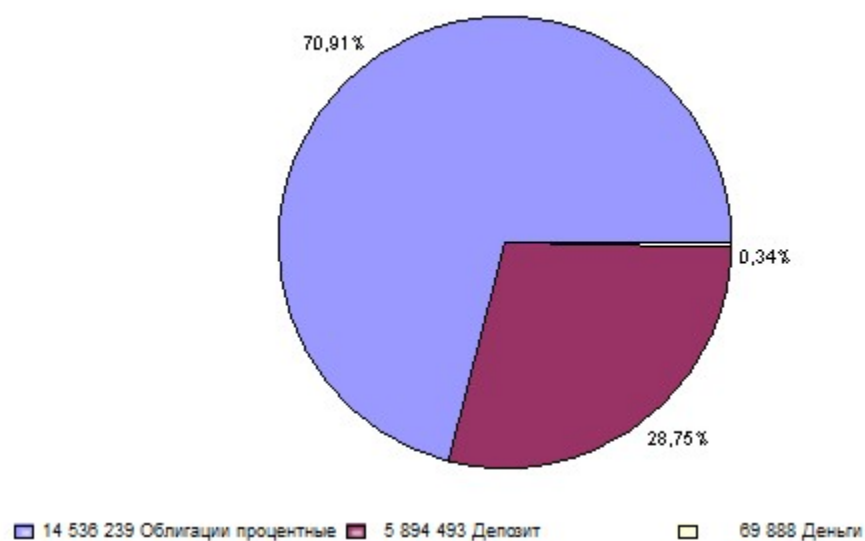


Доходность по месяцам, %

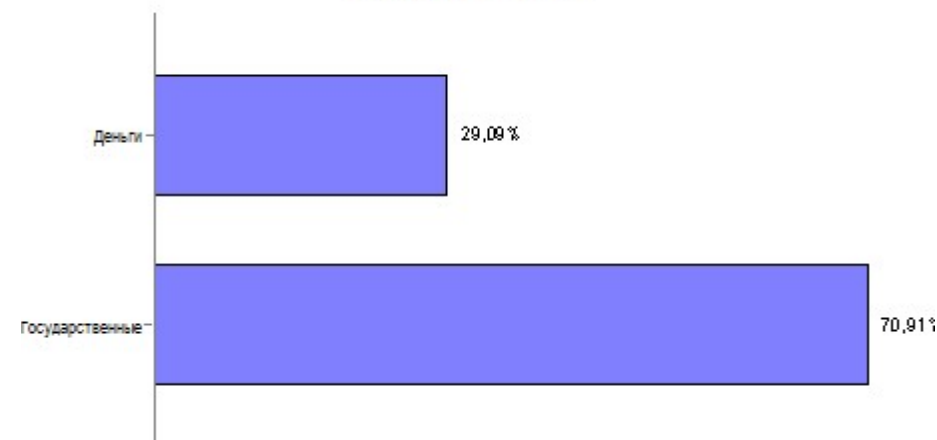


	С 01.01.2017	Посл. квартал	Посл. 30 дней
Изменение стоимости портфеля клиента TWRR, %	8,75	2,26	1,06
Изменение величины индекса RUXCbonds, %	12,19	3,05	0,96
Изменение стоимости портфеля клиента TWRR годовых, %	8,80	9,36	13,68
Изменение величины индекса RUXCbonds годовых, %	12,26	12,81	12,38
Прибыль/убытки (реализованная+нереализованная), RUR	1 872 961,99	469 032,47	214 853,69
Приток, RUR	6 506 566,69	1 100 000,00	0,00
Отток, RUR	-9 953 133,38	-4 976 566,69	0,00
Нетто, RUR	-3 446 566,69	-3 876 566,69	0,00

Структура по видам активов



Структура по отраслям



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 29.12.2017

Наименование актива	Номинал	Погашение купона	Купон, дн.	Купон	Доходность	Дюрация, в годах	Количество	Котировка	НКД на бумагу	Сумма	Доля, %
---------------------	---------	------------------	------------	-------	------------	------------------	------------	-----------	---------------	-------	---------

Денежные средства
5 964 380,72 29,09
Депозиты
5 894 493,15 28,75

Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Договор №810/77/839 от 23.03.2017	0,00			0,00	0,00	0,00	394 493,15	1,000	0,00	394 493,15	1,92
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	26,83

Остатки на счетах
69 887,57 0,34

/ Российские рубли БИРЖА	0,00			0,00	0,00	0,00	65 925,77	1,000	0,00	65 925,77	0,32
Публичное акционерное общество "БАНК УРАЛСИБ" / Российские рубли Р/С	0,00			0,00	0,00	0,00	3 961,80	1,000	0,00	3 961,80	0,02

Облигации процентные
14 536 239,37 70,91
Государственные
14 536 239,37 70,91

Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-24019-ПК	1000,00	18.04.18	182	9,13	7,63	1,67	1 999	1 026,620	18,01	2 088 215,37	10,19
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-26216-ПД	1000,00	16.05.18	182	6,70	6,77	1,33	1 500	1 000,500	8,08	1 512 870,00	7,38
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-26222-ПД	1000,00	25.04.18	182	7,10	7,30	5,44	3 500	996,820	12,64	3 533 110,00	17,23
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29006-ПК	1000,00	07.02.18	182	10,61	9,14	0,11	2 000	1 085,710	41,27	2 253 960,00	10,99
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29011-ПК	1000,00	31.01.18	182	10,43	8,31	0,09	3 100	1 042,730	42,58	3 364 461,00	16,41
Министерство финансов Российской Федерации / ОФЗ-29012-ПК	1000,00	23.05.18	182	8,95	8,10	4,05	1 700	1 040,120	9,07	1 783 623,00	8,70

ДЕПОЗИТЫ и НСО

Начало	Конец	Нач. сумма	Вал.	Ставка, %	Расчетные проценты	Тек. сумма	Тек. сумма	Банк
Итого		10 500 000,00			908 082,19	5 500 000,00	6 408 082,19	
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	394 493,15	5 500 000,00	5 894 493,15	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		554 448,70	23 390 529,82	2,43	2,43
2017-3	01.07.2017	30.09.2017	23 390 529,82			463 559,90	23 854 089,72	1,98	1,98
2017-4	01.10.2017	29.12.2017	23 854 089,72	1 100 000,00	-4 976 566,69	523 097,06	20 500 620,09	2,49	2,49
Итого 2017	01.01.2017	29.12.2017	22 074 224,79	6 506 566,69	-9 953 133,38	1 872 961,99	20 500 620,09	8,74	8,72