



: " " " " " " " "

" "

: 2010 -267 01.10.2010

" "

01.01.2016

30.12.2016

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

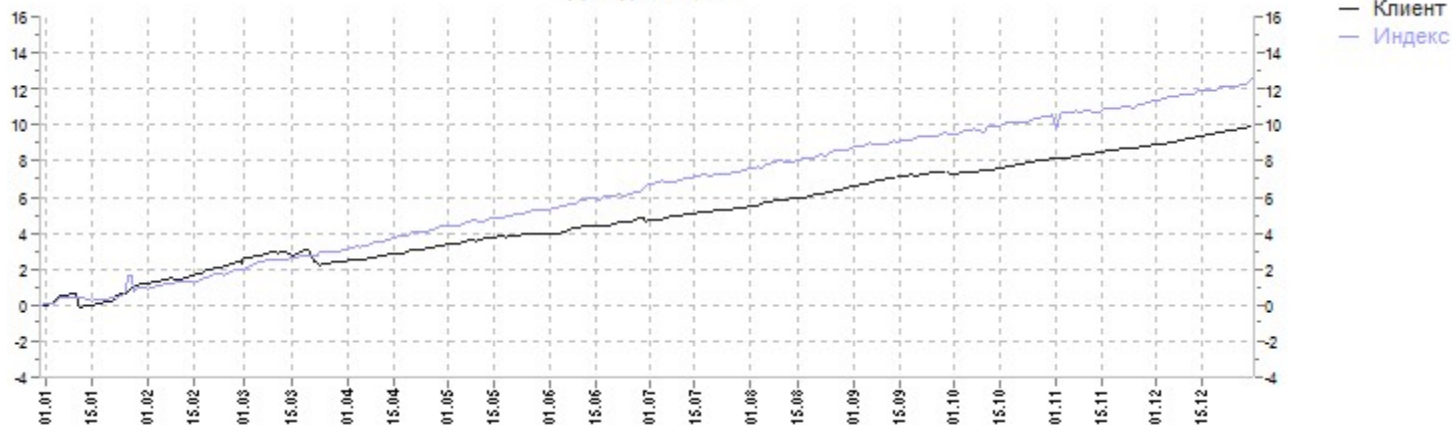


30.12.2016 .

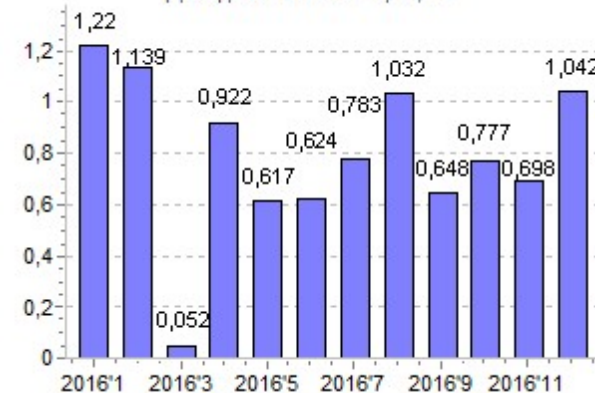
: " " " " " " "
 : 01.01.2016 – 30.12.2016
 : 22 269 206.64 ()
 :
 : USD 60,273 / EUR 63,0214
 : RUXCbonds

: 9,98
 : 0,61
 , %: 8,97
 : BB

Доходность, %

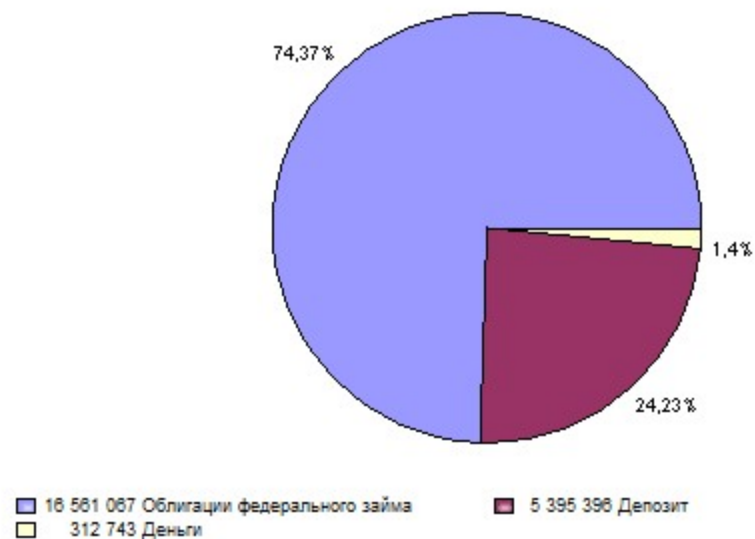


Доходность по месяцам, %

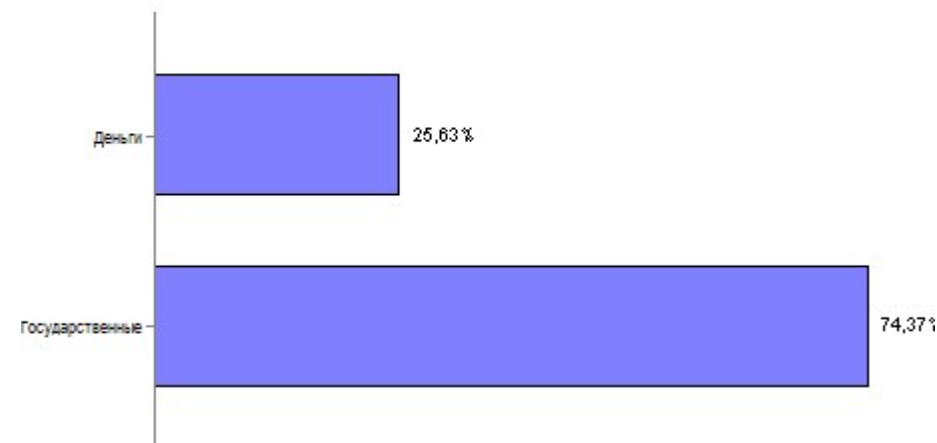


	01.01.2016	.	. 30
TWRR, %	9,98	2,54	1,04
RUXCbonds, %	12,66	2,92	1,20
TWRR, % (07-37/ -)	9,98	10,18	12,67
TWRR, %	9,98	10,57	13,44
RUXCbonds, %	12,66	12,25	15,62
/ (+), RUR	1 525 124,29	551 141,08	229 560,81
, RUR	20 450 000,00	0,00	0,00
, RUR	-22 724,00	0,00	0,00
, RUR	20 427 276,00	0,00	0,00

Структура по видам активов



Структура по отраслям





30.12.2016

												%	
												5 708 139,48 25,63	
												5 395 396,17 24,23	
()/	240316DJ52491721	24.03.2016	000			000	000	000	395 396,17	1,000	000	395 396,17	1,78
()/			000			000	000	000	5 000 000,00	1,000	000	5 000 000,00	22,45
												312 743,31 1,40	
/			000			000	000	000	312 691,22	1,000	000	312 691,22	1,40
"	" /	/	000			000	000	000	52,09	1,000	000	52,09	0,00
												16 561 067,16 74,37	
												16 561 067,16 74,37	
/	-24018-		1000,00	28.06.17	182	10,95	9,08	0,49	3109	1 018,942	0,60	3 169 756,08	14,23
/	-29011-		1000,00	01.02.17	182	11,70	10,59	0,09	3000	1 035,271	47,76	3 249 093,00	14,59
/	, 25080		1000,00	19.04.17	182	7,40	8,35	0,30	795	997,614	14,60	804 710,13	3,61
/	, 25081		1000,00	01.02.17	182	6,20	8,71	1,04	3000	977,675	25,31	3 008 955,00	13,51
/	, 26204		1000,00	16.03.17	182	7,50	8,28	1,15	2900	992,981	21,78	2 942 806,90	13,21
/	, 26206		1000,00	14.06.17	182	7,40	8,31	0,45	3386	996,685	3,24	3 385 746,05	15,20



				%,				
		5 000 000,00			396 479,45	5 000 000,00	5 396 479,45	
24.03.2016	23.03.2017	5 000 000,00	RUR	10,30	396 479,45	5 000 000,00	5 396 479,45	()

								TWR	MWR
						P&L Gross			
2016-1	01.01.2016	31.03.2016	316 806,35	20 000 000,00	-22 724,00	3 472,37	20 297 554,72	2,43	0,15
2016-2	01.04.2016	30.06.2016	20 297 554,72	250 000,00		444 823,32	20 992 378,04	2,18	2,18
2016-3	01.07.2016	30.09.2016	20 992 378,04	200 000,00		525 687,52	21 718 065,56	2,48	2,48
2016-4	01.10.2016	30.12.2016	21 718 065,56			551 141,08	22 269 206,64	2,54	2,54
2016	01.01.2016	30.12.2016	316 806,35	20 450 000,00	-22 724,00	1 525 124,29	22 269 206,64	9,98	9,50