

Оценка стоимости портфеля
высокодходных рублевых
облигаций
Angrybonds

обзор на 29.03.2019

Облигации, входящие в портфель

Эмитент	ISIN	Начало размещения	Погашения/ оферты	Кол-во	Начальный номинал, тыс. руб.	Номинальная сумма в обращении, тыс. руб.	Включение в портфель	Исключение из портфеля	Основание для исключения	Доля в портфеле на 03.12.2018	Доля в портфеле на 29.03.2019
СТРОЙКА										23,10%	11,13%
АПРИ Флай Пленнинг	RU000A0ZZ2V1	12.04.2018	11.04.2019	200 000	1	200 000	03.12.2018	11.03.2019	1 мес до погашения	6,61%	0,00%
АПРИ Флай Пленнинг	RU000A1003E6	12.02.2019	27.01.2022	200 000	1	200 000	12.03.2019			0,00%	3,55%
Жилкапинвест	RU000A0ZYSS5	06.03.2018	05.03.2021	200 000	1	200 000	03.12.2018			6,78%	3,72%
СК Легион	RU000A0ZZNV7	08.10.2018	10.10.2019	200 000	1	200 000	03.12.2018	01.03.2019	низк. ликвидность	6,74%	0,00%
ЧЗПСН-Профнастил	RU000A0ZZD39	16.07.2018	12.07.2021	200 000	1	200 000	03.12.2018			2,98%	3,87%
ЛИЗИНГ										27,56%	30,24%
Бэлти Гранд	RU000A100535	05.03.2019	01.03.2022	200000	1	200 000	11.03.2019			0,00%	3,52%
ДиректЛизинг	RU000A0ZYE96	26.10.2017	22.10.2020	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,34%	1,85%
ДиректЛизинг	RU000A0ZZ0D3	29.03.2018	25.03.2021	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,25%	1,79%
ДиректЛизинг	RU000A0ZZR90	30.10.2018	26.10.2021	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,31%	1,82%
МСБ Лизинг	RU000A0ZZUR0	21.11.2018	09.05.2021	150 000	1	150 000	21.01.2019			0,00%	2,68%
ПР-Лизинг	RU000A0ZZFP5	08.08.2018	12.02.2020	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,31%	1,83%
ПР-Лизинг	RU000A0ZZX35	10.12.2018	16.06.2020	150 000	1	150 000	10.12.2018			0,00%	2,70%
Роделен	RU000A0ZZV52	26.11.2018	10.11.2021	200 000	1	200 000	03.01.2019			0,00%	3,20%
Роял Капитал	RU000A0ZZ9X2	15.06.2018	19.06.2019	50 000	1	50 000	03.12.2018			1,71%	0,96%
Роял Капитал	RU000A0ZZWG9	04.02.2018	06.12.2019	50 000	1	50 000	03.12.2018			0,00%	0,93%
Солид-Лизинг	RU000A0ZZEA0	24.07.2018	06.08.2019	200 000	1	200 000	03.12.2018			6,62%	3,64%
Солид-Лизинг	RU000A0ZZMQ9	25.09.2018	08.10.2019	180 000	1	180 000	03.12.2018			6,03%	3,34%
Солид-Лизинг	RU000A0ZZY42	17.12.2018	30.12.2019	110 000	1	110 000	03.12.2018			0,00%	1,98%

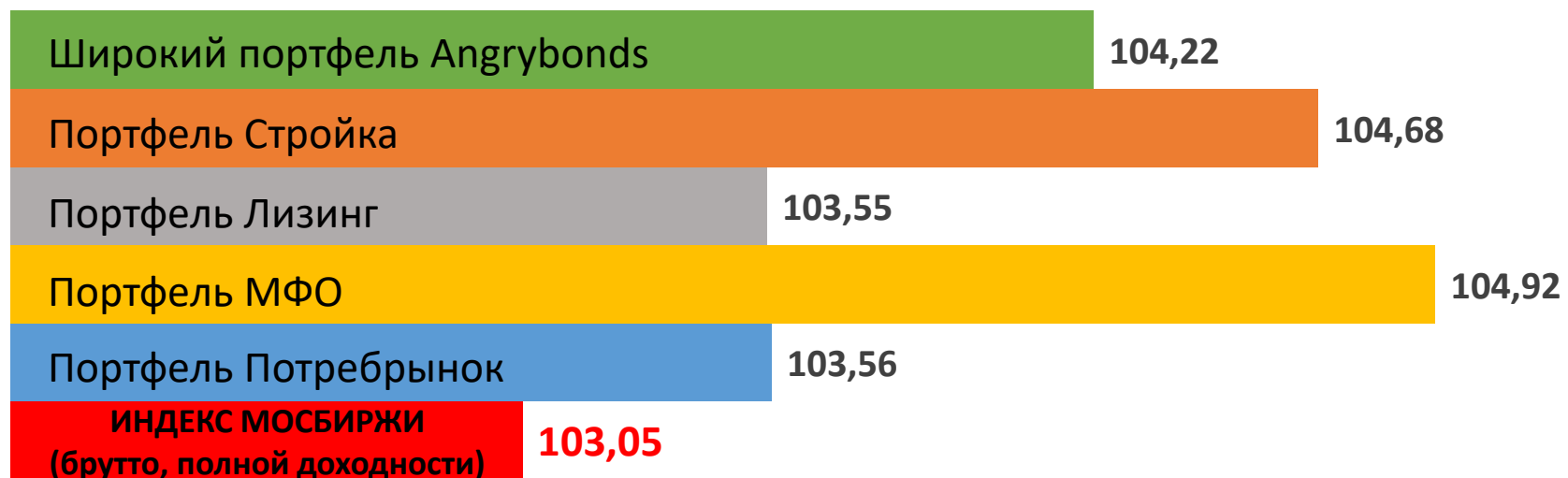
Облигации, входящие в портфель (2)

Эмитент	ISIN	Начало размещения	Погашения/ оферты	Кол-во	Начальный номинал, тыс. руб.	Номинальная сумма в обращении, тыс. руб.	Включение в портфель	Исключение из портфеля	Основание для исключения	Доля в портфеле на 03.12.2018	Доля в портфеле на 29.03.2019
МФО										29,40%	24,07%
Ломбард-Мастер	RU000A0ZZAR2	25.06.2018	24.06.2019	50 000	1	50 000	03.12.2018			1,72%	0,96%
Ломбард-Мастер	RU000A0ZZDQ8	19.07.2018	18.07.2019	50 000	1	50 000	03.12.2018			1,68%	0,95%
Ломбард-Мастер	RU000A1001K7	22.01.2019	21.01.2020	50 000	1	50 000	22.01.2019			0,00%	0,90%
Ломбард-Мастер	RU000A1004R6	27.02.2019	26.02.2020	100 000	1	100 000	03.03.2019			0,00%	1,77%
Мани Мен	RU000A0ZYJX4	08.12.2017	04.12.2020	500 000	1	500 000	03.12.2018			0,00%	4,95%
ПЮДМ	RU000A0ZZ8A2	30.05.2018	29.05.2019	3 800	50	190 000	03.12.2018			6,34%	3,52%
СЗД (Кармани)	RU000A0ZYAQ7	21.09.2017	11.10.2019	300 000	1	300 000	03.12.2018			9,79%	5,50%
СЗД (Кармани)	RU000A0ZZ1F6	06.04.2018	29.10.2020	300 000	1	300 000	03.12.2018			9,87%	5,51%
ПОТРЕБИТЕЛЬСКИЙ РЫНОК										16,64%	29,18%
Все инструменты	RU000A0ZZXT0	13.12.2018	17.12.2019	700 000	1	700 000	13.12.2018			0,00%	12,68%
Грузовичкоф-Центр	RU000A0ZZ0R3	02.04.2018	22.03.2020	1 000	50	50 000	03.12.2018	26.02.2019- 27.03.2019	прохождение оферты	1,69%	0,95%
Грузовичкоф-Центр	RU000A0ZZV03	23.11.2018	12.11.2020	4 000	10	40 000	03.12.2018			1,35%	0,76%
Дядя Денер	RU000A0ZZ7R8	25.05.2018	23.05.2019	1 200	50	60 000	03.12.2018			1,99%	1,10%
Левенгук	RU000A0ZYHW0	04.12.2017	04.03.2021	100 000	1	100 000	03.12.2018	04.02.2019- 04.03.2019	прохождение оферты	3,30%	1,86%
Мясничий	RU000A0ZZAE0	21.06.2018	25.06.2019	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,30%	1,83%
Мясничий	RU000A0ZZGZ2	20.08.2018	04.08.2021	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,29%	1,83%
ОбъединениеАгроэлита	RU000A0ZZWJ3	05.12.2018	12.02.2023	200 000	1	200 000	09.01.2019			0,00%	3,59%
ОбъединениеАгроэлита	RU000A0ZZYP6	18.12.2018	25.02.2023	200 000	1	200 000	03.01.2019			0,00%	3,61%
Светофор	RU000A0ZZQ59	23.10.2018	25.10.2019	50 000	1	50 000	03.12.2018			1,72%	0,96%
ПРОЧЕЕ										3,31%	5,39%
Нафтатранс	RU000A100303	06.02.2019	04.02.2021	12 000	10	120 000	18.02.2010			0,00%	2,14%
НЗРМ	RU000A1004Z9	01.03.2019	27.02.2020	8 000	10	80 000	04.03.2019			0,00%	1,42%
Ред Софт	RU000A0ZZ695	14.05.2018	11.05.2020	100 000	1	100 000	03.12.2018			3,31%	1,83%

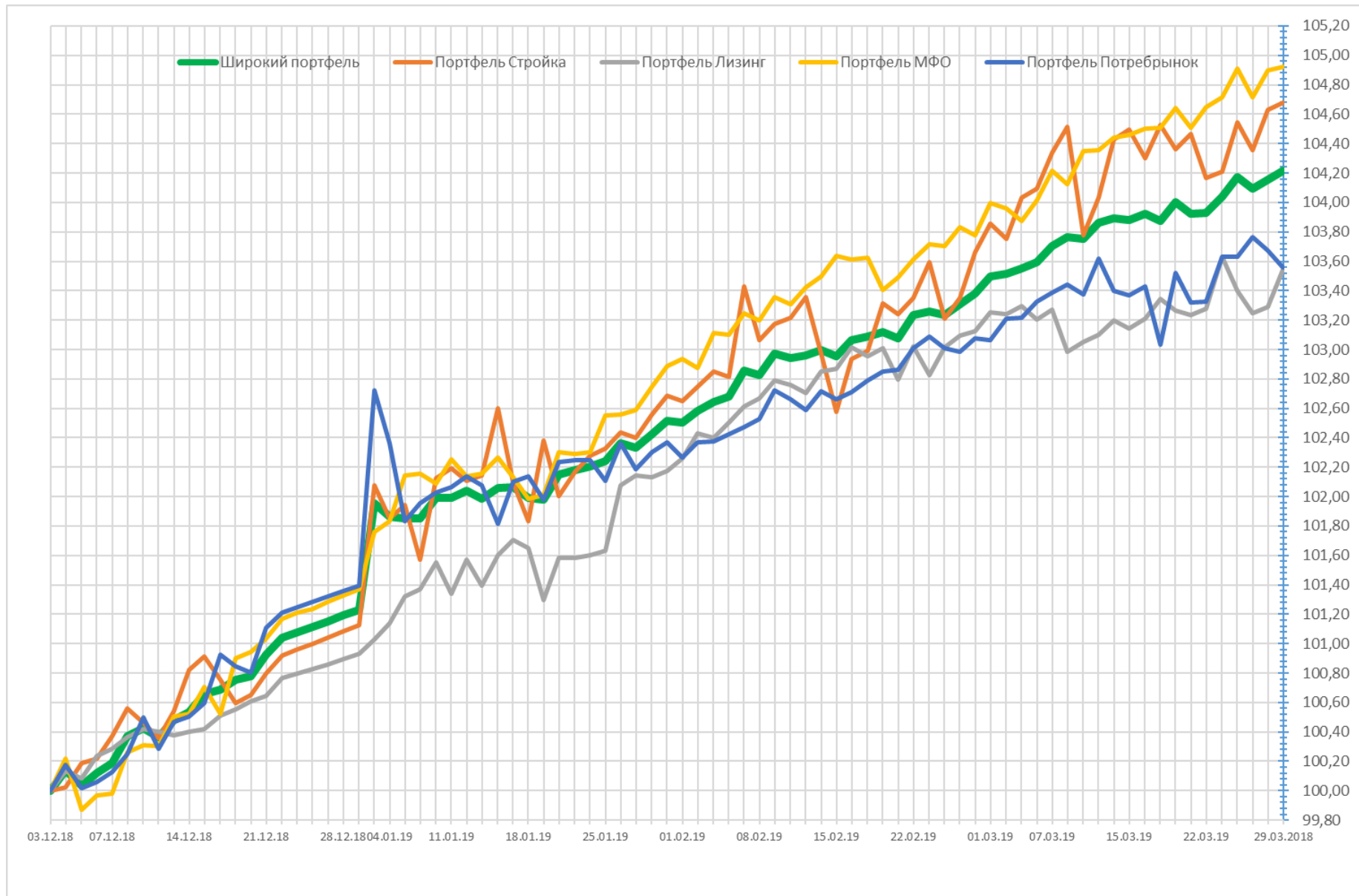
Итоги за период 03.12.2-29.03.2019

	Рост стоимости			Доходность			Дюрация		
	29.03.2019	Δ	03.12.2018	29.03.2019	Δ	03.12.2018	29.03.2019	Δ	03.12.2018
Широкий портфель	104,22	4,22%	100,00	14,64%	-1,03%	15,67%	1,009	0,051	0,958
Портфель Стройка	104,68	4,68%	100,00	16,27%	-0,84%	17,12%	1,710	0,689	1,021
Портфель Лизинг	103,55	3,55%	100,00	14,67%	0,26%	14,41%	0,912	-0,134	1,046
Портфель МФО	104,92	4,92%	100,00	15,70%	-1,58%	17,29%	0,604	-0,221	0,825
Портфель Потребрынок	103,56	3,56%	100,00	13,12%	-0,03%	13,14%	1,165	0,244	0,920

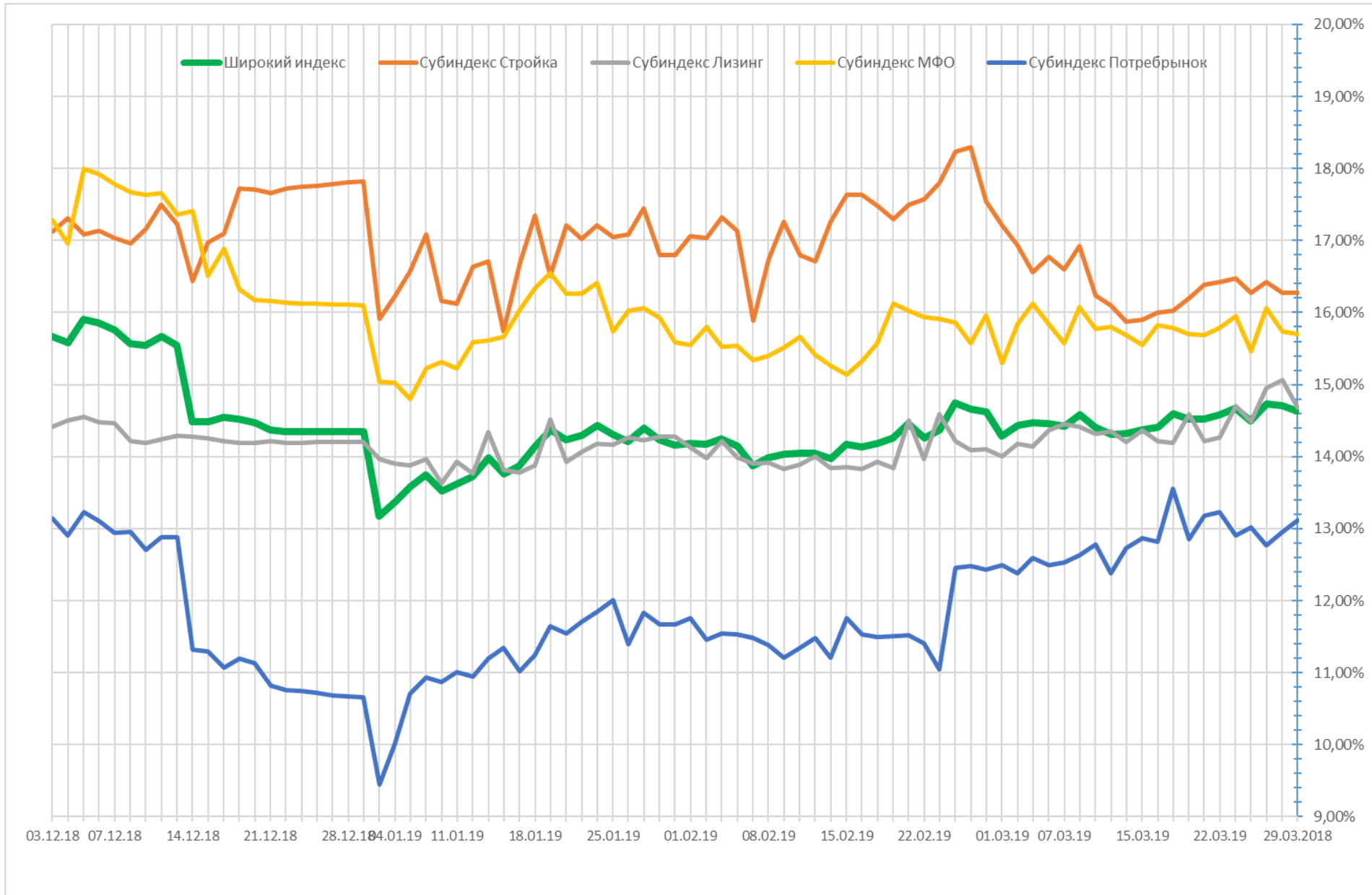
Значения индексов



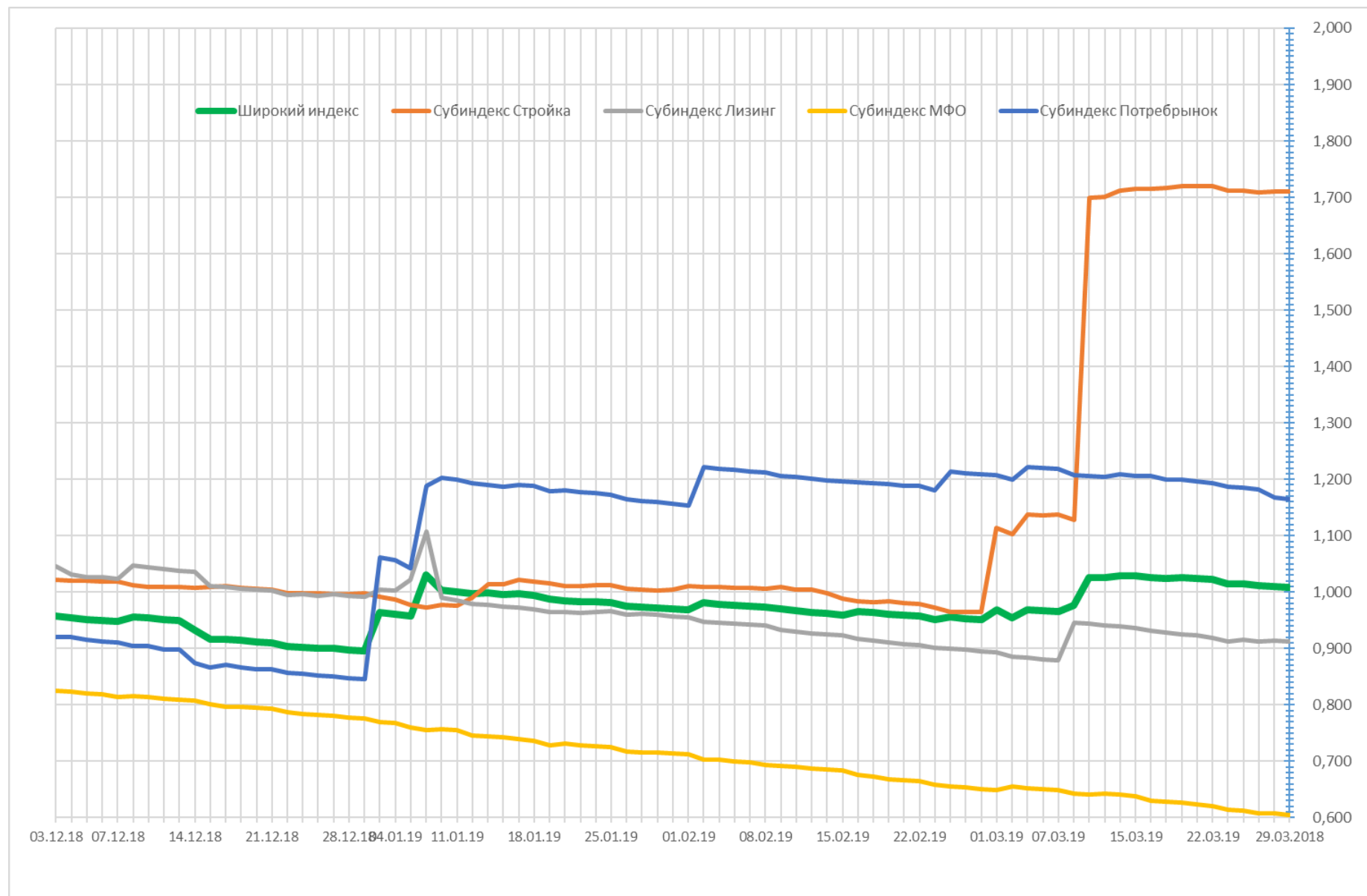
Изменение стоимость портфеля в период 03.12.18-29.03.19 (03.12.18 = 100,00)



Изменение доходности портфеля в период 03.12.18-22.03.19



Изменение дюрации портфеля в период 03.12.18-29.03.19



Соотношение доходность/дюрация портфеля в период 03.12.18-29.03.19

