

Выпуск	Погашение (оферта)	Доходность к погашению, % годовых	Ближайшая купонная выплата	Рыночная цена, % от номинала	Грязная цена, руб.	Накопленная доходность инвестирования, % годовых	Изменение индекса ОФЗ за сопоставимый промежуток времени ²⁾	
							RGBI TR ³⁾	RUGBITR3Y ⁴⁾
РСХБ БО-08Р	02.04.2020	7.22%	03.10.2019	100.70%	1 043.84	9.88%	21.80%	13.06%
РСХБ БО-01Р	25.09.2020	7.09%	27.09.2019	102.46%	1 068.07	8.37%	9.32%	8.17%
РСХБ БО-04Р	09.12.2020	7.34%	03.12.2019	101.02%	1 032.39	8.25%	9.32%	8.17%
РСХБ БО-02Р	21.06.2021	7.36%	23.12.2019	102.59%	1 044.86	8.59%	9.32%	8.17%
РСХБ БО-09Р	22.06.2021	7.39%	24.12.2019	101.44%	1 032.04	14.62%	16.75%	11.87%
РСХБ БО-03Р	28.09.2021	7.44%	01.10.2019	102.04%	1 057.91	8.40%	9.32%	8.17%
РСХБ БО-05Р	09.03.2022	7.56%	11.03.2020	99.96%	999.80	7.86%	7.88%	7.68%
РСХБ БО-06Р	14.10.2022	7.48%	18.10.2019	104.48%	1 080.80	14.28%	16.89%	11.25%
РСХБ 01Т1	бессроч. (12.04.2028)	9.38%	23.10.2019	98.82%	1 022.97	9.17%	8.81%	8.15%
РСХБ 09Т1	бессроч. (13.04.2028)	9.29%	24.10.2019	99.53%	1 029.82	9.73%	8.93%	8.14%

1) Результаты по состоянию на 12.09.2019. В список включены облигации, размещенные с 01.01.2017. Купонный доход по этим облигациям не облагается НДФЛ. Предполагается, что инвестор приобрел облигации в конце 2017 года или в дату размещения, если они были выпущены позднее.

2) Для выпусков БО-01Р-БО-04Р изменение индекса с 29.12.2017, для БО-05Р – с 14.03.2018, для БО-06Р – с 19.10.2018, для БО-08Р – с 04.04.2019, для БО-09Р – с 25.06.2019, для 01Т1 – с 25.04.2018, для 09Т1 – с 26.04.2018. Изменения индексов приведены в годовом исчислении, т.е. $\left(\frac{P_t}{P_0} - 1\right) * \frac{365}{\tau}$, где P_t – значение индекса на дату последних торгов, P_0 – значение индекса на дату размещения рассматриваемой облигации, τ – количество дней между датой последних торгов и датой размещения.

3) Индекс государственных облигаций России, рассчитываемый по методике индекса совокупного дохода (Total Return Index).

4) Индекс государственных облигаций России, рассчитываемый по методике индекса совокупного дохода с дюрацией 1-3 года.

Рыночная цена-средневзвешенная цена по итогам торгов на Московской бирже на указанную дату.

Грязная цена-сумма текущей рыночной цены в рублях и НКД на указанную дату.

Накопленный купонный доход (НКД) - сумма процентов, накопленных с даты последней выплаты купона, подлежащая уплате покупателем продавцу в момент купли/продажи облигации. Если покупка облигации происходит внутри купонного периода, то покупатель выплачивает продавцу текущую рыночную цену плюс НКД. Для облигаций, приобретаемых при первичном размещении, НКД в момент первичного размещения равен нулю.

Накопленная доходность инвестирования-показатель текущей прибыльности вложений с учетом реинвестирования купонных платежей.

Доходность к погашению (YTM)-показатель прибыльности вложений при условии приобретения облигации на указанную дату и владения ей до момента погашения.

Контакты в АО «Россельхозбанк»

**Департамент по работе на рынках капитала
Управление клиентских операций**

+7 495 651-60-91

Настоящий отчет был подготовлен аналитическим отделом АО «Россельхозбанк» (далее – Банк). Представленные в настоящем отчете оценки и мнения выражены с учетом ситуации на дату выхода отчета. Банк оставляет за собой право вносить или не вносить в данный отчет изменения и корректировки без предварительного уведомления. Настоящий отчет носит исключительно ознакомительный характер и не является предложением по покупке либо продаже ценных бумаг и не должен рассматриваться как рекомендация подобного рода действий. Представленная информация, мнения и оценки подготовлены на основе публичных источников, которые рассматриваются как надежные. Однако за достоверность предоставленной информации АО «Россельхозбанк» ответственности не несет. Инвесторам не следует полагаться исключительно на содержание данного отчета в ущерб проведению собственного анализа. Банк, его аффилированные лица и сотрудники не несут ответственности за использование данной информации, за прямой или косвенный ущерб, наступивший вследствие использования представленной в настоящем отчете информации, а также за ее достоверность. Банк осуществляет свою деятельность в Российской Федерации. Данный материал может использоваться инвесторами на территории РФ при условии соблюдения российского законодательства. Использование настоящего отчета за пределами Российской Федерации должно регулироваться законодательством той страны, в которой оно осуществляется. Банк обращает внимание на то, что инвестиции в российскую экономику и операции на финансовом рынке связаны с повышенным риском и требуют соответствующей квалификации и опыта. Распространение, копирование и изменение материалов Банка не допускается без получения предварительного письменного согласия Банка. Дополнительная информация предоставляется на основании запроса.

©2019 АО «Россельхозбанк». Все права защищены.