

aigenis ИНВЕСТИЦИОННАЯ
КОМПАНИЯ

28 мая 2026 г.



Модельный портфель облигаций



Модельный портфель облигаций сформирован только из государственных облигаций и эмитентов 1-го эшелона, что объясняется отсутствием уровня спредов, компенсирующих кредитный риск эмитента.

Портфель разделён на 2 части в зависимости от сроков погашения бумаг:

1. Короткие бумаги служат источником ликвидности при портфельном инвестировании и или аналогом срочного годового депозита. Цель — заработать столько же, сколько по депозиту, и чуть больше.
2. В средних и длинных бумагах цель — дополнительно заработать на потенциальном снижении ключевой ставки ЦБ РФ, в пользу которого говорят фундаментальные факторы: состояние экономики, данные по инфляции, крепкий рубль, коммуникация ЦБ, и рыночные факторы: заложенная в свопах ключевая ставка. Средний участок представлен преимущественно корпоративными бумагами с высоким спредом к кривой ОФЗ: «Атомэнергпром», «РЖД», или наибольшей чувствительностью к изменению ставки: «Газпромнефть», «Сбербанк». На текущих ценовых уровнях, которые учитывают вектор более медленного снижения ставок, целесообразно держать повышенную долю длинных бумаг, так как они обладают привлекательным соотношением параметра риск доходность. Плюс выбранные ОФЗ с высоким текущим купоном: ОФЗ 26253, ОФЗ 26254, наиболее защищены от возможных негативных ценовых колебаний.

Модельный портфель облигаций

ISINCode	SecName	Рейтинг выпуска	G-Spread	Цена, %	Доход к погаш., %	Дюрация, лет	Купон, %	Дата погашения	Вес
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	AAA	15	87,2	13,97	3,5	9,5	28-08-30	15,0%
SU26254RMFS1	ОФЗ 26254	AAA	0	92,64	14,72	6,55	13	03-10-40	15,0%
SU26253RMFS3	ОФЗ 26253	AAA	6	92,99	14,72	6,22	13	06-10-38	15,0%
RU000A10BK17	ГазпнЗР15R	AAA	51	65	14,44	3,72	2	11-04-30	11,0%
RU000A10EJQ7	Атомэнпр11	AAA	127	102,44	14,55	2,79	14,7	07-12-29	8,0%
RU000A109X37	Сбер Sbd3R	AAA	70	62,16	14,52	3,51	0	12-11-29	8,0%
RU000A0JTU85	РЖД-28 обл	AAA	138	106,4	14,53	1,63	18,1	21-03-28	6,0%
RU000A0JUAN8	РЖД-30 обл	AAA	147	103,65	14,7	2,16	15,98	07-11-28	6,0%
RU000A10EML2	ВТБЛИЗ 1P5	AA	199	101,69	15,1	1,25	15,5	04-03-29	5,5%
RU000A10B214	РостелP15R	AAA	95	104,08	14,23	0,75	18,75	02-03-27	5,5%
RU000A102A15	СПБГОЗ35003	AAA	132	94,67	14,6	0,71	6,05	13-04-27	5,0%
ИТОГО						14,52	3,72		

Контактная информация



Владимир Седых

Доверительный управляющий ООО ИК "Айгенис"

- С 2006 года — в сфере доверительного управления. Эксперт в области российского долгового и денежного рынков
- Сертификаты ФСФР 1.0 и 5.0
- Начал карьеру управляющим сразу после окончания СПбГУ по специальности «Финансовая математика»

Первый же подопечный облигационный ПИФ вошёл в ТОП-5 по доходности за 5 лет к 2012 году. Более 10 лет работал в крупных УК («Ингосстрах Инвестиции», «ТКБ Инвестментс Партнерс»), управляя активами институциональных и частных инвесторов, включая пенсионные фонды, с устойчивым превышением бенчмарков.

В ООО ИК «Айгенис» отвечает за авторскую стратегию доверительного управления на долговом рынке, основанную на многолетнем успешном опыте.

ООО ИК «Айгенис»

info@aigenis.ru
+7 (495) 21 21 101

123112, Москва,
Пресненская наб., д.12,
оф.9.5 (башня Федерация)

ООО ИК «Айгенис» (ИНН 9729319955, ОГРН 1227700088142), место нахождения: 123112, г. Москва, Вн. тер. г. Муниципальный округ Пресненский, Наб. Пресненская, д. 12, оф. 9.5, осуществляет свою деятельность на рынке ценных бумаг в соответствии со следующими лицензиями: - профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности № 045-14147-100000 от 02 августа 2022 г. Выдана Банком России; - профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности № 045-14148-010000 от 02 августа 2022 г. Выдана Банком России; - профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности № 045-14149-000100 от 02 августа 2022 г. Выдана Банком России; - профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 045-14150-001000 от 02 августа 2022 г. Выдана Банком России. ООО ИК «Айгенис» внесено в Единый реестр инвестиционных советников. Информация, связанная с деятельностью ООО ИК «Айгенис», в том числе по выпуску цифровых финансовых активов (далее - ЦФА), публикуется в сети Интернет по адресу: <https://www.aigenis.ru> (далее - Сайт). На указанном Сайте также размещены актуальные на конкретный момент времени условия предоставления брокерских и иных услуг. Адрес электронной почты для направления обращений: info@aigenis.ru Порядок направления обращений (жалоб) указан на страницах регулирующих органов в сети Интернет. Наименование и контакты регулирующего органа и саморегулируемой организации: Центральный банк Российской Федерации <https://www.cbr.ru/> Национальная ассоциация участников фондового рынка (СРО НАУФОР) <https://www.naufor.ru/> Любые опубликованные материалы и/или сведения не являются исчерпывающим изложением актуальных событий финансового или коммерческого характера и не могут быть использованы в таком качестве. Информация, содержащаяся в опубликованных материалах, не должна рассматриваться как совет или индивидуальная инвестиционная рекомендация, как предложение о покупке или продаже каких-либо финансовых инструментов, ЦФА или оказания услуг какому-либо лицу, как oferta и/или публичная oferta по какому бы то ни было действующему законодательству, как приглашение или стимул к покупке или продаже определенных ценных бумаг, финансовых инструментов и/или ЦФА, или упоминание ценных бумаг, финансовых инструментов и/или ЦФА могут не подлежать продаже во всех юрисдикциях или определенных категориях инвесторов. Опубликованная информация не может рассматриваться в качестве гарантии или обещания в будущем доходности вложений. Прошлые показатели доходности вложений не являются гарантией будущих результатов. Стоимость инвестиций может упасть или вырасти, при этом инвестор может потерять внесенные денежные средства в полном объеме. Финансовые инструменты, ЦФА, продукты и/или услуги, упоминаемые в информационных материалах, могут быть ограничены в обороте и не предназначены для широкого круга инвесторов. ООО ИК «Айгенис» стремится получать информацию из надежных источников, но не несет ответственности, если такая информация окажется неточной, неполной или недостоверной. До приобретения финансовых инструментов и/или ЦФА необходимо внимательно ознакомиться с условиями их обращения и возможными рисками. ООО ИК «Айгенис» информирует о том, что ЦФА являются высокорискованными активами, их приобретение может привести к потере внесенных денежных средств. Для совершения операций с ЦФА необходимо изучить правила информационной системы и понимать экономическую и юридическую природу ЦФА. ООО ИК «Айгенис» не может гарантировать, что финансовые инструменты, ЦФА, продукты и услуги, описанные или упомянутые в настоящих материалах, подходят всем лицам, которые ознакомились с такими материалами, в том числе в соответствии с их инвестиционным профилем. Инвестиции в ценные бумаги и/или ЦФА не являются банковским депозитом, связанные с ним риски не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации». Возврат инвестиций и/или доходность вложений в ценные бумаги и/или ЦФА не гарантированы государством. Опубликованные материалы и содержащаяся в них сведения предназначены исключительно для внимания лиц, которым они адресованы, в информационных целях. Опубликованные материалы и/или сведения не могут воспроизводиться, передаваться или распространяться без предварительного письменного разрешения ООО ИК «Айгенис».