

Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, паевыми фондами по управлению ценными бумагами
 Закрытое акционерное общество "Газпромбанк-Управление активами"
 Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, паевыми фондами по управлению ценными бумагами
 № 045.12879.09.10.00 от 26.01.2010.
 119049, г. Москва, Коровин Вал. Ул. Дом № 7

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам на 09.01.2018

Инвестор: Ассоциация СРО ОАУ «Лидер»
 Договор: НО-24КФ

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. по бал.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / Дата исполнения контракта	Уровень	Duration	УТМ
РП 40701840300000016 (ISD)	Деньги	20 727.36	20 727.36	1 193 900.08	1 193 900.08		4.64%	09.01.2018			1 193 900.08	4.63%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)				1 193 900.08	1 193 900.08		4.64%				1 193 900.08	4.63%				
По всем Деньги	Деньги у брокера рас.	2 711.13	2 711.13	2 711.13	2 711.13		0.01%			1 000 000 000.00	2 711.13	0.01%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)	Расчеты	-182 116.41	-182 116.41	-182 116.41	-182 116.41		0.01%			1 000 000 000.00	2 711.13	0.01%				
Газпромбанк - Управление активами	Расчеты	-21 394.02	-21 394.02	-21 394.02	-21 394.02		-0.71%			1 000 000 000.00	-182 116.41	-0.71%				
Всего по Расчеты				-21 394.02	-21 394.02		-0.08%				-21 394.02	-0.08%				
Всего по Расчеты				-203 510.43	-203 510.43		-0.79%				-203 510.43	-0.79%				
25081R1MFS 093 25081	Облигации Фед.	7 500.00	7 500.00	1 000.55	7 504.125 00	157 931.69	29.89%	09.01.2018		1 000 070 000 000.00	7 500 000.00	29.85%	31.01.2018	IOBлгация	22.00	5.82
25081R1MFS 093 25081	Купон			25.65	192 375.00	192 375.00	29.89%	09.01.2018		27 180 000.00	208 850.00	29.86%	31.01.2018	IOBлгация	65.00	6.26
Всего по 25081R1MFS 093 25081		2 500.00	2 500.00	1 002.76	7 696 500.00	6 612.52				1 001 960 000 000.00	7 704 375.00		15.03.2018	IOBлгация	85.00	6.26
26201R1MFS 093 26201	Купон			22.19	2 506 900.00	39 025.00				24 040 000.00	60 100.00		15.03.2018	IOBлгация		
Всего по 26201R1MFS 093 26201		1 300.00	1 300.00	990.16	2 562 375.00	49 637.52	9.85%	09.01.2018		995 230 000 000.00	2 565 075.00	9.84%	27.05.2020	IOBлгация	814.00	6.73
26214R1MFS 093 26214	Купон			6.14	1 297 212.36	1 297 212.36				7 900 000.00	1 298 799.00		30.05.2018	IOBлгация		
Всего по 26214R1MFS 093 26214		9 897.00	9 897.00	1 000.61	1 295 840.20	43 912.10	5.03%	09.01.2018		1 300 000 000.00	9 347.00	5.05%	15.05.2019	IOBлгация	6.73	6.73
26216R1MFS 093 26216	Купон			8.81	9 677 465.24	18 694.40				10 021 310 000 000.00	9 829 145.97		16.05.2018	IOBлгация	474.00	6.60
Всего по 26216R1MFS 093 26216		3 248.00	3 248.00	1 042.73	9 677 465.24	62 596.90	37.58%	09.01.2018		10 021 310 000 000.00	9 829 145.97	37.62%	29.01.2020	IOBлгация	607.00	6.60
29011R1MFS 093 29011	Купон			43.15	140 151.20	140 151.20	13.70%	09.01.2018		45 720 000.00	148 498.56	13.68%	31.01.2018	IOBлгация	8.38	8.38
Всего по 29011R1MFS 093 29011				24 758 313.12	24 758 313.12	165 127.69	96.14%				24 809 146.67	96.15%				
Всего по Минфин России				24 758 313.12	24 758 313.12	165 127.69	96.14%				24 809 146.67	96.15%				6.76
По всем облигации Фед				25 751 413.90	25 751 413.90	165 127.69	100.00%				25 802 247.45	100.00%				3.76

Приrost с начала года: 53 846.15 RUB

Доходность с начала года на 09.01.2018 0:00:00: 8.48 % годовых

Заместитель генерального директора -
 Главный операционный директор



Саморукова О.Р.