

Закрое акционерное общество "Газпромбанк-Управление активами"
 Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00657 от 15.09.2009; Лицензия на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 045-12879-001000 от 26.01.2010
 119049, г. Москва, Коровий Вал ул. дом № 7

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
 на 24.01.2018

Инвестор: Ассоциация СРО ОАУ «Лидер»
 Договор: HO-24/KO

Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. лист.	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	Duraton	УТМ
№ 407014107000000089 (RUB) 2501IRMS OФЗ 2501	Деньги	4	88,57	88,57	88,57		0,00%	9			88,57	0,00%	14	15		17
№ 407014107000000015 (USD) 2501IRMS OФЗ 2501	Деньги	20 727,36	20 727,36	1 193 989,65	1 193 989,65		4,64%	24.01.2018			1 189 281,47	4,53%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)				1 193 989,65	1 193 989,65		4,64%				1 189 351,04	4,53%				
По всем Деньги				562,29	562,29		0,00%				562,29	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)				562,29	562,29		0,00%				562,29	0,00%				
По всем Деньги у брокера				7 303,00	7 303,00		0,00%				7 303,00	0,00%				
2501IRMS OФЗ 2501	Облигации Фэд	7 303,00	7 303,00	1 000,56	7 303,00	153 716,36	4,63%	24.01.2018		899,8500000000	7 303,00	29,14%	31.01.2018	1-Облигации	7,00	6,11
2501IRMS OФЗ 2501	Купон	-	-	25,00	187 321,96	187 321,96	29,09%	24.01.2018		29 730,0000	217 118,19	29,14%	31.01.2018	1-Облигации		6,71
2501IRMS OФЗ 2501	Облигации Фэд	2 000,00	2 000,00	891,74	341 040,31	341 040,31	7,75%	24.01.2018		993,9600000000	1 967 860,00	7,75%	27.05.2020	1-Облигации	799,00	6,80
2501IRMS OФЗ 26214	Купон	-	-	6,94	1 863 477,22	1 863 477,22	15,69%	24.01.2018		9 820,0000	19 840,00	15,69%	30.05.2018	1-Облигации	459,00	6,78
2501IRMS OФЗ 26214	Облигации Фэд	11 433,00	11 433,00	1 000,60	11 439 883,41	43 912,10	44,82%	24.01.2018		1000,1300000000	2 007 600,00	44,82%	15.05.2019	1-Облигации	651,00	6,78
2501IRMS OФЗ 26216	Купон	-	-	9,23	105 472,72	18 684,40	13,69%	24.01.2018		12,850000	146 914,05	13,69%	16.05.2018	1-Облигации		8,71
2501IRMS OФЗ 26011	Облигации Фэд	3 248,00	3 248,00	1 042,73	3 385 787,04	62 596,50	95,36%	24.01.2018		1024,7200000000	11 581 400,34	95,36%	29.01.2020	1-Облигации	4,06	4,06
2501IRMS OФЗ 26011	Купон	-	-	43,15	1 140 151,20	140 151,20		24.01.2018		50,010000	3 385 770,56		31.01.2018	1-Облигации		8,71
Всего по Минфин России				24 563 986,19	24 563 986,19	169 127,69	95,36%				24 631 226,12	95,47%				
По всем облигации Фэд				25 758 538,13	25 758 538,13	169 127,69	100,00%				25 801 139,45	100,00%				

Пример с начала года: 52 740,15 RUB

Доходность с начала года на 24.01.2018 0.00.00: 3,12 % годовых

Заместитель генерального директора –
 Главный операционный директор



Саморукова О.Р.