Закрытое 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 28.02.2018

Инвестор: Ассоциация СРО ОАУ «Лидер»

Договор: НО-24/КФ

Финансовый инструмент	Тип вложения	Коли-чество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. ст-ти	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	YTM
1	3	4	4.1	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
P/c 40701810700000000069 (RUB)	Деньги	58 590,00	58 590,00	58 590,00	58 590,00		0,20%			1.0000000000	58 590,00	0,20%				
P/c 40701840300000000015 (USD)	Деньги	20 727,36	20 727,36	1 153 927,37	1 153 927,37		4,03%	28.02.2018		55.6717000000	1 153 927,37	4,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**1 212 517,37**		**4.24%**				**1 212 517,37**	**4.20%**				
По всем Деньги					**1 212 517,37**		**4,24%**				**1 212 517,37**	**4,20%**				
Деньги у брокера, p/c 30601810400001028890 (RUB)	Деньги у брокера	5 402,96	5 402,96	5 402,96	5 402,96		0,02%			1.0000000000	5 402,96	0,02%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**5 402,96**		**0.02%**				**5 402,96**	**0.02%**				
По всем Деньги у брокера					**5 402,96**		**0,02%**				**5 402,96**	**0,02%**				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-4 396,01	-4 396,01	-4 396,01	-4 396,01					1.0000000000	-4 396,01					
Всего по Расчеты					**-4 396,01**		**-0,02%**				**-4 396,01**	**-0,02%**				
По всем Расчеты					**-4 396,01**		**-0,02%**				**-4 396,01**	**-0,02%**				
26214RMFS ОФЗ 26214	Облигации Фед	5 500,00	5 500,00	993,30	5 463 131,07			28.02.2018		1002.1000000000	5 511 550,00		27.05.2020	I-Облигации	765,00	6,40
26214RMFS ОФЗ 26214	Купон	-	-	10,11	55 596,00			28.02.2018		15,960000	87 780,00		30.05.2018	I-Облигации		
Всего по 26214RMFS ОФЗ 26214					*5 518 727,07*		*19,29%*				*5 599 330,00*	*19,40%*				*6,40*
26216RMFS ОФЗ 26216	Облигации Фед	11 433,00	11 433,00	1 000,60	11 439 883,41	43 912,10		28.02.2018		1004.6600000000	11 486 277,78		15.05.2019	I-Облигации	424,00	6,37
26216RMFS ОФЗ 26216	Купон	-	-	9,23	105 472,72	18 684,40		28.02.2018		19,280000	220 428,24		16.05.2018	I-Облигации		
Всего по 26216RMFS ОФЗ 26216					*11 545 356,13*	*62 596,50*	*40,35%*				*11 706 706,02*	*40,57%*				*6,37*
29011RMFS ОФЗ 29011	Облигации Фед	3 248,00	3 248,00	1 042,73	3 386 787,04	24 976,49		28.02.2018		1032.1100000000	3 352 293,28		29.01.2020	I-Облигации	655,00	7,27
29011RMFS ОФЗ 29011	Купон	-	-					28.02.2018		6,870000	22 313,76		01.08.2018	I-Облигации		
Всего по 29011RMFS ОФЗ 29011					*3 386 787,04*	*24 976,49*	*11,84%*				*3 374 607,04*	*11,69%*				*7,27*
Всего по Минфин России					**20 450 870,24**		**71,47%**				**20 680 643,06**	**71,67%**				**6,68**
По всем Облигации Фед					**20 450 870,24**		**71,47%**				**20 680 643,06**	**71,67%**				**6,68**
4B02-02-00207-A Акрон БО-2	Облигации	966,00	966,00	1 010,17	975 820,99			28.02.2018		1011.1000000000	976 722,60		20.11.2018	II-Облигации	257,00	7,58
4B02-02-00207-A Акрон БО-2	Купон	-	-	20,69	19 986,54			28.02.2018		24,680000	23 840,88		22.05.2018	II-Облигации		
Всего по ПАО "Акрон"					**995 807,53**		**3.48%**				**1 000 563,48**	**3.47%**				**7.58**
4-03-36420-R Лента 3 об	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 023,17	1 023 168,80			28.02.2018		1005.0000000000	1 005 000,00		25.02.2020	I-Облигации	181,00	11,80
4-03-36420-R Лента 3 об	Купон	-	-					28.02.2018		0,320000	320,00		28.08.2018	I-Облигации		
Всего по ООО "Лента"					**1 023 168,80**		**3.58%**				**1 005 320,00**	**3.48%**				**11.80**
4B02-06-36276-R МираторБО-6	Облигации	971,00	971,00	1 043,17	1 012 920,10			28.02.2018		1042.1000000000	1 011 879,10		23.04.2021	II-Облигации	393,00	10,65
4B02-06-36276-R МираторБО-6	Купон	-	-	34,19	33 198,49			28.02.2018		40,770000	39 587,67		27.04.2018	II-Облигации		
Всего по ООО "Мираторг Финанс"					**1 046 118,59**		**3.66%**				**1 051 466,77**	**3.64%**				**10,65**
4010017OB РН БАНК 01	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 011,17	1 011 166,83			28.02.2018		1011.0000000000	1 011 000,00		09.07.2021	II-Облигации	129,00	10,24
4010017OB РН БАНК 01	Купон	-	-	9,12	9 120,00			28.02.2018		15,390000	15 390,00		07.07.2018	II-Облигации		
Всего по АО "РН Банк"					**1 020 286,83**		**3.57%**				**1 026 390,00**	**3.56%**				**10,24**
4B02-01-00122-A РоснефтьБ1	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 015,17	1 015 167,49			28.02.2018		1018.0000000000	1 018 000,00		06.02.2024	II-Облигации	341,00	8,70
4B02-01-00122-A РоснефтьБ1	Купон	-	-	0,24	240,00			28.02.2018		3,660000	3 660,00		14.08.2018	II-Облигации		
Всего по ПАО "НК "Роснефть"					**1 015 407,49**		**3.55%**				**1 021 660,00**	**3.54%**				**8,70**
421033498 РСХБ 21	Облигации	800,00	800,00	1 011,37	809 093,47			28.02.2018		1011.1000000000	808 880,00		18.07.2023	I-Облигации	146,00	9,96
421033498 РСХБ 21	Купон	-	-	6,03	4 824,00			28.02.2018		9,860000	7 888,00		24.07.2018	I-Облигации		
Всего по АО «Россельхозбанк»					**813 917,47**		**2.84%**				**816 768,00**	**2.83%**				**9,96**
4B0201035008001P ФолксвБ1P1	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 003,67	1 003 665,58			28.02.2018		1003.1000000000	1 003 100,00		17.10.2023	II-Облигации	44,00	9,95
4B0201035008001P ФолксвБ1P1	Купон	-	-	31,41	31 410,00			28.02.2018		37,320000	37 320,00		13.04.2018	II-Облигации		
Всего по ООО "ФОЛЬКСВАГЕН БАНК РУС"					**1 035 075,58**		**3.62%**				**1 040 420,00**	**3.61%**				**9,95**
По всем Облигации					**6 949 782,29**		**24,29%**				**6 962 588,25**	**24,13%**				**9,84**
	ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:				**28 614 176,85**		**100,00%**				**28 856 755,63**	**100,00%**			**6,35**	**6,35**

Прирост с начала года: 278 356,33 RUB

Доходность с начала года на 28.02.2018 0:00:00: 6,4 % годовых

Заместитель генерального директора – Главный операционный директор

Саморукова О.Р.

Затрутина О.Б.