

Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными 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, Хоровый Вал ул, дом № 7

Закрое акционерное общество "Газпромбанк-Управление активами"

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
на 30.11.2017

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

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 переоценки, RUB	Процент от всего по бал. с/д-м	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
RU-40701640300000000015 (USD)	Денеж	20 727,36	20 727,36	1 209 049,71	1 209 049,71		4,81%	30.11.2017		58 331 000,00	1 209 049,71	4,70%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					1 209 049,71		4,81%				1 209 049,71	4,70%				
По всем Денеж					1 209 049,71		4,81%				1 209 049,71	4,70%				
Денеж у брокера, р/с 30001810400001028860 (RUB)	Денеж у брокера	838,82	838,82	838,82	838,82		0,00%			1 000 000 000,00	838,82	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					838,82		0,00%				838,82	0,00%				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-19 533,12	-19 533,12	-19 533,12	-19 533,12		-0,08%			1 000 000 000,00	-19 533,12	-0,08%				
Всего по Расчеты					-19 533,12		-0,08%				-19 533,12	-0,08%				
По всем Денеж у брокера					838,82		0,00%				838,82	0,00%				
25091RIFMS Oq3 25091	Облигации Фед	15 000,00	15 000,00	979,46	14 691,951 39	150 300,00	58,99%	30.11.2017		998 280 000 000,00	14 691,951 39	59,36%	31.01.2018	Облигации	62,00	7,17
25091RIFMS Oq3 26204	Купон	-	-	10,02	14 442 231,39	150 300,00	58,99%	30.11.2017		20 380 000,00	14 442 231,39	59,36%	31.01.2018	Облигации	105,00	7,17
26216RIFMS Oq3 26216	Купон	-	-	6,58	25 372,16		14,21%	30.11.2017		1001 190 000 000,00	25 372,16	14,04%	15.03.2018	Облигации	7,07	
26216RIFMS Oq3 26216	Купон	-	-	0,03	3 875 789,61		8,46%	30.11.2017		15 820 000,00	3 875 789,61	8,43%	15.05.2019	Облигации	513,00	7,21
26216RIFMS Oq3 26216	Купон	-	-	0,03	2 132 820,95		13,58%	30.11.2017		2 750 000,00	2 132 820,95	13,53%	15.05.2018	Облигации	706,00	8,69
26216RIFMS Oq3 26216	Купон	-	-	16,86	3 361 810,95	54 761,28	13,58%	30.11.2017		3 401 572,23	3 361 810,95	13,53%	31.01.2018	Облигации	6,69	
29011RIFMS Oq3 29011	Купон	-	-	16,86	3 416 571,83	54 761,28	13,58%	30.11.2017		3 461 333,11	3 416 571,83	13,53%	31.01.2018	Облигации	6,69	
Всего по Минфин России					23 968 505,46		95,27%				24 543 151,44	95,37%				
По всем Облигации Фед					23 968 505,46		95,27%				24 543 151,44	95,37%				
Всего по всем вложениям					25 168 860,87		100,00%				25 733 506,85	100,00%			4,31	4,31

Прирост с начала года: 1 626 506,85 RUB

Доходность с начала года на 30.11.2017 0,00,00, 8,56 % годовых

Заместитель генерального директора –
Главный операционный директор



Саморукова О.Р.