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 30.04.2018

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 |
| Р/с 40701810700000000069 (RUB) | Деньги | 58 104,64 | 58 104,64 | 58 104,64 | 58 104,64 | | 0,20% | | | 1,0000000000 | 58 104,64 | 0,20% | | | | |
| Р/с 40701840300000000015 (USD) | Деньги | 15 545,36 | 15 545,36 | 963 807,66 | 963 807,66 | | 3,31% | 30.04.2018 | | 61,9997000000 | 963 807,66 | 3,29% | | | | |
| **Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)** | | | | | **1 021 912,30** | | **3,51%** | | | | **1 021 912,30** | **3,49%** | | | | |
| **По всем Деньги** | | | | | **1 021 912,30** | | **3,51%** | | | | **1 021 912,30** | **3,49%** | | | | |
| Деньги у брокера, р/с 30601810400001028890 (RUB) | Деньги у брокера | 11 066,96 | 11 066,96 | 11 066,96 | 11 066,96 | | 0,04% | | | 1,0000000000 | 11 066,96 | 0,04% | | | | |
| **Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)** | | | | | **11 066,96** | | **0,04%** | | | | **11 066,96** | **0,04%** | | | | |
| **По всем Деньги у брокера** | | | | | **11 066,96** | | **0,04%** | | | | **11 066,96** | **0,04%** | | | | |
| Газпромбанк - Управление активами ЗАО | Расчеты | -9 144,12 | -9 144,12 | -9 144,12 | -9 144,12 | | | | | 1,0000000000 | -9 144,12 | | | | | |
| **Всего по Расчеты** | | | | | **-9 144,12** | | **-0,03%** | | | | **-9 144,12** | **-0,03%** | | | | |
| **По всем Расчеты** | | | | | **-9 144,12** | | **-0,03%** | | | | **-9 144,12** | **-0,03%** | | | | |
| 26214RMFS ОФЗ 26214 | Облигации Фед | 5 800,00 | 5 800,00 | 993,32 | 5 761 227,25 | | | 30.04.2018 | | 998,1000000000 | 5 788 980,00 | | 27.05.2020 | I-Облигации | 703,00 | 6,61 |
| 26214RMFS ОФЗ 26214 | Купон | | - | 21,57 | 125 115,00 | 62 049,00 | | 30.04.2018 | | 26,650000 | 154 570,00 | | 30.05.2018 | I-Облигации | | |
| *Всего по 26214RMFS ОФЗ 26214* | | | | | *5 886 342,25* | *62 049,00* | *20,22%* | | | | *5 943 550,00* | *20,31%* | | | | *6,61* |
| 26216RMFS ОФЗ 26216 | Облигации Фед | 11 495,00 | 11 495,00 | 1 000,62 | 11 502 170,54 | 43 912,10 | | 30.04.2018 | | 1003,4400000000 | 11 534 542,80 | | 15.05.2019 | I-Облигации | 363,00 | 6,43 |
| 26216RMFS ОФЗ 26216 | Купон | | - | 24,97 | 287 030,15 | 199 024,15 | | 30.04.2018 | | 30,470000 | 350 252,65 | | 16.05.2018 | I-Облигации | | |
| *Всего по 26216RMFS ОФЗ 26216* | | | | | *11 789 200,69* | *242 936,25* | *40,49%* | | | | *11 884 795,45* | *40,62%* | | | | *6,43* |
| 29011RMFS ОФЗ 29011 | Облигации Фед | 3 248,00 | 3 248,00 | 1 042,73 | 3 386 787,04 | 24 976,49 | | 30.04.2018 | | 1026,8600000000 | 3 335 241,28 | | 29.01.2020 | I-Облигации | 594,00 | 7,43 |
| 29011RMFS ОФЗ 29011 | Купон | | - | 14,48 | 47 031,04 | 47 031,04 | | 30.04.2018 | | 21,850000 | 70 968,80 | | 01.08.2018 | I-Облигации | | |
| *Всего по 29011RMFS ОФЗ 29011* | | | | | *3 433 818,08* | *72 007,53* | *11,79%* | | | | *3 406 210,08* | *11,64%* | | | | *7,43* |
| **Всего по Минфин России** | | | | | **21 109 361,02** | | **72,50%** | | | | **21 234 555,53** | **72,57%** | | | | **6,82** |
| **По всем Облигации Фед** | | | | | **21 109 361,02** | | **72,50%** | | | | **21 234 555,53** | **72,57%** | | | | **6,82** |
| 4B02-02-00207-A Акрон БО-2 | Облигации | 966,00 | 966,00 | 1 010,17 | 975 820,99 | | | 30.04.2018 | | 1010,0000000000 | 975 660,00 | | 20.11.2018 | II-Облигации | 196,00 | 7,32 |
| 4B02-02-00207-A Акрон БО-2 | Купон | | - | 32,41 | 31 308,06 | 11 321,52 | | 30.04.2018 | | 39,890000 | 38 533,74 | | 22.05.2018 | II-Облигации | | |
| **Всего по ПАО "Акрон"** | | | | | **1 007 129,05** | | **3,46%** | | | | **1 014 193,74** | **3,47%** | | | | **7,32** |
| 4-07-00013-A Башнефть07 | Облигации | 500,00 | 500,00 | 1 026,17 | 513 084,65 | | | 30.04.2018 | | 1025,9000000000 | 512 950,00 | | 31.01.2023 | I-Облигации | 601,00 | 8,34 |
| 4-07-00013-A Башнефть07 | Купон | | - | 17,46 | 8 730,00 | | | 30.04.2018 | | 20,120000 | 10 060,00 | | 07.08.2018 | I-Облигации | | |
| **Всего по ПАО АНК "Башнефть"** | | | | | **521 814,65** | | **1,79%** | | | | **523 010,00** | **1,79%** | | | | **8,34** |
| 4-03-36420-R Лента 3 об | Облигации | 1 000,00 | 1 000,00 | 1 023,17 | 1 023 168,80 | | | 30.04.2018 | | 1016,2000000000 | 1 016 200,00 | | 25.02.2020 | I-Облигации | 120,00 | 11,03 |
| 4-03-36420-R Лента 3 об | Купон | | - | 10,30 | 10 300,00 | 10 300,00 | | 30.04.2018 | | 19,960000 | 19 960,00 | | 28.08.2018 | I-Облигации | | |
| **Всего по ООО "Лента"** | | | | | **1 033 468,80** | | **3,55%** | | | | **1 036 160,00** | **3,54%** | | | | **11,03** |
| 4B02-06-36276-R МираторФБО-6 | Облигации | 971,00 | 971,00 | 1 043,17 | 1 012 920,10 | | | 30.04.2018 | | 1036,0000000000 | 1 005 956,00 | | 23.04.2021 | II-Облигации | 351,00 | 10,83 |
| 4B02-06-36276-R МираторФБО-6 | Купон | | - | | | | | 30.04.2018 | | 0,990000 | 961,29 | | 26.10.2018 | II-Облигации | | |
| **Всего по ООО "Мираторг Финанс"** | | | | | **1 012 920,10** | | **3,48%** | | | | **1 006 917,29** | **3,44%** | | | | **10,83** |
| 401001708 РН БАНК 01 | Облигации | 1 000,00 | 1 000,00 | 1 011,17 | 1 011 166,83 | | | 30.04.2018 | | 1008,0000000000 | 1 008 000,00 | | 09.07.2021 | II-Облигации | 68,00 | 10,33 |
| 401001708 РН БАНК 01 | Купон | | - | 24,22 | 24 220,00 | 15 100,00 | | 30.04.2018 | | 32,770000 | 32 770,00 | | 07.07.2018 | II-Облигации | | |
| **Всего по АО "РН Банк"** | | | | | **1 035 386,83** | | **3,56%** | | | | **1 040 770,00** | **3,56%** | | | | **10,33** |
| 4B02-01-00122-A РоснефтьБ1 | Облигации | 1 000,00 | 1 000,00 | 1 015,17 | 1 015 167,49 | | | 30.04.2018 | | 1012,0000000000 | 1 012 000,00 | | 06.02.2024 | II-Облигации | 280,00 | 8,83 |
| 4B02-01-00122-A РоснефтьБ1 | Купон | | - | 11,22 | 11 220,00 | 10 980,00 | | 30.04.2018 | | 18,530000 | 18 530,00 | | 14.08.2018 | II-Облигации | | |
| **Всего по ПАО "НК "Роснефть"** | | | | | **1 026 387,49** | | **3,52%** | | | | **1 030 530,00** | **3,52%** | | | | **8,83** |
| 421033498 РСХБ 21 | Облигации | 800,00 | 800,00 | 1 011,37 | 809 093,47 | | | 30.04.2018 | | 1006,5000000000 | 805 200,00 | | 18.07.2023 | I-Облигации | 85,00 | 10,07 |
| 421033498 РСХБ 21 | Купон | | - | 18,36 | 14 688,00 | 9 864,00 | | 30.04.2018 | | 26,580000 | 21 264,00 | | 24.07.2018 | I-Облигации | | |
| **Всего по АО «Россельхозбанк»** | | | | | **823 781,47** | | **2,83%** | | | | **826 464,00** | **2,82%** | | | | **10,07** |
| 4B02-03-65018-D ФСК ЕЭС Б3 | Облигации | 514,00 | 514,00 | 1 018,17 | 523 338,34 | | | 30.04.2018 | | 1016,2000000000 | 522 326,80 | | 06.09.2052 | I-Облигации | 1 391,00 | 7,84 |
| 4B02-03-65018-D ФСК ЕЭС Б3 | Купон | | - | | | | | 30.04.2018 | | 2,120000 | 1 089,68 | | 20.07.2018 | I-Облигации | | |
| **Всего по ПАО "ФСК ЕЭС"** | | | | | **523 338,34** | | **1,80%** | | | | **523 416,48** | **1,79%** | | | | **7,84** |
| **По всем Облигации** | | | | | **6 984 226,73** | | **23,99%** | | | | **7 001 461,51** | **23,93%** | | | | **9,32** |
| | **ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:** | | | | **29 117 422,89** | | **100,00%** | | | | **29 259 852,18** | **100,00%** | | | **6,34** | **6,34** |

Прирост с начала года: 681 452,88 RUB

Доходность с начала года на 30.04.2018 0:00:00: 7,44 % годовых

Заместитель генерального директора –
Главный операционный директор

"Газпромбанк - Управление активами"

Саморукова О.Р.