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 31.05.2018

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	185 811,93	185 811,93	185 811,93	185 811,93		0,63%			1,0000000000	185 811,93	0,63%				
P/c 40701840300000000015 (USD)	Деньги	15 545,36	15 545,36	973 041,60	973 041,60		3,32%	31.05.2018		62,5937000000	973 041,60	3,31%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**1 158 853,53**		**3,96%**				**1 158 853,53**	**3,95%**				
По всем Деньги					**1 158 853,53**		**3,96%**				**1 158 853,53**	**3,95%**				
Деньги у брокера, p/c 30601810400001028890 (RUB)	Деньги у брокера	44 821,60	44 821,60	44 821,60	44 821,60		0,15%			1,0000000000	44 821,60	0,15%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**44 821,60**		**0,15%**				**44 821,60**	**0,15%**				
По всем Деньги у брокера					**44 821,60**		**0,15%**				**44 821,60**	**0,15%**				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-11 600,08	-11 600,08	-11 600,08	-11 600,08					1,0000000000	-11 600,08					
Всего по Расчеты					**-11 600,08**		**-0,04%**				**-11 600,08**	**-0,04%**				
По всем Расчеты					**-11 600,08**		**-0,04%**				**-11 600,08**	**-0,04%**				
26214RMFS ОФЗ 26214	Облигации Фед	5 823,00	5 823,00	993,34	5 784 190,10			31.05.2018		995,2500000000	5 795 340,75		27.05.2020	I-Облигации	694,00	6,78
26214RMFS ОФЗ 26214	Купон		-					31.05.2018		0,180000	1 048,14		28.11.2018	I-Облигации		
Всего по 26214RMFS ОФЗ 26214					*5 784 190,10*		*19,75%*				*5 796 388,89*	*19,73%*				*6,78*
26216RMFS ОФЗ 26216	Облигации Фед	11 923,00	11 923,00	1 000,61	11 930 326,77	43 912,10		31.05.2018		1000,3200000000	11 926 815,36		15.05.2019	I-Облигации	343,00	6,75
26216RMFS ОФЗ 26216	Купон		-	0,04	470,80			31.05.2018		2,750000	32 788,25		14.11.2018	I-Облигации		
Всего по 26216RMFS ОФЗ 26216					*11 930 797,57*	*43 912,10*	*40,73%*				*11 959 603,61*	*40,72%*				*6,75*
29011RMFS ОФЗ 29011	Облигации Фед	3 248,00	3 248,00	1 042,73	3 386 787,04	24 976,49		31.05.2018		1026,0800000000	3 332 707,84		29.01.2020	I-Облигации	563,00	7,40
29011RMFS ОФЗ 29011	Купон		-	14,48	47 031,04	47 031,04		31.05.2018		29,460000	95 686,08		01.08.2018	I-Облигации		
Всего по 29011RMFS ОФЗ 29011					*3 433 818,08*	*72 007,53*	*11,72%*				*3 428 393,92*	*11,67%*				*7,40*
Всего по Минфин России					**21 148 805,75**		**72,20%**				**21 184 386,42**	**72,12%**				**6,98**
По всем Облигации Фед					**21 148 805,75**		**72,20%**				**21 184 386,42**	**72,12%**				**6,98**
4B02-02-00207-A Акрон БО-2	Облигации	966,00	966,00	1 010,17	975 820,99			31.05.2018		1008,4000000000	974 114,40		20.11.2018	II-Облигации	173,00	7,35
4B02-02-00207-A Акрон БО-2	Купон		-					31.05.2018		2,240000	2 163,84		20.11.2018	II-Облигации		
Всего по ПАО "Акрон"					**975 820,99**		**3,33%**				**976 278,24**	**3,32%**				**7,35**
4-07-00013-A БашнефтьО7	Облигации	500,00	500,00	1 026,17	513 084,65			31.05.2018		1025,0000000000	512 500,00		31.01.2023	I-Облигации	570,00	8,35
4-07-00013-A БашнефтьО7	Купон		-	17,46	8 730,00			31.05.2018		27,640000	13 820,00		07.08.2018	I-Облигации		
Всего по ПАО АНК "Башнефть"					**521 814,65**		**1,78%**				**526 320,00**	**1,79%**				**8,35**
4-03-36420-R Лента 3 об	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 023,17	1 023 168,80			31.05.2018		1009,6000000000	1 009 600,00		25.02.2020	I-Облигации	89,00	11,42
4-03-36420-R Лента 3 об	Купон		-	10,30	10 300,00	10 300,00		31.05.2018		29,940000	29 940,00		28.08.2018	I-Облигации		
Всего по ООО "Лента"					**1 033 468,80**		**3,53%**				**1 039 540,00**	**3,54%**				**11,42**
4B02-06-36276-R МиратФБО-6	Облигации	971,00	971,00	1 043,17	1 012 920,10			31.05.2018		1029,8000000000	999 935,80		23.04.2021	II-Облигации	320,00	11,05
4B02-06-36276-R МиратФБО-6	Купон		-					31.05.2018		11,180000	10 855,78		26.10.2018	II-Облигации		
Всего по ООО "Мираторг Финанс"					**1 012 920,10**		**3,46%**				**1 010 791,58**	**3,44%**				**11,05**
401001708 РН БАНК 01	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 011,17	1 011 166,83			31.05.2018		1002,9000000000	1 002 900,00		09.07.2021	II-Облигации	37,00	10,53
401001708 РН БАНК 01	Купон		-	24,22	24 220,00	15 100,00		31.05.2018		41,600000	41 600,00		07.07.2018	II-Облигации		
Всего по АО "РН Банк"					**1 035 386,83**		**3,53%**				**1 044 500,00**	**3,56%**				**10,53**
4B02-01-00122-A РоснефтьБ1	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 015,17	1 015 167,49			31.05.2018		1012,0000000000	1 012 000,00		06.02.2024	II-Облигации	249,00	8,83
4B02-01-00122-A РоснефтьБ1	Купон		-	11,22	11 220,00	10 980,00		31.05.2018		26,090000	26 090,00		14.08.2018	II-Облигации		
Всего по ПАО "НК "Роснефть"					**1 026 387,49**		**3,50%**				**1 038 090,00**	**3,53%**				**8,83**
42103349B РСХБ 21	Облигации	800,00	800,00	1 011,37	809 093,47			31.05.2018		1005,3000000000	804 240,00		18.07.2023	I-Облигации	54,00	10,10
42103349B РСХБ 21	Купон		-	18,36	14 668,00	9 864,00		31.05.2018		35,070000	28 056,00		24.07.2018	I-Облигации		
Всего по АО «Россельхозбанк»					**823 761,47**		**2,81%**				**832 296,00**	**2,83%**				**10,10**
4B02-03-65018-D ФСК ЕЭС Б3	Облигации	514,00	514,00	1 018,17	523 338,34			31.05.2018		1019,0000000000	523 766,00		06.09.2052	I-Облигации	1 362,00	7,82
4B02-03-65018-D ФСК ЕЭС Б3	Купон		-					31.05.2018		8,710000	4 476,94		20.07.2018	I-Облигации		
Всего по ПАО "ФСК ЕЭС"					**523 338,34**		**1,79%**				**528 242,94**	**1,80%**				**7,82**
По всем Облигации					**6 952 918,67**		**23,74%**				**6 996 058,76**	**23,82%**				**9,43**
	ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:				**29 293 799,47**		**100,00%**				**29 372 520,23**	**100,00%**			**6,42**	**6,42**

Прирост с начала года: 794 120,93 RUB

Доходность с начала года на 31.05.2018 0:00:00: 6,87 % годовых

Заместитель генерального директора –
Главный операционный директор

"Газпромбанк - Управление активами"

Саморукова О.Р.