

Э.М. У.К.

Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, публичными инвестиционными фондами № 045-12879-03/1000 от 26.01.2010.
119048, г. Москва, Коровий Вал ул, дом № 7

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
на 31.12.2017

Инвестор: Ассоциация СРО ОАУ «Лидер»
Договор: HO-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 переоценка, RUB	Процент от всего по б.п. сл.г.г.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка Т бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / Дата исполнения контракта	Уровень	Duration	УТМ
РК-4070164030000000015 (USD)	Депозит	20 727,36	20 727,36	1 193 900,08	1 193 900,08		4,64%	31.12.2017		57 602000000	1 193 900,08	4,64%		15	16	17
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					1 193 900,08		4,64%				1 193 900,08	4,64%				
По всем Деньги					1 193 900,08		4,64%				1 193 900,08	4,64%				
Деньги у брокера, РК-30001610400001028880 (RUB)	Деньги у брокера	677,17	2 711,13	677,17	677,17		0,00%			1 000 000 000	677,17	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					677,17		0,00%				677,17	0,00%				
По всем Деньги у брокера					677,17		0,00%				677,17	0,00%				
Закрытое Акционерное Общество "Газпромбанк - Управление активами"	Расчеты	-182 116,41	-182 116,41	-182 116,41	-182 116,41		-0,71%			1 000 000 000	-182 116,41	-0,71%				
Всего по Расчеты					-182 116,41		-0,71%				-182 116,41	-0,71%				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-21 394,02	-21 394,02	-21 394,02	-21 394,02		-0,08%			1 000 000 000	-21 394,02	-0,08%				
Всего по Расчеты					-21 394,02		-0,08%				-21 394,02	-0,08%				
По всем Расчеты					-203 510,43		-0,79%				-203 510,43	-0,79%				
25091RPMFS OJQ3 25081	Облигации Фед.	15 000,00	7 500,00	1 000,55	15 000,00	316 318,61	59,78%	29.12.2017		1000 5000000000	384 750,00	59,78%	31.01.2018	Облигации	33,00	5,37
25091RPMFS OJQ3 25081	Купон			25,65	384 750,00	384 750,00		31.12.2017		25 650,00	384 750,00		31.01.2018	Облигации		5,37
25091RPMFS OJQ3 25081	Облигации Фед.	2 500,00	2 500,00	1 002,76	2 500,00	6 812,52	9,95%	29.12.2017		1000 7800000000	2 500,00	9,95%	15.03.2018	Облигации	76,00	6,05
25091RPMFS OJQ3 25081	Купон			22,19	55 475,00	55 475,00		31.12.2017		22 180,00	55 475,00		15.03.2018	Облигации		6,05
26216RPMFS OJQ3 26204	Облигации Фед.	3 246,00	9 567,00	1 000,50	2 592 375,00	45 637,52	12,72%	29.12.2017		1000 5000000000	2 592 375,00	12,72%	15.05.2019	Облигации	485,00	6,75
26216RPMFS OJQ3 26216	Купон			8,44	3 247 620,00	43 912,10		31.12.2017		8 440,00	3 247 620,00		15.05.2019	Облигации		6,75
29011RPMFS OJQ3 29011	Облигации Фед.	3 246,00	3 246,00	1 042,73	3 275 019,24	18 894,40	13,70%	29.12.2017		1042 7300000000	3 275 019,24	13,70%	29.01.2020	Облигации	678,00	8,92
29011RPMFS OJQ3 29011	Купон			43,15	140 151,20	140 151,20		31.12.2017		43 150,00	140 151,20		31.01.2018	Облигации		8,32
Всего по Минфин России					24 757 332,48		96,15%				24 757 332,48	96,15%				6,62
По всем Облигации Фед					24 757 332,48		96,15%				24 757 332,48	96,15%				6,62
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:					25 748 399,30		100,00%				25 748 399,30	100,00%			3,31	3,31

Прирост с начала года: 1 841 399,3 RUB
Доходность с начала года на 31.12.2017 0,00.00, 7,87 % годовых

Заместитель генерального директора –
Главный операционный директор



Саморукова О.Р.

Затрутина О.Б.