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 03.10.2017

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 40701840300000000015 (USD)	Деньги	20 727,36	20 727,36	1 202 537,17	1 202 537,17		4,79%	03.10.2017		57.8134000000	1 198 319,15	4,71%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**1 202 537,17**		**4,79%**				**1 198 319,15**	**4,71%**				
По всем Деньги					**1 202 537,17**		**4,79%**				**1 198 319,15**	**4,71%**				
Деньги у брокера, р/с 30601810400001028890 (RUB)	Деньги у брокера	753,81	753,81	753,81	753,81		0,00%			1.0000000000	753,81	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**753,81**		**0,00%**				**753,81**	**0,00%**				
По всем Деньги у брокера					**753,81**		**0,00%**				**753,81**	**0,00%**				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-15 649,64	-15 649,64	-15 649,64	-15 649,64					1.0000000000	-15 649,64					
Всего по Расчеты					**-15 649,64**		**-0,06%**				**-15 649,64**	**-0,06%**				
По всем Расчеты					**-15 649,64**		**-0,06%**				**-15 649,64**	**-0,06%**				
24019RMFS ОФЗ 24019	Облигации Фед	3 327,00	3 327,00	1 014,20	3 374 237,51			03.10.2017		1027.2800000000	3 417 760,56		16.10.2019	I-Облигации	660,00	7,81
24019RMFS ОФЗ 24019	Купон		-	46,51	154 738,77	154 522,87		03.10.2017		47,360000	157 566,72		16.10.2017	I-Облигации		
Всего по 24019RMFS ОФЗ 24019					*3 528 976,28*	*154 522,87*	*14,07%*				*3 575 327,28*	*14,06%*				*7,81*
25081RMFS ОФЗ 25081	Облигации Фед	15 000,00	15 000,00	979,46	14 691 931,39			03.10.2017		995.2200000000	14 928 300,00		31.01.2018	I-Облигации	120,00	7,74
25081RMFS ОФЗ 25081	Купон		-	10,02	150 300,00	150 300,00		03.10.2017		10,530000	157 950,00		31.01.2018	I-Облигации		
Всего по 25081RMFS ОФЗ 25081					*14 842 231,39*	*150 300,00*	*59,16%*				*15 086 250,00*	*59,34%*				*7,74*
26216RMFS ОФЗ 26216	Облигации Фед	2 104,00	2 104,00	980,23	2 062 398,72			03.10.2017		989.0300000000	2 080 919,12		15.05.2019	I-Облигации	554,00	7,55
26216RMFS ОФЗ 26216	Купон		-	24,97	52 536,88	25 414,40		03.10.2017		25,520000	53 694,08		15.11.2017	I-Облигации		
Всего по 26216RMFS ОФЗ 26216					*2 114 935,60*	*25 414,40*	*8,43%*				*2 134 613,20*	*8,40%*				*7,55*
29011RMFS ОФЗ 29011	Облигации Фед	3 248,00	3 248,00	1 035,04	3 361 810,55			03.10.2017		1042.6800000000	3 386 624,64		29.01.2020	I-Облигации	765,00	8,55
29011RMFS ОФЗ 29011	Купон		-	16,86	54 761,28	54 761,28		03.10.2017		17,720000	57 554,56		31.01.2018	I-Облигации		
Всего по 29011RMFS ОФЗ 29011					*3 416 571,83*	*54 761,28*	*13,62%*				*3 444 179,20*	*13,55%*				*8,55*
Всего по Минфин России					**23 902 715,10**		**95,27%**				**24 240 369,68**	**95,35%**				**7,91**
По всем Облигации Фед					**23 902 715,10**		**95,27%**				**24 240 369,68**	**95,35%**				**7,91**
	ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:				**25 090 356,44**		**100,00%**				**25 423 793,00**	**100,00%**			**4,52**	**4,52**

Прирост с начала года: 1 516 793 RUB

Доходность с начала года на 03.10.2017 0:00:00: 8,64 % годовых

Заместитель генерального директора –
Главный операционный директор

Саморукова О.Р.