

Закрывшее акционерное общество "Газпромбанк-Управление активами"
 Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и государственными 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 01.10.2017

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

Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценки, RUB	Процент от всего по бал. с.п.п.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / Дата исполнения контракта	Уровень	Duration	УТМ
PK 4070184000000000015 (USD)	3	20 727,36	20 727,36	1 202 537,17	1 202 537,17		4,79%	01.10.2017		58,0168000000	4,73%				
По всем Газпромбанк (Акционерное общество)				1 202 537,17	1 202 537,17		4,79%				4,73%				
По всем Деньги				1 202 537,17	1 202 537,17		4,79%				4,73%				
Деньги у брокера, РС 30801810400001028890 (RUB)	Денеж у брокера	753,81	753,81	753,81	753,81		0,00%			1,0000000000	0,00%				
По всем Деньги у брокера				753,81	753,81		0,00%				0,00%				
По всем Газпромбанк (Акционерное общество)				753,81	753,81		0,00%				0,00%				
Газпромбанк - Управление активами, ЗАО	Расчеты	-15 649,64	-15 649,64	-15 649,64	-15 649,64		-0,06%			1,0000000000	-0,06%				
По всем Расчеты				-15 649,64	-15 649,64		-0,06%				-0,06%				
По всем Расчеты				-15 649,64	-15 649,64		-0,06%				-0,06%				
2401RBMFS OB3 24019	Облигация Фед. Купон	3 327,00	3 327,00	1 014,20	3 327,00	154 522,87	14,07%	29.09.2017	3 418 891,55	1027 6500000000	14,06%	18.10.2019	I-Облигации	694,00	7,80
2401RBMFS OB3 24019	Купон			46,51						46,790000		18.10.2017	I-Облигации		
25081RBMFS OB3 25081	Облигация Фед. Купон	15 000,00	15 000,00	979,46	14 691,91	154 822,87	14,07%	29.09.2017	3 474 667,88	995 3500000000	14,06%	31.01.2018	I-Облигации	124,00	7,69
25081RBMFS OB3 25081	Купон			10,02						10,190000		31.01.2018	I-Облигации		
2621RBMFS OB3 26216	Облигация Фед. Купон	2 104,00	2 104,00	980,23	1 482,23	25 414,40	9,16%	29.09.2017	3 889 248,64	989 5400000000	9,16%	18.05.2019	I-Облигации	558,00	7,51
2621RBMFS OB3 26216	Купон			24,97						25,150000		15.11.2017	I-Облигации		
2901RBMFS OB3 29011	Облигация Фед. Купон	3 248,00	3 248,00	1 035,04	3 248,00	54 761,28	8,43%	29.09.2017	5 703,20	1 043 1800000000	8,43%	29.01.2020	I-Облигации	769,00	8,53
2901RBMFS OB3 29011	Купон			16,95						17,150000		31.01.2018	I-Облигации		
По всем Минфин России				23 902 715,10	23 902 715,10	54 761,28	13,62%				13,55%				
По всем Облигациям Фед				23 902 715,10	23 902 715,10	54 761,28	95,27%				95,27%				
По всем вложениям:				25 090 356,44	25 090 356,44		100,00%				100,00%			4,50	4,50

Прирост с начала года: 1 517 262,82 RUB

Доходность с начала года на 01.10.2017 0:00:00: 8,71 % годовых

Заместитель генерального директора –
 Главный операционный директор



Саморукова О.Р.