

Закрытое акционерное общество "Газпромбанк-Управление активами"  
Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-00-1-00657 от 15.09.2009. Лицензия на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 045-12879-001000 от 26.01.2010.  
119049, г. Москва, Корольев Вал ул., дом № 7

**Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам**  
на 31.12.2017

Инвестор: АССОЦИАЦИЯ "ДМСО"  
Договор: НО-11КФ

Финансовый инструмент	Тип вложения	Кол-во	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в той числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. котир.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / исполнения контракта	Уровень	Duratio	УТМ
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
Депозит у Брокера пр-м 300101610000010174661 (RUB)	Депозит у Брокера	801.44	4.1	801.44	801.44		0.00%			1.0000000000	801.44	0.00%				
<b>Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)</b>					<b>801.44</b>		<b>0.00%</b>				<b>801.44</b>	<b>0.00%</b>				
<b>По всем Деньги у Брокера</b>					<b>801.44</b>		<b>0.00%</b>				<b>801.44</b>	<b>0.00%</b>				
Частичное Акционерное Общество "Аптекари" - Удешевление активов	Расчеты	-225 048.42	-225 048.42	-225 048.42	-225 048.42		-0.83%			1.0000000000	-225 048.42	-0.83%				
<b>Всего по Расчеты</b>					<b>-225 048.42</b>		<b>-0.83%</b>				<b>-225 048.42</b>	<b>-0.83%</b>				
Газпромбанк - Удешевление активов ЗАО	Расчеты	-24 978.11	-24 978.11	-24 978.11	-24 978.11		-0.99%			1.0000000000	-24 978.11	-0.99%				
<b>По всем Расчеты</b>					<b>-24 978.11</b>		<b>-0.99%</b>				<b>-24 978.11</b>	<b>-0.99%</b>				
<b>По всем Расчеты</b>					<b>-250 024.53</b>		<b>-0.92%</b>				<b>-250 024.53</b>	<b>-0.92%</b>				
272011RUB.S.OBJ 25081	Облигации деп.	13 737.00	7 000.00	1 000.95	13 744 503.35	221 043.79	51.99%	29.12.2017	340 492.12	1000 5590000000	13 744 555.26	51.99%	31.01.2018	1.Облигации	33.00	5.37
25081RUB.S.OBJ 25081	Купон			25.00	252 259.12	862 718.67	51.99%	29.12.2017	21 650.00	21 650.00	14 998 809.40	51.99%	31.01.2018	1.Облигации	78.00	5.37
<b>Всего по 25081RUB.S.OBJ 25081</b>					<b>14 996 809.40</b>	<b>862 718.67</b>	<b>51.99%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>3 081 200.00</b>	<b>1002 7900000000</b>	<b>14 998 809.40</b>	<b>51.99%</b>	<b>15.03.2018</b>	<b>1.Облигации</b>	<b>78.00</b>	<b>6.05</b>
272011RUB.S.OBJ 26081	Облигации деп.	3 000.00	3 000.00	1 000.36	3 014 570.02	46 833.00	11.34%	29.12.2017	66 570.00	1000 5000000000	3 014 570.02	11.34%	15.05.2018	1.Облигации	480.00	6.75
26081RUB.S.OBJ 26081	Купон			22.10	2 992 000.00	54 765.62	11.34%	29.12.2017	2 074 860.00	4 440.00	4 182 090.00	11.34%	18.05.2018	1.Облигации	480.00	6.75
<b>Всего по 26081RUB.S.OBJ 26081</b>					<b>4 190.00</b>	<b>54 765.62</b>	<b>11.34%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>26 279.20</b>	<b>8 440.00</b>	<b>4 178 269.20</b>	<b>11.34%</b>	<b>29.01.2018</b>	<b>1.Облигации</b>	<b>480.00</b>	<b>6.75</b>
272011RUB.S.OBJ 28016	Облигации деп.	3 800.00	3 800.00	1 042.73	3 862 374.03	43 190.00	15.55%	31.12.2017	3 982 374.00	1042 7300000000	3 862 374.00	15.55%	31.01.2018	1.Облигации	0.78 00	8.32
28016RUB.S.OBJ 28016	Купон			43.19	193 970.00	191 479.16	15.22%	29.12.2017	1 053 970.00	4 126 344.00	4 126 344.00	15.22%	29.01.2018	1.Облигации	25.00	8.32
<b>Всего по 28016RUB.S.OBJ 28016</b>					<b>4 126 344.00</b>	<b>191 479.16</b>	<b>15.22%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>1 053 970.00</b>	<b>1006 8000000000</b>	<b>4 126 344.00</b>	<b>15.22%</b>	<b>29.01.2018</b>	<b>1.Облигации</b>	<b>25.00</b>	<b>8.32</b>
<b>По всем Минфин России</b>					<b>25 515 472.60</b>		<b>94.09%</b>				<b>25 515 472.60</b>	<b>94.09%</b>				
<b>По всем Облигации Фад</b>					<b>25 515 472.60</b>		<b>94.09%</b>				<b>25 515 472.60</b>	<b>94.09%</b>				
4-01-32430-04 ПТТК 01	Облигации деп.	257.00	257.00	1 000.95	258 747.86	1 780.18	1.02%	29.12.2017	1 780.18	69 340.00	258 747.86	1.02%	29.01.2018	1.Облигации	201.00	3.83
4-03-34400-04 ПТТК 01	Облигации деп.	500.00	500.00	1 020.02	515 390.00	38 050.00	1.97%	31.12.2017	38 050.00	38 050.00	515 390.00	1.97%	27.02.2018	1.Облигации	130.00	10.38
<b>Всего по ОАО "ТТК"</b>					<b>757.00</b>	<b>1 500.97</b>	<b>1.02%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>1 780.18</b>	<b>1006 8000000000</b>	<b>757.00</b>	<b>1.02%</b>	<b>29.01.2018</b>	<b>1.Облигации</b>	<b>201.00</b>	<b>3.83</b>
4-03-34400-04 ПТТК 01	Облигации деп.	500.00	500.00	1 020.02	515 390.00	38 050.00	1.97%	31.12.2017	38 050.00	38 050.00	515 390.00	1.97%	27.02.2018	1.Облигации	130.00	10.38
<b>Всего по ОАО "Лента"</b>					<b>400.00</b>	<b>1 524.33</b>	<b>1.53%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>5 376.00</b>	<b>1004 2000000000</b>	<b>400.00</b>	<b>1.53%</b>	<b>17.05.2018</b>	<b>1.Облигации</b>	<b>130.00</b>	<b>8.95</b>
000323088 ПСД-03	Облигации деп.	400.00	400.00	1 524.33	402 050.32	19 614.00	1.53%	29.12.2017	5 376.00	13 440.00	402 050.32	1.53%	17.05.2018	1.Облигации	130.00	8.95
<b>Всего по АО "Россельхозбанк"</b>					<b>302.00</b>	<b>1 080.75</b>	<b>1.19%</b>	<b>29.12.2017</b>	<b>324 061.10</b>	<b>324 061.10</b>	<b>302 061.10</b>	<b>1.19%</b>	<b>03.03.2022</b>	<b>1.Сбербанк</b>	<b>1 192.00</b>	<b>8.95</b>
4802-01-17844-001R ПКСМ/В/Р1	Облигации	302.00	302.00	1 080.75	324 061.10	1 432.82	1.19%	29.12.2017	301 401.50	1021 7300000000	301 401.50	1.19%	18.03.2018	1.Сбербанк	1 192.00	8.95
4802-01-17844-001R ПКСМ/В/Р1	Купон			3.25	324 061.10	442.47	1.19%	31.12.2017	1 158.48	1 158.48	301 401.50	1.19%				
<b>Всего по АО "Стандарт ЛесСтенСМУ"</b>					<b>295.00</b>	<b>1 021.13</b>	<b>2.31%</b>	<b>31.12.2017</b>	<b>7 291.85</b>	<b>1021 7300000000</b>	<b>295.00</b>	<b>2.31%</b>	<b>18.03.2018</b>	<b>1.Сбербанк</b>	<b>1 192.00</b>	<b>8.95</b>
4802-02-17844-001R ПКСМ/В/Р2	Облигации	295.00	295.00	1 021.13	302 557.90	7 291.85	2.31%	31.12.2017	7 291.85	302 557.90	302 557.90	2.31%				
4802-02-17844-001R ПКСМ/В/Р2	Купон			3.32	302 557.90	7 291.85	2.31%				302 557.90	2.31%				
<b>По всем Облигации</b>					<b>1 852 474.98</b>		<b>6.83%</b>				<b>1 852 474.98</b>	<b>6.83%</b>				
<b>ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:</b>					<b>27 118 724.49</b>		<b>100.00%</b>				<b>27 118 724.49</b>	<b>100.00%</b>				

Пример с начала года: 2 025 439 82 RUB  
Держатель с начала года на 31.12.2017: 0 000 00 8 89 % годовых