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 30.09.2017

Инвестор: АССОЦИАЦИЯ "ДМСО"
Договор: НО-11/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
Деньги у брокера, р/с 30601810800001017456 (RUB)	Деньги у брокера	749,64	749,64	749,64	749,64		0,00%			1.0000000000	749,64	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					**749,64**		**0,00%**				**749,64**	**0,00%**				
По всем Деньги у брокера					**749,64**		**0,00%**				**749,64**	**0,00%**				
Газпромбанк - Управление активами ЗАО	Расчеты	-18 081,31	-18 081,31	-18 081,31	-18 081,31					1.0000000000	-18 081,31					
Всего по Расчеты					**-18 081,31**		**-0,07%**				**-18 081,31**	**-0,07%**				
По всем Расчеты					**-18 081,31**		**-0,07%**				**-18 081,31**	**-0,07%**				
24019RMFS ОФЗ 24019	Облигации Фед	3 700,00	3 700,00	1 027,65	3 802 305,00	52 582,78		29.09.2017		1027.6500000000	3 802 305,00		16.10.2019	I-Облигации	664,00	9,02
24019RMFS ОФЗ 24019	Купон		-	46,51	172 087,00	169 922,08		30.09.2017		46,510000	172 087,00		16.10.2017	I-Облигации		
Всего по 24019RMFS ОФЗ 24019					*3 974 392,00*	*222 504,86*	*15,19%*				*3 974 392,00*	*15,19%*				*9,02*
25081RMFS ОФЗ 25081	Облигации Фед	13 245,00	13 245,00	995,35	13 183 410,75	151 431,36		29.09.2017		995.3500000000	13 183 410,75		31.01.2018	I-Облигации	124,00	7,67
25081RMFS ОФЗ 25081	Купон		-	10,02	132 714,90	130 048,45		30.09.2017		10,020000	132 714,90		31.01.2018	I-Облигации		
Всего по 25081RMFS ОФЗ 25081					*13 316 125,65*	*281 479,81*	*50,91%*				*13 316 125,65*	*50,91%*				*7,67*
26216RMFS ОФЗ 26216	Облигации Фед	3 000,00	3 000,00	989,54	2 968 620,00	23 090,35		29.09.2017		989.5400000000	2 968 620,00		15.05.2019	I-Облигации	558,00	7,51
26216RMFS ОФЗ 26216	Купон		-	24,97	74 910,00	30 529,62		30.09.2017		24,970000	74 910,00		15.11.2017	I-Облигации		
Всего по 26216RMFS ОФЗ 26216					*3 043 530,00*	*53 619,97*	*11,64%*				*3 043 530,00*	*11,64%*				*7,51*
29011RMFS ОФЗ 29011	Облигации Фед	3 800,00	3 800,00	1 043,18	3 964 084,00	31 692,06		29.09.2017		1043.1800000000	3 964 084,00		29.01.2020	I-Облигации	769,00	8,53
29011RMFS ОФЗ 29011	Купон		-	16,86	64 068,00	61 595,06		30.09.2017		16,860000	64 068,00		31.01.2018	I-Облигации		
Всего по 29011RMFS ОФЗ 29011					*4 028 152,00*	*93 287,16*	*15,40%*				*4 028 152,00*	*15,40%*				*8,53*
Всего по Минфин России					**24 362 199,65**		**93,14%**				**24 362 199,65**	**93,14%**				**8,18**
По всем Облигации Фед					**24 362 199,65**		**93,14%**				**24 362 199,65**	**93,14%**				**8,18**
4-03-36420-R Лента 3 об	Облигации	500,00	500,00	1 028,10	514 050,00	6 216,22		29.09.2017		1028.1000000000	514 050,00		25.02.2020	I-Облигации	323,00	10,67
4-03-36420-R Лента 3 об	Купон		-	10,30	5 150,00	5 150,00		30.09.2017		10,300000	5 150,00		27.02.2018	I-Облигации		
Всего по ООО "Лента"					**519 200,00**		**1,98%**				**519 200,00**	**1,98%**				**10,67**
41503349B РСХБ 15	Облигации	255,00	255,00	1 002,60	255 663,00	2 160,65		29.09.2017		1002.6000000000	255 663,00		26.10.2021	I-Облигации	32,00	11,20
41503349B РСХБ 15	Купон		-	45,51	11 605,05	8 543,08		30.09.2017		45,510000	11 605,05		31.10.2017	I-Облигации		
Всего по 41503349B РСХБ 15					*267 268,05*	*10 703,73*	*1,02%*				*267 268,05*	*1,02%*				*11,20*
40903349B РСХБ 9	Облигации	400,00	400,00	1 015,80	406 320,00	10 254,66		29.09.2017		1015.8000000000	406 320,00		14.11.2019	I-Облигации	221,00	10,28
40903349B РСХБ 9	Купон		-	40,32	16 128,00	16 128,00		30.09.2017		40,320000	16 128,00		16.11.2017	I-Облигации		
Всего по 40903349B РСХБ 9					*422 448,00*	*26 382,66*	*1,62%*				*422 448,00*	*1,62%*				*10,28*
Всего по АО «Россельхозбанк»					**689 716,05**		**2,64%**				**689 716,05**	**2,64%**				**10,74**
4-02-17644-J ЛенССМУ 02	Облигации	2 515,00	2 515,00	121,12	304 606,74	-774,96		29.09.2017		121.1160000000	304 606,74		12.12.2017	I-Облигации	74,00	8,29
4-02-17644-J ЛенССМУ 02	Купон		-	0,76	1 911,40	1 911,40		30.09.2017		0,760000	1 911,40		12.12.2017	I-Облигации		
Всего по 4-02-17644-J ЛенССМУ 02					*306 518,14*	*1 136,44*	*1,17%*				*306 518,14*	*1,17%*				*8,29*
4B02-02-17644-J-001P ЛнССМУБ1P2	Облигации	295,00	295,00	1 002,10	295 619,50	563,45		29.09.2017		1002.1000000000	295 619,50		09.09.2022	I-Облигации	1 224,00	9,18
4B02-02-17644-J-001P ЛнССМУБ1P2	Купон		-	3,68	1 085,60	1 085,60		30.09.2017		3,680000	1 085,60		15.12.2017	I-Облигации		
Всего по 4B02-02-17644-J-001P ЛнССМУБ1P2					*296 705,10*	*1 649,05*	*1,13%*				*296 705,10*	*1,13%*				*9,18*
Всего по АО "Эталон ЛенСпецСМУ"					**603 223,24**		**2,31%**				**603 223,24**	**2,31%**				**8,74**
По всем Облигации					**1 812 139,29**		**6,93%**				**1 812 139,29**	**6,93%**				**9,93**
	ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:				**26 157 007,27**		**100,00%**				**26 157 007,27**	**100,00%**			**7,49**	**7,49**

Прирост с начала года: 1 663 718,6 RUB

Доходность с начала года на 30.09.2017 0:00:00: 9,64 % годовых