

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
 На 31.03.2018

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

Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Средний остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по блан.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Входящая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, RUB	Процент от всего по цене	Дата исполнения / контракта	Уровень	Duration	УТМ
Депозит У брокера, рос.ЗАО(018108005001017456) (RUB) (безопл)	3	341,11	341,11	341,11	341,11	0,00	0,00%			1,000000	341,11	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)			341,11	341,11	341,11	0,00	0,00%					0,00%				
По всем Депозиты У Брокера			341,11	341,11	341,11	0,00	0,00%					0,00%				
Газпромбанк, "Управляющие активами ЗАО"	Расчеты	-7 441,33	-7 441,33	-7 441,33	-7 441,33	0,00	-0,03%					-0,03%				
По всем Расчеты			-7 441,33	-7 441,33	-7 441,33	0,00	-0,03%					-0,03%				
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Облигации Фиа	5 800,00	5 800,00	5 800,00	5 800,00	61 739,79	0,00%	30.03.2018		1003,700000	5 821,460,00	0,00%	27.05.2020	1-Облигация	735,00	6,31
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Купон					124,082,00		31.03.2018		21,390000	124,082,00		30.03.2018	1-Облигация	6,31	
Всего по 2821240018 ОАО 282124 в Газпромбанк ММВБ					5 800,00	124 082,00		20,74%			5 945 522,00	20,74%	15.05.2016	1-Облигация	394,00	5,20
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Облигации Фиа	12 595,00	12 595,00	12 595,00	12 595,00	126 462,72	0,00%	31.03.2018		1006,130000	12 672 207,35	0,00%	19.05.2018	1-Облигация	6,20	7,34
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Купон					222 055,07		31.03.2018		24,970000	222 055,07		07.07.2018	1-Облигация	10,34	10,80
Всего по 2821240018 ОАО 282124 в Газпромбанк ММВБ					12 595,00	12 996 704,50		45,31%			12 996 704,50	45,31%	29.01.2020	1-Облигация	625,00	7,34
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Облигации Фиа	3 800,00	3 800,00	3 800,00	3 800,00	3 912 214,00	13,84%	31.03.2018		14,480000	3 967 239,00	13,84%	07.09.2018	1-Облигация	7,34	7,34
2021-04-05-001-282124 в Газпромбанк ММВБ	Купон					55 024,00		31.03.2018			55 024,00		25.02.2020	1-Облигация	151,00	10,94
Всего по 2821240018 ОАО 282124 в Газпромбанк ММВБ					3 800,00	3 967 239,00		79,89%			3 967 239,00	79,89%	25.02.2020	1-Облигация	151,00	10,94
Всего по Минфин России					22 899 464,50	22 899 464,50		79,89%			22 899 464,50	79,89%	25.02.2020	1-Облигация	151,00	6,62
По всем облигации Фиа					1 000,00	1 000,00		3,59%			1 000,00	3,59%	29.04.2021	1-Облигация	263,00	10,84
4-03-292920-9 Тинькофф в Газпромбанк ММВБ	Облигации	1 190,00	1 190,00	1 190,00	1 190,00	60 642,40	4,53%	31.03.2018		1040,000000	1 237 600,00	4,53%	09.07.2021	1-Облигация	99,00	10,70
4-03-292920-9 Тинькофф в Газпромбанк ММВБ	Купон					1 292 600,00		31.03.2018		50,960000	1 292 600,00		07.07.2018	1-Облигация	10,34	10,34
Всего по ООО "Мираторг Финанс"					1 190,00	1 292 600,00		4,53%			1 292 600,00	4,53%	09.07.2021	1-Облигация	99,00	10,34
4010017008 ФНБАНК.ОТ в Газпромбанк ММВБ	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 000,00	1 000,00	24 220,00	3,80%	31.03.2018		1008,000000	1 032 220,00	3,80%	17.10.2023	1-Облигация	14,00	10,80
4010017008 ФНБАНК.ОТ в Газпромбанк ММВБ	Купон					24 220,00		31.03.2018		24,220000	24 220,00		17.05.2016	1-Облигация	48,00	10,80
Всего по АО "РН Банк"					1 000,00	1 032 220,00		3,80%			1 032 220,00	3,80%	17.10.2023	1-Облигация	14,00	10,80
4090102488 РСКБ в Газпромбанк ММВБ	Облигации	400,00	400,00	400,00	400,00	401 980,00	1,46%	30.03.2018		1004,900000	401 980,00	1,46%	17.05.2016	1-Облигация	7,39	10,80
4090102488 РСКБ в Газпромбанк ММВБ	Купон					18 128,00		30.03.2018		40,320000	18 128,00		17.10.2023	1-Облигация	14,00	10,80
Всего по АО "Россельхозбанк"					400,00	418 088,00		1,46%			418 088,00	1,46%	17.10.2023	1-Облигация	14,00	10,80
409020103505090019Р Фольксваген в Газпромбанк ММВБ	Облигации	1 000,00	1 000,00	1 000,00	1 000,00	45 640,00	3,65%	31.03.2018		1000,700000	1 046 340,00	3,65%	17.08.2021	1-Облигация	738,00	10,01
409020103505090019Р Фольксваген в Газпромбанк ММВБ	Купон					45 640,00		31.03.2018		45,640000	45 640,00		15.06.2019	1-Облигация	7,39	10,01
Всего по ООО "Фольксваген Банк Рус"					1 000,00	1 046 340,00		3,65%			1 046 340,00	3,65%	17.08.2021	1-Облигация	738,00	10,01
409020117644-0019Р ЛисСМУБ.ГР в Газпромбанк ММВБ	Облигации	302,00	302,00	302,00	302,00	881,84	2,16%	31.03.2018		2,920000	881,84	2,16%	21.06.2018	1-Облигация	7,99	8,24
409020117644-0019Р ЛисСМУБ.ГР в Газпромбанк ММВБ	Купон					881,84		31.03.2018			881,84		09.09.2022	1-Облигация	8,24	8,24
Всего по 4802-02-17644-0019Р ЛисСМУБ.ГР в Газпромбанк ММВБ					302,00	881,84		2,16%			881,84	2,16%	21.06.2018	1-Облигация	7,99	8,24
4802-02-17644-0019Р ЛисСМУБ.ГР в Газпромбанк ММВБ	Облигации	600,00	600,00	600,00	600,00	327 796,84	1,14%	30.03.2018		1028,200000	327 796,84	1,14%	09.09.2022	1-Облигация	1 096,00	8,24
4802-02-17644-0019Р ЛисСМУБ.ГР в Газпромбанк ММВБ	Купон					816 920,00		31.03.2018		3,680000	816 920,00		15.06.2019	1-Облигация	7,99	8,24
Всего по АО "Этагон ЛенСпецСМУ"					600,00	816 920,00		2,14%			816 920,00	2,14%	15.06.2019	1-Облигация	7,99	8,24
По всем Облигации					5 772 115,24	5 772 115,24		20,14%			5 772 115,24	20,14%	15.06.2019	1-Облигация	7,40	8,24
По всем ВЛОЖЕНИЯМ:					28 664 479,52	28 664 479,52		100,00%			28 664 479,52	100,00%	15.06.2019	1-Облигация	7,40	7,40

Привлест с начала года 540 756,03 RUB
 Доходность с начала года на 31.03.2018 0,00% & 0,3% годовых