ГАЗПРОМБАНК
УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ

Некоммерческая специализированная организация Фонд целевого капитала Самарского аэрокосмического университета
целевой капитал Самарского аэрокосмического университета
2016 год

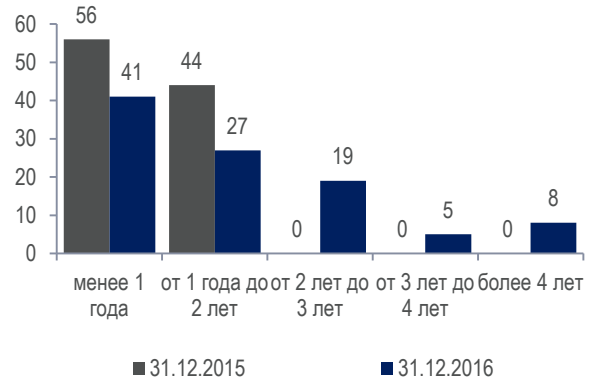
Структура портфеля 31.12.2016



	31.12.2015	31.12.2016
Активы Фонда млн.руб.	**19,2**	**26,2**
Облигации	**31,5%**	**100,0%**
Облигации корпоративные	29,1%	91,4%
Облигации субфедеральные	2,4%	2,9%
Облигации федеральные	0,0%	5,7%
Депозит	**48,2%**	**0,0%**
Денежные средства	**20,3%**	**0,0%**
ИТОГ	**100,00%**	**100,00%**

* Структура портфеля без задолженностей по расчетам

Дюрация (%) от портфеля



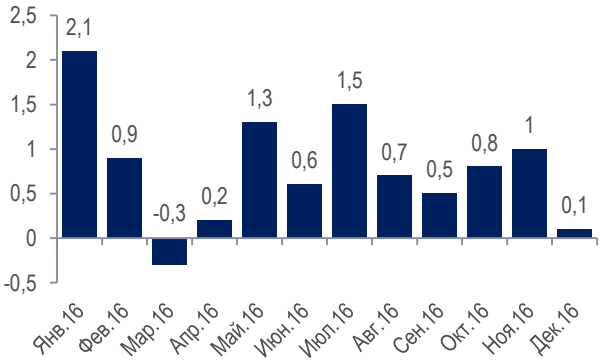
Дюрация активов с фиксированной доходностью

Активы	Дюрация (лет)	
	31.12.2015	31.12.2016
Облигации корпоративные	0,8	1,9
Облигации субфедеральные	1,1	3,8
Облигации федеральные		0,3
Средневзвешенная дюрация	**0,8**	**1,9**

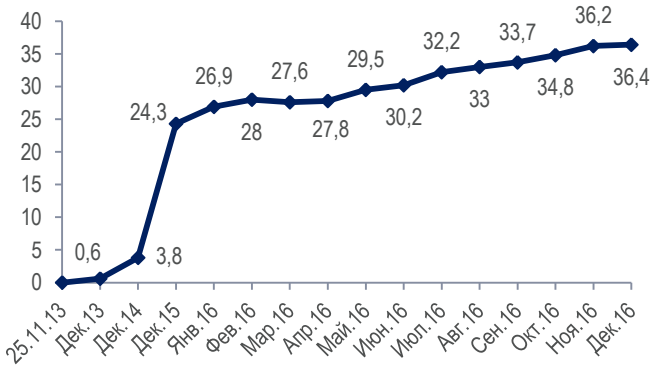
Рейтинг бумаг по портфелю 31.12.2016

A-	1%	BB-	17%
BBB-	25%	B+	13%
BB+	21%	B	5%
BB	17%	без рейтинга	1%
		Итог:	**100%**

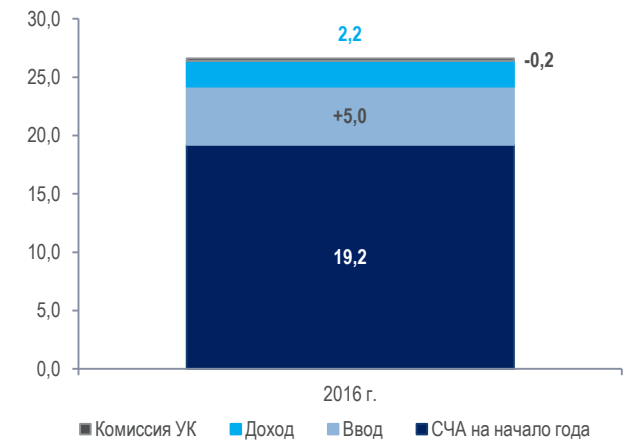
Доходность портфеля по месяцам (%)



Прирост стоимости активов с начала инвестирования (%)



СЧА млн.руб.



ТОП 10 позиций в портфеле (%)

ВЭБ.РФ	12,4
ПАО РОСБАНК	6,0
Минфин России	5,8
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	5,0
ПАО "Промсвязьбанк"	4,7
ПАО "Силовые машины"	4,6
АО "РН Банк"	4,5
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4,4
АО «Россельхозбанк»	4,3
ПАО "НК "Роснефть"	3,9

Движение средств по портфелю (ТОП 20 бумаг по доходности)

Ценные бумаги	Стоимость на 31.12.15	Сделки			Стоимость на 31.12.16	Доходность за период (%)	Сальдо
		Покупка	Продажа	Купон			
Облигации							
ГТЛК БО-04	354 650,31	-	-	54 813,94	361 728,03	17,45	61 891,66
ЕврХол1Р1R	-	1 200 386,60	-	75 396,00	1 308 828,00	15,31	183 837,40
Лента 3 об	499 428,75	-	-	52 598,25	520 017,00	14,65	73 186,50
ВымпелКБО3	392 608,40	-	-	45 098,40	395 819,40	12,30	48 309,40
Акрон БО-3	609 036,00	-	-	69 408,00	613 314,00	12,10	73 686,00
СПбТел 07	477 526,00	458 849,60	-	114 444,00	932 211,00	11,78	110 279,40
ВымпелКом4	274 001,40	-	-	26 924,40	278 251,20	11,38	31 174,20
ЛенССМУ 02	579 629,05	145 544,04	-	417 662,50	381 588,35	10,22	74 077,76
МКБ БО-10	-	676 042,30	-	30 540,00	714 514,80	10,21	69 012,50
Тойота 01	-	250 000,00	-	13 475,00	261 870,00	10,14	25 345,00
О'КЕЙ-Б06	-	500 000,00	-	29 170,00	521 330,00	10,10	50 500,00
ПромсвбБО8	-	1 203 086,00	-	71 376,00	1 241 868,00	9,16	110 158,00
ИКС5ФинБО5	-	304 008,00	-	16 305,00	315 465,00	9,13	27 762,00
РосбанкБ20	-	1 000 000,00	-	55 450,00	1 034 960,00	9,04	90 410,00
ИНГБ-БО1	-	1 100 000,00	-	57 310,00	1 141 789,00	9,01	99 099,00
АльфаБО-12	-	700 000,00	-	37 380,00	725 228,00	8,94	62 608,00
МарЭл2014	256 821,40	-	-	189 514,12	88 989,76	8,44	21 682,48
РСХБ 15	99 372,62	1 004 103,30	-	66 622,54	1 129 788,00	8,42	92 934,62
МагнитБО11	-	530 792,96	-	58 340,00	515 110,00	8,04	42 657,04
ПИК БО-7	-	700 000,00	-	-	754 397,00	7,77	54 397,00

Комментарии по результатам управления

Доходность портфеля за 2016 год составила 9,7%. Общий инвестиционный доход составил 2 196 375 рублей.

Важная информация

АО «Газпромбанк - Управление активами». Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00657 от 15 сентября 2009 г., выдана ФСФР России. Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 077-12879-001000, выдана ФСФР России 26 января 2010 года, срок действия лицензии — бессрочно. Местонахождение/почтовый адрес: 117418, Российская Федерация, г. Москва, ул. Новочерёмушкинская, д. 63 info-am@gazprombank.ru