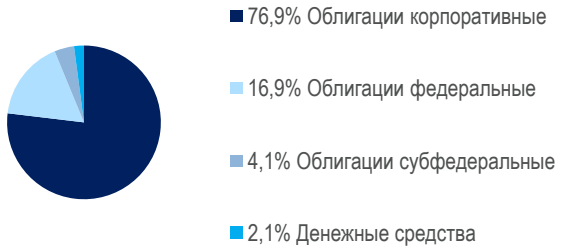
ГАЗПРОМБАНК
УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ

Некоммерческая специализированная организация Фонд целевого капитала Самарского аэрокосмического университета
целевой капитал Самарского аэрокосмического университета
2017 год

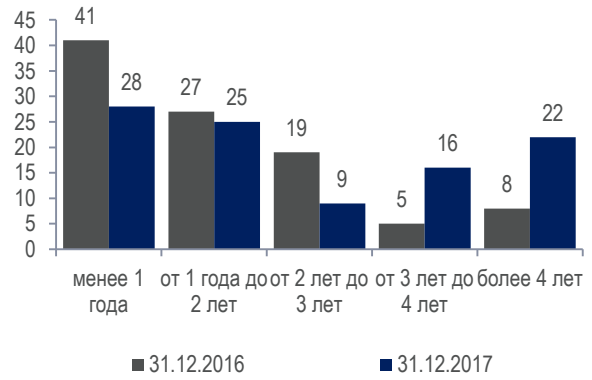
Структура портфеля 31.12.2017



	31.12.2016	31.12.2017
Активы Фонда млн.руб.	**26,2**	**28,9**
Облигации	**100,0%**	**97,9%**
Облигации корпоративные	91,4%	76,9%
Облигации федеральные	5,7%	16,9%
Облигации субфедеральные	2,9%	4,1%
Денежные средства	**0,0%**	**2,1%**
ИТОГ	**100,00%**	**100,00%**

* Структура портфеля без задолженностей по расчетам

Дюрация (%) от портфеля



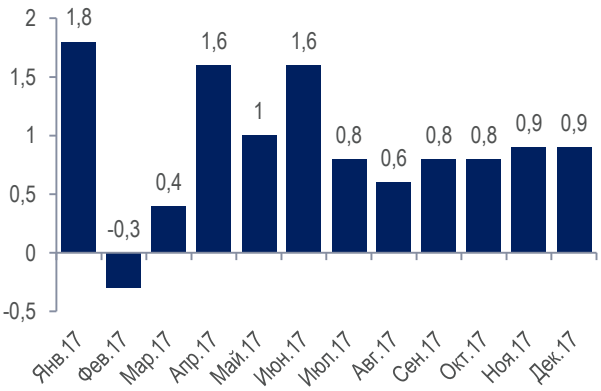
Дюрация активов с фиксированной доходностью

Активы	Дюрация (лет)	
	31.12.2016	31.12.2017
Облигации корпоративные	1,9	2,1
Облигации федеральные	0,3	4,6
Облигации субфедеральные	3,8	4,4
Средневзвешенная дюрация	**1,9**	**2,6**

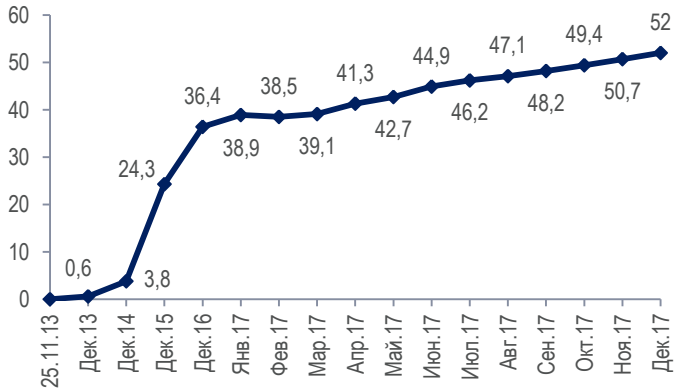
Рейтинг бумаг по портфелю 31.12.2017

A-	2%	BB-	8%
BBB-	40%	B+	13%
BB+	25%	B	6%
BB	5%	без рейтинга	1%
		Итог:	**100%**

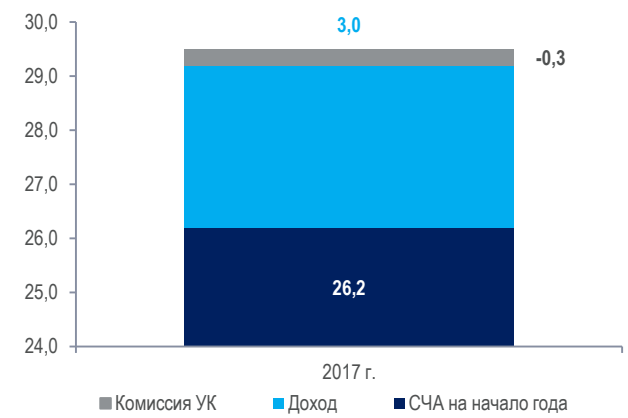
Доходность портфеля по месяцам (%)



Прирост стоимости активов с начала инвестирования (%)



СЧА млн.руб.



ТОП 10 позиций в портфеле (%)

Минфин России	16,9
ВЭБ.РФ	10,9
ООО "О`КЕЙ"	5,5
ПАО РОСБАНК	5,1
ПАО "ГТЛК"	5,0
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4,8
АО "РН Банк"	4,1
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	3,9
АО "Теле2-Санкт-Петербург"	3,3
ПАО "МегаФон"	3,2

Движение средств по портфелю (ТОП 20 бумаг по доходности)

Ценные бумаги	Стоимость на 31.12.16	Сделки		Купон	Стоимость на 31.12.17	Доходность за период (%)	Сальдо
		Покупка	Продажа				
Облигации							
ЕврХол1Р1R	1 308 828,00	-	-	150 792,00	1 399 968,00	18,48	241 932,00
ЛСР БО 1Р1	807 504,00	-	-	85 760,00	843 184,00	15,04	121 440,00
ТамбовОбл2	671 915,85	-	-	78 535,20	688 505,25	14,16	95 124,60
СПбТел 07	932 211,00	-	-	101 871,00	961 785,00	14,10	131 445,00
МОСТРЕСТ 7	318 867,00	19 488,49	-	35 493,46	349 751,60	13,86	46 889,57
ТрансмшПБ1	-	753 272,50	-	37 207,50	810 997,50	12,60	94 932,50
РосбанкБ20	1 034 960,00	-	-	110 000,00	1 050 660,00	12,15	125 700,00
ПИК БО-7	754 397,00	-	-	90 748,00	754 719,00	12,07	91 070,00
О'КЕЙ-Б06	521 330,00	-	-	58 340,00	525 140,00	11,92	62 150,00
МиратФБО-6	525 670,00	323 250,50	-	92 752,00	856 776,00	11,85	100 607,50
РосбанкБ26	527 650,00	-	102 351,00	46 392,00	435 560,00	10,74	56 653,00
О'КЕЙ-Б01Р	-	1 000 000,00	-	47 620,00	1 057 740,00	10,54	105 360,00
РН БАНК 01	1 166 440,00	-	-	114 708,00	1 172 292,00	10,34	120 560,00
ФолксвБ1Р1	563 337,50	-	-	54 043,00	564 894,00	9,87	55 599,50
ИНГБ-БО1	1 141 789,00	-	-	114 620,00	1 138 258,00	9,73	111 089,00
АльфаБО-12	725 228,00	102 701,00	-	79 890,00	826 992,00	9,54	78 953,00
ОФЗ 26216	-	1 497 235,00	-	66 820,00	1 513 410,00	5,54	82 995,00
Тойота 01	261 870,00	884 063,00	614 376,00	67 375,00	519 195,00	4,80	55 013,00
ЛнССМУБ1Р2	-	400 000,00	-	8 924,00	410 248,00	4,79	19 172,00
ОФЗ 29012	-	1 042 426,00	-	50 430,80	1 028 686,40	3,52	36 691,20

Комментарии по результатам управления

Доходность портфеля за 2017 год составила 11,5%. Общий инвестиционный доход составил 3 005 585 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