

Состав портфеля средств пенсионных резервов АО "НПФ Газпромбанк-фонд"
Отчетная дата: 29.01.2021

I. ЦЕННЫЕ БУМАГИ

| Вид ценных бумаг | Наименование | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | ISIN | ОГРН | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % |
|--|--------------|---|--------------|---------------|------------------|----------------------------|---------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 24020RMFS | RU000A100Q52 | 1037739085636 | 5 742 | 5 737 061,88 | 0,05% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 24021RMFS | RU000A101CK7 | 1037739085636 | 58 000 | 57 367 800,00 | 0,46% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 25083RMFS | RU000A02YCK6 | 1037739085636 | 16 715 | 17 233 833,60 | 0,14% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26211RMFS | RU000A07JL3 | 1037739085636 | 1 650 | 1 723 837,50 | 0,01% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26212RMFS | RU000A07TK38 | 1037739085636 | 18 857 | 20 046 310,99 | 0,16% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26217RMFS | RU000A0JWV30 | 1037739085636 | 106 215 | 111 630 902,85 | 0,89% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26220RMFS | RU000A0XB41 | 1037739085636 | 290 | 307 684,20 | 0,00% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26223RMFS | RU000A0ZVU88 | 1037739085636 | 5 | 5 325,65 | 0,00% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26227RMFS | RU000A1007F4 | 1037739085636 | 92 430 | 98 815 064,40 | 0,79% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26229RMFS | RU000A100EG3 | 1037739085636 | 43 935 | 47 477 918,40 | 0,38% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 26234RMFS | RU000A10VLE0 | 1037739085636 | 24 650 | 23 713 546,50 | 0,19% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 29006RMFS | RU000A0V4L2 | 1037739085636 | 202 073 | 214 057 949,63 | 1,71% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 29012RMFS | RU000A0JXH6 | 1037739085636 | 650 | 657 195,50 | 0,01% |
| облигации федерального займа РФ | Минфин РФ | 52002RMFS | RU000A0ZY2Z6 | 1037739085636 | 906 000 | 1 033 292 352,75 | 8,27% |
| Итого оценочная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации | | | | | | 1 632 066 783,85 | 13,06% |

| Вид ценных бумаг | Наименование субъекта Российской Федерации | Государственный регистрационный номер выпуска | ISIN | ОГРН | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % |
|--|--|---|--------------|---------------|------------------|----------------------------|---------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Департамент финансов Ярославской области | RU35014YRSO | RU000A0JWHN7 | 1027600695363 | 101 | 65 554,24 | 0,00% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Департамент финансов Томской области | RU35015TMSO | RU000A0JWIK9 | 1037000100719 | 3 448 | 2 769 795,64 | 0,02% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство управления финансами Самарской области | RU35010SAMO | RU000A0JUCP7 | 1026300972444 | 30 000 | 1 535 400,00 | 0,01% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство управления финансами Самарской области | RU35012SAMO | RU000A0JWMS6 | 1026300972444 | 259 900 | 255 136 033,00 | 2,04% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство управления финансами Самарской области | RU35013SAMO | RU000A0JXT41 | 1026300972444 | 3 000 | 2 853 819,90 | 0,02% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области | RU34020AHO0 | RU000A1011Q3 | 1105476023223 | 7 000 | 7 109 340,00 | 0,06% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство экономики и финансов Московской области | RU34011MOO0 | RU000A0ZVML3 | 1025002870837 | 399 515 | 207 508 091,00 | 1,66% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство экономики и финансов Московской области | RU34012MOO0 | RU000A100XP4 | 1025002870837 | 200 000 | 204 980 020,00 | 1,64% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство экономики и финансов Московской области | RU35010MOO0 | RU000A0JX0B9 | 1025002870837 | 78 020 | 76 660 111,40 | 0,61% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство экономики и финансов Московской области | RU35016MOO0 | RU000A102G35 | 1025002870837 | 100 000 | 100 443 000,00 | 0,80% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство финансов Республики Саха (Якутия) | RU35006RSYO | RU000A0JUCQ4 | 1031402066079 | 16 287 | 1 680 991,04 | 0,01% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство финансов Республики Саха (Якутия) | RU35008RSYO | RU000A0JWGT6 | 1031402066079 | 158 000 | 49 209 100,00 | 0,39% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство финансов Свердловской области | RU34010SVSO | RU000A102DQ0 | 1026605256589 | 107 000 | 108 068 930,00 | 0,86% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Министерство финансов Свердловской области | RU35003SVSO | RU000A0JW277 | 1026605256589 | 18 000 | 15 900 480,00 | 0,13% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Иркутской области | RU34001IRKO | RU000A0JX314 | 1063808000154 | 200 000 | 104 271 820,00 | 0,83% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Краснодарского края | RU35001KND0 | RU000A0JXV59 | 1022301211570 | 180 000 | 194 911 200,00 | 1,56% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Краснодарского края | RU35002KND0 | RU000A0Z28X4 | 1022301211570 | 123 464 | 130 406 380,72 | 1,04% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Кузбасса | RU35002KEMO | RU000A0ZV840 | 102200085233 | 1 | 1 052,64 | 0,00% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Нижегородской области | RU34012NIGO | RU000A0ZVQ11 | 1025203044426 | 5 701 | 2 951 236,67 | 0,02% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Нижегородской области | RU35013NIGO | RU000A0Z2UT6 | 1025203044426 | 351 700 | 302 205 259,00 | 2,42% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Омской области | RU35003OMSO | RU000A0JWX87 | 1045504005414 | 200 000 | 142 944 700,00 | 1,14% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Оренбургской области | RU35002AOR0 | RU000A0JUEP3 | 1025501036493 | 21 500 | 1 114 775,00 | 0,01% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Республики Коми | RU35012KMO0 | RU000A0JWKF9 | 1021100524213 | 665 079 | 284 653 812,00 | 2,28% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34012KNAD | RU000A0JWXF0 | 1052460087008 | 52 635 | 43 141 225,05 | 0,35% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU34013BELO | RU000A100Y84 | 1023101674650 | 5 000 | 5 113 288,50 | 0,04% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU34014BELO | RU000A101PA0 | 1023101674650 | 2 000 | 1 986 073,00 | 0,02% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU34016BELO | RU000A1025F6 | 1023101674650 | 200 000 | 201 124 000,00 | 1,61% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU35008BELO | RU000A0JUCQ7 | 1023101674650 | 12 641 | 652 844,45 | 0,01% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры | RU35001HMNO | RU000A0JX215 | 1028600512181 | 489 | 364 437,03 | 0,00% |
| государственные ЦБ субъектов РФ | Правительство ЯНАО | RU35002YML0 | RU000A0JX0Z8 | 1028900508735 | 92 655 | 29 989 643,85 | 0,24% |
| Итого оценочная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации | | | | | | 2 479 752 414,13 | 19,84% |

| Вид ценных бумаг | Наименование муниципального образования | Государственный регистрационный номер выпуска | ISIN | ОГРН | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % |
|--|---|---|--------------|---------------|------------------|----------------------------|--------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| муниципальные облигации | Мэрия города Новосибирск | RU35007NSB1 | RU000A0JWVD3 | 1045402490100 | 66 000 | 27 754 320,00 | 0,22% |
| Итого оценочная стоимость муниципальных облигаций | | | | | | 27 754 320,00 | 0,22% |

| Вид ценных бумаг | Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | ISIN | ОГРН | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % |
|--|----------------------------|---|--------------|---------------|------------------|----------------------------|---------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 4802-08-01326-B-002P | RU000A102A07 | 1027700067328 | 100 000 | 102 149 000,00 | 0,82% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 4802-09-01326-B-002P | RU000A102I28 | 1027700067328 | 250 000 | 252 390 000,00 | 2,02% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48020101326B002P | RU000A0Z2EWA | 1027700067328 | 200 | 210 736,00 | 0,00% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48020201326B002P | RU000A0Z2R80 | 1027700067328 | 1 868 | 1 955 926,76 | 0,02% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48020401326B002P | RU000A100998 | 1027700067328 | 700 | 722 771,00 | 0,01% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48020501326B002P | RU000A100P08 | 1027700067328 | 4 491 | 4 808 693,24 | 0,04% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48021401326B | RU000A0JUUA1 | 1027700067328 | 47 | 49 280,97 | 0,00% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "АЛЬФА-БАНК" | 48021801326B | RU000A0JX5W4 | 1027700067328 | 20 000 | 20 267 200,00 | 0,16% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Альфа-Банк" | 48022101326B | RU000A0Z2Y84 | 1027700067328 | 162 | 163 764,50 | 0,00% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Атомэнергострой" | 4802-08-55319-E | RU000A0JW175 | 1027758081664 | 72 019 | 73 679 426,85 | 0,59% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "МХК "ЕвроХим" | 4802-03-31153-H-001P | RU000A100820 | 102770002659 | 22 215 | 23 532 202,88 | 0,19% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "МХК "ЕвроХим" | 4802-04-31153-H-001P | RU000A100L53 | 102770002659 | 22 789 | 23 702 155,23 | 0,19% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "МХК "ЕвроХим" | 4802-06-31153-H-001P | RU000A100R55 | 102770002659 | 4 000 | 4 222 528,80 | 0,03% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "НПК" | 4802-02-08551-A-001P | RU000A1004A2 | 1027705050570 | 4 000 | 4 437 828,80 | 0,04% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "РН Банк" | 40100170B | RU000A0JWJM5 | 1025500003737 | 35 000 | 35 374 500,00 | 0,28% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Россельхозбанк" | 48020503349B001P | RU000A0ZYXJ4 | 1027700342890 | 29 075 | 30 493 569,25 | 0,24% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Россельхозбанк" | 48021403349B | RU000A0JWJ72 | 1027700342890 | 49 500 | 51 305 265,00 | 0,41% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Россельхозбанк" | 48021403349B001P | RU000A102H75 | 1027700342890 | 250 000 | 251 506 375,00 | 2,01% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Теле2-Санкт-Петербург" | 4-07-00740-D | RU000A0JRVJ3 | 1027809223903 | 25 565 | 27 726 520,75 | 0,22% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Трансмашинодин" | 4802-02-35992-H-001P | RU000A0Z2RZ9 | 1027739893246 | 45 000 | 47 232 450,00 | 0,38% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Трансмашинодин" | 4802-03-35992-H-001P | RU000A1009M6 | 1027739893246 | 99 950 | 105 860 353,35 | 0,85% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Трансмашинодин" | 4802-05-35992-H-001P | RU000A101P08 | 1027739893246 | 100 000 | 101 586 000,00 | 0,81% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "КМ "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4802-03-25642-H | RU000A100YF3 | 1027700006289 | 50 000 | 51 704 500,00 | 0,41% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "КМ "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4802-07-25642-H | RU000A0JW5H6 | 1027700006289 | 40 000 | 44 618 679,11 | 0,36% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "КМ "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4802-09-25642-H | RU000A100B73 | 1027700006289 | 250 000 | 255 758 678,07 | 2,05% |
| облигации российских хозяйственных обществ | АО "Этап ЛенСпецСМУ" | 4802-02-17644-J-001P | RU000A0ZYA66 | 1027801544308 | 20 200 | 16 261 969,60 | 0,13% |
| облигации российских хозяйственных обществ | Банк ПТБ (АО) | 4802-18-00354-B-001P | RU000A102GJ8 | 1027700167110 | 300 000 | 301 776 000,00 | 2,41% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4-19-65045-D | RU000A0JQ722 | 1037739877295 | 100 000 | 106 587 000,00 | 0,85% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4-28-65045-D | RU000A0JTU85 | 1037739877295 | 12 252 | 12 634 262,40 | 0,10% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4-41-65045-D | RU000A0JX1S1 | 1037739877295 | 40 000 | 41 404 400,00 | 0,33% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-02-65045-D | RU000A0JWV71 | 1037739877295 | 2 000 | 2 102 959,20 | 0,02% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-02-65045-D | RU000A0JWV71 | 1037739877295 | 400 000 | 407 758 826,13 | 3,26% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-07-65045-D | RU000A0JWC82 | 1037739877295 | 1 518 | 1 580 566,44 | 0,01% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-07-65045-D-001P | RU000A0Z29R4 | 1037739877295 | 3 756 | 3 968 214,00 | 0,03% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-11-65045-D | RU000A0JXK7K | 1037739877295 | 20 500 | 30 643 698,79 | 0,25% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ОАО "РЖД" | 4802-15-65045-D-001P | RU000A1009L8 | 1037739877295 | 300 000 | 301 226 522,47 | 2,41% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ТЭЗПРОМ КАПИТАЛ" | 4802-03-36400-B-001P | RU000A1010M8 | 1087746212388 | 9 500 | 9 423 595,00 | 0,08% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ТСП-ФИНАНС" | 4-01-09057-R | RU000A102KZ6 | 1207800076440 | 100 000 | 102 326 000,00 | 0,82% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ЕвразХолдинг Финанс" | 4802-01-36383-R-001P | RU000A0JWBN2 | 1097746549515 | 35 000 | 36 936 550,00 | 0,30% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-01-36241-R-001P | RU000A0JWJD1 | 1067761792053 | 257 | 270 124,73 | 0,00% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-05-36241-R | RU000A0JW9G0 | 1067761792053 | 475 | 491 941,26 | 0,00% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-05-36241-R-001P | RU000A100AB2 | 1067761792053 | 2 000 | 2 112 560,00 | 0,02% |

| | | | | | | | |
|--|--------------------------------|-----------------------|-----------------|---------------|----------------|------------------|--------|
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-06-36241-R-001P | RU000A100V46 | 1067761792053 | 3 316 | 3 466 528,83 | 0,03% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-10-36241-R-001P | RU000A101LH4 | 1067761792053 | 150 000 | 155 060 700,00 | 1,24% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4802-11-36241-R-001P | RU000A101QA8 | 1067761792053 | 90 000 | 91 123 200,00 | 0,73% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "Лента" | 4802-02-36420-R-001P | RU000A100782 | 1037832048605 | 53 000 | 56 425 390,00 | 0,45% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "Лента" | 4802-03-36420-R-001P | RU000A1011A7 | 1037832048605 | 1 014 | 1 047 593,82 | 0,01% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ООО "СУЭК-Финанс" | 4802-04-36393-R-001P | RU000A100Y50 | 1107746282687 | 4 000 | 4 200 720,00 | 0,03% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Акрон" | 4802-01-00207-A-001P | RU000A03JWV89 | 1025300786610 | 11 589 | 11 868 294,90 | 0,09% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Акрон" | 4802-02-00207-A-001P | RU000A03XS51 | 1025300786610 | 4 639 | 4 815 282,00 | 0,04% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Акрон" | 4802-03-00207-A-001P | RU000A100YU2 | 1025300786610 | 54 000 | 56 795 580,00 | 0,45% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "ТМК "Норильский никель" | 4802-01-40155-F-001P | RU000A100VQ6 | 1028400000298 | 13 851 | 14 912 956,17 | 0,12% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Группа Компаний ПИК" | 4802-07-01556-A-001P | RU000A03JW46 | 1027739137084 | 20 000 | 20 608 000,00 | 0,16% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Группа ЛСР" | 4802-02-55234-E-001P | RU000A03JXPM0 | 5067847227300 | 15 000 | 9 285 430,50 | 0,07% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МТС" | 4802-01-04715-A-001P | RU000A03JTA5 | 1027700149124 | 204 000 | 214 442 760,00 | 1,72% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МТС" | 4802-05-04715-A-001P | RU000A02YXW7 | 1027700149124 | 2 849 | 2 964 327,52 | 0,02% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МТС" | 4802-07-04715-A-001P | RU000A100238 | 1027700149124 | 100 000 | 109 072 000,00 | 0,87% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МТС" | 4802-12-04715-A-001P | RU000A1002K0 | 1027700149124 | 100 000 | 103 299 000,00 | 0,83% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Магнит" | 4802-01-60525-P-002P | RU000A101HJ8 | 1032304945947 | 202 000 | 207 927 791,00 | 1,66% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Магнит" | 4802-01-60525-P-003P | RU000A1002U4 | 1032304945947 | 21 500 | 23 170 120,00 | 0,19% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Магнит" | 4802-02-60525-P-003P | RU000A1004G9 | 1032304945947 | 3 609 | 3 749 967,54 | 0,03% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Магнит" | 4802-03-60525-P-002P | RU000A101P11 | 1032304945947 | 59 053 | 60 004 934,36 | 0,48% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Магнит" | 4802-04-60525-P-003P | RU000A1002S3 | 1032304945947 | 5 000 | 5 156 539,50 | 0,04% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МегаФон" | 4802-02-00822-J-001P | RU000A03JWKA8 | 1027809169585 | 190 000 | 194 650 143,46 | 1,56% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "МегаФон" | 4802-04-00822-J-001P | RU000A02YTM6 | 1027809169585 | 68 329 | 70 614 605,05 | 0,56% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "НК "Роснефть" | 4802-01-00122-A | RU000A03JUF0 | 1027700043502 | 90 000 | 97 524 000,00 | 0,78% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "НК "Роснефть" | 4802-02-00122-A | RU000A03JW5 | 1027700043502 | 75 000 | 80 464 966,92 | 0,64% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "НК "Роснефть" | 4802-02-00122-A-001P | RU000A03JX35 | 1027700043502 | 59 000 | 61 796 600,00 | 0,49% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "НК "Роснефть" | 4802-04-00122-A-001P | RU000A03JXQ2 | 1027700043502 | 48 200 | 52 324 100,00 | 0,42% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "НК "Роснефть" | 4802-04-00122-A-002P | RU000A02YTF0 | 1027700043502 | 40 916 | 43 785 439,08 | 0,35% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "ОГК-2" | 4802-01-65105-D-002P | RU000A101WR0 | 1025600002180 | 100 000 | 101 162 000,00 | 0,81% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "ОГК-2" | 4802-03-65105-D-001P | RU000A02Z1H2 | 1025600002180 | 3 000 | 3 077 280,00 | 0,02% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Полес" | 4802-01-55192-E | 4802-01-55192-E | 1068400002990 | 90 000 | 93 338 100,00 | 0,75% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "РОСТЕЛЕКОМ" | 4802-02-00124-A-002P | RU000A101FC7 | 1027700198767 | 70 000 | 72 345 490,00 | 0,58% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "РОСТЕЛЕКОМ" | 4802-04-00124-A-002P | RU000A101Y9 | 1027700198767 | 14 500 | 15 103 490,00 | 0,12% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "РОСТЕЛЕКОМ" | 4802-05-00124-A-001P | RU000A100881 | 1027700198767 | 70 000 | 74 179 581,00 | 0,59% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Северсталь" | 4802-07-00143-A | RU000A1008L0 | 1023501236901 | 900 000 | 514 107 751,19 | 4,11% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина | 4802-01-00161-A-001P | RU000A1018K1 | 1026101623702 | 4 300 | 4 416 616,00 | 0,04% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "ТрансКонтейнер" | 4802-01-55194-E-001P | RU000A100YE6 | 1067746341024 | 250 380 | 261 879 377,53 | 2,09% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "ТрансКонтейнер" | 4802-02-55194-E | RU000A03JWTH4 | 1067746341024 | 1 781 | 930 795,13 | 0,01% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Транснефть" | 4802-01-00206-A-001P | RU000A03JWK90 | 1027700049486 | 510 000 | 544 441 948,83 | 4,36% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Транснефть" | 4802-05-00206-A | RU000A03JWE9 | 1027700049486 | 26 945 | 28 004 746,85 | 0,22% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Транснефть" | 4802-05-00206-A-001P | RU000A03JXC24 | 1027700049486 | 135 000 | 147 528 000,00 | 1,18% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО "Транснефть" | 4802-06-00206-A-001P | RU000A03JXM97 | 1027700049486 | 19 795 | 20 550 377,20 | 0,16% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО АНК "Башнефть" | 4802-02-00013-A-001P | RU000A03JX29 | 102020255240 | 100 000 | 103 412 703,25 | 0,83% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО АНК "Башнефть" | 4802-06-00013-A | RU000A03JGC2 | 102020255240 | 188 933 | 195 010 676,34 | 1,56% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО РОСБАНК | 4802-06-02272-B-002P | RU000A101QG5 | 5 000 | 5 048 687,00 | 0,04% | |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО РОСБАНК | 4802-07-02272-B-002P | RU000A102F28 | 100 000 | 100 907 000,00 | 0,81% | |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО РОСБАНК | 48020402272B002P | RU000A100816 | 11 800 | 12 167 216,00 | 0,10% | |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО Сбербанк | 4802-264-01481-B-001P | RU000A101QW2 | 1027700132195 | 350 000 | 354 399 500,00 | 2,83% |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО Сбербанк | 4802-369-01481-B-001P | RU000A102FR3 | 150 000 | 151 102 500,00 | 1,21% | |
| облигации российских хозяйственных обществ | ПАО Сбербанк | 48021201481B001P | RU000A02ZBN9 | 1027700132195 | 21 480 | 22 872 978,00 | 0,18% |
| Итого оценочная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ | | | | | | 7 479 514 400,65 | 59,83% |

| Вид ценных бумаг | Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | ISIN | ОГРН | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % |
|---|------------------------------|---|--------------|---------------|------------------|----------------------------|---------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| облигации с ипотечным покрытием | ООО "ДОМ.РФ Ипотечный агент" | 4-18-00307-R-002P | RU000A102D46 | 1167746438881 | 50 000 | 39 657 000,00 | 0,32% |
| облигации с ипотечным покрытием | ООО "ДОМ.РФ Ипотечный агент" | 4802-02-00307-R-001P | RU000A102I89 | 1167746438881 | 250 000 | 203 093 575,00 | 1,62% |
| облигации с ипотечным покрытием | ПАО РОСБАНК | 41403338B | RU000A03JUG1 | 1027739460737 | 24 000 | 15 802 711,20 | 0,13% |
| Итого оценочная стоимость облигаций с ипотечным покрытием | | | | | | 258 552 286,20 | 2,07% |

| Вид ценных бумаг | Наименование эмитента | ISIN | LIE | Количество (шт.) | Оценочная стоимость (руб.) | Доля, % | |
|---|---------------------------|--------------|---------------------|------------------|----------------------------|----------------|-------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | |
| ценные бумаги международных финансовых организаций | Евразийский банк развития | RU000A100JC1 | 253400QAQ3F58BLL187 | 3 300 | 3 472 615,74 | 0,03% | |
| ценные бумаги международных финансовых организаций | Евразийский Банк развития | RU000A101L54 | 253400QAQ3F58BLL187 | 303 000 | 309 382 136,23 | 2,47% | |
| Итого оценочная стоимость ценных бумаг международных финансовых организаций | | | | | | 312 854 751,97 | 2,50% |

II. ПРОЧЕЕ АКТИВЫ

Денежные средства на расчетных счетах

| Наименование Банка | Реквизиты договора банковского счета | ОГРН | Название валюты | Реквизиты банковского счета | Сумма денежных средств (руб.) | Доля, % | |
|----------------------------------|--------------------------------------|--------------------|-----------------|-----------------------------|-------------------------------|---------------|-------|
| 1 | дата 2, номер 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | |
| Банк ПТБ (АО) | 27.12.2005 | 810-0-7626/05 | 1027700167110 | Российский рубль | 40701810000000017626 | 1 115,11 | 0,00% |
| Банк ПТБ (АО) | 11.03.2016 | 810-1-20-4410/2016 | 1027700167110 | Российский рубль | 407018101000000204410 | 5 444 782,65 | 0,04% |
| Банк ПТБ (АО) | 16.10.2019 | 2812019-DV | 1027700167110 | Российский рубль | 40701810200000001775 | 93 239,30 | 0,00% |
| Банк ПТБ (АО) | 19.05.2005 | 810-8-7635/05 | 1027700167110 | Российский рубль | 40701810800000017635 | 84 257 600,47 | 0,67% |
| Банк ПТБ (АО) | 21.08.2015 | 810-9-2-7635/2015 | 1027700167110 | Российский рубль | 40701810900000027635 | 65 853,99 | 0,00% |
| Московский филиал "БАНК СГБ" | 16.09.2019 | 854 | 1027700167110 | Российский рубль | 407018103190000000854 | 225,30 | 0,00% |
| Итого денежных средств на счетах | | | | | | 89 862 617,72 | 0,72% |

Средства на специальных брокерских счетах

| Наименование брокера | ОГРН | Сумма средств (руб.) | Доля, % | | |
|--|---------------|----------------------|---------|--------------|-------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | | |
| Банк ПТБ (АО) | 1027700167110 | 751 544,60 | 0,01% | | |
| АО "ПТБ - УА" | 1047796382920 | 70 699,35 | 0,00% | | |
| ООО "АЛОР +" | 1027700075941 | 3 449 725,57 | 0,03% | | |
| ООО "АЛОР +" | 1027700075941 | 519 276,07 | 0,00% | | |
| Итого средств на специальных брокерских счетах | | | | 4 791 245,59 | 0,04% |

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям

| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) / ISIN | Сумма дебиторской задолженности (руб.) | Доля, % |
|---|--|--|---------|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| ПАО "Транснефть" | 4802-05-00206-A-001P/RU000A03JXC24 | 6 226 200,00 | |
| ПАО "Группа Компаний ПИК" | 4802-07-01556-A/RU000A03JW46 | 867 600,00 | |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | 7 093 800,00 | 0,06% |

Дебиторская задолженность по сделкам РЕПО

| Наименование контрагента | Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) / ISIN | Количество (шт.) | Сумма дебиторской задолженности (руб.) | Доля, % | |
|---|-----------------------|--|------------------|--|----------------|-------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | |
| НКО НКЦ (АО) | Минфин России | 290128MFS/RU000A03X0H6 | 4 208 | 3 999 173,42 | 0,03% | |
| НКО НКЦ (АО) | Минфин России | 262258MFS/RU000A03Y0B7 | 231 234 | 238 010 664,30 | 1,82% | |
| Итого дебиторская задолженность по сделкам РЕПО | | | | | 232 009 837,72 | 1,86% |

Прочая дебиторская задолженность

| Наименование дебиторской задолженности | Сумма дебиторской задолженности (руб.) | Доля, % | |
|---|--|-----------|-------|
| 1 | 2 | 3 | |
| % по МНО (Банк ПТБ (АО), ОГРН: 1027700167110) | 32 604,93 | 0,00% | |
| Итого прочая дебиторская задолженность | | 32 604,93 | 0,00% |

Прочая кредиторская задолженность

| Наименование кредиторской задолженности | Сумма кредиторской задолженности (руб.) | Доля, % | |
|---|---|---------------|-------|
| 1 | 2 | 3 | |
| вознаграждение управляющей (им) компании (им) вознаграждение специализированного депозитари | 21 844 840,35 | 0,17% | |
| | 1 153 624,71 | 0,01% | |
| Итого прочая кредиторская задолженность | | 22 998 465,06 | 0,18% |

Итого стоимость портфеля средств пенсионных резервов 12 501 286 847,20