



4B02-07-65045-D-001P	RU000A02Z9R4	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	3 756	3 758 609,29	0,03
4B02-08-01326-B-002P	RU000A102A07	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	100 000	99 143 980,00	0,72
4B02-08-012272-B-002P	RU000A103DU0	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	105 400	105 740 903,65	0,77
4B02-08-03251-B-003P	RU000A1042P0	Публичное акционерное общество "Промсвязьбанк"	1027739019142	250 000	256 607 227,85	1,88
4B02-09-01326-B-002P	RU000A102ZJ8	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	250 000	243 962 500,00	1,78
4B02-09-25642-H	RU000A100B73	Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	1027700006289	250 000	257 751 054,45	1,88
4B02-10-01326-B-002P	RU000A102S80	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 355 335,00	0,14
4B02-11-00739-A-001P	RU000A103ZE3	Акционерное общество "ДОМ.РФ"	1027700262270	50 000	50 471 000,00	0,37
4B02-11-36241-R-001P	RU000A101QA8	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	90 000	90 925 200,00	0,66
4B02-11-65045-D	RU000A02XJK7	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	29 500	29 597 214,94	0,22
4B02-12-01326-B-002P	RU000A1036E6	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 977 630,60	0,15
4B02-15-65045-D-001P	RU000A1009L8	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	300 000	303 593 725,74	2,22
4B02-16-01326-B-002P	RU000A1049K6	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	3 000	3 064 050,30	0,02
4B02-18-00354-B-001P	RU000A102GJ8	"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110	300 000	291 685 290,00	2,13
4B02-18-04715-A-001P	RU000A102VL3	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	27 000	27 029 901,15	0,20
4B02-20-04715-A-001P	RU000A104SU6	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	49 400	54 432 378,00	0,40
4B02-22-04715-A-001P	RU000A1051T3	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	183 000	183 898 530,00	1,34
4B02-231-01000-B-001P	RU000A103BE8	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	100 000	101 233 000,00	0,74
4B02-24-65045-D-001P	RU000A104SX0	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	3 000	3 113 866,25	0,02
4B02-264-01481-B-001P	RU000A101QW2	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	350 000	338 898 000,00	2,48
4B02-333-00004-T-001P	RU000A1031T5	Государственная корпорация развития "ВЭБ.РФ"	1077711000102	300 000	308 513 415,94	2,25
4B02-335-01481-B-001P	RU000A1025U5	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	23 900	23 638 295,00	0,17
4B02-369-01481-B-001P	RU000A102FR3	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	150 000	150 718 500,00	1,10
4B02-431-01481-B-001P	RU000A102RS6	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	3 300	3 327 456,00	0,02
4B02-474-01481-B-001P	RU000A103G42	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	10 000	9 667 900,00	0,07
4B02-478-01481-B-001P	RU000A103H66	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	100 000	100 544 822,51	0,73
4B02-511-01481-B-001P	RU000A1040T7	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	475 000	487 593 249,44	3,56
4B020903349B	RU000A0JYWB3	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	6 000	5 964 258,00	0,04
4B021403349B	RU000A0JLW72	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	49 500	49 994 406,00	0,37
4B021801326B	RU000A0JX5W4	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 964 800,00	0,15
4B022101326B	RU000A0ZYBM4	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	162	160 132,04	0,00
<b>Итого:</b>					<b>8 482 766 405,49</b>	<b>61,99</b>
<b>Ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах</b>						
4-18-00307-R-002P	RU000A102D46	Общество с ограниченной ответственностью "ДОМ.РФ Ипотечный агент"	1167746438881	50 000	17 810 335,00	0,13
41403338B	RU000A0JLJG1	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	24 000	8 836 399,20	0,06
4B02-02-00307-R-001P	RU000A102B9	Общество с ограниченной ответственностью "ДОМ.РФ Ипотечный агент"	1167746438881	250 000	97 344 050,00	0,71
<b>Итого:</b>					<b>123 990 784,20</b>	<b>0,91</b>
<b>Ценные бумаги международных финансовых организаций</b>						
RU000A100C1	RU000A100C1	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BLL187	3 300	3 318 779,31	0,02
RU000A101L54	RU000A101L54	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BLL187	303 000	311 407 738,44	2,28
<b>Итого:</b>					<b>314 726 517,75</b>	<b>2,30</b>
<b>Денежные средства на счетах в кредитных организациях</b>						
Банк ГТБ (АО), 28.2019-ДУ, 16.10.2019		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		2 198 743,30	0,02
Банк ГТБ (АО), 810-6-7626/05, 27.12.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		3 729 202,68	0,03
Банк ГТБ (АО), 810-1-20-4410/2016, 11.03.2016		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		2 843 491,45	0,02
Банк ГТБ (АО), 810-8-7635/05, 19.05.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		157 282 378,35	1,15
Банк ГТБ (АО), 810-9-2-7635/2015, 21.08.2015		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		2 751,00	0,00
Московский филиал "БАНК СГБ", 854, 16.09.2019		Московский филиал акционерного общества "БАНК СГБ"	1023500000160		1 170,51	0,00
<b>Итого:</b>					<b>166 057 737,29</b>	<b>1,21</b>
<b>Средства на специальных брокерских, клиринговых счетах</b>						
АО "ААА Управление Капиталом", ДКУ/02334/18, 17.09.2018		Акционерное общество "ААА Управление Капиталом"	1047796382920		66 485,98	0,00
Банк ГТБ (АО), Б-ММВБ-0746, 12.01.2006		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		2 157,19	0,00
ООО "АЛОР +", 60452, 09.03.2016		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		35 404 957,65	0,26
ООО "АЛОР +", 69039, 17.10.2019		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		109 175,64	0,00
<b>Итого:</b>					<b>35 582 776,46</b>	<b>0,26</b>
<b>Дебиторская задолженность по сделкам репо</b>						
29006RMFS	RU000A0JV4L2	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		1 479 769,32	0,01
29014RMFS	RU000A101N52	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		351 005 668,80	2,57
52002RMFS	RU000A0OZY226	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		6 819 586,40	0,05
<b>Итого:</b>					<b>359 305 024,52</b>	<b>2,63</b>
<b>Дебиторская задолженность эмитента (по погашению номинала и процентному (купонному) доходу) по облигациям</b>						
26223RMFS	RU000A0OZYU88	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636		29 460,69	0,00
4B02-04-65018-D	RU000A0OZYJ91	Публичное акционерное общество "Федеральная сетевая компания Единой энергетической системы"	1024701893336		50 103,80	0,00
RU35002YML0	RU35002YML0	Правительство Ямало-Ненецкого автономного округа	1028900508735		324 292,50	0,00
<b>Итого:</b>					<b>403 856,99</b>	<b>0,00</b>
<b>Начисленные проценты по МНО</b>						
Банк ГТБ		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		207 057,53	0,00
<b>Итого:</b>					<b>207 057,53</b>	<b>0,00</b>
<b>Прочая дебиторская задолженность, в т.ч.:</b>						
Расчеты с прочими дебиторами ЗАО "Лидер"		Закрытое акционерное общество "Лидер" (Компания по управлению активами пенсионного фонда)	1025002040250		692 603,95	0,01
<b>Итого:</b>					<b>692 603,95</b>	<b>0,01</b>
<b>Кредиторская задолженность, в т.ч.:</b>						
Расчеты с АО "Специализированный депозитарий "ИНВИНТИМ"		АО "Специализированный депозитарий "ИНВИНТИМ"	1027739039283		-92 975,74	0,00
<b>Итого:</b>					<b>-92 975,74</b>	<b>0,00</b>
<b>Всего активов:</b>					<b>13 684 208 878,74</b>	<b>100,00</b>