

4B02-07-25642-H	RU000A0W5H6	Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	102770006289	40 000	43 480 025.90	0.33
4B02-07-65045-D-001P	RU000A0Z9R4	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	3 756	3 620 139.09	0.03
4B02-08-01326-B-002P	RU000A102A07	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	100 000	94 612 760.00	0.73
4B02-08-02272-B-002P	RU000A103D00	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	105 400	103 024 863.70	0.79
4B02-08-03251-B-003P	RU000A1042P0	Публичное акционерное общество "Промсвязьбанк"	1027739019142	250 000	254 703 292.54	1.96
4B02-09-01326-B-002P	RU000A102Z28	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	250 000	234 345 212.50	1.80
4B02-09-25642-H	RU000A100B73	Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	102770006289	250 000	255 929 870.67	1.97
4B02-10-01326-B-002P	RU000A102S80	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 113 800.00	0.15
4B02-10-36241-R-001P	RU000A101LH4	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	150 000	152 519 073.00	1.17
4B02-11-36241-R-001P	RU000A104Q48	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	90 000	88 375 500.00	0.68
4B02-11-65045-D	RU000A0DJK7	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	29 500	30 659 065.73	0.24
4B02-12-01326-B-002P	RU000A103E66	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 021 000.00	0.15
4B02-12-04715-A-001P	RU000A100ZK0	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	100 000	95 947 310.00	0.74
4B02-15-65045-D-001P	RU000A1009L8	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	102773987295	300 000	301 434 496.26	2.32
4B02-16-01326-B-002P	RU000A1049K6	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	3 000	3 005 567.10	0.02
4B02-18-00354-B-001P	RU000A102GJ8	"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110	300 000	279 342 000.00	2.15
4B02-18-04715-A-001P	RU000A102VL3	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	27 000	26 050 129.20	0.20
4B02-231-01000-B-001P	RU000A103BE8	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	100 000	96 497 150.00	0.74
4B02-264-01481-B-001P	RU000A101QW2	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	350 000	325 192 070.00	2.50
4B02-333-00004-T-001P	RU000A1031T5	государственная корпорация развития "ВЭБ.РФ"	1027711000102	300 000	306 505 707.40	2.36
4B02-335-01481-B-001P	RU000A102S15	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	23 900	22 786 271.95	0.18
4B02-369-01481-B-001P	RU000A102FK3	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	150 000	146 502 000.00	1.13
4B02-431-01481-B-001P	RU000A102RS6	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	3 300	3 210 075.00	0.02
4B02-474-01481-B-001P	RU000A103G42	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	10 000	9 659 300.00	0.07
4B02-478-01481-B-001P	RU000A103H66	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	100 000	103 649 597.76	0.80
4B02-511-01481-B-001P	RU000A1040U7	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	475 000	484 185 305.42	3.72
4B020501326B002P	RU000A100PQ8	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	4 491	4 617 466.56	0.04
4B02050349B001P	RU000A0ZYX14	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	29 075	29 881 831.25	0.23
4B020903349B	RU000A0YVW3	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	6 000	5 840 052.60	0.04
4B021201481B001P	RU000A0ZZB89	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	14 828	15 382 270.64	0.12
4B021403349B	RU000A0UW72	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	49 500	49 106 866.05	0.38
4B021801326B	RU000A0XS54	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 489 054.00	0.15
4B022101326B	RU000A0ZYU84	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	162	155 070.30	0.00
Итого:					8 500 460 263.59	65.38
Ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах						
4-18-00307-R-002P	RU000A102D46	Общество с ограниченной ответственностью "ДОМ.РФ Ипотечный агент"	1167746438881	50 000	23 660 495.00	0.18
41403338B	RU000A0UJG1	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	24 000	11 212 351.20	0.09
4B02-02-00307-R-001P	RU000A102B9	Общество с ограниченной ответственностью "ДОМ.РФ Ипотечный агент"	1167746438881	250 000	129 598 250.00	1.00
Итого:					164 471 096.20	1.27
Ценные бумаги международных финансовых организаций						
RU000A100JC1	RU000A100C1	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BL1.187	3 300	3 267 396.33	0.03
RU000A101L54	RU000A101L54	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BL1.187	303 000	309 529 834.37	2.38
Итого:					312 797 230.70	2.41
Денежные средства на счетах в кредитных организациях						
Банк ГТБ (АО), 28.09.2019-ДУ, 16.10.2019		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		527 079.19	0.00
Банк ГТБ (АО), 810-0-762605, 27.12.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		868 467.58	0.01
Банк ГТБ (АО), 810-1-20-4410/2016, 11.03.2016		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 567 848.47	0.01
Банк ГТБ (АО), 810-8-763505, 19.05.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		105 478 485.85	0.81
Банк ГТБ (АО), 810-9-2-76352015, 21.08.2015		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		59 908.70	0.00
Московский филиал "БАНК СГБ", 854, 16.09.2019		Московский филиал акционерного общества "БАНК СГБ"	1023500000160		1 170.51	0.00
Итого:					108 502 960.30	0.83
Средства на специальных брокерских, клиринговых счетах						
АО "ГТБ - УА", ДКУ02334/18, 17.09.2018		Акционерное общество "Газпромбанк - Управление активами"	1047796382920		10 156.57	0.00
Банк ГТБ (АО), Б-ММВБ-0746, 12.01.2006		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 376.19	0.00
ООО "АЛОР +", 60452, 09.03.2016		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		6 619 139.58	0.05
ООО "АЛОР +", 69039, 17.10.2019		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		437 133.20	0.00
Итого:					7 067 805.54	0.05
Дебиторская задолженность по сделкам репо						
26220RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		179 002 882.98	1.38
26223RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		44 200 110.81	0.34
26230RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		28 999 969.82	0.22
29020RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		6 999 733.03	0.05
Итого:					259 202 696.64	1.99
Начисленные проценты по МНО						
Банк ГТБ (АО)		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		179 871.23	0.00
Итого:					179 871.23	0.00
Прочая кредиторская задолженность, в т.ч.:						
АО "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"		Акционерное общество "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"	1027739039283		-90 916.38	-0.001
ЗАО "Лидер"		ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ЛИДЕР" (КОМПАНИЯ ПО УПРАВЛЕНИЮ АКТИВАМИ ПЕНСИОННОГО ФОНДА)	1025002040250		-163 097.32	-0.001
Итого:					-254 013.70	0.00
Всего активов:					13 000 930 903.12	100.00