

4B02-05-04715-A-001P	RU000AOZYWX7	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 849	2 895 951,52	0,02
4B02-05-35992-H-001P	RU000A101PU8	акционерное общество "Трансмашхолдинг"	1027739893246	100 000	100 857 000,00	0,81
4B02-05-36241-R	RU000AOJW9G0	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	475	480 963,29	0,00
4B02-05-36241-R-001P	RU000A100AB2	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	2 000	2 052 440,00	0,02
4B02-06-00013-A	RU000AOJWGC2	Публичное акционерное общество "Акционерная нефтяная Компания "Башнефть"	1020202555240	188 933	198 981 037,76	1,59
4B02-06-02272-B-002P	RU000A101QG5	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	5 000	5 117 868,50	0,04
4B02-06-31153-H-001P	RU000A100RG5	Акционерное общество "Минерально-химическая компания "ЕвроХим"	1027700002659	9 990	10 403 086,50	0,08
4B02-06-36241-R-001P	RU000A100V46	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	3 316	3 370 091,26	0,03
4B02-06-65045-D-001P	RU000AOZZ4P9	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	103773987295	2 000	2 020 727,56	0,02
4B02-07-00143-A	RU000A1008L0	Публичное акционерное общество "Северсталь"	1023501236901	500 000	503 363 273,28	4,02
4B02-07-01556-A	RU000AOJW4P6	Публичное акционерное общество "ПИК-специализированный застройщик"	1027739137084	20 000	20 951 598,00	0,17
4B02-07-02272-B-002P	RU000A102F28	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	100 000	101 133 000,00	0,81
4B02-07-04715-A-001P	RU000A100238	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	100 000	105 316 441,00	0,84
4B02-07-25642-H	RU000AOJW5H6	Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛИОНВЕСТ"	1027700006289	40 000	43 141 953,01	0,34
4B02-07-65045-D	RU000AOJWC82	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	103773987295	1 516	1 536 845,00	0,01
4B02-07-65045-D-001P	RU000AOZZ9R4	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	103773987295	3 756	3 910 641,21	0,03
4B02-08-01326-B-002P	RU000A102A07	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	100 000	97 573 110,00	0,78
4B02-08-55319-E	RU000AOJW175	акционерное общество "Атомный энергопромышленный комплекс"	107758081664	71 744	74 895 894,74	0,60
4B02-09-01326-B-002P	RU000A102JZ8	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	250 000	248 800 600,00	1,99
4B02-09-25642-H	RU000A100B73	Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛИОНВЕСТ"	1027700006289	250 000	250 294 148,34	2,00
4B02-10-01326-B-002P	RU000A102S80	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	19 836 800,00	0,16
4B02-10-36241-R-001P	RU000A101LH4	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	150 000	150 986 265,00	1,21
4B02-11-36241-R-001P	RU000A101Q48	Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС"	1067761792053	90 000	91 212 771,60	0,73
4B02-11-65045-D	RU000AOJXJK7	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	103773987295	29 500	29 997 076,98	0,24
4B02-12-04715-A-001P	RU000A100ZK0	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	100 000	101 249 000,00	0,81
4B02-15-65045-D-001P	RU000A1009L8	Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	103773987295	300 000	301 224 707,28	2,41
4B02-18-00354-B-001P	RU000A102GJ8	"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110	300 000	301 419 000,00	2,41
4B02-264-01481-B-001P	RU000A101QW2	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	350 000	348 337 500,00	2,78
4B02-333-00004-T-001P	RU000A1031T5	государственная корпорация развития "ВЭБ.РФ"	1077711000102	300 000	300 288 003,28	2,40
4B02-369-01481-B-001P	RU000A102FR3	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	150 000	151 221 000,00	1,21
4B02-431-01481-B-001P	RU000A102R56	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	3 300	3 330 129,00	0,03
4B020101326B002P	RU000AOZZEW4	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	200	205 212,00	0,00
4B020201326B002P	RU000AOZZRB0	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1 868	1 976 544,06	0,02
4B020501326B002P	RU000A100PQ8	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	4 491	4 649 667,03	0,04
4B020503349B001P	RU000AOZYXJ4	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	29 075	29 625 881,12	0,24
4B020903349B	RU000AOJVVW3	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	6 000	6 061 440,00	0,05
4B021201481B001P	RU000AOZZBN9	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	21 480	22 197 646,80	0,18
4B021401326B	RU000A0JLUA1	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	47	47 984,26	0,00
4B021403349B	RU000A0JLW72	Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	1027700342890	49 500	50 672 947,05	0,41
4B021801326B	RU000A0JXSW4	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	20 000	20 307 775,80	0,16
4B022101326B	RU000AOZYBM4	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	162	158 808,34	0,00
Итого:					7 524 821 666,06	60,15
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	34 228 250,00	0,27
41403338B	RU000A0JLJG1	Публичное акционерное общество РОСБАНК	1027739460737	24 000	15 785 594,40	0,13
4B02-02-00307-R-001P	RU000A102JB9	Общество с ограниченной ответственностью "ДОМ.РФ Ипотечный агент"	1167746438881	250 000	184 590 025,00	1,48
Итого:					234 603 869,40	1,88
Ценные бумаги международных финансовых организаций						
RU000A100JС1	RU000A100JC1	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BL1.187	3 300	3 472 866,21	0,03
RU000A101L54	RU000A101L54	Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BL1.187	303 000	303 671 833,42	2,43
Итого:					307 144 699,63	2,46
Денежные средства на счетах в кредитных организациях						
Банк ГТБ (АО), 28/2019-ДУ, 16.10.2019		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		623 770,25	0,00
Банк ГТБ (АО), 810-0-7626/05, 27.12.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		2 080 176,25	0,02
Банк ГТБ (АО), 810-1-20-4410/2016, 11.03.2016		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 203 933,60	0,01
Банк ГТБ (АО), 810-8-7635/05, 19.05.2005		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		44 565 879,23	0,36
Банк ГТБ (АО), 810-9-2-7635/2015, 21.08.2015		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		85 1 80,51	0,00
Московский филиал "БАНК СГБ", 854, 16.09.2019		Московский филиал акционерного общества "БАНК СГБ"	1023500000160		225,30	0,00
Итого:					48 559 165,14	0,39
Средства на специальных брокерских, клиринговых счетах						
АО "ГТБ - УА", ДКУ/02334/18, 17.09.2018		Акционерное общество "Газпромбанк - Управление активами"	1047796382920		56 893,48	0,00
Банк ГТБ (АО), Б-ММВБ-0746, 12.01.2006		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		754,79	0,00
ООО "АЛОР +", 60452, 09.03.2016		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		2 740 085,06	0,02
ООО "АЛОР +", 69039, 17.10.2019		Общество с ограниченной ответственностью "АЛОР +"	1027700075941		661 992,55	0,01
Итого:					3 459 725,88	0,03
Дебиторская задолженность по сделкам репо						
29012RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		13 699 967,45	0,11
52003RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		124 007 587,04	0,99
Итого:					137 707 554,49	1,10
Дебиторская задолженность эмитента (по погашению номинала и процентному (купонному) доходу) по облигациям						
4B02-02-35992-H-001P		акционерное общество "Трансмашхолдинг"	1027739893246		2 052 900,00	0,02
Итого:					2 052 900,00	0,02
Начисленные проценты по МНО						
Банк ГТБ (АО)		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		9 400,00	0,00
Итого:					9 400,00	0,00
Прочая дебиторская задолженность, в т.ч.:						
Расчеты с прочими дебиторами. ЗАО "Лидер"		Закрытое акционерное общество "Лидер" (Компания по управлению активами пенсионного фонда)	1025002040250		77 792,87	0,00
Итого:					77 792,87	0,00
Кредиторская задолженность						
АО "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"			1027739039283		-90 138,34	
Итого:					-90 138,34	0,00
Всего активов:					12 509 536 691,78	100,00