АПРЕЛЬ КАПИТАЛ

Акционерное общество Управляющая компания "Апрель Капитал"

123112, Москва г, Пресненская наб, дом № 12

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам

на 31.03.2018

Инвестор: Ассоциация "Региональная саморегулируемая организация профессиональных арбитражных управляющих"
Договор: С108/ДУ-ЮЛ-2018

Финансовый инструмент	Тип вложения	Коли-чество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. ст-ти	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / Дата исполнения контракта	Уровень	Duration	YTM
1	3	4	4.1	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
P/c 40701810601850000118 (RUB)	Деньги	2 698,12	2 698,12	2 698,12	2 698,12		0,01%			1.000000	2 698,12	0,01%				
Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"					**2 698,12**		**0,01%**				**2 698,12**	**0,01%**				
По всем Деньги					**2 698,12**		**0,01%**				**2 698,12**	**0,01%**				
Деньги у брокера, р/с 40701810400020005890 (RUB)	Деньги у брокера	222 425,35	222 425,35	222 425,35	222 425,35		0,91%			1.000000	222 425,35	0,91%				
Всего по НКО АО НРД					**222 425,35**		**0,91%**				**222 425,35**	**0,91%**				
По всем Деньги у брокера					**222 425,35**		**0,91%**				**222 425,35**	**0,91%**				
1-03-40046-N АЛРОСА ао	Акции	13 000,00	13 000,00	91,60	1 190 800,00	-2 051,55		30.03.2018		91.600000	1 190 800,00			I-Акции и ДР		
Всего по АК "АЛРОСА" (ПАО)					**1 190 800,00**		**4,85%**				**1 190 800,00**	**4,85%**				
1-01-00010-A Аэрофлот, ао	Акции	4 200,00	4 200,00	155,20	651 840,00	-18 536,39		30.03.2018		155.200000	651 840,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Аэрофлот"					**651 840,00**		**2,66%**				**651 840,00**	**2,66%**				
1-02-00028-A ГАЗПРОМ ао	Акции	8 140,00	8 140,00	142,66	1 161 252,40	27 903,55		30.03.2018		142.660000	1 161 252,40			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Газпром"					**1 161 252,40**		**4,73%**				**1 161 252,40**	**4,73%**				
1-01-00077-A ЛУКОЙЛ, ао	Акции	160,00	160,00	3 980,50	636 880,00	24 610,00		30.03.2018		3980.500000	636 880,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "ЛУКОЙЛ"					**636 880,00**		**2,59%**				**636 880,00**	**2,59%**				
1-03-00822-J МегаФон ао	Акции	1 680,00	1 680,00	541,40	909 552,00	33 537,22		30.03.2018		541.400000	909 552,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "МегаФон"					**909 552,00**		**3,70%**				**909 552,00**	**3,70%**				
10301481B Сбербанк России ОАО, ао	Акции	4 000,00	4 000,00	253,80	1 015 200,00	-477,00		30.03.2018		253.800000	1 015 200,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО Сбербанк					**1 015 200,00**		**4,14%**				**1 015 200,00**	**4,14%**				
1-02-00143-A Северсталь-ао	Акции	1 050,00	1 050,00	873,10	916 755,00	-20 761,26		30.03.2018		873.100000	916 755,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Северсталь"					**916 755,00**		**3,73%**				**916 755,00**	**3,73%**				
2-01-00155-A Сургутнефтегаз-ап	Акции	10 200,00	10 200,00	29,56	301 512,00	-8 916,68		30.03.2018		29.560000	301 512,00			II-Акции и ДР		
Всего по ОАО "Сургутнефтегаз"					**301 512,00**		**1,23%**				**301 512,00**	**1,23%**				
По всем Акции					**6 783 791,40**		**27,63%**				**6 783 791,40**	**27,63%**				
25083RMFS ОФЗ 25083	Облигации Фед	2 000,00	2 000,00	1 019,00	2 038 000,00	-3 700,12		30.03.2018		1019.000000	2 038 000,00		15.12.2021	I-Облигации	1 183,00	6,51
25083RMFS ОФЗ 25083	Купон		-	32,80	65 600,00	1 920,00		31.03.2018		32,800000	65 600,00		20.06.2018	I-Облигации		
Всего по 25083RMFS ОФЗ 25083					***2 103 600,00***	***-1 780,12***	***8,57%***				***2 103 600,00***	***8,57%***				***6,51***
26220RMFS ОФЗ 26220	Облигации Фед	7 700,00	7 700,00	1 041,05	8 016 085,00	318 776,16		30.03.2018		1041.050000	8 016 085,00		07.12.2022	I-Облигации	1 454,00	6,45
26220RMFS ОФЗ 26220	Купон		-	21,90	168 630,00	166 820,44		31.03.2018		21,900000	168 630,00		13.06.2018	I-Облигации		
Всего по 26220RMFS ОФЗ 26220					***8 184 715,00***	***485 596,60***	***33,34%***				***8 184 715,00***	***33,34%***				***6,45***
26223RMFS ОФЗ 26223	Облигации Фед	1 555,00	1 555,00	993,41	1 544 752,55	-3 714,35		30.03.2018		993.410000	1 544 752,55		28.02.2024	I-Облигации	1 815,00	6,74
26223RMFS ОФЗ 26223	Купон		-	6,77	10 527,35	1 383,95		31.03.2018		6,770000	10 527,35		05.09.2018	I-Облигации		
Всего по 26223RMFS ОФЗ 26223					***1 555 279,90***	***-2 330,40***	***6,34%***				***1 555 279,90***	***6,34%***				***6,74***
26222RMFS ОФЗ, 26222	Облигации Фед	5 400,00	5 400,00	1 024,50	5 532 300,00	136 081,62		30.03.2018		1024.500000	5 532 300,00		16.10.2024	I-Облигации	1 904,00	6,73
26222RMFS ОФЗ, 26222	Купон		-	30,54	164 916,00	81 918,00		31.03.2018		30,540000	164 916,00		25.04.2018	I-Облигации		
Всего по 26222RMFS ОФЗ, 26222					***5 697 216,00***	***217 999,62***	***23,21%***				***5 697 216,00***	***23,21%***				***6,73***
Всего по Минфин России					**17 540 810,90**		**71,45%**				**17 540 810,90**	**71,45%**				**6,61**
По всем Облигации Фед					**17 540 810,90**		**71,45%**				**17 540 810,90**	**71,45%**				**6,61**
	ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:				**24 549 725,77**		**100,00%**				**24 549 725,77**	**100,00%**			**1,89**	**1,89**

Вр.И.О. Генерального директора _____ **Н.М. Буайе**

МП

УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ "АПРЕЛЬ КАПИТАЛ"