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 30.09.2018

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	4 006,61	4 006,61	4 006,61	4 006,61		0,02%			1.000000	4 006,61	0,02%				
Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"					**4 006,61**		**0,02%**				**4 006,61**	**0,02%**				
По всем Деньги					**4 006,61**		**0,02%**				**4 006,61**	**0,02%**				
Деньги у брокера, р/с 40701810400020005890 (RUB)	Деньги у брокера	2 506,03	2 506,03	2 506,03	2 506,03		0,01%			1.000000	2 506,03	0,01%				
Всего по ПАО СБЕРБАНК					**2 506,03**		**0,01%**				**2 506,03**	**0,01%**				
По всем Деньги у брокера					**2 506,03**		**0,01%**				**2 506,03**	**0,01%**				
1-03-40046-N АЛРОСА ао	Акции	11 400,00	11 400,00	106,26	1 211 364,00	156 455,50		28.09.2018		106.260000	1 211 364,00			I-Акции и ДР		
Всего по АК "АЛРОСА" (ПАО)					**1 211 364,00**		**4,71%**				**1 211 364,00**	**4,71%**				
1-01-00010-A Аэрофлот, ао	Акции	2 978,00	2 978,00	106,35	316 710,30	-144 242,03		28.09.2018		106.350000	316 710,30			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Аэрофлот"					**316 710,30**		**1,23%**				**316 710,30**	**1,23%**				
10401000B ВТБ ао	Акции	4 000 000,00	4 000 000,00	0,04	163 400,00	-13 948,59		28.09.2018		0.040900	163 400,00			I-Акции и ДР		
Всего по Банк ВТБ (ПАО)					**163 400,00**		**0,64%**				**163 400,00**	**0,64%**				
1-02-00028-A ГАЗПРОМ ао	Акции	7 000,00	7 000,00	162,14	1 134 980,00	159 525,23		28.09.2018		162.140000	1 134 980,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Газпром"					**1 134 980,00**		**4,41%**				**1 134 980,00**	**4,41%**				
1-01-00077-A ЛУКОЙЛ, ао	Акции	185,00	185,00	4 988,50	922 872,50	160 109,42		28.09.2018		4988.500000	922 872,50			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "ЛУКОЙЛ"					**922 872,50**		**3,59%**				**922 872,50**	**3,59%**				
1-01-55005-E Челябинский металлургический комбинат ао	Акции	4 050,00	4 050,00	105,40	426 870,00	-52 353,02		28.09.2018		105.400000	426 870,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Мечел"					**426 870,00**		**1,66%**				**426 870,00**	**1,66%**				
1-01-04715-A МТС-ао	Акции	1 010,00	1 010,00	271,70	274 417,00	18 788,11		28.09.2018		271.700000	274 417,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "МТС"					**274 417,00**		**1,07%**				**274 417,00**	**1,07%**				
1-05-08443-H Московская Биржа, ао	Акции	2 800,00	2 800,00	97,50	273 000,00	-10 609,71		28.09.2018		97.500000	273 000,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО Московская Биржа					**273 000,00**		**1,06%**				**273 000,00**	**1,06%**				
1-01-40155-F ГМК Норильский никель, ао	Акции	39,00	39,00	11 295,00	440 505,00	20 318,43		28.09.2018		11295.000000	440 505,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "ГМК "Норильский никель"					**440 505,00**		**1,71%**				**440 505,00**	**1,71%**				
1-01-55192-E ПАО "Полюс" ао	Акции	85,00	85,00	4 084,00	347 140,00	21 804,17		28.09.2018		4084.000000	347 140,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Полюс"					**347 140,00**		**1,35%**				**347 140,00**	**1,35%**				
10301481B Сбербанк России ОАО, ао	Акции	5 500,00	5 500,00	202,67	1 114 685,00	-207 979,13		28.09.2018		202.670000	1 114 685,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО Сбербанк					**1 114 685,00**		**4,34%**				**1 114 685,00**	**4,34%**				
1-02-00143-A Северсталь-ао	Акции	700,00	700,00	1 087,20	761 040,00	123 132,76		28.09.2018		1087.200000	761 040,00			I-Акции и ДР		
Всего по ПАО "Северсталь"					**761 040,00**		**2,96%**				**761 040,00**	**2,96%**				
По всем Акции					**7 386 983,80**		**28,73%**				**7 386 983,80**	**28,73%**				
29011RMFS Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом 29011	Облигации Фед	3 150,00	3 150,00	1 010,42	3 182 823,00	-50 921,77		28.09.2018		1010.420000	3 182 823,00		29.01.2020	I-Облигации	467,00	7,33
29011RMFS Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом 29011	Купон		-	13,18	41 517,00	40 165,50		30.09.2018		13,180000	41 517,00		30.01.2019	I-Облигации		
Всего по 29011RMFS Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом 29011					***3 224 340,00***	***-10 756,27***	***12,54%***				***3 224 340,00***	***12,54%***				***7,33***
25083RMFS ОФЗ 25083	Облигации Фед	2 000,00	2 000,00	975,66	1 951 320,00	-90 380,12		28.09.2018		975.660000	1 951 320,00		15.12.2021	I-Облигации	1 050,00	8,03
25083RMFS ОФЗ 25083	Купон		-	19,56	39 120,00	39 120,00		30.09.2018		19,560000	39 120,00		19.12.2018	I-Облигации		
Всего по 25083RMFS ОФЗ 25083					***1 990 440,00***	***-51 260,12***	***7,74%***				***1 990 440,00***	***7,74%***				***8,03***
26214RMFS ОФЗ 26214	Облигации Фед	250,00	250,00	982,16	245 540,00	679,60		28.09.2018		982.160000	245 540,00		27.05.2020	I-Облигации	574,00	7,70
26214RMFS ОФЗ 26214	Купон		-	21,57	5 392,50	220,00		30.09.2018		21,570000	5 392,50		28.11.2018	I-Облигации		
Всего по 26214RMFS ОФЗ 26214					***250 932,50***	***899,60***	***0,98%***				***250 932,50***	***0,98%***				***7,70***
26220RMFS ОФЗ 26220	Облигации Фед	3 000,00	3 000,00	980,19	2 940 570,00	-58 381,50		28.09.2018		980.190000	2 940 570,00		07.12.2022	I-Облигации	1 314,00	8,13
26220RMFS ОФЗ 26220	Купон		-	22,10	66 300,00	66 300,00		30.09.2018		22,100000	66 300,00		12.12.2018	I-Облигации		
Всего по 26220RMFS ОФЗ 26220					***3 006 870,00***	***7 918,50***	***11,70%***				***3 006 870,00***	***11,70%***				***8,13***
26223RMFS ОФЗ 26223	Облигации Фед	1 555,00	1 555,00	930,93	1 447 596,15	-100 870,75		28.09.2018		930.930000	1 447 596,15		28.02.2024	I-Облигации	1 680,00	8,29
26223RMFS ОФЗ 26223	Купон		-	4,45	6 919,75	6 919,75		30.09.2018		4,450000	6 919,75		06.03.2019	I-Облигации		
Всего по 26223RMFS ОФЗ 26223					***1 454 515,90***	***-93 951,00***	***5,66%***				***1 454 515,90***	***5,66%***				***8,29***
24019RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 24019	Облигации Фед	2 240,00	2 240,00	1 004,84	2 250 841,60	-2 626,35		28.09.2018		1004.840000	2 250 841,60		16.10.2019	I-Облигации	363,00	7,39
24019RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 24019	Купон		-	34,99	78 377,60	34 734,10		30.09.2018		34,990000	78 377,60		17.10.2018	I-Облигации		
Всего по 24019RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 24019					***2 329 219,20***	***32 107,75***	***9,06%***				***2 329 219,20***	***9,06%***				***7,39***
29012RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 29012	Облигации Фед	2 750,00	2 750,00	1 003,45	2 759 487,50	-70 077,90		28.09.2018		1003.450000	2 759 487,50		16.11.2022	I-Облигации	1 289,00	7,65
29012RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 29012	Купон		-	27,25	74 937,50	69 756,35		30.09.2018		27,250000	74 937,50		21.11.2018	I-Облигации		
Всего по 29012RMFS ОФЗ с переменным купонным доходом 29012					***2 834 425,00***	***-321,55***	***11,03%***				***2 834 425,00***	***11,03%***				***7,65***
26222RMFS ОФЗ, 26222	Облигации Фед	3 285,00	3 285,00	950,89	3 123 673,65	-159 025,86		28.09.2018		950,890000	3 123 673,65		16.10.2024	I-Облигации	1 767,00	8,32
26222RMFS ОФЗ, 26222	Купон		-	30,73	100 948,05	100 948,05		30.09.2018		30,730000	100 948,05		24.10.2018	I-Облигации		
Всего по 26222RMFS ОФЗ, 26222					***3 224 621,70***	***-58 077,81***	***12,54%***				***3 224 621,70***	***12,54%***				***8,32***
Всего по Минфин России					**18 315 364,30**		**71,24%**				**18 315 364,30**	**71,24%**				**7,86**
По всем Облигации Фед					**18 315 364,30**		**71,24%**				**18 315 364,30**	**71,24%**				**7,86**
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:					**25 708 860,74**		**100,00%**				**25 708 860,74**	**100,00%**			**2,86**	**2,86**

УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ "АПРЕЛЬ КАПИТАЛ" ОБЩЕСТВО ОГРН 1027700268513 МОСКВА

Генеральный директор

Раджпут Н.В.