

# Актуарное заключение

по итогам  
обязательного актуарного оценивания  
деятельности

Акционерного общества  
«Негосударственный пенсионный фонд  
ТРАДИЦИЯ»

(по итогам 2019 финансового года)

Ответственный актуарий

*В. Мур*  
27.03.20

Шерстнев В. И.

Москва  
2020



## СОДЕРЖАНИЕ

I. ВВЕДЕНИЕ.....	3
II. ВЫВОДЫ И РЕКОМЕНДАЦИИ .....	6
III. ПЕНСИОННЫЕ СХЕМЫ .....	7
IV. УЧАСТНИКИ И ВКЛАДЧИКИ ФОНДА.....	12
V. МЕТОДЫ АКТУАРНОГО ОЦЕНИВАНИЯ .....	14
VI. АКТУАРНЫЕ ПРЕДПОЛОЖЕНИЯ.....	16
VII. ОЦЕНИВАНИЕ АКТУАРНЫХ АКТИВОВ .....	17
VIII. РЕЗУЛЬТАТЫ ОЦЕНИВАНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ .....	18
IX. АНАЛИЗ ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТИ И ЭФФЕКТА ИЗМЕНЕНИЙ.....	21
X. ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ИНФОРМАЦИЯ.....	22
СПИСОК ПРИЛОЖЕНИЙ .....	23

## І. ВВЕДЕНИЕ

Данное заключение подготовлено по результатам обязательного актуарного оценивания деятельности Акционерного общества «Негосударственный пенсионный фонд ТРАДИЦИЯ» (ОГРН 1177700017725, ИНН 7704445513, место нахождения: Россия, 119021, г. Москва, бульвар Зубовский, д. 11 А, этаж 11, помещение I, ком. 1), лицензия №215/2 от 30 июня 2009 года на осуществление деятельности по негосударственному пенсионному обеспечению (далее – Фонд). Сайт Фонда [www.tradnpf.com](http://www.tradnpf.com). Фонд является правопреемником по всем обязательствам некоммерческой организации НЕГОСУДАРСТВЕННЫЙ ПЕНСИОННЫЙ ФОНД «ТРАДИЦИЯ» (ОГРН 1027700266791).

Актуарное оценивание осуществлялось ответственным актуарием Вячеславом Игоревичем Шерстневым (далее - Актуарий), зарегистрированным в Едином реестре ответственных актуариев под регистрационным номером 39, членом саморегулируемой организации актуариев Ассоциация профессиональных актуариев (ОГРН 1137799022085, ИНН 7703480716), включенной Банком России в реестр саморегулируемых организаций актуариев под регистрационным номером 1. Включен в Список лиц, сведения о которых подлежат внесению в единый реестр ответственных актуариев без проведения аттестации, сформированный на основании Указания Банка России от 20.01.2014 №3176-У. Успешно прошел аттестацию на ответственного актуария по направлению «Деятельность негосударственных пенсионных фондов» (Свидетельство №0028 саморегулируемой организации актуариев «Ассоциация профессиональных актуариев», решение аттестационной комиссии от 25.06.2019, протокол №7). Опыт актуарной деятельности с 1992 года.

Актуарное оценивание деятельности Фонда было проведено во исполнение статьи 21 Федерального закона «О негосударственных пенсионных фондах» в соответствии с Указанием Банка России № 4595-У от 31.10.2017 «О дополнительных требованиях к содержанию актуарного заключения, подготовленного по итогам проведения актуарного оценивания деятельности негосударственного пенсионного фонда» и с учетом Федерального закона от 02.11.2013 N 293-ФЗ (ред. от 21.07.2014) «Об актуарной деятельности в Российской Федерации», Федерального стандарта актуарной деятельности «Общие требования к осуществлению актуарной деятельности» (утв. Советом по актуарной деятельности 12.11.2014), Федерального стандарта актуарной деятельности «Актуарное оценивание деятельности негосударственных пенсионных фондов» от 28.12.2018 (далее - ФСАД НПФ), Федерального стандарта актуарной деятельности «Актуарное оценивание деятельности страховщика и негосударственного пенсионного фонда. Анализ активов и проведение сопоставления активов и обязательств» от 21.05.2018 (далее - ФСАД Активы), стандартов и правил саморегулируемой организации актуариев «Ассоциация профессиональных актуариев». Нормы нормативных правовых актов и (или) нормативных актов, вступившие в силу после отчетной даты, не учитывались.

Цель составления актуарного заключения – представление в уполномоченный орган, осуществляющий надзор за деятельностью негосударственных пенсионных фондов, заключения по итогам ежегодного обязательного актуарного оценивания деятельности Фонда. Задача, поставленная перед актуарием – проведение обязательного ежегодного актуарного оценивания в соответствии с требованиями, установленными законодательством.

Заказчиком актуарного оценивания являлся Фонд. Актуарное оценивание проводилось на основании гражданско-правового договора. В течение двенадцати месяцев,

предшествующих дате составления актуарного заключения, между Фондом и ответственным актуарием трудовые договоры и гражданско-правовые договоры, кроме договоров о проведении обязательного актуарного оценивания, отсутствовали.

Актуарное оценивание деятельности Фонда проводилось по состоянию на 31 декабря 2019 года.

Актуарное оценивание деятельности Фонда проводилось в период с 10 марта по 26 марта 2020 года.

Актуарное заключение составлено 27 марта 2020 года.

Значение (показатель) при оценивании признавалось существенным, если оно превышает один процент от валюты баланса Фонда, что составляет 5358 тыс. руб.

В отчетном периоде Фонд осуществлял деятельность по негосударственному пенсионному обеспечению.

Актуарное оценивание основывалось на предоставленных Фондом данных. Ответственность за достоверность и полноту представленных данных несет представившая их организация.

Фонд по запросу Актуария предоставил запрошенные сведения и копии документов, в том числе:

- Пенсионные правила Фонда;
- Шаблоны пенсионных договоров Фонда;
- Предписания, полученные Фондом за отчетный период;
- Учетная политика Фонда;
- Бухгалтерская отчетность на дату оценивания;
- Отчетность по негосударственному пенсионному обеспечению в ЦБ РФ на дату оценивания;
- Инвестиционные портфели на дату оценивания отдельно по пенсионным резервам и СС;
- Справки специализированного депозитария о рыночной стоимости активов на дату оценивания, по активам в которые вложены пенсионные резервы;
- Сведения о наличии/отсутствии обременений по активам;
- Справка с выводами о результатах определения признаков обесценения финансовых активов в составе пенсионных резервов АО «НПФ ТРАДИЦИЯ» на дату 31.12.2019
- Данные по доходности размещения пенсионных резервов.
- Информацию о договорах НПО;
- Информацию об участниках.

Указанные документы и информация были представлены в электронном виде.

Актуарий использовал следующие данные из открытых источников:

- прогноз инфляции - Официальный сайт Банка России – [www.cbr.ru/DKP/about\\_monetary\\_policy/main\\_objective\\_and\\_principles/](http://www.cbr.ru/DKP/about_monetary_policy/main_objective_and_principles/)
- данные по доходности ОФЗ – Московская биржа ([www.moex.com](http://www.moex.com))

Данные были проверены на адекватность и непротиворечивость. В том числе были проведены:

- сверка с бухгалтерской отчетностью общей суммы резервов покрытия пенсионных обязательств и собственных средств;
- сверка со специальной отчетностью общей численности получателей негосударственной пенсии;
- проверка данных на адекватность, включавшая проверку сведений о возрасте и размере выплат в части их попадания в ожидаемый интервал значений.

В отношении исходных данных существенные изменения и корректировки не проводились.

Предоставленные Фондом данные и данные из открытых источников соответствуют поставленной перед актуарием задаче (проведению обязательного актуарного оценивания деятельности Фонда) и достаточны для ее выполнения.

При проведении актуарного оценивания актуарием были проанализированы документы Фонда, включающие Пенсионные правила Фонда, данные бухгалтерской (финансовой) отчетности Фонда, справки специализированного депозитария о стоимости активов Фонда, формы договоров НПО и другая информация.

На основании проведенного анализа был сделан вывод о том, что состав, качество и объем предоставленной информации позволяют использовать ее в целях решения поставленной задачи.

Ответственность за актуарные выводы настоящего заключения несет актуарий. Конфликт интересов у Актуария отсутствовал. В случае необходимости Фонд может получить у Актуария дополнительную информацию и пояснения о сфере применения, методах и данных, использованных при составлении данного актуарного заключения.

## II. ВЫВОДЫ И РЕКОМЕНДАЦИИ

Актуарный дефицит не обнаружен. Стоимость активов Фонда, учитываемых при актуарном оценивании, составляет **526686** тыс. руб., что существенно выше 288787 тыс. руб. - суммы стоимости обязательств, отраженной в актуарном заключении.

Распределения ожидаемых поступлений денежных средств от активов и обязательств нельзя считать не согласованными на установленных временных интервалах.

По результатам проведенного актуарного оценивания обязательства Фонда по договорам негосударственного пенсионного обеспечения, отраженные в финансовой (бухгалтерской) отчетности, оцениваются как адекватные.

Не установлено существенных оснований, указывающих на невозможность Фонда выполнить имеющиеся финансовые обязательства, включая обязательства по выплате уже назначенных негосударственных пенсий, в том числе в условиях прекращения поступления взносов вкладчиков.

Риск возможной недооценки обязательств по НПО установлен.

Фонду рекомендуется увеличить размер страхового резерва до 5% от размера резервов покрытия пенсионных обязательств на отчетную дату.

### III. ПЕНСИОННЫЕ СХЕМЫ

Правила Фонда утверждены Советом директоров Фонда 24 ноября 2017 года и зарегистрированы Банком России 8 декабря 2017 года.

Правила Фонда содержат 2 пенсионные схемы.

*Пенсионная схема № 1. «С фиксированными пенсионными взносами и именными пенсионными счетами».*

Вкладчик вносит в Фонд пенсионные взносы в пользу Участника (Участников). Участник может выступать Вкладчиком в свою пользу. Порядок уплаты пенсионных взносов, их размер, периодичность и продолжительность определяются настоящими Правилами и устанавливаются Пенсионным договором.

При назначении негосударственной пенсии Участник может выбрать одну из схем пенсионных выплат, с учетом ограничений, установленных Пенсионным договором:

- пожизненная схема выплаты негосударственных пенсий;
- пожизненная схема выплат негосударственной пенсии с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока;
- срочные схемы пенсионных выплат;
- выплата негосударственной пенсии в течение выбранного Участником срока (не менее двух лет);
- выплата негосударственной пенсии до исчерпания средств, учтенных на именном пенсионном счете Участника (при расчетном сроке выплаты негосударственной пенсии не менее 12 месяцев).

Размер выкупной суммы, выплачиваемой либо переводимой в другой негосударственный пенсионный фонд при расторжении Пенсионного договора на этапе накопления, определяется по формуле:

$$S_{\text{вык}} = k_1 \cdot S_{\text{взн}} + k_2 \cdot S_{\text{доход}}, \quad \text{где:}$$

$S_{\text{вык}}$  - выкупная сумма;

$S_{\text{взн}}$  - отраженная на пенсионном счете сумма пенсионных взносов, включая пенсионные суммы, поступившие с других пенсионных счетов;

$S_{\text{доход}}$  - отраженная на пенсионном счете сумма инвестиционного дохода;

Коэффициенты  $k_1, k_2$  устанавливаются решением Совета директоров Фонда и указываются в Пенсионном договоре.

б) При расторжении договора на этапе выплат (при выборе Участником срочной схемы выплат или пожизненной схемы выплат с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока до истечения этого срока) выкупная сумма определяется по формуле:

$$S_{\text{вык}} = k_3 \cdot S_{\text{пенс}}, \quad \text{где:}$$

$S_{\text{пенс}}$  - пенсионная сумма, отраженная на именном пенсионном счете;

Коэффициент  $k_3$  устанавливается решением Совета директоров Фонда и указывается в Пенсионном договоре.



в) При выборе Участником пожизненной схемы пенсионных выплат выкупная сумма на этапе выплат негосударственной пенсии не выплачивается (не переводится в другой негосударственный пенсионный фонд).

г) При выборе Участником пожизненной схемы пенсионных выплат с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока выкупная сумма по истечении установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока не выплачивается (не переводится в другой негосударственный пенсионный фонд).

Пенсионная схема предусматривает возможность выбора Вкладчиком инвестиционной стратегии размещения пенсионных резервов.

Пенсионная схема предусматривает именную форму ведения пенсионных счетов.

Наследование происходит на всех этапах за исключением этапа выплаты пожизненной пенсии.

*Пенсионная схема № 2. «С фиксированными пенсионными взносами и применением солидарных пенсионных счетов в накопительный период».*

Вкладчик вносит в Фонд пенсионные взносы в пользу Участников. Порядок уплаты пенсионных взносов, их размер, периодичность и продолжительность определяются настоящими Правилами и устанавливаются Пенсионным договором.

Вкладчик вправе представлять в Фонд список Участников, в пользу которых он производит пенсионные взносы, изменять его или дополнять.

Участнику, получившему право требования по Пенсионному договору, Фонд открывает именной пенсионный счет на основании распорядительного письма Вкладчика. На именной пенсионный счет с солидарного пенсионного счета переводится сумма, указанная в распорядительном письме Вкладчика.

При назначении пенсии Участник может выбрать одну из схем пенсионных выплат (с учетом ограничений, которые могут быть установлены Пенсионным договором):

- пожизненная схема выплаты пенсий;
- пожизненная схема выплат с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока;
- срочные схемы выплат:
- выплата негосударственной пенсии в течение выбранного Участником срока (не менее двух лет);
- выплата негосударственной пенсии до исчерпания средств, учтенных на именном пенсионном счете Участника (при расчетном сроке выплаты негосударственной пенсии не менее 12 месяцев).

а) Выкупная сумма при расторжении Пенсионного договора выплачивается Вкладчику (либо переводится в другой негосударственный пенсионный фонд), исходя из размера пенсионной суммы, отраженной на солидарном пенсионном счете:

$$S_{\text{вык}} = k_4 \cdot S_{\text{пенс}}, \quad \text{где:}$$

$S_{\text{вык}}$  - выкупная сумма;

$S_{\text{пенс}}$  - пенсионная сумма, отраженная на солидарном пенсионном счете;



Коэффициент  $k_4$  устанавливается решением Совета директоров Фонда и указывается в Пенсионном договоре.

б) Размер выкупной суммы, выплачиваемой Участнику, получившему право требования при расторжении Пенсионного договора на этапе накопления, или при расторжении Пенсионного договора на этапе выплат (при выборе Участником срочной схемы выплат или пожизненной схемы выплат с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока до истечения этого срока) определяется, исходя из размера пенсионной суммы, отраженной на его именном пенсионном счете по формуле:

$$S_{\text{вык}} = k_5 \cdot S_{\text{пенс}}, \quad \text{где:}$$

$S_{\text{вык}}$  - выкупная сумма;

$S_{\text{пенс}}$  - пенсионная сумма, отраженная на именном пенсионном счете;

Коэффициент  $k_5$  устанавливается решением Совета директоров Фонда и указывается в Пенсионном договоре.

в) При выборе Участником пожизненной схемы выплат выкупная сумма на этапе выплат не выплачивается (не переводится в другой негосударственный пенсионный фонд).

з) При выборе Участником пожизненной схемы выплат с правопреемством в течение установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока выкупная сумма по истечении установленного Пенсионным договором (соглашением о выплатах) срока не выплачивается (не переводится в другой негосударственный пенсионный фонд).

Пенсионная схема предусматривает солидарную и именную форму ведения пенсионных счетов.

Пенсионная схема предусматривает возможность выбора Вкладчиком инвестиционной стратегии размещения пенсионных резервов.

Правилами Фонда устанавливаются следующие пенсионные основания для назначения Фондом Участнику пенсии по негосударственному пенсионному обеспечению:

- Достижение Участником возраста для назначения страховой пенсии по старости на общих основаниях, предусмотренных законодательством Российской Федерации.
- Досрочное назначение страховой пенсии по старости.
- Назначение страховой пенсии по инвалидности.
- Назначение страховой пенсии по случаю потери кормильца.
- Назначение пенсии по государственному пенсионному обеспечению в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Пенсионными договорами могут быть установлены одно либо несколько из перечисленных в настоящем пункте правил пенсионных оснований.

Пенсионными договорами могут быть установлены дополнительные основания для приобретения Участником права на получение негосударственной пенсии.

Выплаты негосударственных пенсий с выбранной Участником периодичностью:

- ежемесячно;

- ежеквартально;
- один раз в шесть месяцев;
- один раз в год.

Исполнение Фондом обязательств перед Участниками квалифицируется как встречное, то есть исполнимость обязательств Фонда обуславливается исполнением обязательств Вкладчиком. Исполнение встречных обязательств Фонда может быть приостановлено или прекращено в случае неисполнения Вкладчиком своих обязательств по Пенсионному договору либо наличия обстоятельств, очевидно свидетельствующих о том, что такое исполнение не будет произведено в установленный срок.

По состоянию на отчетную дату в Фонде были пенсионные договоры, заключенные в соответствии со схемой 1 данной редакции пенсионных правил. Данные договоры Фонд на этапе взносов классифицирует как инвестиционные с негарантированной возможностью получения дополнительных выгод (ИНВД).

На практике в Фонде есть договоры, действующие по пенсионным схемам из предыдущих редакций пенсионных правил:

*Пенсионная схема № 1 (Пенсионные правила от 31 мая 1996 года).* Солидарная схема.

*Пенсионная схема № 3 (Пенсионные правила от 25 мая 2001 года).* Схема с установленными пенсионными выплатами. Пенсионные выплаты производятся пожизненно или в течение установленного ряда лет (от 3 до 5 лет) с именного пенсионного счета участника.

*Пенсионная схема № 3 (Пенсионные правила от 30 марта 2005 года).* Схема с установленными пенсионными выплатами. Пенсионные выплаты производятся с солидарного пенсионного счета вкладчика или с именного пенсионного счета участника пожизненно или в течение определенного ряда лет (не менее 5 лет) до полного исчерпания средств на счете.

*Пенсионная схема № 3 (Пенсионные правила от 03 марта 2009 года).* Схема с установленными пенсионными выплатами. Пенсионные выплаты производятся с солидарного пенсионного счета вкладчика или с именного пенсионного счета участника пожизненно или в течение определенного ряда лет (не менее 5 лет) до полного исчерпания средств на пенсионном счете.

Эти пенсионные схемы используются в договорах трех типов:

1. Для выплат пожизненных пенсий. В этом случае никакие средства не наследуются и не выплачиваются при расторжении договора. Пенсии не индексируются. Договоры в этом случае классифицируются Фондом как страховые (СТРД).
2. Для выплат пенсий до исчерпания средств на пенсионном счете. В этом случае остаток средств на счете наследуется. Выплата пенсии прекращается после исчерпания средств на счете. Такие договоры классифицируются Фондом как ИНВД.
3. Для ведения солидарных пенсионных счетов вкладчика. Такие договоры классифицируются Фондом как ИНВД.

---

По некоторым договорам действует гарантированная ставка инвестиционной доходности 3%, а по одному договору – 6%.

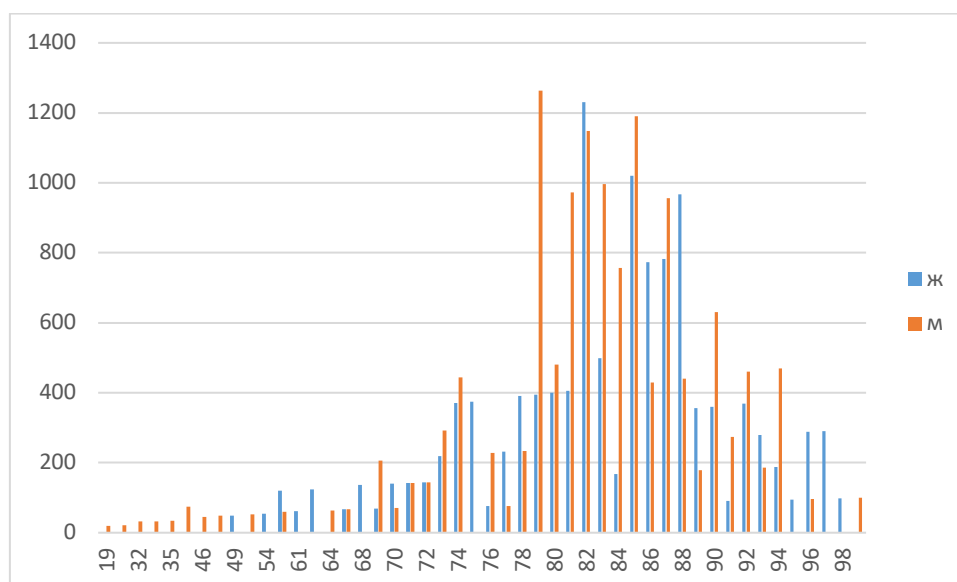
Распределение договоров негосударственного пенсионного обеспечения по группам однородных договоров в целях сопоставимости представления результатов проводилось исходя из принятой в Фонде классификации договоров на страховые договоры (далее – СТРД) и инвестиционные договоры с негарантированной возможностью получения дополнительных выгод (далее – ИНВД). При этом расчеты проводились по каждой из применяемых Фондом пенсионных схем без группировки на уровне счет-участник (т.е. при применении именных пенсионных счетов – по каждому именованному пенсионному счету, при применении солидарных пенсионных счетов – по каждому участнику, которому установлена негосударственная пенсия, и солидарному счету в целом).

#### IV. УЧАСТНИКИ И ВКЛАДЧИКИ ФОНДА

Вкладчиками Фонда являются юридические и физические лица.

Актуарию были предоставлены Фондом данные на 312 именных пенсионных счетов участников.

Распределение участников с ИПС по полу и возрасту показано на следующей диаграмме:



В следующей таблице дано распределение предполагаемых в следующем году выплат пенсии по полу и возрасту.

*Распределение предполагаемого размера выплат пенсии (руб.) в течение года, следующего за отчетным по полу, возрасту участников и продолжительности выплат*

Возраст	до исчерпания		пожизненно		срочная		Общий итог
	ж	м	ж	м	ж	м	
19						1 099 106,61	1 099 106,61
22						1 398 473,40	1 398 473,40
32						3 406 626,95	3 406 626,95
33		489,69					489,69
35		1 344,73					1 344,73
37		493,72				3 669 643,64	3 670 137,35
46						2 362 231,00	2 362 231,00
48						2 505 398,95	2 505 398,95
49					3 463 419,16		3 463 419,16
52				4 800,00			4 800,00
54					2 478 626,64		2 478 626,64
60	9 468 668,49	89 169,90	4 800,00				9 562 638,39
61			4 800,00				4 800,00

62			9 600,00				9 600,00
64		9 544 383,56					9 544 383,56
67	5 553 258,77			4 800,00			5 558 058,77
68	27 601 212,34		4 800,00				27 606 012,34
69		45 275,20	4 800,00	4 800,00			54 875,20
70			9 600,00	4 800,00			14 400,00
71	12 228 841,10		4 800,00	9 600,00			12 243 241,10
72			9 600,00	9 600,00			19 200,00
73		21 008,07	14 400,00	9 600,00			45 008,07
74		137 004,58	24 000,00	17 400,00		152 988,53	331 393,11
75			23 292,00				23 292,00
76		12 510,89	4 800,00	9 600,00			26 910,89
77			14 400,00			119 759,51	134 159,51
78			24 000,00	9 600,00		1 929 246,76	1 962 846,76
79		12 046,39	24 000,00	58 800,00		152 988,54	247 834,93
80		827 580,00	24 000,00	25 800,00			877 380,00
81		13 828,53	24 000,00	52 800,00			90 628,53
82	31 445,42	7 098,27	67 200,00	63 600,00			169 343,69
83		13 929,82	36 000,00	66 000,00			115 929,82
84		13 829,77	12 000,00	46 800,00			72 629,77
85	38 564,85	14 837,53	66 000,00	74 400,00			193 802,38
86			52 800,00	18 000,00			70 800,00
87			45 600,00	60 000,00			105 600,00
88	22 033,50		64 800,00	30 000,00			116 833,50
89	39 505,48		18 000,00	12 000,00			69 505,48
90			24 000,00	42 000,00			66 000,00
91		13 829,77	6 000,00	12 000,00			31 829,77
92			24 000,00	24 000,00			48 000,00
93			18 000,00	12 000,00			30 000,00
94			12 000,00	28 800,00			40 800,00
95			6 000,00				6 000,00
96	30 910,94		10 800,00	6 000,00			47 710,94
97			15 000,00				15 000,00
98			6 000,00				6 000,00
100				6 000,00			6 000,00

## V. МЕТОДЫ АКТУАРНОГО ОЦЕНИВАНИЯ

Методы актуарного оценивания установлены в соответствии с требованиями ФСАД НПФ.

Оценивание обязательств проводилось проспективным методом. Стоимость обязательств рассчитывалась как ожидаемая приведенная стоимость денежных потоков пенсий, выкупных сумм, наследуемых сумм, расходов на обслуживание договоров и отчислений в собственные средства. Расчет проводился по стандартным актуарным формулам.

В целях расчетов все будущие поступления и выплаты предполагаются ежегодными в начале каждого расчетного года.

Горизонт прогнозирования определен в сто лет. Такой выбор сделан потому, что за данный период все потоки по участникам Фонда, являющимся таковыми на отчетную дату, вероятнее всего будут завершены.

Обязательства рассчитываются по потокам по каждому участнику.

В соответствии с ФСАД НПФ величина обязательств, отраженная в актуарном заключении, не может быть менее стоимости гарантированных выплат (выкупная сумма или иная выплата, не являющаяся выплатой пенсии), которые могут быть произведены по требованию вкладчиков (участников).

«При определении стоимости обязательств по договорам негосударственного пенсионного обеспечения, отраженной в актуарном заключении, актуарию следует определять приведенную стоимость потока сопутствующих поступлений и выплат денежных средств в размере не менее приведенной стоимости ожидаемого потока денежных средств, направляемых на пополнение собственных средств негосударственного пенсионного фонда или имущества для обеспечения уставной деятельности фонда за счет дохода от размещения средств пенсионных резервов.» В этом случае распределение данного превышения по счетам проводится пропорционально размеру пенсионных обязательств.

В связи с нерегулярностью по данным Фонда уплаты пенсионных взносов по договорам с физическими лицами, а также в связи с тем, что по договорам с юридическими лицами предусмотрено прекращение выплат пенсий при прекращении взносов размер будущих взносов принимался равным нулю.

Целевые взносы принимались равными нулю.

В отношении участников, находящихся на этапе выплат, размер пенсии брался по данным Фонда.

В отношении участников, находящихся на этапе накопления, размер назначаемой пенсии определяется предположением, что пенсия будет выплачена за один год, так как такая возможность, предусмотренная правилами, выглядит наиболее вероятной.

В целях расчета и исходя из принципа разумной консервативности, размер выплаты принимается равным сумме, учтенной на именном пенсионном счете.

Размер выплат правопреемникам принимался равным остатку по счету на дату события.

Сопутствующие расходы в год, следующий за расчетной датой, определяются как произведение удельной величины расходов (на один пенсионный счет) на численность счетов на отчетную дату.

В общем случае солидарный счет рассматривается так же, как именной пенсионный счет, открытый в отношении участника на этапе накопления, назначение новых пенсий в отсутствие достаточной статистики не моделируется; в целях расчетов предполагается выплата выкупной суммы в размере профицита по солидарному пенсионному счету в день, следующий за отчетной датой.

В связи с высокой ликвидностью активов Фонда и значительным превышением общей стоимости ликвидных активов над суммой пенсионных резервов, стоимость гарантий обеспечения сохранности аккумулированных средств отдельно не рассчитывалась.



## VI. АКТУАРНЫЕ ПРЕДПОЛОЖЕНИЯ

Для расчета обязательств используются следующие предположения:

*Ставка дисконтирования 6,58%.* Данная ставка выбрана на основании кривой бескупонной доходности ОФЗ по состоянию на 30 декабря 2019 года, что соответствует доходности к погашению самых длинных до погашения государственных облигаций с постоянным доходом (ОФЗ 26225 и 26230), (данные сайта Московской биржи [www.moex.ru](http://www.moex.ru)). Такая ставка дисконтирования соответствует безрисковой временной стоимости денег в максимально доступной перспективе. Эта ставка дисконтирования используется для расчета приведенных стоимостей всех потоков. (при этом следует отметить, что по состоянию на 12 марта 2020 года такая ставка равна 8,28).

*Ставка доходности 7%.* Данная ставка выбрана исходя из прогноза Фонда данных по доходности. Ставка выбрана с учетом структуры портфеля активов Фонда. Данная ставка учитывает расходы на размещение пенсионных резервов (с математической точки зрения это означает мультипликативный учет потока расходов на размещение).

*Инфляция 4%.* Предположение взято из денежно-кредитной политики Банка России, опубликованной на его официальном сайте.

Для оценки *вероятностей дожития* участников НПО использовалась таблица смертности, рекомендуемая комитетом по статистике Ассоциации профессиональных актуариев для оценки обязательств НПФ по негосударственному пенсионному обеспечению ([www.actuary.ru](http://www.actuary.ru)). В данной таблице учтено ожидаемое увеличение продолжительности жизни. Из-за отсутствия достаточного объема данных по смертности участников Фонда анализ смертности не проводился.

Темп роста пенсий на основании данных Фонда и исторических данных предполагался нулевым. Также на основании данных Фонда не предполагалось представление негарантированных выгод.

В связи с тем, что в Фонде недостаточно данных по статистике возраста обращения за пенсией, предполагалось, что все участники и застрахованные лица обращаются за назначением пенсии в 60 лет для мужчин и в 55 лет для женщин. Для лиц более старших возрастов предполагалось немедленное обращение за назначением пенсии. Назначение пенсий по инвалидности не учитывалось из-за незначительности

Стоимость сопутствующих расходов на один пенсионный счет принята исходя из данных Фонда за предшествующий календарный год (2686 рублей) с дальнейшей индексацией по уровню инфляции. «Инфляция – это устойчивое повышение общего уровня цен на товары и услуги в экономике» (Банк России). Индексация увеличения расходов Фонда по инфляции связана с неоднородностью состава таких расходов (расходы на оплату труда, аренду помещений, программное обеспечение и т.д.)

*Вероятность выплаты выкупной суммы* на этапе накопления определяется на основе фактических данных на уровне 0.1.

В соответствии с законодательством доля дохода от размещения средств пенсионных резервов, направляемая на пенсионные счета, принята равной 85%. На основе практики Фонда 15% дохода от инвестирования пенсионных резервов направляются в собственные средства и в страховой резерв.

## VII. ОЦЕНИВАНИЕ АКТУАРНЫХ АКТИВОВ

Активы оценены следующим образом:

### *Пенсионные резервы*

Наименование	Балансовая стоимость, тыс. руб.	Актuarная оценка стоимости, тыс. руб.
Денежные средства	715	715
Денежные средства на брокерских счетах	175	175
Государственные ценные бумаги РФ	54606	54606
Корпоративные облигации	167642	167642
Акции	18335	18335
Паи ОПИФ	47742	47742
Дебиторская задолженность	266	266
Кредиторская задолженность	-520	-520
<i>Итого</i>	<i>288961</i>	<i>288961</i>

### *Собственные средства*

Наименование	Балансовая стоимость, тыс. руб.	Актuarная оценка стоимости, тыс. руб.
Денежные средства	1017	1017
Денежные средства на брокерских счетах	76	76
Государственные облигации	9078	9078
Корпоративные облигации	229169	229169
Дебиторская задолженность	316	40
Кредиторская задолженность	-1655	-1655
<i>Итого</i>	<i>238001</i>	<i>237725</i>

При оценке средств пенсионных резервов использовались данные специализированного депозитария. Данные по активам предоставлены Фондом (Приложения 2,3).

В связи с высокой ликвидностью активов актuarная оценка их стоимости принята равной балансовой стоимости с учетом процентного дохода. В дебиторской задолженности по собственным средствам не учтены основные средства, запасы, ИТ и т.п.

***Всего актuarных активов 526 686 тыс. руб.***

Распределение по годам ожидаемых будущих поступлений денежных средств от активов по видам вложений дано Фондом.

### VIII. РЕЗУЛЬТАТЫ ОЦЕНИВАНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Результаты оценивания обязательств Фонда с разбивкой по группам договоров в соответствии с классификацией Фонда приведены в следующей таблице

Договоры	Стоимость обязательств, тыс. руб.	Стоимость обязательств, отраженная в актуарном заключении, тыс. руб.	Обязательства по отчетности Фонда, тыс. руб.
ИНВД	261754	272940	268853
СТРД	15423	15847	15748
<i>Все</i>	<i>277177</i>	<i>288787</i>	<i>284601</i>

Сумма обязательств по возможной немедленной выплате выкупных сумм по всем договорам по данным Фонда не превосходит 273931 тыс. руб. Приведенная стоимость ожидаемого потока денежных средств, направляемых на пополнение собственных средств негосударственного пенсионного фонда или имущества для обеспечения уставной деятельности фонда за счет дохода от размещения средств пенсионных резервов равна 17700 тыс. руб., что превосходит сопутствующие расходы.

Распределение обязательств, отраженных в актуарном заключении, по полу и возрасту участников дано в следующей таблице. При этом следует заметить, что в ней не приведены обязательства по солидарным счетам.

*Распределение размера обязательств, отраженного в актуарном заключении, (руб.) по полу и возрасту участников*

Возраст	Женский	Мужской	Общий итог
19		10 937 950,37	10 937 950,37
22		13 882 151,55	13 882 151,55
32		33 575 034,25	33 575 034,25
33		58 046,82	58 046,82
35		63 682,11	63 682,11
37		36 121 984,52	36 121 984,52
46		23 023 952,33	23 023 952,33
48		24 263 988,18	24 263 988,18
49	34 860 607,55		34 860 607,55
52		111 651,98	111 651,98
54	25 018 756,74		25 018 756,74
60	9 983 559,20	95 674,83	10 079 234,03
61	104 359,34		104 359,34
62	204 023,87		204 023,87
64		9 955 832,38	9 955 832,38
67	5 793 777,39	80 042,72	5 873 820,11
68	28 873 757,21		28 873 757,21

69	85 432,81	128 551,49	213 984,30
70	166 277,34	73 975,75	240 253,09
71	12 836 090,33	144 054,48	12 980 144,81
72	157 034,26	140 249,81	297 284,06
73	228 587,30	163 836,40	392 423,70
74	369 352,18	559 003,34	928 355,52
75	351 488,17		351 488,17
76	69 218,89	141 890,15	211 109,04
77	200 694,69	127 574,52	328 269,21
78	322 920,28	2 133 943,07	2 456 863,36
79	311 399,13	908 153,72	1 219 552,85
80	299 933,74	1 160 110,78	1 460 044,53
81	288 537,76	618 393,13	906 930,89
82	811 706,85	707 072,81	1 518 779,67
83	367 722,70	667 693,47	1 035 416,17
84	117 498,92	467 428,38	584 927,29
85	661 435,90	715 472,61	1 376 908,51
86	476 435,09	160 256,97	636 692,05
87	396 322,22	531 967,07	928 289,28
88	539 666,27	247 584,99	787 251,26
89	182 876,12	95 018,69	277 894,81
90	175 504,36	318 091,29	493 595,66
91	41 411,59	103 689,89	145 101,47
92	155 673,91	164 105,55	319 779,46
93	109 104,17	77 218,39	186 322,56
94	67 442,19	175 026,57	242 468,76
95	30 918,63		30 918,63
96	86 826,24	29 790,67	116 616,92
97	64 875,26		64 875,26
98	20 402,79		20 402,79
100		8 942,97	8 942,97
<b>Общий итог</b>	<b>124 831 631,38</b>	<b>162 939 089,00</b>	<b>287 770 720,38</b>

В соответствии со сделанными предположениями будущие взносы не предполагались и, соответственно, возможность исполнения обязательств в случае прекращения взносов отдельно не анализировалась.

В соответствии с требованиями ФСАД НПФ вывод об адекватности обязательств может быть сделан при отсутствии существенного превышения стоимости обязательств по негосударственному пенсионному обеспечению над размером обязательств в отношении договоров негосударственного пенсионного обеспечения, отраженный в бухгалтерской (финансовой) отчетности негосударственного пенсионного фонда. В связи с отсутствием превышения согласно результатам, представленным в Таблице размера

обязательств выше, обязательства по негосударственному пенсионному обеспечению полагаются адекватными. Изменения результатов проверки адекватности обязательств Фонда по сравнению с предыдущей датой, по состоянию на которую было проведено обязательное актуарное оценивание, не произошло.

В соответствии со сделанными предположениями будущие взносы не предполагались и, соответственно, результаты оценивания обязательств в условиях прекращения пенсионных взносов совпадают с общими результатами оценивания обязательств. Уровень собственного обеспечения выплат составляет 100%.

В связи с превышением на 4186 тыс. руб. стоимости обязательств, отраженной в актуарном заключении, над стоимостью, отраженной в бухгалтерской отчетности, существует риск возможной недооценки обязательств. Величина капитала Фонда равна 246460 тыс. руб., величина превышения балансовой стоимости активов собственных средств над стоимостью активов собственных средств равна 276 тыс. руб. Таким образом, возможная недооценка обязательств существенно меньше капитала, уменьшенного на вышеуказанную величину превышения.

Распределение по периодам ожидаемых будущих потоков денежных средств, связанных с исполнением обязательств Фонда, и ожидаемых будущих поступлений от активов (по данным Фонда) приведено в следующей таблице (значения не приведены к отчетной дате):

	До года	От 1 года до 3 лет	От 3 до 5 лет	От 5 лет
Обязательства, тыс. руб.	90786	60216	33709	219427
Активы, тыс. руб.	25702	2853	2370	497887

Данная таблица показывает, что обязательства Фонда не согласованы с поступлениями от активов по времени. При этом вывод о несогласованности во времени обязательств и поступлений от активов сделать нельзя. Это следует из высокой ликвидности средств пенсионных резервов и адекватности пенсионных обязательств).

В Фонде существует страховой резерв в размере 11425 тыс. руб. Данный размер больше 5% от стоимости резервов покрытия пенсионных обязательств на начало отчетного года, что соответствует нормативу. При этом этот размер меньше 5% стоимости резерва покрытия пенсионных обязательств на конец года.

**IX. АНАЛИЗ ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТИ И ЭФФЕКТА ИЗМЕНЕНИЙ**

Анализ чувствительности размера обязательств приведен в следующей таблице:

<i>Измененные актуарные предположения</i>	<i>Изменение стоимости обязательств, %</i>	<i>Обязательства, отраженные в актуарном заключении, тыс. руб.</i>	<i>Проверка адекватности обязательств</i>
Ставка дисконтирования 8,7%	-9	264059	Проходит
Ставка доходности 8,5%	9	314452	Не проходит
Инфляция 5%	-0,1	288519	Проходит
Вероятность расторжения 0,2	-1	286202	Проходит
Таблица смертности РФ 2016	0,1	289195	Проходит

По сравнению с предыдущим годом изменений методов, допущений и предположений не произошло, за исключением ставки дисконтирования и ставки доходности. Ставка дисконтирования изменилась с 8,7% до 6,58%, ставка доходности – с 8,5% до 7%. Эффект от этих изменений приведен в таблице выше (одновременно с чувствительностью).

## Х. ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Событием после окончания отчетного периода, которое оказывает существенное влияние на отчетность, для Фонда является распределение дохода, полученного от размещения средств пенсионных резервов за 2019 год (Протокол № 06-02-2020 заседания Совета директоров от 06.02.2020 г.). По информации Фонда событий после отчетной даты, связанных с деятельностью Фонда, которые могут оказать существенное влияние на результаты актуарного оценивания, не происходило.

После отчетной даты началось развитие эпидемии коронавируса, что может оказать негативное влияние на инвестиционную деятельность Фонда. Руководство Фонда не ожидает существенного сокращения деятельности, но при этом понимает, что невозможно предугадать, каким будет конечный эффект этой пандемии.

При оценивании не использовались пункты 4.10, 6.5.2 стандарта ФСАД НПФ и пункты 3.1.4, 4.2.2, 6.1.3, 7.3.4 стандарта ФСАД Активы.

В актуарном заключении, составленном на предыдущую дату, по состоянию на которую было проведено обязательное актуарное оценивание, Фонду были даны рекомендации:

- Фонду рекомендуется увеличить размер страхового резерва до 5% от размера резервов покрытия пенсионных обязательств на отчетную дату.

Рекомендацию можно считать выполненной.



## СПИСОК ПРИЛОЖЕНИЙ

1. Таблица смертности, рекомендуемая комитетом по статистике АПА для оценки обязательств НПФ по негосударственному пенсионному обеспечению.
2. Портфель пенсионных резервов на 31.12.2019.
3. Структура портфеля СС на 31.12.2019.

Приложение 1

**Таблица смертности, рекомендуемая комитетом по статистике АПА для оценки обязательств НПФ по негосударственному пенсионному обеспечению.**

	ix		qx		ex	
	ж	м	ж	м	ж	м
0	100 000	100 000	0,000	0,000	81,9	75,6
1	99 981	99 979	0,000	0,000	80,9	74,6
2	99 966	99 960	0,000	0,000	79,9	73,6
3	99 953	99 945	0,000	0,000	78,9	72,6
4	99 943	99 932	0,000	0,000	77,9	71,7
5	99 935	99 922	0,000	0,000	76,9	70,7
6	99 928	99 912	0,000	0,000	75,9	69,7
7	99 923	99 905	0,000	0,000	74,9	68,7
8	99 919	99 898	0,000	0,000	73,9	67,7
9	99 916	99 892	0,000	0,000	72,9	66,7
10	99 913	99 886	0,000	0,000	71,9	65,7
11	99 910	99 879	0,000	0,000	71,0	64,7
12	99 906	99 873	0,000	0,000	70,0	63,7
13	99 901	99 865	0,000	0,000	69,0	62,7
14	99 895	99 856	0,000	0,000	68,0	61,7
15	99 888	99 843	0,000	0,000	67,0	60,7
16	99 878	99 827	0,000	0,000	66,0	59,7
17	99 867	99 807	0,000	0,000	65,0	58,7
18	99 856	99 782	0,000	0,000	64,0	57,8
19	99 844	99 754	0,000	0,000	63,0	56,8
20	99 831	99 721	0,000	0,000	62,0	55,8
21	99 818	99 683	0,000	0,000	61,0	54,8
22	99 803	99 641	0,000	0,000	60,0	53,8
23	99 788	99 593	0,000	0,001	59,0	52,9
24	99 771	99 540	0,000	0,001	58,0	51,9
25	99 753	99 481	0,000	0,001	57,0	50,9
26	99 734	99 415	0,000	0,001	56,1	49,9
27	99 714	99 344	0,000	0,001	55,1	49,0
28	99 692	99 266	0,000	0,001	54,1	48,0
29	99 668	99 180	0,000	0,001	53,1	47,1
30	99 642	99 087	0,000	0,001	52,1	46,1
31	99 615	98 987	0,000	0,001	51,1	45,2
32	99 586	98 878	0,000	0,001	50,1	44,2
33	99 554	98 760	0,000	0,001	49,2	43,3
34	99 520	98 634	0,000	0,001	48,2	42,3
35	99 483	98 497	0,000	0,001	47,2	41,4
36	99 443	98 351	0,000	0,002	46,2	40,4
37	99 400	98 195	0,000	0,002	45,2	39,5
38	99 353	98 027	0,001	0,002	44,2	38,6
39	99 303	97 848	0,001	0,002	43,3	37,6
40	99 249	97 656	0,001	0,002	42,3	36,7
41	99 190	97 452	0,001	0,002	41,3	35,8
42	99 127	97 234	0,001	0,002	40,3	34,9
43	99 058	97 003	0,001	0,003	39,4	33,9
44	98 984	96 756	0,001	0,003	38,4	33,0

45	98 904	96 495	0,001	0,003	37,4	32,1
46	98 817	96 196	0,001	0,004	36,5	31,2
47	98 723	95 858	0,001	0,004	35,5	30,3
48	98 621	95 477	0,001	0,004	34,5	29,4
49	98 510	95 050	0,001	0,005	33,6	28,6
50	98 391	94 573	0,001	0,006	32,6	27,7
51	98 247	94 041	0,002	0,006	31,7	26,9
52	98 077	93 452	0,002	0,007	30,7	26,0
53	97 875	92 801	0,002	0,008	29,8	25,2
54	97 639	92 083	0,003	0,009	28,8	24,4
55	97 364	91 295	0,003	0,009	27,9	23,6
56	97 045	90 433	0,004	0,010	27,0	22,8
57	96 677	89 491	0,004	0,011	26,1	22,1
58	96 255	88 466	0,005	0,013	25,2	21,3
59	95 773	87 352	0,006	0,014	24,4	20,6
60	95 223	86 147	0,007	0,015	23,5	19,9
61	94 599	84 845	0,007	0,017	22,6	19,2
62	93 892	83 444	0,008	0,018	21,8	18,5
63	93 094	81 938	0,010	0,020	21,0	17,8
64	92 197	80 325	0,011	0,021	20,2	17,1
65	91 191	78 603	0,012	0,023	19,4	16,5
66	90 065	76 769	0,014	0,025	18,6	15,9
67	88 810	74 821	0,016	0,028	17,9	15,3
68	87 415	72 759	0,018	0,030	17,2	14,7
69	85 870	70 583	0,020	0,032	16,5	14,1
70	84 162	68 294	0,022	0,035	15,8	13,6
71	82 346	65 894	0,023	0,038	15,1	13,1
72	80 415	63 388	0,025	0,041	14,5	12,6
73	78 368	60 779	0,028	0,044	13,9	12,1
74	76 202	58 075	0,030	0,048	13,2	11,6
75	73 915	55 284	0,033	0,051	12,6	11,2
76	71 506	52 480	0,035	0,054	12,0	10,8
77	68 975	49 670	0,038	0,056	11,5	10,4
78	66 324	46 864	0,042	0,060	10,9	9,9
79	63 555	44 070	0,045	0,063	10,4	9,5
80	60 674	41 298	0,049	0,066	9,8	9,2
81	57 687	38 558	0,053	0,070	9,3	8,8
82	54 602	35 858	0,058	0,074	8,8	8,4
83	51 431	33 210	0,063	0,078	8,3	8,0
84	48 187	30 624	0,068	0,082	7,8	7,7
85	44 887	28 108	0,074	0,087	7,4	7,3
86	41 547	25 672	0,081	0,091	6,9	6,9
87	38 190	23 327	0,088	0,096	6,5	6,6
88	34 839	21 079	0,095	0,102	6,1	6,2
89	31 518	18 937	0,103	0,107	5,7	5,9
90	28 256	16 908	0,112	0,113	5,3	5,5
91	25 079	14 998	0,122	0,119	4,9	5,2
92	22 016	13 212	0,133	0,126	4,5	4,8
93	19 096	11 553	0,144	0,132	4,1	4,4
94	16 345	10 023	0,157	0,140	3,7	4,0
95	13 787	8 624	0,170	0,147	3,3	3,6
96	11 444	7 355	0,185	0,155	2,9	3,1

---

97	9 331	6 215	0,201	0,163	2,4	2,6
98	7 460	5 199	0,218	0,172	1,9	2,0
99	5 836	4 303	0,237	0,182	1,3	1,3
100	4 455	3 521			0,5	0,5

АФ01. Структура активов  
По состоянию на отчетную дату  
Категория активов

Пенсияные резервы

Пенсияные резервы  
Пенсияные резервы  
Собственный капитал

№ п/п	Наименование	Идентификатор	ISIN	Тип ценной бумаги	Номинал	Дата погашения	Кол-во на отчетную дату	Балансовая стоимость на отчетную дату	Справедливая стоимость на отчетную дату	Котировка на отчетную дату	Наличие обременений в отношении активов	Отметка об отнесении актива к категории разрешенных активов (1-да, 0-нет)	Примечание	
010	Акция ОАО, ПАО [1-01-00077-A] Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ"	030	040	050	060	070	080	090	100	110	120	130	140	150
1	Типовыковенная; Кол-во разм.:250000000шт.	RU0009024277	1-01-00077-A	Акция ОАО, ПАО			139	855 128,00	855 128,00	6 132,000000	0,00	нет	1	
2	Акция ОАО, ПАО [1-01-55038-E] Публичное акционерное общество "Федеральная гидрогенерирующая компания - РусГидро"	RU000A0JPKH7	1-01-55038-E	Акция ОАО, ПАО			578000	321 136,80	321 136,80	0 55560	0,00	нет	1	
3	Типовыковенная; Кол-во разм.:426288813551шт.						42	143 871,00	143 871,00	3 425,500000	0,00	нет	1	
4	Акция ОАО, ПАО [1-01-60525-P] Публичное акционерное общество "Магнит"	RU000A0JKQJ8	1-01-60525-P	Акция ОАО, ПАО			13 300	3 410 386,00	3 410 386,00	256,420000	0,00	нет	1	
5	Типовыковенная; Кол-во разм.:10598177817шт.	RU000A0JZQ06	1-02-00122-A	Акция ОАО, ПАО			330	148 401,00	148 401,00	449,700000	0,00	нет	1	
6	Акция ОАО, ПАО [1-02-00143-A] Публичное акционерное общество "Северсталь"	RU000904E510	1-02-00143-A	Акция ОАО, ПАО			210	197 064,00	197 064,00	938,400000	0,00	нет	1	
7	Типовыковенная; Кол-во разм.:837718660шт.						2 370	254 964,60	254 964,60	107,580000	0,00	нет	1	
8	Акция ОАО, ПАО [1-05-08443-H] Публичное акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС"	RU000A0JRA41	1-05-08443-H	Акция ОАО, ПАО			46 790	11 920 220,40	11 920 220,40	254,760000	0,00	нет	1	
9	Акция ОАО, ПАО [10301481B] Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	RU0009029540	10301481B	Акция ОАО, ПАО			12 650 000	581 014,50	581 014,50	0 04593	0,00	нет	1	
10	Типовыковенная; Кол-во разм.:1296054133738шт.	RU000A0JPSV6	10401000B	Акция ОАО, ПАО			2 200	502 480,00	502 480,00	228,400000	0,00	нет	1	
11	Акция ОАО, ПАО [20301481B] Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	RU0009029557	20301481B	Акция ОАО, ПАО			250	254 250,00	254 250,00	1 006,200000	2 700,00	нет	1	
12	Государственные ЦБ [24020RMFS] Министерство финансов Российской Федерации	RU000A100Q52	24020RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		4 515	4 645 799,55	4 645 799,55	1 026,480000	11 242,35	нет	1	
13	Объем выпуска:350000000 шт.	RU000A0JZCK6	25083RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		6 845	7 153 914,85	7 153 914,85	1 029,300000	108 356,35	нет	1	
14	Государственные ЦБ [26205RMFS] Министерство финансов Российской Федерации	RU000A0JREQ7	26205RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		370	425 107,80	425 107,80	1 117,900000	11 484,80	нет	1	
15	Объем выпуска:150000000 шт.	RU000A0J3W6	26207RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		6 029	6 510 174,49	6 510 174,49	1 046,490000	200 886,28	нет	1	
16	Государственные ЦБ [26207RMFS] Министерство финансов Российской Федерации	RU000A0JSM2	26207RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		150	158 479,50	158 479,50	1 029,400000	4 069,50	нет	1	

17	Государственные ЦБ [262.26RMFS] Министерство финансов Российской Федерации Объем выпуска:35000000 шт.	RU000A0Z2YW2	26226RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		2 190	2 446 339,50	2 446 339,50	1 000,500000	36 244,50 шт	1
18	Государственные ЦБ [262.27RMFS] Министерство финансов Российской Федерации Объем выпуска:40000000 шт.	RU000A1007F4	26227RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		8 060	8 774 438,40	8 774 438,40	1 056,200000	261 466,40 шт	1
19	Государственные ЦБ [262.29RMFS] Министерство финансов Российской Федерации Объем выпуска:45000000 шт.	RU000A100EG3	26229RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		500	530 220,00	530 220,00	1 052,410000	4 015,00 шт	1
20	Государственные ЦБ [290.11RMFS] Министерство финансов Российской Федерации Объем выпуска:25000000 шт.	RU000A0V7I9	29011RMFS	Государственные ЦБ	1 000,00		22 828	23 707 334,56	23 707 334,56	1 002,810000	815 187,88 шт	1
21	Облигации российских хозяйственных обществ [4-01-00332-R] Общество с ограниченной ответственностью "КТЖ Финанс" Объем выпуска:15000000 шт.	RU000A0JXS34	4-01-00332-R	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 396	1 455 790,68	1 455 790,68	1 037,800000	7 021,88 шт	1
22	Облигации российских хозяйственных обществ [4-07-02472-A] Публичное акционерное общество "Мостотрест" Объем выпуска:5000000 шт.	RU000A0JWN63	4-07-02472-A	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		3 000	3 248 340,00	3 248 340,00	1 040,200000	127 740,00 шт	1
23	Облигации российских хозяйственных обществ [4-08-02472-A] Публичное акционерное общество "Мостотрест" Объем выпуска:5000000 шт.	RU000A0JWN89	4-08-02472-A	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		350	383 320,00	383 320,00	1 050,600000	15 610,00 шт	1
24	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-01-36400-R] Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал" Объем выпуска:5000000 шт.	RU000A0ZVU5	4802-01-36400-R	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		442	461 748,56	461 748,56	1 020,000000	10 908,56 шт	1
25	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-01-40155-F-001P] Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель" Объем выпуска:25000000 шт.	RU000A100V06	4802-01-40155-F-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		6 757	7 039 780,45	7 039 780,45	1 023,900000	121 288,15 шт	1
26	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-01-65018-D-001P] Публичное акционерное общество "Федеральная сетевая компания Единой энергетической системы" Объем выпуска:10000000 шт.	RU000A0ZZQN7	4802-01-65018-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		7 000	7 645 470,00	7 645 470,00	1 076,000000	113 470,00 шт	1
27	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-02-00221-A-001P] Публичное акционерное общество "Нефтегазовая компания "Славнефть" Объем выпуска:10000000 шт.	RU000A1007H0	4802-02-00221-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		6 840	6 951 362,04	6 951 362,04	1 015,101000	8 071,20 шт	1
28	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-03-00146-A-001P] Публичное акционерное общество "Газпром нефть" Объем выпуска:25000000 шт.	RU000A0ZYD57	4802-03-00146-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		6 331	6 680 281,27	6 680 281,27	1 039,900000	96 674,37 шт	1
29	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-03-32432-H-001P] Публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания" Объем выпуска:10000000 шт.	RU000A0JXE06	4802-03-32432-H-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		3 241	3 717 977,97	3 717 977,97	1 130,900000	52 731,07 шт	1
30	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-03-55465-E-001P] Акционерное общество "Федеральная пассажирская компания" Объем выпуска:10000000 шт.	RU000A0ZYX69	4802-03-55465-E-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 880	1 961 366,40	1 961 366,40	1 020,000000	43 766,40 шт	1
31	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-04-00122-A-001P] Публичное акционерное общество "Норильская компания "Роснефть" Объем выпуска:40000000 шт.	RU000A0JXK02	4802-04-00122-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		7 390	7 967 602,40	7 967 602,40	1 063,700000	106 859,40 шт	1
32	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-04-00122-A-002P] Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть" Объем выпуска:50000000 шт.	RU000A0ZT740	4802-04-00122-A-002P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		6 900	7 286 124,00	7 286 124,00	1 027,600000	195 684,00 шт	1
33	Облигации российских хозяйственных обществ [4802-04-00124-A-001P] Публичное акционерное общество "Ростелеком" Объем выпуска:10000000 шт.	RU000A0ZYUE3	4802-04-00124-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 600	1 658 160,00	1 658 160,00	1 015,000000	34 160,00 шт	1

34	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-04-00739-A-001P) Акционерное общество "ДОМ.РФ" Объем выпуска: 25000000 шт.	RU000A0Z77C0	4802-04-00739-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		3 058	3 133 563,18	3 133 563,18	1 021,900000	8 592,98 шт	1
35	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-04-65045-D-001P) Открытое акционерное общество "Российские железные дороги" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A0JXZB2	4802-04-65045-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 650	1 785 322,70	1 785 322,70	1 064,100000	50 839,70 шт	1
36	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-00122-A-002P) Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть" Объем выпуска: 20000000 шт.	RU000A0Z7YU5	4802-05-00122-A-002P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 000	1 044 600,00	1 044 600,00	1 020,000000	24 600,00 шт	1
37	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-00206-A-001P) Публичное акционерное общество "Транснефть" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A0JXC24	4802-05-00206-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		9 016	10 231 086,32	10 231 086,32	1 096,500000	345 042,32 шт	1
38	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-00296-A-001P) Публичное акционерное общество "Уралкалий" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A0Z7T80	4802-05-00296-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 600	1 693 568,00	1 693 568,00	1 046,000000	19 968,00 шт	1
39	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-00739-A-001P) Акционерное общество "ДОМ.РФ" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A1004W6	4802-05-00739-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		6 370	6 699 583,80	6 699 583,80	1 023,600000	179 251,80 шт	1
40	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-00822-J-001P) Публичное акционерное общество "МегаФон" Объем выпуска: 20000000 шт.	RU000A1002P4	4802-05-00822-J-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 600	1 718 032,00	1 718 032,00	1 039,100000	55 472,00 шт	1
41	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-32432-H) Акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания" Объем выпуска: 4000000 шт.	RU000A0JWVD9	4802-05-32432-H	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		81	93 286,89	93 286,89	1 131,500000	1 635,99 шт	1
42	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-36241-R-001P) Общество с ограниченной ответственностью "ИКС 5 ФИНАНС" Объем выпуска: 5000000 шт.	RU000A100AB2	4802-05-36241-R-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		64	67 283,84	67 283,84	1 035,100000	1 037,44 шт	1
43	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-05-65045-D-001P) Открытое акционерное общество "Российские железные дороги" Объем выпуска: 20000000 шт.	RU000A0Z7YU5	4802-05-65045-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		13 011	13 677 163,20	13 677 163,20	1 024,600000	346 092,60 шт	1
44	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-06-00143-A) Публичное акционерное общество "Сверсталь" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A1008W7	4802-06-00143-A	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		518	566 127,38	566 127,38	1 073,000000	10 313,38 шт	1
45	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-06-00822-J-001P) Публичное акционерное общество "МегаФон" Объем выпуска: 5000000 шт.	RU000A1006G4	4802-06-00822-J-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		3 300	3 648 315,00	3 648 315,00	1 079,700000	85 305,00 шт	1
46	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-06-32432-H) Публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания" Объем выпуска: 4000000 шт.	RU000A0JWJ16	4802-06-32432-H	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 000	1 043 520,00	1 043 520,00	1 026,900000	16 620,00 шт	1
47	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-06-65045-D-001P) Открытое акционерное общество "Российские железные дороги" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A0Z74P9	4802-06-65045-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		1 000	1 031 700,00	1 031 700,00	1 017,600000	14 100,00 шт	1
48	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-07-32432-H) Публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания" Объем выпуска: 4000000 шт.	RU000A0JW1P8	4802-07-32432-H	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		197	203 217,32	203 217,32	1 030,000000	307,32 шт	1
49	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-07-65045-D-001P) Открытое акционерное общество "Российские железные дороги" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A0Z59R4	4802-07-65045-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00		150	154 650,00	154 650,00	1 027,200000	570,00 шт	1



50	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-08-00206-A-001P) Публичное акционерное общество "Транснефть" Объем выпуска: 25000000 шт.	RU000A0ZVD99	4802-08-00206-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	405	439 882,65	439 882,65	1 069,90000	6 573,15	нет	1
51	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-08-32432-H-001P) Публичное акционерное общество "Государственная транспортная ливинговая компания" Объем выпуска: 100000000 шт.	RU000A0ZV991	4802-08-32432-H-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	4 200	4 229 820,00	4 229 820,00	994,60000	52 500,00	нет	1
52	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-09-00206-A-001P) Публичное акционерное общество "Транснефть" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A0ZVUS1	4802-09-00206-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	4 100	4 291 388,00	4 291 388,00	1 021,80000	102 008,00	нет	1
53	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-09-04715-A-001P) Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы" Объем выпуска: 7500000 шт.	RU000A100A66	4802-09-04715-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	1 450	1 581 558,50	1 581 558,50	1 074,00000	24 258,50	нет	1
54	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-10-04715-A-001P) Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A100HU7	4802-10-04715-A-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	11 460	12 302 653,80	12 302 653,80	1 053,80000	226 105,80	нет	1
55	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-12-32432-H-001P) Публичное акционерное общество "Государственная транспортная ливинговая компания" Объем выпуска: 5000000 шт.	RU000A0ZV11	4802-12-32432-H-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	5 248	5 581 667,84	5 581 667,84	1 053,00000	55 523,84	нет	1
56	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-12-65045-D-001P) Открытое акционерное общество "Российские железные дороги" Объем выпуска: 15000000 шт.	RU000A1002C2	4802-12-65045-D-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	1 410	1 558 035,90	1 558 035,90	1 069,00000	50 745,90	нет	1
57	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-14-32432-H-001P) Публичное акционерное общество "Государственная транспортная ливинговая компания" Объем выпуска: 100000000 шт.	RU000A100FE5	4802-14-32432-H-001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	810	853 424,10	853 424,10	1 049,00000	3 734,10	нет	1
58	Облигации российских хозяйственных обществ (4802-103287B001P) Акционерное общество "Всероссийский банк развития регионов" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A0ZVCSB	4802-103287B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	4 000	4 078 240,00	4 078 240,00	1 000,00000	78 240,00	нет	1
59	Облигации российских хозяйственных обществ (48020103349B001P) Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A0JXMG8	48020103349B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	5 828	6 106 170,44	6 106 170,44	1 023,00000	144 126,44	нет	1
60	Облигации российских хозяйственных обществ (48020201326B002P) АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛФА-БАНК" Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A0ZVR80	48020201326B002P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	1 220	1 287 051,20	1 287 051,20	1 040,00000	18 251,20	нет	1
61	Облигации российских хозяйственных обществ (48020203287B001P) Акционерное общество "Всероссийский банк развития регионов" Объем выпуска: 5000000 шт.	RU000A0ZYQX9	48020203287B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	73	76 450,71	76 450,71	1 015,00000	2 355,71	нет	1
62	Облигации российских хозяйственных обществ (48020303470B001P) АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ГОЙОТА БАНК" Объем выпуска: 5000000 шт.	RU000A100YW8	48020303470B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	300	309 366,00	309 366,00	1 018,00000	3 966,00	нет	1
63	Облигации российских хозяйственных обществ (48020500354B001P) "Газпромбанк" (Акционерное общество) Объем выпуска: 10000000 шт.	RU000A1002E8	48020500354B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	6 500	7 204 275,00	7 204 275,00	1 070,00000	249 275,00	нет	1
64	Облигации российских хозяйственных обществ (48020503349B001P) Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк" Объем выпуска: 25000000 шт.	RU000A0ZVXU4	48020503349B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	4 000	4 190 400,00	4 190 400,00	1 025,10000	90 000,00	нет	1
65	Облигации российских хозяйственных обществ (48020603349B001P) Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк" Объем выпуска: 13000000 шт.	RU000A0ZV9Z3	48020603349B001P	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	6 470	7 048 094,50	7 048 094,50	1 071,10000	118 077,50	нет	1

66	Облигации российских хозяйственных обществ (48021303349В) Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк" Объем выпуска:5000000 шт.	RU000A0JUM31	48021303349В	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	1 054	1 093 250,96	1 093 250,96	1 019,40000	18 803,36	нет	1
67	Облигации российских хозяйственных обществ (48021600354В) "Газпромбанк" (Акционерное общество) Объем выпуска:1 000 000 000 шт.	RU000A0JXP45	48021600354В	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	30	31 303,50	31 303,50	1 024,90000	556,50	нет	1
68	Облигации российских хозяйственных обществ (48021603349В001Р) Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк" Объем выпуска:5 000 000 шт.	RU000A1011R1	48021603349В001Р	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	300	303 846,00	303 846,00	1 004,00000	2 646,00	нет	1
69	Облигации российских хозяйственных обществ (48027301481В001Р) Публичное акционерное общество "Сбербанк России" Объем выпуска:40000000 шт.	RU000A100758	48027301481В001Р	Облигации российских хозяйственных обществ	1 000,00	1 750	1 826 720,00	1 826 720,00	1 022,50000	37 345,00	нет	1
70	Паи ПИФ-ов ОПИФ рыночных финансовых инструментов "Атлант" под управлением РЕГИОН Эссет Менеджмент (АО)[3015]	3015 3015	3015 3015	Паи ПИФ-ов		30 724	39 238 901,30	39 238 901,30	1 277,14000	0,00	нет	1
71	Паи ПИФ-ов ОПИФ рыночных финансовых инструментов "Глобус" под управлением РЕГИОН Траст (ООО)[3014]	3014 3014	3014 3014	Паи ПИФ-ов		2 610	3 392 008,20	3 392 008,20	1 299,62000	0,00	нет	1
72	Паи ПИФ-ов ОПИФ рыночных финансовых инструментов "РЕГИОН Фонда Облигаций" под управлением РЕГИОН Инвестиции УК (АО)[0254-74113798]	0254-74113798	0254-74113798	Паи ПИФ-ов		117	649 397,39	649 397,39	5 560,52996	0,00	нет	1
73	Паи ПИФ-ов ОПИФ рыночных финансовых инструментов "Сфера" под управлением РЕГИОН Траст (ООО)[3012]	3012 3012	3012 3012	Паи ПИФ-ов		3 508	4 461 314,22	4 461 314,22	1 271,76000	0,00	нет	1
74	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810100000001464; Дог.:810-385-4785 от 03.06.2019 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	110 119,27	110 119,27		0,00	нет	1
75	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810300000000896; Дог.:810-896-4785 от 08.05.2018 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	10 607,46	10 607,46		0,00	нет	1
76	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810400000000388; Дог.:810-385-4785 от 14.07.2017 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	103 315,14	103 315,14		0,00	нет	1
77	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810500000000832; Дог.:810-832-21054 от 13.03.2018 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	15 209,58	15 209,58		0,00	нет	1
78	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810500000001048; Дог.:4785/2018-ДВ-1 от 13.08.2018 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	18 050,51	18 050,51		0,00	нет	1
79	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810600000000334; Дог.:810-334-21054 от 05.07.2017 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	38 812,18	38 812,18		0,00	нет	1
80	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810600000000499; Дог.:810-499-4785 от 04.09.2017 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	9 699,75	9 699,75		0,00	нет	1
81	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810700000000108; Дог.:810-108-4785 от 16.12.2016 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	28 018,80	28 018,80		0,00	нет	1
82	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810700000000386; Дог.:810-386-4785 от 14.07.2017 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	87 202,75	87 202,75		0,00	нет	1
83	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810800000001049; Дог.:4785/2018-ДВ-2 от 13.08.2018 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	68 635,50	68 635,50		0,00	нет	1
84	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 407018108000000001641; Дог.:4785/2019-ДВ-4 от 28.08.2019 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	145 596,68	145 596,68		0,00	нет	1
85	Банк: "газпромбанк" (Акционерное общество); Счет: 40701810900000000500; Дог.:810-500-4785 от 04.09.2017 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	2 326,91	2 326,91		0,00	нет	1
86	Банк: Акционерное общество "Всероссийский банк развития регионов"; Счет: 407018100000000000125; Дог.:280109-0Д/04 от 28.01.2004 (RUR)	4,07018Е+19	4,07018Е+19	Средства в рублях		0	77 466,08	77 466,08		0,00	нет	1
87	Расчеты некредитных финансовых организаций - доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, АО "Сбербанк КИБ", 33-8964/99-Брокерский счет			Средства у брокера		0	1 239,58	1 239,58		0,00	нет	1
88	Расчеты некредитных финансовых организаций - доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2274 (2274-Ю)/30111665 от 30.11.2016г.-) Брокерский счет			Средства у брокера		0	206,47	206,47		0,00	нет	1
89	Расчеты некредитных финансовых организаций - доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2275 (2275-Ю)/30111665 от 30.11.2016г.-) Брокерский счет			Средства у брокера		0	450,02	450,02		0,00	нет	1

90	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2280 (2280-Ю)/2012.166 от 20.12.2016)-брокерский счет	Средства у брокера	0	26 785,77	26 785,77	0,00	нет	1
91	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2346 (Дог.№2346-Ю)/0607176 от 06.07.17.-брокерский счет	Средства у брокера	0	34 782,71	34 782,71	0,00	нет	1
92	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2348 (2348-Ю)/1807176 от 18.07.17)-брокерский счет	Средства у брокера	0	10 345,27	10 345,27	0,00	нет	1
93	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2349 (2349-Ю)/1807176 от 18.07.17)-брокерский счет	Средства у брокера	0	2 530,61	2 530,61	0,00	нет	1
94	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2364 (№2364-Ю)/0609176 от 06.09.2017)-брокерский счет	Средства у брокера	0	34 352,70	34 352,70	0,00	нет	1
95	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2365 (№2365-Ю)/0609176 от 06.09.2017)-брокерский счет	Средства у брокера	0	21 205,18	21 205,18	0,00	нет	1
96	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2402 (2402-Ю)/1603186 от 16.03.18)-брокерский счет	Средства у брокера	0	2 371,05	2 371,05	0,00	нет	1
97	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2403 (2403-Ю)/1603186 от 16.03.2018)-брокерский счет	Средства у брокера	0	14 927,32	14 927,32	0,00	нет	1
98	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2439 (2439-Ю)/1005186 от 10.05.18)-брокерский счет	Средства у брокера	0	8 142,29	8 142,29	0,00	нет	1
99	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2480 (2480-Ю)/1708186 от 17.08.2018)-брокерский счет	Средства у брокера	0	3 079,96	3 079,96	0,00	нет	1
100	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2481 (2481-Ю)/1708186 от 17.08.2018)-брокерский счет	Средства у брокера	0	1 078,35	1 078,35	0,00	нет	1
101	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2625 (2625-Ю)/250619/Б от 25.06.19)-брокерский счет	Средства у брокера	0	5 283,22	5 283,22	0,00	нет	1
102	Расчеты некредитных финансовых организаций – доверителей (комитентов) по брокерским операциям с ценными бумагами и другими финансовыми активами, ООО "БК "РЕГИОН", 2653 (2653-Ю)/2908196 от 29.08.19)-брокерский счет	Средства у брокера	0	8 374,93	8 374,93	0,00	нет	1
103	Расчеты по вкладам, Налог на прибыль, ИФНС РОССИИ №10 ПО Г. МОСКВЕ	Прочая дебиторская задолженность	0	238 982,95	238 982,95	0,00	нет	1
104	Расчеты по начисленным доходам по акциям, долям, паям, ЛУКОЙЛ (ПАО) ао [1-01-00077-А]	Прочая дебиторская задолженность	0	26 688,00	26 688,00	0,00	нет	1
105	Требования по прочим финансовым операциям, ПТБ Банк (АО), Без указания ЦБ [1]. Договор сделки МНО №1 от 30.12.2019[30.12.2019-09.01.2020].	Прочая дебиторская задолженность	0	15,07	15,07	0,00	нет	1
106	Требования по прочим финансовым операциям, ПТБ Банк (АО), Без указания ЦБ [1]. Договор сделки МНО №4 от 30.12.2019[30.12.2019-09.01.2020].	Прочая дебиторская задолженность	0	19,59	19,59	0,00	нет	1
107	Требования по прочим финансовым операциям, ПТБ Банк (АО), Без указания ЦБ [1]. Договор сделки МНО №74 от 30.12.2019[30.12.2019-09.01.2020].	Прочая дебиторская задолженность	0	15,07	15,07	0,00	нет	1

108	Расчеты по налогам, НДФЛ, ИФНС РОССИИ № 10 ПО Г. МОСКВЕ								0	146,00	0,00		0,00 руб	1	
109	Внутрихозяйственные расчеты, РЕГИОН Траст ООО, Расчеты с УК по вознаграждениям								0	-69 972,60	-69 972,60		0,00 руб	1	
110	Внутрихозяйственные расчеты, РЕГИОН ЭсМ АО, Расчеты с УК по вознаграждениям								0	-405 346,53	-405 346,53		0,00 руб	1	
111	Расчеты с поставщиками и подрядчиками, ВТБ Специализированный Депозитарий ЗАО								0	-44 773,52	-44 773,52		0,00 руб	1	
										288 960 278,63	288 960 132,63				

АОФ201. Структура структуры активов  
По состоянию на отчетную дату  
Категория активов

Собственные средства

№ п/п	Наименование	Идентификатор	ISIN	Тип ценной бумаги	Номинал	Дата погашения	Курс на отчетную дату	Базисная стоимость на отчетную дату	Страховая стоимость на отчетную дату	Котировка на отчетную дату	НКД	Наличие обременения в отношении актива	Отметка об отношении актива к категории разрешенных активов (1-да, 0-нет)	Примечание
010	020	030	040	050	060	070	080	090	100	110	120	130	140	150
	Минфин России	1623.74MEX	RU00AA1007E4	Государственная (ГКО) облигация	1000.17.07.2024	10.04.17.07.2024	8 329.00	9 078.168.96	9 078.168.96	1 046.230	270.517.16	нет	1	
	АО "ДЛР-БАД-БАНК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.01.11.2021	18.28.20	19.40.803.88	19.40.803.88	19.40.803.88	1.040.00	275.683.88	нет	1	
	АО "ДЛР-БАНК"	41.Г.40739.А	RU00AA100487	Корпоративная облигация	500.14.03.2021	14.03.20	1.627.805.00	1.627.805.00	1.627.805.00	6.51.71	1.468.00	нет	1	
	АО "ДОМ.РФ"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.21.03.2021	14.03.20	1.500.00	1.527.065.00	1.527.065.00	1.011.20	210.00	нет	1	
	АО "ДОМ.РФ"	4B0240163Z4B001P	RU00AA100487	Корпоративная облигация	1000.06.11.2021	10.70.20	4.288.000	4.288.000	4.288.000	1.023.50	140.740.00	нет	1	
	АО "Росельхозбанк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.06.11.2022	10.70.20	10.488.966.00	10.488.966.00	10.488.966.00	1.011.20	14.258.50	нет	1	
	АО "Росельхозбанк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA10068FZ	Корпоративная облигация	1000.06.04.2020	4.00.20	5.813.911.50	5.813.911.50	5.813.911.50	1.071.10	10.985.50	нет	1	
	АО "Росельхозбанк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.06.10.2021	7.00.20	1.748.742.00	1.748.742.00	1.748.742.00	1.024.60	10.985.50	нет	1	
	АО "Тинькофф Банк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.05.10.2022	14.00.20	11.538.450.00	11.538.450.00	11.538.450.00	1.020.00	28.450.00	нет	1	
	Банк "ВЭБ.РФ" (АО)	4B0240163Z4B001P	RU00AA100487	Корпоративная облигация	1000.30.10.2022	10.00.20	19.822.200.00	19.822.200.00	19.822.200.00	1.018.00	32.880.00	нет	1	
	Банк "ВЭБ.РФ" (АО)	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.12.10.2022	3.00.20	3.938.650.00	3.938.650.00	3.938.650.00	1.071.10	131.200.00	нет	1	
	Банк "ВЭБ.РФ" (АО)	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.17.03.2021	3.00.20	8.378.160.00	8.378.160.00	8.378.160.00	1.000.00	38.680.00	нет	1	
	Банк ГИП (АО)	4B0240163Z4B001P	RU00AA1002E8	Корпоративная облигация	1000.31.01.2023	20.00.20	22.167.000.00	22.167.000.00	22.167.000.00	1.033.10	21.800.00	нет	1	
	ВЭБ.РФ	4-05-00004-T	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.19.09.2020	10.96.20	11.413.356.90	11.413.356.90	11.413.356.90	1.070.00	25.917.90	нет	1	
	ВЭБ.РФ	4-05-00004-T	RU00AA0Z7280	Корпоративная облигация	1000.13.10.2020	7.75.20	801.102.00	801.102.00	801.102.00	1.016.00	13.702.00	нет	1	
	ВЭБ.РФ	4B0240163Z4B001P	RU00AA100487	Корпоративная облигация	1000.25.02.2021	14.00.20	2.260.058.50	2.260.058.50	2.260.058.50	1.032.70	39.753.50	нет	1	
	ВЭБ.РФ	4B0240163Z4B001P	RU00AA100487	Корпоративная облигация	1000.22.06.2023	24.70.20	2.574.777.40	2.574.777.40	2.574.777.40	1.031.80	296.600.00	нет	1	
	ОАО "ФРЖД"	4B0240163Z4B001P	RU00AA1013F1	Корпоративная облигация	1000.17.11.2026	5.985.20	6.050.655.45	6.050.655.45	6.050.655.45	1.041.30	2.766.40	нет	1	
	ОАО "ТМК "Норильский никель"	4B0240163Z4B001P	RU00AA1002C2	Корпоративная облигация	1000.26.01.2024	2.00.00	2.209.980.00	2.209.980.00	2.209.980.00	1.069.00	71.980.00	нет	1	
	ПАО "ТТК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA100YQ6	Корпоративная облигация	1000.24.09.2024	2.00.00	208.370.00	208.370.00	208.370.00	1.046.40	673.000.00	нет	1	
	ПАО "ТТК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0X806	Корпоративная облигация	1000.25.10.2023	5.00.00	575.845.00	575.845.00	575.845.00	1.130.90	19.324.00	нет	1	
	ПАО "ТТК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0YND9	Корпоративная облигация	1000.18.01.2023	3.00.00	303.519.00	303.519.00	303.519.00	995.00	5.019.00	нет	1	
	ПАО "ТТК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7891	Корпоративная облигация	1000.05.08.2022	12.65.00	12.739.815.00	12.739.815.00	12.739.815.00	994.60	138.125.00	нет	1	
	ПАО "ТТК"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0Z7V11	Корпоративная облигация	1000.24.11.2021	5.25.00	5.583.795.00	5.583.795.00	5.583.795.00	1.053.00	55.545.00	нет	1	
	ПАО "МАТИТ"	4B0240163Z4B001P	RU00AA1005A4	Корпоративная облигация	1000.09.02.2022	1.50.00	1.597.185.00	1.597.185.00	1.597.185.00	1.051.00	20.685.00	нет	1	
	ПАО "Ростелеком"	4B0240163Z4B001P	RU00AA1002S3	Корпоративная облигация	1000.03.05.2022	1.07.00	1.085.611.30	1.085.611.30	1.085.611.30	1.044.00	11.331.30	нет	1	
	ПАО "Трансфер"	4B0240163Z4B001P	RU00AA1007H0	Корпоративная облигация	1000.28.04.2022	5.45.00	5.538.731.45	5.538.731.45	5.538.731.45	1.015.10	643.00	нет	1	
	ПАО "Сурьжанин"	4B0240163Z4B001P	RU00AA0X8P88	Корпоративная облигация	1000.27.11.2020	4.42.00	210.470.00	210.470.00	210.470.00	1.036.00	32.700.00	нет	1	
	ПАО "Сбербанк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA100E39	Корпоративная облигация	1000.09.11.2021	13.56.00	16.258.252.80	16.258.252.80	16.258.252.80	1.021.20	40.630.60	нет	1	
	ПАО "Сбербанк"	4B0240163Z4B001P	RU00AA100B16	Корпоративная облигация	1000.27.04.2021	5.100.00	5.331.387.00	5.331.387.00	5.331.387.00	1.030.00	78.387.00	нет	1	
	Банк ГИП (АО)	4B0216061481B001P	RU00AA100K30	Наименование процентов МНО	1000.11.07.2022	3.267.00	3.488.339.25	3.488.339.25	3.488.339.25	1.032.10	116.468.55	нет	1	
	Денежные средства на расчетных счетах: Банк ГИП (АО), 40701810500000254785 (РUB) в Банке ГИП (АО)			Средства в рублях			333.264.52	333.264.52	333.264.52			нет	1	
	Денежные средства на брокерских счетах: ООО "БК РЕГИОН", БК РЕГИОН, № 2778- Ю/1312165 от 13.12.2016			Средства у брокера			75.597.45	75.597.45	75.597.45			нет	1	
	Кредиторская задолженность: Вознаграждение управляющего			Кредиторская задолженность			394.227.64	394.227.64	394.227.64			нет	1	
	Кредиторская задолженность: ООО "БК РЕГИОН", Расходы по услугам депозитария			Кредиторская задолженность			0.00	0.00	0.00			нет	1	
	Кредиторская задолженность: ООО "БК РЕГИОН", БК "РЕГИОН", № 2278- Ю/1312162 от 13.12.16			Кредиторская задолженность			150.00	150.00	150.00			нет	1	
	407018100000003933, ПАО МКБ 4070181010000000125, БАНК "ТВЕР"			Средства в рублях			6.250.90	6.250.90	6.250.90			нет	1	
	4070181030000001802, БАНК ГИП (АО)			Средства в рублях			673.462.08	673.462.08	673.462.08			нет	1	
	Наименование имущества			Средства в рублях			4.900.00	4.900.00	4.900.00			нет	1	
	ИДФ-П			Кредиторская задолженность			86.00	86.00	86.00			нет	1	
	Резерв на отпуски			Кредиторская задолженность			39.844.36	39.844.36	39.844.36			нет	1	
	Расчеты с персоналом			Кредиторская задолженность			1.036.213.18	1.036.213.18	1.036.213.18			нет	1	
	ЗАО "РЕГИОН" / №2/80/18 от 23.03.2018			Кредиторская задолженность			0.10	0.10	0.10			нет	1	
				Кредиторская задолженность			269.50	269.50	269.50			нет	1	

ЗАО "РЕЛИАИП" / №2080/18-СВТ от 23.03.2018	Прочая кредиторская задолженность.		67,32	67,32					67,32						1				1
АО "Государственная страховая компания "Югория" /	Прочая дебиторская задолженность.		13 660,07	13 660,07											1				1
АО "Региональный Сетевой Информационный Центр" / 5	Прочая дебиторская задолженность.		390,00	390,00											1				1
Интерфакс ЗАО / С2018-02-58001 от 03.05.2018	Прочая дебиторская задолженность.		6 481,01	6 481,01											1				1
Организация-Медиакомпания ООО / 161205/0003-К от 05.12.20	Прочая дебиторская задолженность.		168 081,00	168 081,00											1				1
ПАО "Мобильные ТелеСистемы" / 17752860169 от 01.11	Прочая дебиторская задолженность.		382,99	382,99											1				1
Налог на прибыль.	Прочая кредиторская задолженность.		221 697,49	221 697,49											1				1
Налог на прибыль.	Прочая дебиторская задолженность.		87 613,07	87 613,07											1				1
Страховые взносы в ПФР	Прочая кредиторская задолженность.		2 002,24	2 002,24											1				1
Основные средства	Основные средства		84 528,14	84 528,14											1				1
Аренда	Аренда		509 912,36	509 912,36											1				1
Авансы (предоплаты) уплаченные	Расходы будущих периодов		588 721,99	588 721,99											1				1
Отложенные налоговые обязательства и отложенные налоговые активы	Отложенные налоговые обязательства и отложенные налоговые активы		2 916 243,32	2 916 243,32											1				1