

Перечень ценных бумаг по которым допускается возникновение непокрытых позиций, и (или) по которым положительное значение плановой позиции не принимается равным 0
(Перечень ликвидного имущества) *

| № | Наименование эмитента | Тип ценных бумаг | Код в системе торгов | ISIN | № гос. регистрации |
|----|--|-------------------------|----------------------|--------------|--------------------|
| 1 | ПАО "АК АЛРОСА" | Акция обыкновенная | ALRS | RU0007252813 | 1-03-40046-N |
| 2 | ПАО "Северсталь" | Акция обыкновенная | CHMF | RU0009046510 | 1-02-00143-A |
| 3 | ПАО "Газпром" | Акция обыкновенная | GAZP | RU0007661625 | 1-02-00028-A |
| 4 | ПАО "ГМК "Норильский никель" | Акция обыкновенная | GMKN | RU0007288411 | 1-01-40155-F |
| 5 | ПАО "РусГидро" | Акция обыкновенная | HYDR | RU000A0JPKH7 | 1-01-55038-E |
| 6 | ПАО "Интер РАО" | Акция обыкновенная | IRAO | RU000A0JPNM1 | 1-04-33498-E |
| 7 | ПАО "ЛУКОЙЛ" | Акция обыкновенная | LKOH | RU0009024277 | 1-01-00077-A |
| 8 | ПАО "ММК" | Акция обыкновенная | MAGN | RU0009084396 | 1-03-00078-A |
| 9 | ПАО "Магнит" | Акция обыкновенная | MGNT | RU000A0JKQU8 | 1-01-60525-P |
| 10 | ПАО "Московская Биржа" | Акция обыкновенная | MOEX | RU000A0JR4A1 | 1-05-08443-H |
| 11 | ПАО "МТС" | Акция обыкновенная | MTSS | RU0007775219 | 1-01-04715-A |
| 12 | ПАО "НЛМК" | Акция обыкновенная | NLMK | RU0009046452 | 1-01-00102-A |
| 13 | ПАО "НОВАТЭК" | Акция обыкновенная | NVTK | RU000A0DKVS5 | 1-02-00268-E |
| 14 | ПАО "ФосАгро" | Акция обыкновенная | PHOR | RU000A0JRKT8 | 1-01-00077-A |
| 15 | ПАО "ПИК СЗ" | Акция обыкновенная | PIKK | RU000A0JP7J7 | 1-02-01556-A |
| 16 | ПАО "Полюс" | Акция обыкновенная | PLZL | RU000A0JNAA8 | 1-01-55192-E |
| 17 | ПАО "НК "Роснефть" | Акция обыкновенная | ROSN | RU000A0J2Q06 | 1-02-00122-A |
| 18 | ПАО "Транснефть" | Акция привилегированная | TRNFP | RU0009091573 | 2-01-00206-A |
| 19 | ПАО "Ростелеком" | Акция обыкновенная | RTKM | RU0008943394 | 1-01-00124-A |
| 20 | МКПАО "ОК РУСАЛ" | Акция обыкновенная | RUAL | RU000A1025V3 | 1-01-16677-A |
| 21 | ПАО "Сбербанк" | Акция обыкновенная | SBER | RU0009029540 | 10301481B |
| 22 | ПАО "Сбербанк" | Акция привилегированная | SBERP | RU0009029557 | 20301481B |
| 23 | ПАО "Сургутнефтегаз" | Акция обыкновенная | SNGS | RU0008926258 | 1-01-00155-A |
| 24 | ПАО "Сургутнефтегаз" | Акция привилегированная | SNGSP | RU0009029524 | 2-01-00155-A |
| 25 | ПАО "Татнефть" | Акция обыкновенная | TATN | RU0009033591 | 1-03-00161-A |
| 26 | ПАО "Татнефть" | Акция привилегированная | TATNP | RU0006944147 | 2-03-00161-A |
| 27 | Международная компания ПАО "ВК" | Акция обыкновенная | VKCO | RU000A106YF0 | 1-01-16753-A |
| 28 | ПАО "Банк ВТБ" | Акция обыкновенная | VTBR | RU000A0JP5V6 | 10401000B |
| 29 | Международная компания ПАО "ТКС Холдинг" | Акция обыкновенная | TCSG | RU000A107UL4 | 1-01-16784-A |
| 30 | ПАО "Банк "Санкт-Петербург" | Акция обыкновенная | BSPB | RU0009100945 | 10300436B |
| 31 | ПАО "Россети" | Акция обыкновенная | FEES | RU000A0JPNN9 | 1-01-65018-D |
| 32 | ПАО "Совкомфлот" | Акция обыкновенная | FLOT | RU000A0JXNU8 | 1-01-10613-A |
| 33 | ПАО "Мосэнерго" | Акция обыкновенная | MSNG | RU0008958863 | 1-01-00085-A |
| 34 | ПАО "Юнипро" | Акция обыкновенная | UPRO | RU000A0JNGA5 | 1-02-65104-D |
| 35 | МКПАО "ЯНДЕКС" | Акция обыкновенная | YDEX | RU000A107T19 | 1-01-16777-A |
| 36 | МКПАО "МД Медикал Групп" | Акция обыкновенная | MDMG | RU000A108KL3 | 1-01-16802-A |

| | | | | | |
|----|-----------------------------|---------------------------|--------------|--------------|--------------|
| 37 | ПАО "Газпром нефть" | Акция обыкновенная | SIBN | RU0009062467 | 1-01-00146-A |
| 38 | ООО "УК "Атон-менеджмент" | Пай биржевого ПИФа | AMNR | RU000A107H96 | 5936 |
| 39 | АО "ВИМ Инвестиции" | Пай биржевого ПИФа | LQDT | RU000A1014L8 | 3915 |
| 40 | ООО "УК "Альфа-Капитал" | Пай биржевого ПИФа | AKMM | RU000A104X08 | 5012 |
| 41 | АО "УК "Первая" | Пай биржевого ПИФа | SBMM | RU000A103RF1 | 4607 |
| 42 | ООО "Т-Капитал" | Пай биржевого ПИФа | TMON | RU000A106DL2 | 5229 |
| 43 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26207RMFS9 | RU000A0JS3W6 | 26207RMFS |
| 44 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26212RMFS9 | RU000A0JTK38 | 26212RMFS |
| 45 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26218RMFS6 | RU000A0JVW48 | 26218RMFS |
| 46 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26219RMFS4 | RU000A0JWM07 | 26219RMFS |
| 47 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26221RMFS0 | RU000A0JXFM1 | 26221RMFS |
| 48 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26224RMFS4 | RU000A0ZYUA9 | 26224RMFS |
| 49 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26225RMFS1 | RU000A0ZYUB7 | 26225RMFS |
| 50 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26226RMFS9 | RU000A0ZZYW2 | 26226RMFS |
| 51 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26228RMFS5 | RU000A100A82 | 26228RMFS |
| 52 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26229RMFS3 | RU000A100EG3 | 26229RMFS |
| 53 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26230RMFS1 | RU000A100EF5 | 26230RMFS |
| 54 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26232RMFS7 | RU000A1014N4 | 26232RMFS |
| 55 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26233RMFS5 | RU000A101F94 | 26233RMFS |
| 56 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26234RMFS3 | RU000A101QE0 | 26234RMFS |
| 57 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26235RMFS0 | RU000A1028E3 | 26235RMFS |
| 58 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26236RMFS8 | RU000A102BT8 | 26236RMFS |
| 59 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26237RMFS6 | RU000A1038Z7 | 26237RMFS |
| 60 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26238RMFS4 | RU000A1038V6 | 26238RMFS |
| 61 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26239RMFS2 | RU000A103901 | 26239RMFS |
| 62 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26240RMFS0 | RU000A103BR0 | 26240RMFS |
| 63 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26241RMFS8 | RU000A105FZ9 | 26241RMFS |
| 64 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26242RMFS6 | RU000A105RV3 | 26242RMFS |
| 65 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26243RMFS4 | RU000A106E90 | 26243RMFS |
| 66 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26244RMFS2 | RU000A1074G2 | 26244RMFS |
| 67 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26245RMFS9 | RU000A108EG6 | 26245RMFS |
| 68 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26246RMFS7 | RU000A108EE1 | 26246RMFS |
| 69 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26247RMFS5 | RU000A108EF8 | 26247RMFS |
| 70 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU26248RMFS3 | RU000A108EH4 | 26248RMFS |
| 71 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU29006RMFS2 | RU000A0JV4L2 | 29006RMFS |
| 72 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU29007RMFS0 | RU000A0JV4M0 | 26007RMFS |
| 73 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU29008RMFS8 | RU000A0JV4P3 | 29008RMFS |
| 74 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU29009RMFS6 | RU000A0JV4N8 | 29009RMFS |
| 75 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU29010RMFS4 | RU000A0JV4Q1 | 29010RMFS |
| 76 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU46020RMFS2 | RU000A0GN9A7 | 46020RMFS |
| 77 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU46023RMFS6 | RU000A0JRTL6 | 46023RMFS |
| 78 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU52002RMFS1 | RU000A0ZYZ26 | 52002RMFS |

| | | | | | |
|----|--------------------------------|--------------------------------------|--------------|--------------|--------------------|
| 79 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU52003RMFS9 | RU000A102069 | 52003RMFS |
| 80 | Минфин Российской Федерации | Государственная облигация | SU52004RMFS7 | RU000A103MX5 | 52004RMFS |
| 81 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A0JWHA4 | RU000A0JWHA4 | 12840077V |
| 82 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A0JXTS9 | RU000A0JXTS9 | 12840078V |
| 83 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A0JXU14 | RU000A0JXU14 | 12840079V |
| 84 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A0ZYYN4 | RU000A0ZYYN4 | 12840080V |
| 85 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A0ZZVE6 | RU000A0ZZVE6 | 12978082V |
| 86 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A1006S9 | RU000A1006S9 | 12840086V |
| 87 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A102CK5 | RU000A102CK5 | 12978087V |
| 88 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A102CL3 | RU000A102CL3 | 12978088V |
| 89 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | RU000A1034K8 | RU000A1034K8 | 12978104V |
| 90 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | XS0088543193 | XS0088543193 | MK-0-CM-119 |
| 91 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | XS0114288789 | XS0114288789 | SK-0-CM-128 |
| 92 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | XS0767473852 | XS0767473852 | 12840061V |
| 93 | Минфин Российской Федерации | Государственная замещающая облигация | XS0971721963 | XS0971721963 | 12840069V |
| 94 | ПАО "Группа компаний "Самолет" | Биржевая облигация | RU000A104JQ3 | RU000A104JQ3 | 4-36522-R-001P-02E |
| 95 | ООО "Газпром капитал" | Биржевая облигация | RU000A105RH2 | RU000A105RH2 | 4-11-36400-R-003P |

* ценные бумаги принимаются в обеспечение со ставками риска, определенными НКО НКЦ (АО) и размещенными на сайте <https://www.nationalclearingcentre.ru/rates/fondMarketRates>