

Разреш. доля %	Вид актива	Кол-во	Цена	Стоимость	Доля актива в портфеле %
	Структура активов на 31.01.2012г. ОФБУ Вечные ценности				
	СТОИМОСТЬ ЧИСТЫХ АКТИВОВ			495337178.89	
	КАПИТАЛ В УПРАВЛЕНИИ			299020817.41	
	СВОБОДНЫЕ ДЕНЕЖНЫЕ СРЕДСТВА			294077889.32	59.37
-	ГАРАНТИЙНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ			91940442.97	18.56
	Опционы call				
	Маржируемый опцион колл на фьючерс на АФФИНИРОВАННУЮ ПЛАТИНУ В СЛИТКАХ 3.12 (цена-страйк 1425)	-1250			
	Маржируемый опцион колл на фьючерс на КУРС БЕЗНАЛ. ДОЛЛАРА США С КОТИРОВКАМИ В РУБЛЯХ SI-3.12 (цена-страйк 30000)	-8500			
	Фьючерсы				
	Фьючерс на АФФИНИРОВАННУЮ ПЛАТИНУ В СЛИТКАХ 3.12	10746			
	Облигации				22.07
	Облигации Государственные				22.07
	Облигации МИНФИН РФ ОФЗ-ПД 25067RMFS	52000	1.0409	54125448	10.93
	Облигации МИНФИН РФ ОФЗ-ПД вып.25075	29400	0.9888	29072160.6	5.87
	Облигации МИНФИН РФ ОФЗ-ПД вып.26199	26000	1.0047	26121238	5.27
-	ЭМИТЕНТЫ				
	ОТРАСЛЬ				