

Общество с ограниченной ответственностью "Управляющая компания "Альфа-Капитал"  
123001, Россия, г. Москва, ул. Садовая-Кудринская, дом 32, строение 1  
**Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам**  
на 01.11.2024 0:00

Альфа-Капитал

Инвестор: СОЮЗ "СРО АУ «СТРАТЕГИЯ»  
Договор: 622581/ДУ-ЮЛ-2021 (СОЮЗ "СРО АУ «СТРАТЕГИЯ») от 01.11.2021

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Финансовый инструмент	Код финан. инструмента	Тип вложения	Количество	Балансовая стоимость, руб.	в том числе переоценка, руб.	Процент от всего по бал. ст-ти	Дата котировки	Текущая оценка 1 бумаги, руб.	Текущая оценка, руб.	Процент от всего по оценке	Дата погашения	Эффективная доходность к погашению
26221RMFS ОФЗ 26221 ПД обл	RU000A0JXFM1	Облигация	3 415	2 681 116,50	-1 211 484,57	-	31.10.2024	588,52	2 009 795,80	-	23.03.2033	17,84%
26221RMFS ОФЗ 26221 ПД обл, НКД	RU000A0JXFM1	Купон	-	-	-	-	-	6,12	20 899,80	-	02.04.2025	-
26236RMFS ОФЗ-ПД236	RU000A102B18	Облигация	4 908	3 934 154,64	-646 025,70	-	31.10.2024	658,19	3 230 396,52	-	17.05.2028	20,44%
26236RMFS ОФЗ-ПД236, НКД	RU000A102B18	Купон	-	-	100 417,66	-	-	25,3	124 172,40	-	20.11.2024	-
26244RMFS ОФЗ-ПД244	RU000A1074G2	Облигация	750	726 980,52	-	-	31.10.2024	733,94	550 455,00	-	15.03.2034	17,75%
26244RMFS ОФЗ-ПД244, НКД	RU000A1074G2	Купон	-	-	1 155,00	-	-	11,1	8 325,00	-	26.03.2025	-
29013RMFS ОФЗ-ПК013	RU000A101KT1	Облигация	2 500	2 478 750,00	49 400,56	-	31.10.2024	973,63	2 434 075,00	-	18.09.2030	0,88%
29013RMFS ОФЗ-ПК013, НКД	RU000A101KT1	Купон	-	-	6 300,00	-	-	18,2	45 500,00	-	25.12.2024	-
29015RMFS ОФЗ-ПК015	RU000A1025A7	Облигация	3 450	3 430 328,79	-	-	31.10.2024	982,03	3 388 003,50	-	18.10.2028	1,52%
29015RMFS ОФЗ-ПК015, НКД	RU000A1025A7	Купон	-	-	-	-	-	4,09	14 110,50	-	22.01.2025	-
29019RMFS ОФЗ-ПК019	RU000A102A49	Облигация	800	796 304,00	2 465,92	-	31.10.2024	979,89	783 912,00	-	18.07.2029	19,72%
29019RMFS ОФЗ-ПК019, НКД	RU000A102A49	Купон	-	-	-	-	-	4,09	3 272,00	-	22.01.2025	-
29020RMFS ОФЗ-ПК020	RU000A102BV4	Облигация	29 800	29 549 600,00	127 628,27	-	31.10.2024	986,19	29 191 224,00	-	22.06.2027	18,71%
29020RMFS ОФЗ-ПК020, НКД	RU000A102BV4	Купон	-	-	74 592,00	-	-	18,2	538 720,00	-	25.12.2024	-
29021RMFS ОФЗ-ПК021	RU000A105B11	Облигация	22 000	21 874 820,00	396 378,40	-	31.10.2024	972,87	21 403 140,00	-	27.11.2030	0,68%
29021RMFS ОФЗ-ПК021, НКД	RU000A105B11	Купон	-	-	286 640,00	-	-	28,8	833 600,00	-	04.12.2024	-
<b>Всего по Минфин России</b>				<b>65 941 139,13</b>		<b>89,32%</b>			<b>64 379 601,52</b>	<b>89,15%</b>		<b>11,00%</b>
<b>по всем федеральным облигациям</b>				<b>65 941 139,13</b>		<b>89,32%</b>			<b>64 379 601,52</b>	<b>89,15%</b>		<b>11,00%</b>
4802-02-40155-F-001P ГМК Норильский никель о6602	RU000A105A61	Облигация	1 284	1 198 844,64	-	-	31.10.2024	903,3	1 159 837,20	-	05.10.2027	5,21%
4802-02-40155-F-001P ГМК Норильский никель о6602, НКД	RU000A105A61	Купон	-	-	-	-	-	6,14	7 883,76	-	08.04.2025	-
<b>Всего по ПАО "ГМК "Норильский никель"</b>				<b>1 198 844,64</b>		<b>1,62%</b>			<b>1 167 720,96</b>	<b>1,62%</b>		<b>5,21%</b>
4802-06-18419-A-001P ЛК Европлан оббП06	RU000A106F40	Облигация	1 100	1 044 213,17	-	-	31.10.2024	940,3	1 034 330,00	-	24.08.2025	21,91%
4802-06-18419-A-001P ЛК Европлан оббП06, НКД	RU000A106F40	Купон	-	-	1 848,00	-	-	10,39	11 429,00	-	24.12.2024	-
<b>Всего по ПАО "Лк "Европлан"</b>				<b>1 046 061,17</b>	<b>1 848,00</b>	<b>1,42%</b>			<b>1 045 759,00</b>	<b>1,45%</b>		<b>21,91%</b>
4802-01-55194-E-002P Трансконтейнер о652701	RU000A109E71	Облигация	3 000	2 994 898,20	-	-	31.10.2024	975,4	2 926 200,00	-	20.08.2027	0,94%
4802-01-55194-E-002P Трансконтейнер о652701, НКД	RU000A109E71	Купон	-	-	-	-	-	15,35	46 050,00	-	03.11.2024	-
<b>Всего по ПАО "Трансконтейнер"</b>				<b>2 994 898,20</b>		<b>4,06%</b>			<b>2 972 250,00</b>	<b>4,12%</b>		<b>0,94%</b>
<b>по всем облигациям предприятий и организаций</b>				<b>5 239 804,01</b>		<b>7,10%</b>			<b>5 185 729,96</b>	<b>7,16%</b>		<b>6,13%</b>
Денги у брокера или оператора инвестиционной платформы, r/c 30501810000119918267 (RUB)		Денги	2 642 230,92	2 642 230,92	-	-	-	-	2 642 230,92	-	-	-
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>				<b>2 642 230,92</b>		<b>3,58%</b>			<b>2 642 230,92</b>	<b>3,66%</b>		-
<b>по всем денежным средствам у брокера</b>				<b>2 642 230,92</b>		<b>3,58%</b>			<b>2 642 230,92</b>	<b>3,66%</b>		-
р/с 40701810101850002357 (RUB) в АО "АЛЬФА-БАНК"		Денги	10 080,83	10 080,83	-	-	-	-	10 080,83	-	-	-
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>				<b>10 080,83</b>		<b>0,01%</b>			<b>10 080,83</b>	<b>0,01%</b>		-
Расчеты со специализированным депозитарием АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ» (RUB) договор EB637765_10044RAY от 27.07.2020 АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»		Расчеты	-4 930,24	-4 930,24	-	-	-	-	-4 930,24	-	-	-
<b>Всего по АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»</b>				<b>-4 930,24</b>		<b>-0,01%</b>			<b>-4 930,24</b>	<b>-0,01%</b>		-
<b>по всем прочим вложениям</b>				<b>5 150,59</b>		<b>0,01%</b>			<b>5 150,59</b>	<b>0,01%</b>		-

**ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ: 73 828 324,65 100,00% 72 212 712,99 100,00%**

**Балансовая стоимость по всем вложениям с учетом забалансовых обязательств: 73 828 324,65**

М.П.



*Президент Союза  
Жоданова Ю.В.*