

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам  
на 01.12.2024 0:00

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 финанс. 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	ФФЗ 26221 ПД обл	RU000A0JXFM1	Облигация	3 415	2 681 116,50	-1 211 484,57	29.11.2024	603,74	2 061 772,10		23.03.2033	17,36%
26221RMFS	ФФЗ 26221 ПД обл, НКД	RU000A0JXFM1	Купон					12,45	42 516,75		02.04.2025	-
26236RMFS	ФФЗ-ПД236	RU000A102BT8	Облигация	4 908	3 934 154,64	-646 025,70	29.11.2024	667,28	3 275 010,24		17.05.2028	20,25%
26236RMFS	ФФЗ-ПД236: НКД	RU000A102BT8	Купон					1,56	7 656,48		21.05.2025	-
26244RMFS	ФФЗ-ПД244	RU000A1024G2	Облигация	750	726 960,52		29.11.2024	755,67	566 752,50		15.03.2034	17,14%
26244RMFS	ФФЗ-ПД244: НКД	RU000A1024G2	Купон		1 155,00	1 155,00		20,34	15 255,00		26.03.2025	-
29013RMFS	ФФЗ-ПК013	RU000A101KT1	Облигация	2 500	2 476 750,00	49 400,58	29.11.2024	969,24	2 423 100,00		18.09.2030	0,67%
29013RMFS	ФФЗ-ПК013: НКД	RU000A101KT1	Купон		6 300,00	6 300,00		34,92	87 300,00		25.12.2024	-
29015RMFS	ФФЗ-ПК015	RU000A1025A7	Облигация	3 450	3 430 328,79		29.11.2024	975,41	3 365 164,50		18.10.2028	1,27%
29015RMFS	ФФЗ-ПК015: НКД	RU000A1025A7	Купон					20,8	71 760,00		22.01.2025	-
29019RMFS	ФФЗ-ПК019	RU000A102A49	Облигация	800	796 304,00	2 465,92	29.11.2024	974,18	779 344,00		18.07.2029	19,86%
29019RMFS	ФФЗ-ПК019: НКД	RU000A102A49	Купон					20,8	16 640,00		22.01.2025	-
29020RMFS	ФФЗ-ПК020	RU000A102B4V	Облигация	29 600	29 549 600,00	127 628,27	29.11.2024	981,3	29 046 480,00		22.09.2027	18,84%
29020RMFS	ФФЗ-ПК020: НКД	RU000A102B4V	Купон		74 592,00	74 592,00		34,92	1 033 632,00		25.12.2024	-
29021RMFS	ФФЗ-ПК021	RU000A105B11	Облигация	22 000	21 874 820,00	396 378,40	29.11.2024	969,37	21 326 140,00		27.11.2030	1,41%
29021RMFS	ФФЗ-ПК021: НКД	RU000A105B11	Купон		288 640,00	288 640,00		45,52	1 001 440,00		04.12.2024	-
<b>Всего по Минфин России</b>					<b>65 840 721,45</b>				<b>65 119 963,57</b>	<b>89,02%</b>		<b>11,26%</b>
<b>по всем федеральным облигациям</b>					<b>65 840 721,45</b>				<b>65 119 963,57</b>	<b>89,02%</b>		<b>11,26%</b>
4B02-02-40106602	5-F-001P ГМК Норильский никель	RU000A105A61	Облигация	1 284	1 198 844,64		29.11.2024	903,8	1 160 479,20		05.10.2027	5,01%
4B02-02-40106602: НКД	5-F-001P ГМК Норильский никель	RU000A105A61	Купон					14,1	18 181,44		08.04.2025	-
<b>Всего по ПАО "ГМК "Норильский никель"</b>					<b>1 198 844,64</b>				<b>1 178 660,64</b>	<b>1,61%</b>		<b>5,01%</b>
4B02-06-16406602	9-A-001P ЛК Европлан оббП06	RU000A106F40	Облигация	1 100	1 044 213,17		29.11.2024	943,8	1 038 180,00		24.06.2025	22,76%
4B02-06-16406602: НКД	9-A-001P ЛК Европлан оббП06	RU000A106F40	Купон		1 848,00	1 848,00		18,82	20 702,00		24.12.2024	-
<b>Всего по ПАО "ЛК "Европлан"</b>					<b>1 046 061,17</b>				<b>1 058 882,00</b>	<b>1,45%</b>		<b>22,76%</b>
4B02-01-5510662P01	4-E-002P Трансконтейнер	RU000A109E71	Облигация	3 000	2 994 898,20		29.11.2024	971,4	2 914 200,00		20.08.2027	1,08%
4B02-01-5510662P01: НКД	4-E-002P Трансконтейнер	RU000A109E71	Купон					16,83	50 490,00		03.12.2024	-
<b>Всего по ПАО "Трансконтейнер"</b>					<b>2 994 898,20</b>				<b>2 964 690,00</b>	<b>4,05%</b>		<b>1,08%</b>
<b>по всем облигациям предприятий и организаций</b>					<b>5 239 804,01</b>				<b>5 202 232,64</b>	<b>7,11%</b>		<b>6,38%</b>
Денги у брокера или оператора инвестиционной платформы, р/с 30601810000119918267 (RUB)				Деньги	6 230,92	6 230,92			6 230,92			
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>					<b>6 230,92</b>				<b>6 230,92</b>	<b>0,01%</b>		<b>0,01%</b>
<b>по всем денежным средствам у брокера</b>					<b>6 230,92</b>				<b>6 230,92</b>	<b>0,01%</b>		<b>0,01%</b>
р/с 4070181101850002357 (RUB) в АО "АЛЬФА-БАНК"				Деньги	2 830 917,73	2 830 917,73			2 830 917,73			
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>					<b>2 830 917,73</b>				<b>2 830 917,73</b>	<b>3,87%</b>		<b>3,87%</b>
Расчеты со специализированным депозитарием АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ» (RUB); договор EB637765_1_044PAY от 27.07.2020 АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»:				Расчеты	-4 564,57	-4 564,57			-4 564,57			
<b>Всего по АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»</b>					<b>-4 564,57</b>				<b>-4 564,57</b>	<b>-0,01%</b>		<b>-0,01%</b>
<b>по всем прочим вложениям</b>					<b>2 826 353,16</b>				<b>2 826 353,16</b>	<b>3,86%</b>		<b>3,86%</b>

**ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:** 73 913 109,54 100,00% 73 154 780,29 100,00%

Балансовая стоимость по всем вложениям с учетом забалансовых обязательств: 73 913 109,54

М.П.

Фредерик Соуф  
Федосанова  
У.В.

