

Облигации												
ISIN	Эмитент	Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	YTM, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость в руб.	Доля в текущем портфеле, %
Облигации, руб.												
RU000A1011R1	Россельхозбанк, БО-10P	RUB	10.11.2023	7,0%	0,080768566	1,0	1 000	99,0	22,4	9 543	9 658 852	17%
RU000A0ZZE2S	Газпром, БО-22	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	0,082299864	2,4	1 000	100,1	9,5	1 979	1 999 265	4%
RU000A0ZZET0	Газпром, БО-23	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	0,084493464	2,4	1 000	99,5	9,5	494	496 440	1%
RU000A101137	Газпром нефть, 003P-01R	RUB	05.11.2024	6,9%	0,084863344	1,9	1 000	97,3	5,4	3 800	3 717 692	7%
RU000A10ORG5	ЕвроХим, БО-001P-06	RUB	18.08.2023	7,9%	0,081031699	0,8	1 000	100,0	4,1	10 000	10 038 900	18%
RU000A101012	АФК Система, 001P-12	RUB	23.10.2029 (01.11.2024)	7,9%	0,099486015	1,8	1 000	96,5	27,3	10 000	9 918 100	18%
RU000A101QF7	Ритейл Бел Финанс, 001P-01	RUB	28.05.2025	9,5%	0,129308091	1,6	1 000	95,0	1,8	4 996	4 756 742	9%
RU000A101SM9	КАМАЗ, БО-П07	RUB	07.06.2023	6,7%	0,085322907	0,7	1 000	98,9	0,0	2 997	2 963 134	5%
RU000A101FH6	МТС, 001P-14	RUB	11.02.2027	6,6%	0,089677961	3,5	1 000	92,4	3,8	3 000	2 783 400	5%
RU000A1013P1	ВЭБ.РФ, ЛБО-001P-18	RUB	17.11.2026	7,3%	0,091343696	3,3	1 000	94,3	21,1	3 000	2 891 130	5%
RU000A0JXPD9	ТМК, БО-06	RUB	13.04.2027 (24.04.2023)	8,3%	0,090384939	0,5	1 000	99,6	31,9	3 000	3 084 810	6%
RU000A100928	ОКЕЙ, 001P-02	RUB	06.04.2029 (16.04.2025)	9,9%	0,100138071	2,1	1 000	100,5	14,7	2 979	3 038 729	5%
Итого облигации											55 347 194	100%

ISIN	Эмитент	Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	УТМ, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость
Продажа											
Облигации											
RU000A1011R1	Россельхозбанк, БО-10P	RUB	10.11.2023	7,0%	8,1%	1,0	1000	99,0	22,4	6 063	6 136 605
RU000A101137	Газпром нефть, 003P-01R	RUB	05.11.2024	6,9%	8,5%	1,9	1000	97,3	5,4	960	939 206
RU000A100RG5	ЕвроХим, БО-001P-06	RUB	18.08.2023	7,9%	8,1%	0,8	1000	100,0	4,1	6 247	6 271 301
RU000A101012	АФК Система, 001P-12	RUB	23.10.2029 (01.11.2024)	7,9%	9,9%	1,8	1000	96,5	27,3	6 202	6 151 206
RU000A101QF7	Ритейл Бел Финанс, 001P-01	RUB	28.05.2025	9,5%	12,9%	1,6	1000	95,0	1,8	4 996	4 756 742
RU000A1015M9	КАМАЗ, БО-П107	RUB	07.06.2023	6,7%	8,5%	0,7	1000	98,9	0,0	2 997	2 963 134
RU000A101FH6	МТС, 001P-14	RUB	11.02.2027	6,6%	9,0%	3,5	1000	92,4	3,6	3 000	2 782 860
RU000A0JXPD9	ТМК, БО-06	RUB	13.04.2027 (24.04.2023)	8,3%	9,0%	0,5	1000	99,6	31,9	3 000	3 084 810
RU000A1009Z8	ОКЕЙ, 001P-02	RUB	06.04.2029 (16.04.2025)	9,9%	10,0%	2,1	1000	100,5	14,7	150	153 008
Итого от продажи											33 238 871
Покупка											
Облигации											
RU000A104ZC9	КАМАЗ, БО-П110	RUB	18.07.2025 (24.07.2024)	10,8%	0,09454128	1,5	1 000	102,8	13,9	3 925	4 090 282
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001P-01	RUB	24.05.2024	8,1%	0,099751084	1,5	1 000	97,5	22,9	4 089	4 078 205
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001P-02	RUB	01.08.2025	9,6%	0,099210954	2,3	1 000	99,9	8,6	4 037	4 069 417
RU000A1050H0	ЕАБР, 003P-001	RUB	29.07.2025	9,4%	0,095617735	2,4	1 000	100,0	9,2	4 047	4 084 313
RU000A101GZ6	Уралкалий, ПБО-06-P	RUB	25.02.2025	6,9%	0,088127801	2,1	1 000	96,1	1,5	4 244	4 085 699
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,6%	2,7	1 000	95,4	1,3	4 268	4 075 599
RU000A104V75	Почта России, БО-002P-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	0,089771833	3,4	1 000	109,9	28,4	3 620	4 082 346
RU000A103943	Азрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	0,096589358	2,9	1 000	96,9	19,0	4 132	4 083 614
RU000A104Y15	Белуга Групп, БО-П05	RUB	06.07.2027	10,9%	0,102373917	3,3	1 000	103,0	16,9	3 894	4 077 174
RU000A103QK3	Майл.Ру Финанс, 001P-01	RUB	15.09.2026	7,9%	0,093246967	3,1	1 000	96,0	36,6	4 102	4 086 741
RU000A104IQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	0,132044538	1,9	1 000	99,8	7,7	2 037	2 048 305
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001P-06	RUB	24.02.2026	8,0%	0,107984957	2,2	1 000	94,6	1,8	2 155	2 041 324
Фонды											
RU000A1002S8	БПИФ WIMB - Фонд рос. корп. облигаций	RUB			10,1%	1,6		130,9		58 500	7 658 820
Итого на покупки											52 561 839

Текущая оценка портфеля		
	Стоимость, руб.	Доля, %
Облигации	67 010 802	90%
Фонды	7 810 200	10%
	74 821 002	100%

Параметры по портфелю	
YTM, %	Дюрация, лет
9,5%	2,2

Облигации												
ISIN	Эмитент	Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	УТМ, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость в руб.	Доля в текущем портфеле, %
Облигации, руб.												
RU000A1011R1	Россельхозбанк, БО-10P	RUB	10.11.2023	7,0%	0,080768566	1,0	1 000	99,0	22,4	3 480	3 522 247	5%
RU000A0ZZES2	Газпром, БО-22	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	0,082299864	2,4	1 000	100,1	9,5	1 979	1 999 265	3%
RU000A0ZZET0	Газпром, БО-23	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	0,084493464	2,4	1 000	99,5	9,5	494	496 440	1%
RU000A101137	Газпром нефть, 003P-01R	RUB	05.11.2024	6,9%	0,084863344	1,9	1 000	97,3	5,4	2 840	2 778 486	4%
RU000A100RG5	ЕвроХим, БО-001P-06	RUB	18.08.2023	7,9%	0,081031699	0,8	1 000	100,0	4,1	3 753	3 767 599	5%
RU000A101012	АФК Система, 001P-12	RUB	23.10.2029 (01.11.2024)	7,9%	0,099486015	1,8	1 000	96,5	27,3	3 798	3 766 894	5%
RU000A1013P1	ВЭБ.РФ, ПБО-001P-18	RUB	17.11.2026	7,3%	0,091343696	3,3	1 000	94,3	21,1	3 000	2 891 130	4%
RU000A1009Z8	ОКЕЙ, 001P-02	RUB	06.04.2029 (16.04.2025)	9,9%	0,100138071	2,1	1 000	100,5	14,7	2 829	2 885 721	4%
RU000A1042C9	КАМАЗ, БО-П10	RUB	18.07.2025 (24.07.2024)	10,8%	0,09454128	1,5	1 000	102,8	13,9	3 925	4 090 282	5%
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001P-01	RUB	24.05.2024	8,1%	0,099751084	1,5	1 000	97,5	22,9	4 089	4 078 205	5%
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001P-02	RUB	01.08.2025	9,6%	0,099210954	2,3	1 000	99,9	8,6	4 037	4 069 417	5%
RU000A1050H0	ЕАБР, 003P-001	RUB	29.07.2025	9,4%	0,095617735	2,4	1 000	100,0	9,2	4 047	4 084 313	5%
RU000A101GZ6	Уралкалий, ПБО-06-P	RUB	25.02.2025	6,9%	0,088127801	2,1	1 000	96,1	1,5	4 244	4 085 699	5%
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,61%	2,7	1 000	95,4	1,3	4 268	4 075 599	5%
RU000A104V75	Почта России, БО-002P-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	0,089717833	3,4	1 000	109,9	28,4	3 620	4 082 346	5%
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	0,096589358	2,9	1 000	96,9	19,0	4 132	4 083 614	5%
RU000A104Y15	Белуга Групп, БО-П05	RUB	06.07.2027	10,9%	0,102373917	3,3	1 000	103,0	16,9	3 894	4 077 174	5%
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001P-01	RUB	15.09.2026	7,9%	0,093246967	3,1	1 000	96,0	36,6	4 102	4 086 741	5%
RU000A104IQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	0,132044538	1,9	1 000	99,8	7,7	2 037	2 048 305	3%
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001P-06	RUB	24.02.2026	8,0%	0,107984957	2,2	1 000	94,6	1,8	2 155	2 041 324	3%
										Итого облигации	67 010 802	90%
Фонды облигаций												
RU000A1002S8	БПИФ WIMB - Фонд рос. корп. облигаций	RUB			10,1%	1,6		130,2		60 000	7 810 200	10%
										Итого фонды	7 810 200	10%