

Текущая оценка портфеля			Параметры по портфелю до ребалансировок									
	Стоимость, руб.	Доля, %	УТМ, %	Дюрация, лет								
Облигации	11 825 669	28%										
Акции	29 818 678	72%	9,7%	0,6								
	41 644 346	28%										
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.												
RU000A0JXSD3	Волгоградская область, 35007	RUB	02.06.2024	8,2%	8,8%	1,1	650	99,5	0,6	3 000	1 941 795	5%
RU000A100JH0	Ритейл Бел Финанс, 01	RUB	02.07.2024	11,0%	12,4%	0,9	1 000	99,1	19,5	2 398	2 423 179	6%
RU000A0ZZPZ3	Россельхозбанк, БО-06Р	RUB	14.10.2022	9,0%	8,2%	0,1	1 000	100,1	36,0	2 000	2 073 600	5%
RU000A101H43	Группа компаний Самолет, БО-П08	RUB	28.02.2023	11,0%	10,3%	0,4	1 000	100,4	2,7	1 163	1 171 153	3%
RU000A0JXN21	АФК Система, 001Р-06	RUB	26.03.2027 (05.04.2023)	17,0%	9,1%	0,5	1 000	104,3	74,5	2 405	2 688 357	6%
RU35006HAK0	Республика Хакасия, 35006	RUB	02.11.2023	11,7%	9,3%	0,6	700	101,8	9,0	2 117	1 527 585	4%
Итого облигации											11 825 669	28%
Акции												
ISIN	Эмитент	Валюта	Цена текущая	Количество	Текущая стоимость	Доля в текущем портфеле, %						
RU0007661625	Газпром, акция об.	RUB	244,0	8 790	2 144 321	5%						
RU0007288411	ГМК Норильский никель, акция об.	RUB	16 244,0	97	1 575 668	4%						
RU0009024277	Лукойл, акция об.	RUB	4 410,0	2 655	11 708 550	28%						
RU000A0JKQU8	Магнит, акция об.	RUB	5 433,0	474	2 575 242	6%						
RU0007775219	МТС, акция об.	RUB	237,6	7 690	1 826 760	4%						
RU0009029557	Сбербанк России, акция прив.	RUB	127,8	8 630	1 102 914	3%						
RU000A0JXNU8	Совкомфлот, акция об.	RUB	41,1	170 940	7 032 472	17%						
RU0009029524	Сургутнефтегаз, акция прив.	RUB	29,0	63 800	1 852 752	4%						
Итого акции					29 818 678	72%						

ISIN	Эмитент	Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	YTM, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость
Продажа Облигаций											
RU000A0JXSD3	Волгоградская область, 35007	RUB	02.06.2024	7,0%	8,8%	1,1	650	99,5	0,6	3 000	1 941 795
Итого от продажи облигаций											1 941 795

RU0009024277	Лукойл, акция об.	RUB	4 410,0	2 268	10 001 880
RU0007775219	МТС, акция об.	RUB	237,6	7 690	1 826 760
RU0009029557	Сбербанк России, акция прив.	RUB	127,8	8 630	1 102 914
RU000A0JXNU8	Совкомфлот, акция об.	RUB	41,1	170 940	7 032 472
RU0009029524	Сургутнефтегаз, акция прив.	RUB	29,0	63 800	1 852 752
				Итого от продажи акций	21 816 777

Облигации		Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	YTM, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость
ISIN	Эмитент										
RU000A104V75	Почта России, БО-002P-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	9,0%	3,4	1 000	109,8	28,7	1 832	2 064 719
RU000A104IQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13,2%	1,9	1 000	99,8	8,0	2 053	2 065 729
RU000A102763	Группа ЛСР (ПАО), 001P-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,8%	2,2	1 000	94,6	2,0	1 082	1 025 487
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,1%	2,4	1 000	95,5	1,5	2 156	2 061 847
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001P-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	95,9	36,8	2 071	2 062 902
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001P-01	RUB	24.05.2024	8,1%	10,6%	2,7	1 000	98,3	23,1	2 060	2 072 937
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001P-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	99,9	8,9	2 049	2 066 007
RU000A1050H0	ЕАБР, 003P-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,4	1 000	100,0	9,5	2 047	2 066 406
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,2	19,2	2 085	2 066 694
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002P-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12,3%	2,2	1 000	100,9	7,3	1 024	1 040 814
RU000A1053P7	Сережа Групп, 002P-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	10,9%	2,7	1 000	100,3	6,2	2 059	2 077 284
Итого на покупку облигаций											20 670 825

Оценка портфеля после ребалансировки

	Стоимость, руб.	Доля, %
Облигации	33 297 905	81%
Акции	8 001 901	19%
	41 299 806	100%

Параметры по портфелю после ребалансировок

УТМ, %	Дюрация, лет
10,2%	2,0

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.												
RU000A100IH0	Ритейл Бел Финанс, 01	RUB	02.07.2024	11,0%	12,4%	0,9	1 000	99,1	19,5	2 398	2 423 179	6%
RU000A0ZZPZ3	Россельхозбанк, БО-06Р	RUB	14.10.2022	9,0%	8,2%	0,1	1 000	100,1	36,0	2 000	2 073 600	5%
RU000A101H43	Группа компаний Самолет, БО-П08	RUB	28.02.2023	11,0%	10,3%	0,4	1 000	100,4	2,7	1 163	1 171 153	3%
RU000A0JXN21	АФК Система, 001Р-06	RUB	26.03.2027 (05.04.2023)	17,0%	9,1%	0,5	1 000	104,3	74,5	2 405	2 688 357	7%
RU35006HAK0	Республика Хакасия, 35006	RUB	02.11.2023	11,7%	9,3%	0,6	700	101,8	9,0	2 117	1 527 585	4%
RU000A104V75	Почта России, БО-002Р-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	9,0%	3,4	1 000	109,8	28,7	2 075	2 338 587	6%
RU000A104JQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13,2%	1,9	1 000	99,8	8,0	2 326	2 340 421	6%
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001Р-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,8%	2,2	1 000	94,6	2,0	1 226	1 161 966	3%
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,1%	2,4	1 000	95,5	1,5	2 443	2 336 314	6%
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001Р-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	95,9	36,8	2 346	2 336 827	6%
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001Р-01	RUB	24.05.2024	8,1%	10,6%	2,7	1 000	98,3	23,1	2 333	2 347 651	6%
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001Р-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	99,9	8,9	2 321	2 340 264	6%
RU000A1050H0	ЕАБР, 003Р-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,4	1 000	100,0	9,5	2 318	2 339 975	6%
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,2	19,2	2 361	2 340 270	6%
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002Р-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12,3%	2,2	1 000	100,9	7,3	1 160	1 179 047	3%
RU000A1053P7	Сегежа Групп, 002Р-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	10,9%	2,7	1 000	100,3	6,2	2 332	2 352 708	6%
Итого облигации											33 297 905	81%

Акции

ISIN	Эмитент	Валюта	Цена текущая	Количество	Текущая стоимость	Доля в текущем портфеле, %
RU0007661625	Газпром, акция об.	RUB	243,95	8 790	2 144 321	5%
RU0007288411	ГМК Норильский никель, акция об.	RUB	16 244,00	97	1 575 668	4%
RU000A0JKQU8	Магнит, акция об.	RUB	5 433,00	474	2 575 242	6%
RU0009024277	Лукойл, акция об.	RUB	4 410,00	387	1 706 670	4%
Итого акции					8 001 901	19%