Текущая оценка портфеля

Стоимость, руб. Доля, % 69 045 599 100,0% 69 045 599 100% Параметры по портфелю до ребалансировок YTM, % Дюрация, лет 13,8% 1,6

Облигации

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, %
RU000A102GU5	Белуга Групп, БО-ПО4	RUB	05.12.2025	7,4%	9,4%	2,3	1 000	95,5	19	1 475	1 437 181	2,1%
RU000A1026H0	ГИДРОМАШСЕРВИС, БО-03	RUB	20.09.2030 (04.10.2023)	8,0%	9,9%	0,9	1 000	98,4	36	3 000	3 057 960	4,4%
RU000A1026C1	ПИК-Корпорация, 001Р-03	RUB	29.03.2023	7,4%	9,9%	0,5	1 000	98,9	15	5 000	5 020 550	7,3%
RU000A100JH0	Ритейл Бел Финанс, 01	RUB	02.07.2024	11,0%	12,8%	0,9	1 000	98,7	21	689	694 581	1,0%
RU000A100QA0	Группа компаний Самолет, БО-П06	RUB	01.08.2029 (14.08.2023)	9,5%	10,0%	0,8	1 000	99,9	9	1 900	1 914 231	2,8%
RU000A101H43	Группа компаний Самолет, БО-П08	RUB	28.02.2023	11,0%	10,2%	0,4	1 000	100,5	4	3 000	3 025 260	4,4%
RU000A0ZYQY7	АФК Система, 001Р-07	RUB	21.01.2028 (30.07.2025)	6,9%	9,9%	2,4	1 000	93,1	9	214	201 119	0,3%
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,2%	2,4	1 000	95,4	2	24 964	23 873 323	34,6%
RU000A1029P7	ЭР-Телеком Холдинг, ПБО-04	RUB	21.10.2022	7,9%	11,5%	0,1	1 000	99,7	11	5 000	5 039 750	7,3%
RU000A1034Q5	Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т1-6	RUB	Бессрочная (18.11.2026)	17,8%	26,4%		10 000 000	80,4	544 658	1	8 582 658	12,4%
RU000A102879	Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т2-1	RUB	02.04.2031 (08.04.2026)	7,6%	16,6%	2,6	10 000 000	77,8	316 493	2	16 198 986	23,5%
									V	1того облигации	69 045 599	100%

Рекомендации по ребалансировке

Рекомендаци	и по ребалансировке										
ISIN	Эмитент	Валюта	Дата погашения (оферта)	Ставка купона, %	YTM, %	Модиф-ая дюрация	Номинал, руб.	Цена текущая	НКД, руб	Количество	Текущая стоимость в руб.
Продажа											
Облигации											
RU000A1026C1	ПИК-Корпорация, 001Р-03	RUB	29.03.2023	7,4%	9,9%	0,5	1 000	98,9	15,2	5 000	5 020 550
RU000A100JH0	Ритейл Бел Финанс, 01	RUB	02.07.2024	11,0%	15,7%	1,2	1 000	95,7	20,7	689	694 581
RU000A100QA0	Группа компаний Самолет, БО-ПО6	RUB	01.08.2029 (14.08.2023)	9,5%	9,3%	0,8	1 000	100,5	8,6	1 900	1 924 871
RU000A101H43	Группа компаний Самолет, БО-П08	RUB	28.02.2023	11,0%	10,2%	0,4	1 000	100,5	3,9	3 000	3 025 260
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,2%	2,4	1 000	95,4	2,4	14 507	13 873 323
RU000A1029P7	ЭР-Телеком Холдинг, ПБО-04	RUB	21.10.2022	7,9%	11,5%	0,1	1 000	99,7	11,3	5 000	5 039 750
									Из	ого от продажи	29 578 335
Покупка											
Облигации RU000A104V75	Почта России, БО-002Р-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	9,0%	3,4	1 000	109,7	30,0	5 956	6 714 080
RU000A104JQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13,2%	1,9	1 000	99,9	9,4	6 668	6 722 611
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001Р-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,4%	2,2	1 000	95,5	2,9	3 511	3 362 660
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001Р-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	96,1	37,7	6 733	6 723 304
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001Р-01	RUB	24.05.2024	8,1%	9,3%	1,4	1 000	98,5	24,0	6 687	6 744 976
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001Р-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	100,0	9,9	6 660	6 723 536
RU000A1050H0	ЕАБР, 003Р-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,3	1 000	99,8	10,5	6 669	6 725 020
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,1	20,1	6 791	6 730 764
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002Р-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12,1%	2,2	1 000	101,3	8,7	3 319	3 392 184
RU000A1053P7	Сегежа Групп, 002P-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	10,8%	2,6	1 000	100,7	7,4	6 674	6 768 504
									и	того на покупку	60 607 639

Оценка портфеля после ребалансировки		
оценка портфели после резалансировки	Стоимость, руб.	Доля, %
Облигации	100 066 403	100,0%
	100 066 403	100%

Параметры по портфелю

YTM, % Дюрация, лет
12,6% 2,2

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, %
RU000A102GU5	Белуга Групп, БО-ПО4	RUB	05.12.2025	7,4%	9,4%	2,3	1 000	95,5	18,9	1 475	1 436 871	1,4%
RU000A1026H0	гидромашсервис, бо-03	RUB	20.09.2030 (04.10.2023)	8,0%	9,9%	0,9	1 000	98,4	35,5	3 000	3 057 300	3,1%
RU000A0ZYQY7	АФК Система, 001Р-07	RUB	21.01.2028 (30.07.2025)	6,9%	9,9%	2,4	1 000	93,1	8,3	214	201 079	0,2%
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,2%	2,4	1 000	95,4	2,2	10 457	9 997 699	10,0%
RU000A1034Q5	Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т1-6	RUB	Бессрочная (18.11.2026)	17,8%	26,4%		10 000 000	80,4	544 658	1	8 582 658	8,6%
RU000A102879	Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т2-1	RUB	02.04.2031 (08.04.2026)	7,6%	16,6%	2,6	10 000 000	77,8	316 493	2	16 198 986	16,2%
RU000A104V75	Почта России, БО-002Р-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	9,0%	3,4	1 000	109,7	29,7	5 956	6 712 233	6,7%
RU000A104JQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13,2%	1,9	1 000	99,9	9,1	6 668	6 720 344	6,7%
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001Р-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,4%	2,2	1 000	95,5	2,6	3 511	3 361 888	3,4%
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001Р-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	96,1	37,4	6 733	6 721 823	6,7%
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001Р-01	RUB	24.05.2024	8,1%	9,3%	1,4	1 000	98,5	23,8	6 687	6 743 505	6,7%
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001Р-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	100,0	9,7	6 660	6 721 805	6,7%
RU000A1050H0	ЕАБР, 003Р-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,3	1 000	99,8	10,3	6 669	6 723 352	6,7%
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,1	19,9	6 791	6 729 202	6,7%
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002Р-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12,1%	2,2	1 000	101,3	8,3	3 319	3 391 089	3,4%
RU000A1053P7	Сегежа Групп, 002P-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	10,8%	2,6	1 000	100,7	7,1	6 674	6 766 568	6,8%

Итого облигации 100 066 403