## Текущая оценка портфеля

Облигации

RU000A1029P7

RU000A1034Q5

RU000A102879

мость, руб. 69 045 599 **69 045 599** Доля, %

RUB

RUB

RUB

21.10.2022

Бессрочная (18.11.2026) 02.04.2031

(08.04.2026

7,9%

17,8%

7.6%

Параметры по портфелю тансировок YTM, % Дюрация, лет 12.8% 1,6

ЭР-Телеком Холдинг, ПБО-04

Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т1-6

Банк ВТБ (ПАО), СУБ-Т2-1

Облигации Текущая стоимость Доля в текущег Дата погашения Ставка купона, % Модиф-ая Цена Номинал YTM, % нкд, руб ISIN Эмитент Валюта Количество руб. 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% 20.09.2030 RU000A1026H0 ГИЛРОМАШСЕРВИС БО-03 RUB 8.0% 9.9% 0.9 1 000 98.4 36 3 000 3 057 960 4.4% (04.10.2023) 5 020 550 RU000A1026C1 ПИК-Корпорация, 001Р-03 RUB 29.03.2023 7,4% 9,9% 0,5 1 000 15 5 000 7,3% 98,9 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% 01.08.2029 RU000A100QA0 Группа компаний Самолет, БО-ПО6 RUB 9,5% 10,0% 0,8 1 000 99,9 1 900 1 914 231 2,8% (14.08.2023) RU000A101H43 Группа компаний Самолет, БО-ПО8 28.02.2023 11,0% 3 025 260 4,4% RUB 10,2% 0,4 1 000 100,5 3 000 21.01.2028 (30.07.2025) RU000A0ZYQY7 АФК Система, 001Р-07 RUB 6,9% 9,9% 2,4 1 000 93,1 9 214 201 119 0,3% RU000A1032P1 СФО ВТБ РКС-1. 01 RUB 8.0% 10.2% 2,4 1 000 95.4 2 24 964 23 873 323 34,6% 01.12.2030

11,5%

26,4%

16.6%

0,1

2.6

1 000

10 000 000

10 000 000

99,7

80,4

77.8

11

544 658

316 493

5 000

1

16 198 986 69 045 599

5 039 750

8 582 658

7,3%

12,4%

23.5%

	и по ребалансировке		Дата погашения			Модиф-ая	Номинал,	Цена			Текущая стоимост
ISIN	Эмитент	Валюта	(оферта)	Ставка купона, %	YTM, %	дюрация	руб.	текущая	нкд, руб	Количество	в руб.
Продажа											
Облигации											
RU000A1026C1	ПИК-Корпорация, 001Р-03	RUB	29.03.2023	7,4%	10%	0,5	1 000	98,9	15,2	5 000	5 020 550
RU000A100JH0	Ритейл Бел Финанс, 01	RUB	02.07.2024	11,0%	16%	1,2	1 000	95,7	20,7	689	694 581
RU000A100QA0	Группа компаний Самолет, БО-П06	RUB	01.08.2029 (14.08.2023)	9,5%	9%	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%	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	15 551	14 871 252
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
									Ит	ого от продажи	30 576 264
Покупка											
Облигации			26.05.2032								
RU000A104V75	Почта России, БО-002Р-01	RUB	(07.06.2027)	11,4%	9%	3,4	1 000	109,7	30,0	5 070	5 715 310
RU000A104JQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13%	1,9	1 000	99,9	9,4	5 676	5 722 486
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001Р-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10%	2,2	1 000	95,5	2,9	2 989	2 862 715
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001Р-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9%	3,1	1 000	96,1	37,7	5 732	5 723 746
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001Р-01	RUB	24.05.2024	8,1%	9%	1,4	1 000	98,5	24,0	5 693	5 742 358
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001Р-02	RUB	01.08.2025	9,6%	10%	2,3	1 000	100,0	9,9	5 670	5 724 092
RU000A1050H0	EA5P, 003P-001	RUB	29.07.2025	9,4%	10%	2,3	1 000	99,8	10,5	5 677	5 724 687
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	10%	2,9	1 000	97,1	20,1	5 781	5 729 723
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002Р-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12%	2,2	1 000	101,3	8,7	2 826	2 888 313
RU000A1053P7	Сегежа Групп, 002P-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	11%	2,6	1 000	100,7	7,4	5 681	5 761 443
			, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,							того на покупку	51 594 872

Оценка портфеля после ребалансировки

	Стоимость, руб.	Доля, %
Облигации	90 058 290	100,0%
	00.056.300	100%

Параметры по портфелю

YTM, % Дюрация, лет
12,9% 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-П04	RUB	05.12.2025	7,4%	9,4%	2,3	1 000	95,5	18,9	1 475	1 436 871	1,6%
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	3,4%
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	9 413	9 000 000	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	9,5%
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	18,0%
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	5 070	5 713 738	6,3%
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	5 676	5 720 557	6,4%
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001Р-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,4%	2,2	1 000	95,5	2,6	2 989	2 862 057	3,2%
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001Р-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	96,1	37,4	5 732	5 722 485	6,4%
RU000A1035D0	Синара-Транспортные Машины, 001Р-01	RUB	24.05.2024	8,1%	9,3%	1,4	1 000	98,5	23,8	5 693	5 741 106	6,4%
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001Р-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	100,0	9,7	5 670	5 722 618	6,4%
RU000A1050H0	ЕАБР, 003Р-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,3	1 000	99,8	10,3	5 677	5 723 268	6,4%
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,1	19,9	5 781	5 728 393	6,4%
RU000A1053A9	Сэтл Групп, 002Р-01	RUB	13.08.2025	12,2%	12,1%	2,2	1 000	101,3	8,3	2 826	2 887 381	3,2%
RU000A1053P7	Сегежа Групп, 002P-05R	RUB	30.07.2037 (17.02.2026)	10,8%	10,8%	2,6	1 000	100,7	7,1	5 681	5 759 795	6,4%

Итого облигации 90 058 290