

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%	9,2%	1,0	1 000	97,8	22,8	9 543	9 554 642	17%
RU000AOZSE2S	Газпром, БО-22	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	8,3%	2,4	1 000	99,8	10,0	1 979	1 995 604	4%
RU000AOZSEZ0	Газпром, БО-23	RUB	23.06.2048 (29.07.2025)	8,1%	8,4%	2,4	1 000	99,7	10,0	494	497 651	1%
RU000A101137	Газпром нефть, 003P-01R	RUB	05.11.2024	6,9%	8,4%	1,9	1 000	97,4	5,8	3 800	3 722 556	7%
RU000A100RG5	ЕвроХим, БО-001P-06	RUB	18.08.2023	7,9%	8,3%	0,8	1 000	99,8	4,5	10 000	10 029 200	18%
RU000A101012	АФК Система, 001P-12	RUB	23.10.2029 (01.11.2024)	7,9%	10,1%	1,8	1 000	96,2	27,7	10 000	9 898 400	18%
RU000A101QF7	Ритейл Бел Финанс, 001P-01	RUB	28.05.2025	9,5%	13,0%	1,6	1 000	95,0	2,3	4 996	4 755 343	9%
RU000A101SM9	КАМАЗ, БО-П07	RUB	07.06.2023	6,7%	9,1%	0,7	1 000	98,5	0,4	2 997	2 954 053	5%
RU000A101FH6	МТС, 001P-14	RUB	11.02.2027	6,6%	9,0%	3,5	1 000	92,2	3,8	3 000	2 778 600	5%
RU000A1013P1	ВЭБ.РФ, ЛБО-001P-18	RUB	17.11.2026	7,3%	9,1%	3,3	1 000	94,3	21,5	3 000	2 893 530	5%
RU000A0JXPD9	ТМК, БО-06	RUB	13.04.2027 (24.04.2023)	8,3%	10,4%	0,5	1 000	98,9	32,3	3 000	3 063 960	6%
RU000A100928	ОКЕЙ, 001P-02	RUB	06.04.2029 (16.04.2025)	9,9%	10,1%	2,1	1 000	100,4	15,2	2 979	3 034 975	6%
Итого облигации											55 178 514	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	6 252	6 276 320
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
RU000A101SM9	КАМАЗ, БО-П07	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	33 243 890
Покупка											
Облигации											
RU000A104ZC9	КАМАЗ, БО-П10	RUB	18.07.2025 (24.07.2024)	10,8%	8,9%	1,6	1 000	103,7	14,5	2 440	2 564 684
RU000A103SD0	Синара-Транспортные Машины, 001P-01	RUB	24.05.2024	8,1%	9,6%	1,5	1 000	98,0	23,3	2 540	2 549 398
RU000A1051U1	МТС-Банк, 001P-02	RUB	01.08.2025	9,6%	9,9%	2,3	1 000	100,0	9,2	2 510	2 531 737
RU000A1050H0	ЕАБР, 003P-001	RUB	29.07.2025	9,4%	9,6%	2,3	1 000	99,9	9,7	2 520	2 541 244
RU000A101GZ6	Уралкалий, ПБО-06-P	RUB	25.02.2025	6,9%	8,6%	2,1	1 000	96,5	1,9	2 640	2 552 299
RU000A1032P1	СФО ВТБ РКС-1, 01	RUB	01.12.2030	8,0%	10,6%	2,7	1 000	95,6	1,8	2 650	2 537 457
RU000A104V75	Почта России, БО-002P-01	RUB	26.05.2032 (07.06.2027)	11,4%	9,0%	3,4	1 000	109,8	29,1	2 250	2 536 313
RU000A103943	Аэрофлот, П01-БО-01	RUB	11.06.2026	8,4%	9,6%	2,9	1 000	97,2	19,5	2 570	2 547 770
RU000A104Y15	Белуга Групп, БО-П05	RUB	06.07.2027	10,9%	9,9%	3,3	1 000	104,3	17,5	2 420	2 566 991
RU000A103QK3	Мэйл.Ру Финанс, 001P-01	RUB	15.09.2026	7,9%	9,3%	3,1	1 000	96,1	37,0	2 550	2 543 906
RU000A104JQ3	Группа компаний Самолет, БО-П11	RUB	08.02.2028 (14.02.2025)	12,7%	13,2%	1,9	1 000	99,8	8,4	1 270	1 278 065
RU000A102T63	Группа ЛСР (ПАО), 001P-06	RUB	24.02.2026	8,0%	10,5%	2,2	1 000	95,1	2,2	1 340	1 277 141
Фонды											
RU000A1002S8	БПИФ WIMB - Фонд рос. корп. облигаций	RUB			10,1%	1,6		131,3		36 322	4 767 615
										Итого на покупку	32 794 617

