



Общество с ограниченной ответственностью "Управляющая компания "Альфа-Капитал"

123001, Россия, г. Москва, ул. Садовая-Кудринская, дом 32, строение 1

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам на 01.02.2025 0:00

Инвестор: СОЮЗ "СРО АУ "СТРАТЕГИЯ"

Договор: 622581/ДУ-ЮЛ-2021 (СОЮЗ "СРО АУ «СТРАТЕГИЯ») от 01.11.2021

Альфа-Капитал

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	Эффективная доходность к погашению
26221RMFS ФФЗ 26221 ПД обл	RU000A0JXFM1	Облигация	3 415,	2 204 484,95	-1 688 116,12		31.01.2025	620,39	2 118 631,85		23.03.2033	16,93%	
26221RMFS ФФЗ 26221 ПД обл. НКД	RU000A0JXFM1	Купон	-	64 816,70	64 816,70			25,52	87 150,80		02.04.2025	-	
26236RMFS ФФЗ-ПД236	RU000A102BT8	Облигация	4 908,	3 587 551,68	-992 628,66		31.01.2025	731,73	3 591 330,84		17.05.2028	17,28%	
26236RMFS ФФЗ-ПД236; НКД	RU000A102BT8	Купон	-	31 411,20	31 411,20			11,24	55 165,92		21.05.2025	-	
26244RMFS ФФЗ-ПД244	RU000A1074G2	Облигация	750,	599 137,50	-127 823,02		31.01.2025	775,04	581 280,00		15.03.2034	16,66%	
26244RMFS ФФЗ-ПД244; НКД	RU000A1074G2	Купон	-	22 425,00	22 425,00			39,45	29 587,50		26.03.2025	-	
29013RMFS ФФЗ-ПК013	RU000A101KT1	Облигация	2 500,	2 397 575,00	-29 774,42		31.01.2025	969,07	2 422 675,00		18.09.2030	1,09%	
29013RMFS ФФЗ-ПК013; НКД	RU000A101KT1	Купон	-	8 600,00	8 600,00			20,99	52 475,00		26.03.2025	-	
29015RMFS ФФЗ-ПК015	RU000A1025A7	Облигация	3 450,	3 380 896,50	-49 432,29		31.01.2025	987,5	3 406 875,00		18.10.2028	1,63%	
29015RMFS ФФЗ-ПК015; НКД	RU000A1025A7	Купон	-	-	-			5,17	17 836,50		23.04.2025	-	
29019RMFS ФФЗ-ПК019	RU000A102A49	Облигация	800,	781 144,00	-12 694,08		31.01.2025	986,93	789 544,00		18.07.2029	22,64%	
29019RMFS ФФЗ-ПК019; НКД	RU000A102A49	Купон	-	-	-			5,17	4 136,00		23.04.2025	-	
29020RMFS ФФЗ-ПК020	RU000A102BV4	Облигация	29 600,	29 008 000,00	-413 971,73		31.01.2025	988,12	29 248 352,00		22.09.2027	21,94%	
29020RMFS ФФЗ-ПК020; НКД	RU000A102BV4	Купон	-	101 824,00	101 824,00			20,99	621 304,00		26.03.2025	-	
29021RMFS ФФЗ-ПК021	RU000A105B11	Облигация	22 000,	21 414 360,00	-64 081,60		31.01.2025	975,15	21 453 300,00		27.11.2030	0,69%	
29021RMFS ФФЗ-ПК021; НКД	RU000A105B11	Купон	-	344 080,00	344 080,00			33,19	730 180,00		05.03.2025	-	
<b>Всего по Минфин России</b>			<b>63 946 306,53</b>			<b>85,72%</b>			<b>65 209 824,41</b>	<b>85,77%</b>		<b>12,38%</b>	
<b>по всем федеральным облигациям</b>			<b>63 946 306,53</b>			<b>85,72%</b>			<b>65 209 824,41</b>	<b>85,77%</b>		<b>12,38%</b>	
4B02-02-40155-F-001P ГМК Норильский никель о6602	RU000A105A61	Облигация	1 284,	1 198 228,80	-615,84		31.01.2025	926,4	1 189 497,60		05.10.2027	3,64%	
4B02-02-40155-F-001P ГМК Норильский никель о6602; НКД	RU000A105A61	Купон	-	28 812,96	28 812,96			30,72	39 444,48		08.04.2025	-	
<b>Всего по ПАО "ГМК "Норильский никель"</b>			<b>1 227 041,76</b>			<b>1,64%</b>			<b>1 228 942,08</b>	<b>1,62%</b>		<b>3,64%</b>	
4B02-06-16419-A-001P ЛК Европлан о66П06	RU000A106F40	Облигация	1 100,	1 060 510,00	16 296,83		31.01.2025	970,	1 067 000,00		24.06.2025	19,55%	
4B02-06-16419-A-001P ЛК Европлан о66П06; НКД	RU000A106F40	Купон	-	2 167,00	2 167,00			10,67	11 737,00		25.03.2025	-	
<b>Всего по ПАО "ЛК "Европлан"</b>			<b>1 062 677,00</b>			<b>1,42%</b>			<b>1 078 737,00</b>	<b>1,42%</b>		<b>19,55%</b>	
4B02-05-55038-E-002P РусГидро о66П05	RU000A10AEV8	Облигация	2 600,	2 611 183,12	-		31.01.2025	1 012,4	2 632 240,00		09.12.2026	-0,07%	
4B02-05-55038-E-002P РусГидро о66П05; НКД	RU000A10AEV8	Купон	-	-	-			8,46	21 996,00		17.02.2025	-	
<b>Всего по ПАО "РусГидро"</b>			<b>2 611 183,12</b>			<b>3,50%</b>			<b>2 654 236,00</b>	<b>3,49%</b>		<b>-0,07%</b>	
4B02-01-55194-E-002P Трансконтейнер о66П01	RU000A109E71	Облигация	3 000,	2 933 400,00	-61 498,20		31.01.2025	978,9	2 930 700,00		20.08.2027	1,71%	
4B02-01-55194-E-002P Трансконтейнер о66П01; НКД	RU000A109E71	Купон	-	-	-			18,08	54 240,00		01.02.2025	-	
<b>Всего по ПАО "Трансконтейнер"</b>			<b>2 933 400,00</b>			<b>3,93%</b>			<b>2 984 940,00</b>	<b>3,93%</b>		<b>1,71%</b>	
<b>по всем облигациям предприятий и организаций</b>			<b>7 834 301,88</b>			<b>10,50%</b>			<b>7 948 855,08</b>	<b>10,45%</b>		<b>3,84%</b>	
Деньги у брокера или оператора инвестиционной платформы, р/с 30601810000119918267 (RUB)		Деньги	378 055,8	378 055,80					378 055,80	0,50%			
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>			<b>378 055,80</b>			<b>0,51%</b>			<b>378 055,80</b>	<b>0,50%</b>			
<b>по всем денежным средствам у брокера</b>			<b>378 055,80</b>			<b>0,51%</b>			<b>378 055,80</b>	<b>0,50%</b>			
Банк ВТБ (ПАО); договор №9 от 02.12.2024 (RUB)		Депозиты	2 830 000,	2 879 331,69	49 331,69				2 932 210,05		03.02.2025		
<b>Всего по Банк ВТБ (ПАО)</b>			<b>2 879 331,69</b>			<b>3,86%</b>			<b>2 932 210,05</b>	<b>3,86%</b>			
<b>по всем депозитам</b>			<b>2 879 331,69</b>			<b>3,86%</b>			<b>2 932 210,05</b>	<b>3,86%</b>			
р/с 40701810101850002357 (RUB) в АО "Альфа-Банк"		Деньги	6 451,6	6 451,60					6 451,60	0,01%			
<b>Всего по АО "АЛЬФА-БАНК"</b>			<b>6 451,60</b>			<b>0,01%</b>			<b>6 451,60</b>	<b>0,01%</b>			
Расчеты со специализированным депозитарием АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ» (RUB); договор EB637765_10044PAY от 27.07.2020 АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»		Расчеты	-4 874,89	-4 874,89					-4 874,89				
<b>Всего по АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»</b>			<b>-4 874,89</b>			<b>-0,01%</b>			<b>-4 874,89</b>	<b>-0,01%</b>			
Расчеты с управляющей компанией ООО УК "Альфа-Капитал" (RUB) ООО УК "Альфа-Капитал"		Расчеты	-441 606,83	-441 606,83					-441 606,83				
<b>Всего по ООО УК "Альфа-Капитал"</b>			<b>-441 606,83</b>			<b>-0,59%</b>			<b>-441 606,83</b>	<b>-0,58%</b>			
<b>по всем прочим вложениям</b>			<b>-440 030,12</b>			<b>-0,59%</b>			<b>-440 030,12</b>	<b>-0,58%</b>			
<b>ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:</b>			<b>74 597 965,78</b>			<b>100,00%</b>			<b>76 026 915,22</b>	<b>100,00%</b>			

Балансовая стоимость по всем вложениям с учетом забалансовых обязательств: 74 597 965,78

М.П.

ПРЕЗИДЕНТ СОЮЗА СРО АУ СТРАТЕГИЯ  
ФЕОФАНОВА У В

