

Отчет №2 "Портфель"

По состоянию на: 16.07.2024

Клиент: АССОЦИАЦИЯ "САМОРЕГУЛИРУЕМАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ АРБИТРАЖНЫХ УПРАВЛЯЮЩИХ "ЮЖНЫЙ УРАЛ"

Ценная бумага	Кол-во	Бал. ст-сть (руб.)	Оцен ст-сть (руб.)	Купон по баланс. ст-сти (руб.)	Купон по оцен. ст-сти (руб.)	% к стоим. активов	Цена (руб.)
<b>Облигации оценившиеся</b>							
Облигации МИНФИН РОССИИ №26207RMFS	5 780	5 329 160,00	4 814 740,00	185 827,00	206 519,40	10,08	922,00
Облигации МИНФИН РОССИИ №26219RMFS	3 400	3 123 614,00	2 881 772,00	73 644,00	85 170,00	5,96	918,71
Облигации МИНФИН РОССИИ №26225RMFS	3 500	2 621 500,00	2 088 870,00	27 125,00	38 220,00	4,27	749,00
Облигации МИНФИН РОССИИ №26227RMFS	8 110	7 929 958,00	8 107 810,30	271 279,50	297 637,00	16,88	977,80
Облигации МИНФИН РОССИИ №26230RMFS	3 290	2 384 493,30	1 845 722,90	61 062,40	72 182,60	3,85	724,77
Облигации МИНФИН РОССИИ №26236RMFS	3 694	2 970 197,64	2 621 668,74	22 496,46	31 731,46	5,33	804,06
Облигации МИНФИН РОССИИ №26241RMFS	2 000	1 772 560,00	1 442 980,00	16 660,00	24 980,00	2,95	886,28
Облигации МИНФИН РОССИИ №26242RMFS	3 500	3 155 320,00	2 674 735,00	100 100,00	113 925,00	5,60	901,52
Облигации МИНФИН РОССИИ №29006RMFS	7 050	7 079 962,50	7 022 505,00	424 621,50	469 671,00	15,05	1 004,25
<b>Итого:</b>		<b>36 366 765,44</b>	<b>33 500 803,94</b>	<b>1 182 815,86</b>	<b>1 340 036,46</b>	<b>69,96</b>	

Остаток денежных средств на бирже	Сумма (руб.)	Сумма (руб.)
SRO 30411810300022005642 ООО ИК Гелиус Капитал	34 376,84	34 376,84

0,07

Деньги на р/с	Сумма (руб.)	Сумма (руб.)
SRO Банк ГПБ АО 40701810800000003076	15 159 013,60	15 159 013,60

29,84

Денежные средства в депозитах	Сумма (руб.)	Сумма (руб.)
Дебиторская задолженность	63 898,79	63 898,79
Кредиторская задолженность	-	-

0,13

НКД всего	1 182 815,86	1 340 036,46
-----------	--------------	--------------

Итого стоимость активов	52 506 870,53	49 798 129,63
Итого стоимость активов на предыдущий рабочий день	52 502 498,94	49 854 202,76
Относительное изменение итоговой стоимости в процентах	0,01	-0,11

Переоценка на конец отчетного месяца	-2 865 961,50
--------------------------------------	---------------

Итого ст-сть активов с учетом переоценки	50 098 129,63
--	---------------

100,00

**Дебиторы и кредиторы**

Дебиторы		Сумма (баланс) (руб.)	Сумма (рынок) (руб.)
<b>Контрагент</b>	<b>Описание</b>		
ИК ГЕЛИУС КАПИТАЛ	Расчеты по продаже ц/б	2 696,60	2 696,60
АССОЦИАЦИЯ "СРО АУ "ЮЖНЫЙ УРАЛ" (40701810800000003076)	Проценты к получению по банковским счетам	61 202,19	61 202,19
		<b>63 898,79</b>	<b>63 898,79</b>

**Кредиторы**

к договору №Д(ДУ)-001-16032022 от 16.03.2022

Цена оценочная (руб.)	Переоценка ц/б (руб.)	Тип ц/б	Гос. регистр. номер ц/б	Графа котировки	Дата котировки	Котир. лист	Срок до погашения (тело)	Срок до погашения (купон)
833,00	-514 420,00	Гос. ц/б РФ	26207RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	от 1 до 5 (03.02.27)	< 1 года (07.08.24)
847,58	-241 842,00	Гос. ц/б РФ	26219RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	от 1 до 5 (16.09.26)	< 1 года (18.09.24)
596,82	-532 630,00	Гос. ц/б РФ	26225RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	> 5лет (10.05.34)	< 1 года (20.11.24)
999,73	177 852,30	Гос. ц/б РФ	26227RMFS	99,973	16.07.2024	1	от 1 до 5 (17.07.24)	< 1 года (17.07.24)
561,01	-538 770,40	Гос. ц/б РФ	26230RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	> 5лет (16.03.39)	< 1 года (02.10.24)
709,71	-348 528,90	Гос. ц/б РФ	26236RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	от 1 до 5 (17.05.28)	< 1 года (20.11.24)
721,49	-329 580,00	Гос. ц/б РФ	26241RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	> 5лет (17.11.32)	< 1 года (27.11.24)
764,21	-480 585,00	Гос. ц/б РФ	26242RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	> 5лет (29.08.29)	< 1 года ( )
996,10	-57 457,50	Гос. ц/б РФ	29006RMFS	ЦенаСпроса	16.07.2024	1	от 1 до 5 (29.01.25)	< 1 года (31.07.24)
	<b>-2 865 961,50</b>							

Приложение № 5

: доверительного управления ценными бумагами и средствами инвестирования в ценные бумаги  
 Ассоциация «СРО АУ «Южный Урал»

Наименование эмитента	ИНН Эмитента	Биржа	ISIN
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A0JS3W6
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A0JWM07
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A0ZYUB7
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A1007F4
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A100EF5
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A102BT8
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A105FZ9
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A105RV3
МИНФИН РОССИИ	7710168360	ММВБ	RU000A0JV4L2

Контрагент	Описание	Сумма (баланс) (руб.)	Сумма (рынок) (руб.)
		-	-

Компания:

ФИО \_\_\_\_\_  
Должность \_\_\_\_\_

Подпись \_\_\_\_\_

ФИО \_\_\_\_\_  
Должность \_\_\_\_\_

Подпись \_\_\_\_\_