

ОТЧЕТ О ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ДОВЕРИТЕЛЬНОГО УПРАВЛЯЮЩЕГО ЗА ПЕРИОД С 01.05.2023 ПО 31.05.2023

Клиент: АССОЦИАЦИЯ "САМОРЕГУЛИРУЕМАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ
АРБИТРАЖНЫХ УПРАВЛЯЮЩИХ "ЮЖНЫЙ УРАЛ"
Счет клиента: Ассоциация «СРО АУ «Южный Урал» (компенсационный фонд)
Договор №: Д(ДУ)-001-16032022 от 16.03.2022

Исполнитель: Андреева Екатерина
Телефон для справок: (3519) 25-60-26
Факс: (3519) 25-60-20

I. Расчет Прироста Рыночной стоимости активов за отчетный период

Показатели	Стоимость, руб
Рыночная стоимость активов на начало отчетного периода	51 206 476,86
Рыночная стоимость активов на конец отчетного периода	51 450 000,49
Балансовая стоимость активов на начало отчетного периода	51 450 293,14
Балансовая стоимость активов на конец отчетного периода	51 783 728,14
Стоимость переданных в управление Активов на начало отчетного периода	47 355 724,95
Стоимость переданных в управление Активов на конец отчетного периода	47 355 724,95
Вложения в отчетном периоде	-
Изъятия в отчетном периоде	-
Прирост рыночной стоимости за период	243 523,63

II. Оценка портфеля (позиции)

Информация, содержащаяся в настоящем разделе, не является официальной оценкой Активов, выпиской со счета депо и счета расчетов по денежным средствам для бухгалтерского учета клиента

ДЕНЕЖНЫЕ СРЕДСТВА	Сумма, руб	Текущие данные, руб
Денежные средства на текущих счетах	114 186,02	114 186,02
Денежные средства в пути	-	-
Денежные средства на депозитных счетах	-	-
Денежные средства на брокерских счетах	371 351,97	371 351,97
В том числе Гарантийное обеспечение	-	-
Дебиторская задолженность	-	-
Кредиторская задолженность	-	-
ИТОГО ДЕНЕЖНЫЕ СРЕДСТВА:	485 537,99	485 537,99

ЦЕННЫЕ БУМАГИ

АКЦИИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Балансовые данные, руб		Текущие данные, руб	
			Балансовая цена	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-
Итого:						

ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ПАИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Балансовые данные, руб		Текущие данные, руб	
			Балансовая цена	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-
Итого:						

ИПОТЕЧНЫЕ СЕРТИФИКАТЫ УЧАСТИЯ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Балансовые данные, руб		Текущие данные, руб	
			Балансовая цена	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-
Итого:						

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Номинал	Балансовые данные, руб.			Текущие данные, руб.		
				Балансовая цена	Накопленный купонный доход	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Накопленный купонный доход	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Итого:									

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ОБЛИГАЦИИ СУБЪЕКТОВ РФ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Номинал	Балансовые данные, руб.			Текущие данные, руб.		
				Цена приобретения	Накопленный купонный доход	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Накопленный купонный доход	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Итого:									

МУНИЦИПАЛЬНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Номинал	Балансовые данные, руб.			Текущие данные, руб.		
				Цена приобретения	Накопленный купонный доход	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Накопленный купонный доход	Рыночная стоимость
	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Итого:									

ФЕДЕРАЛЬНЫЕ ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос регистрации	Количество (шт.)	Номинал	Балансовые данные, руб.			Текущие данные, руб.		
				Цена приобретения	Накопленный купонный доход	Балансовая стоимость	Рыночная цена	Накопленный купонный доход	Рыночная стоимость
МИНФИН РОССИИ 26207RMFS	26207RMFS	5 500	1 000	990,01	137 555,00	5 445 055,00	985,84	137 555,00	5 422 120,00
МИНФИН РОССИИ 26212RMFS	26212RMFS	3 000	1 000	924,20	72 990,00	2 772 600,00	923,00	72 990,00	2 769 000,00
МИНФИН РОССИИ 26215RMFS	26215RMFS	3 085	1 000	1 002,41	62 101,05	3 092 434,85	998,99	62 101,05	3 081 884,15

МИНФИН РОССИИ 26219RMFS	26219RMFS	3 400	1 000	977,14	50 524,00	3 322 292,73	981,99	50 524,00	3 338 766,00
МИНФИН РОССИИ 26222RMFS	26222RMFS	5 830	1 000	993,34	47 631,10	5 791 155,83	991,91	47 631,10	5 782 835,30
МИНФИН РОССИИ 26223RMFS	26223RMFS	600	1 000	994,39	9 726,00	596 834,00	993,78	9 726,00	596 268,00
МИНФИН РОССИИ 26225RMFS	26225RMFS	3 500	1 000	821,54	4 865,00	2 875 390,00	798,61	4 865,00	2 795 135,00
МИНФИН РОССИИ 26227RMFS	26227RMFS	8 110	1 000	998,43	218 726,70	8 097 299,14	996,01	218 726,70	8 077 641,10
МИНФИН РОССИИ 26229RMFS	26229RMFS	3 800	1 000	973,26	10 412,00	3 698 399,77	974,66	10 412,00	3 703 708,00
МИНФИН РОССИИ 26230RMFS	26230RMFS	3 290	1 000	821,24	38 854,90	2 701 879,60	789,57	38 854,90	2 597 685,30
МИНФИН РОССИИ 26236RMFS	26236RMFS	4 030	1 000	853,14	4 392,70	3 438 154,20	854,74	4 392,70	3 444 602,20
МИНФИН РОССИИ 26242RMFS	26242RMFS	1 400	1 000	981,41	43 498,00	1 373 975,58	964,00	43 498,00	1 349 600,00
МИНФИН РОССИИ 29006RMFS	29006RMFS	7 050	1 000	1 020,00	200 643,00	7 191 000,00	1 007,56	200 643,00	7 103 298,00
Итого:					901 919,45	50 396 270,70		901 919,45	50 062 543,05

ДЕПОЗИТАРНЫЕ РАСПИСКИ

Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш, серия ЦБ	№ гос. регистрации	Количество (шт.)	Балансовые данные, руб		Текущие данные, руб	
			Цена приобретения	Стоимость приобретения	Рыночная цена	Рыночная стоимость
Итого:						

ВСЕГО ЦЕННЫЕ БУМАГИ	Балансовая стоимость с учетом НКД, руб	Рыночная стоимость с учетом НКД, руб
Итого:	51 298 190,15	50 964 462,50

СРОЧНЫЕ ДОГОВОРЫ (КОНТРАКТЫ):

Наименование договора (контракта)	Код	Количество (шт.)
Итого:		

Премии по опционам

Премия по внебиржевым опционам	Код	Количество (шт.)	Премия (баланс.)	Премия (оцен.)
Итого:				

III. Сделки за период

Информация, содержащаяся в настоящем разделе, не является подтверждением перехода прав собственности на ценные бумаги для целей бухгалтерского учета.

Дата и время заключения сделки	ISIN	Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш ЦБ, № гос. регистрации	Номинал ценной бумаги	Тип сделки	Контрагент (если известен), или наименование организатора торгов	Количество (шт.)	Цена за ед.	Биржевой сбор	Комиссия брокера	НКД	Сумма сделки (всего)	Валюта	НКД в рублях на дату принятия к учету	Сумма сделки в рублях на дату принятия к учету	Дата поставки	Дата оплаты	Ставка репо/цена 1 ЦБ по 1-ой части репо и цена 1 ЦБ по 2-ой
Биржевые сделки (безадресные)																	
Завершенные сделки																	
08.05.2023 10:47:02	RU000A0JXOF2	МИНФИН РОССИИ 26222RMFS	1 000	Купля	ММВБ	139,000	994,00	20,73	82,90	567,12	138 836,75 RUB		567,12	138 166,00	10.05.23	10.05.23	-
08.05.2023 10:58:17	RU000A0JXOF2	МИНФИН РОССИИ 26222RMFS	1 000	Купля	ММВБ	11,000	994,00	1,64	6,56	44,88	10 987,08 RUB		44,88	10 934,00	10.05.23	10.05.23	-
25.05.2023 14:11:15	RU000A1007F4	МИНФИН РОССИИ 26227RMFS	1 000	Купля	ММВБ	200,000	996,26	29,89	119,55	5 190,00	204 591,44 RUB		5 190,00	199 252,00	26.05.23	26.05.23	-
Незавершенные сделки																	
Завершенные Биржевые сделки в режиме переговорных сделок																	
Незавершенные Биржевые сделки в режиме переговорных сделок																	
Завершенные внебиржевые сделки																	
Незавершенные внебиржевые сделки																	
Завершенные Сделки РЕПО																	
Незавершенные Сделки РЕПО																	
Срочные сделки																	
Дата и время заключения сделки	ISIN	Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш ЦБ, № гос. регистрации	Тип сделки	Контрагент (если известен)	Количество (шт.)	Цена срочного контракта	Размер премии по опционному контракту	Биржевой сбор	Комиссия брокера	НКД	Сумма сделки (всего)	Валюта	НКД в рублях на дату принятия к учету	Сумма сделки в рублях на дату принятия к учету	Дата поставки	Дата оплаты	Ставка репо/цена 1 ЦБ по 1-ой части репо и цена 1 ЦБ по 2-ой
Биржевые срочные сделки																	
Внебиржевые срочные сделки																	
Завершенные сделки																	
Незавершенные сделки																	

III.1. В том числе сделки за период, подпадающие под категорию сделок "заключенных на заведомо худших по сравнению с рыночными условиями"

Дата и время заключения сделки	Наименование эмитента, вид, категория (тип), выпуск, транш ЦБ, № гос. регистрации	Номинал ценной бумаги	Тип сделки	Контрагент (если известен), или наименование организатора торгов	Количество (шт.)	Цена за ед.	Биржевой сбор	Комиссия брокера	НКД	Сумма сделки (всего)	Валюта	Дата поставки	Дата оплаты	Ставка репо/цена 1 ЦБ по 1-ой части репо и цена 1 ЦБ по 2-ой части
Биржевые сделки (безадресные)														
Завершенные сделки														
Незавершенные сделки														
Завершенные Биржевые сделки в режиме переговорных сделок														
Незавершенные Биржевые сделки в режиме переговорных сделок														

