

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
на 31.08.2024

Инвестор: ААУ "ГАРАНТИЯ"
Логотип: НО-4/КФ

Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бип. г.г.т.т.	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая цена 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая цена, RUB	Процент от всего по оценке	Дата погашения / Дата исполнения контракта	Уровень	Duration	YTM
1	2	3	3.1	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16
Рис 30420810331000217971 (RUB)	Денеги	4 054,67	4 054,67	4 054,67	4 054,67		0,01%			1,0000000000	4 054,67	0,01%				
Всего по НКО НКЦ (АО)					4 054,67		0,01%				4 054,67	0,01%				
По всем Денеги					4 054,67		0,01%				4 054,67	0,01%				
Денеги у брокера, рис 30801810100001015491 (RUB)	Денеги у брокера	1 047,74	1 047,74	1 047,74	1 047,74		0,00%			1,0000000000	1 047,74	0,00%				
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					1 047,74		0,00%				1 047,74	0,00%				
По всем Денеги у брокера					1 047,74		0,00%				1 047,74	0,00%				
НО-4/КФ Подтверждение №1 ГС Д213-7626/2023 от 30.11.2023, 15,00%	Депозит	5 285 000,00	5 285 000,00	5 285 000,00	5 285 000,00					1,0000000000	5 285 000,00		28.11.2024			14,01
НО-4/КФ Подтверждение №1 ГС Д213-7626/2023 от 30.11.2023, 15,00%	Процент		-	67 329,45	67 329,45	67 329,45					595 829,45					
Всего по НО-4/КФ Подтверждение №1 ГС Д213-7626/2023 от 30.11.2023, 15,00%					5 352 329,45	67 329,45	9,61%				5 880 829,45	10,33%				14,01
НО-4/КФ Подтверждение №2 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%	Депозит	1 250 000,00	1 250 000,00	1 250 000,00	1 250 000,00					1,0000000000	1 250 000,00		03.12.2024			14,03
НО-4/КФ Подтверждение №2 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%	Процент		-	13 869,86	13 869,86	13 869,86					138 869,86					
Всего по НО-4/КФ Подтверждение №2 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%					1 263 869,86	13 869,86	2,27%				1 388 869,86	2,44%				14,02
НО-4/КФ Подтверждение №3 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%	Депозит	1 475 000,00	1 475 000,00	1 475 000,00	1 475 000,00					1,0000000000	1 475 000,00		11.12.2024			13,98
НО-4/КФ Подтверждение №3 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%	Процент		-	11 440,34	11 440,34	11 440,34					157 957,01					
Всего по НО-4/КФ Подтверждение №3 ГС Д213-7626/2023 от 04.12.2023, 14,90%					1 486 440,34	11 440,34	2,67%				1 632 957,01	2,87%				13,98
Всего по Газпромбанк (Акционерное общество)					8 102 639,65		14,54%				8 902 656,32	15,64%				14,01
По всем Депозит					8 102 639,65		14,54%				8 902 656,32	15,64%				14,01
ААА Управление Капиталом АО	Расчеты	-36 320,15	-36 320,15	-36 320,15	-36 320,15					1,0000000000	-36 320,15					
Всего по Расчеты					-36 320,15		-0,07%				-36 320,15	-0,06%				
По всем Расчеты					-36 320,15		-0,07%				-36 320,15	-0,06%				
26234/MFMS СФЗ 26234	Облигация Фед.	2 624,00	2 624,00	892,66	2 342 332,63			30.08.2024		897,8700000000	2 356 010,88		16.07.2025	1-Облигация	315,78	18,30
26234/MFMS СФЗ 26234	Мусон		-		2 342 332,63			31.08.2024		5,5500000000	14 563,20		16.01.2025	1-Облигация		
Всего по 26234/MFMS СФЗ 26234					2 342 332,63		4,20%				2 370 574,08	4,17%				18,30
29009/MFMS СФЗ 29009	Облигация Фед.	13 000,00	13 000,00	1 008,51	13 110 690,45	-12 241,26		30.08.2024		999,4980000000	12 993 370,00		29.01.2025	1-Облигация	152,00	17,60
29009/MFMS СФЗ 29009	Мусон		-		13 110 690,45	-12 241,26		31.08.2024		14,4300000000	187 590,00		29.01.2025	1-Облигация		
Всего по 29009/MFMS СФЗ 29009					13 110 690,45	-12 241,26	23,53%				13 180 960,00	23,16%				17,60
29015/MFMS СФЗ 29015	Облигация Фед.	987,00	987,00	997,78	984 795,23	609,30		30.08.2024		993,7290000000	980 801,64		18.10.2028	1-Облигация		16,80
29015/MFMS СФЗ 29015	Мусон		-		984 795,23	609,30		31.08.2024		17,6200000000	17 390,84		23.10.2024	1-Облигация		17,60
Всего по 29015/MFMS СФЗ 29015					984 795,23	609,30	1,77%				998 192,58	1,75%				16,99
29016/MFMS СФЗ 29016	Облигация Фед.	11 416,00	11 416,00	999,59	11 411 259,13	2 280,41		30.08.2024		997,3600000000	11 385 861,76		21.12.2028	1-Облигация		16,73
29016/MFMS СФЗ 29016	Мусон		-	4,48	51 151,30			31.08.2024		29,7600000000	339 740,16		25.09.2024	1-Облигация		
Всего по 29016/MFMS СФЗ 29016					11 462 450,43	2 289,47	20,67%				11 725 601,92	20,60%				16,75
29016/MFMS СФЗ 29016	Облигация Фед.	15 302,00	15 302,00	983,34	15 047 088,68	169 538,15		30.08.2024		982,9000000000	14 734 256,80		18.04.2025	1-Облигация		17,60
29016/MFMS СФЗ 29016	Мусон		-		15 047 088,68	169 538,15		31.08.2024		14,6100000000	223 562,22		30.10.2024	1-Облигация		
Всего по 29016/MFMS СФЗ 29016					15 047 088,68	169 538,15	27,01%				14 957 819,02	28,20%				17,60
Всего по Минфин России					42 947 327,43		77,08%				43 233 186,60	75,87%				17,45
По всем Облигации Фед					42 947 327,43		77,08%				43 233 186,60	75,87%				17,45
4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4	Облигация	846,00	846,00	383,80	324 854,80	-18 729,42		30.08.2024		396,8800000000	335 760,48		27.09.2024	1-Облигация	28,00	19,93
4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4	Мусон		-		324 854,80	-18 729,42		31.08.2024		5,9600000000	5 042,16		27.09.2024	1-Облигация		
Всего по 4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4					324 854,80	-18 729,42	0,58%				340 802,64	0,60%				19,93
4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4	Облигация	210,00	210,00	383,80	80 598,00	-4 648,15		30.08.2024		396,8800000000	83 344,80		27.09.2024	1-Облигация	28,00	19,93
4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4	Мусон		-		80 598,00	-4 648,15		31.08.2024		5,9600000000	1 251,80		27.09.2024	1-Облигация		
Всего по 4802-04-55234-E-001P PCCP БО IP4					80 598,00	-4 648,15	0,14%				84 596,60	0,15%				19,93
Всего по ПАО "Группа ЛСР"					405 292,80		0,73%				425 399,04	0,75%				19,93
4802-03-25842-H-METAL/ИНВ03	Облигация	251,00	251,00	930,60	233 580,60	-8 294,18		30.08.2024		936,9000000000	235 161,90		10.10.2029	1-Облигация	222,41	8,82
4802-03-25842-H-METAL/ИНВ03	Мусон		-		233 580,60	-8 294,18		31.08.2024		26,6800000000	6 888,54		16.10.2024	1-Облигация		
Всего по АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"					233 580,60	-8 294,18	0,42%				241 848,54	0,42%				8,89
4802-03-04115-F-001P MTC IP-23	Облигация	398,00	398,00	963,90	381 704,40	-11 939,04		30.08.2024		972,8000000000	385 238,80		18.12.2024	1-Облигация	108,09	19,04
4802-23-04715-A-001P MTC IP-23	Мусон		-		381 704,40	-11 939,04		31.08.2024		16,8000000000	6 652,80		18.09.2024	1-Облигация		
Всего по ПАО "МТС"					381 704,40	-11 939,04	0,69%				391 891,60	0,69%				19,04
4802-02-55032-E-002P НоваяБелГП4	Облигация	590,00	590,00	898,90	530 351,00	-32 241,87		30.08.2024		901,9000000000	535 121,00		05.12.2025	1-Облигация	308,68	21,11
4802-02-55032-E-002P НоваяБелГП4	Мусон		-		530 351,00	-32 241,87		31.08.2024		17,2300000000	10 165,70		06.12.2024	1-Облигация		
Всего по ПАО "НоваяБелГП"					530 351,00	-32 241,87	0,95%				542 286,70	0,95%				21,11
4802-02-40165-F-001P НорильскБП2	Облигация	738,00	738,00	950,80	701 690,40	-52 709,40		30.08.2024		913,2000000000	673 841,60		05.10.2027	1-Облигация	378,43	13,67
4802-02-40165-F-001P НорильскБП2	Мусон		-		701 690,40	-52 709,40		31.08.2024		38,4700000000	28 390,88		08.10.2024	1-Облигация		
Всего по 4802-02-40165-F-001P НорильскБП2					701 690,40	-52 709,40	1,26%				702 332,48	1,23%				13,67
Всего по ПАО "ГМК "Норильский никель"					701 690,40	-52 709,40	1,26%				702 332,48	1,23%				13,67
4802-21-01869-A-001P Системы IP21	Облигация	630,00	630,00	867,40	806 682,00	-122 318,11		30.08.2024		836,2000000000	777 689,00		23.06.2031	1-Облигация	619,91	12,33
4802-21-01869-A-001P Системы IP21	Мусон		-		806 682,00	-122 318,11		31.08.2024		14,9400000000	13 057,00		30.12.2024	1-Облигация		
Всего по ПАО "ОАО "РЖД"					806 682,00	-122 318,11	1,45%				790 732,00	1,30%				12,33
4-28-45045-D PCCP-28 обл	Облигация	1 413,00	1 413,00	983,70	1 389 968,10	-26 034,86		30.08.2024		981,2000000000	1 379 435,80		21.03.2028	1-Облигация	194,14	16,33
4-28-45045-D PCCP-28 обл	Мусон		-		1 389 968,10	-26 034,86		31.08.2024		64,9300000000	91 746,09		24.09.2024	1-Облигация		
Всего по 4-28-45045-D PCCP-28 обл					1 389 968,10	-26 034,86	2,49%				1 471 181,89	2,60%				16,33
Всего по ОАО "РЖД"					1 389 968,10	-26 034,86	2,49%				1 471 181,89	2,60%				16,33
4802-01-06556-A-001P ФосАгро П1	Облигация	253,00	253,00	979,00	247 687,00	-4 464,32		30.08.2024		876,5000000000	221 501,50		17.04.2028	1-Облигация	543,10	16,41
4802-01-06556-A-001P ФосАгро П1	Мусон		-		247 687,00	-4 464,32		31.08.2024		34,5100000000	8 731,03		18.10.2024	1-Облигация		
Всего по ПАО "ФосАгро"					247											