

**ОТЧЕТ ОБ ИНВЕСТИЦИОННОМ ПОРТФЕЛЕ  
ОТЧЕТНЫЙ ПЕРИОД С 01.01.2023 Г. ПО 31.03.2023 Г.**

**УЧРЕДИТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ:** Ассоциация «НацАрбитр»  
наименование / уникальный код

**1. Информация о движении ценных бумаг, переданных в управление или выведенных из управления, за отчетный период**

Дата совершения операции	Наименование эмитента / лица, выдавшего Ценную бумагу	Вид, категория (тип), выпуск, транш, серия	Государственный регистрационный номер	Количество Ценных бумаг	Содержание Операции	Балансовая стоимость одной Ценной бумаги	Балансовая стоимость ЦБ (на дату акта приема-передачи ЦБ с учетом НКД) в руб.	Оценочная стоимость ЦБ (на дату акта приема-передачи ЦБ с учетом НКД) в руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9
<b>Итого:</b>								

**2. Информация о Сделках за отчетный период**

Дата заключения Сделки	Наименование эмитента (лица, выдавшего ЦБ)/Базовый актив	Вид, категория (тип), выпуск/гос. рег. Вид производного финансового инструмента, срочного договора (контракта), внебиржевого	Вид сделки/описание операции	Наименование контрагента	Цена одной ценной бумаги/ Цена срочного договора (контракта)*	Количество ценных бумаг/Количество о фьючерсных договоров (контрактов), опционных договоров (контрактов), своп договоров (контрактов)	Валюта сделки	Сумма сделки без НКД	НКД	Комиссия организатора торговли	Комиссия посредника	Валюта расчетов	Сумма оплаты по сделке в валюте расчетов	Сумма оплаты по сделке в руб	Место совершения сделки	Дата поставки (по договору)	Дата оплаты (по договору)	Дата поставки (факт)	Дата оплаты (факт)	Цена исполнения опциона	Часть сделки РЕПО	Цена одной ЦБ по первой/второй части РЕПО	Сумма второй части РЕПО	НКД второй части РЕПО	Дата оплаты второй части РЕПО	Дата поставки второй части РЕПО
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,84500	1	RUB	918,45	22,32	0,12	0,06	RUB	940,59	940,59	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,84400	15	RUB	13 776,60	334,80	1,72	0,90	RUB	14 108,78	14 108,78	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,84300	10	RUB	9 184,30	223,20	1,15	0,60	RUB	9 405,75	9 405,75	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,78100	17	RUB	15 602,77	379,44	1,95	1,01	RUB	15 979,25	15 979,25	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,78000	8	RUB	7 342,40	178,56	0,92	0,48	RUB	7 519,56	7 519,56	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75300	11	RUB	10 092,83	245,52	1,27	0,66	RUB	10 336,42	10 336,42	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75200	2	RUB	1 835,04	44,64	0,23	0,12	RUB	1 879,33	1 879,33	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	3	RUB	2 752,50	66,96	0,35	0,18	RUB	2 818,93	2 818,93	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	1	RUB	917,50	22,32	0,12	0,06	RUB	939,64	939,64	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	88,70000	4 815	RUB	4 270 905,00	76 799,25	533,86	277,60	RUB	4 346 892,79	4 346 892,79	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	2	RUB	1 835,00	44,64	0,23	0,12	RUB	1 879,29	1 879,29	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	1	RUB	917,50	22,32	0,12	0,06	RUB	939,64	939,64	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	20	RUB	18 350,00	446,40	2,29	1,19	RUB	18 792,92	18 792,92	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	13	RUB	11 927,50	290,16	1,49	0,78	RUB	12 215,39	12 215,39	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	212	RUB	194 510,00	4 731,84	24,31	12,64	RUB	199 204,89	199 204,89	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	57	RUB	52 297,50	1 272,24	6,54	3,40	RUB	53 559,80	53 559,80	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	1	RUB	917,50	22,32	0,12	0,06	RUB	939,64	939,64	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	10	RUB	9 175,00	223,20	1,15	0,60	RUB	9 396,45	9 396,45	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	16	RUB	15 568,00	194,24	1,95	1,01	RUB	15 759,28	15 759,28	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	2	RUB	1 946,00	24,28	0,24	0,13	RUB	1 969,91	1 969,91	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	1	RUB	917,50	22,32	0,12	0,06	RUB	939,64	939,64	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	30	RUB	29 190,00	364,20	3,65	1,90	RUB	29 548,65	29 548,65	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	2	RUB	1 946,00	24,28	0,24	0,13	RUB	1 969,91	1 969,91	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	10	RUB	9 175,00	223,20	1,15	0,60	RUB	9 396,45	9 396,45	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	3	RUB	2 752,50	66,96	0,35	0,18	RUB	2 818,93	2 818,93	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	3	RUB	2 919,00	36,42	0,37	0,19	RUB	2 954,86	2 954,86	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	9	RUB	8 257,50	200,88	1,03	0,54	RUB	8 456,81	8 456,81	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	97,30000	9	RUB	8 757,00	109,26	1,10	0,57	RUB	8 864,59	8 864,59	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							
16.01.2023	Минфин России	Облигации федеральные	Продажа	НКО НКЦ (АО)	91,75000	20	RUB	18 350,00	446,40	2,29	1,19	RUB	18 792,92	18 792,92	ММВБ	17.01.2023	17.01.2023	17.01.23	17.01.23							





2	Вариационная маржа по фьючерсам		
3	Премии по опционам		
4	Комиссия биржи		6 592,54
5	Комиссия брокера		3 950,21
6	Комиссия депозитария		20 305,97
7	Иные расходы		
<b>Итого:</b>			<b>30 848,72</b>

#### 8. Информация об остатках денежных средств

Валюта счёта	Место хранения ДС	Остаток ДС на начало периода в валюте счёта	Остаток ДС на начало периода в рублях	Остаток ДС на конец периода в валюте счёта	Остаток ДС на конец периода в рублях
1	2	3	4	5	6
RUB	БАНК ГТБ (АО)	3 726,01	3 726,01	3 472,93	3 472,93
<b>Итого:</b>			<b>3 726,01</b>		<b>3 472,93</b>

#### 9. Информация об остатках Ценных бумаг/срочных договоров (контрактов)

Место учета Ценных бумаг	Наименование эмитента / лица, выдавшего Ценную бумагу / срочного договора (контракта)	Вид, категория (тип), выпуск, транш, серия	Государственный регистрационный номер	Остаток на начало отчетного периода (шт.)	Оценочная стоимость Ценных бумаг/срочных договоров (контрактов) на начало периода, в руб.	НКД на начало периода, в руб.	Зачислено (шт.)	Списано (шт.)	Остаток на конец периода (шт.)	Оценочная стоимость Ценных бумаг/срочных договоров (контрактов) на конец отчетного периода, в руб.	НКД на конец периода, в руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26227RMFS	6 831	6 819 455,61	227 130,75	10 007		16 838	16 722 154,56	245 834,80
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26223RMFS	1 524	1 513 789,20	33 116,52	824		2 348	2 323 346,00	12 538,32
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	24021RMFS	16 109	16 142 828,90	215 538,42			16 109	16 113 993,79	206 839,56
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26215RMFS	21 087	21 112 937,01	549 948,96		11 687	9 400	9 383 832,00	79 336,00
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26222RMFS	3 893	3 863 958,22	55 280,60			3 893	3 840 405,57	123 408,10
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26234RMFS	1 745	1 598 402,55	35 283,90		1 745			
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26232RMFS	4 815	4 276 971,90	63 317,25		4 815			
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26229RMFS	447	434 533,17	3 938,07		447			
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	26236RMFS	8 500	7 237 665,00	50 405,00		8 500			
ВТБ спейсдел - торговый раздел	Минфин России	Облигации федеральные	25084RMFS	1 257	1 240 784,70	15 875,91	13 680		14 937	14 762 834,58	383 880,90
<b>Итого</b>				<b>66 208</b>	<b>64 241 326,26</b>	<b>1 249 835,38</b>	<b>24 511</b>	<b>27 194</b>	<b>63 525</b>	<b>63 146 566,50</b>	<b>1 051 837,68</b>

#### 10. Итоги

№	Наименование	Сумма
1	Стоимость чистых активов на конец периода (раздел 9 (графа 11 + графа 12) + строка 8 - строка 6 + строка 7), руб.	71 341 562,56
2	Введенные Ценные бумаги за период (оценочная стоимость), руб.	
3	Выведенные Ценные бумаги за период (оценочная стоимость), руб.	
4	Введенные денежные средства за период, руб.	500 000,00
5	Выведенные денежные средства за период, руб.	
6	Кредиторская задолженность на конец периода, руб.	20 305,97
7	Дебиторская задолженность на конец периода, руб.	
8	Депозиты, расчётные счета управляющего на конец периода, руб.	7 163 464,35
9	Стоимость чистых активов на начало периода (раздел 9 (графа 6 + графа 7) + строка 14 - строка 12 + строка 13), руб.	69 847 812,90
10	Прирост оценочной стоимости активов за период (строка 1 - строка 2 + строка 3 - строка 4 + строка 5 - строка 9), руб.	993 749,66
11	Прирост оценочной стоимости депозитов с учетом суммы приращенного дохода, руб.	35 280,63
12	Кредиторская задолженность на начало периода, руб.	394 785,54
13	Дебиторская задолженность на начало периода, руб.	
14	Депозиты, расчётные счета управляющего на начало периода, руб.	4 751 436,80
15	Количество календарных дней в периоде, дни	90,00