

ОТЧЕТ ОБ ИНВЕСТИЦИОННОМ ПОРТФЕЛЕ
ОТЧЕТНЫЙ ПЕРИОД С 01.10.2025 г. ПО 31.12.2025 г.

УЧРЕДИТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ:

НО-28/КФ
наименование / ФИО уникального код

1. Информация о движении ценных бумаг, введенных в управление и/или выведенных из управления, за отчетный период

Дата совершения операции	Наименование эмитента / лица, выдавшего Ценную бумагу	ISIN/Гос. номер ЦБ/ Идентификационный 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
Итого:							

2. Информация о Сделках за отчетный период

2.1. Информация о сделках с финансовыми инструментами за отчетный период

Дата заключения Сделки. Время заключения сделки	Наименование эмитента / Название ценного инвестиционного инструмента / ИИН	Вид (категория) ценной бумаги/ ИИН	ISIN/ Гос. номер ЦБ/ Идентификационный номер	Вид сделки	Направление сделки (покупка, продажа, иной результат)	Наименование контрагента	Наименование брокера	Цена ценной бумаги/Цена ИИН/Пресчет по описанию**	Количество ценных бумаг/контракт о.п.	Валюта сделки	Сумма сделки без НКД	НКД	Комиссия организатора торговли	Комиссия брокера	Валюта расчетов	Сумма оплаты по сделке в валюте расчета	Сумма оплаты по сделке в руб.	Место совершения сделки (наименование организатора торговли или внебиржевой площадки)	Дата поставки (по договору) план	Дата поставки (по договору) факт	Дата поставки (факт)	Дата оплаты (факт)	Цена исполнения опциона	№ Части сделки РЕПО	Ставка*
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
30.09.2025 17:00:44	Минфин России	Облигация федерального займа	26246RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	86,43500	462	RUB	399 329,70	1 062,60	33,95	79,87	RUB	400 506,12	400 506,12	ММВБ	01.10.2025	01.10.2025	01.10.25	01.10.25			
01.12.2025 11:28:24	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	99,42200	1	RUB	99,422	31,25	0,15	0,15	RUB	1 025,17	1 025,17	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	99,42100	2 729	RUB	2 713 199,09	85 281,25	406,98	406,97	RUB	2 797 666,39	2 797 666,39	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	1 137	RUB	1 037 478,39	15 963,48	155,62	155,62	RUB	1 053 753,11	1 053 753,11	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	359	RUB	327 576,73	5 040,36	49,13	49,14	RUB	332 715,36	332 715,36	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	74	RUB	67 522,78	1 038,06	10,12	10,13	RUB	68 581,99	68 581,99	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	87	RUB	79 284,89	1 221,48	11,91	11,91	RUB	80 630,19	80 630,19	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	441	RUB	402 399,27	6 191,64	60,36	60,36	RUB	408 711,63	408 711,63	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	101	RUB	92 159,47	1 418,04	13,83	13,82	RUB	93 605,16	93 605,16	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24700	455	RUB	415 173,85	6 388,29	62,28	62,28	RUB	421 686,61	421 686,61	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
01.12.2025 11:28:28	Минфин России	Облигация федерального займа	26252RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	91,24900	366	RUB	333 971,24	5 138,64	50,10	50,10	RUB	339 210,18	339 210,18	ММВБ	02.12.2025	02.12.2025	02.12.25	02.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,99000	3	RUB	2 978,97	107,13	0,26	0,19	RUB	3 085,65	3 085,65	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,99000	200	RUB	198 598,00	7 142,00	16,88	12,91	RUB	205 710,21	205 710,21	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,97000	5	RUB	4 964,85	178,55	0,42	0,32	RUB	5 142,66	5 142,66	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,97000	9	RUB	8 936,73	321,39	0,76	0,58	RUB	9 256,78	9 256,78	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,99000	200	RUB	198 592,00	7 142,00	16,88	12,91	RUB	205 704,21	205 704,21	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,95000	10	RUB	9 929,59	357,10	0,85	0,65	RUB	10 285,10	10 285,10	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,95000	14	RUB	13 901,30	499,94	1,18	0,90	RUB	14 399,16	14 399,16	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,94000	48	RUB	47 661,12	1 714,08	4,05	3,10	RUB	49 388,45	49 388,45	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,94000	10	RUB	9 929,40	357,10	0,85	0,65	RUB	10 285,00	10 285,00	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,92000	100	RUB	99 292,00	3 571,00	8,44	6,45	RUB	102 848,11	102 848,11	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,90000	10	RUB	9 929,00	357,10	0,85	0,65	RUB	10 284,60	10 284,60	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,90000	2	RUB	1 985,80	71,42	0,17	0,13	RUB	2 056,92	2 056,92	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,90000	10	RUB	9 929,00	357,10	0,85	0,65	RUB	10 284,60	10 284,60	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,90000	10	RUB	9 929,00	357,10	0,85	0,65	RUB	10 284,60	10 284,60	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,81000	1	RUB	992,81	35,71	0,09	0,06	RUB	1 028,37	1 028,37	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,80000	2	RUB	1 985,69	71,42	0,17	0,13	RUB	2 056,72	2 056,72	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,80000	10	RUB	9 928,00	357,10	0,85	0,65	RUB	10 283,60	10 283,60	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,74000	48	RUB	47 651,52	1 714,08	4,05	3,10	RUB	49 388,45	49 388,45	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,73000	100	RUB	99 273,00	3 571,00	8,44	6,45	RUB	102 829,11	102 829,11	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,70000	18	RUB	17 868,60	642,78	1,52	1,16	RUB	18 508,70	18 508,70	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	29016RMFS	Продажа	Продажа (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	992,70000	5 313	RUB	5 274 215,10	189 727,23	448,31	342,82	RUB	5 463 151,20	5 463 151,20	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:04	Минфин России	Облигация федерального займа	26254RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	935,00000	3 194	RUB	2 986 390,00	58 003,04	253,84	194,11	RUB	3 044 840,99	3 044 840,99	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:34:19	Минфин России	Облигация федерального займа	26254RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	935,00000	3 200	RUB	2 992 000,00	58 112,00	254,32	194,48	RUB	3 050 560,80	3 050 560,80	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
11.12.2025 10:35:27	Минфин России	Облигация федерального займа	26254RMFS	Покупка	Покупка (Списание ДС)	Банк ГТБ (АО)	Банк ГТБ (АО)	935,00000	2 008	RUB	194 480,00	3 777,28	16,54	12,64	RUB	198 286,46	198 286,46	ММВБ	12.12.2025	12.12.2025	12.12.25	12.12.25			
25.12.2025 18:31:20	Минфин России																								

Валюта счёта	Место хранения ДС, тип счёта	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 ТТБ (АО), Брокерский	401 240,17	401 240,17	491,05	491,05
Итого:			401 240,17		491,05

9. Информация об остатках Ценных бумаг

Место учета Ценных бумаг	Наименование эмитента / лица, выдвшего Ценную бумагу	ISIN/Гос.номер ЦБ/Идентификационный номер	Остаток на начало отчетного периода (шт.)	Оценочная стоимость Ценных бумаг на начало периода, в руб.	НКД на начало периода, в руб.	Зачислено (шт.)	Списано (шт.)	Остаток на конец периода (шт.)	Оценочная стоимость Ценных бумаг на конец отчетного периода, в руб.	НКД на конец периода, в руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
ВТБ спецдеп - торговый раздел	Минфин России	26246RMFS	1 117	963 546,54	2 200,49	462		1 579	1 395 378,09	50 875,38
ВТБ спецдеп - торговый раздел	Минфин России	26252RMFS				6 744		6 744	6 151 337,28	161 653,68
ВТБ спецдеп - торговый раздел	Минфин России	26254RMFS				6 602		6 602	6 142 962,94	164 587,86
ВТБ спецдеп - торговый раздел	Минфин России	26235RMFS	1 442	995 470,28	3 028,20			1 442	1 037 519,00	24 470,74
ВТБ спецдеп - торговый раздел	Минфин России	29016RMFS	74 153	73 812 637,73	206 145,34		8 853	65 300	64 974 153,00	198 512,00
Итого				75 771 654,55	211 374,03				79 701 350,31	600 099,66

10. Информация об открытых позициях по производным финансовым инструментам

Наименование фьючерсного договора (контракта), опционного договора (контракта), своп-договора (контракта), форвардного контракта	Вид срочного договора (контракта)	Тип позиции	Остаток на начало отчетного периода (шт.)	Оценочная стоимость на начало отчетного периода, руб.	Зачислено (шт.)	Списано (шт.)	Остаток на конец отчетного периода (шт.)	Цена исполнения опциона (руб.)	Оценочная стоимость на конец отчетного периода, руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Итого:				0,00					0,00

11. Итого

№	Наименование	Сумма
1	Стоимость чистых активов на конец периода (раздел 9 (графа 10 + графа 11) + строка 8 - строка 6 + строка 7 + раздел 10 (графа 10)), руб.	105 381 201,92
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.	800 000,00
5	Выведенные денежные средства за период, руб.	
6	Кредиторская задолженность на конец периода, руб.	1 357 084,21
7	Дебиторская задолженность (включая денежные средства, находящиеся у брокера) на конец периода, руб.	491,05
8	Денежные средства, находящиеся на расчетном счете и размещенные в депозитах, на конец периода, руб.	26 436 345,11
9	Стоимость чистых активов на начало периода (раздел 9 (графа 5 + графа 6) + строка 13 - строка 11 + строка 12 + раздел 10 (графа 5)), руб.	101 698 820,11
10	Прирост оценочной стоимости активов за период (строка 1 - строка 2 + строка 3 - строка 4 + строка 5 - строка 9), руб.	2 882 381,81
11	Кредиторская задолженность на начало периода, руб.	79 305,71
12	Дебиторская задолженность (включая денежные средства, находящиеся у брокера) на начало периода, руб.	401 240,17
13	Денежные средства, находящиеся на расчетном счете и размещенные в депозитах, на начало периода, руб.	25 393 857,07
14	Количество календарных дней в периоде, дни	92,00