

Портфель с группировкой по видам вложений и по эмитентам
на 31.05.2026

Инвестор: HO-33/КФ
Договор: HO-33/КФ

Финансовый инструмент	Тип вложения	Количество	Свободный остаток	Балансовая цена, RUB	Балансовая стоимость, RUB	в том числе переоценка, RUB	Процент от всего по бал. ст-ти	Дата котировки	Цена исполнения контракта	Текущая оценка 1 бумаги / контракта, RUB	Текущая оценка, 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
Р/с 4070181050000001695 (RUB)	Деньги	417.06	417.06	417.06	417.06	0.00	0.00%			1.000000	417.06	0.00%				
Всего по Банк ГПБ (АО)					417.06		0.00%				417.06	0.00%				
По всем Деньги					417.06		0.00%				417.06	0.00%				
Деньги у брокера, р/с 30601810200001053939 (RUB)	Деньги у брокера	8 367.17	8 367.17	8 367.17	8 367.17	0.00	0.02%			1.000000	8 367.17	0.02%				
Всего по Банк ГПБ (АО)					8 367.17		0.02%				8 367.17	0.02%				
По всем Деньги у брокера					8 367.17		0.02%				8 367.17	0.02%				
HO-33/КФ ААУ Содружество_Подтверждение № 20260522001558_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 13.700 %	Депозит	2 147 000.00	2 147 000.00	2 147 000.00	2 147 000.00	0.00				1.000000	2 147 000.00		21.08.2026			14,21
HO-33/КФ ААУ Содружество_Подтверждение № 20260522001558_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 13.700 %	Процент		-	0.00	0.00	0.00					7 252.74					
Всего по HO-33/КФ ААУ Содружество_Подтверждение № 20260522001558_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 13.700 %					2 147 000.00	0.00	3.98%				2 154 252.74	3.93%				14,21
HO-33/КФ Подтверждение № 10 ААУ Содружество_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 15.40 %	Депозит	10 764 000.00	10 764 000.00	10 764 000.00	10 764 000.00	0.00				1.000000	10 764 000.00		15.06.2026			14,39
HO-33/КФ Подтверждение № 10 ААУ Содружество_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 15.40 %	Процент		-	481 401,47	481 401,47	481 401,47					758 434,39					
Всего по HO-33/КФ Подтверждение № 10 ААУ Содружество_ГС № Д 152-7626/2019 от 02.10.2019 г. 15.40 %					11 245 401,47	481 401,47	20.83%				11 522 434,39	21.03%				14,39
Всего по Банк ГПБ (АО)					13 392 401,47		24.80%				13 676 687,13	24.97%				14,30
По всем Депозит					13 392 401,47		24.80%				13 676 687,13	24.97%				14,30
AAA Управление Капиталом АО	Расчеты	-11 927,47	-11 927,47	-11 927,47	-11 927,47	0.00				1.000000	-11 927,47					
Всего по Расчеты					-11 927,47		-0.02%				-11 927,47	-0.02%				
По всем Расчеты					-11 927,47		-0.02%				-11 927,47	-0.02%				
26246RMFS ОФЗ 26246 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	1 116.00	1 116.00	886,29	989 099,64	65 906,07	1,84%	29.05.2026		879,490000	981 510,84	1,84%	12.03.2036	I-Облигации	2 052,66	14,85
26246RMFS ОФЗ 26246 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	1,97	2 198,52	2 198,52		31.05.2026		22,030000	24 585,48		23.09.2026	I-Облигации		
Всего по 26246RMFS ОФЗ 26246 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					991 298,16	68 104,59	1,84%				1 006 096,32	1,84%				14,85
26252RMFS ОФЗ 26252 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	3 175.00	3 175.00	927,03	2 943 320,25	46 259,00	5,45%	29.05.2026		924,780000	2 936 176,50	5,44%	12.10.2033	I-Облигации	1 774,57	14,67
26252RMFS ОФЗ 26252 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	0,00	0,00	0,00		31.05.2026		13,380000	42 418,00		21.10.2026	I-Облигации		
Всего по 26252RMFS ОФЗ 26252 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					2 943 320,25	46 259,00	5,45%				2 978 594,50	5,44%				14,67
26254RMFS ОФЗ 26254 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	3 301.00	3 301.00	927,01	3 060 060,01	-26 837,97	5,67%	29.05.2026		921,210000	3 040 914,21	5,64%	03.10.2040	I-Облигации	2 365,50	14,83
26254RMFS ОФЗ 26254 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	0,00	0,00	0,00		31.05.2026		13,890000	45 850,89		21.10.2026	I-Облигации		
Всего по 26254RMFS ОФЗ 26254 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					3 060 060,01	-26 837,97	5,67%				3 086 765,10	5,64%				14,83
29007RMFS ОФЗ 29007 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	15 917.00	15 917.00	1 019,15	16 221 855,91	0.00		29.05.2026		1018,730000	16 215 125,41		03.03.2027	I-Облигации	263,58	15,14
29007RMFS ОФЗ 29007 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	37,35	594 499,95	0.00		31.05.2026		42,140000	670 742,38		02.09.2026	I-Облигации		
Всего по 29007RMFS ОФЗ 29007 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					16 816 355,86	0.00	31,14%				16 885 867,79	30,83%				15,14
29016RMFS ОФЗ 29016 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	15 000.00	15 000.00	1 004,31	15 064 650,00	168 808,00	27,97%	29.05.2026		1001,060000	15 015 900,00	28,14%	23.12.2026	I-Облигации		16,50
29016RMFS ОФЗ 29016 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	2,43	36 450,00	36 450,00		31.05.2026		26,610000	399 150,00		24.06.2026	I-Облигации		
Всего по 29016RMFS ОФЗ 29016 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					15 101 100,00	205 258,00	27,97%				15 415 050,00	28,14%				16,50
29020RMFS ОФЗ 29020 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Облигации Фед	1 687.00	1 687.00	1 001,04	1 688 762,19	-277,25		29.05.2026		1000,290000	1 687 489,23	3,16%	22.09.2027	I-Облигации		16,55
29020RMFS ОФЗ 29020 в ВТБ спейсдел - торговый раздел	Купон		-	5,01	8 448,51	528,08		31.05.2026		26,610000	44 891,07		24.06.2026	I-Облигации		
Всего по 29020RMFS ОФЗ 29020 в ВТБ спейсдел - торговый раздел					1 697 210,70	250,83	3,14%				1 732 380,30	3,16%				16,55
Всего по Минфин России					40 609 344,98		75,20%				41 104 754,01	75,04%				15,42
По всем облигации Фед					40 609 344,98		75,20%				41 104 754,01	75,04%				15,42
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:					53 998 603,21		100,00%				54 778 297,90	100,00%			11,01	11,01

Прирост с начала года: 3 398 866,34 RUB

Доходность с начала года на 31.05.2026 0:00:00: 15,99 % годовых



Расчет доходов и расходов в целях определения налогооблагаемой базы
Период: 01.01.2026-31.05.2026 г.

Инвестор: Содружество ААУ
 Договор: НО-33/КФ

Финансовый инструмент	Реализация (выбытие) ЦБ, руб					Прочие доходы / расходы, в т.ч. проценты, купоны, дивиденды, вариационная маржа, руб.					Всего Прибыль+ / Убыток-, руб.	
	Тело		Процент (купон)		Итого Прибыль+ / Убыток-	Полученные, уплаченные		Начисленные (накопленные)		Прибыль+ / Убыток-		
	Доходы	Расходы	Доходы	Расходы		Доходы	Расходы	Начисленный доход	Расход, в т.ч. списан ранее начисленный доход Всего			в т.ч. при реализации и (выбытии)
1.												
Проценты начисленные по депозиту								441 487,27			441 487,27	441 487,27
Проценты полученные по депозиту						88 200,37					88 200,37	88 200,37
Итого по депозитным договорам и р/с						88 200,37		441 487,27			529 687,64	529 687,64
2.												
Депозитарная комиссия							11 927,47				-11 927,47	-11 927,47
Итого по прочим вложениям							11 927,47				-11 927,47	-11 927,47
3.												
ОФЗ 26246						9 173,52		46 235,88			55 409,4	55 409,4
ОФЗ 29020								36 970,64			36 970,64	36 970,64
ОФЗ 26252						80 395,53	56 487,78	140 303,25			164 211	164 211
ОФЗ 26254						85 826	59 946,16	151 647,94			177 527,78	177 527,78
ОФЗ 29016			149 528,56		149 528,56	326 955,2		1 431 953,64			1 758 908,84	1 908 437,4
ОФЗ 29007								76 242,43			76 242,43	76 242,43
Итого по федеральным облигациям, облигациям субъектов РФ и муниципальных образований,			149 528,56		149 528,56	502 350,25	116 433,94	1 883 353,78			2 269 270,09	2 418 798,65
4.												
ОФЗ 29016	17 989 582,14	17 868 266,27			121 315,87							121 315,87
Итого по ЦБ, обращающие на ОРЦБ	17 989 582,14	17 868 266,27			121 315,87							121 315,87
ВСЕГО:	17 989 582,14	17 868 266,27	149 528,56		270 844,43	590 550,62	128 361,41	2 324 841,05			2 787 030,26	3 057 874,69



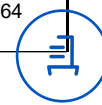
Акционерное общество "ААА Управление Капиталом"

Регистр бухгалтерского/налогового учета "Проценты по ценным бумагам"

период:
инвестор:
по портфелю

с 01.01.2026 по 31.05.2026
Содружество ААУ
НО-33/КФ

1	2	3 Финансовый инструмент	4 Бухгалтерский учет, сумма в рублях			5 Налоговый учет, сумма в рублях		
			4 Доходы	5 Расходы	6 Прибыль	7 Доходы	8 Расходы	9 Прибыль
Ставка 20%	При погашении	ОФЗ 26246	30 823,92		30 823,92	9 173,52		9 173,52
		ОФЗ 26252	80 395,53	56 487,78	23 907,75	80 395,53	56 487,78	23 907,75
		ОФЗ 26254	85 826	59 946,16	25 879,84	85 826	59 946,16	25 879,84
		ОФЗ 29016	1 121 079,08		1 121 079,08	326 955,2		326 955,2
		Итого:	1 318 124,53	116 433,94	1 201 690,59	502 350,25	116 433,94	385 916,31
	При выбытии	ОФЗ 29016	348 263,98		348 263,98	149 528,56		149 528,56
		Итого:	348 263,98		348 263,98	149 528,56		149 528,56
	Переоценка НКД	ОФЗ 26246	2 198,52		2 198,52	46 235,88		46 235,88
		ОФЗ 29020	528,08		528,08	36 970,64		36 970,64
		ОФЗ 26252	97 885,25		97 885,25	140 303,25		140 303,25
		ОФЗ 26254	105 797,05		105 797,05	151 647,94		151 647,94
		ОФЗ 29016	76 394,34		76 394,34	1 431 953,64		1 431 953,64



	ОФЗ 29007				76 242,43		76 242,43
	Итого:	282 803,24		282 803,24	1 883 353,78		1 883 353,78
	Итого:	1 949 191,75	116 433,94	1 832 757,81	2 535 232,59	116 433,94	2 418 798,65

Идентификатор документа 27838e6a-0dfa-48cb-bd71-9b165213243f



Документ подписан и передан через оператора ЭДО АО «ПФ «СКБ Контур»

Подписи отправителя:	Организация, сотрудник	Доверенность: рег. номер, период действия и статус	Сертификат: серийный номер, период действия	Дата и время подписания
	Акционерное общество "ААА Управление Капиталом" Затрутина Ольга Борисовна Доверитель: АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ААА УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ"	f477051e-4d76-4e86-a60d-daa04c319e82 с 06.11.2024 00:00 по 06.11.2027 23:59 GMT+03:00 Доверенность прошла проверку	02C572900086B335B2468E2E6AEFFC2522 с 30.10.2025 11:35 по 30.01.2027 11:35 GMT+03:00	03.06.2026 17:59 GMT+03:00 Подпись соответствует файлу документа
Подписи получателя:	ААУ "СОДРУЖЕСТВО" БУРЦЕВ СЕРГЕЙ ЮРЬЕВИЧ ДИРЕКТОР АССОЦИАЦИИ	Не требуется для подписания	02EF309000CEB25F8A4DB59CD049C7AA0C с 29.04.2025 11:34 по 29.07.2026 11:34 GMT+03:00	10.06.2026 13:02 GMT+03:00 Подпись соответствует файлу документа