

Состав инвестиционного портфеля средств пенсионных резервов фонда на 31.01.2024
Акционерное общество "Негосударственный пенсионный фонд "ВЭФ.Русские Фонды"

Наименование актива	ISIN (номер государственной регистрации правил доверительного управления, кадастровый номер)	Полное наименование эмитента (дебитора)	ОГРН	Количество, шт.	Стоимость, руб.	Доля, %
Государственные ценные бумаги Российской Федерации						
12840077V	RU000A0JWNA4	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	3,000000	54 554 279,58	3,81
24021RMFS	RU000A101CK7	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	2 900,000000	2 909 396,00	0,20
26207RMFS	RU000A0JS3W6	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	41 340,000000	42 606 220,32	2,98
26212RMFS	RU000A0JTK38	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	29 600,000000	28 251 561,59	1,97
26218RMFS	RU000A0JVW48	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	12 300,000000	12 234 267,18	0,85
26219RMFS	RU000A0JWM07	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	20 171,000000	19 809 446,21	1,38
26221RMFS	RU000A0JXFM1	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	130 000,000000	119 611 742,52	8,35
26222RMFS	RU000A0JXQF2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	51 500,000000	50 774 880,00	3,55
26223RMFS	RU000A0ZYU88	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	8 696,000000	8 880 355,20	0,62
26224RMFS	RU000A0ZYUA9	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	16 500,000000	15 756 500,98	1,10
26226RMFS	RU000A0ZZYW2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	14 600,000000	13 773 640,00	0,96
26227RMFS	RU000A1007F4	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	63 973,000000	62 557 917,24	4,37
26228RMFS	RU000A100A82	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	90 000,000000	85 112 197,39	5,95
26229RMFS	RU000A100EG3	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	40 100,000000	38 548 557,97	2,69
26232RMFS	RU000A1014N4	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	830,000000	710 488,30	0,05
26234RMFS	RU000A101QE0	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	12 500,000000	11 087 500,00	0,77
26237RMFS	RU000A1038Z7	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	69 625,000000	63 867 329,72	4,46
26239RMFS	RU000A103901	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	90 500,000000	80 911 195,78	5,65
26241RMFS	RU000A105F29	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	130 000,000000	127 426 170,61	8,90
Итого:					839 383 646,59	58,63
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации						
RU25072MOS0	RU000A103059	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	1027700505348	5 220,000000	5 219 321,40	0,36
RU34012MOO0	RU000A100XP4	Министерство экономики и финансов Московской области	1025002870837	17 869,000000	4 282 931,27	0,30
RU35012SAM0	RU000A0JWM56	Министерство управления финансами Самарской области	1026300972444	14 020,000000	3 495 648,59	0,24
Итого:					12 997 901,26	0,91
Муниципальные облигации						
Итого:						0,00
Облигации российских эмитентов						
4-01-06556-A	RU000A106G31	Публичное акционерное общество "ФосАгро"	1027700190572	230,000000	20 290 149,00	1,42
4-17-00077-A	RU000A1059N9	Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ"	1027700035769	340,000000	30 817 841,21	2,15
4-21-00078-A	RU000A105H64	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "МАГНИТОГОРСКИЙ МЕТАЛЛУРГИЧЕСКИЙ КОМБИНАТ"	1027402166835	166,000000	14 847 314,16	1,04
4802-01-00268-E-001P	RU000A106938	публичное акционерное общество "НОВАТЭК"	1026303117642	15 600,000000	14 688 960,00	1,03
4802-01-40155-F-001P	RU000A100VQ6	Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель"	1028400000298	9 524,000000	9 370 187,40	0,65
4802-01-55192-E-001P	RU000A100XC2	Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	12 000,000000	11 684 520,00	0,82
4802-01-60525-P-004P	RU000A105KQ8	Публичное акционерное общество "Магнит"	1032304945947	3 000,000000	2 888 370,00	0,20
4802-02-40155-F-001P	RU000A105A61	Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель"	1028400000298	3 200,000000	3 094 656,00	0,22
4802-02-55385-E-001P	RU000A101MG4	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЕТЕВАЯ КОМПАНИЯ - РОССЕТИ"	1024701893336	1 998,000000	1 844 444,43	0,13
4802-02-60525-P-004P	RU000A105TP1	Публичное акционерное общество "Магнит"	1032304945947	16 500,000000	15 820 530,00	1,11
4802-03-00122-A	RU000A0JV1X3	публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	1027700043502	1 100,000000	1 081 267,00	0,08
4802-03-32501-D	RU000A1002F0	Публичное акционерное общество "Россети Урал"	1056604000970	9 200,000000	8 826 699,14	0,62
4802-03-55192-E-001P	RU000A105VC5	Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	2 500,000000	2 486 250,00	0,17
4802-05-00122-A-002P	RU000A0ZYUV5	публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	1027700043502	3 596,000000	3 708 481,08	0,26

4802-05-65045-D-001P							
	RU000A0ZYU05	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	6 055,000000	5 588 765,00	0,39	
4802-06-00296-A-001P	RU000A101G26	Публичное акционерное общество "Уралкалий"	1025901702188	8 865,000000	8 425 207,35	0,59	
4802-06-04715-A-001P	RU000A0ZYWY5	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 000,000000	2 046 509,67	0,14	
4802-06-65045-D-001P	RU000A02Z249	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	16 410,000000	16 004 673,00	1,12	
4802-07-65045-D-001P	RU000A02Z294	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	9 963,000000	9 831 488,40	0,69	
4802-09-55038-E-001P	RU000A10SSL2	Публичное акционерное общество "Федеральная гидрогенерирующая компания - РусГидро"	1042401810494	2 340,000000	2 180 880,00	0,15	
4802-10-04715-A-001P	RU000A100HU7	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 700,000000	2 735 766,59	0,19	
4802-13-00206-A-001P	RU000A1010B7	Публичное акционерное общество "Транснефть"	1027700049486	24 550,000000	23 694 576,39	1,66	
4802-14-04715-A-001P	RU000A101FH6	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 600,000000	2 252 744,00	0,16	
4802-16-65045-D-001P	RU000A100HY9	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	11 700,000000	11 615 928,33	0,81	
4802-17-65045-D-001P	RU000A1010M4	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	1 930,000000	1 759 967,00	0,12	
4802-18-00354-B-001P	RU000A102GJ8	"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110	900,000000	914 328,00	0,06	
4802-20-65045-D-001P	RU000A101M04	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	6 500,000000	5 716 360,00	0,40	
4802-442-01481-B-001P	RU000A102YG7	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	29 616,000000	27 399 538,56	1,91	
4802-500-01481-B-001P	RU000A103WV8	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	5 785,000000	5 688 911,15	0,40	
Итого:					267 305 312,86	18,67	
Акции							
Итого:						0,00	
Паи паевых инвестиционных фондов, в том числе паи (акции, доли) иностранных индексных инвестиционных фондов							
Итого:						0,00	
Ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах							
Итого:						0,00	
Ценные бумаги международных финансовых организаций							
Итого:						0,00	
Облигации иностранных эмитентов							
Итого:						0,00	
Денежные средства на счетах в кредитных организациях							
Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-3, 02.05.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		154 500,63	0,01	
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), 6/м, 29.12.2023		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		50 052 650,82	3,50	
Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г. Москве, РР-188467, 10.11.2022		Филиал Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		1 522 170,53	0,11	
Банк ГПБ (АО), 4267/2021-ДУ-4, 01.03.2021		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		24 127 946,85	1,69	
Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-4, 02.05.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		4 253,56	0,00	
Итого:					75 861 522,39	5,30	
Депозиты и депозитные сертификаты							
АКБ «ПЕРЕСВЕТ» (ПАО), 42007/1/2017, 24.04.2017		Акционерный коммерческий банк «ПЕРЕСВЕТ» (Публичное акционерное общество)	1027739250285		223 331 331,00	15,60	
Итого:					223 331 331,00	15,60	
Недвижимое имущество							
Итого:						0,00	
Средства на специальных брокерских, клиринговых счетах							
ООО "ИК "Гелиус Капитал", 210302/1, 02.03.2021		Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал"»	1067746469702		7 201 469,27	0,50	
ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/1, 17.05.2023		Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал"»	1067746469702		1 751 775,36	0,12	
ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/2, 17.05.2023		Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал"»	1067746469702		526 073,36	0,04	
Итого:					9 479 317,99	0,66	
Предварительные затраты по ценным бумагам							
4802-06-00296-A-001P		Публичное акционерное общество "Уралкалий"	1025901702188		252,35	0,00	
Итого:					252,35	0,00	
Положительная переоценка сделок Т+							
Итого:						0,00	

Дебиторская задолженность по сделкам репо						
Итого:						0,00
Дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи						
Итого:						0,00
Дебиторская задолженность по дивидендам						
Итого:						0,00
Дебиторская задолженность эмитента (по погашению номинала и процентному (купонному) доходу) по облигациям						
26239RMFS		Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636		3 114 105,00	0,22
4802-09-55038-E-001P		Публичное акционерное общество "Федеральная гидрогенерирующая компания - РусГидро"	1042401810494		107 335,80	0,01
Итого:					3 221 440,80	0,23
Начисленные проценты по МНО						
Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №6 от 30.01.2024), 19.01.2024		Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		5 696,72	0,00
Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №72 от 30.01.2024), 16.02.2022		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		8 254,10	0,00
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №3 от 25.01.2024), 19.01.2024		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		34 426,23	0,00
Итого:					48 377,05	0,00
Прочая дебиторская задолженность, в т.ч.:						
Итого:						0,00
Всего активов:					1 431 629 102,29	100,00