

Состав инвестиционного портфеля средств пенсионных резервов фонда на 31.05.2024
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	54 085 072,33	3,78
26207RMFS	RU000A0JS3W6	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	41 340,000000	42 081 632,66	2,94
26212RMFS	RU000A0JTK38	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	29 600,000000	29 059 253,04	2,03
26218RMFS	RU000A0JVW48	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	12 300,000000	12 078 135,71	0,84
26219RMFS	RU000A0JWM07	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	13 000,000000	12 689 656,73	0,89
26221RMFS	RU000A0JXFM1	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	130 000,000000	118 433 342,05	8,28
26222RMFS	RU000A0JXQF2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	51 500,000000	50 600 810,00	3,54
26224RMFS	RU000A0ZYUA9	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	16 500,000000	15 624 915,95	1,09
26226RMFS	RU000A0ZZYW2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	14 600,000000	12 745 070,00	0,89
26227RMFS	RU000A1007F4	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	47 000,000000	47 863 390,00	3,35
26228RMFS	RU000A100A82	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	90 000,000000	84 328 683,88	5,90
26229RMFS	RU000A100EG3	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	40 100,000000	37 828 969,69	2,64
26232RMFS	RU000A1014N4	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	830,000000	646 138,40	0,05
26234RMFS	RU000A101QE0	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	12 500,000000	11 319 375,00	0,79
26237RMFS	RU000A1038Z7	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	69 625,000000	63 570 358,72	4,44
26239RMFS	RU000A103901	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	90 500,000000	83 406 834,13	5,83
26241RMFS	RU000A105FZ9	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	130 000,000000	125 538 989,85	8,78
26242RMFS	RU000A105RV3	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	11 000,000000	8 994 810,00	0,63
26244RMFS	RU000A1074G2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	12 000,000000	11 373 777,97	0,80
Итого:					822 269 216,11	57,49
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации						
RU34012MO00	RU000A100XP4	Министерство экономики и финансов Московской области	1025002870837	16 106,000000	3 953 378,76	0,28
RU35012SAM0	RU000A0JWM56	Министерство управления финансами Самарской области	1026300972444	6 000,000000	1 525 620,00	0,11
Итого:					5 478 998,76	0,38
Муниципальные облигации						
Итого:						0,00
Облигации российских эмитентов						
4-01-06556-A	RU000A106G31	Публичное акционерное общество "ФосАгро"	1027700190572	280,000000	25 121 577,34	1,76
4-09-36400-R-003P	RU000A105RG4	ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ"	1087746212388	125,000000	11 127 582,34	0,78
4-17-00077-A	RU000A1059N9	Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ"	1027700035769	375,000000	33 130 659,03	2,32
4-21-00078-A	RU000A105H64	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "МАГНИТОГОРСКИЙ МЕТАЛЛУРГИЧЕСКИЙ КОМБИНАТ"	1027402166835	211,000000	19 286 235,92	1,35
4B02-01-00268-E-001P	RU000A106938	публичное акционерное общество "НОВАТЭК"	1026303117642	15 488,000000	13 853 861,12	0,97
4B02-01-40155-F-001P	RU000A100VQ6	Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель"	1028400000298	9 524,000000	9 401 330,88	0,66
4B02-01-55192-E-001P	RU000A100XC2	Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	2 000,000000	1 956 700,00	0,14
4B02-01-60525-P-004P	RU000A105KQ8	Публичное акционерное общество "Магнит"	1032304945947	2 766,000000	2 686 394,52	0,19
4B02-02-40155-F-001P	RU000A105A61	Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель"	1028400000298	3 200,000000	2 991 648,00	0,21
4B02-02-55385-E-001P	RU000A101MG4	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЕТЕВАЯ КОМПАНИЯ - РОССЕТИ"	1024701893336	1 998,000000	1 868 358,31	0,13
4B02-02-60525-P-004P	RU000A105TP1	Публичное акционерное общество "Магнит"	1032304945947	15 972,000000	14 734 968,60	1,03
4B02-03-00122-A	RU000A0JV1X3	публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	1027700043502	1 100,000000	1 068 166,00	0,07
4B02-03-32501-D	RU000A100ZF0	Публичное акционерное общество "Россети Урал"	1056604000970	9 200,000000	8 430 062,03	0,59
4B02-03-55192-E-001P	RU000A105VC5	Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	2 500,000000	2 224 800,00	0,16
4B02-05-65045-D-001P	RU000A0ZYUJ05	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	6 055,000000	5 393 794,00	0,38

4B02-06-04715-A-001P	RU000A0ZYWY5	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 000,000000	2 026 798,02	0,14
4B02-06-65045-D-001P	RU000A0Z24P9	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	16 410,000000	15 702 072,60	1,10
4B02-07-65045-D-001P	RU000A0Z29R4	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	4 825,000000	4 947 072,50	0,35
4B02-09-55038-E-001P	RU000A105SL2	Публичное акционерное общество "Федеральная гидрогенерирующая компания - РусГидро"	1042401810494	2 340,000000	2 176 200,00	0,15
4B02-10-04715-A-001P	RU000A100HU7	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 700,000000	2 749 967,09	0,19
4B02-13-00206-A-001P	RU000A1010B7	Публичное акционерное общество "Транснефть"	1027700049486	24 550,000000	23 011 504,11	1,61
4B02-14-04715-A-001P	RU000A101FH6	Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы"	1027700149124	2 600,000000	2 108 886,00	0,15
4B02-16-65045-D-001P	RU000A100HY9	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	11 700,000000	11 945 858,43	0,84
4B02-17-65045-D-001P	RU000A1010M4	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	1 930,000000	1 707 123,60	0,12
4B02-18-00354-B-001P	RU000A102GJ8	"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110	899,000000	909 859,92	0,06
4B02-20-65045-D-001P	RU000A101M04	открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	1037739877295	6 500,000000	5 386 940,00	0,38
4B02-442-01481-B-001P	RU000A102YG7	Публичное акционерное общество "Сбербанк России"	1027700132195	12 386,000000	11 008 800,66	0,77
Итого:					236 957 221,02	16,57
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), 4267/2021-ДУ-4, 01.03.2021		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		64 086 693,98	4,48
Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-3, 02.05.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		3 884 441,17	0,27
Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-4, 02.05.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		5 056 297,17	0,35
Банк ГПБ (АО), 4267/2024-ДУ-1, 05.03.2024		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 016 268,12	0,07
Банк ГПБ (АО), 4267/2024-ДУ-1, 09.02.2024		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		694 409,40	0,05
Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г. Москве, РР-188467, 10.11.2022		Филиал Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		8 891 389,03	0,62
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), РР-762352, 04.12.2023		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		3 523 478,69	0,25
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), 6/н, 01.03.2024		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		6 365 519,39	0,45
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), 6/н, 29.12.2023		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		68 548 551,15	4,79
Итого:					162 067 048,10	11,33
Депозиты и депозитные сертификаты						
АКБ «ПЕРЕСВЕТ» (ПАО), 42007/1/2017, 24.04.2017		Акционерный коммерческий банк «ПЕРЕСВЕТ» (Публичное акционерное общество)	1027739250285		181 880 689,19	12,72
Итого:					181 880 689,19	12,72
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		154 771,28	0,01
ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/1, 17.05.2023		Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал"	1067746469702		658 410,12	0,05
ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/2, 17.05.2023		Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал"	1067746469702		1 498 017,85	0,10
Итого:					2 311 199,25	0,16
Предварительные затраты по ценным бумагам						
Итого:						0,00
Положительная переоценка сделок Т+						
Итого:						0,00

Дебиторская задолженность по сделкам репо						
26233RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		12 044 746,04	0,84
26243RMFS		Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481		6 945 799,82	0,49
Итого:					18 990 545,86	1,33
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						
Итого:						0,00
Начисленные проценты по МНО						
Банк ВТБ (ПАО), НСО22-080-026-92 (Уведомление №48 от 21.05.2024), 29.12.2022		Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		26 868,85	0,00
Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №31 от 23.05.2024), 19.01.2024		Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		66 010,93	0,00
Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №32 от 24.05.2024), 19.01.2024		Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		25 991,80	0,00
Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №33 от 27.05.2024), 19.01.2024		Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		36 546,45	0,00
Банк ГПБ (АО), М24-4267/2023 (Подтверждение №12 от 27.05.2024), 15.11.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		6 021,86	0,00
Банк ГПБ (АО), М25-4267/2023 (Подтверждение №09 от 27.05.2024), 15.11.2023		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		7 923,50	0,00
Банк ГПБ (АО), М29-4267/2024 (Подтверждение №07 от 27.05.2024), 07.03.2024		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 426,23	0,00
Банк ГПБ (АО), М34-4267/2024 (Подтверждение №07 от 27.05.2024), 13.03.2024		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		1 045,90	0,00
Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №96 от 23.05.2024), 16.02.2022		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		32 568,31	0,00
Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №97 от 27.05.2024), 16.02.2022		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		33 595,63	0,00
Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №98 от 27.05.2024), 16.02.2022		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		12 677,60	0,00
Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №99 от 27.05.2024), 16.02.2022		"Газпромбанк" (Акционерное общество)	1027700167110		36 878,69	0,00
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-10 (Уведомление №04 от 27.05.2024), 05.03.2024		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		10 465,57	0,00
Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-9 (Уведомление №03 от 27.05.2024), 05.03.2024		Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве	1027739609391		5 814,21	0,00
Итого:					303 835,53	0,02
Прочая дебиторская задолженность, в т.ч.:						
Итого:						0,00
Всего активов:					1 430 258 753,82	100,00