

Состав инвестиционного портфеля средств пенсионных резервов фонда на 31.07.2024
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 | 50 155 378,21 | 3,56 |
| 26207RMFS | RU000A0JS3W6 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 41 340,000000 | 42 664 073,93 | 3,03 |
| 26212RMFS | RU000A0JTK38 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 29 600,000000 | 28 425 949,85 | 2,02 |
| 26218RMFS | RU000A0JVW48 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 12 300,000000 | 12 262 136,49 | 0,87 |
| 26219RMFS | RU000A0JWM07 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 13 000,000000 | 12 829 872,44 | 0,91 |
| 26221RMFS | RU000A0JXFM1 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 130 000,000000 | 120 355 835,91 | 8,54 |
| 26222RMFS | RU000A0JXQF2 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 51 500,000000 | 51 725 570,00 | 3,67 |
| 26224RMFS | RU000A0ZYUA9 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 16 500,000000 | 15 844 733,36 | 1,12 |
| 26226RMFS | RU000A0ZZYW2 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 14 600,000000 | 12 788 286,00 | 0,91 |
| 26228RMFS | RU000A100A82 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 90 000,000000 | 85 665 096,06 | 6,08 |
| 26229RMFS | RU000A100EG3 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 40 100,000000 | 38 384 150,76 | 2,72 |
| 26232RMFS | RU000A1014N4 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 830,000000 | 644 229,40 | 0,05 |
| 26234RMFS | RU000A101QE0 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 12 500,000000 | 11 269 125,00 | 0,80 |
| 26237RMFS | RU000A1038Z7 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 69 625,000000 | 64 593 568,40 | 4,58 |
| 26239RMFS | RU000A103901 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 90 500,000000 | 81 550 449,49 | 5,79 |
| 26241RMFS | RU000A105FZ9 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 130 000,000000 | 127 692 731,78 | 9,06 |
| 26242RMFS | RU000A105RV3 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 11 000,000000 | 8 844 110,00 | 0,63 |
| 26244RMFS | RU000A1074G2 | Министерство финансов Российской Федерации | 1037739085636 | 12 000,000000 | 11 614 166,45 | 0,82 |
| Итого: | | | | | 777 309 463,53 | 55,17 |
| Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации | | | | | | |
| RU34012MOO0 | RU000A100XP4 | Министерство экономики и финансов Московской области | 1025002870837 | 16 106,000000 | 3 976 732,46 | 0,28 |
| Итого: | | | | | 3 976 732,46 | 0,28 |
| Муниципальные облигации | | | | | | |
| Итого: | | | | | | 0,00 |
| Облигации российских эмитентов | | | | | | |
| 4-01-06556-A | RU000A106G31 | Публичное акционерное общество "ФосАгро" | 1027700190572 | 280,000000 | 23 594 462,06 | 1,67 |
| 4-05-40155-F | RU000A107BL4 | Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель" | 1028400000298 | 275,000000 | 22 569 784,99 | 1,60 |
| 4-09-36400-R-003P | RU000A105RG4 | ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ" | 1087746212388 | 125,000000 | 10 518 986,78 | 0,75 |
| 4-17-00077-A | RU000A1059N9 | Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ" | 1027700035769 | 375,000000 | 31 158 989,75 | 2,21 |
| 4B02-02-55385-E-001P | RU000A101MG4 | ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЕТЕВАЯ КОМПАНИЯ - РОССЕТИ" | 1024701893336 | 1 274,000000 | 1 187 457,18 | 0,08 |
| 4B02-03-32501-D | RU000A100ZF0 | Публичное акционерное общество "Россети Урал" | 1056604000970 | 9 200,000000 | 8 560 194,65 | 0,61 |
| 4B02-03-55192-E-001P | RU000A105VC5 | Публичное акционерное общество "Полос" | 1068400002990 | 110,000000 | 98 285,00 | 0,01 |
| 4B02-06-04715-A-001P | RU000A0ZYWY5 | Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы" | 1027700149124 | 2 000,000000 | 2 053 320,90 | 0,15 |
| 4B02-07-65045-D-001P | RU000A0Z29R4 | открытое акционерное общество "Российские железные дороги" | 1037739877295 | 4 825,000000 | 4 928 062,00 | 0,35 |
| 4B02-10-04715-A-001P | RU000A100HU7 | Публичное акционерное общество "Мобильные ТелеСистемы" | 1027700149124 | 2 700,000000 | 2 730 403,60 | 0,19 |
| 4B02-13-00206-A-001P | RU000A1010B7 | Публичное акционерное общество "Транснефть" | 1027700049486 | 23 639,000000 | 22 342 134,55 | 1,59 |
| 4B02-16-65045-D-001P | RU000A100HY9 | открытое акционерное общество "Российские железные дороги" | 1037739877295 | 11 700,000000 | 11 651 286,12 | 0,83 |
| 4B02-18-00354-B-001P | RU000A102GJ8 | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 168,000000 | 152 454,96 | 0,01 |
| Итого: | | | | | 141 545 822,54 | 10,05 |
| Акции | | | | | | |
| Итого: | | | | | | 0,00 |
| Пай паевых инвестиционных фондов, в том числе пай (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 | | | | | | |
| АО "АЛЬФА-БАНК", б/н, 05.07.2024 | | АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" | 1027700067328 | 20 013 000,00 | 1,42 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2021-ДУ-4, 01.03.2021 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 58 975 443,87 | 4,19 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-3, 02.05.2023 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 18 509 966,29 | 1,31 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2023-ДУ-4, 02.05.2023 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 13 309 698,18 | 0,94 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2024-ДУ-1, 05.03.2024 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 1 278 551,65 | 0,09 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2024-ДУ-1, 09.02.2024 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 2 412 693,92 | 0,17 | |
| Банк ГПБ (АО), 4267/2024-ДУ-5, 09.02.2024 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 307 346,32 | 0,02 | |
| Московский филиал "БАНК СГБ", 2100455936-3/36-2100378583, 03.04.2024 | | Московский филиал акционерного общества "БАНК СГБ" | 1023500000160 | 9 875,52 | 0,00 | |
| Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г. Москве, РР-188467, 10.11.2022 | | Филиал Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | 2 875 536,87 | 0,20 | |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), РР-762352, 04.12.2023 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | 14 223 239,90 | 1,01 | |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), б/н, 01.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | 18 670 257,10 | 1,33 | |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), б/н, 29.12.2023 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | 70 022 167,57 | 4,97 | |
| Итого: | | | | 220 607 777,19 | 15,66 | |
| Депозиты и депозитные сертификаты | | | | | | |
| АКБ «ПЕРЕСВЕТ» (ПАО), 42007/1/2017, 24.04.2017 | | Акционерный коммерческий банк «ПЕРЕСВЕТ» (Публичное акционерное общество) | 1027739250285 | 183 079 719,11 | 12,99 | |
| Итого: | | | | 183 079 719,11 | 12,99 | |
| 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 | 322 958,50 | 0,02 | |
| ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/1, 17.05.2023 | | Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал" | 1067746469702 | 2 117 985,86 | 0,15 | |
| ООО "ИК "Гелиус Капитал", 230517/2, 17.05.2023 | | Общество с ограниченной ответственностью «Инвестиционная компания "Гелиус Капитал" | 1067746469702 | 166 682,48 | 0,01 | |
| Итого: | | | | 2 607 626,84 | 0,19 | |
| Предварительные затраты по ценным бумагам | | | | | | |
| 4802-03-55192-Е-001Р | | Публичное акционерное общество "Полус" | 1068400002990 | 69,63 | 0,00 | |
| 4802-13-00206-А-001Р | | Публичное акционерное общество "Транснефть" | 1027700049486 | 12,29 | 0,00 | |
| 4802-18-00354-В-001Р | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | 112,11 | 0,00 | |
| Итого: | | | | 194,03 | 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 | 28 061 008,52 | 1,99 | |
| 26240RMFS | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 1067711004481 | 33 579 637,76 | 2,38 | |
| 26243RMFS | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 1067711004481 | 14 863 541,16 | 1,05 | |
| Итого: | | | | 76 504 187,44 | 5,43 | |
| 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 |
| Итого: | | | | | 3 114 105,00 | 0,22 |
| Начисленные проценты по МНО | | | | | | |
| Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №43 от 25.07.2024), 19.01.2024 | | Банк ВТБ (публичное акционерное общество) | 1027739609391 | | 56 934,43 | 0,00 |
| Банк ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-4 (Уведомление №44 от 29.07.2024), 19.01.2024 | | Банк ВТБ (публичное акционерное общество) | 1027739609391 | | 21 702,19 | 0,00 |
| Банк ГПБ (АО), М24-4267/2023 (Подтверждение №21 от 19.07.2024), 15.11.2023 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | | 7 206,56 | 0,00 |
| Банк ГПБ (АО), М24-4267/2023 (Подтверждение №22 от 29.07.2024), 15.11.2023 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | | 6 770,49 | 0,00 |
| Банк ГПБ (АО), М25-4267/2023 (Подтверждение №13 от 19.07.2024), 15.11.2023 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | | 36 032,79 | 0,00 |
| Банк ГПБ (АО), М34-4267/2024 (Подтверждение №11 от 18.07.2024), 13.03.2024 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | | 1 322,73 | 0,00 |
| Банк ГПБ (АО), М8-4267/2022 (Подтверждение №114 от 29.07.2024), 16.02.2022 | | "Газпромбанк" (Акционерное общество) | 1027700167110 | | 19 827,87 | 0,00 |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-10 (Уведомление №12 от 25.07.2024), 05.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | | 4 950,82 | 0,00 |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-10 (Уведомление №13 от 29.07.2024), 05.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | | 9 234,97 | 0,00 |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-9 (Уведомление №10 от 19.07.2024), 05.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | | 35 150,82 | 0,00 |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-9 (Уведомление №11 от 19.07.2024), 05.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | | 7 426,23 | 0,00 |
| Филиал "Центральный" Банка ВТБ (ПАО), НСО24-081-2062-9 (Уведомление №12 от 29.07.2024), 05.03.2024 | | Филиал "Центральный" Банка ВТБ (публичное акционерное общество) в г. Москве | 1027739609391 | | 4 802,19 | 0,00 |
| Итого: | | | | | 211 362,09 | 0,02 |
| Прочая дебиторская задолженность, в т.ч.: | | | | | | |
| Итого: | | | | | | 0,00 |
| Всего активов: | | | | | 1 408 956 990,23 | 100,00 |