

Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем, государство не гарантирует доходность инвестиций в паевые инвестиционные фонды. Прежде чем приобрести инвестиционный пай, следует внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевым инвестиционным фондом

Отчет о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, принадлежащего акционерному инвестиционному фонду (составляющего паевой инвестиционный фонд)

Раздел I. Реквизиты акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда)

| Полное наименование акционерного инвестиционного фонда (полное название паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии акционерного инвестиционного фонда (регистрационный номер правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) |
|--|---|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Российские корпоративные облигации смарт бета» | 3647 | 38757208 |

Раздел II. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Март 2022 г. | RUB |

Раздел III. Сведения о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, принадлежащего акционерному инвестиционному фонду (составляющего паевой инвестиционный фонд)

| Наименование показателя | Код строки | Значение показателя за отчетный период |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего | 01 | 3 931 296,41 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 3 931 296,41 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 0,00 |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества | 01.03 | 0,00 |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04 | 0,00 |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными | 01.05 | 0,00 |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций | 01.06 | 0,00 |
| с проектной документацией | 01.07 | 0,00 |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент | 01.08 | 0,00 |
| с художественными ценностями | 01.09 | 0,00 |
| с иным имуществом | 01.10 | 0,00 |
| с дебиторской задолженностью | 01.11 | 0,00 |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях | 01.12 | 0,00 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего | 02 | -45 480 361,54 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -45 480 361,54 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | 0,00 |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества | 02.03 | 0,00 |
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00 |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными | 02.05 | 0,00 |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций | 02.06 | 0,00 |
| проектной документации | 02.07 | 0,00 |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент | 02.08 | 0,00 |
| художественных ценностей | 02.09 | 0,00 |
| иного имущества | 02.10 | 0,00 |
| дебиторской задолженности | 02.11 | 0,00 |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях | 02.12 | 0,00 |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 20 562 045,38 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счета по депозиту) | 03.01 | 672 540,29 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 19 889 505,09 |
| дивиденды по акциям акционерных обществ | 03.03 | 0,00 |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов | 03.04 | 0,00 |
| распределение прибыли обществ с ограниченной ответственностью (иностраных коммерческих организаций) | 03.05 | 0,00 |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду (субаренду) | 03.06 | 0,00 |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа), имущественные права по обязательствам из которых составляют имущество фонда | 03.07 | 0,00 |
| иные доходы по имуществу | 03.08 | 0,00 |
| Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда | 04 | 0,00 |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего | 05 | 1 549 755,53 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 1 443 791,14 |

| | | |
|--|-------|----------------|
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 105 964,39 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 119 234,26 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 1 549 755,53 |
| Прочие расходы | 09 | 1 693 678,06 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 0,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | 0,00 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 0,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | 0,00 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -22 799 932,07 |

Раздел IV. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам РЕПО

| Наименование ценной бумаги | Код строки | Государственный регистрационный номер | Код ISIN | Наименование эмитента ценной бумаги | ИНН эмитента представляемых ценных бумаг | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | ОГРН эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|---|------------|---------------------------------------|--------------|---|--|--|---|--|-------------------|
| | | | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | | | 4 | | | | |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | | | 4 928 994 099,64 | 4 932 460 606,00 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | | | | |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | | | | |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | | | 1 286 394 099,64 | 1 287 055 505,28 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | | | |
| Минфин России, 020. 29020RMFS | 01.03 | 29020RMFS | RU000A102BV4 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | | 1037739085636 | 857 382 866,08 | 857 823 889,24 |
| Минфин России, 002. 52002RMFS | 01.03 | 52002RMFS | RU000A0ZYZ26 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | | 1037739085636 | 429 011 233,56 | 429 231 616,04 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.04 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.04.1 | | x | | | | | | |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.05 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю | 1.05.1 | | x | | | | | | |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.06 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю | 1.06.1 | | x | | | | | | |
| векселя | 1.07 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому векселю | 1.07.1 | | x | | | | | | |
| ипотечные сертификаты | 1.08 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату | 1.08.1 | | x | | | | | | |
| депозитные сертификаты | 1.09 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату | 1.09.1 | | x | | | | | | |
| закладные | 1.10 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой закладной | 1.10.1 | | x | | | | | | |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | 1.11 | | x | | | | | 3 642 600 000,00 | 3 645 405 100,72 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | | |
| КСУ - акции RU000A0JWKG5 | 01.11 | | RU000A0JWKG5 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 5 300 000,00 | 5 303 194,52 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYP02 | 01.11 | | RU000A0ZYP02 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 388 000 000,00 | 388 209 413,70 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 3 249 300 000,00 | 3 251 892 492,50 |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего | 2 | | x | | | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 2.1 | | x | | | | | | |

Руководитель акционерного инвестиционного фонда
(управляющей компании паевого инвестиционного
фонда) (лицо, исполняющее обязанности
руководителя акционерного инвестиционного фонда
(управляющей компании паевого инвестиционного
фонда))

С.Г. Дюдин

(инициалы, фамилия)

Уполномоченное лицо специализированного
депозитария акционерного инвестиционного
фонда (паевого инвестиционного фонда)

Т.С. Есаулкова

(инициалы, фамилия)