



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

АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ НЕЗАВИСИМОГО АУДИТОРА

**ОБ ОТЧЕТНОСТИ ОТКРЫТОГО ПАЕВОГО
ИНВЕСТИЦИОННОГО ФОНДА РЫНОЧНЫХ ФИНАНСОВЫХ
ИНСТРУМЕНТОВ
«ВТБ – ФОНД КАЗНАЧЕЙСКИЙ»
ПОД УПРАВЛЕНИЕМ АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА
ВТБ КАПИТАЛ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ
ЗА 2021 ГОД**

**Аудиторское заключение независимого аудитора
по результатам аудита отчетности паевого инвестиционного фонда**

Владельцам инвестиционных паев Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский»

Мнение

Мы провели аудит отчетности в отношении имущества, составляющего Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский», и операций с этим имуществом (далее – отчетность специального назначения), состоящей из:

- Справки о стоимости чистых активов, в том числе о стоимости имущества паевого инвестиционного фонда, составленной по состоянию на 30.12.2021;
- Ежемесячных отчетов о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, за каждый месяц 2021 года;
- Отчета о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим паевой инвестиционный фонд, за 2021 год;
- Пояснительной записки к годовой отчетности паевого инвестиционного фонда за 2021 год.

По нашему мнению, прилагаемая отчетность специального назначения Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» (далее – Фонд) под управлением АО ВТБ Капитал Управление активами (далее - Управляющая компания) по состоянию на 30 декабря 2021 года, а также за год, закончившийся на указанную дату, подготовлена во всех существенных отношениях в соответствии с требованиями к составлению отчетности в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и операций с этим имуществом, установленными Федеральным Законом от 29.11.2001 №156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», Указанием Банка России от 08.02.2018 №4715-У «О формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов», Указанием Банка России от 13.01.2021 N 5708-У «Об объемах, формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов», Указанием Банка России от 05.09.2016 №4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов», Указанием Банка России от 25.08.2015 №3758-У «Об определении стоимости чистых активов инвестиционных фондов, в том числе о порядке расчета среднегодовой стоимости чистых активов паевого инвестиционного фонда и чистых активов акционерного инвестиционного фонда, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, стоимости имущества, переданного в оплату инвестиционных паев» (далее – нормативно-правовые акты Российской Федерации).

Основание для выражения мнения

Мы провели аудит в соответствии с Международными стандартами аудита (далее – МСА). Наша ответственность в соответствии с этими стандартами далее раскрывается в разделе «Ответственность аудитора за аудит отчетности специального назначения» настоящего заключения.

Мы независимы в соответствии с Правилами независимости аудиторов и аудиторских организаций и Кодексом профессиональной этики аудиторов, соответствующими Международному кодексу этики профессиональных бухгалтеров (включая международные стандарты независимости), разработанному Советом по международным стандартам этики для профессиональных бухгалтеров, и нами выполнены прочие иные обязанности в соответствии с этими требованиями профессиональной этики. Мы полагаем, что полученные нами аудиторские доказательства являются достаточными и надлежащими, чтобы служить основанием для выражения нашего мнения.

Важные обстоятельства: принципы учета и ограничение распространения

Мы обращаем внимание на Пояснительную записку к годовой отчетности паевого инвестиционного фонда за 2021 год, в которой указаны нормативные требования в отношении составления отчетности специального назначения. Прилагаемая отчетность специального назначения составлена с целью отражения соблюдения Управляющей компанией требований, установленных указанными нормативно-правовыми актами Российской Федерации в отношении составления отчетности в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и операций с этим имуществом. Следовательно, данная отчетность специального назначения может быть непригодна для иной цели. Мы не выражаем модифицированное мнение в связи с этим вопросом.

Прочие сведения: события после отчетной даты

В связи с напряженной геополитической обстановкой, сложившейся в феврале 2022 года, произошел существенный рост волатильности на фондовых и валютных рынках, курс рубля по отношению к доллару и евро существенно снизился. Сложившаяся ситуация на финансовых рынках, вызванная введением ограничений иностранными государствами в отношении ряда финансовых институтов, а также новых международных санкций в отношении ряда российских компаний и граждан, оказывает негативное влияние на российскую экономику и существенно ухудшает условия выполнения обязательств или может привести к невозможности либо несвоевременному исполнению управляющей компанией своих обязательств в рамках договора доверительного управления. Наличие риска приостановки организованных торгов ценными бумагами российскими организаторами торговли, проблем с корректным определением активного рынка, наличие кредитного риска и прочие нерыночные факторы, а также отсутствие необходимого объема торгов, приводит к ситуации, когда определение справедливой стоимости активов в паевых инвестиционных фондах, и как следствие, определение стоимости чистых активов таких фондов, является затруднительным и может нарушать права и законные интересы владельцев инвестиционных паев.

Мы не выражаем модифицированное мнение в связи с этим вопросом.

Ответственность руководства Управляющей компании и лиц, отвечающих за корпоративное управление за отчетность специального назначения

Руководство Управляющей компании несет ответственность за подготовку указанной отчетности специального назначения в соответствии с требованиями к составлению отчетности в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и операций с этим имуществом, установленными нормативно-правовыми актами Российской Федерации, и за систему внутреннего контроля, которую руководство Управляющей компании считает необходимой для подготовки отчетности специального назначения, не содержащей существенных искажений вследствие недобросовестных действий или ошибок.

Лица, отвечающие за корпоративное управление, несут ответственность за надзор за подготовкой отчетности специального назначения.

Ответственность аудитора за аудит отчетности специального назначения

Наша цель состоит в получении разумной уверенности в том, что отчетность специального назначения не содержит существенных искажений вследствие недобросовестных действий или ошибок, и в выпуске аудиторского заключения, содержащего наше мнение. Разумная уверенность представляет собой высокую степень уверенности, но не является гарантией того, что аудит, проведенный в соответствии с МСА, всегда выявляет существенные искажения при их наличии. Искажения могут быть результатом недобросовестных действий или ошибок и считаются существенными, если можно обоснованно предположить, что в отдельности или в совокупности они могут повлиять на экономические решения пользователей, принимаемые на основе этой отчетности специального назначения.

В рамках аудита, проводимого в соответствии с МСА, мы применяем профессиональное суждение и сохраняем профессиональный скептицизм на протяжении всего аудита. Кроме того, мы:

- › выявляем и оцениваем риски существенного искажения отчетности специального назначения вследствие недобросовестных действий или ошибок; разрабатываем и проводим аудиторские процедуры в ответ на эти риски; получаем аудиторские доказательства, являющиеся достаточными и надлежащими, чтобы служить основанием для выражения нашего мнения. Риск необнаружения существенного искажения в результате недобросовестных действий выше, чем риск необнаружения существенного искажения в результате ошибки, так как недобросовестные действия могут включать сговор, подлог, умышленный пропуск, искаженное представление информации или действия в обход системы внутреннего контроля;

- › получаем понимание системы внутреннего контроля, имеющей значение для аудита, с целью разработки аудиторских процедур, соответствующих обстоятельствам, но не с целью выражения мнения об эффективности системы внутреннего контроля;

- › оцениваем надлежащий характер применяемой учетной политики и обоснованность оценочных значений, рассчитанных руководством Управляющей компании, и соответствующего раскрытия информации.

Мы осуществляем информационное взаимодействие с лицами, отвечающими за корпоративное управление, доводя до их сведения, помимо прочего, информацию о запланированном объеме и сроках аудита, а также о существенных замечаниях по результатам аудита, в том числе о значительных недостатках системы внутреннего контроля, которые мы выявляем в процессе аудита.

ОТЧЕТ О РЕЗУЛЬТАТАХ ПРОВЕДЕННЫХ АУДИТОРОМ ПРОЦЕДУР В СООТВЕТСТВИИ С ТРЕБОВАНИЯМИ ФЕДЕРАЛЬНОГО ЗАКОНА ОТ 29.11.2001 №156-ФЗ «ОБ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДАХ»

Руководство Управляющей компании несет ответственность за выполнение требований, установленных нормативно-правовыми актами Российской Федерации в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, а также операций с этим имуществом.

В соответствии со статьей 50 Федерального Закона от 29.11.2001 №156-ФЗ «Об инвестиционных фондах» мы провели проверку:

1. выполнения по состоянию на отчетную дату требований к:

- › составу и структуре имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд;
- › оценке расчетной стоимости одного инвестиционного пая, суммы, на которую выдается один инвестиционный пай, и суммы денежной компенсации, подлежащей выплате в связи с погашением инвестиционного пая.

2. соблюдения Управляющей компанией:

- › правил ведения учета и составления отчетности в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и операций с этим имуществом;
- › требований, предъявляемых к порядку хранения имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и документов, удостоверяющих права на имущество, составляющее паевой инвестиционный фонд;
- › требований к сделкам, совершенным с активами паевого инвестиционного фонда.

По результатам проведенных процедур мы не обнаружили нарушений требований действующего законодательства во всех существенных отношениях.

Однако обращаем внимание, что по состоянию на 30.12.2021 состав активов не соответствует инвестиционной декларации Фонда, в частности, пп. 1 п. 23.1 Правил доверительного управления Фондом, а именно в состав активов Фонда входят облигации ОАО «Мособлтрастинвест» (гос. номер 4-01-05741-А и 4-02-05741-А), по которым объявлен дефолт и они не допущены к организованным торгам. ОАО «Мособлтрастинвест» признано банкротом в 2009 году, а Управляющая компания включена в реестр кредиторов эмитента – банкрота. Облигации будут списаны из состава активов в соответствии с требованиями действующего законодательства после ликвидации эмитента-банкрота. Данные ценные бумаги отражены в Справке о стоимости чистых активов по справедливой стоимости в размере 0 руб.

Мы не проводили каких-либо процедур в отношении ведения учета и составления отчетности в отношении имущества, составляющего Фонд, и операций с этим имуществом, кроме процедур, которые мы сочли необходимыми для целей выражения мнения о том, составлена ли отчетность специального назначения Фонда по состоянию на 30.12.2021, а также за год, закончившийся на указанную дату, во всех существенных отношениях в соответствии с требованиями к отчетности паевых инвестиционных фондов, установленных нормативно-правовыми актами Российской Федерации.

Ирина Ефремовна Авдеева,

действующая от имени аудиторской организации на основании доверенности № 002-АК-2022 от 12.01.2022, руководитель аудита, по результатам которого составлено аудиторское заключение (ОРНЗ 21606077496),



Аудируемое лицо

Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» под управлением АО ВТБ Капитал Управление активами
123112, г. Москва, вн.тер.г. муниципальный округ Пресненский, наб. Пресненская, д.10, стр.1, этаж 38, помещение I
Правила доверительного управления фондом №0089-59893097 от 26.02.2003

Аудиторская организация

Общество с ограниченной ответственностью «Аудиторская компания «Мариллион»
ОГРН 1027700190429
129090, РФ, г. Москва, Протопоповский пер., д.25, корп. А
Член саморегулируемой организации аудиторов Ассоциации «Содружество»
ОРНЗ 11606054861

Справка о стоимости чистых активов, в том числе стоимости активов (имущества),
акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда)

Раздел I. Реквизиты паевого инвестиционного фонда

| Полное название паевого инвестиционного фонда | Номер правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) |
|--|---|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | 59893097 |

Раздел II. Параметры справки о стоимости чистых активов

| Отчетная дата | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|---------------|---|
| 1 | 2 |
| 30.12.2021 | RUB |

Раздел III. Активы

Подраздел 1. Денежные средства

| Наименование показателя | Код строки | Сумма на текущую отчетную дату |
|--|------------|--------------------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| Денежные средства – всего | 01 | 145 327 751,81 |
| в том числе: | | |
| на счетах в кредитных организациях – всего | 01.01 | 145 327 751,81 |
| в том числе: | | |
| в валюте Российской Федерации | 01.01.01 | 145 267 755,38 |
| в иностранной валюте | 01.01.02 | 59 996,43 |
| на счетах по депозиту в кредитных организациях – всего | 01.02 | 0,00 |
| в том числе: | | |
| в валюте Российской Федерации | 01.02.01 | 0,00 |
| в иностранной валюте | 01.02.02 | 0,00 |

Подраздел 2. Ценные бумаги российских эмитентов (за исключением закладных)

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 02 | 50 438 900 922,95 |
| в том числе: | | |
| облигации российских хозяйственных обществ (за исключением облигаций с ипотечным покрытием) – всего | 02.01 | 20 768 439 727,51 |
| из них: | | |
| биржевые облигации российских хозяйственных обществ | 02.01.01 | 15 408 788 800,45 |
| государственные ценные бумаги Российской Федерации | 02.02 | 26 435 141 117,95 |
| государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации | 02.03 | 2 202 713 849,75 |
| муниципальные ценные бумаги | 02.04 | 94 622 346,00 |
| российские депозитарные расписки | 02.05 | 0,00 |
| инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов | 02.06 | 0,00 |
| акции российских акционерных обществ – всего | 02.07 | 0,00 |
| в том числе: | | |
| акции публичных акционерных обществ | 02.07.01 | 0,00 |
| акции непубличных акционерных обществ | 02.07.02 | 0,00 |
| векселя российских хозяйственных обществ | 02.08 | 0,00 |
| ипотечные ценные бумаги – всего | 02.09 | 235 348 816,74 |
| в том числе: | | |
| облигации с ипотечным покрытием | 02.09.01 | 235 348 816,74 |

| | | |
|-------------------------------|----------|----------------|
| ипотечные сертификаты участия | 02.09.02 | 0,00 |
| иные ценные бумаги | 02.10 | 702 635 065,00 |

Подраздел 3. Ценные бумаги иностранных эмитентов

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|--|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Ценные бумаги иностранных эмитентов – всего | 03 | 1 485 726 599,68 |
| в том числе: | | |
| облигации иностранных эмитентов – всего | 03.01 | 912 649 690,00 |
| в том числе: | | |
| облигации иностранных коммерческих организаций | 03.01.01 | 178 978 200,00 |
| облигации иностранных государств | 03.01.02 | 733 671 490,00 |
| облигации международных финансовых организаций | 03.02 | 573 076 909,68 |
| иностранное депозитарные расписки | 03.03 | 0,00 |
| паи (акции) иностранных инвестиционных фондов | 03.04 | 0,00 |
| акции иностранных акционерных обществ | 03.05 | 0,00 |
| иные ценные бумаги | 03.06 | 0,00 |

Подраздел 4. Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Недвижимое имущество и права аренды на недвижимое имущество – всего | 04 | 0,00 |
| в том числе: | | |
| недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации – всего | 04.01 | 0,00 |
| из него: | | |
| объекты незавершенного строительства | 04.01.01 | 0,00 |
| недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств – всего | 04.02 | 0,00 |
| из него: | | |
| объекты незавершенного строительства | 04.02.01 | 0,00 |
| права аренды недвижимого имущества, находящегося на территории Российской Федерации | 04.03 | 0,00 |
| права аренды недвижимого имущества, находящегося на территории иностранных государств | 04.04 | 0,00 |

Подраздел 5. Имущественные права (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов)

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|--|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Имущественные права – всего | 05 | 0,00 |
| в том числе: | | |
| имущественные права из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества | 05.01 | 0,00 |
| имущественные права, связанные с возникновением права собственности на объект недвижимости (его часть) после завершения его строительства (создание) и возникающие из договора, стороной по которому является юридическое лицо, которому принадлежит право собственности или иное вещное право, включая право аренды, на земельный участок, выделенный в установленном порядке для целей строительства объекта недвижимости, и (или) имеющее разрешение на строительство объекта недвижимости на указанном земельном участке, либо юридическое лицо, инвестирующее денежные средства или иное имущество в строительство объекта недвижимости | 05.02 | 0,00 |

| | | |
|---|-------|------|
| имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется строительство (создание) объектов недвижимого имущества (в том числе на месте объектов недвижимости) на выделенном в установленном порядке для целей строительства (создания) указанного объекта недвижимости земельном участке, который (право аренды которого) составляет активы акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | 05.03 | 0,00 |
| имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимости, составляющих активы акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | 05.04 | 0,00 |
| иные имущественные права | 05.05 | 0,00 |

Подраздел 6. Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенные закладными

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенные закладными – всего | 06 | 0,00 |
| в том числе: денежные требования по кредитным договорам и договорам займа, не удостоверенные закладными | 06.01 | 0,00 |
| закладные | 06.02 | 0,00 |

Подраздел 7. Производные финансовые инструменты (актив)

| Наименование показателя | Код строки | Стоимость на текущую отчетную дату |
|---|------------|------------------------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| Общая стоимость производных финансовых инструментов | 07 | 0,00 |

Подраздел 8. Дебиторская задолженность

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Дебиторская задолженность – всего | 08 | 1 112 810 322,58 |
| в том числе: средства, находящиеся у профессиональных участников рынка ценных бумаг | 08.01 | 28 011,70 |
| по сделкам | 08.02 | 163 861 371,27 |
| по процентному (купонному) доходу по денежным средствам на счетах и во вкладах, а также по ценным бумагам | 08.03 | 948 920 939,61 |
| прочая | 08.04 | 0,00 |

Подраздел 9. Иное имущество, не указанное в подразделах 1-8

| Наименование показателя | Код строки | Сумма (стоимость) на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Иное имущество – всего | 09 | 0,00 |
| в том числе: доли в уставных капиталах российских обществ с ограниченной ответственностью | 09.01 | 0,00 |
| права участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций | 09.02 | 0,00 |
| проектная документация для строительства или реконструкции объекта недвижимости | 09.03 | 0,00 |
| драгоценные металлы и требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов по текущему курсу – всего | 09.04 | 0,00 |
| в том числе: драгоценные металлы | 09.04.01 | 0,00 |
| требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов по текущему курсу | 09.04.02 | 0,00 |
| художественные ценности | 09.05 | 0,00 |
| прочее имущество | 09.06 | 0,00 |

Подраздел 10. Общая стоимость активов

| Наименование показателя | Стоимость на текущую отчетную дату |
|--|------------------------------------|
| 1 | 2 |
| Общая стоимость активов (сумма строк 01+02+03+04+05+06+07+08+09) | 53 182 765 597,02 |

Раздел IV. Обязательства

| Наименование показателя | Код строки | Величина на текущую отчетную дату |
|---|------------|-----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| Кредиторская задолженность - всего | 10 | 139 789 027,27 |
| по сделкам купли-продажи имущества | 10.1 | 121 663,30 |
| владельцам инвестиционных паев - всего | 10.2 | 70 845 878,91 |
| в том числе: | | |
| обмен паев (акций) (перечисление денежных средств) | 10.2.1 | 0,00 |
| обмен паев (выдача паев), обмен акций (выпуск акций) | 10.2.2 | 0,00 |
| погашение паев (выкуп акций) | 10.2.3 | 70 845 878,91 |
| выплата дохода (дивидендов) | 10.2.4 | 0,00 |
| по налогам и сборам | 10.3 | 437 528,00 |
| по вознаграждениям (комиссиям) | 10.4 | 68 383 957,06 |
| по аренде, по охране, по услугам связи и др. | 10.5 | 0,00 |
| по кредитам и займам полученным - всего | 10.6 | 0,00 |
| в том числе: | | |
| кредиты и займы полученные | 10.6.1 | 0,00 |
| накопленные проценты по кредитам (займам) | 10.6.2 | 0,00 |
| по страхованию | 10.7 | 0,00 |
| по рекламе | 10.8 | 0,00 |
| прочая кредиторская задолженность | 10.9 | 0,00 |
| Резерв на выплату вознаграждения – всего | 11 | 71 354 108,81 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 11.1 | 0,00 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 11.2 | 71 354 108,81 |
| Производные финансовые инструменты | 12 | 0,00 |
| Общая величина обязательств (сумма строк 10+11+12) | 13 | 211 143 136,08 |

Раздел V. Стоимость чистых активов

| Наименование показателя | Код строки | Значение показателя на текущую отчетную дату |
|--|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Стоимость чистых активов (разность строк 10 и 13) | 14 | 52 971 622 460,94 |
| Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) – штук | 15 | 730 556 968,83216 |
| Стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда в расчете на одну акцию (расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда) (частное от деления строк 14 и 15) | 16 | 72,51 |

Раздел VI. Примечания

| Текущая отчетная дата | Примечание |
|-----------------------|------------|
| 1 | 2 |
| | |

Расшифровки активов и обязательств, принятых к расчету стоимости чистых активов

Расшифровки раздела III «Активы»

Подраздел 1. Денежные средства

1.1. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
|--------------|--|-------------|------------|-----------------------|--------------------------------|---------------------------------------|----------------|------------------------------|------------|
| Номер строки | Наименование кредитной организации (полное наименование) | Счет | Код валюты | Вид банковского счета | Сумма денежных средств (рубль) | Условие истребования средств | Дата погашения | Количество в составе активов | Примечание |
| 1 | Банк ВТБ (ПАО) | 10273360231 | 645-RUB | Другие счета | 58 888,46 | Идентификация средств по номеру счета | 2023.03.28 | 57,447 | |
| 2 | Банк ВТБ (ПАО) | 10273360251 | 645-RUB | Расчетный | 145 127,78,38 | Идентификация средств по номеру счета | 2023.03.21 | 354,333 | |
| Итого | | | | | 145 127,78,38 | | 2023.03.21 | 30,000 | |

1.2. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
|--------------|--|------|------------|---------------------------|--------------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------|----|
| Номер строки | Наименование кредитной организации (полное наименование) | Счет | Код валюты | Субординированный депозит | Дата вклада денежных средств (рубль) | Условие истребования средств | Количество в составе активов | Примечание | |
| 1 | | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | | |
| 3 | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | |

Подраздел 2. Ценные бумаги российских эмитентов (за исключением закладных)

2.1. Облигации российских хозяйственных обществ

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 |
|--------------|---|--------------|------------|-----------------------------|--------------------------------|---|------------------------------|------------|----------------------------------|----------------|---|------------------------------|------------|
| Номер строки | Наименование эмитента (полное наименование) | Счет | Код валюты | Субординированные облигации | Дата выпуска облигации (рубль) | Условие истребования средств | Количество в составе активов | Примечание | Сумма номинала облигации (рубль) | Дата погашения | Условие истребования средств | Количество в составе активов | Примечание |
| 1 | Публичное акционерное общество «Татнефть (ПАО) | 10273360329 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 270,000 | | 286 936 000,00 | 2023.01.28 | Идентификация облигации по номеру облигации | 270,000 | |
| 2 | Публичное акционерное общество «Татнефть (ПАО) | 11874658023 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 57,447 | | 58 153 538,10 | 2023.03.28 | Идентификация облигации по номеру облигации | 57,447 | |
| 3 | Публичное акционерное общество «Татнефть (ПАО) | 11173905433 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 354,333 | | 297 895 160,00 | 2023.03.28 | Идентификация облигации по номеру облигации | 354,333 | |
| 4 | Публичное акционерное общество «Татнефть (ПАО) | 10273360178 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 30,000 | | 25 951 000,00 | 2023.04.21 | Идентификация облигации по номеру облигации | 30,000 | |
| 5 | Публичное акционерное общество «Самобит» | 11448200025 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 67,742 | | 64 105 024,20 | 2023.04.17 | Идентификация облигации по номеру облигации | 67,742 | |
| 6 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273000391 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 344,000 | | 319 752 400,00 | 2023.05.15 | Идентификация облигации по номеру облигации | 344,000 | |
| 7 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273980783 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 5,184 | | 4 754 245,40 | 2023.05.14 | Идентификация облигации по номеру облигации | 5,184 | |
| 8 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 11974625740 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 344,000 | | 322 392 400,00 | 2023.05.26 | Идентификация облигации по номеру облигации | 344,000 | |
| 9 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10238003877 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 959,300 | | 823 388 950,00 | 2023.05.28 | Идентификация облигации по номеру облигации | 959,300 | |
| 10 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273910513 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 300,000 | | 289 779 320,00 | 2023.06.04 | Идентификация облигации по номеру облигации | 300,000 | |
| 11 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273000391 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 719,628 | | 688 274 816,00 | 2023.07.10 | Идентификация облигации по номеру облигации | 719,628 | |
| 12 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 11974620000 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 170,796 | | 158 997 608,00 | 2023.07.23 | Идентификация облигации по номеру облигации | 170,796 | |
| 13 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10274233840 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 2,391 | | 2 811 540,00 | 2023.08.08 | Идентификация облигации по номеру облигации | 2,391 | |
| 14 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 102733848914 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 61,101 | | 59 864 539,00 | 2023.08.19 | Идентификация облигации по номеру облигации | 61,101 | |
| 15 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273360380 | RUB | Нет | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 56,424 | | 54 061 162,00 | 2023.08.20 | Идентификация облигации по номеру облигации | 56,424 | |
| 16 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 10273360391 | RUB | Да | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 113 | | 985 177 334,37 | 2023.04.02 | Идентификация облигации по номеру облигации | 113 | |
| 17 | Публичное акционерное общество «Академия Фриланс» | 102739609381 | RUB | Да | 4825-05-0305-40 | Идентификация облигации по номеру облигации | 92 | | 448 602 000,00 | 2023.04.02 | Идентификация облигации по номеру облигации | 92 | |

4

| № | Общество с ограниченной ответственностью "Специализированное финансовое общество МСЭ-Эксперт" | 910245339 | 10770024566 | 910245339 | ООО | ИИ | 401-00584-1 | RU000A1028P | 2023.05.26 | 1 140 379 | 79 929 291 49 | Центральная биржа | Цена расчётная НКЦ АО ИРД |
|----|--|-----------|---------------|-----------|-----|----|------------------------|-------------|------------|-----------|------------------|--------------------------------|--|
| 19 | МСП-Эксперт "Экспертная Компания" | 590220276 | 10630202820 | 590220276 | АО | ИИ | 402-04301614-0 ОИР | RU000A1028P | 2022.10.21 | 283 977 | 245 117 200 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 20 | Публичное акционерное общество "Якутия" (полное наименование в уставе) | 140503048 | 102401624187 | 140503048 | ПАО | ИИ | 402-01-020104-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.10.31 | 147 120 | 146 378 848 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 21 | Публичное акционерное общество "Челябинская область" (полное наименование в уставе) | 744093070 | 132740284186 | 744093070 | ПАО | ИИ | 402-05-05102-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.11.28 | 749 822 | 744 652 517 82 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 22 | Акционерное общество "АО ИРД" | 772819187 | 11778904833 | 772819187 | АО | ИИ | 402-05-05487(74)-0 ОИР | RU000A1028P | 2022.12.12 | 820 350 | 754 548 000 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 23 | Публичное акционерное общество "Сбербанк России" | 770795883 | 103770013195 | 770795883 | ПАО | Дз | 402-01-0481-0-002 ОИР | RU000A1028P | 2021.03.11 | 32 | 262 520 143 20 | ИИ | В силу ст.102.1 Федерального закона от 06.12.2007 № 306-ФЗ "Об организации работы на бирже" НКЦ АО ИРД |
| 24 | Публичное акционерное общество Банк "Корпоративные Технологии" | 770502528 | 1027739013528 | 770502528 | ПАО | ИИ | 402-01-102039-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.02.06 | 140 334 | 136 593 954 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 25 | Публичное акционерное общество "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 771037395 | 102773921778 | 771037395 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.02.17 | 104 828 | 100 150 254 40 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 26 | Акционерное общество "Сбербанк России" | 697241304 | 107872002820 | 697241304 | АО | ИИ | 402-01-04010-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.05.24 | 87 500 | 83 962 900 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 27 | Публичное акционерное общество "Восточный федеральный округ" | 771034016 | 102770002381 | 771034016 | ПАО | ИИ | 402-01-04010-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.06.11 | 326 307 | 321 347 193 60 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 28 | Публичное акционерное общество "Академия Финансовых Корпораций "Сбербанк" | 770116430 | 102770000381 | 770116430 | ПАО | ИИ | 402-05-051693-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2021.05.23 | 400 000 | 379 600 000 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 29 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 770512530 | 105716440781 | 770512530 | АО | ИИ | 402-05-11281-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.07.17 | 181 536 | 180 138 172 80 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 30 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 667241304 | 107872002820 | 667241304 | АО | ИИ | 402-05-051693-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.07.22 | 441 779 | 417 348 621 30 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 31 | Публичное акционерное общество "Энергетика" (полное наименование в уставе) | 870510184 | 11774683784 | 870510184 | ПАО | ИИ | 402-01-04145-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2021.01.08 | 203 400 | 196 913 160 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 32 | Публичное акционерное общество "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 973100468 | 118774693281 | 973100468 | ПАО | ИИ | 402-01-04145-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.08.21 | 395 100 | 377 320 980 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 33 | Публичное акционерное общество "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 783385041 | 105074672200 | 783385041 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.05.11 | 100 000 | 94 430 000 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 34 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 771440150 | 118774691141 | 771440150 | АО | ИИ | 402-01-042035-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.05.15 | 148 025 | 138 050 875 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 35 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 770512536 | 10571644078 | 770512536 | АО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.05.15 | 303 200 | 290 708 160 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 36 | Публичное акционерное общество Банк "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 770509528 | 1027739013528 | 770509528 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.08.19 | 83 699 | 67 138 374 40 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 37 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 380917078 | 10340060004 | 380917078 | АО | ИИ | 402-01-043203-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.12.11 | 44 300 | 46 421 976 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 38 | "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 774001487 | 102770016710 | 774001487 | АО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2021.12.27 | 44 100 | 41 483 670 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 39 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 772026187 | 1027739013528 | 772026187 | АО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.10.21 | 226 500 | 174 140 120 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 40 | Публичное акционерное общество "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 763036051 | 105074672200 | 763036051 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.10.24 | 634 559 | 618 846 332 70 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 41 | Публичное акционерное общество "Акционерная компания по обслуживанию клиентов "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 770316430 | 102770000381 | 770316430 | ПАО | ИИ | 402-05-051693-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.11.13 | 988 478 | 947 454 246 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 42 | АО "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 772816871 | 102770007238 | 772816871 | ПАО | Дз | 40101028600P | RU000A1028P | 2023.12.31 | 4 | 40 990 000 00 | ИИ | В силу ст.102.1 Федерального закона от 06.12.2007 № 306-ФЗ "Об организации работы на бирже" НКЦ АО ИРД |
| 43 | Общество с ограниченной ответственностью "СБСЭН БИЗНЕС" | 590809236 | 116200600463 | 590809236 | ООО | ИИ | 402-05-052035-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.06.30 | 140 353 | 140 169 038 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 44 | Акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 970513136 | 119774625743 | 970513136 | АО | ИИ | 401-05-052-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2024.07.02 | 1 233 024 | 1 220 247 868 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 45 | Публичное акционерное общество "РСПД" (полное наименование в уставе) | 380300284 | 102800403377 | 380300284 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.06.28 | 101 403 | 100 977 167 40 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 46 | Акционерное общество "Трудовые Машинные Технологии" (полное наименование в уставе) | 772026187 | 1027739013528 | 772026187 | АО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.24.06 | 18 307 | 18 418 672 70 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |
| 47 | Публичное акционерное общество "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 772051464 | 104779874992 | 772051464 | ПАО | ИИ | 402-05-052031-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.04.16 | 67 814 | 66 183 295 74 | ИИ | ИИ |
| 48 | Публичное акционерное общество "Акционерная компания по обслуживанию клиентов "Сбербанк России" (полное наименование в уставе) | 770316430 | 102770000381 | 770316430 | ПАО | ИИ | 402-05-051693-0-0 ОИР | RU000A1028P | 2023.07.16 | 189 300 | 180 397 940 00 | Рыночные котировки (уровень 1) | - |

| Номер строки | Наименование ценной бумаги (полное наименование) | Сокращенное наименование ценной бумаги | Код (РН) | Дата погашения | Количество ценных бумаг | Стоимость актива | Наименование биржи | Примечание | Цена приобретения ценной бумаги | | |
|--------------|--|--|----------|----------------|-------------------------|------------------|--------------------|-------------------|---------------------------------|---|--|
| 49 | Банк ВТБ (Публичное акционерное общество) | 7702070139 | РАО | НН | 493010083 | RU00A0101442 | 2030.05.21 | 239 | 2 249 276 720,00 | Центральный РФД | Цена приобретения ценной бумаги от 16.02.2010 г. |
| 50 | Акционерное общество "Холдинг Финанс" | 4005102020 | АО | НН | 480204137044-0 ОИР | RU00A0101453 | 2024.11.27 | 53 972 | 55 833 199,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 51 | Акционерное общество "ТрансКредит" | 7705105856 | АО | НН | 480205255834-0 ОИР | RU00A0210139 | 2024.02.15 | 588 919 | 671 538 525,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 52 | Публичное акционерное общество "Интеграция" | 7707017569 | РАО | НН | 480206180701-0 ОИР | RU00A1001010 | 2023.03.15 | 349 429 | 349 428 000,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 53 | Публичное акционерное общество "Чувашский государственный банк" | 7449000730 | РАО | НН | 480207245105-0 ОИР | RU00A0410117 | 2027.05.08 | 533 368 | 521 841 679,20 | РАО Московская Биржа | - |
| 54 | Публичное акционерное общество "РСК-АВ" | 3903109054 | РАО | НН | 480208200744-0 ОИР | RU00A1000580 | 2023.04.16 | 304 397 | 304 446 016,60 | РАО Московская Биржа | - |
| 55 | Публичное акционерное общество "Амурская энергетическая компания" | 7703104630 | РАО | НН | 480209100109-0 ОИР | RU00A1008144 | 2023.03.23 | 611 580 | 514 498 009,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 56 | Акционерное общество "Ленинградский металлургический завод" | 7702061827 | АО | НН | 480210325294-0 ОИР | RU00A0410119 | 2025.12.19 | 179 984 | 173 174 320,20 | РАО Московская Биржа | - |
| 57 | Публичное акционерное общество "Минский металлургический завод" ИММ ЗС "ИММ" | 7710370386 | РАО | НН | 480211200314-0 ОИР | RU00A0410118 | 2027.05.21 | 48 705 | 47 657 279,50 | Центральный РФД | Цена приобретения ценной бумаги от 16.02.2010 г. |
| 58 | Публичное акционерное общество "Туркменметаллургический завод" ИММ ЗС "ИММ" | 7710370396 | РАО | НН | 480212200314-0 ОИР | RU00A0410119 | 2026.04.01 | 171 086 | 167 458 978,80 | РАО Московская Биржа | - |
| 59 | Акционерное общество "Туркменметаллургический завод" ИММ ЗС "ИММ" | 110507200738 | АО | НН | 480213250744-0 ОИР | RU00A1000570 | 2023.05.24 | 378 275 | 375 334 312,50 | РАО Московская Биржа | - |
| 60 | Трудовое общество "Трудовое общество "Трудовое общество" | 7702070188 | АО | НН | 480214322044-0 ОИР | RU00A1000570 | 2024.05.25 | 182 680 | 181 203 267,70 | РАО Московская Биржа | - |
| 61 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 7704201120 | ООО | НН | 480215034644-0 ОИР | RU00A0410139 | 2022.07.05 | 37 082 | 37 075 261,80 | РАО Московская Биржа | - |
| 62 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 102509103489 | ООО | НН | 4802160744-0 ОИР | RU00A0410110 | 2025.08.26 | 5 988 | 0,00 | Модель оценки ликвидности на дату выпуска ценной бумаги (необязательный документ) | НП |
| 63 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 507030559 | ООО | НН | 4802170744-0 ОИР | RU00A0410110 | 2011.01.29 | 120 | 0,00 | Модель оценки ликвидности на дату выпуска ценной бумаги (необязательный документ) | НП |
| 64 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 102704054445 | ООО | НН | 480218030744-0 ОИР | RU00A0210109 | 2022.10.27 | 91 321 | 41 038 231,11 | РАО Московская Биржа | - |
| 65 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 3903100054 | РАО | НН | 480219030744-0 ОИР | RU00A1001151 | 2023.08.30 | 1 552 | 1 538 022,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 66 | Открытое акционерное общество "Трудовое общество" | 7750507561 | ООО | НН | 480220020191-0 ОИР | RU00A1010193 | 2024.08.13 | 338 737 | 336 029 952,30 | РАО Московская Биржа | - |
| 67 | Акционерное общество "Трудовое общество" | 7710160579 | АО | НН | 480221030744-0 ОИР | RU00A1010178 | 2025.06.12 | 273 592 | 271 947 356,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 68 | Общество с ограниченной ответственностью "Трудовое общество" | 7708517168 | ООО | НН | 480222030744-0 ОИР | RU00A1001077 | 2023.05.13 | 1 | 948 53 | РАО Московская Биржа | - |
| 69 | Публичное акционерное общество "Трудовое общество" | 7303030651 | РАО | НН | 480223030744-0 ОИР | RU00A1001048 | 2024.03.27 | 230 090 | 233 903 000,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 70 | Публичное акционерное общество "Трудовое общество" | 7754202860 | РАО | НН | 480224030744-0 ОИР | RU00A1001054 | 2022.03.30 | 91 239 | 92 892 248,20 | РАО Московская Биржа | - |
| 71 | Публичное акционерное общество "Трудовое общество" | 8731004648 | РАО | НН | 480225164044-0 ОИР | RU00A1001051 | 2022.10.18 | 79 145 | 80 852 466 40 | РАО Московская Биржа | - |
| 72 | Публичное акционерное общество "Трудовое общество" | 3903100054 | РАО | НН | 480226030744-0 ОИР | RU00A1010153 | 2023.11.01 | 364 450 | 357 784 204,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 73 | Публичное акционерное общество "Трудовое общество" | 7710160579 | АО | НН | 480227030744-0 ОИР | RU00A1010153 | 2023.05.11 | 30 758 039 727,31 | 30 758 039 727,31 | РАО Московская Биржа | - |

2.2. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

| Номер строки | Наименование ценной бумаги | Сокращенное наименование ценной бумаги | Код (РН) | Дата погашения | Количество ценных бумаг | Стоимость актива | Наименование биржи | Примечание | | | |
|--------------|--|--|----------|----------------|-------------------------|------------------|--------------------|------------|------------------|----------------------|--|
| 1 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710160330 | РАО | НН | 493010083 | RU00A0101442 | 2030.05.21 | 239 | 2 249 276 720,00 | Центральный РФД | Цена приобретения ценной бумаги от 16.02.2010 г. |
| 2 | Министерство финансов Российской Федерации | 4005102020 | АО | НН | 480204137044-0 ОИР | RU00A0101453 | 2024.11.27 | 53 972 | 55 833 199,00 | РАО Московская Биржа | - |
| 3 | Министерство финансов Российской Федерации | 7705105856 | АО | НН | 480205255834-0 ОИР | RU00A0210139 | 2024.02.15 | 588 919 | 671 538 525,00 | РАО Московская Биржа | - |

| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
|-------|--|-------------|-----------|----------|--------------|------------|-------------------|------------------|----------------------|--------------------------------|----|----|----|
| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| 4 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905583 | 771018350 | 2622RWF5 | RU00A103B01 | 2021.07.23 | 3 462 250 | 3 167 413 895,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 5 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905586 | 771018330 | 2623RWF5 | RU00A103B27 | 2020.03.14 | 3 321 47 | 3 369 593 005,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 6 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905839 | 771018340 | 2623RWF5 | RU00A103B16 | 2021.05.15 | 8 547 391 | 7 433 051 166,40 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 7 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2624RWF5 | RU00A103B80 | 2020.07.30 | 8 388 131 | 7 524 781 407,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 8 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905836 | 771018350 | 2622RWF5 | RU00A106B20 | 2023.11.12 | 1 124 466 | 1 046 732 031,16 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 9 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2622RWF5 | RU00A02Z1VQ2 | 2020.10.07 | 360 000 | 302 376 960,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 10 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018320 | 2612RWF5 | RU00A0U1K38 | 2020.01.19 | 343 873 | 328 577 732,38 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 11 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018320 | 2622RWF5 | RU00A0U2K41 | 2023.03.23 | 350 791 | 337 449 597,09 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 12 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2622RWF5 | RU00A02U1B7 | 2024.05.10 | 410 688 | 386 183 151,50 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 13 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905836 | 771018340 | 2622RWF5 | RU00A02U1A8 | 2023.06.23 | 600 000 | 555 629 000,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 14 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2612RWF5 | RU00A101K44 | 2021.10.06 | 410 200 | 393 389 868,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 15 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2612RWF5 | RU00A105B45 | 2020.03.16 | 433 465 | 412 248 849,25 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 16 | Министерство финансов Российской Федерации | 10373905838 | 771018350 | 2622RWF5 | RU00A105B42 | 2023.04.10 | 600 000 | 578 648 000,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| Итого | | | | | | | 26 483 141 117,85 | | | | | | |

2.4. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
|-------|--|---------------|---------------|------------|-------------|------------|------------------|----------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------------|----|----|
| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| 1 | Министерство финансов Московской области | 102602297037 | 102602297037 | 500001451 | RU00A13MCC0 | 2024.11.20 | 310 000 | 297 104 000,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 2 | Министерство финансов Республики Саха (Якутия) | 13142026879 | 13142026879 | 145027273 | RU00A14R510 | 2027.06.12 | 223 814 | 189 513 189,39 | Центробанк РФ | Модель оценки облигаций (уровень 2) | Цена дисконтная НКД по НКД | - | - |
| 3 | Министерство финансов Московской области | 102602297037 | 102602297037 | 500001451 | RU00A101M33 | 2025.07.28 | 330 396 | 312 884 971,20 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 4 | Министерство финансов Свердловской области | 102602297037 | 102602297037 | 661124608 | RU00A102D76 | 2027.11.17 | 39 892 | 27 588 646,69 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 5 | Министерство финансов Московской области | 102602297037 | 102602297037 | 500001451 | RU00A102C90 | 2025.11.10 | 295 154 | 245 267 450,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 6 | Министерство финансов Ульяновской области | 102720178160 | 102720178160 | 742020151 | RU00A102D08 | 2025.11.12 | 148 991 | 113 251 200,82 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 7 | Министерство финансов Омской области | 1046509052414 | 1046509052414 | 650207620 | RU00A102D08 | 2025.11.14 | 79 055 | 73 742 524,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 8 | Министерство финансов Свердловской области | 102602297037 | 102602297037 | 661124608 | RU04018V850 | 2027.11.23 | 101 740 | 86 502 390,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 9 | Министерство финансов Челябинской области | 104742452868 | 104742452868 | 743119570 | RU00A102FV6 | 2027.11.30 | 66 655 | 66 657 163,50 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 10 | Министерство финансов Свердловской области | 102602297037 | 102602297037 | 500001451 | RU00A102D00 | 2027.11.30 | 100 000 | 92 770 000,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 11 | Министерство финансов Свердловской области | 102260193337 | 102260193337 | 2634038133 | RU00A102D04 | 2027.11.14 | 66 778 | 42 803 546,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 12 | Министерство финансов Свердловской области | 102602297037 | 102602297037 | 668104626 | RU04018V850 | 2025.11.16 | 81 982 | 90 457 675,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 13 | Министерство финансов Челябинской области | 1027705052494 | 1027705052494 | 771012413 | RU00A102D20 | 2025.09.18 | 252 764 | 243 180 318,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 14 | Министерство финансов Челябинской области | 1105470023223 | 1105470023223 | 549634648 | RU00A02D294 | 2025.11.15 | 270 265 | 135 132 260,00 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| 15 | Департамент финансов Тюменской области | 1037001007919 | 1037001007919 | 760005985 | RU00A02U1M7 | 2024.11.19 | 68 826 | 61 233 022,84 | Центробанк РФ | Модель оценки облигаций (уровень 2) | Цена дисконтная НКД по НКД | - | - |
| 16 | Министерство финансов Краснодарского края | 1022010111270 | 1022010111270 | 219040020 | RU00A101B60 | 2025.11.12 | 121 978 | 119 818 060,50 | РАО Московская биржа | Рыночные котировки (уровень 1) | - | - | - |
| Итого | | | | | | | 2 292 213 645,75 | | | | | | |

2.4. Муниципальные ценные бумаги

| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
|-------|---|---------------|---------------|-----------|-------------|------------|---------|----------------|---------------|-------------------------------------|----------------------------|----|----|
| № | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| 1 | Министерство финансов Челябинской области | 1037001007919 | 1037001007919 | 760005985 | RU00A02U1M7 | 2024.11.19 | 68 826 | 61 233 022,84 | Центробанк РФ | Модель оценки облигаций (уровень 2) | Цена дисконтная НКД по НКД | - | - |
| 2 | Министерство финансов Челябинской области | 1037001007919 | 1037001007919 | 760005985 | RU00A02U1M7 | 2024.11.19 | 68 826 | 61 233 022,84 | Центробанк РФ | Модель оценки облигаций (уровень 2) | Цена дисконтная НКД по НКД | - | - |
| Итого | | | | | | | 137 654 | 122 466 045,68 | | | | | |

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
|-------|----------------------|--------------|---|------------|------------|-------------|------------|--------|---------------|----------------------|----|----|
| 1 | Акционерное общество | 107070087709 | | 1070700441 | RJ40670101 | RJ000410201 | 2025.12.27 | 99 918 | 94 622 340.00 | ПАО Московская Биржа | | |
| Итого | | | | | | | | | | | | |

2.5. Российские депозитарные расписки

| Номер строки | Наименование эмитента депозитарной расписки (ДР) | Секьюритизированный актив | Код ISIN | Регистрационный номер депозитарной расписки | Код ISIN | Количество депозитарных расписки | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Вид депозитарной расписки | Код ISIN депозитарной расписки | Примечание |
|--------------|--|---------------------------|----------|---|----------|----------------------------------|--------------|----------------|-----------------------|---------------------------|--------------------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | | | |

2.6. Инвестиционные или паевые инвестиционные фонды

| Номер строки | Наименование инвестиционного фонда | Юридический адрес | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество долей | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|------------------------------------|-------------------|----------|----------|----------|------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

2.7. Акции российских акционерных обществ

| Номер строки | Наименование акционерного общества | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество акций | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|------------------------------------|----------|----------|----------|----------|------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

2.8. Векселя российских хозяйственных обществ

| Номер строки | Наименование хозяйственного общества | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество векселей | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|--------------------------------------|----------|----------|----------|----------|---------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

2.9. Облигации с ипотечным покрытием

| Номер строки | Наименование эмитента облигации | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество облигаций | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|---------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

2.10. Ипотечные сертификаты участия

| Номер строки | Наименование эмитента сертификата | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество сертификатов | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|-----------------------------------|----------|----------|----------|----------|-------------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

2.11. Ценные бумаги российских эмитентов (за исключением закладных), не указанные в таблицах пунктов 2.–2.10

| Номер строки | Наименование эмитента ценной бумаги | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество ценных бумаг | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|-------------------------------------|----------|----------|----------|----------|-------------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

3.1. Облигации иностранных коммерческих организаций

| Номер строки | Наименование эмитента облигации | Код страны | Код ISIN | Код ISIN | Код ISIN | Количество облигаций | Дата выпуска | Срок погашения | Номинальная стоимость | Примечание |
|--------------|---------------------------------|------------|----------|----------|----------|----------------------|--------------|----------------|-----------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | | |

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|-----------------------|------------|----------|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 2 | VEON-Holdings B.V. | NLD | 34546933 | | | | | | | | | Blomberg |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.2. Облигации иностранных государств

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|--|------------|------------------|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Республика Казахстан - Лице Министерства Финансов Республики Казахстан | KAZ | БИН-201040000013 | не предоставлен | | | | | | | | |
| 2 | Республика Казахстан - Лице Министерства Финансов Республики Казахстан | KAZ | БИН-201040000013 | не предоставлен | | | | | | | | |
| 3 | Республика Казахстан - Лице Министерства Финансов Республики Казахстан | KAZ | БИН-201040000013 | не предоставлен | | | | | | | | |
| 4 | Республика Беларусь - Лице Министерства Финансов Республики Беларусь | BLR | 10691863 | РБ-40919 | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.3. Облигации международных финансовых организаций

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|--|------------|-----|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Международный банк экономического сотрудничества | 7388 | | не предоставлен | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.4. Иностранное депозитарное расписие

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|--|------------|-----|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Международный банк экономического сотрудничества | 7388 | | не предоставлен | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.5. Пак (ваучи) иностранных инвестиционных фондов

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|-----------------------------------|------------|-----|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Иностранное депозитарное расписие | | | | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.6. Акции иностранных акционерных обществ

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|-----------------------------------|------------|-----|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Иностранное депозитарное расписие | | | | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.7. Иные ценные бумаги иностранных эмитентов

| № строки | Наименование эмитента | Код страны | TIN | Регистрационный номер (идентификационный номер эмитента) | HEX | DTMFR | 2009.09.16 | 643-RUB | 1 200 | 112 856 403.09 | ИП | Модель оценки используемая для определения рыночной стоимости (Дробные 2) |
|----------|-----------------------------------|------------|-----|--|-----|-------|------------|---------|-------|----------------|----|---|
| 1 | Иностранное депозитарное расписие | | | | | | | | | | | |
| итого | | | | | | | | | | | | |

3.8. Информация об организациях, осуществляющих учет и (или) хранение ценных бумаг (только для указания информации по иностранным ценным бумагам)

| № строки | Полное наименование | Регистрационный номер (ИНН) | TIN | Количество ценных бумаг |
|----------|---------------------|-----------------------------|-----|-------------------------|
| 1 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 6 |
| 2 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 35 000 |
| 3 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 104 937 |
| 4 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 582 398 |
| 5 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 700 |
| 6 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 1 200 |
| 7 | ИКСО АЭ ИРД | 7702153310 | - | 1 351 423 |
| итого | | | | |

Подраздел 4. Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества

4.1. Недвижимое имущество

| № п/п | Категория (статья) № п/п | Вид объекта | Назначение объекта | Код страны | Адрес (местоположение) | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|--------------------------|-------------------|--------------------|------------|------------------------|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | Земельный участок | Земельный участок | 5 | 5 | 7 | 8 | 9 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

4.2. Право аренды недвижимого имущества

4.2.1. Право аренды недвижимого имущества (арендодатель – физическое лицо)

| № п/п | Фамилия, имя, отчество арендатора (полное наименование юридического лица) | Категория (статья) № п/п | Вид объекта | Назначение объекта | Код страны | Адрес (местоположение) | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|---|--------------------------|-------------|--------------------|------------|------------------------|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 4 | 5 | 8 | 7 | 9 | 10 | 11 | 12 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

4.2.2. Право аренды недвижимого имущества (арендодатель – юридическое лицо)

| № п/п | Наименование арендодателя (полное наименование юридического лица) | ИН | Адрес арендодателя | Код страны | Назначение объекта | Вид объекта | Адрес (местоположение) объекта | Стоимость актива | Дата окончания срока аренды | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|---|----|--------------------|------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------------|-----------------------------|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 4 | 5 | 8 | 7 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х | Х | Х |

Подраздел 5. Имущественные права (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов)

5.1. Имущественные права из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества

| № п/п | № п/п | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Наименование застройщика | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | ИН | Вид объекта строительства | Назначение объекта строительства | Адрес (местоположение) объекта строительства | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|-------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---|----|---------------------------|----------------------------------|--|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

5.2. Имущественные права, связанные с возникновением права собственности на объект недвижимости (его часть) после завершения его строительства (создание) и возникновение из договора, стороной по которому является юридическое лицо, которому принадлежит право собственности или иное вещное право, включая право аренды, на земельный участок, выделенный в установленном порядке для целей строительства объекта недвижимости, и (или) имеющее разрешение на строительство объекта недвижимости на указанном земельном участке, либо юридическое лицо, инвестирующее денежные средства или иное имущество в строительство объекта недвижимости

| № п/п | № п/п | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Наименование застройщика | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | ИН | Вид объекта строительства | Назначение объекта строительства | Адрес (местоположение) объекта строительства | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|-------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---|----|---------------------------|----------------------------------|--|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

5.3. Имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется строительство объектов недвижимости (в том числе на месте объектов недвижимости) наделением и уставлением прав для целей строительства (создания) указанного объекта недвижимости земельного участка, который (право аренды (которого) составляет актив акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда))

| № п/п | № п/п | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Наименование застройщика | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | ИН | Вид объекта строительства | Назначение объекта строительства | Адрес (местоположение) объекта строительства | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|-------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---|----|---------------------------|----------------------------------|--|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

5.4. Имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимости, составляющих активы акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда)

| № п/п | № п/п | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Наименование застройщика | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | ИН | Вид объекта строительства | Назначение объекта строительства | Адрес (местоположение) объекта строительства | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|-------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---|----|---------------------------|----------------------------------|--|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | Х | 0,00 | Х | Х |

5.5. Иные имущественные права

| № п/п | Степень участия | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|-------|-----------------|------------------|---|------------|
| 1 | 1 | 3 | 4 | 5 |
| Итого | 2 | Х | Х | Х |

Подраздел 6. Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенные закладными

6.1. Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа

6.1.1. Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа (должник – физическое лицо)

| Номер строки | Номер договора (договора займа) | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Код валюты денежных требований по договору займа | Код страны | Зачем или документ (показатель – при наличии – при наличии документа по договору займа) | Способ обеспечения исполнения обязательств по договору | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|------------|---|--|------------------|---|------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |

6.1.2. Денежные требования из кредитных договоров и договоров займа (должник – юридическое лицо)

| Номер строки | Номер договора (договора займа) | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Код валюты денежных требований по договору займа | Код страны | Наличие документа (показатель – при наличии – при наличии документа по договору займа) | Способ обеспечения исполнения обязательств по договору | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|------------|--|--|------------------|---|------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |

6.2. Запасные

6.2.1. Запасные (должник – физическое лицо)

| Номер строки | Номер договора (договора займа) | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Код валюты денежных требований по договору займа | Код страны | Наличие документа (показатель – при наличии – при наличии документа по договору займа) | Способ обеспечения исполнения обязательств по договору | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|------------|--|--|------------------|---|------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |

6.2.2. Запасные (должник – юридическое лицо)

| Номер строки | Номер договора (договора займа) | Дата заключения договора | Срок исполнения договора | Код валюты денежных требований по договору займа | Код страны | Наличие документа (показатель – при наличии – при наличии документа по договору займа) | Способ обеспечения исполнения обязательств по договору | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|------------|--|--|------------------|---|------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 11 | 12 |

Подраздел 7. Производные финансовые инструменты (акции)

| Номер строки | Наименование финансового инструмента | Спринг положе | Код валюты | Количество договоров (контрактов) | Уровень иерархии справедливой стоимости | Справедливая стоимость производного инструмента | Вид базового актива | Идентификатор базового актива | Код ISIN | Регистратор (идентификационный номер выпуска) | Наименование эмитента базового актива (наименование эмитента базового актива) | Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание | | | | |
|--------------|--------------------------------------|---------------|------------|-----------------------------------|---|---|---------------------|-------------------------------|----------|---|---|------------------|---|------------|----|----|----|----|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |

Подраздел 8. Дебиторская задолженность

8.1. Дебиторская задолженность (должник – физическое лицо)

| Номер строки | Вид (описание) задолженности | Дата заключения задолженности | Сумма задолженности | Дата окончания срока задолженности | Код валюты | Сумма задолженности | Код страны | Ссылка на документ (номер документа) | Уровень иерархии справедливой стоимости | Тип сделки РЕПО | Срок РЕПО - дата вступления в силу | Сумма РЕПО | Уровень иерархии справедливой стоимости | Код ISIN | Примечание | | | |
|--------------|------------------------------|-------------------------------|---------------------|------------------------------------|------------|---------------------|------------|--------------------------------------|---|-----------------|------------------------------------|------------|---|----------|------------|----|----|----|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |

8.2. Дебиторская задолженность (должник – юридическое лицо)

| Номер строки | Вид (описание) задолженности | Дата заключения задолженности | Сумма задолженности | Дата окончания срока задолженности | Код валюты | Сумма задолженности | Код страны | Ссылка на документ (номер документа) | Уровень иерархии справедливой стоимости | Тип сделки РЕПО | Срок РЕПО - дата вступления в силу | Сумма РЕПО | Уровень иерархии справедливой стоимости | Код ISIN | Примечание | | | |
|--------------|------------------------------|-------------------------------|---------------------|------------------------------------|------------|---------------------|------------|--------------------------------------|---|-----------------|------------------------------------|------------|---|----------|------------|----|----|----|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 2 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 3 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 4 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 5 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |
| 6 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 |

| 7 | Купоны доход | 4892100168-4401 Р | 4892100168-4401 Р | 2022.04.01 | Публичное акционерное общество «Сбербанк России» | Российская Федерация, Москва г., Мясницкая ул, дом № 13, строение 1 | 10770002981 | - | 7703104800 | RUS | 643-RUB | 15 487 697,80 | 12 487 697,80 | - | - | - | - | - | - |
|-------|--------------|----------------------|----------------------|------------|--|---|-------------|---|------------|-----|---------|----------------|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 8 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.01.04 | Общество с ограниченной ответственностью «Рейд» Банк «Сбербанк России» | Российская Федерация, Москва г., Садовническая наб, дом № 15 корпус 3 | 11078625740 | - | 9705131130 | RUS | 643-RUB | 31 788 219,20 | 31 788 219,20 | - | - | - | - | - | - |
| 9 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.04.13 | Банк ВТБ (Публичное акционерное общество) | Российская Федерация, Татарстан Республика, Дятловский район, д. Мельба А. | 10778069391 | - | 7702070130 | RUS | 643-RUB | 19 352 438,48 | 19 352 438,48 | - | - | - | - | - | - |
| 10 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.05.31 | Банк ВТБ (Публичное акционерное общество) | Российская Федерация, Татарстан Республика, Дятловский район, д. Мельба А. | 10778069391 | - | 7702070130 | RUS | 643-RUB | 16 437 781,80 | 16 437 781,80 | - | - | - | - | - | - |
| 11 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.01.26 | Акционерное общество «Трансстрой Банк» | Российская Федерация, Рязань Область, г. Рязань, ул. Коммунальная, д. 31, помещение 514 | 10767008500 | - | 6872241304 | RUS | 643-RUB | 16 323 734,05 | 16 323 734,05 | - | - | - | - | - | - |
| 12 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.02.02 | Министерство финансов Российской Федерации | Российская Федерация, Москва г., Глазковский пр, дом № 9, строение 1 | 10773086558 | - | 7710186900 | RUS | 643-RUB | 18 221 727,48 | 18 221 727,48 | - | - | - | - | - | - |
| 13 | Купоны доход | РФ0140100405 | РФ0140100405 | 2022.05.16 | Министерство финансов Российской Федерации | Российская Федерация, Москва г., Мясницкая ул, дом № 9, строение 1 | 10773086558 | - | 7710186900 | RUS | 643-RUB | 294 384 079,79 | 294 384 079,79 | - | - | - | - | - | - |
| Итого | | | | | | | | | | | | 832 662 098,32 | 832 662 098,32 | | | | | | |

Подраздел 3. Иные инструменты, не указанные в подразделах 1-8

9.1. Доля в уставных капиталах российских обществ с ограниченной ответственностью

| Номер строки | Наименование организации | Ссылка на сайт | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | Дата приобретения доли | Вид деятельности | Размер доли в уставном капитале | Стоимость вклада | Уровень иерархии | Примечание |
|--------------|--------------------------|----------------|---|------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|------------------|------------|
| | | | | | | | | | |
| 1 | | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | | |

9.2. Права участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций

| Номер строки | Наименование организации | Код страны | ТН | Вид деятельности | Размер доли в уставном капитале | Стоимость вклада | Уровень иерархии | Примечание |
|--------------|--------------------------|------------|----|------------------|---------------------------------|------------------|------------------|------------|
| | | | | | | | | |
| 1 | | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | | |

9.3. Проектная документация для строительства или реконструкции объекта недвижимости

| Номер строки | Вид объекта | Наименование объекта | Код страны | Адрес | Стоимость вклада | Уровень иерархии | Примечание |
|--------------|-------------|----------------------|------------|-------|------------------|------------------|------------|
| | | | | | | | |
| 1 | | | | | | | |
| Итого | | | | | | | |

Подраздел 3.4. Драгоценные металлы

| Номер строки | Вид драгоценного металла | Масса драгоценного металла | Место хранения | Стоимость вклада | Уровень иерархии | Примечание |
|--------------|--------------------------|----------------------------|----------------|------------------|------------------|------------|
| | | | | | | |
| 1 | | | | | | |
| Итого | | | | | | |

9.5. Требования кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов по текущему курсу

| Номер строки | Вид драгоценного металла | Масса драгоценного металла | Наименование организации | Стоимость вклада | Уровень иерархии | Примечание |
|--------------|--------------------------|----------------------------|--------------------------|------------------|------------------|------------|
| | | | | | | |
| 1 | | | | | | |
| Итого | | | | | | |

9.6. Художественные ценности

| 2 | Рыночные котировки | 645-RUB | Правительственное управление | Не установлена | Американская биржа ВТБ Клиринг Управление | 1027793260 | 770142986 | - | Российская Федерация, Республика Крым | RUS | 14,484,760,52 | 14,484,760,52 | Российская Федерация, Республика Крым | Российская Федерация, Республика Крым | Российская Федерация, Республика Крым | Российская Федерация, Республика Крым | Российская Федерация, Республика Крым | Российская Федерация, Республика Крым |
|----|--------------------|---------|------------------------------|----------------|--|------------|-----------|---|---|--|---------------|---------------|---|--|---|--|---|---------------------------------------|
| 1 | Рыночные котировки | 645-RUB | Правительственное управление | 2022.01.21 | Американская биржа ВТБ Клиринг Управление <td>1027793260</td> <td>770142986</td> <td>-</td> <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>RUS <td>47,352,442,19</td> <td>47,352,442,19</td> <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td></td></td></td></td></td> | 1027793260 | 770142986 | - | Российская Федерация, Республика Крым <td>RUS <td>47,352,442,19</td> <td>47,352,442,19</td> <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td></td></td></td></td> | RUS <td>47,352,442,19</td> <td>47,352,442,19</td> <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td></td></td></td> | 47,352,442,19 | 47,352,442,19 | Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td></td></td> | Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td></td> | Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td></td> | Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td></td> | Российская Федерация, Республика Крым <td>Российская Федерация, Республика Крым </td> | Российская Федерация, Республика Крым |
| 18 | Итого | | | | | | | | | | 69,222,959,79 | 69,222,959,79 | | | | | | |

Подраздел 3. Проведение финансовых инструментов

| Номер строки | Идентификатор финансового инструмента | Сторона позиции | Код валюты | Количество договоров (контрактов) | Уровень маржи (справедливая стоимость) | Вид базисного актива | Наименование вида инвестирования | Идентификатор базисного актива | Код ISIN | Регистрационный номер и номер выпуска | Наименование эмитента ценной бумаги (бумаг) | Наименование биржевого сектора процентной ставки или валюты | Идентификатор эмитента | Количество единиц базисного актива | Рыночная стоимость | Примечание |
|--------------|---------------------------------------|-----------------|------------|-----------------------------------|--|----------------------|----------------------------------|--------------------------------|----------|---------------------------------------|---|---|------------------------|------------------------------------|--------------------|------------|
| 1 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 18 | | | | | | | | | | | | | | | | |

Пояснительная записка к справке о стоимости чистых активов

Информация о фактах совершения ошибок, потребовавших перерасчета стоимости чистых активов, а также о принятых мерах по исправлению и последующим исправлениям таких ошибок

| Номер строки | Информация о фактах совершения ошибок, потребовавших перерасчета стоимости чистых активов | Информация о принятых мерах по исправлению ошибок |
|--------------|---|---|
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |

Информация о фактах возникновения разногласий со специализированным депозитарием при расчете стоимости чистых активов, а также о принятых мерах по предоставлению этих разногласий

| Номер строки | Информация о фактах возникновения разногласий со специализированным депозитарием при расчете стоимости чистых активов | Информация о принятых мерах по предоставлению этих разногласий |
|--------------|---|--|
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |

Сведения о событиях, которые оказали существенное влияние на стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда или чистых активов паевого инвестиционного фонда

| Номер строки | Сведения о событиях, которые оказали существенное влияние на стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда или чистых активов паевого инвестиционного фонда |
|--------------|---|
| 1 | |
| 2 | |

Информация, не указанная в разделе I-III

| Номер строки | Иная информация |
|--------------|-----------------|
| 1 | |
| 2 | |

Руководитель акционерного инвестиционного фонда (лицо, исполняющее обязанности руководителя акционерного инвестиционного фонда) (уполномоченный сотрудник паевого инвестиционного фонда)

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



**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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
|--|---|---|--|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Январь 2021 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 | -20 519 371,09 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных) | 01.01 | -2 331 891,01 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | -15 656 923,10 |
| 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 залладными | 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 | -2 530 556,98 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего | 02 | 98 307 035,17 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных) | 02.01 | -18 830 968,32 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | 10 288 059,23 |
| 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 залладными | 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 | -279 110,56 |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях | 02.12 | 107 129 054,82 |

| | | |
|--|-------|------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 372 233 656,46 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 372 233 656,46 |
| дивиденды по акциям акционерных обществ | 03.03 | 0,00 |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов | 03.04 | 0,00 |
| распределение прибыли общества 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 | 49 392 345,29 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 44 030 174,55 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 362 170,74 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 1 153 796,63 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 464 905 588,39 |
| Прочие расходы | 09 | 53 716 812,95 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 2 785 149 691,05 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -758 407 149,92 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 416 704 222,33 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -502 989 137,03 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | 2 751 121 580,49 |

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 ⁴⁷ | Наименование эмитента ценной бумаги | ИНН (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------------|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов – всего | 1 | | x | | | 21 033 419 000,00 | 21 038 444 910,58 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| 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 | | | 21 033 419 000,00 | 21 038 444 910,58 | |
| 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 | 1 800 520 000,00 | 1 802 160 491,17 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYP02 | 01.11 | | | RU000A0ZYP02 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 5 297 379 000,00 | 5 298 094 523,20 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 13 935 520 000,00 | 13 938 189 896,21 |
| 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)

Ю.Ю.Абушева
(инициалы, фамилия)

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



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

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

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
|--|---|---|--|---|
| Полное наименование акционерного инвестиционного фонда (полное название паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии акционерного инвестиционного фонда (регистрационный номер правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| 1 | 2 |
|-----------------|---|
| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
| Февраль 2021 г. | RUB |

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

| 1 | 2 | 3 |
|---|------------|--|
| Наименование показателя | Код строки | Значение показателя за отчетный период |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего | 01 | 3 546 892,51 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 7 318 846,21 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | -3 771 953,70 |
| 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 | -487 950 306,05 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -373 075 935,98 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -11 055 612,72 |
| 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 | -103 818 757,35 |

| | | |
|--|-------|------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 360 360 306,80 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 360 360 306,80 |
| 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 (иностранных 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 | 62 759 740,02 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 57 388 646,10 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 371 093,92 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 3 082 752,81 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 62 759 754,05 |
| Прочие расходы | 09 | 70 014 148,24 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 3 199 064 830,03 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -795 427 251,98 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 288 745 106,77 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -667 662 159,01 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | 1 827 580 532,05 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|--------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 17 180 349 832,60 | 17 183 126 724,63 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 2 803 009 832,60 | 2 803 609 814,66 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 014, 29014RMFS | 01.03 | 29014RMFS | RU000A101N52 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1 313 965 877,60 | 1 314 401 106,30 |
| Минфин России, 020, 29020RMFS | 01.03 | 29020RMFS | RU000A102BV4 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1 297 970 800,00 | 1 298 113 043,37 |
| Минфин России, 230, 26230RMFS | 01.03 | 26230RMFS | RU000A100EF5 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 191 073 155,00 | 191 095 664,99 |
| 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 |

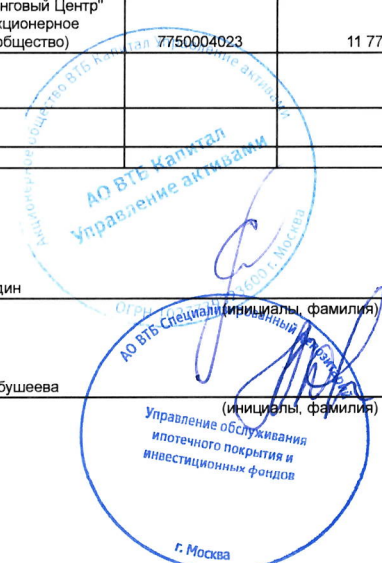
| | | | | | | | | |
|---|--------|--|---|--------------|---|-------------------|-------------------|-------------------|
| в том числе: по каждому инвестиционному паю | 1.06.1 | | x | | | | | |
| ... | | | | | | | | |
| векселя | 1.07 | | x | | | 0,00 | 0,00 | |
| в том числе: по каждому векселю | 1.07.1 | | 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 | | | 14 377 340 000,00 | 14 379 516 909,97 | |
| 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 | 656 900 000,00 | 656 973 788,77 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | | RU000A0ZYPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 1 947 615 000,00 | 1 948 051 166,01 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 11 772 825 000,00 | 11 774 491 955,19 |
| 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

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

Ю.Ю.Абушеева



(инициалы, фамилия)

(инициалы, фамилия)

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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
|--|---|---|--|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Март 2021 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 | 14 176 546,14 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 13 301 221,14 |
| 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 | 875 325,00 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего | 02 | -316 192 169,63 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -304 419 168,00 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -5 709 513,22 |
| 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 | -6 063 468,41 |

12

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 447 480 950,10 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 447 480 950,10 |
| 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 (иностранных 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 | 74 022 734,05 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 67 578 090,16 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 6 444 643,89 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 4 123 898,65 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 80 686 557,50 |
| Прочие расходы | 09 | 82 445 286,06 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 2 768 338 147,82 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 185 830 586,96 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 168 599 820,15 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -938 940 666,04 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | 877 726 680,32 |

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 ⁴⁷ | Наименование эмитента ценной бумаги | ИНН (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|------------------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 9 657 052 996,80 | 9 658 907 904,88 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 87 745 996,80 | 87 775 926,60 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 15, 26215RMFS | 01.03 | 26215RMFS | RU000A0J U4L3 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 87 745 996,80 | 87 775 926,60 |
| 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 | | | 9 569 307 000,00 | 9 571 131 978,28 | |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYP02 | 01.11 | | | RU000A0ZYP02 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 4 295 240 000,00 | 4 296 200 599,27 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 5 274 067 000,00 | 5 274 931 379,01 |
| 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)

Ю.Ю.Абушеева

(инициалы, фамилия)



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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
|--|---|---|--|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «БТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Апрель 2021 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 | -8 723 073,71 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | -8 903 064,91 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 179 991,20 |
| 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 | -142 593 128,87 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -131 886 378,12 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -11 101 769,98 |
| 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 | 112 173,43 |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях | 02.12 | 282 845,80 |

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 422 835 673,64 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 422 835 673,64 |
| 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 | 73 603 240,89 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 67 726 085,08 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 877 155,81 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 2 259 321,74 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 73 603 365,04 |
| Прочие расходы | 09 | 82 625 823,79 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 1 661 886 414,10 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 232 610 417,06 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 237 165 084,88 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -1 285 739 610,92 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -432 664 079,32 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|---------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 722 104 358,06 | 722 205 984,89 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 75 364 358,06 | 75 373 257,25 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 008, 29008RMFS | 01.03 | 29008RMFS | RU000A0J V4P3 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 75 364 358,06 | 75 373 257,25 |
| 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 | | | 646 740 000,00 | 646 832 727,64 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | | RU000A0ZYPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 131 180 000,00 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 515 560 000,00 |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего | 2 | | x | | | | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 2.1 | | x | | | | 0,00 |
| ... | | | | | | | |

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

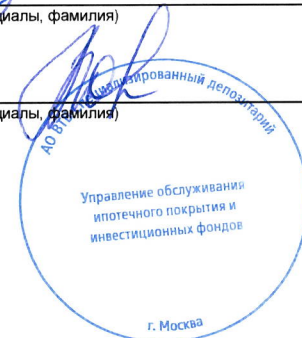
С.Г.Дюдин

(инициалы, фамилия)

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

Ю.Ю.Абушеева

(инициалы, фамилия)



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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
|--|---|---|--|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Май 2021 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 | 174 811,14 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 174 808,24 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 2,90 |
| 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 | -241 156 810,13 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -237 211 392,43 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -3 927 783,05 |
| 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 | -17 634,65 |

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 433 043 445,02 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 433 043 445,02 |
| 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 (иностранных 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 | 64 244 963,23 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 58 200 305,61 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 6 044 657,62 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 1 267 667,57 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 64 244 963,23 |
| Прочие расходы | 09 | 71 004 372,85 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 1 260 004 057,23 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -992 047 589,09 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные пай данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 132 019 209,77 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные пай других паевых инвестиционных фондов | 13 | -1 364 219 119,28 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -844 454 035,76 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|--------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 3 802 692 452,72 | 3 803 498 585,23 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 354 883 452,72 | 354 931 094,61 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 29012RMFS | 01.03 | 29012RMFS | RU000A0JX0H6 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 354 883 452,72 | 354 931 094,61 |
| 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 пай, 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 пай, 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 | | | 3 447 809 000,00 | 3 448 567 490,62 | |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | |
| КСУ - акции RU000A0JWKG5 | 01.11 | | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | RU000A0JWKG5 | 7750004023 | 1 112 550 000,00 | 1 112 983 638,49 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | RU000A0JW4Z1 | 7750004023 | 2 335 259 000,00 | 2 335 583 852,13 |
| 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))

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

С.Г.Дюдин (инициалы, фамилия)

АО ВТБ Капитал
Управление активами

Ю.Ю.Абушева (инициалы, фамилия)

АО ВТБ Специализированный депозитарий

Управление обслуживания ипотечного покрытия и инвестиционных фондов

г. Москва

Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами
ОГРН 1027739323600 г. Москва

**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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен) |
|--|---|---|--|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Июнь 2021 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 | -197 986,83 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных) | 01.01 | 538 310,86 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 790,00 |
| 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 залладными | 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 | -737 087,69 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего | 02 | -187 004 347,36 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных) | 02.01 | -181 064 357,96 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -7 100 518,76 |
| 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 залладными | 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 | -70 568,48 |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях | 02.12 | 1 231 097,84 |

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 409 262 256,67 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 409 262 256,67 |
| 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 (иностранных 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 | 68 298 109,19 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 62 399 909,31 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 898 199,88 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 1 253 976,45 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 73 406 431,83 |
| Прочие расходы | 09 | 80 032 154,22 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 711 280 941,73 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 819 455 117,99 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 150 200 141,67 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -1 935 908 130,65 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -2 748 000 050,79 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|---------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 1 405 583 710,17 | 1 405 909 879,26 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 268 833 710,17 | 268 870 335,03 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 020, 29020RMFS | 01.03 | 29020RMFS | RU000A10 2BV4 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 6 007 824,44 | 6 008 721,50 |
| Минфин России, 26212RMFS | 01.03 | 26212RMFS | RU000A0J TK3B | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 65 385 358,35 | 65 395 121,37 |
| Минфин России, 002, 52002RMFS | 01.03 | 52002RMFS | RU000A0Z YZ26 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 197 440 527,38 | 197 466 492,16 |
| 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 | | | 1 136 750 000,00 | 1 137 039 544,23 |
| 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 | 1 950 000,00 1 950 288,49 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | | RU000A0ZYPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 474 520 000,00 474 590 189,54 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 660 280 000,00 660 499 066,20 |
| 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)

Ю.Ю.Абушьева

(инициалы, фамилия)



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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен)) |
|--|---|---|--|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Июль 2021 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 | 6 907 382,57 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 6 759 395,60 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 57 618,17 |
| 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 | 90 368,80 |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего | 02 | 213 288 185,47 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | 217 680 307,32 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -4 409 343,85 |
| 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 | 17 222,00 |

25

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 404 008 748,26 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 404 008 748,26 |
| 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 (иностранных 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 | 69 131 466,99 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 63 283 245,62 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 848 221,37 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 3 305 666,71 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 78 029 829,79 |
| Прочие расходы | 09 | 80 098 334,52 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 548 421 593,21 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 717 902 862,04 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 261 260 375,89 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -1 511 883 436,92 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -1 870 405 651,99 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|--|------------|---------------------------------------|--------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 11 222 245 061,73 | 11 224 759 257,15 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 290 525 061,73 | 290 569 041,80 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 003, 52003RMFS | 01.03 | 52003RMFS | RU000A102069 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 51 445 566,48 | 51 452 754,76 |
| Минфин России, 52001RMFS | 01.03 | 52001RMFS | RU000A0JVMH1 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 93 210 324,48 | 93 225 135,98 |
| Минфин России, 10, 29010RMFS | 01.03 | 29010RMFS | RU000A0JV4Q1 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 145 869 170,77 | 145 891 151,06 |
| 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 |

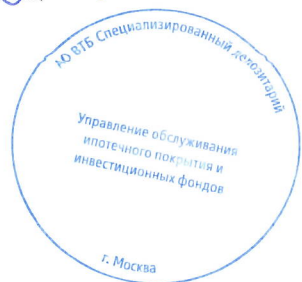
| | | | | | | | |
|---|--------|--|---|--------------|---|-------------------|-----------------------------------|
| в том числе: по каждому инвестиционному паю | 1.06.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| векселя | 1.07 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому векселю | 1.07.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| 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 | | | 10 931 720 000,00 | 10 934 190 215,35 |
| 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 | 624 700 000,00 624 995 234,94 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYP02 | 01.11 | | | RU000A0ZYP02 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 678 320 000,00 678 420 974,79 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 9 628 700 000,00 9 630 774 005,62 |
| 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))

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

С.Г. Дюдин
(инициалы, фамилия)

Ю.Ю. Абушева
(инициалы, фамилия)



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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен) |
|--|---|---|--|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Август 2021 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 | 20 011 331,93 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных) | 01.01 | 20 010 924,23 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 407,70 |
| 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 залладными | 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 | -235 399 669,98 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных) | 02.01 | -231 682 143,01 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -3 717 839,78 |
| 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 залладными | 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 | 312,81 |

27

| | | |
|--|-------|-------------------|
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 428 961 799,26 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 428 961 799,26 |
| 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 (иностранных 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 | 67 578 448,55 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 61 512 601,53 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 6 065 847,02 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 7 306 933,10 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 67 578 448,55 |
| Прочие расходы | 09 | 73 757 413,78 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 551 610 172,06 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 560 673 916,81 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 95 332 500,78 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -1 541 156 105,25 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -2 322 378 234,89 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|---|------------|---------------------------------------|---------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 19 804 324 956,20 | 19 808 365 363,11 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 13 827 404 956,20 | 13 830 147 476,44 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 014, 29014RMFS | 01.03 | 29014RMFS | RU000A101N52 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 3 244 055 166,45 | 3 244 618 992,74 |
| Минфин России, 237, 26237RMFS | 01.03 | 26237RMFS | RU000A103827 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1 716 091 504,50 | 1 716 392 883,05 |
| Минфин России, 26, 26226RMFS | 01.03 | 26226RMFS | RU000A0Z ZYW2 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 200 634 941,25 | 200 666 273,28 |
| Минфин России, 25, 26225RMFS | 01.03 | 26225RMFS | RU000A0Z YUB7 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 3 240 759 382,32 | 3 241 330 447,18 |
| Минфин России, 15, 26215RMFS | 01.03 | 26215RMFS | RU000A0J U4L3 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 336 585 135,74 | 336 645 075,56 |
| Минфин России, 22, 26222RMFS | 01.03 | 26222RMFS | RU000A0J XQF2 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 627 623 507,20 | 627 932 367,26 |
| Минфин России, 230, 26230RMFS | 01.03 | 26230RMFS | RU000A10 0EF5 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 2 699 170 774,94 | 2 699 966 555,80 |
| Минфин России, 228, 26228RMFS | 01.03 | 26228RMFS | RU000A10 0A82 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 778 802 943,80 | 778 942 701,59 |

| | | | | | | | |
|--|--------|-----------|------------------|--|------------|------------------|------------------|
| Минфин России, 26223RMFS | 01.03 | 26223RMFS | RU000A0Z YU88 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 983 481 600,00 | 983 652 159,96 |
| 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 (коносамента, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | 1.11 | | x | | | 5 976 920 000,00 | 5 978 217 886,67 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | |
| КСУ - акции RU000A0JWKG5 | 01.11 | | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 1 031 180 000,00 | 1 031 430 420,17 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 4 945 740 000,00 | 4 946 787 466,50 |
| 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))

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

С.Г.Дюдин

(инициалы, фамилия)

Ю.Ю.Абушева

(инициалы, фамилия)



**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) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда (если присвоен) |
|--|---|---|--|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | Акционерное общество ВТБ Капитал Управление активами | 21-000-1-00059 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|------------------|---|
| 1 | 2 |
| Сентябрь 2021 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 | 12 383 839,44 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 12 124 639,44 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 259 200,00 |
| 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 | -713 724 202,66 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -707 858 340,97 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -5 865 198,93 |
| 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 | -662,76 |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 399 423 863,96 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетах по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 399 423 863,96 |
| 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 (иностранных 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 | 64 776 757,68 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 59 292 968,24 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 5 483 789,44 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 2 593 377,29 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 64 776 757,68 |
| Прочие расходы | 09 | 71 083 046,70 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 436 858 984,92 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 323 967 610,14 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 323 386 561,27 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -2 069 774 136,07 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -3 009 089 123,27 |

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 (TIN) эмитента представляемых ценных бумаг | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда | |
|---|------------|---------------------------------------|---------------|--|--|--|-------------------|
| | | | | | | оборот по покупке | оборот по продаже |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | 1 | | x | | | 2 666 423 949,48 | 2 667 037 867,04 |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.01 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.01.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.02 | | x | | | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой акции | 1.02.1 | | x | | | | |
| ... | | | | | | | |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг | 1.03 | | x | | | 263 713 949,48 | 263 780 741,79 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | |
| Минфин России, 019, 29019RMFS | 01.03 | 29019RMFS | RU000A10 2A49 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 165 186 583,52 | 165 214 190,04 |

| | | | | | | | |
|---|--------|-----------|--------------|---|------------|------------------|------------------|
| Минфин России, 238, 26238RMFS | 01.03 | 26238RMFS | RU000A1038V6 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 56 476 152,00 | 56 507 623,92 |
| Минфин России, 228, 26228RMFS | 01.03 | 26228RMFS | RU000A100A82 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 13 432 523,86 | 13 435 007,96 |
| Минфин России, 10, 29010RMFS | 01.03 | 29010RMFS | RU000A0JV4Q1 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 28 618 690,10 | 28 623 919,87 |
| 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 | | | | |
| ... | | | | | | | |
| деPOSITные 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 (коносамента, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | 1.11 | | x | | | 2 402 710 000,00 | 2 403 257 125,25 |
| 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 | 435 860 000,00 | 435 955 541,56 |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | RU000A0ZYPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 124 520 000,00 | 124 543 006,62 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | 1 842 330 000,00 | 1 842 758 577,07 |
| 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)

Ю.Ю.Абушеева

(инициалы, фамилия)





**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 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Октябрь 2021 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 | 11 520 695,07 |
| в том числе в результате сделок с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 11 520 501,24 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 193,83 |
| 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 | -1 731 706 571,05 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -1 706 426 876,53 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -25 277 869,73 |
| 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 | -1 824,79 |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 373 532 720,23 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 373 532 720,23 |
| дивиденды по акциям акционерных обществ | 03.03 | 0,00 |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов | 03.04 | 0,00 |
| распределение прибыли общества с ограниченной ответственностью (иностранного коммерческого организации) | 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 | 61 319 554,17 |
| в том числе управляющей компании | 05.01 | 53 013 576,10 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 8 305 978,07 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 1 962 070,64 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 61 319 566,94 |
| Прочие расходы | 09 | 63 528 939,38 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 286 921 955,77 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -2 165 000 113,07 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 165 989 639,05 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -2 900 850 607,40 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -6 025 083 278,65 |

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 | | | | | 572 705 532,50 | 572 818 793,36 |
| 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 | | | | | 96 535 532,50 | 96 553 252,72 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | | | |
| Минфин России, 017_29017RMFS | 01.03 | 29017RMFS | RU000A1028D5 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | | 1037739085636 | 96 535 532,50 | 96 553 252,72 |
| 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 (консольные, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | 1.11 | | x | | | | | 476 170 000,00 | 476 265 540,64 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | | |
| KCY GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | RU000A0JW4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 476 170 000,00 | 476 265 540,64 |
| 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)

Ю.Ю.Абушеева

(инициалы, фамилия)



**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 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «БТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Ноябрь 2021 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 | 39 390 758,07 |
| в том числе в результате сделок с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных) | 01.01 | 39 440 680,60 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | -49 922,53 |
| 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 | -1 030 479 046,33 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных) | 02.01 | -1 016 658 598,95 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | -13 824 081,39 |
| 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 | 3 634,01 |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 379 278 675,84 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 379 278 675,84 |
| 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 (иностранных 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 | 50 532 259,45 |
| в том числе управляющей компании | 05.01 | 45 560 294,20 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 4 971 965,25 |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 2 376 863,87 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 50 532 259,45 |
| Прочие расходы | 09 | 54 559 632,19 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 362 062 445,58 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 998 693 496,99 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 254 636 919,94 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -2 706 053 090,62 |
| Итого прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -4 756 793 330,57 |

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 | | | | | 2 996 464 417,90 | 2 998 004 991,65 |
| 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 | | | | | 25 354 417,90 | 25 370 672,51 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | | | |
| Минфин России, 10_29010RMFS | 01.03 | 29010RMFS | RU000A0J V4Q1 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | | 1037739085636 | 25 354 417,90 | 25 370 672,51 |
| 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 | | | | | 2 971 110 000,00 | 2 972 634 319,14 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | | |
| КСУ - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | RU000A0Z YPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 80 700 000,00 | 80 716 272,66 |
| КСУ GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | RU000A0J W4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 2 890 410 000,00 | 2 891 918 046,48 |

| | | | | | | | | | |
|--|-----|--|---|--|--|--|--|------|------|
| Иностраные 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)

Ю.Ю. Абушеева

(инициалы, фамилия)



**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 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | 59893097 |

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

| Отчетный период | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|-----------------|---|
| 1 | 2 |
| Декабрь 2021 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 | 6 319 295,65 |
| в том числе в результате сделок: | | |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залповых) | 01.01 | 6 299 158,24 |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов | 01.02 | 20 137,41 |
| 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 залповыми | 01.05 | 0,00 |
| с долями в уставных капиталах общества 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 | 313 785 807,99 |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости: | | |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залповых) | 02.01 | 305 449 418,36 |
| ценных бумаг иностранных эмитентов | 02.02 | 8 337 473,37 |
| 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 залповыми | 02.05 | 0,00 |
| долей в уставных капиталах общества 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 | -1 083,74 |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего | 03 | 341 153 847,35 |
| в том числе: | | |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту) | 03.01 | 0,00 |
| процентный доход по облигациям | 03.02 | 341 153 847,35 |
| 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 | 53 409 000,50 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 05.01 | 47 352 442,19 |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже | 05.02 | 6 116 638,39 |

35

| | | |
|--|----|-------------------|
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом | 06 | 2 366 020,20 |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паевым инвестиционным фондам) | 07 | 0,00 |
| Прочие доходы | 08 | 53 469 080,58 |
| Прочие расходы | 09 | 56 697 194,30 |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 10 | 764 077 336,45 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 11 | -1 887 803 465,78 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 12 | 238 563 425,91 |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | -952 179 838,84 |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13) | 14 | -1 235 146 805,77 |

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 | | | | | 917 675 185,36 | 917 952 708,44 |
| 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 | | | | | 84 325 185,36 | 84 342 651,07 |
| в том числе: по каждой облигации | 1.03.1 | | x | | | | | | |
| Минфин России, 228, 26228RMFS | 01.03 | 26228RMFS | RU000A10 0A82 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | | 1037739085636 | 84 325 185,36 | 84 342 651,07 |
| 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 | | | | | 833 350 000,00 | 833 610 057,37 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге | 1.11.1 | | x | | | | | | |
| KCY - акции RU000A0JWKG5 | 01.11 | | RU000A0J WKG5 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 230 050 000,00 | 230 112 451,58 |
| KCY - не прин. в обеспеч RU000A0ZYPO2 | 01.11 | | RU000A0Z YPO2 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 153 750 000,00 | 153 784 751,71 |
| KCY GC Bonds RU000A0JW4Z1 | 01.11 | | RU000A0J W4Z1 | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) | 7750004023 | | 1067711004481 | 449 550 000,00 | 449 712 854,08 |
| 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. Дудин

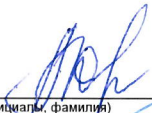
АО ВТБ Капитал
Управление активами

(инициалы, фамилия)

ОГРН 1027739323600 г. Москва

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

Ю.Ю. Абушеева


(инициалы, фамилия)



Отчет о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (имуществом, составляющим 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) акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) |
|--|---|---|
| 1 | 2 | 3 |
| Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «ВТБ – Фонд Казначейский» | 0089 | 59893097 |

Раздел II. Параметры отчета о вознаграждениях и расходах

| Текущий отчетный год | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|----------------------|---|
| 1 | 2 |
| 2021 | RUB |

Раздел III. Сведения о вознаграждениях и расходах, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом (доверительным управлением паевым инвестиционным фондом)

| Наименование показателя | Код строки | Значение показателя на текущую отчетную дату |
|--|------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| Сумма вознаграждений, начисленных за услуги, оказанные в течение отчетного года – всего | 01 | 759 128 700,09 |
| в том числе: | | |
| управляющей компании | 01.01 | 687 338 338,69 |
| специализированному депозитарию | 01.02 | 62 345 512,41 |
| лицу, осуществляющему ведение реестра акционеров акционерного инвестиционного фонда (владелец паев инвестиционного фонда) | 01.03 | 4 385 848,99 |
| оценщику | 01.04 | 0,00 |
| аудиторской организации | 01.05 | 5 059 000,00 |
| бирже | 01.06 | 0,00 |
| Сумма расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (имуществом, составляющим паевой инвестиционный фонд), - всего | 02 | 33 052 345,66 |
| в том числе (по видам расходов) | | |
| расходы специализированного депозитария по оплате услуг других депозитариев, привлеченных им к исполнению своих обязанностей по хранению и (или) учету прав на ценные бумаги, составляющие имущество Фонда, расходы специализированного депозитария, связанные с операциями по переходу прав на указанные ценные бумаги в системе ведения реестра владельцев ценных бумаг, а также расходы специализированного депозитария, связанные с оплатой услуг кредитных организаций по осуществлению функций агента валютног | 02.01 | 7 315 114,93 |
| оплата услуг организаций, индивидуальных предпринимателей по совершению сделок за счет имущества Фонда от имени этих организаций, индивидуальных предпринимателей или от имени управляющей компании, осуществляющей доверительное управление указанным имуществом | 02.02 | 25 724 256,07 |
| ИТОГО сумма вознаграждений и расходов (сумма строк 01+02) | 03 | 792 181 045,75 |

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)

Ю.Ю. Абушеова

(инициалы, фамилия)



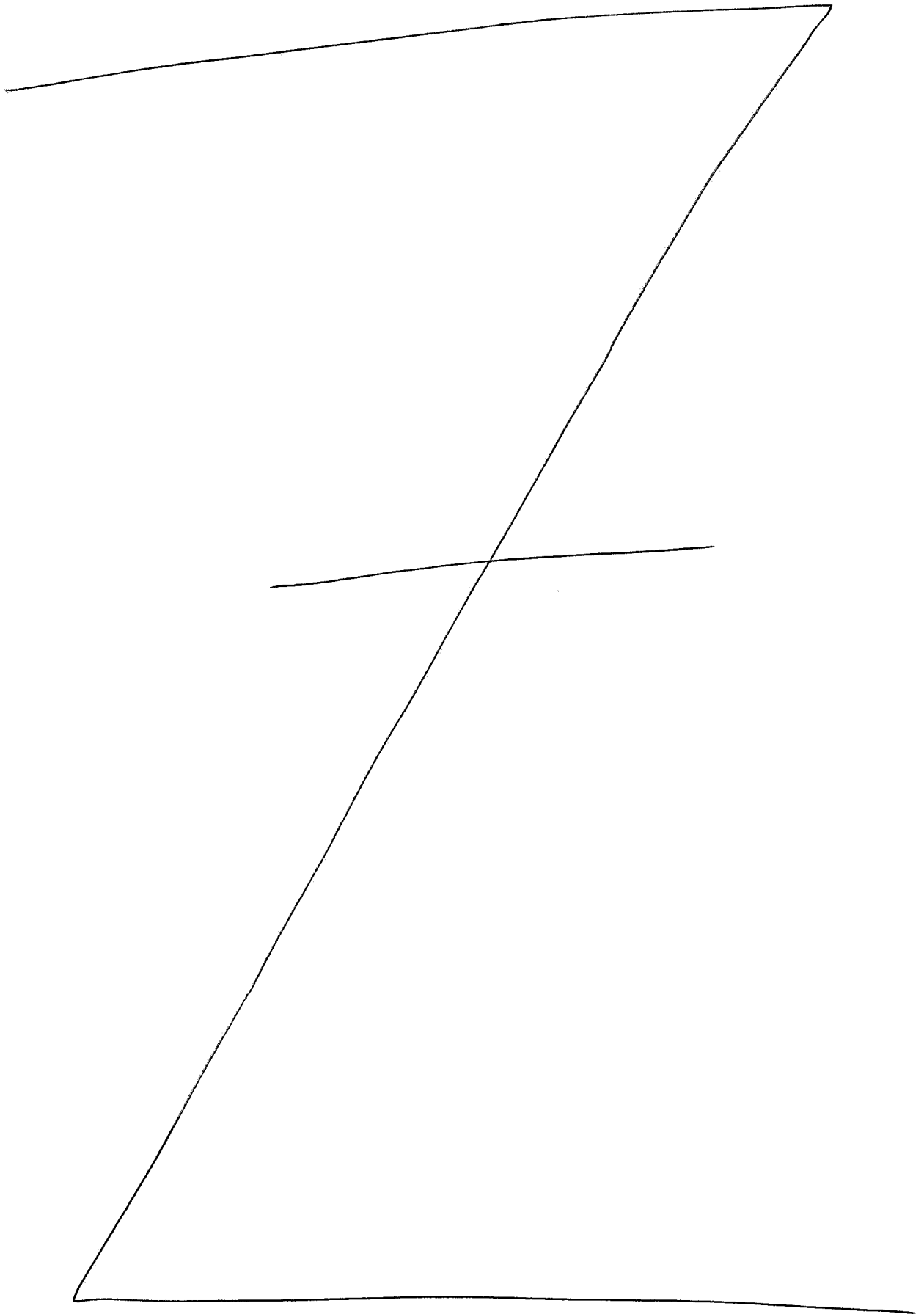
Пояснительная записка
к годовой отчетности паевого инвестиционного фонда за 2021г.

Отчетность в отношении имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, и операций с этим имуществом составлена в соответствии с требованиями, установленными Федеральным Законом от 29.11.2001 №156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», Указанием Банка России от 08.02.2018 №4715-У «О формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов», Указанием Банка России от 05.09.2016 №4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов», Указанием Банка России от 25.08.2015 №3758-У «Об определении стоимости чистых активов инвестиционных фондов, в том числе о порядке расчета среднегодовой стоимости чистых активов паевого инвестиционного фонда и чистых активов акционерного инвестиционного фонда, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, стоимости имущества, переданного в оплату инвестиционных паев».

Генеральный директор
АО ВТБ Капитал Управление активами

Дюдин С.Г.





Всего прошито и
пронумеровано
39 лист(ов)



