

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 фондом.

Справка о стоимости чистых активов, в том числе стоимости активов (имущества), акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) по состоянию на 29 декабря 2023 г.

Код формы по ОКУД 0420502
Месячная

Раздел 1. Реквизиты паевого инвестиционного фонда

Полное название паевого инвестиционного фонда	Номер правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом	Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО)	ISIN инвестиционных паев биржевого паевого инвестиционного фонда
1	2	3	4
Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Тинькофф Локальные валютные облигации»	5728	74519491	RU000A107597

Раздел 2. Параметры справки о стоимости чистых активов

	Отчетная дата	Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов
	1	2
Значения	29.12.2023	643-RUB

Раздел 3.

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

Наименование показателя	Код строки	Ценные бумаги российских эмитентов - Сумма на текущую отчетную дату
		1
Ценные бумаги российских эмитентов – всего	02	334 757 113,95
облигации российских хозяйственных обществ (за исключением облигаций с ипотечным покрытием) – всего	02.01	334 757 113,95
биржевые облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	116 775 036,5
ипотечные сертификаты участия	02.09.02	

Подраздел 8. Дебиторская задолженность

Наименование показателя	Код строки	Дебиторская задолженность - Сумма на текущую отчетную дату
		1
Дебиторская задолженность – всего	08	94 482 165,03
по сделкам	08.02	19 017 683,31
прочая	08.04	75 464 481,72

Подраздел 10. Общая стоимость активов

	Общая стоимость активов - Сумма на текущую отчетную дату
	1
Значение	429 239 278,98

Раздел 4. Обязательства.

Наименование показателя	Код строки	Обязательства - Величина на текущую отчетную дату
		1

Кредиторская задолженность, всего	10	709 483,1
по сделкам купли-продажи имущества	10.1	593 842,08
по вознаграждениям (комиссиям)	10.4	115 641,02
Общая величина обязательств	13	709 483,1

Раздел 5. Стоимость чистых активов

Наименование показателя	Код строки	Значение показателя на текущую отчетную дату
		1
Стоимость чистых активов	14	428 529 795,88
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	15	40 806 436,82111
Стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда в расчете на одну акцию (расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда)	16	10,5015

Расшифровки активов и обязательств, принятых к расчету стоимости чистых активов

Расшифровки раздела 3 «Активы».

Подраздел 2. Ценные бумаги российских эмитентов

2.1. Облигации российских хозяйственных обществ

Наименование эмитента ценной бумаги	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН)	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН)	Организационно-правовая форма эмитента	Субординированные облигации	Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN ценной бумаги	Дата погашения	Облигации российских хозяйственных обществ - Количество в составе активов	Облигации российских хозяйственных обществ - Стоимость актива	Наименование биржи	Уровень иерархии справедливой стоимости	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Общество с ограниченной ответственностью "Борец Капитал"	1227700520959	9731098069	Общество с ограниченной ответственностью	Нет	4-01-00676-R	RU000A105GN3	17.09.2026	364	32 589 890	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "ФосАгро"	1027700190572	7736216869	Публичное акционерное общество	Нет	4-02-06556-A	RU000A106G56	16.09.2028	197	16 052 816,34	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
публичное акционерное общество "Современный коммерческий флот"	1027739028712	7702060116	Публичное акционерное общество	Нет	4-02-10613-A	RU000A105A87	26.04.2028	380	32 297 915,15	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Акционерное общество "Тинькофф Банк"	1027739642281	7710140679	Непубличные акционерные общества	Да	4-03-02673-B	RU000A107738		67	6 288 414,44	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	1027739407189	7720261827	Непубличные акционерные общества	Нет	4-03-32432-H	RU000A1077H3	31.05.2024	229	20 500 331,03	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	1027739407189	7720261827	Непубличные акционерные общества	Нет	4-04-32432-H	RU000A1078V2	17.04.2025	125	11 134 272,15	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Горно-металлургическая компания "Норильский никель"	1028400000298	8401005730	Публичное акционерное общество	Нет	4-05-40155-F	RU000A107BL4	11.09.2025	129	11 482 339,78	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	

Акционерное общество "Холдинговая компания "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	1027700006289	7705392230	Непубличн ые акционерн ые общества	Нет	4-08-25642-Н	RU000A105A04	22.10.2028	391	32 773 978,62	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ Ю "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ"	1087746212388	7726588547	Общество с ограниченн ой ответствен ностью	Нет	4-10-36400-Р	RU000A105QX1		326	26 556 227,36	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ Ю "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ"	1087746212388	7726588547	Общество с ограниченн ой ответствен ностью	Нет	4-11-36400-Р-003Р	RU000A105RH2	16.08.2037	54	5 202 512,24	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ"	1027700035769	7708004767	Публичное акционерн ое общество	Нет	4-20-00077-А	RU000A1059R0	26.10.2031	288	23 103 380,34	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерно общество "Южуралзолото Группа Компаний"	1077424000686	7424024375	Публичное акционерн ое общество	Нет	4B02-02-33010-D-001Р	RU000A1061L9	01.04.2025	1 832	23 485 858,06	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	

Наименование эмитента ценной бумаги	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН)	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН)	Организационно-правовая форма эмитента	Субординированные облигации	Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN ценной бумаги	Дата погашения	Облигации российских хозяйственных обществ - Количество в составе активов	Облигации российских хозяйственных обществ - Стоимость актива	Наименование биржи	Уровень иерархии справедливой стоимости	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	7703389295	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-02-55192-E-001P	RU000A1054W1	24.08.2027	2 501	30 145 782,37	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Общество с ограниченной ответственностью "ПИК - Корпорация"	1027739093843	7703255661	Общество с ограниченной ответственностью	Нет	4B02-05-00464-R-001P	RU000A105146	19.11.2026	381	32 906 925,29	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Международная компания публичное акционерное общество "Объединённая Компания "РУСАЛ""	1203900011974	3906394938	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-05-16677-A-001P	RU000A1076U8	08.05.2026	2 366	30 236 470,78	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
х	х	х	х	х	х	х	х	х	334 757 113,95	х	х	х

Подраздел 8. Дебиторская задолженность

8.2. Дебиторская задолженность (должник – юридическое лицо)

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование должника	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) должника	TIN должника	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) должника	Адрес должника	Код страны	Дебиторская задолженность (по справедливой стоимости) - сумма	Дебиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Уровень иерархии справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19
Клиринговое обеспечение (рубли)	156-CNY	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	08.08.2038	Небанковская кредитная организация-контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	7750004023		1067711004481	Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	19 980 232,85	19 980 232,85	Рыночные котировки (уровень 1)						

Клирингово е обеспечени е (рубли)	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.20 23	08.08.2038	Небанковс кая кредитная организац ия-центра льный контраген т "Национал ьный Клирингов ый Центр" (Акционер ное общество)	7750004 023		106771100 4481	Российска я Федераци я, Москва г, Кисловски й переулок, дом № 13	643	55 477 442, 87	55 477 442, 87	Рыночны е котировк и (уровень 1)						
--	---------	---	------------	--	----------------	--	-------------------	--	-----	-------------------	-------------------	---	--	--	--	--	--	--

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование должника	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) должника	TIN должника	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) должника	Адрес должника	Код страны	Дебиторская задолженность (по справедливой стоимости) - сумма	Дебиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Уровень иерархии и справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19
Сделки РЕПО с КСУ	643-RUB	Сделка 9328551 028 от 29.12.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	7750004 023		106771100 4481	Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	19 000 000	19 000 000	Рыночные котировки (уровень 1)	репо обратное	15,52	09.01.2024 0:00:00	RU000A0JW4Z1	19 000 000	
х	х	х	х	х	х	х	х	х	х	94 457 675, 72	94 457 675, 72	х	х	х	х	х	х	х

Расшифровки раздела 4 «Обязательства»

Подраздел 2. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) кредитора	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) кредитора	TIN кредитора	Адрес кредитора	Код страны	Обязательства (по справедливой стоимости) - сумма	Кредиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Категория кредиторской задолженности	Уровень иерархии и справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Расчеты с Управляющей компанией	643-RUB	ПДУ № 5728 от 19.10.2023.	29.01.2024	Общество с ограниченной ответственностью "Тинькофф Капитал"	11977463 80138	77433045 30		Российская Федерация, 125212, Москва г, ш Головинское, д. 5, к. 1, этаж 19, помещение 19018	643	109 554,65	109 554,65	по вознаграждениям (комиссиям)	Модель оценки, использующая значительный объем ненаблюдаемых данных (уровень 3)						

Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	8 111,92		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
--	---------	--	------------	---	---------------	------------	--	--	-----	----------	--	------------------------------------	--------------------------------	--	--	--	--	--	--

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) кредитора	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) кредитора	TIN кредитора	Адрес кредитора	Код страны	Обязательства (по справедливой стоимости) - сумма	Кредиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Категория кредиторской задолженности	Уровень иерархии справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	22 325,05		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	35 634,23		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	55 849,21		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	8 068,83		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) кредитора	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) кредитора	TIN кредитора	Адрес кредитора	Код страны	Обязательства (по справедливой стоимости) - сумма	Кредиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Категория кредиторской задолженности	Уровень иерархии и справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	24 342,84		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	8 294,2		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	103 720,34		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	11 960,87		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) кредитора	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) кредитора	TIN кредитора	Адрес кредитора	Код страны	Обязательства (по справедливой стоимости) - сумма	Кредиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Категория кредиторской задолженности	Уровень иерархии и справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	58 889,95		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	27 678,3		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	12 396,82		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок , дом № 13	643	15 152,88		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						

Вид (описание) задолженности	Код валюты задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) кредитора	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) кредитора	TIN кредитора	Адрес кредитора	Код страны	Обязательства (по справедливой стоимости) - сумма	Кредиторская задолженность (по документу-основанию) - сумма	Категория кредиторской задолженности	Уровень иерархии и справедливой стоимости	Тип сделки репо	Ставка репо	Срок репо - дата второй части сделки	Код ISIN ценной бумаги	Количество ценных бумаг	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	48 218,33		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236, письмо 1110-05 от 10.11.2023	09.01.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	81 451,25		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
х	х	х	х	х	х	х	х	х	х	631 649,67	109 554,65	х	х	х	х	х	х	х	х

Пояснительные примечания к справке о стоимости чистых активов.

Сведения о лице, подписавшем отчетность (уполномоченное лицо специализированного депозитария)

Фамилия, имя, отчество уполномоченного лица специализированного депозитария, подписавшего отчетность	Полное наименование специализированного депозитария	ИНН специализированного депозитария	ОГРН специализированного депозитария
1	2	3	4
Прасс Павел Игоревич	Акционерное общество "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"	7705380065	1027739039283

Фамилия, имя, отчество руководителя управляющей компании (лица, исполняющего обязанности руководителя управляющей компании), подписывающего отчетность

Мучипов Руслан Закариянович

(инициалы, фамилия)