

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 31 мая 2024 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	31.05.2024	643-RUB

Раздел 3.

Подраздел 1. Денежные средства

Наименование показателя	Код строки	Денежные средства - Сумма на текущую отчетную дату
		1
Денежные средства – всего	01	85 284 117,01
в том числе: на счетах в кредитных организациях – всего	01.01	85 284 117,01
в том числе: в валюте Российской Федерации	01.01.01	75 608 673,25
в иностранной валюте	01.01.02	9 675 443,76

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	1 875 550 942,08
облигации российских хозяйственных обществ (за исключением облигаций с ипотечным покрытием) – всего	02.01	1 875 550 942,08
биржевые облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	668 460 524,19
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	180 992 721,23

Наименование показателя	Код строки	Дебиторская задолженность - Сумма на текущую отчетную дату
		1
по сделкам	08.02	159 831 000
по процентному (купонному) доходу по денежным средствам на счетах и во вкладах, а также по ценным бумагами	08.03	21 161 721,23

Подраздел 10. Общая стоимость активов

	Общая стоимость активов - Сумма на текущую отчетную дату
	1
Значение	2 141 827 780,32

Раздел 4. Обязательства.

Наименование показателя	Код строки	Обязательства - Величина на текущую отчетную дату
		1
Кредиторская задолженность, всего	10	1 885 285,42
по сделкам купли-продажи имущества	10.1	271 025,08
по вознаграждениям (комиссиям)	10.4	1 614 260,34
Резерв на выплату вознаграждения, всего	11	53 637,08
специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра владельцев акций (инвестиционных паев), аудиторской организации, оценщику и на оплату услуг бирже	11.02	53 637,08
Общая величина обязательств	13	1 938 922,5

Раздел 5. Стоимость чистых активов

Наименование показателя	Код строки	Значение показателя на текущую отчетную дату
		1
Стоимость чистых активов	14	2 139 888 857,82
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	15	200 938 630,04374
Стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда в расчете на одну акцию (расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда)	16	10,6495

Расшифровки активов и обязательств, принятых к расчету стоимости чистых активов

Расшифровки раздела 3 «Активы».

Подраздел 1. Денежные средства

1.1. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Наименование кредитной организации	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН)	TIN	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты	Вид банковского счета	Сумма денежных средств	Уровень иерархии справедливой стоимости	Примечание
1	2	3	4	5	6	7	8	9
Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391		80	643-RUB	Счет доверительного управления	695	Рыночные котировки (уровень 1)	
Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481			156-CNY	Клиринговый	948,92	Рыночные котировки (уровень 1)	
Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481			643-RUB	Клиринговый	755 729	Рыночные котировки (уровень 1)	
Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481			643-RUB	Клиринговый	74 852 249,25	Рыночные котировки (уровень 1)	
Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481			840-USD	Клиринговый	65 654,07	Рыночные котировки (уровень 1)	
Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481			156-CNY	Клиринговый	9 608 840,77	Рыночные котировки (уровень 1)	

х	х	х	х	х	х	85 284 117,01	х	х
---	---	---	---	---	---	---------------	---	---

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

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	1 517	135 274 288,45	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	834	65 731 689,15	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	781	65 172 330,33	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Акционерное общество "Тинькофф Банк"	1027739642281	7710140679	Непубличные акционерные общества	Да	4-03-02673-B	RU000A107738		220	20 440 406,76	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	11 308 733,02	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Трубная Металлургическая Компания"	1027739217758	7710373095	Публичное акционерное общество	Нет	4-06-29031-H	RU000A107JN3	12.02.2027	2 019	175 119 309,65	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	1027739407189	7720261827	Непубличные акционерные общества	Нет	4-06-32432-H	RU000A107B43	10.03.2027	867	74 239 612,31	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Акционерное общество "ХОЛДИНГОВАЯ КОМПАНИЯ "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	1027700006289	7705392230	Непубличные акционерные общества	Нет	4-08-25642-H	RU000A105A04	22.10.2028	1 736	140 924 273,84	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	1027739407189	7720261827	Непубличные акционерные общества	Нет	4-08-32432-H	RU000A107D58	27.02.2029	968	78 054 762,55	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	7728168971	Непубличные акционерные общества	Нет	4-10-01326-B	RU000A108BD9		398	29 583 259,21	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	

ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ Ю "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ"	108774621238 8	7726588547	Общество с ограниченн ой ответствен ностью	Нет	4-10-36400- R	RU000A10 5QX1		2 146	159 992 373, 18	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ Ю "ГАЗПРОМ КАПИТАЛ"	108774621238 8	7726588547	Общество с ограниченн ой ответствен ностью	Нет	4-11-36400-R -003P	RU000A10 5RH2	16.08.2037	295	28 591 169,9 1	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ"	102770003576 9	7708004767	Публичное акционерн ое общество	Нет	4-20-00077- A	RU000A10 59R0	26.10.2031	1 032	82 194 544,9 1	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
"МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК" (публичное акционерное общество)	102773955528 2	7734202860	Публичное акционерн ое общество	Нет	4-23-01978- B	RU000A10 7VV1	21.09.2026	1 657	140 463 664, 62	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 "Южуралзолото Группы Компаний"	1077424000686	7424024375	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-02-33010-D-001P	RU000A1061L9	01.04.2025	1 892	23 481 995,6	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Полюс"	1068400002990	7703389295	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-02-55192-E-001P	RU000A1054W1	24.08.2027	3 555	41 570 802,94	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Акционерное общество "Уральская Сталь"	1055607061498	5607019523	Непубличные акционерные общества	Нет	4B02-03-55163-E-001P	RU000A107U81	19.02.2026	12 764	157 767 507,17	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Публичное акционерное общество "Акрон"	1025300786610	5321029508	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-04-00207-A-001P	RU000A108JH3	22.05.2026	10 000	124 480 322,48	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	2 025	175 521 677,34	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	4 319	52 955 197,79	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
Международная компания публичное акционерное общество "Объединённая Компания "РУСАЛ""	1203900011974	3906394938	Публичное акционерное общество	Нет	4B02-06-16677-A-001P	RU000A107RH8	05.08.2026	7 500	92 683 020,87	Московская Биржа ММВБ - РТС	Рыночные котировки (уровень 1)	
х	х	х	х	х	х	х	х	х	1 875 550 942,08	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 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
Погашение тела облигации, сумма к получению	840-USD	Погашение активов ТЛВО-И Н-00000 0001 от 31.05.20 24 23:59:07	31.05.2024	акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	7720261 827		102773940 7189	Российская Федерация, 629008, Ямало-Ненецкий АО, г Салехард, ул Республики, д. 73, ком. 100	643	20 632 900	20 561 200, 1	Рыночные котировки (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 10559956952 от 31.05.2024	03.06.2024	Небанковская кредитная организация-контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	7750004023		1067711004481	Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	8 580 000	8 580 000	Рыночные котировки (уровень 1)	репо обратное	15,72	03.06.2024 0:00:00	RU000A0JW4Z1	8 580 000	
Сделки РЕПО с КСУ	643-RUB	Сделка 10559956955 от 31.05.2024	03.06.2024	Небанковская кредитная организация-контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	7750004023		1067711004481	Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	151 251 000	151 251 000	Рыночные котировки (уровень 1)	репо обратное	15,71	03.06.2024 0:00:00	RU000A0JW4Z1	151 251 000	
х	х	х	х	х	х	х	х	х	х	180 463 900	180 392 200,1	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
Задолженность по прочим расчетам	643-RUB	Счет на оплату № 295/0004-КБ от 31.05.2024	07.06.2024	Акционерное общество "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"	1027739039283	7705380065		115162 , Москва город, улица Шаболовка, дом № 31, корпус Б	643	21 876,58	21 876,58	по вознаграждениям (комиссиям)	Модель оценки, использующая значительный объем ненаблюдаемых данных (уровень 3)						

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 со Спец.депозитарием	643-RUB	Договор № 2-145-23-ДУ-ПИФ от 23.08.2023.	07.06.2024	Акционерное общество "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"	1027739039283	7705380065		115162, Москва город, улица Шаболовка, дом № 31, корпус Б	643	60 000	60 000	по вознаграждениям (комиссиям)	Модель оценки, использующая значительный объем ненаблюдаемых данных (уровень 3)						
Расчеты с Управляющей компанией	643-RUB	ПДУ № 5728 от 19.10.2023.	24.06.2024	Общество с ограниченной ответственностью "Тинькофф Капитал"	1197746380138	7743304530		Российская Федерация, 125212, Москва г, ш Головинское, д. 5, к. 1, этаж 19, помещение 19018	643	1 532 383,76	1 532 383,76	по вознаграждениям (комиссиям)	Модель оценки, использующая значительный объем ненаблюдаемых данных (уровень 3)						
Расчеты по переоценке незавершенных сделок	643-RUB	РК 26236 от 09.11.2023	03.06.2024	Небанковская кредитная организация-центральный контрагент "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество)	1067711004481	7750004023		Российская Федерация, Москва г, Кисловский переулок, дом № 13	643	271 025,08		по сделкам купли-продажи имущества	Рыночные котировки (уровень 1)						
х	х	х	х	х	х	х	х	х	х	1 885 285,42	1 614 260,34	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)

Сопроводительная информация к отчетности.

Раздел V. Реквизиты отчитывающейся организации (управляющая компания инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов)

Полное фирменное наименование управляющей компании	Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) управляющей компании	Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) управляющей компании	Номер лицензии управляющей компании	Дата предоставления лицензии управляющей компании	Фактический адрес
1	2	3	4	5	6
Общество с ограниченной ответственностью «Тинькофф Капитал»	7743304530	1197746380138	21-000-1-01027	03.09.2019	125212, Российская Федерация, Москва г, шоссе Головинское, д. 5, к. 1, этаж 19, пом.19018