

**АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ  
НЕЗАВИСИМОГО АУДИТОРА**

**ОБ ОТЧЕТНОСТИ  
БИРЖЕВОГО ПАЕВОГО ИНВЕСТИЦИОННОГО ФОНДА  
РЫНОЧНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ  
«АЛЬФА-КАПИТАЛ УПРАВЛЯЕМЫЕ ОБЛИГАЦИИ»  
ПОД УПРАВЛЕНИЕМ ОБЩЕСТВА С ОГРАНИЧЕННОЙ  
ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ «УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ  
«АЛЬФА-КАПИТАЛ»  
ЗА 2022 ГОД**

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

### Владельцам инвестиционных паев Биржевого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации»

#### Мнение

Мы провели аудит отчетности в отношении имущества, составляющего Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации», 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 30.12.2022;
- Ежемесячных отчетов о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, за каждый месяц 2022 года;
- Отчета о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим паевой инвестиционный фонд, за 2022 год;
- Пояснительной записки к годовой отчетности паевого инвестиционного фонда за 2022 год.

По нашему мнению, прилагаемая отчетность специального назначения Биржевого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» (далее – Фонд) под управлением ООО УК «Альфа-Капитал» (далее - Управляющая компания) по состоянию на 30 декабря 2022 года, а также за год, закончившийся на указанную дату, подготовлена во всех существенных отношениях достоверно 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 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 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 2022 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.

## **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 руководством Управляющей компании.

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.

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 30.12.2022, 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-2023 от 12.01.2023,  
руководитель аудита,  
по результатам которого  
составлено аудиторское заключение  
(ОРНЗ 21606077496),

23 марта 2023 года



#### Аудлируемое лицо

Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» под управлением ООО УК «Альфа-Капитал»  
123001, г. Москва, ул. Садовая-Кудринская, д.32, стр.1  
Правила доверительного управления фондом №4039 от 19.05.2020

#### 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 акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда)

|   |  |   |  |  |
|---|--|---|--|--|
| Полное наименование акционерного инвестиционного фонда (полное наименование паевого инвестиционного фонда)  | Номер лицензии инвестиционного фонда (регистрационный номер управления паевым инвестиционным фондом) | Полное наименование управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда) | Номер лицензии управляющей компании акционерного инвестиционного фонда (регистрационный номер управления паевым инвестиционным фондом) | Код по Общероссийскому классификатору предприятий и организаций (ОКПО) |
| Брокерский завод инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Брокер-Завод Управление стратегиями» | 4039   | Общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания «Альда-Клантав»                              | 21-100-1-00023   | 44494079   |
| 1   | 2  | 3   | 4  | 5  |

Раздел II. Параметры справки о стоимости чистых активов

|                       |   |
|-----------------------|---|
| Текущая отчетная дата | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
| 2022.12.30            | 643-RUB   |
| 1                     | 3   |

Раздел 3. Активы

Подраздел 1. Денежные средства

| Наименование показателя                                 | Код строки | Денежные средства - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| Денежные средства - всего                               | 01         | 42 577 890,06                                      |
| в том числе:  |            |  |
| на счетах в кредитных организациях - всего              | 01.01      | 42 577 890,06                                      |
| в том числе:  |            |  |
| в банках - всего  | 01.01.01   | 42 577 890,06                                      |
| в кредитных организациях - всего                        | 01.01.02   | 0,00   |
| на счетах по депозитам в кредитных организациях - всего | 01.02      | 0,00   |
| в том числе:  |            |  |
| в валюте Российской Федерации                           | 01.02.01   | 0,00   |
| иностранных валют                                       | 01.02.02   | 0,00   |

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

| Наименование показателя   | Код строки | Ценные бумаги российских эмитентов - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|---|
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего  | 02         | 1 151 555 272,83  |
| в том числе:  |            |   |
| облигации российских кредитных организаций (за исключением облигаций с ипотечным покрытием) - всего | 02.01      | 1 004 691 712,83  |
| в том числе:  |            |   |
| кредитных организаций   | 02.01.01   | 908 474 315,59  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.02      | 177 465 590,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.03      | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.04      | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.05      | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.06      | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.07      | 0,00  |
| в том числе:  |            |   |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.07.01   | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.07.02   | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.08      | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.09      | 0,00  |
| в том числе:  |            |   |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.09.01   | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.09.02   | 0,00  |
| исключительно облигации российских кредитных организаций  | 02.10      | 0,00  |

Подраздел 3. Ценные бумаги иностранных эмитентов

| Наименование показателя                       | Код строки | Ценные бумаги иностранных эмитентов - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| Ценные бумаги иностранных эмитентов - всего   | 03         | 0,00   |
| в том числе:                                  |            |  |
| облигации иностранных эмитентов - всего       | 03.01      | 0,00   |
| в том числе:                                  |            |  |
| облигации иностранных эмитентов               | 03.01.01   | 0,00   |
| облигации иностранных эмитентов               | 03.01.02   | 0,00   |
| облигации иностранных эмитентов               | 03.02      | 0,00   |
| исключительно облигации иностранных эмитентов | 03.03      | 0,00   |
| исключительно облигации иностранных эмитентов | 03.04      | 0,00   |

5

|   |       |      |
|---|-------|------|
| Итого недвижимых имущественных объектов | 03.05 | 0,00 |
| Итого ценные бумаги                     | 03.06 | 0,00 |

**Подраздел 4. Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества**

| Наименование показателя   | Код строки | Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества в том числе:                |            |  |
| в том числе:  |            |  |
| недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации - 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 | Имущественные права - Сумма на текущую отчетную дату |
|--|------------|--|
| Имущественные права - всего  | 05         | 0,00   |
| в том числе:   |            |  |
| Имущественные права на договор участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества  | 05.01      | 0,00   |
| Имущественные права, связанные с долевой собственностью на объект недвижимости (во части) после завершения его строительства (создание), возникающие из договора, стороной по которому является застройщик (лицензиат) долевой собственности или иное лицо (право аренды, право залога, на земельный участок, выделенный для целей строительства объекта недвижимости, и (или) которое имеет разрешение на строительство объекта недвижимости, и (или) которое имеет разрешение на строительство объекта недвижимости или иное имущество в строительстве объекта недвижимости) | 05.02      | 0,00   |
| Имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется строительство (создание) объектов недвижимого имущества (в том числе на землях государственного или муниципального назначения) на территории Российской Федерации, возникающие из договоров участия в долевом строительстве (создание) земельных участков, которые (права аренды которых) составляют часть лицензионного инвестиционного фонда (фондов инвестиционного фонда)  | 05.03      | 0,00   |
| Имущественные права из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимого имущества, расположенного на территории Российской Федерации (фонды 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 | Денежные требования по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенные закладными - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| 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 - всего          | 06.01      | 0,00   |
| закладные   | 06.02      | 0,00   |

**Подраздел 7. Приобретенные финансовые инструменты (активы)**

| Наименование показателя                               | Код строки | Средствая сумма, приобретенная по номинальной стоимости финансового инструмента - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| Общая стоимость приобретенных финансовых инструментов | 07         | 0,00   |

**Подраздел 8. Дебиторская задолженность**

| Наименование показателя   | Код строки | Дебиторская задолженность - Сумма на текущую отчетную дату |
|---|------------|--|
| Дебиторская задолженность - всего   | 08         | 108 010 376,50   |
| в том числе:  |            |  |
| Средства, находящиеся у профессиональных участников рынка ценных бумаг по депозитам | 08.01      | 9 450,00   |
|   | 08.02      | 108 000 926,50   |





|                  |            |         |           |               |                                 |
|------------------|------------|---------|-----------|---------------|---------------------------------|
| АО<br>"МБФ-БАНК" | 1027006728 | 643 RUB | Расчетный | 99 532,51     | Уровень 1<br>Рыночные котировки |
| Итого            |            |         |           | 42 577 850,06 |                                 |

1.2. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

| Номер строки | Наименование депозитной организации | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Первичный номер депозитной организации | Код валюты | Субординированный депозит | Дата погашения вклада денежных средств | Сумма денежных средств | Уровень иерархии рыночных котировок |   |   | Примечание |   |   |   |
|--------------|-------------------------------------|---|--|------------|---------------------------|--|------------------------|-------------------------------------|---|---|------------|---|---|---|
|              |                                     |   |  |            |                           |  |                        | 1                                   | 2 | 3 |            | 4 | 5 | 6 |
| Итого        |                                     |   |  |            |                           |  | 0,00                   |                                     |   |   |            |   |   |   |

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

2.1. Облигации российских хозяйственных обществ

| Номер строки | Наименование эмитента/эмитентской бумаги  | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | Однородность правовая форма эмитента | Субординированность облигации | Дата погашения (квартал/месяц/год выпуска) | Код ISIN     | Дата погашения | Облигации российских хозяйственных обществ - стоимость актива | Облигации российских хозяйственных обществ - стоимость актива | Уровень иерархии рыночных котировок | Примечание |
|--------------|---|---|---|--------------------------------------|-------------------------------|--|--------------|----------------|---|---|-------------------------------------|------------|
|              |   |   |   |                                      |                               |  |              |                |   |   |                                     |            |
| 1            | "Дин-Групп", АО   | 121160013866  | 1660359180                                      | АО                                   | Нет                           | 4802-01-0000-Р-001P                        | RU000A10B1R3 | 2024.08.12     | 69 999,00   | 69 715 218,34   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 2            | Тригласкопский "Пылеу", АО  | 507746655848  | 770335416                                       | АО                                   | Нет                           | 4802-05-0750-Н-001P                        | RU000A102K06 | 2024.12.17     | 111 805,00  | 105 801 250,05  | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 3            | "РБК-Интер", ООО  | 105749202590  | 7705701907                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-01-0050-Р-001P                        | RU000A1021G3 | 2020.08.06     | 59 793,00   | 57 840 100,62   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 4            | Общество с ограниченной ответственностью "Энергоинвест"                                       | 102700786524  | 7203129844                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-04-0050-Р-001P                        | RU000A1039E8 | 2025.06.05     | 56 000,00   | 48 056 647,40   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 5            | Акционерное общество "Элтон-Волгоградское предприятие по производству и сбыту электроэнергии" | 104736714656  | 7706106856                                      | АО                                   | Нет                           | 4802-05-5030-Н-001P                        | RU000A1030H9 | 2026.09.15     | 100 000,00  | 91 559 000,00   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 6            | "Сурдарианский транспортный депозитарий", ООО   | 102723407188  | 7720261827                                      | АО                                   | Нет                           | 4802-17-3040-Н-001P                        | RU000A101QL5 | 2025.05.14     | 25 713,00   | 23 368 488,66   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 7            | Банк БТБ (публичное акционерное общество)   | 102775656261  | 7702050139                                      | ПАО                                  | Да                            | 4-01-01000-Ф-002P                          | RU000A102879 | 2031.04.02     | 15,00   | 95 817 397,25   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 8            | Общество с ограниченной ответственностью "Степное поле"                                       | 118856525470  | 6655151897                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-01-0050-Р-002P                        | RU000A1046A9 | 2025.06.10     | 55 291,00   | 54 756 536,12   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 9            | Публичное акционерное общество "Группа компаний "Самсон"                                      | 118746500233  | 9731004888                                      | ПАО                                  | Нет                           | 4802-11-16400-А-001P                       | RU000A1044Q3 | 2028.02.08     | 69 857,00   | 73 108 315,34   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 10           | Общество с ограниченной ответственностью "ВУД"  | 118746542180  | 9717068640                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-01-00075-Л-001P                       | RU000A104W52 | 2025.06.25     | 65 000,00   | 67 453 100,00   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 11           | Акционерное общество "Группа компаний "Самсон"  | 118746500233  | 9731004688                                      | ПАО                                  | Нет                           | 4802-12-16400-А-001P                       | RU000A104Y76 | 2025.07.11     | 7 072,00  | 7 440 442,35  | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 12           | Общество с ограниченной ответственностью "Александров"  | 102780400445  | 7810245491                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-01-36160-Р-002P                       | RU000A1053A9 | 2025.08.13     | 87 306,00   | 90 331 152,90   | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 13           | Общество с ограниченной ответственностью "Новый Север"  | 1094205128745   | 4205119220                                      | АО                                   | Нет                           | 4802-03-12414-Ф-001P                       | RU000A105CM4 | 2027.10.26     | 100 000,00  | 101 791 000,00  | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 14           | Общество с ограниченной ответственностью "РСК ХОЛДИНГ"  | 107761125828  | 7724639872                                      | ООО                                  | Нет                           | 4802-01-00085-Л-001P                       | RU000A105R55 | 2025.12.23     | 115 000,00  | 118 224 800,00  | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| Итого        |   |   |   |                                      |                               |  |              |                | 1 054 081 725,83  |   |                                     |            |

2.2. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

| Номер строки | Наименование эмитентской бумаги            | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | Регистрационный номер идентификации (на номер выпуска) | Код ISIN     | Дата погашения | Государственный ценный бумаги Российской Федерации - стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии рыночных котировок | Примечание |
|--------------|--|---|---|--|--------------|----------------|---|--------------------|-------------------------------------|------------|
|              |  |   |   |  |              |                |   |                    |                                     |            |
| 1            | Министерство финансов Российской Федерации | 102773065626  | 7710165360                                      | 26238RWF5  | RU000A1038V6 | 2041.05.15     | 100 000,00  | 76 697 000,00      | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| 2            | Министерство финансов Российской Федерации | 103773065626  | 7710166560                                      | 24021RWF5  | RU000A101CK7 | 2024.04.24     | 50 000,00   | 50 585 500,00      | Уровень 1: Рыночные котировки       |            |
| Итого        |  |   |   |  |              |                | 127 482 500,00  |                    |                                     |            |

2.3. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации



| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Наименование Российской Федерации, от имени которого выпущена ценная бумага | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Регистрационный номер | Код ISIN | Дата погашения | Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации - Количество в составе актива | Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|---|-----------------------|----------|----------------|--|---|--------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4   | 5                     | 6        | 7              | 8  | 9   | 10                 | 11                                      | 12         |
|              |                                 |   | х   | х   | х                     | х        | х              | х  | 0,00  | х                  | х                                       | х          |

2.4. Муниципальные ценные бумаги

| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Исследователь муниципальный образований, от имени которого выпущена ценная бумага | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Регистрационный номер | Код ISIN | Дата погашения | Муниципальные ценные бумаги - Количество в составе актива | Муниципальные ценные бумаги - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|---|-----------------------|----------|----------------|---|--|--------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4   | 5                     | 6        | 7              | 8   | 9  | 10                 | 11                                      | 12         |
|              |                                 |   | х   | х   | х                     | х        | х              | х   | 0,00   | х                  | х                                       | х          |

2.5. Российские депозитные расписки

| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Организационно-правовая форма эмитента | Регистрационный номер (идентификационный номер выпуска) | Код ISIN | Количество в составе актива | Наименование эмитента предоставляющих ценные бумаги | TIN | Вид предоставляемых ценных бумаг | Код валюты номинала предоставляемых ценных бумаг | Регистрационный номер предоставляемых ценных бумаг | Код ISIN предоставляемых ценных бумаг | Код страны | Российские депозитные расписки - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|--|---|----------|-----------------------------|---|-----|----------------------------------|--|--|---------------------------------------|------------|---|--------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4                                      | 5   | 6        | 7                           | 8   | 9   | 10                               | 11   | 12   | 13                                    | 14         | 15  | 16                 | 17                                      | 18         |
|              |                                 |   | х   | х                                      | х   | х        | х                           | х   | х   | х                                | х  | х  | х                                     | х          | 0,00  | х                  | х                                       | х          |

2.6. Инвестиционные паи плавких инвестиционных фондов

| Номер строки | Полное название паевого инвестиционного фонда | Номер транша депозитного инвестиционного фонда | Половое фирменное наименование управляющей компании фонда | Идентификационный номер государственного регистрационного номера (ОГРН) управляющей компании | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) управляющей компании | Код ISIN | Идентификационный номер паевого инвестиционного фонда - Количество в составе актива | Инвестиционные паи плавких инвестиционных фондов - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |    |    |    |      |    |    |    |    |
|--------------|---|--|---|--|--|----------|---|---|--------------------|---|------------|----|----|----|------|----|----|----|----|
| Итого        |   |  |   | 3  | 4  | 5        | 6   | 7   | 8                  | 9                                       | 10         | 11 | 12 | 13 | 14   | 15 | 16 | 17 | 18 |
|              |   |  |   | х  | х  | х        | х   | х   | х                  | х                                       | х          | х  | х  | х  | 0,00 | х  | х  | х  |    |

2.7. Акции российских акционерных обществ

| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Организационно-правовая форма эмитента | Регистрационный номер (идентификационный номер выпуска) | Код ISIN | Категория акций | Акции российских акционерных обществ - Количество в составе актива | Акции российских акционерных обществ - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|--|---|----------|-----------------|--|---|--------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4                                      | 5   | 6        | 7               | 8  | 9   | 10                 | 11                                      | 12         |
|              |                                 |   | х   | х                                      | х   | х        | х               | х  | 0,00  | х                  | х                                       | х          |

2.8. Векселя российских хозяйственных обществ

| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Организационно-правовая форма эмитента | Срок платежа по векселю | Высоте российских хозяйственных обществ - Стоимость актива | Тип векселя | Средняя ставка | Номер векселя | Дата составления векселя | Место нахождения векселя | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|--|-------------------------|--|-------------|----------------|---------------|--------------------------|--------------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4                                      | 5                       | 6  | 7           | 8              | 9             | 10                       | 11                       | 12                                      | 13         |
|              |                                 |   | х   | х                                      | х                       | 0,00   | х           | х              | х             | х                        | х                        | х                                       | х          |

2.9. Облигации с ипотечным покрытием

| Номер строки | Наименование эмиссионной бумаги | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Организационно-правовая форма эмитента | Регистрационный номер (идентификационный номер выпуска) | Код ISIN | Дата погашения | Облигации с ипотечным покрытием - Количество в составе актива | Облигации с ипотечным покрытием - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |
|--------------|---------------------------------|---|---|--|---|----------|----------------|---|--|--------------------|---|------------|
| Итого        |                                 |   | 3   | 4                                      | 5   | 6        | 7              | 8   | 9  | 10                 | 11                                      | 12         |
|              |                                 |   | х   | х                                      | х   | х        | х              | х   | 0,00   | х                  | х                                       | х          |

2.10. Ипотечные сертификаты участия

| Номер строки | Ипотечное обеспечение, в котором участвует участник | Регистрационный номер права требования участника | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | Идентификационный номер эмиссионной бумаги (ИНЭБ) | Организационно-правовая форма эмитента | Код ISIN | Количество в составе актива | Ипотечные сертификаты участия - Стоимость актива | Наименование биржи | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |    |
|--------------|---|--|---|---|--|----------|-----------------------------|--|--------------------|---|------------|----|
| Итого        |   |  | 3   | 4   | 5                                      | 6        | 7                           | 8  | 9                  | 10                                      | 11         | 12 |
|              |   |  | х   | х   | х                                      | х        | х                           | 0,00   | х                  | х                                       | х          | х  |

2.11. Ценные бумаги российских эмитентов (за исключением закладных), не указанные в таблицах пунктов 2.1-2.10

| Номер строки | Сведения, позволяющие идентифицировать ценную бумагу | Наименование эмитента ценной бумаги (обязанного по ценной бумаге) | Основной государственный регистрационный номер эмитента ценной бумаги (по ценной бумаге) | Иные ценные бумаги - Количество в составе актива | Иные ценные бумаги - Стоимость актива | Уровень иерархии справедливой стоимости | Примечание |   |   |    |    |    |
|--------------|--|---|--|--|---------------------------------------|---|------------|---|---|----|----|----|
| Итого        |  |   | 3  | 4  | 5                                     | 6                                       | 7          | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 |
|              |  |   | х  | х  | х                                     | 0,00                                    | х          | х | х | х  | х  | х  |

















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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 1 636 339,44                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 1 636 339,44                           |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего  | 02         | -10 545 559,66                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | -10 545 559,66                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |



|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00          |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00          |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00          |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00          |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00          |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00          |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00          |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00          |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00          |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 1 735 839,46  |
| в том числе:  |       |               |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00          |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 1 735 839,46  |
| 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    | 466 801,39    |
| в том числе:  |       |               |
| управляющей компании  | 05.01 | 409 474,91    |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 57 326,48     |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 78 349,37     |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00          |
| Прочие доходы   | 08    | 512 425,60    |
| Прочие расходы  | 09    | 470 896,15    |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 50 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00          |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00          |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00          |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 42 322 997,93 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 938 631 499,30   | 938 924 803,34   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 938 631 499,30   | 938 924 803,34   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS   | RU000A103BR0 | 102 399 427,46   | 102 422 740,86   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | 29012RMFS   | RU000A0JX0H6 | 104 199 404,25   | 104 223 241,65   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS   | RU000A102BV4 | 27 098 430,57  | 27 110 814,49  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZY226 | 59 986 390,32  | 59 999 620,19  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | 26212RMFS   | RU000A0JTK38 | 58 699 737,15  | 58 713 326,54  |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 2 498 878,13   | 2 499 271,07   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | 26233RMFS   | RU000A101F94 | 97 299 596,28  | 97 321 773,72  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 96 199 968,51  | 96 265 990,68  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | 26230RMFS   | RU000A100EF5 | 9 198 937,88   | 9 204 338,93   |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003        | 52003RMFS | RU000A102069 | 70 420 662,36  | 70 463 007,42  |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом  | 29010RMFS | RU000A0JV4Q1 | 144 798 398,38 | 144 830 211,73 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225    | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 59 899 315,09  | 59 913 428,35  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26215    | 26215RMFS | RU000A0JU4L3 | 1 499 048,60   | 1 500 099,99   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019                | 29019RMFS | RU000A102A49 | 104 433 304,32 | 104 456 937,72 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26215 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |

|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списывый

(инициалы, фамилия)

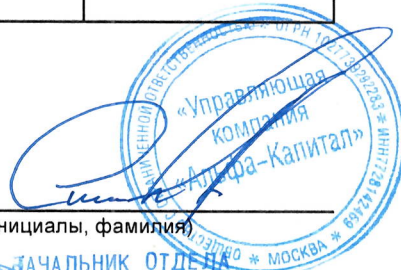
Уполномоченное лицо специализированного депозитария акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда)

ТАЧАЛЬНИК ОТДЕЛА

БОСОВ Г.В.

БОСОВА Г.В.

(инициалы, фамилия)





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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 740 774,87                             |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 740 774,87                             |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего  | 02         | -60 807 765,80                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | -60 826 964,60                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 19 198,80      |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 4 389 966,38   |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 4 389 966,38   |
| 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    | 564 493,26     |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 495 169,52     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 69 323,74      |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 31 338,88      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 564 493,26     |
| Прочие расходы  | 09    | 569 444,94     |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 35 000 000,00  |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00           |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | -21 277 808,37 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 912 310 506,51   | 912 628 444,77   |
| обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 912 310 506,51   | 912 628 444,77   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26228 | 26228RMFS   | RU000A100A82 | 21 799 521,83  | 21 804 150,50  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 69 999 257,91  | 70 014 120,77  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS   | RU000A103BR0 | 72 636 922,80  | 72 654 335,76  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | 29012RMFS   | RU000A0JX0H6 | 83 799 094,20  | 83 861 082,57  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS   | RU000A102BV4 | 30 699 837,97  | 30 707 828,34  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52002   | 52002RMFS   | RU000A0ZY226 | 42 989 083,41  | 43 000 272,35  |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 52 299 514,71  | 52 311 120,90  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | 26233RMFS   | RU000A101F94 | 70 399 475,22  | 70 415 966,06  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 43 589 187,48  | 43 623 222,88  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 10 299 963,16  | 10 302 150,14  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | 26230RMFS   | RU000A100EF5 | 7 999 940,20   | 8 001 759,36   |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020             | 46020RMFS | RU000A0GN9A7 | 83 999 797,62  | 84 021 591,54  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008    | 29008RMFS | RU000A0JV4P3 | 55 099 621,83  | 55 111 622,98  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236                | 26236RMFS | RU000A102BT8 | 41 999 706,43  | 42 011 788,54  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019                | 29019RMFS | RU000A102A49 | 126 999 218,98 | 127 032 043,44 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 24021    | 24021RMFS | RU000A101CK7 | 54 699 756,73  | 54 734 914,44  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016    | 29016RMFS | RU000A1025B5 | 43 000 606,03  | 43 020 474,20  |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 24021 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |



|  |  |            |  |                           |
|--|--|------------|--|---------------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26228 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

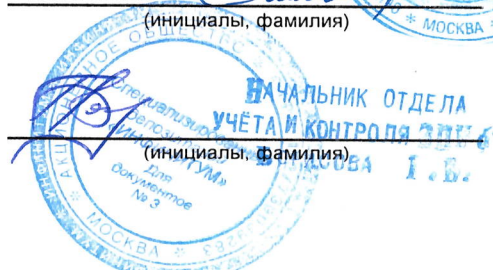
Руководитель акционерного инвестиционного фонда (управляющей компании паевого инвестиционного фонда) (лицо, исполняющее обязанности руководителя акционерного инвестиционного фонда (управляющей компании паевого инвестиционного фонда))

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)



27

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 696 131,89                             |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных)  | 01.01      | 696 131,89                             |
| 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 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         | -37 317 259,14                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных)  | 02.01      | -37 317 259,14                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 5 858 771,64   |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 5 858 771,64   |
| 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    | 634 074,98     |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 544 364,01     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 89 710,97      |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 17 748,20      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 634 074,98     |
| Прочие расходы  | 09    | 626 018,62     |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00           |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | -31 406 122,43 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 922 092 558,44   | 922 782 129,83   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 922 092 558,44   | 922 782 129,83   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 71 798 734,25  | 71 879 896,43  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZYZ26 | 212 832 035,82   | 213 036 785,94   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | 26212RMFS   | RU000A0JTK38 | 52 461 580,80  | 52 487 753,23  |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 58 187 278,78  | 58 209 747,01  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | 26233RMFS   | RU000A101F94 | 45 899 627,04  | 45 921 646,29  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 132 099 503,40   | 132 166 275,21   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | 46020RMFS   | RU000A0GN9A7 | 27 248 942,95  | 27 263 076,45  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные документарные, серия 26238                | 26238RMFS   | RU000A1038V6 | 41 999 776,95  | 42 019 913,83  |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | 29010RMFS   | RU000A0JV4Q1 | 71 598 671,32  | 71 678 360,88  |

|   |           |              |               |               |
|---|-----------|--------------|---------------|---------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008    | 29008RMFS | RU000A0JV4P3 | 43 699 361,06 | 43 722 647,43 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26218    | 26218RMFS | RU000A0JVW48 | 45 999 590,69 | 46 070 518,28 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52004        | 52004RMFS | RU000A103MX5 | 82 767 591,88 | 82 807 165,97 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26207    | 26207RMFS | RU000A0JS3W6 | 35 499 863,50 | 35 518 342,88 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |               |               |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |               |               |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |               |               |
| векселя   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |               |               |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |               |               |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |               |               |
| закладные   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |               |               |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |               |               |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |               |               |

Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)



| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные документарные, серия 26238                | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52004     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26207 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26218 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |

|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

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                                    |
| Е.Н.Калинихина   | Акционерное общество «Альфа-Банк»                   | 7728168971                          | 1027700067328                        |

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

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)



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

Е.Н.Калинихина

(инициалы, фамилия)



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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 730 340,76                             |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 730 340,76                             |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего  | 02         | 43 879 548,17                          |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | 43 879 548,17                          |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 6 274 117,33   |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 6 274 117,33   |
| 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 (иностраннх 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    | 579 172,44     |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 508 046,00     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 71 126,44      |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 63 802,47      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 579 172,44     |
| Прочие расходы  | 09    | 584 252,90     |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 25 000 000,00  |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | -31 389 840,00 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 43 846 110,89  |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 841 974 796,79   | 842 522 454,55   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 841 974 796,79   | 842 522 454,55   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 26 176 096,72  | 26 187 650,06  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS   | RU000A103BR0 | 90 099 483,84  | 90 146 415,41  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | 29012RMFS   | RU000A0JX0H6 | 8 358 903,09   | 8 362 590,17   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS   | RU000A102BV4 | 38 999 653,66  | 39 016 749,40  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZYZ26 | 111 790 842,11   | 111 840 493,80   |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 47 399 362,70  | 47 462 085,69  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 27 299 953,40  | 27 341 688,67  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 89 199 462,48  | 89 242 631,06  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | 26230RMFS   | RU000A100EF5 | 45 999 734,77  | 46 071 002,85  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | 46020RMFS   | RU000A0GN9A7 | 75 531 998,57  | 75 565 381,30  |

|  |           |              |               |               |
|--|-----------|--------------|---------------|---------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные документарные, серия 26238                | 26238RMFS | RU000A1038V6 | 48 299 664,09 | 48 324 872,54 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | 52003RMFS | RU000A102069 | 26 999 550,27 | 27 011 311,72 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | 26227RMFS | RU000A1007F4 | 47 499 724,02 | 47 520 025,27 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 27 299 506,71 | 27 311 324,03 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016 | 29016RMFS | RU000A1025B5 | 48 199 072,87 | 48 223 423,31 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26207 | 26207RMFS | RU000A0JS3W6 | 21 299 176,48 | 21 308 571,46 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26226 | 26226RMFS | RU000A0ZZYW2 | 20 523 152,15 | 20 532 120,49 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | 26229RMFS | RU000A100EG3 | 40 999 458,86 | 41 054 117,32 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждой облигации   |           |              |               |               |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю  |           |              |               |               |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю  |           |              |               |               |
| векселя  | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому векселю  |           |              |               |               |
| ипотечные сертификаты  | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату   |           |              |               |               |
| деPOSITные сертификаты   | x         | x            | 0,00          | 0,00          |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату  |           |              |               |               |
| закладные  | x         | x            | 0,00          | 0,00          |



|  |   |   |      |      |
|--|---|---|------|------|
| в том числе:<br>по каждой закладной  |   |   |      |      |
| иные российские ценные бумаги<br>(коносаменты, складские свидетельства,<br>опционы эмитента и прочие ценные<br>бумаги) | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной<br>бумаге  |   |   |      |      |
| Иностранные ценные бумаги,<br>квалифицированные в качестве ценных<br>бумаг, - всего                                    | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной<br>бумаге  |   |   |      |      |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги  | Наименование эмитента<br>ценной бумаги                  | Идентификационный<br>номер налогопла-<br>тельщика (ИНН) | TIN эмитента<br>представляемых<br>ценных бумаг | Основной<br>государственный<br>регистрационный<br>номер (ОГРН) |
|---|---|---|--|--|
|   | 1   | 2   | 3  | 4  |
| Министерство финансов<br>Российской Федерации,<br>облигации процентные<br>бездокументарные, серия<br>26237    | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |
| Министерство финансов<br>Российской Федерации,<br>облигации процентные<br>бездокументарные, серия<br>26240    | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |
| Министерство финансов<br>Российской Федерации,<br>облигации процентные<br>бездокументарные, серия<br>29018    | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |
| Министерство финансов<br>Российской Федерации,<br>облигации процентные<br>бездокументарные, серия<br>29020    | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |
| Министерство финансов<br>Российской Федерации,<br>облигации процентные<br>документарные, серия<br>26238       | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |
| МинФин РФ, облигации<br>федерального займа с<br>амортизацией долга,<br>документарные именные,<br>выпуск 46020 | Министерс<br>тво<br>финансов<br>Российской<br>Федерации | 7710168<br>360  |  | 10377<br>39085<br>636  |

|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26207 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26226 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

|  |  |                |                       |
|--|--|----------------|-----------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |

**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                                    |
| Е.Н.Калинихина   | Акционерное общество «Альфа-Банк»                   | 7728168971                          | 1027700067328                        |

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

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)



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

Е.Н.Калинихина

(инициалы, фамилия)



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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 1 886 894,88                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 1 886 894,88                           |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества - всего  | 02         | 13 805 960,79                          |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | 13 805 960,79                          |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00          |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00          |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00          |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00          |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00          |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00          |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00          |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00          |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00          |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) - всего  | 03    | 2 054 398,03  |
| в том числе:  |       |               |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00          |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 2 054 398,03  |
| 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 (иностраннх 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    | 533 690,65    |
| в том числе:  |       |               |
| управляющей компании  | 05.01 | 472 641,95    |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 61 048,70     |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 25 096,48     |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00          |
| Прочие доходы   | 08    | 533 690,65    |
| Прочие расходы  | 09    | 538 982,56    |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 54 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00          |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00          |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00          |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 71 183 174,66 |

Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 963 901 441,77   | 964 521 388,93   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 963 901 441,77   | 964 521 388,93   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZYZ26 | 230 306 452,00   | 230 518 561,59   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239             | 26239RMFS   | RU000A103901 | 120 822 590,57   | 120 918 263,11   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | 29007RMFS   | RU000A0JV4M0 | 63 312 481,06  | 63 367 120,60  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | 46020RMFS   | RU000A0GN9A7 | 6 499 525,03   | 6 501 417,91   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | 26225RMFS   | RU000A0ZYUB7 | 83 899 312,38  | 83 930 159,74  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | 26232RMFS   | RU000A1014N4 | 225 162 512,19   | 225 299 429,35   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | 29019RMFS   | RU000A102A49 | 73 499 465,73  | 73 527 757,99  |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | 26220RMFS   | RU000A0JXB41 | 83 899 886,47  | 83 931 377,66  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | 26229RMFS   | RU000A100EG3 | 76 499 216,34  | 76 527 300,98  |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |

|   |   |   |      |      |
|---|---|---|------|------|
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |   |   |      |      |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |   |   |      |      |
| векселя   | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому векселю   |   |   |      |      |
| ипотечные сертификаты   | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |   |   |      |      |
| деPOSITные сертификаты  | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |   |   |      |      |
| закладные   | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой закладной  |   |   |      |      |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |   |   |      |      |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |   |   |      |      |

Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)

| Наименование ценной бумаги  | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|---|--|---|--|---|
|   | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |



|  |  |            |  |                       |
|--|--|------------|--|-----------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

**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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

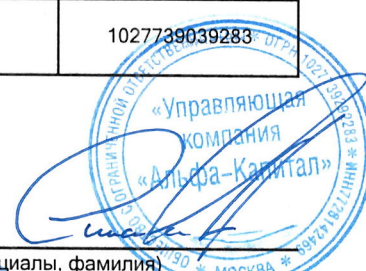
Руководитель акционерного инвестиционного фонда (управляющей компании паевого инвестиционного фонда) (лицо, исполняющее обязанности руководителя акционерного инвестиционного фонда (управляющей компании паевого инвестиционного фонда))

А.В.Списивый  
(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)

НАЧАЛЬНИК УПРАВЛЕНИЯ  
УЧЕТА И КОНТРОЛЯ ПИФ  
АНИКИН И.А.



45

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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                                      |
| <b>Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего</b>  | <b>01</b>  | <b>2 421 679,00</b>                    |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 2 421 679,00                           |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| <b>Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества - всего</b>   | <b>02</b>  | <b>37 938 855,96</b>                   |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением ценных бумаг иностранных эмитентов)   | 02.01      | 37 938 855,96                          |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов)       | 02.04      | 0,00                                   |

|  |       |                |
|--|-------|----------------|
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций                                      | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации   | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент   | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей   | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества  | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности  | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях  | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) - всего   | 03    | 6 706 784,15   |
| в том числе:   |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счета по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям   | 03.02 | 6 706 784,15   |
| 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 (иностраннх 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    | 749 900,66     |
| в том числе:   |       |                |
| управляющей компании   | 05.01 | 671 125,52     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже  | 05.02 | 78 775,14      |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом                                 | 06    | 44 246,67      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)  | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы  | 08    | 749 900,66     |
| Прочие расходы   | 09    | 760 448,38     |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)                                | 10    | 92 000 000,00  |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)             | 11    | -11 448 300,00 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда                    | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов                 | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)  | 14    | 126 814 324,06 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги                 | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|----------|--|--|
|  | 1   | 2        | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего | x   | x        | 2 286 275 095,75   | 2 287 118 135,40   |

47

|  |           |              |                  |                  |
|--|-----------|--------------|------------------|------------------|
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных  | x         | x            | 0,00             | 0,00             |
| в том числе: по каждой акции   |           |              |                  |                  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x         | x            | 0,00             | 0,00             |
| в том числе: по каждой акции   |           |              |                  |                  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 2 286 275 095,75 | 2 287 118 135,40 |
| в том числе:<br>по каждой облигации  |           |              |                  |                  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS | RU000A0JV4L2 | 280 953 531,29   | 281 021 683,16   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | 29012RMFS | RU000A0JX0H6 | 119 486 821,60   | 119 515 629,38   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS | RU000A102BV4 | 135 675 140,56   | 135 769 927,30   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52002   | 52002RMFS | RU000A0ZYZ26 | 125 548 927,02   | 125 673 169,26   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | 26224RMFS | RU000A0ZYUA9 | 105 599 006,94   | 105 628 372,14   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS | RU000A102A31 | 151 195 498,12   | 151 231 577,92   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS | RU000A1038Z7 | 151 627 856,34   | 151 664 413,20   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | 26230RMFS | RU000A100EF5 | 121 686 030,00   | 121 771 043,53   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | 29007RMFS | RU000A0JV4M0 | 13 999 764,04    | 14 003 814,38    |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020          | 46020RMFS | RU000A0GN9A7 | 59 530 201,29    | 59 547 832,02    |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | 29010RMFS | RU000A0JV4Q1 | 116 844 545,89   | 116 872 076,39   |

|  |           |              |                |                |
|--|-----------|--------------|----------------|----------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | 26222RMFS | RU000A0JXQF2 | 151 334 356,96 | 151 423 465,90 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 145 999 936,80 | 146 035 376,78 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | 29009RMFS | RU000A0JV4N8 | 6 499 568,71   | 6 501 361,88   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | 26232RMFS | RU000A1014N4 | 182 047 750,46 | 182 099 568,32 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013 | 29013RMFS | RU000A101KT1 | 87 690 638,57  | 87 718 507,38  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236             | 26236RMFS | RU000A102BT8 | 107 996 120,81 | 108 021 744,00 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | 26209RMFS | RU000A0JSMA2 | 999 149,38     | 1 000 333,03   |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | 26220RMFS | RU000A0JXB41 | 49 522 380,00  | 49 536 694,00  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | 26229RMFS | RU000A100EG3 | 107 890 005,82 | 107 916 017,65 |
| Облигации федерального займа с индексированным номиналом   | 52001RMFS | RU000A0JVMH1 | 64 147 865,15  | 64 165 527,78  |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю  |           |              |                |                |
| векселя  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю  |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |

|   |   |   |      |      |
|---|---|---|------|------|
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |   |   |      |      |
| депозитные сертификаты  | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |   |   |      |      |
| закладные   | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой закладной  |   |   |      |      |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |   |   |      |      |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x | x | 0,00 | 0,00 |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |   |   |      |      |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги  | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|---|--|---|--|---|
|   | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020    | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с амортизацией долга, документарные именные, выпуск 46020 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |

|  |  |                |  |                           |
|--|--|----------------|--|---------------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29012 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |



|  |  |            |                           |
|--|--|------------|---------------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26230 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации федерального займа с индексированным номиналом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списивый  
(инициалы, фамилия)

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

  
(инициалы, фамилия)

  
Для документов № 3

Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И.А.

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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                                      |
| <b>Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего</b>  | <b>01</b>  | <b>1 462 267,93</b>                    |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 1 462 267,93                           |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| <b>Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества - всего</b>   | <b>02</b>  | <b>5 952 678,49</b>                    |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением ценных бумаг иностранных эмитентов)   | 02.01      | 5 952 678,49                           |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов)       | 02.04      | 0,00                                   |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05      | 0,00                                   |

|   |           |                       |
|---|-----------|-----------------------|
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06     | 0,00                  |
| проектной документации  | 02.07     | 0,00                  |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08     | 0,00                  |
| художественных ценностей  | 02.09     | 0,00                  |
| иного имущества   | 02.10     | 0,00                  |
| дебиторской задолженности   | 02.11     | 0,00                  |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12     | 0,00                  |
| <b>Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) - всего</b>   | <b>03</b> | <b>2 333 174,02</b>   |
| в том числе:  |           |                       |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01     | 0,00                  |
| процентный доход по облигациям  | 03.02     | 2 333 174,02          |
| 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                  |
| <b>Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда</b>  | <b>04</b> | <b>0,00</b>           |
| <b>Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже - всего</b> | <b>05</b> | <b>817 526,12</b>     |
| в том числе:  |           |                       |
| управляющей компании  | 05.01     | 732 412,56            |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02     | 85 113,56             |
| <b>Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом</b>                                 | <b>06</b> | <b>126 030,54</b>     |
| <b>Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)</b>  | <b>07</b> | <b>0,00</b>           |
| <b>Прочие доходы</b>  | <b>08</b> | <b>817 526,12</b>     |
| <b>Прочие расходы</b>   | <b>09</b> | <b>829 843,49</b>     |
| <b>Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)</b>                                | <b>10</b> | <b>58 000 000,00</b>  |
| <b>Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)</b>             | <b>11</b> | <b>-13 917 120,00</b> |
| <b>Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда</b>                    | <b>12</b> | <b>0,00</b>           |
| <b>Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов</b>                 | <b>13</b> | <b>0,00</b>           |
| <b>Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)</b>  | <b>14</b> | <b>52 875 126,41</b>  |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги                                      | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|---|---|----------|--|--|
|   | 1   | 2        | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего                      | x   | x        | 2 656 070 528,60   | 2 656 960 312,66   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных | x   | x        | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции                                    |   |          |  |  |

|  |           |              |                  |                  |
|--|-----------|--------------|------------------|------------------|
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x         | x            | 0,00             | 0,00             |
| в том числе: по каждой акции   |           |              |                  |                  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 2 656 070 528,60 | 2 656 960 312,66 |
| в том числе:<br>по каждой облигации  |           |              |                  |                  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS | RU000A0JV4L2 | 136 083 490,95   | 136 118 201,57   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS | RU000A103BR0 | 75 471 923,74    | 75 490 864,09    |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS | RU000A0ZYZ26 | 503 127 667,37   | 503 322 272,17   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | 29014RMFS | RU000A101N52 | 151 999 912,34   | 152 035 101,36   |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS | RU000A1028E3 | 135 999 748,68   | 136 034 773,27   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS | RU000A102A31 | 151 999 873,59   | 152 034 021,51   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS | RU000A1038Z7 | 86 847 174,70    | 86 867 399,38    |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | 29010RMFS | RU000A0JV4Q1 | 282 529 820,93   | 282 600 989,28   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | 26222RMFS | RU000A0JXQF2 | 151 999 983,59   | 152 032 257,56   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | 26227RMFS | RU000A1007F4 | 95 143 040,00    | 95 164 956,04    |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 247 047 352,60   | 247 107 294,86   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | 29009RMFS | RU000A0JV4N8 | 139 899 727,65   | 139 934 606,76   |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | 26232RMFS | RU000A1014N4 | 149 999 287,31   | 150 102 232,03   |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236                | 26236RMFS | RU000A102BT8 | 96 498 432,00  | 96 563 945,18  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019                | 29019RMFS | RU000A102A49 | 154 375 013,07 | 154 480 001,91 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом  | 26209RMFS | RU000A0JSMA2 | 31 599 132,44  | 31 606 292,02  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52004        | 52004RMFS | RU000A103MX5 | 65 448 947,64  | 65 465 103,67  |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги | Наименование эмитента ценной бумаги | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|----------------------------|-------------------------------------|---|--|---|
|                            | 1                                   | 2   | 3  | 4   |

|  |  |                |  |                           |
|--|--|----------------|--|---------------------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52002   | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52004   | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

54

|  |  |            |  |                           |
|--|--|------------|--|---------------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26232 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

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

| 1  | 2  | 3                                   | 4                                    |
|--|--|-------------------------------------|--------------------------------------|
| Фамилия, имя, отчество уполномоченного лица специализированного депозитария, подписавшего отчетность | Полное наименование специализированного депозитария              | ИНН специализированного депозитария | ОГРН специализированного депозитария |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списовый  
(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)

ДИР...  
УЧЕТА И КОНТРОЛЯ ЦИФ  
АНИКИН И.А.



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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 4 605 864,95                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных)  | 01.01      | 4 605 864,95                           |
| 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 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 залладженностью   | 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         | 9 070 348,48                           |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:<br>ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных)  | 02.01 | 9 070 348,48  |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02 | 0,00          |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого<br>имущества  | 02.03 | 0,00          |
| имущественных прав (за исключением прав аренды<br>недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и<br>договоров займа и прав требования к кредитной<br>организации выплатить денежный эквивалент<br>драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00          |
| денежных требований по кредитным договорам и<br>договорам займа, в том числе удостоверенными<br>залладными  | 02.05 | 0,00          |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной<br>ответственностью и прав участия в уставных капиталах<br>иностраных коммерческих организаций  | 02.06 | 0,00          |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00          |
| драгоценных металлов и требований к кредитной<br>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<br>кредитных организациях  | 02.12 | 0,00          |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному<br>фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего   | 03    | 10 550 361,17 |
| в том числе:  |       |               |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00          |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 10 550 361,17 |
| дивиденды по акциям акционерных обществ   | 03.03 | 0,00          |
| доходы по инвестиционным паям (акциям)<br>инвестиционных фондов   | 03.04 | 0,00          |
| распределение прибыли обществ с ограниченной<br>ответственностью (иностраных коммерческих организаций)  | 03.05 | 0,00          |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду<br>(субаренду)  | 03.06 | 0,00          |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа),<br>имущественные права по обязательствам из которых<br>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<br>которых составляют имущество фонда  | 04    | 0,00          |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании,<br>специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение<br>реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего  | 05    | 985 726,67    |
| в том числе:  |       |               |
| управляющей компании  | 05.01 | 847 549,25    |
| специализированному депозитарию, лицу,<br>осуществляющему ведение реестра, аудиторской<br>организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 138 177,42    |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным<br>инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым<br>инвестиционным фондом  | 06    | 65 218,08     |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного<br>инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого<br>инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00          |
| Прочие доходы   | 08    | 947 260,92    |
| Прочие расходы  | 09    | 959 985,92    |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного<br>инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого<br>инвестиционного фонда)   | 10    | 40 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения<br>акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных<br>паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00          |

|  |    |               |
|--|----|---------------|
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда    | 12 | 0,00          |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 13 | 0,00          |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)                                | 14 | 63 162 904,85 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 2 134 838 808,33   | 2 135 496 725,51   |
| обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 2 134 838 808,33   | 2 135 496 725,51   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS   | RU000A103BR0 | 108 899 469,73   | 108 922 443,04   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZYZ26 | 420 688 973,65   | 420 853 355,10   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | 29014RMFS   | RU000A101N52 | 130 399 138,98   | 130 424 945,93   |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 155 068 529,78   | 155 133 376,22   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | 26224RMFS   | RU000A0ZYUA9 | 77 599 737,74  | 77 614 981,30  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 175 848 773,96   | 175 885 553,98   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | 29007RMFS   | RU000A0JV4M0 | 88 499 027,77  | 88 517 406,47  |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, выпуск 29017               | 29017RMFS | RU000A1028D5 | 163 999 881,64 | 164 035 240,52 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008    | 29008RMFS | RU000A0JV4P3 | 255 499 477,33 | 255 554 777,22 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225    | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 338 197 721,53 | 338 339 818,42 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009    | 29009RMFS | RU000A0JV4N8 | 143 638 747,01 | 143 668 655,36 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52004        | 52004RMFS | RU000A103MX5 | 76 499 329,21  | 76 546 171,95  |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| деPOSITные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |

|                                      |  |  |  |  |
|--------------------------------------|--|--|--|--|
| в том числе: по каждой ценной бумаге |  |  |  |  |
|                                      |  |  |  |  |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, выпуск 29017            | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52002   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52004   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360                                      |  | 1037739085636   |

|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списивый  
(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)

Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И.А.

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 876 293,70                             |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 876 293,70                             |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего  | 02         | -48 862 714,84                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | -48 862 714,84                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |



|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 10 701 699,94  |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 10 701 699,94  |
| дивиденды по акциям акционерных обществ   | 03.03 | 0,00           |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов  | 03.04 | 0,00           |
| распределение прибыли обществ с ограниченной ответственностью (иностраных коммерческих организаций)   | 03.05 | 0,00           |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду (субаренду)   | 03.06 | 0,00           |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа), имущественные права по обязательствам из которых составляют имущество фонда   | 03.07 | 0,00           |
| иные доходы по имуществу  | 03.08 | 0,00           |
| Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда   | 04    | 0,00           |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего                                  | 05    | 1 051 203,75   |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 886 639,30     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 164 564,45     |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 43 768,14      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 1 051 203,75   |
| Прочие расходы  | 09    | 1 004 251,21   |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 107 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | -10 584 450,00 |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные пай данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные пай других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 58 082 809,45  |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 2 934 668 538,25   | 2 935 468 373,21   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 2 934 668 538,25   | 2 935 468 373,21   |
| в том числе:<br>по каждой облигации  |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 60 334 084,00  | 60 346 894,66  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS   | RU000A102BV4 | 152 599 865,10   | 152 630 385,07   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZYZ26 | 317 136 312,55   | 317 201 572,71   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | 29014RMFS   | RU000A101N52 | 130 499 833,44   | 130 526 147,93   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 336 498 448,11   | 336 567 109,43   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | 26223RMFS   | RU000A0ZYU88 | 126 314 320,85   | 126 389 071,24   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | 26222RMFS   | RU000A0JXQF2 | 253 194 702,51   | 253 247 075,76   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | 26227RMFS   | RU000A1007F4 | 267 663 068,54   | 267 717 174,80   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | 29008RMFS   | RU000A0JV4P3 | 210 771 288,99   | 210 873 519,89   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | 26225RMFS   | RU000A0ZYUB7 | 252 333 281,61   | 252 449 783,53   |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009    | 29009RMFS | RU000A0JV4N8 | 214 925 894,76 | 214 996 354,22 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013    | 29013RMFS | RU000A101KT1 | 461 797 863,08 | 461 893 795,65 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229    | 26229RMFS | RU000A100EG3 | 150 599 574,71 | 150 629 488,32 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| деPOSITные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги | Наименование эмитента ценной бумаги | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|----------------------------|-------------------------------------|---|--|---|
|                            | 1                                   | 2   | 3  | 4   |
|                            |                                     |   |  |   |

68

|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29009 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

|  |  |            |               |
|--|--|------------|---------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037739085636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037739085636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 | 1037739085636 |

**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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)



**Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И.А.**

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 1 572 358,45                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных)  | 01.01      | 1 572 358,45                           |
| 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 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         | 58 443 971,91                          |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных)  | 02.01      | 58 443 971,91                          |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

21

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 6 282 982,59   |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 6 282 982,59   |
| дивиденды по акциям акционерных обществ   | 03.03 | 0,00           |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов  | 03.04 | 0,00           |
| распределение прибыли обществ с ограниченной ответственностью (иностраных коммерческих организаций)   | 03.05 | 0,00           |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду (субаренду)   | 03.06 | 0,00           |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа), имущественные права по обязательствам из которых составляют имущество фонда   | 03.07 | 0,00           |
| иные доходы по имуществу  | 03.08 | 0,00           |
| Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда   | 04    | 0,00           |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего                                  | 05    | 1 029 493,97   |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 909 017,61     |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 120 476,36     |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 48 589,49      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 1 029 493,97   |
| Прочие расходы  | 09    | 1 029 493,97   |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 55 000 000,00  |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | -8 314 830,00  |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 111 906 399,49 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 3 454 034 616,12   | 3 455 069 515,62   |
| обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 3 454 034 616,12   | 3 455 069 515,62   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 155 999 065,98   | 156 095 229,79   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | 26240RMFS   | RU000A103BR0 | 158 499 686,76   | 158 531 603,82   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | 52002RMFS   | RU000A0ZY26  | 220 025 229,97   | 220 067 799,23   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | 29014RMFS   | RU000A101N52 | 143 999 618,35   | 144 029 207,31   |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 155 999 876,21   | 156 031 332,62   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 294 998 528,00   | 295 057 271,55   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | 26237RMFS   | RU000A1038Z7 | 155 999 536,07   | 156 030 949,68   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | 29007RMFS   | RU000A0JV4M0 | 169 999 457,25   | 170 109 840,46   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | 26223RMFS   | RU000A0ZYU88 | 171 999 410,83   | 172 035 695,64   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | 52003RMFS   | RU000A102069 | 349 998 831,81   | 350 068 332,94   |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | 29010RMFS   | RU000A0JV4Q1 | 160 999 226,46   | 161 031 955,62   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | 26222RMFS   | RU000A0JXQF2 | 174 999 373,28   | 175 035 332,06   |



|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225    | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 493 998 158,08 | 494 231 064,33 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236                | 26236RMFS | RU000A102BT8 | 159 999 199,27 | 160 097 828,91 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26226    | 26226RMFS | RU000A0ZZYW2 | 154 999 148,92 | 155 029 766,56 |
| Облигации федерального займа с индексированным номиналом  | 52001RMFS | RU000A0JVMH1 | 173 020 921,55 | 173 056 473,79 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25084    | 25084RMFS | RU000A101FA1 | 158 499 347,33 | 158 529 831,31 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги | Наименование эмитента ценной бумаги | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|----------------------------|-------------------------------------|---|--|---|
|                            | 1                                   | 2   | 3  | 4   |

24

|  |  |                |  |                           |
|--|--|----------------|--|---------------------------|
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26237             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26240             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002     | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29007 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29014 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25084 | Министерство финансов Российской Федерации | 771016<br>8360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

|  |  |            |  |                           |
|--|--|------------|--|---------------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26222 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26226 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации федерального займа с индексированным номиналом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168360 |  | 1037<br>7390<br>8563<br>6 |

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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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)

А.В.Списывый  
(инициалы, фамилия)

(инициалы, фамилия)

Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И.А.



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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. 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         | 1 855 307,44                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением закладных)  | 01.01      | 1 855 307,44                           |
| с ценными бумагами иностранных эмитентов  | 01.02      | 0,00                                   |
| с недвижимым имуществом и правами аренды недвижимого имущества  | 01.03      | 0,00                                   |
| с имущественными правами (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 01.04      | 0,00                                   |
| с денежными требованиями по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными   | 01.05      | 0,00                                   |
| с долями в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и правами участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 01.06      | 0,00                                   |
| с проектной документацией   | 01.07      | 0,00                                   |
| с драгоценными металлами и требованиями к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 01.08      | 0,00                                   |
| с художественными ценностями  | 01.09      | 0,00                                   |
| с иным имуществом   | 01.10      | 0,00                                   |
| с дебиторской задолженностью  | 01.11      | 0,00                                   |
| с денежными средствами на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 01.12      | 0,00                                   |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества – всего  | 02         | -14 942 846,63                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением закладных)  | 02.01      | -14 942 846,63                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

27

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00          |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00          |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00          |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00          |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00          |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00          |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00          |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00          |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00          |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 4 538 947,16  |
| в том числе:  |       |               |
| процентный доход по банковским счетам (счетам по депозиту)  | 03.01 | 0,00          |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 4 538 947,16  |
| дивиденды по акциям акционерных обществ   | 03.03 | 0,00          |
| доходы по инвестиционным паям (акциям) инвестиционных фондов  | 03.04 | 0,00          |
| распределение прибыли обществ с ограниченной ответственностью (иностраных коммерческих организаций)   | 03.05 | 0,00          |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду (субаренду)   | 03.06 | 0,00          |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа), имущественные права по обязательствам из которых составляют имущество фонда   | 03.07 | 0,00          |
| иные доходы по имуществу  | 03.08 | 0,00          |
| Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда   | 04    | 0,00          |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего                                  | 05    | 1 066 719,92  |
| в том числе:  |       |               |
| управляющей компании  | 05.01 | 954 095,52    |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 112 624,40    |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 33 779,21     |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00          |
| Прочие доходы   | 08    | 1 066 719,92  |
| Прочие расходы  | 09    | 1 080 350,52  |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 38 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00          |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00          |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00          |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 28 337 278,24 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

ЖР

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 1 901 487 775,68   | 1 902 044 963,44   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 1 901 487 775,68   | 1 902 044 963,44   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 228 398 220,00   | 228 443 903,90   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексировемым номиналом, документарные именные, выпуск 52002    | 52002RMFS   | RU000A0ZY26  | 230 238 623,85   | 230 285 215,50   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | 26212RMFS   | RU000A0JTK38 | 62 141 133,20  | 62 153 340,10  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239             | 26239RMFS   | RU000A103901 | 4 999 798,51   | 5 000 784,77   |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | 26235RMFS   | RU000A1028E3 | 168 479 852,27   | 168 513 132,80   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | 26233RMFS   | RU000A101F94 | 59 399 468,25  | 59 411 022,67  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | 26224RMFS   | RU000A0ZYUA9 | 62 999 769,90  | 63 011 247,94  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 130 599 280,06   | 130 644 531,24   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | 26223RMFS   | RU000A0ZYU88 | 72 499 497,95  | 72 513 799,22  |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | 29010RMFS   | RU000A0JV4Q1 | 135 485 497,64   | 135 541 808,28   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | 29008RMFS   | RU000A0JV4P3 | 167 799 672,93   | 167 938 509,92   |

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225    | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 234 799 342,06 | 234 844 698,43 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236                | 26236RMFS | RU000A102BT8 | 63 199 985,75  | 63 212 279,45  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019                | 29019RMFS | RU000A102A49 | 55 599 707,01  | 55 610 217,64  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016    | 29016RMFS | RU000A1025B5 | 72 449 272,85  | 72 492 444,68  |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52004        | 52004RMFS | RU000A103MX5 | 152 398 653,45 | 152 428 026,90 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| деPOSITные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)**

| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26236             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52002   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексированным номиналом, документарные именные, выпуск 52004   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29016 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26212 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |



|  |  |                |  |                       |
|--|--|----------------|--|-----------------------|
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26223 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26224 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| МинФин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26233 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Минфин РФ №26235RMFS   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации Федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 |  | 10377<br>39085<br>636 |

**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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)



**Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И. А.**

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

**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) |
|--|---|--|
| 1  | 2   | 3  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел 2. Параметры отчета о приросте (об уменьшении) стоимости имущества**

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

**Раздел 3. Сведения о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, принадлежащего акционерному инвестиционному фонду (составляющего паевой инвестиционный фонд)**

| Наименование показателя   | Код строки | Значение показателя за отчетный период |
|---|------------|--|
| 1   | 2          | 3                                      |
| Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего   | 01         | 3 445 223,24                           |
| в том числе в результате сделок:  |            |  |
| с ценными бумагами российских эмитентов (за исключением залладных)  | 01.01      | 3 445 223,24                           |
| 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 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         | -15 431 096,11                         |
| в том числе в результате изменения справедливой стоимости:  |            |  |
| ценных бумаг российских эмитентов (за исключением залладных)  | 02.01      | -15 431 096,11                         |
| ценных бумаг иностранных эмитентов  | 02.02      | 0,00                                   |
| недвижимого имущества и прав аренды недвижимого имущества   | 02.03      | 0,00                                   |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| имущественных прав (за исключением прав аренды недвижимого имущества, прав из кредитных договоров и договоров займа и прав требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент драгоценных металлов) | 02.04 | 0,00           |
| денежных требований по кредитным договорам и договорам займа, в том числе удостоверенными закладными  | 02.05 | 0,00           |
| долей в уставных капиталах обществ с ограниченной ответственностью и прав участия в уставных капиталах иностранных коммерческих организаций   | 02.06 | 0,00           |
| проектной документации  | 02.07 | 0,00           |
| драгоценных металлов и требований к кредитной организации выплатить их денежный эквивалент  | 02.08 | 0,00           |
| художественных ценностей  | 02.09 | 0,00           |
| иного имущества   | 02.10 | 0,00           |
| дебиторской задолженности   | 02.11 | 0,00           |
| денежных средств на счетах, в том числе на счетах по депозиту, в кредитных организациях   | 02.12 | 0,00           |
| Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) – всего  | 03    | 14 163 320,35  |
| в том числе:  |       |                |
| процентный доход по банковским счетам (счетах по депозиту)  | 03.01 | 0,00           |
| процентный доход по облигациям  | 03.02 | 14 163 320,35  |
| 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 (иностраннх коммерческих организаций)   | 03.05 | 0,00           |
| доход от сдачи недвижимого имущества в аренду (субаренду)   | 03.06 | 0,00           |
| платежи по кредитным договорам (договорам займа), имущественные права по обязательствам из которых составляют имущество фонда   | 03.07 | 0,00           |
| иные доходы по имуществу  | 03.08 | 0,00           |
| Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда   | 04    | 0,00           |
| Сумма начисленных вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже – всего                                  | 05    | 1 215 743,21   |
| в том числе:  |       |                |
| управляющей компании  | 05.01 | 1 061 726,89   |
| специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже   | 05.02 | 154 016,32     |
| Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом  | 06    | 45 927,40      |
| Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)   | 07    | 0,00           |
| Прочие доходы   | 08    | 1 215 743,21   |
| Прочие расходы  | 09    | 1 202 112,61   |
| Прирост «+» имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)   | 10    | 138 000 000,00 |
| Уменьшение «-» имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)  | 11    | 0,00           |
| Прирост «+» имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные пай данного паевого инвестиционного фонда   | 12    | 0,00           |
| Уменьшение «-» имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные пай других паевых инвестиционных фондов  | 13    | 0,00           |
| Итого: прирост «+» или уменьшение «-» стоимости имущества (строки 01 + 02 + 03 - 04 - 05 - 06 - 07 + 08 - 09 + 10 + 11 + 12 + 13)   | 14    | 138 929 407,47 |

**Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо**

| Наименование ценной бумаги   | Регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска | Код ISIN     | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (покупка) | Стоимость ценных бумаг в составе активов фонда (продажа) |
|--|---|--------------|--|--|
|  | 1   | 2            | 3  | 4  |
| Ценные бумаги российских эмитентов - всего   | x   | x            | 2 486 916 338,73   | 2 487 566 197,95   |
| в том числе: акции, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| акции, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг  | x   | x            | 0,00   | 0,00   |
| в том числе: по каждой акции   |   |              |  |  |
| облигации, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x   | x            | 2 486 916 338,73   | 2 487 566 197,95   |
| в том числе: по каждой облигации   |   |              |  |  |
| "Джи-групп" АО, облигации биржевые процентные бездокументарные, серия 002P-01                              | 4B02-01-10609-P-001P                                    | RU000A103JR3 | 19 552 761,74  | 19 551 958,23  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | 29006RMFS   | RU000A0JV4L2 | 258 362 333,17   | 258 412 521,54   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | 29020RMFS   | RU000A102BV4 | 216 199 029,92   | 216 240 492,75   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239             | 26239RMFS   | RU000A103901 | 99 841 298,03  | 99 860 445,68  |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | 29018RMFS   | RU000A102A31 | 153 399 280,56   | 153 428 741,63   |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, выпуск 29017            | 29017RMFS   | RU000A1028D5 | 19 551 327,71  | 19 555 184,41  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | 52003RMFS   | RU000A102069 | 87 239 200,52  | 87 256 050,83  |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | 26227RMFS   | RU000A1007F4 | 154 599 705,75   | 154 628 338,46   |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | 29008RMFS   | RU000A0JV4P3 | 289 126 771,79   | 289 219 998,07   |

85

|   |           |              |                |                |
|---|-----------|--------------|----------------|----------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225    | 26225RMFS | RU000A0ZYUB7 | 307 898 596,67 | 307 982 650,51 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013    | 29013RMFS | RU000A101KT1 | 287 649 050,68 | 287 705 398,37 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019                | 29019RMFS | RU000A102A49 | 243 598 316,27 | 243 707 748,98 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229    | 26229RMFS | RU000A100EG3 | 121 499 606,75 | 121 522 974,62 |
| Облигации федерального займа с переменным купонным доходом  | 29015RMFS | RU000A1025A7 | 128 399 528,40 | 128 474 985,11 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом  | 26241RMFS | RU000A105FZ9 | 99 999 530,77  | 100 018 708,76 |
| облигации, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой облигации  |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| инвестиционные паи, не обращающиеся на организованном рынке ценных бумаг                                      | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому инвестиционному паю   |           |              |                |                |
| векселя   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому векселю   |           |              |                |                |
| ипотечные сертификаты   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому ипотечному сертификату  |           |              |                |                |
| депозитные сертификаты  | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждому депозитному сертификату   |           |              |                |                |
| закладные   | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой закладной  |           |              |                |                |
| иные российские ценные бумаги (коносаменты, складские свидетельства, опционы эмитента и прочие ценные бумаги) | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |
| Иностранные ценные бумаги, квалифицированные в качестве ценных бумаг, - всего                                 | x         | x            | 0,00           | 0,00           |
| в том числе: по каждой ценной бумаге  |           |              |                |                |

Раздел 4. Отчет о финансовых вложениях, переданных (полученных) с обязательством обратного выкупа (обратной продажи) по сделкам репо (информация об эмитенте)

| Наименование ценной бумаги   | Наименование эмитента ценной бумаги        | Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН) | TIN эмитента представляемых ценных бумаг | Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) |
|--|--|---|--|---|
|  | 1  | 2   | 3  | 4   |
| "Джи-групп" АО, облигации биржевые процентные бездокументарные, серия 002P-01                              | "Джи-групп", АО                            | 1660359<br>180                                  |  | 12116<br>00013<br>866                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, выпуск 29017            | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 26239             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29018             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29019             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Министерство финансов Российской Федерации, облигации процентные бездокументарные, серия 29020             | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с индексируемым номиналом, документарные именные, выпуск 52003     | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29006 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29008 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360                                  |  | 10377<br>39085<br>636                                 |

84

|  |  |                |                       |
|--|--|----------------|-----------------------|
| Минфин РФ, облигации федерального займа с переменным купонным доходом, документарные именные, выпуск 29013 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26225 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26227 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Минфин РФ, облигации федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26229 | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации федерального займа с переменным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |
| Облигации федерального займа с постоянным купонным доходом   | Министерство финансов Российской Федерации | 7710168<br>360 | 10377<br>39085<br>636 |

**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                                    |
|  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списивый

(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)



Начальник Управления  
Учёта и контроля ПИФ  
Аникин И.А.

88



**Отчет о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)**

**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  |
| Биржевой паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации» | 4039  | 44494078   |

**Раздел II. Параметры отчета о вознаграждениях и расходах**

| Текущий отчетный год | Код валюты, в которой определена стоимость чистых активов |
|----------------------|---|
| 1                    | 2   |
| 2022                 | RUB   |

**Раздел III. Сведения о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)**

| 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         | 9 694 547,02                                 |
| в том числе:   |            |  |
| управляющей компании   | 01.01      | 8 492 263,04                                 |
| специализированному депозитарию  | 01.02      | 365 690,61                                   |
| лицу, осуществляющему ведение реестра акционеров акционерного инвестиционного фонда (владельцев  | 01.03      | 679 381,04                                   |
| оценщику   | 01.04      | 0,00   |
| аудиторской организации  | 01.05      | 88 500,00                                    |
| бирже  | 01.06      | 68 712,33                                    |
| Сумма начисленных расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)   | 02         | 623 919,93                                   |
| в том числе (по видам расходов)  |            |  |
| 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  | 02.01      | 140 152,21                                   |
| расходы по оплате услуг клиринговых организаций по определению взаимных обязательств по сделкам, совершенным с имуществом Фонда, если такие услуги оказываются управляющей компании, осуществляющей доверительное управление   | 02.02      | 172 304,29                                   |
| 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 | 02.03      | 152 870,27                                   |
| Иные расходы   | 02.04      | 151 693,16                                   |
| <b>ИТОГО сумма вознаграждений и расходов (сумма строк 01+02)</b>   | <b>03</b>  | <b>10 318 466,95</b>                         |

**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                                    |
| П.И.Прасс  | Акционерное общество "СПЕЦИАЛИЗИРОВАННЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ "ИНФИНИТУМ" | 7705380065                          | 1027739039283                        |

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

А.В.Списовый

(инициалы, фамилия)

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

(инициалы, фамилия)

СУНДУКОВА И.В.





**Пояснительная записка к годовой отчетности паевого инвестиционного фонда за 2022 год**

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 13.01.2021 №5708-У «Об объеме, 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».

Общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания «Альфа-Капитал» (далее – Общество), имеющее лицензию на осуществление деятельности по управлению паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00028 от 22 сентября 1998 года, выданную Федеральной службой по финансовым рынкам, без ограничения срока действия, направляет Отчеты по форме 0420505 «Отчет о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)» за 2022 год и поясняет следующее:

При подготовке отчетности Общество руководствуется требованиями Указания Банка России от 13.01.2021 №5708-У «Об объеме, 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»:

- Отчет по форме 0420505 «Отчет о вознаграждениях и расходах, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)» (далее – *Отчет о вознаграждениях и расходах*) составляется за календарный год с 1 января по 31 декабря включительно (далее – отчетный год),
- Значение показателя «Сумма начисленных расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)» за отчетный год в Отчете о вознаграждениях и расходах должно соответствовать сумме значений соответствующего показателя «Сумма начисленных расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим активы акционерного инвестиционного фонда (составляющим паевой инвестиционный фонд)» раздела III «Сведения о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, принадлежащего акционерному инвестиционному фонду (составляющего паевой инвестиционный фонд)» Отчета по форме 0420503 «Отчет о приросте (об уменьшении) стоимости имущества, принадлежащего акционерному инвестиционному фонду (составляющего паевой инвестиционный фонд)» (далее – *Отчет о приросте*) за двенадцать отчетных месяцев отчетного года (далее – *контрольное соотношение*),
- Отчет о приросте составляется за каждый календарный месяц со дня, следующего за последним рабочим днем месяца, предшествующего отчетному, до последнего рабочего дня отчетного календарного месяца включительно.

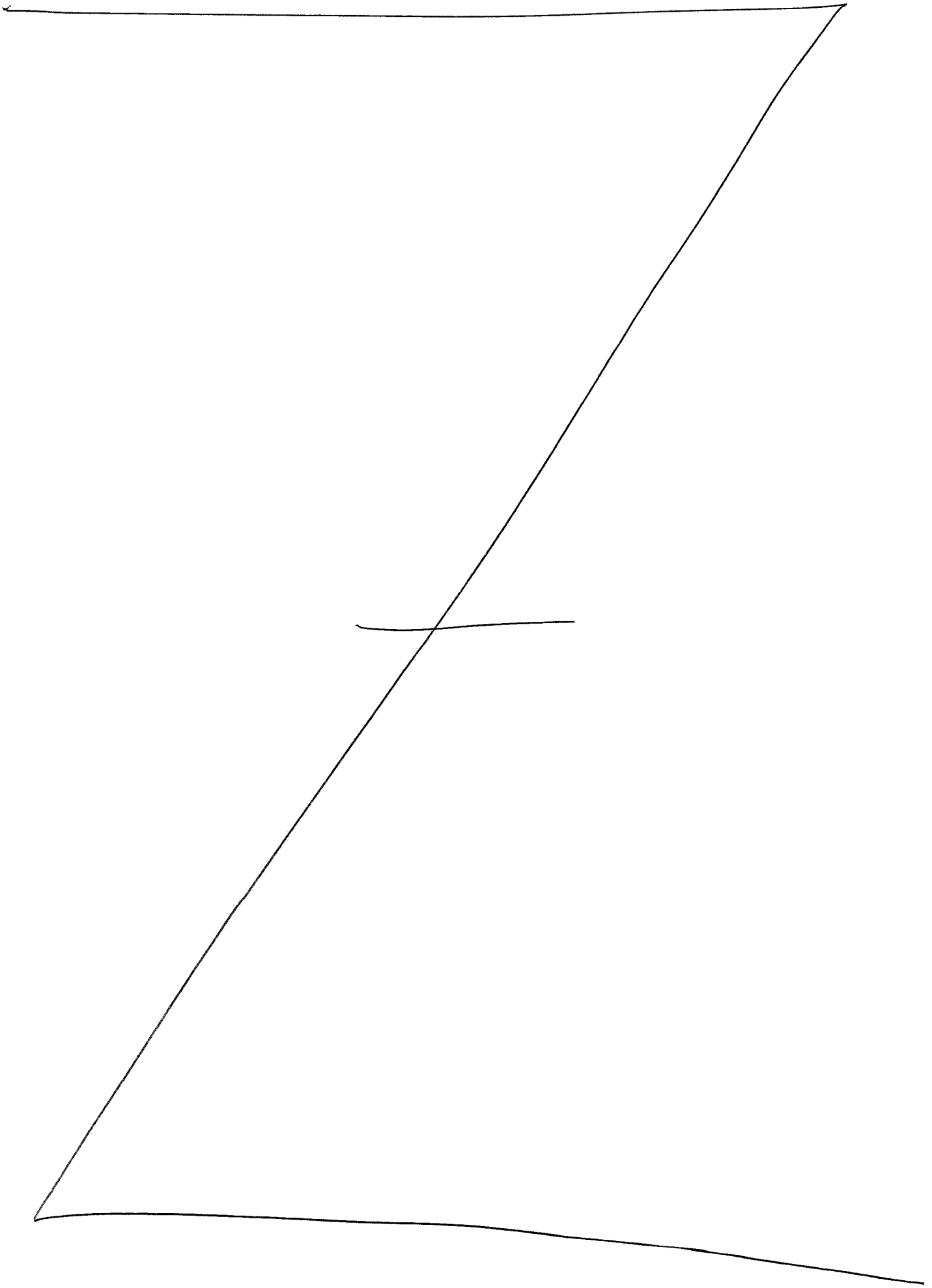
31 декабря 2021 года было нерабочим днем, однако АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" списывало комиссии за расчетно-кассовое обслуживание с расчетных счетов клиентов. Данные комиссии не были отражены в Отчете о вознаграждениях и расходах за 2022 год и были отражены Отчетах о приросте за январь 2022 года.

31 декабря 2022 года было нерабочим днем, однако АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" списывало комиссии за расчетно-кассовое обслуживание с расчетных счетов клиентов. Данные комиссии были отражены в Отчете о вознаграждениях и расходах за 2022 год и не были отражены Отчетах о приросте за декабрь 2022 года.

Таким образом, контрольное соотношение не соблюдается в отношении предоставленной отчетности по БПИФ рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Управляемые облигации».

Первый заместитель Генерального директора, Финансовый директор

  
  
Списывый А.В./  
М.П.



Всего прошито и  
пронумеровано  
91 лист(ов)

