

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2014 г.

Государственное учреждение - Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания "АК БАРС КАПИТАЛ" Д.У.
средствами пенсионных накоплений, 1435126890/165601001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У047

Дата и время составления расчёта: 01.04.2014 17:07:19

1. Денежные средства на счетах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (руб.)
	дата	номер		
1	2	3	4	5
ОАО "АК БАРС" Банк	14.05.2010	395/14	40701810000022000688	68 536,81
Итого денежных средств на счетах				68 536,81

2. Денежные средства в депозитах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (руб.)	Проценты начисленные (руб.)
	дата	номер			
1	2	3	4	5	6
ОАО "АК БАРС" Банк	08.11.2013	204/62	42005810600020000014	237 000 000,00	7 272 328,76
ОАО "АК БАРС" Банк	08.11.2013	205/62	42006810400020000213	176 000 000,00	5 738 082,19
ОАО "АК БАРС" Банк	01.03.2013	32/62	42006810800020000101	84 000 000,00	1 905 534,24
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				511 915 945,19	

3. Государственные ценные бумаги Российской Федерации, обращающиеся на рынке ценных бумаг, за исключением облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации

Вид ценных бумаг	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6
Облигация	25068RMFS	1 020,6510000	5 760,00	5 878 949,76	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	25079RMFS	996,7430000	50 000,00	49 837 150,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	26207RMFS	951,1680000	154 310,00	146 774 734,08	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	26211RMFS	894,9290000	150 000,00	134 239 350,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14

Облигация	26212RMFS	862,8900000	35 000,00	30 201 150,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				366 931 333,84	

4. Государственные ценные бумаги Российской Федерации, специально выпущенные Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов

Вид ценных бумаг	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Цена приобретения (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации, специально выпущенных Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов				0,00

5. Облигации внешних облигационных займов Российской Федерации

Вид ценных бумаг	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость в рублях по курсу Банка России (руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации				0,00

6. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Вид ценных бумаг	Наименование субъекта Российской Федерации	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Облигация	Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	1 003,1000000	7 154,00	7 176 177,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	796,0000000	1 755,00	1 396 980,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 12.02.14
Облигация	Московская область	RU26007MOO0	997,4000000	64 996,00	64 827 010,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 008,5000000	66 604,00	67 170 134,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	870,0000000	55 044,00	47 888 280,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 27.03.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	985,0000000	50 497,00	49 739 545,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	974,1000000	45,00	43 834,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	1 086,5000000	1 394,00	1 514 581,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 27.01.14

Облигация	Правительство г.Нижний Новгород	RU34007NJG0	759,0000000	52 000,00	39 468 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 26.03.14
Облигация	Правительство Ярославской области	RU34010YRS0	649,8700000	856,00	556 288,72	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					279 780 831,02	

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00	

8. Облигации российских хозяйственных обществ

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
"Газпром капитал", ООО	4-06-36400-R	975,0000000	81 499,00	79 461 525,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40600316B	1 003,4000000	45 233,00	45 386 792,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 05.02.14
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000000	23 400,00	0,00	Оценочная стоимость (п. 8.о. Приказа 06-155/пз-н). Облигация просрочена на 1 817 дней
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0,0000000	42 340,00	0,00	Оценочная стоимость (п. 8.о. Приказа 06-155/пз-н). Облигация просрочена на 958 дней
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020703251B	1 002,7000000	26 360,00	26 431 172,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
КБ "ЛОКО-Банк" (ЗАО)	4B020502707B	1 000,3000000	9 014,00	9 016 704,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 04.03.14
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	990,0000000	29 500,00	29 205 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	987,9000000	47 570,00	46 994 403,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	999,8000000	7 129,00	7 127 574,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14

ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	989,6000000	44 143,00	43 683 912,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	1 005,5000000	79 300,00	79 736 150,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	990,4000000	54 000,00	53 481 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	965,1000000	5 000,00	4 825 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 25.03.14
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	959,4000000	10 000,00	9 594 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 27.03.14
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 013,9000000	105 000,00	106 459 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 010,3000000	4 485,00	4 531 195,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	999,4000000	50 000,00	49 970 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Магнит"	4B02-06-60525-P	999,3000000	25 099,00	25 081 430,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	689,8000000	33 248,00	22 934 470,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B020501978B	998,5000000	40 000,00	39 940 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "МТС"	4-02-04715-A	984,9000000	13 872,00	13 662 532,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 24.03.14
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	999,0000000	101 110,00	101 008 890,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "НЛМК"	4-08-00102-A	990,7000000	5 950,00	5 894 665,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "НЛМК"	4B02-07-00102-A	997,2000000	32 870,00	32 777 964,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 27.03.14
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	998,1000000	13 638,00	13 612 087,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020502209B	997,7000000	46 500,00	46 393 050,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 20.03.14
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	1 002,5000000	68 635,00	68 806 587,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 21.03.14

ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	984,9000000	6 900,00	6 795 810,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	982,1000000	20 000,00	19 642 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	987,2000000	32 034,00	31 623 964,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	976,9000000	17 980,00	17 564 662,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "РусГидро"	4-08-55038-E	1 007,3000000	9 500,00	9 569 350,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 04.02.14
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	1 006,2998095	25 201,00	25 359 761,50	Средняя цена на 07.11.13 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-12-65018-D	1 012,2000000	9 999,00	10 120 987,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 07.02.14
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-18-65018-D	999,9000000	50 000,00	49 995 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	997,2000000	8 411,00	8 387 449,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	990,6000000	22 076,00	21 868 485,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО «АЛЬФА-БАНК»	4B020401326B	979,2000000	67 582,00	66 176 294,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО «ГТЛК»	4-02-32432-H	985,0000000	8 592,00	8 463 120,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 25.03.14
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B021002272B	989,3000000	49 100,00	48 574 630,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 290 158 222,40	

8.1 Ценные бумаги международных финансовых организаций

Наименование эмитента	ISIN	CFI	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	4	5	6	7	8
Итого рыночная стоимость бумаг международных финансовых организаций					0,00	

9. Акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ

Наименование эмитента	Категория и тип акций	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
ОАО"Ростелеком"	Обыкновенная	1-01-00124-A	85,1900000	3,00	255,57	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
ОАО"Ростелеком"	Привилегированная	2-01-00124-A	54,9400000	7,00	384,58	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 31.03.14
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					640,15	

10. Облигации с ипотечным покрытием, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием				0,00	

11. Ипотечные сертификаты участия, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах

Индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия с данным ипотечным покрытием	Наименование управляющей компании ипотечным покрытием	Регистрационный номер правил доверительного управления ипотечным покрытием	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия					0,00	

12. Паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов

Вид ценных бумаг	Наименование фонда	Наименование управляющего активами фонда	Номер выпуска или иные реквизиты ценных бумаг	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость в рублях по курсу Банка России (руб.)
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость паев (акций, долей) индексных инвестиционных фондов						0,00

13. Дебиторская задолженность

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	
Наименование брокера	Сумма средств (руб.)
1	2

ОАО "АК БАРС" Банк		235 092 742,14
Итого средств на специальных брокерских счетах		235 092 742,14
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
"Газпром капитал", ООО	4-06-36400-R	652 806,99
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40600316B	231 592,96
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	63 742,14
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	7 493,85
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020703251B	183 202,00
КБ "ЛОКО-Банк" (ЗАО)	4B020502707B	161 891,44
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	75 744,00
Министерство финансов Российской Федерации	25079RMFS	1 122 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	26207RMFS	1 377 988,30
Министерство финансов Российской Федерации	26211RMFS	1 552 500,00
Министерство финансов Российской Федерации	26212RMFS	365 050,00
Московская область	RU26007MOO0	2 364 554,48
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	503 526,24
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	1 160 877,96
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	1 036 198,44
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	77,85
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	61 879,66
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	204 435,00
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	329 660,10
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	78 276,42
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	1 301 777,07
ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	880 230,00
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	170 100,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	157 100,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	314 200,00
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	3 836 700,00
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	217 029,15
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	2 405 500,00
ОАО "Магнит"	4B02-06-60525-P	852 613,03
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	246 035,20
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B020501978B	988 000,00
ОАО "МТС"	4-02-04715-A	471 231,84
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	6 758 192,40
ОАО "НЛМК"	4-08-00102-A	157 496,50
ОАО "НЛМК"	4B02-07-00102-A	1 120 209,60
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	315 856,08
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020502209B	1 009 050,00
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	695 958,90
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	164 703,00
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	620 000,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	473 142,18
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	192 565,80
ОАО "РусГидро"	4-08-55038-E	101 745,00
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	340 213,50

ОАО "ФСК ЕЭС"	4-12-65018-D	348 365,16
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-18-65018-D	1 304 000,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	29 017,95
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	59 825,96
ОАО «АЛЬФА-БАНК»	4B020401326B	2 413 353,22
ОАО «ГТЛК»	4-02-32432-H	138 846,72
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B021002272B	345 173,00
Правительство г.Нижний Новгород	RU34007NJG0	1 456 520,00
Правительство Ярославской области	RU34010YRS0	8 397,36
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		41 426 646,45

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	276 519 388,59

14. Итого рыночная стоимость активов, составляющих инвестиционный портфель управляющей компании

2 725 374 898,00 руб. **

* Указывается наименование организатора торговли на рынке ценных бумаг (фондовой биржи), которым определена рыночная цена, если рыночная цена определена указанным организатором торговли (фондовой биржей).

** Рассчитывается как сумма итоговых статей по активам 1 - 13.

Генеральный директор

Дорогов Алексей Николаевич

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00117-192501F025		
Дата и время отправки	01.04.2014 18:16:16	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 01.04.2014 13:08:03 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 01.04.2014 14:12:35 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		