

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2013 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: 09.01.2014 17:30:48

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	7 533 258,10
Итого денежных средств на счетах				7 533 258,10

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	2 597 260,27
ОАО "АК БАРС" Банк	08.11.2013	205/62	42006810400020000213	176 000 000,00	2 049 315,07
ОАО "АК БАРС" Банк	01.03.2013	32/62	42006810800020000101	84 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				501 646 575,34	

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	1 037,6260000	5 760,00	5 976 725,76	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	25076RMFS	1 002,6700000	155 000,00	155 413 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	25079RMFS	1 012,2720000	50 000,00	50 613 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	26207RMFS	1 032,8090000	265 000,00	273 694 385,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13

Облигация	26211RMFS	964,2540000	150 000,00	144 638 100,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	26212RMFS	931,4460000	35 000,00	32 600 610,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				662 937 270,76	

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	1 039,4000000	7 154,00	7 435 867,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	800,6400000	1 755,00	1 405 123,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Московская область	RU26007MOO0	1 001,7000000	55 996,00	56 091 193,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 024,5000000	66 604,00	68 235 798,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	928,6000000	55 044,00	51 113 858,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 03.12.13
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	998,5000000	50 497,00	50 421 254,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	999,6000000	45,00	44 982,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13

Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	1 101,0000000	1 394,00	1 534 794,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 25.10.13
Облигация	Правительство г.Нижний Новгород	RU34007NJG0	771,6000000	52 000,00	40 123 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Облигация	Правительство Ярославской области	RU34010YRS0	650,2600000	856,00	556 622,56	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					276 962 693,46	

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
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40600316B	1 002,7000000	9 201,00	9 225 842,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-Н	0,0000000	23 400,00	0,00	Оценочная стоимость (п. 8.о. Приказа 06-155/пз-н). Облигация просрочена на 1 362 дней
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-Ж	0,0000000	42 340,00	0,00	Оценочная стоимость (п. 8.о. Приказа 06-155/пз-н). Облигация просрочена на 503 дней
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020303251B	1 001,7000000	53 734,00	53 825 347,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	1 014,5000000	50 000,00	50 725 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	1 011,0000000	40 000,00	40 440 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 038,9000000	105 000,00	109 084 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 022,0000000	2 000,00	2 044 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13

ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	1 006,0000000	5 007,00	5 037 042,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	1 009,8000000	50 000,00	50 490 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4B02-04-00078-A	1 000,3000000	41 945,00	41 957 583,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	999,8000000	399,00	398 920,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	637,6000000	34 000,00	21 678 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	967,3000000	40 373,00	39 052 802,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	961,9000000	37 496,00	36 067 402,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	969,8000000	23 500,00	22 790 300,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	1 001,5000000	10 903,00	10 919 354,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	998,4000000	13 638,00	13 616 179,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 001,4000000	43 289,00	43 349 604,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	1 000,3000000	1 324,00	1 324 397,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	998,9986957	6 900,00	6 893 091,00	Средняя цена на 18.09.13 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	997,8000000	10 000,00	9 978 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 017,1000000	13 119,00	13 343 334,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	1 008,1000000	16 980,00	17 117 538,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
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"	4-18-65018-D	1 006,0000000	50 000,00	50 300 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13

Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ	675 018 402,40
---	----------------

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 "ИНТЕР РАО ЕЭС"	Обыкновенная	1-03-33498-E	0,0099910	2 589 200 000,00	25 868 697,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "ОГК-2"	Обыкновенная	1-02-65105-D	0,2551000	122 502 996,00	31 250 514,28	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Россети"	Обыкновенная	1-01-55385-E	0,7770000	52 000 000,00	40 404 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "РусГидро"	Обыкновенная	1-01-55038-E	0,5676000	207 163 000,00	117 585 718,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Энел ОГК-5"	Обыкновенная	1-01-50077-A	1,1193000	29 699 000,00	33 242 090,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	Обыкновенная	1-01-00085-A	0,8727000	67 163 000,00	58 613 150,10	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Ростелеком"	Обыкновенная	1-01-00124-A	110,9700000	4,00	443,88	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
ОАО "Ростелеком"	Привилегированная	2-01-00124-A	74,3500000	785 003,00	58 364 973,05	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.12.13
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					365 329 588,01	

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	209 985 568,58
Итого средств на специальных брокерских счетах	209 985 568,58

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40600316B	49 501,38
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	241 304,42
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	7 774,65
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020303251B	1 861 345,76
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	249 984,00
Министерство финансов Российской Федерации	25076RMFS	3 317 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	25079RMFS	259 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	26207RMFS	7 812 200,00
Министерство финансов Российской Федерации	26211RMFS	4 200 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	26212RMFS	987 000,00
Московская область	RU26007MOO0	932 893,36
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	503 526,24
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	211 368,96
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	164 620,22
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	863,10
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	20 631,20

ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	1 689 000,00
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	1 018 400,00
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	277 200,00
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	41 300,00
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	134 237,67
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	1 154 000,00
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4B02-04-00078-A	1 090 150,55
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	9 663,78
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	1 108 400,00
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	1 213 612,38
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	1 127 129,76
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	924 020,00
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	524 434,30
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	642 486,18
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 392 174,24
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	44 287,80
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	31 188,00
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	118 900,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	630 761,52
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	545 737,20
ОАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	870 442,54
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-18-65018-D	256 000,00
Правительство г.Нижний Новгород	RU34007NJG0	499 720,00
Правительство Ярославской области	RU34010YRS0	8 799,68
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		36 171 058,89

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	246 156 627,47

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

2 735 584 415,54 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	VTB00117-179845F025		
Дата и время отправки	10.01.2014 14:40:40	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 09.01.2014 13:32:40 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 10.01.2014 10:37:35 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		