

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2014 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: 01.07.2014 15:23:04

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	71 935,61
Итого денежных средств на счетах				71 935,61

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	205/62	42006810400020000213	140 800 000,00	9 246 509,58
ОАО "АК БАРС" Банк	01.03.2013	32/62	42006810800020000101	67 200 000,00	3 717 909,03
ОАО "АК БАРС" Банк	04.06.2014	118/62	42005810600020000043	304 000 000,00	2 219 616,44
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				527 184 035,05	

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	25071RMFS	1 002,6600000	60 000,00	60 159 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	25079RMFS	993,8230000	60 000,00	59 629 380,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	26202RMFS	1 017,5880000	9 000,00	9 158 292,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	26207RMFS	984,7000000	154 310,00	151 949 057,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14

Облигация	26211RMFS	935,8320000	150 000,00	140 374 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	26212RMFS	892,7300000	35 000,00	31 245 550,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				452 516 679,00	

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	1 000,9000000	7 154,00	7 160 438,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	582,0000000	1 755,00	1 021 410,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 19.05.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	847,3000000	55 044,00	46 638 781,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	982,5000000	50 497,00	49 613 302,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	960,7000000	45,00	43 231,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
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	756,4500000	52 000,00	39 335 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14

Облигация	Республика КОМИ	RU35011KOM0	1 034,5000000	18 000,00	18 621 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					163 948 144,80	

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	979,8000000	81 499,00	79 852 720,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	1 006,4000000	18 733,00	18 852 891,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Банк ВТБ	4B020601000B	999,0000000	16 075,00	16 058 925,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Банк ВТБ	4B022101000B	985,0000000	5 074,00	4 997 890,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
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 1 908 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 1 049 дней
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020703251B	1 002,8000000	26 360,00	26 433 808,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
КБ "ЛОКО-Банк" (ЗАО)	4B020502707B	998,8000000	9 014,00	9 003 183,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	990,0000000	29 500,00	29 205 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	990,0000000	47 570,00	47 094 300,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14

ОАО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	1 010,0000000	19 002,00	19 192 020,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	999,2000000	9 383,00	9 375 493,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	993,9000000	48 500,00	48 204 150,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	999,2000000	116 411,00	116 317 871,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	997,5000000	54 590,00	54 453 525,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	967,2000000	5 000,00	4 836 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	967,3000000	10 000,00	9 673 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 006,7000000	5 060,00	5 093 902,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	1 001,0000000	50 000,00	50 050 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Магнит"	4B02-07-60525-P	998,6000000	18 317,00	18 291 356,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-18-00078-A	1 000,0000000	19 300,00	19 300 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 15.05.14
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4B02-07-00078-A	998,9000000	18 288,00	18 267 883,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "МегаФон"	4B02-04-00822-J	1 005,3000000	70 000,00	70 371 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	829,4000000	30 000,00	24 882 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "МТС"	4-02-04715-A	989,3000000	13 872,00	13 723 569,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	978,5000000	19 565,00	19 144 352,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	988,0000000	23 148,00	22 870 224,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "НЛМК"	4-08-00102-A	992,1000000	77 774,00	77 159 585,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14

ОАО "НЛМК"	4B02-07-00102-A	1 000,0000000	32 870,00	32 870 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	991,0000000	8 000,00	7 928 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 26.06.14
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020502209B	1 000,1000000	46 500,00	46 504 650,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	998,9000000	68 635,00	68 559 501,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	990,2000000	6 900,00	6 832 380,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 14.04.14
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	986,3000000	20 000,00	19 726 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	991,2000000	70 784,00	70 161 100,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	978,9000000	22 094,00	21 627 816,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "РусГидро"	4-08-55038-E	979,9000000	9 500,00	9 309 050,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	972,8000000	25 201,00	24 515 532,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-12-65018-D	983,9000000	9 999,00	9 838 016,10	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-15-65018-D	1 002,3000000	40 000,00	40 092 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	999,8000000	8 411,00	8 409 317,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	999,7000000	22 076,00	22 069 377,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО «АЛЬФА-БАНК»	4B020401326B	973,6000000	67 582,00	65 797 835,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 23.06.14
ОАО «ГТЛК»	4-02-32432-H	999,2000000	8 592,00	8 585 126,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B020402272B	1 000,5000000	22 200,00	22 211 100,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B021002272B	987,9000000	49 100,00	48 505 890,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14

ОАО"Ростелеком"	4-64-00124-A	995,0000000	30 000,00	29 850 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 22.05.14
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 396 097 344,70	

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	86,3100000	3,00	258,93	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
ОАО"Ростелеком"	Привилегированная	2-01-00124-A	60,8800000	7,00	426,16	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ММВБ" на 30.06.14
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					685,09	

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	213 439 590,60
Итого средств на специальных брокерских счетах	213 439 590,60

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	2 176 838,29
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	335 320,70
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	239 372,84
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	5 616,00
Банк ВТБ	4B020601000B	36 811,75
Банк ВТБ	4B022101000B	78 190,34
ЗАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020703251B	850 373,60
КБ "ЛОКО-Банк" (ЗАО)	4B020502707B	375 342,96
Министерство финансов Российской Федерации	25071RMFS	439 200,00
Министерство финансов Российской Федерации	25079RMFS	299 400,00
Министерство финансов Российской Федерации	26202RMFS	33 120,00
Министерство финансов Российской Федерации	26207RMFS	4 513 567,50
Министерство финансов Российской Федерации	26211RMFS	4 170 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	26212RMFS	980 000,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	200 360,16
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	155 025,79
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	863,10
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	20 617,26
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	785 290,00
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	1 266 313,40
ОАО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	170 827,98
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	298 379,40
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	371 995,00
ОАО "АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	3 903 260,83
ОАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	1 376 759,80
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	54 250,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	108 500,00

ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	102 920,40
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	1 140 000,00
ОАО "Магнит"	4B02-07-60525-P	437 776,30
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-18-00078-A	124 292,00
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4B02-07-00078-A	581 192,64
ОАО "МегаФон"	4B02-04-00822-J	743 400,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	969 900,00
ОАО "МТС"	4-02-04715-A	203 224,80
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	223 823,60
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	248 146,56
ОАО "НЛМК"	4-08-00102-A	429 312,48
ОАО "НЛМК"	4B02-07-00102-A	386 879,90
ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	240 240,00
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020502209B	2 052 510,00
ОАО "Промсвязьбанк"	4B020203251B	2 278 682,00
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	29 670,00
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	233 600,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	2 403 824,64
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	704 798,60
ОАО "РусГидро"	4-08-55038-E	303 050,00
ОАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	864 898,32
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-12-65018-D	146 485,35
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-15-65018-D	642 400,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	217 760,79
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	555 211,40
ОАО «АЛЬФА-БАНК»	4B020401326B	1 023 191,48
ОАО «ГТЛК»	4-02-32432-H	353 131,20
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B020402272B	622 266,00
ОАО АКБ "РОСБАНК"	4B021002272B	1 391 494,00
ОАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	372 600,00
Правительство г.Нижний Новгород	RU34007NJG0	488 800,00
Республика КОМИ	RU35011KOM0	141 840,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		43 902 919,16

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	257 342 509,76

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****2 797 161 334,01 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			
Исходящий рег. номер	VTB00117-206569F025		
Дата и время отправки	01.07.2014 15:23:44	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 01.07.2014 11:23:43 UTC [00117-5] Электронная подпись верна		