

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2012 г.**

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: 02.04.2012 19:21:12

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	332 444 631,20
Итого денежных средств на счетах				332 444 631,20

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	27.03.2012	66/62	42006810300020000038	5 000 000,00	0,00
ОАО "АК БАРС" Банк	11.05.2011	37/62	42006810700020000146	169 650 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				174 650 000,00	

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
ГКО-ОФЗ	25065RMFS	1 056,3870000	5 000,00	5 281 935,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	25068RMFS	1 115,9710000	42 221,00	47 117 411,59	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	995,5800000	20 000,00	19 911 600,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	46002RMFS	251,2752502	7 834,00	1 968 490,31	-
ГКО-ОФЗ	46014RMFS	483,2660000	27 999,00	13 530 964,73	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ГКО-ОФЗ	46017RMFS	973,4810000	29 999,00	29 203 456,52	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	943,0360000	20 122,00	18 975 770,39	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				135 989 628,54	

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
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU31006CHU0	1 000,0000000	29 407,00	29 407 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU34007CHU0	809,9200000	6 493,00	5 258 810,56	-
Субфедеральная бумага	Московская область	RU26007MOO0	999,1000000	40 000,00	39 964 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	970,2000000	22 798,00	22 118 619,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 112,5000000	107 000,00	119 037 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	1 098,1000000	30 000,00	32 943 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	1 152,9004250	25 400,00	29 283 670,79	-
Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35007KOM0	1 002,0000000	10 000,00	10 020 000,00	-

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации	288 032 600,95
--	----------------

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
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	1 031,2000000	50 297,00	51 866 266,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	986,0000000	6 136,00	6 050 096,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
"Российский сельскохозяйственный банк" ОАО	40303349B	1 016,5000000	23 000,00	23 379 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	1 001,2000000	3 150,00	3 153 780,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000000	23 400,00	0,00	-
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0,0000000	42 340,00	0,00	-
ОАО "АИЖК"	4-10-00739-A	991,4000000	16,00	15 862,40	-
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	995,7000000	181,00	180 221,70	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 025,5000000	96 300,00	98 755 650,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	1 001,5000000	5 000,00	5 007 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	1 014,5000000	69 945,00	70 959 202,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 130,7000000	11 420,00	12 912 594,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	964,1000000	40 000,00	38 564 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ИНПРОМ"	4-02-55534-P	0,0000000	4 724,00	0,00	-
ОАО "МДМ Банк"	4B020100323B	1 024,7000000	46 450,00	47 597 315,00	-

ОАО "МТС"	4-05-04715-A	1 020,0000000	45 000,00	45 900 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	995,6000000	30 000,00	29 868 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 021,0000000	17 895,00	18 270 795,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 005,8000000	46 710,00	46 980 918,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	994,1000000	29 611,00	29 436 295,10	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	4-14-00124-A	1 015,8000000	65 000,00	66 027 000,00	-
ООО "Инком-Лада"	4-02-36068-R	0,0000000	16 621,00	0,00	-
ООО "Инком-Лада"	4-03-36068-R	0,0000000	22 536,00	0,00	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				594 924 996,10	

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	0,0309000	699 000 000,00	21 599 100,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	269,1000000	170 800,00	45 962 280,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Аэрофлот"	обыкновенная	1-01-00010-A	47,2200000	700 000,00	33 054 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	обыкновенная	1-01-55234-E	714,3000000	7 000,00	5 000 100,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Нефтяная компания ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	1 790,2000000	4 000,00	7 160 800,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,7475000	33 000 488,00	24 667 864,78	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D-004D	0,7468000	22 005 508,00	16 433 713,37	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	1,0829000	130 000 000,00	140 777 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	95,1400000	50 000,00	4 757 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО "ТГК-1"	обыкновенная	1-01-03388-D	0,0100620	1 515 200 000,00	15 245 942,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Холдинг МРСК"	обыкновенная	1-01-55385-E	3,2880000	560 000,00	1 841 280,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	2,2920000	13 500 000,00	30 942 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,8473000	66 179 000,00	122 252 466,70	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	145,0000000	500 000,00	72 500 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОГК-1	обыкновенная	1-02-65107-D	0,6839000	64 000 000,00	43 769 600,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					585 963 147,25	

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	1 253 786,45
ОАО "АК БАРС" Банк	176 087 033,60
Итого средств на специальных брокерских счетах	177 340 820,05

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	1 702 050,48
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	42 031,60
"Российский сельскохозяйственный банк" ОАО	40303349B	256 450,00
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	50 494,50
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0,00
Министерство финансов Российской Федерации	25065RMFS	149 600,00
Министерство финансов Российской Федерации	25065RMFS	4 950,00
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	527 340,29
Министерство финансов Российской Федерации	26205RMFS	653 800,00
Министерство финансов Российской Федерации	46002RMFS	22 326,90
Министерство финансов Российской Федерации	46014RMFS	64 397,70
Министерство финансов Российской Федерации	46017RMFS	299 090,03
Министерство финансов Российской Федерации	46018RMFS	105 841,72
Министерство финансов Чувашской Республики	RU31006CHU0	431 694,76
Министерство финансов Чувашской Республики	RU34007CHU0	31 685,84
Московская область	RU26007MOO0	1 438 000,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	539 628,66
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	943 740,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	345 300,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	219 202,00
ОАО "АИЖК"	4-10-00739-A	158,72
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	649,79
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 790 217,00
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	183 650,00
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	408 721,80
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	2 388 621,75
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	93 600,00
ОАО "МДМ Банк"	4B020100323B	1 963 441,50
ОАО "МТС"	4-05-04715-A	4 374 450,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	979 500,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	795 790,65
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	419 455,80
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	689 344,08
ОАО "Ростелеком"	4-14-00124-A	1 229 150,00
Республика КОМИ	RU35007КОМ0	282 700,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		23 427 075,57

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	200 767 895,62

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

2 312 772 899,66 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 А.Н.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса			
Исходящий рег. номер	VTB00117-001-95625F022		
Дата и время отправки	02.04.2012 19:22:22	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич, дата и время ЭЦП 02.04.2012 15:22:21 GMT [CN=048050117-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		