

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2013 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: 02.04.2013 10:11:55

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	350 262 405,37
Итого денежных средств на счетах				350 262 405,37

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	16.05.2012	121/62	42006810200020000060	167 000 000,00	0,00
ОАО "АК БАРС" Банк	01.03.2013	32/62	42006810800020000101	84 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				251 000 000,00	

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	25068RMFS	1 082,0750000	1 000,00	1 082 075,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	26212RMFS	983,3150000	84 997,00	83 578 825,06	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	26207RMFS	1 080,8530000	80 000,00	86 468 240,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				171 129 140,06	

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	Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	1 046,7000000	17 998,00	18 838 506,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	988,6571429	7 000,00	6 920 600,00	-
Субфедеральная бумага	Московская область	RU26007MOO0	1 003,6000000	59 058,00	59 270 608,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	944,8982897	40 829,00	38 579 252,27	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 059,0000000	98 863,00	104 695 917,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	1 128,2700143	1 394,00	1 572 808,40	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	1 019,1000000	2,00	2 038,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	1 064,3000000	29 463,00	31 357 470,90	-
Субфедеральная бумага	Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	1 035,0000000	150,00	155 250,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35007KOM0	501,3000000	4 597,00	2 304 476,10	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35008KOM0	959,5000000	1,00	959,50	-

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации	263 697 887,77
--	----------------

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	1 003,3000000	5 002,00	5 018 506,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	889,2000000	31 741,00	28 224 097,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	964,3000000	43 000,00	41 464 900,00	-
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	949,7000000	36 825,00	34 972 702,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	970,5000000	12 313,00	11 949 766,50	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	989,3000000	6 625,00	6 554 112,50	-
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	1 005,2000000	199,00	200 034,80	-
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	1 012,7000000	34 998,00	35 442 474,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Акрон"	4-03-00207-A	1 000,0000000	1,00	1 000,00	-
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 004,3000000	2 061,00	2 069 862,30	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 080,1000000	98 681,00	106 585 348,10	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	1 000,6000000	12 090,00	12 097 254,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-02-55234-E	1 004,0000000	36 966,00	37 113 864,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 014,3000000	2 000,00	2 028 600,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-01-55234-E	1 006,9000000	8 944,00	9 005 713,60	-

ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 002,2000000	25 320,00	25 375 704,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МДМ Банк"	4B020400323B	1 004,3000000	2 899,00	2 911 465,70	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	1 000,3000000	4 965,00	4 966 489,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 002,8000000	42 800,00	42 919 840,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	1 007,5000000	9 674,00	9 746 555,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	999,8000000	480,00	479 904,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	1 006,3000000	676,00	680 258,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 072,6000000	69 226,00	74 251 807,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	999,8000000	11 500,00	11 497 700,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Челябинский металлургический комбинат"	4-02-55005-E	995,8000000	13 008,00	12 953 366,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-03-36314-R	250,6754500	54,00	13 536,47	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-05-36314-R	673,7347200	40 044,00	26 979 033,13	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-04-36314-R	496,1984000	60 000,00	29 771 904,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "ХКФ Банк"	40500316B	1 001,4881521	17 030,00	17 055 343,23	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				592 331 144,53	

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	0,0179270	3 048 200 000,00	54 645 081,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	153,8000000	310 000,00	47 678 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Банк ВТБ"	обыкновенная	10401000B	0,0498100	935 000 000,00	46 572 350,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,3289000	129 000 996,00	42 428 427,58	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,6136000	323 500 000,00	198 499 600,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Холдинг МРСК"	обыкновенная	1-01-55385-E	1,7260000	13 300 000,00	22 955 800,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	1,3912000	31 500 000,00	43 822 800,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,2820000	47 000 000,00	60 254 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	121,9000000	95 000,00	11 580 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	88,1800000	30 000,00	2 645 400,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					531 081 958,98	

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	214 567 909,97
Итого средств на специальных брокерских счетах	214 567 909,97

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	101 740,68
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	225 995,92
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	388 720,00
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	332 898,00
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	162 531,60
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	155 502,72
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	12 820,00
Министерство финансов Российской Федерации	26207RMFS	696 800,00
Министерство финансов Российской Федерации	26212RMFS	1 099 861,18
Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	24 430,00
Московская область	RU26007MOO0	2 135 537,28
Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	23,02
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	254 265,69
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	809 687,97
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	861 083,61
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	67 037,46

ОАО "АИЖК"	4-10-00739-A	64 262,50
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	714,41
ОАО "Акрон"	4-03-00207-A	2,25
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	1 227 729,84
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	22 155,75
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	3 568 304,96
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	96 160,00
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-01-55234-E	247 033,28
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-02-55234-E	192 592,86
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	31 434,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 067 491,20
ОАО "МДМ Банк"	4B020400323B	79 229,67
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	221 534,60
ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	41 606,70
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	373 644,00
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	9 907,20
ОАО "Россельхозбанк"	41503349B	23 497,76
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	682 568,36
ОАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	152 605,00
ОАО "Челябинский металлургический комбинат"	4-02-55005-E	287 476,80
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-03-36314-R	214,38
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-04-36314-R	607 800,00
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-05-36314-R	437 280,48
ООО "ХКФ Банк"	40500316B	293 426,90
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	5 560,50
Республика КОМИ	RU35007KOM0	64 495,91
Республика КОМИ	RU35008KOM0	5,18
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		17 127 669,62

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	231 695 579,59

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

2 391 198 116,30 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	VTB00117-001-139192F025		
Дата и время отправки	02.04.2013 10:13:09	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭЦП 02.04.2013 10:13:06 GMT [048050117-05] ЭЦП верна		