

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2016 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, 1435126890/165701001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

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

Дата и время составления расчёта: 09.01.2017 16:58:22

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
Нижегородский филиал ПАО Банка "ФК Открытие"	30.04.2015	221965/146/11	40701810101460000017	4 496 165,34
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				4 502 765,34

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
ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	20.12.2016	692/Лк/16	42004810300001600692	304 000 000,00	941 071,04
ПАО "ПРОМСВЯЗЬБАНК"	28.12.2016	32032-12-16-09	42003810300000000578	149 280 000,00	126 031,48
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				454 347 102,52	

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	25080RMFS	997,6140000	33 000,00	32 921 262,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	25081RMFS	977,6750000	23 000,00	22 486 525,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	26206RMFS	996,6850000	145 000,00	144 519 325,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				199 927 112,00	

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	Ярославская область	RU35013YRS0	707,8400000	52 000,00	36 807 680,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	785,7600000	49 930,00	39 232 996,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	401,7600000	7 154,00	2 874 191,04	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	511,1000000	39 749,00	20 315 713,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Облигация	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	990,8000000	38 016,00	37 666 252,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					136 896 834,54	

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	4-05-36400-R	997,9000000	74 812,00	74 654 894,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	1 013,9000000	48 000,00	48 667 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	1 001,0000000	32 001,00	32 033 001,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «Россельхозбанк»	40503349B	1 010,1000000	67 500,00	68 181 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 011,5000000	58 800,00	59 476 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.12.16
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 017,1000000	28 443,00	28 929 375,30	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «Россельхозбанк»	41403349B	1 000,5000000	202,00	202 101,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 007,0000000	60 000,00	60 420 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	199,7200000	45 589,00	9 105 035,08	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	1 000,2000000	49 000,00	49 009 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 003,4000000	49 946,00	50 115 816,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 10.10.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 015,5000000	31 990,00	32 485 845,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	993,0000000	75 000,00	74 475 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	996,0000000	40 000,00	39 840 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 08.04.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-H	994,5000000	3 500,00	3 480 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 04.04.16

АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	783,6800000	30 000,00	23 510 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	785,7600000	50 000,00	39 288 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	486,2500000	5 000,00	2 431 250,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	486,1000000	10 000,00	4 861 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-04-43801-H	1 002,6000000	10 000,00	10 026 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	1 010,2000000	83 000,00	83 846 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
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 1 964 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 024,5000000	60 784,00	62 273 208,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.12.16
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 005,9000000	64 800,00	65 182 320,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	1 016,4000000	120 010,00	121 978 164,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	1 000,7000000	35 000,00	35 024 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 016,2000000	105 000,00	106 701 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 018,0000000	35 500,00	36 139 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001 P	1 003,7000000	84 500,00	84 812 650,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	995,8000000	50 000,00	49 790 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.12.16
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	1 025,7000000	22 766,00	23 351 086,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	1 013,3000000	5 000,00	5 066 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 22.12.16

ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 002,0000000	41 600,00	41 683 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	1 009,8000000	99 617,00	100 593 246,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 17.10.16
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	996,5000000	6 900,00	6 875 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 15.03.16
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	990,5000000	24 500,00	24 267 250,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	990,2000000	26 000,00	25 745 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	749,9250000	30 000,00	22 497 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	999,1000000	9 999,00	9 990 000,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.04.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	999,0000000	30 000,00	29 970 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 24.10.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	1 000,0000000	2 004,00	2 004 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.12.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	991,8000000	10 000,00	9 918 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.16
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 658 902 944,28	

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
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					0,00	

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
АО ИК "АК БАРС ФИНАНС"	6 991 278,82
Итого средств на специальных брокерских счетах	6 991 278,82

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	4-05-36400-R	2 088 751,04
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	2 517 120,00
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	1 830 777,21
АО «Россельхозбанк»	40503349B	635 850,00
АО «Россельхозбанк»	40803349B	772 632,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	373 741,02
АО «Россельхозбанк»	41403349B	12 283,62
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 084 800,00

АО "АИЖК"	4-09-00739-A	86 163,21
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	510 580,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 369 019,86
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 120 609,70
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	2 706 750,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	1 420 400,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-H	63 910,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	676 200,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	1 127 000,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	29 950,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	59 900,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-04-43801-H	511 800,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	3 439 520,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	40 560,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	508 287,40
Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	95 577,44
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	184 435,36
Минфин РФ	25080RMFS	488 400,00
Минфин РФ	25081RMFS	586 040,00
Минфин РФ	26206RMFS	500 250,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	3 206 963,84
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 080 864,00
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	3 467 088,90
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	1 045 100,00
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	2 670 150,00
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	1 350 775,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	46 475,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	631 500,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	305 747,38
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	98 850,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 072 032,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	1 661 611,56
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	134 688,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	810 215,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	859 820,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	797 700,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	157 584,24
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	702 600,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	73 546,80
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	341 300,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	123 932,16
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		45 479 851,74
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1		2
Итого прочая дебиторская задолженность		0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)		52 471 130,56

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****2 507 047 889,24 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	VTB00117-312352F025		
Дата и время отправки	10.01.2017 10:37:37	Дата и время приёма	10.01.2017 11:17:33
Подписано	'1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 09.01.2017 13:59:02 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 10.01.2017 7:35:57 UTC [00001-1] Электронная подпись верна'		