

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2017 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: 02.10.2017 17:45:07

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
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	266 396,98
Итого денежных средств на счетах				266 396,98

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
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					0,00

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
Облигация	24018RMFS	1 005,6500000	15 000,00	15 084 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММББ" на 29.09.17
Облигация	25081RMFS	995,3500000	23 000,00	22 893 050,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММББ" на 29.09.17
Облигация	26208RMFS	1 001,5400000	89 796,00	89 934 285,84	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММББ" на 29.09.17
Облигация	26221RMFS	998,5100000	27 000,00	26 959 770,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММББ" на 29.09.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				154 871 855,84	

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	459,4500000	52 000,00	23 891 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.09.17
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	700,2100000	49 930,00	34 961 485,30	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 21.09.17
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	311,9100000	39 749,00	12 398 110,59	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					71 250 995,89	

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
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	1 001,6000000	800,00	801 280,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.09.17

АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	1 011,7000000	4 899,00	4 956 318,30	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 014,8000000	49 946,00	50 685 200,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 07.09.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 000,0000000	111 055,00	111 055 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-03-43801-Н	1 005,7000000	30 000,00	30 171 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 11.07.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-09-43801-Н	1 008,6000000	3 500,00	3 530 100,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.06.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-20-43801-Н	399,0000000	30 000,00	11 970 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-21-43801-Н	399,0400000	99 444,00	39 682 133,76	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-22-43801-Н	373,0125000	29 594,00	11 038 931,93	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-23-43801-Н	372,8250000	10 000,00	3 728 250,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4B02-07-43801-Н	996,8000000	83 000,00	82 734 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 22.09.17
АО "Россельхозбанк"	40503349B	1 004,9000000	42 039,00	42 244 991,10	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 25.09.17
АО "Россельхозбанк"	40803349B	1 016,5000000	56 000,00	56 924 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "Россельхозбанк"	40903349B	1 015,6000000	26 000,00	26 405 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "Россельхозбанк"	41503349B	1 002,4000000	57 000,00	57 136 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
АО "Россельхозбанк"	41603349B	1 015,0000000	15 000,00	15 225 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.09.17
АО "Россельхозбанк"	42203349B	986,0000000	2,00	1 972,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-Н	1 000,0000000	17 000,00	17 000 000,00	Средняя цена на 27.06.17 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-Н	1 002,2000000	79 000,00	79 173 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 19.06.17

АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	996,0000000	40 000,00	39 840 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 08.04.16
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 2 237 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 011,6000000	60 784,00	61 489 094,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 002,5000000	64 800,00	64 962 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	999,3000000	32 000,00	31 977 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020402590B	991,2000000	5 868,00	5 816 361,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	1 001,5000000	105 000,00	105 157 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Газпром нефть"	4B02-02-00146-A	1 017,6000000	5 000,00	5 088 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Газпром нефть"	4B02-07-00146-A	1 015,3000000	147 010,00	149 259 253,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 012,7000000	35 500,00	35 950 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001 P	1 005,3000000	84 500,00	84 947 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	999,5000000	50 000,00	49 975 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	1 002,8000000	22 766,00	22 829 744,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	1 002,4000000	5 000,00	5 012 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 18.09.17
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	971,1000000	41 600,00	40 397 760,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.09.17
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020803251B	951,3000000	1 778,00	1 691 411,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	504,9000000	99 617,00	50 296 623,30	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	1 001,2000000	24 500,00	24 529 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 11.07.17
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	1 001,1000000	26 000,00	26 028 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 19.09.17
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	248,8500000	30 000,00	7 465 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 10.04.17
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"	4-06-00013-A	1 001,0000000	35 000,00	35 035 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	1 003,0000000	48 000,00	48 144 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 23.08.17
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 587 194 177,29	

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
АК «АЛРОСА» (ПАО)	Обыкновенная	1-03-40046-N	81,8500000	200 000,00	16 370 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
ПАО "Московский Кредитный Банк"	Обыкновенная	10101978B	4,5930000	45 426 000,00	208 641 618,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.17
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					225 011 618,00	

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"	135 189 815,64
Итого средств на специальных брокерских счетах	135 189 815,64

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	42 872,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	244 411,11
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	204 778,60
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	414 235,15
АО "ВЭБ-лизинг"	4-03-43801-H	1 461 000,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-09-43801-H	152 040,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-20-43801-H	83 700,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-21-43801-H	277 448,76

АО "ВЭБ-лизинг"	4-22-43801-H	361 342,74
АО "ВЭБ-лизинг"	4-23-43801-H	122 100,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4B02-07-43801-H	594 280,00
АО "Россельхозбанк"	40503349B	1 523 072,97
АО "Россельхозбанк"	40803349B	2 257 920,00
АО "Россельхозбанк"	40903349B	1 048 320,00
АО "Россельхозбанк"	41503349B	2 594 070,00
АО "Россельхозбанк"	41603349B	799 800,00
АО "Россельхозбанк"	42203349B	2,32
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	236 300,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	1 098 100,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	522 800,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	26 000,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	444 876,30
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	109 707,24
Минфин РФ	24018RMFS	404 100,00
Минфин РФ	25081RMFS	230 460,00
Минфин РФ	26208RMFS	572 000,52
Минфин РФ	26221RMFS	1 293 030,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 449 090,56
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	2 777 328,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	168 320,00
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020402590B	168 000,84
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	5 785 500,00
ПАО "Газпром нефть"	4B02-02-00146-A	11 650,00
ПАО "Газпром нефть"	4B02-07-00146-A	342 533,30
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	359 615,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	2 153 060,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 716 000,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	830 731,34
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	237 200,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	2 155 712,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020803251B	995,68
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	2 134 792,31
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	298 149,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	291 060,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	308 880,00
ПАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	109 800,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	359 464,05
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	29 700,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	439 600,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	602 880,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		39 848 829,79

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

Итого дебиторская задолженность (руб.)	175 038 645,43

14. Итого рыночная стоимость активов, составляющих инвестиционный портфель управляющей компании**2 213 633 689,43 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	VTB00117-320974F025		
Дата и время отправки	02.10.2017 17:52:52	Дата и время приёма	02.10.2017 17:54:06
Подписано	'1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 02.10.2017 14:45:20 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 02.10.2017 14:51:41 UTC [00001-1] Электронная подпись верна'		