

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.09.2012 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: 02.10.2012 18:33:11

**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        | 320 000 273,23                |
| Итого денежных средств на счетах   |                                      |        |                             | 320 000 273,23                |

**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                                                | 27.03.2012                           | 66/62  | 42006810300020000038        | 49 000 000,00                 | 0,00                        |
| Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты) |                                      |        |                             | 216 000 000,00                |                             |

**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                                                                                              | 25067RMFS                                                               | 1 002,9140000        | 13 330,00        | 13 368 843,62             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ГКО-ОФЗ                                                                                              | 26198RMFS                                                               | 1 000,1490000        | 75 189,00        | 75 200 203,16             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле |                                                                         |                      |                  | 88 569 046,78             |                                               |

#### 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 | RU34007CHU0                                   | 809,9208171          | 6 426,00         | 5 204 551,17              | -                                             |
| Субфедеральная бумага                                                                | Московская область                         | RU26007MOO0                                   | 996,2000000          | 34 305,00        | 34 174 641,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Субфедеральная бумага                                                                | Мэрия (правительство) Москвы               | RU32048MOS0                                   | 896,6000000          | 4 196,00         | 3 762 133,60              | -                                             |
| Субфедеральная бумага                                                                | Мэрия (правительство) Москвы               | RU32049MOS0                                   | 968,5000000          | 21 527,00        | 20 848 899,50             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Субфедеральная бумага                                                                | Мэрия (правительство) Москвы               | RU31062MOS0                                   | 1 089,5000000        | 95 806,00        | 104 380 637,00            | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Субфедеральная бумага                                                                | Мэрия (правительство) Москвы               | RU25061MOS0                                   | 1 060,0000000        | 23 418,00        | 24 823 080,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Субфедеральная бумага                                                                | Мэрия (правительство) Москвы               | RU25063MOS0                                   | 1 099,1000000        | 45 033,00        | 49 495 770,30             | -                                             |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации |                                            |                                               |                      |                  | 242 689 712,57            |                                               |

#### 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                                                            | 1 002,4000000        | 8 596,00         | 8 616 630,40              | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Мечел"                                 | 4-05-55005-E                                                            | 1 000,7000000        | 7 534,00         | 7 539 273,80              | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Мечел"                                 | 4-14-55005-E                                                            | 921,2641511          | 14 100,00        | 12 989 824,53             | -                                             |
| ОАО "Мечел"                                 | 4-15-55005-E                                                            | 929,4000000          | 4 500,00         | 4 182 300,00              | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| "Российский сельскохозяйственный банк" ОАО  | 40303349B                                                               | 1 015,8000000        | 15 206,00        | 15 446 254,80             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| "Российский сельскохозяйственный банк" ОАО  | 40803349B                                                               | 1 004,5000000        | 26 771,00        | 26 891 469,50             | 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 "Газпром"                               | 4-11-00028-A                                                            | 1 103,6000000        | 116 411,00       | 128 471 179,60            | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Группа ЛСР"                            | 4B02-03-55234-E                                                         | 979,0000000          | 32 364,00        | 31 684 356,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "ИНПРОМ"                                | 4-02-55534-P                                                            | 0,0000000            | 4 724,00         | 0,00                      | -                                             |
| ОАО "МДМ Банк"                              | 4B020100323B                                                            | 1 008,6000000        | 42 878,00        | 43 246 750,80             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "МТС"                                   | 4-07-04715-A                                                            | 985,0000000          | 80 002,00        | 78 801 970,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "НЛМК"                                  | 4B02-05-00102-A                                                         | 1 003,2000000        | 55 848,00        | 56 026 713,60             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "НОМОС-БАНК"                            | 4B020102209B                                                            | 999,2000000          | 30 000,00        | 29 976 000,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "НОМОС-БАНК"                            | 40702209B                                                               | 1 000,0000000        | 9 000,00         | 9 000 000,00              | -                                             |
| ОАО "Промсвязьбанк"                         | 40403251B                                                               | 996,3000000          | 39 736,00        | 39 588 976,80             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Российские Железные Дороги"            | 4-10-65045-D                                                            | 1 104,1000000        | 83 591,00        | 92 292 823,10             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| 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 |              |           |           | 584 754 522,93 |   |

**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                                                            | 0,0267790            | 340 000 000,00   | 9 104 860,00              | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Мечел"                                                                                         | обыкновенная          | 1-01-55005-E                                                            | 218,7000000          | 56 000,00        | 12 247 200,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Аэрофлот"                                                                                      | обыкновенная          | 1-01-00010-A                                                            | 43,4300000           | 850 000,00       | 36 915 500,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Группа ЛСР"                                                                                    | обыкновенная          | 1-01-55234-E                                                            | 573,5000000          | 42 450,00        | 24 345 075,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "МТС"                                                                                           | обыкновенная          | 1-01-04715-A                                                            | 228,2000000          | 240 000,00       | 54 768 000,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "НОВАТЭК"                                                                                       | обыкновенная          | 1-02-00268-E                                                            | 351,1100000          | 57 500,00        | 20 188 825,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "ОГК-2"                                                                                         | обыкновенная          | 1-02-65105-D                                                            | 0,3967000            | 102 000 996,00   | 40 463 795,11             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "РусГидро"                                                                                      | обыкновенная          | 1-01-55038-E                                                            | 0,8568000            | 144 000 000,00   | 123 379 200,00            | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Сбербанк России"                                                                               | привилегированная     | 20301481B                                                               | 66,9100000           | 211 600,00       | 14 158 156,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Энел ОГК-5"                                                                                    | обыкновенная          | 1-01-50077-A                                                            | 1,8193000            | 12 265 000,00    | 22 313 714,50             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"                                                        | обыкновенная          | 1-01-00085-A                                                            | 1,3879000            | 78 450 000,00    | 108 880 755,00            | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОАО "Ростелеком"                                                                                    | обыкновенная          | 1-01-00124-A                                                            | 134,9500000          | 291 000,00       | 39 270 450,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| ОГК-1                                                                                               | обыкновенная          | 1-02-65107-D                                                            | 0,6118000            | 76 800 000,00    | 46 986 240,00             | ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа" |
| Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ |                       |                                                                         |                      |                  | 553 021 770,61            |                                               |

### 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                                              | 468 995 648,17       |
| Итого средств на специальных брокерских счетах                  | 468 995 648,17       |

| 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                                                            | 174 842,64                             |
| ОАО "Мечел"                                                               | 4-14-55005-E                                                            | 100 392,00                             |
| ОАО "Мечел"                                                               | 4-05-55005-E                                                            | 193 473,12                             |
| ОАО "Мечел"                                                               | 4-15-55005-E                                                            | 40 680,00                              |
| "Российский сельскохозяйственный банк" ОАО                                | 40303349B                                                               | 173 348,40                             |
| "Российский сельскохозяйственный банк" ОАО                                | 40803349B                                                               | 955 724,70                             |
| ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"                               | 4-01-16444-J                                                            | 0,00                                   |
| Министерство финансов Российской Федерации                                | 25067RMFS                                                               | 305 390,30                             |

|                                                                                 |                 |               |
|---------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------|
| Министерство финансов Российской Федерации                                      | 26198RMFS       | 4 103 815,62  |
| Министерство финансов Чувашской Республики                                      | RU34007CHU0     | 32 644,08     |
| Московская область                                                              | RU26007MOO0     | 1 240 468,80  |
| Мэрия (правительство) Москвы                                                    | RU32048MOS0     | 89 332,84     |
| Мэрия (правительство) Москвы                                                    | RU32049MOS0     | 445 824,17    |
| Мэрия (правительство) Москвы                                                    | RU31062MOS0     | 751 119,04    |
| Мэрия (правительство) Москвы                                                    | RU25061MOS0     | 259 939,80    |
| Мэрия (правительство) Москвы                                                    | RU25063MOS0     | 370 171,26    |
| ОАО "Газпром"                                                                   | 4-11-00028-A    | 4 209 421,76  |
| ОАО "Группа ЛСР"                                                                | 4B02-03-55234-E | 84 146,40     |
| ОАО "МДМ Банк"                                                                  | 4B020100323B    | 1 827 460,36  |
| ОАО "МТС"                                                                       | 4-07-04715-A    | 2 631 265,78  |
| ОАО "НЛМК"                                                                      | 4B02-05-00102-A | 2 500 314,96  |
| ОАО "НОМОС-БАНК"                                                                | 40702209B       | 206 100,00    |
| ОАО "НОМОС-БАНК"                                                                | 4B020102209B    | 276 600,00    |
| ОАО "Промсвязьбанк"                                                             | 40403251B       | 934 193,36    |
| ОАО "Российские Железные Дороги"                                                | 4-10-65045-D    | 824 207,26    |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям |                 | 22 730 876,65 |

| Прочая дебиторская задолженность       |                                        |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| Наименование дебиторской задолженности | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
| 1                                      | 2                                      |
| Итого прочая дебиторская задолженность | 0,00                                   |
| Итого дебиторская задолженность (руб.) |                                        |
|                                        | 491 726 524,82                         |

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

**2 496 761 850,94 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 | operedo@odk.ru                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                     |                    |
| Исходящий рег. номер    | VTB00117-001-115049F022                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                     |                    |
| Дата и время отправки   | 02.10.2012 19:47:47                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | Дата и время приёма | 03.10.2012 8:49:09 |
| Подписано               | 1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭЦП 02.10.2012 14:34:31 GMT<br>[CN=048050117-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU]<br>ЭЦП верна<br>2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 02.10.2012 15:46:00 GMT<br>[CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU]<br>ЭЦП верна |                     |                    |