

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2013 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: 01.10.2013 14:56:42

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	78 010,29
Итого денежных средств на счетах				78 010,29

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	01.03.2013	32/62	42006810800020000101	84 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				84 000 000,00	

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	25076RMFS	1 005,0850000	418 500,00	420 628 072,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	25068RMFS	1 052,6380000	995,00	1 047 374,81	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				421 675 447,31	

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	RU34006NJG0	1 000,0000000	20,00	20 000,00	-
Субфедеральная бумага	Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	1 048,1000000	29 554,00	30 975 547,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	900,9000000	1 000,00	900 900,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	988,6571429	7 000,00	6 920 600,00	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	939,8000000	99,00	93 040,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	1 000,4000000	45,00	45 018,00	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 038,1000000	67 000,00	69 552 700,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	1 119,3000000	1 394,00	1 560 304,20	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	1 029,5399734	29 160,00	30 021 385,62	-
Субфедеральная бумага	Ярославская область	RU34010YRS0	650,3900000	206,00	133 980,34	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					140 223 475,76	

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"	4-14-55005-E	840,0000000	34 423,00	28 915 320,00	-
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	941,7000000	41 690,00	39 259 473,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	935,7000000	37 496,00	35 085 007,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	987,6000000	23 500,00	23 208 600,00	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"	4-11-00739-A	1 007,7000000	199,00	200 532,30	-
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	1 002,1000000	47 600,00	47 699 960,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 050,2000000	79 320,00	83 301 864,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	1 003,0000000	5 007,00	5 022 021,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 020,3000000	2 000,00	2 040 600,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	1 005,3000000	50 000,00	50 265 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 004,4000000	31 600,00	31 739 040,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 005,5000000	43 289,00	43 527 089,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	1 010,3000000	13 638,00	13 778 471,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	998,9986957	6 900,00	6 893 091,00	-
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 036,8000000	49 555,00	51 378 624,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	1 004,3000000	25 000,00	25 107 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020303251B	1 002,7000000	32 020,00	32 106 454,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020203251B	1 014,2000000	1 324,00	1 342 800,80	-
ООО "ХКФ Банк"	40600316B	1 005,0000000	3 300,00	3 316 500,00	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				524 187 948,20	

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 "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	102,0000000	336 133,00	34 285 566,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Банк ВТБ"	обыкновенная	10401000B	0,0428100	3 350 000 000,00	143 413 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Интер РАО"	обыкновенная	1-03-33498-E	0,0112660	3 348 200 000,00	37 720 821,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2707000	137 000 996,00	37 086 169,62	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Россети"	обыкновенная	1-01-55385-E	0,9720000	51 500 000,00	50 058 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,5406000	220 000 000,00	118 932 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Уралкалий"	обыкновенная	1-01-00296-A	169,4400000	200 000,00	33 888 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	1,1096000	31 800 000,00	35 285 280,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,0478000	48 400 000,00	50 713 520,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	102,6300000	790 004,00	81 078 110,52	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	71,2600000	708 403,00	50 480 797,78	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					672 941 765,12	

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	751 963 677,46
Итого средств на специальных брокерских счетах	751 963 677,46

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"	4-14-55005-E	254 730,20
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	386 466,30
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	347 587,92

ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	316 780,00
Администрация Нижегородской области	RU34006NJG0	833,60
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	263 326,14
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	4 800,00
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	13 084,25
Министерство финансов Российской Федерации	25076RMFS	1 464 750,00
Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	24 430,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	239 695,20
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	484 410,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	2 107,71
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	68,85
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	68 013,26
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	670,63
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	1 682 660,00
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	2 898 352,80
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	96 780,00
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	14 320,02
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	2 405 500,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 340 156,00
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	315 856,08
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	399 124,58
ОАО "Россельхозбанк"	40703349B	164 703,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	508 929,85
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	337 500,00
ОАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020203251B	13 425,36
ОАО АКБ "Промсвязьбанк"	4B020303251B	414 979,20
ООО "ХКФ Банк"	40600316B	16 896,00
Ярославская область	RU34010YRS0	2 090,90
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		14 483 027,85

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	766 446 705,31

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

2 609 553 351,99 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	VTB00117-001-166323F025		
Дата и время отправки	01.10.2013 15:04:52	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 01.10.2013 11:04:51 UTC [00117-5] Электронная подпись верна		