

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2017 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: 03.04.2017 12:23:41

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	193 929,45
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				200 529,45

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	25080RMFS	998,9140000	103 000,00	102 888 142,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Облигация	25081RMFS	978,8280000	23 000,00	22 513 044,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Облигация	26206RMFS	996,3250000	145 000,00	144 467 125,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				269 868 311,00	

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	708,5400000	52 000,00	36 844 080,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.03.17
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	792,0800000	49 930,00	39 548 554,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.03.17
Облигация	Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	400,4000000	7 154,00	2 864 461,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	510,1000000	39 749,00	20 275 964,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Облигация	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	995,4000000	38 016,00	37 841 126,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					137 374 187,30	

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
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	1 001,8000000	48 000,00	48 086 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	1 004,0000000	32 001,00	32 129 004,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «Россельхозбанк»	40503349B	1 008,8005018	67 046,00	67 636 038,44	Средняя цена на 31.03.17 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 012,1000000	56 000,00	56 677 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 013,3000000	28 159,00	28 533 514,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 007,1000000	57 000,00	57 404 700,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	999,2000000	49 000,00	48 960 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 13.03.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	996,2000000	49 946,00	49 756 205,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 20.02.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 010,1000000	31 990,00	32 313 099,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-Н	994,2000000	79 000,00	78 541 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	996,0000000	40 000,00	39 840 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 08.04.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-Н	1 001,1000000	3 500,00	3 503 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 21.02.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-Н	593,4600000	30 000,00	17 803 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-Н	593,2800000	50 000,00	29 664 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-Н	492,3000000	5 000,00	2 461 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.03.17

АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	492,6000000	10 000,00	4 926 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	1 009,3000000	83 000,00	83 771 900,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
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 2 054 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 018,1000000	60 784,00	61 884 190,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 004,5000000	64 800,00	65 091 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	987,7000000	32 000,00	31 606 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.02.17
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	1 011,6000000	120 010,00	121 402 116,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020402590B	1 015,1000000	845,00	857 759,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 014,3000000	105 000,00	106 501 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 014,7000000	35 500,00	36 021 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001 P	1 004,4000000	84 500,00	84 871 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	996,1000000	50 000,00	49 805 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	998,9000000	22 766,00	22 740 957,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.03.17
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	1 004,7000000	5 000,00	5 023 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.03.17
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 000,5000000	41 600,00	41 620 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
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	994,0000000	24 500,00	24 353 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	992,5000000	26 000,00	25 805 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.03.17
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	497,7500000	30 000,00	14 932 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
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	993,5000000	35 000,00	34 772 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	993,5000000	48 000,00	47 688 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.17
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 604 417 782,14	

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"	82 191 667,03
Итого средств на специальных брокерских счетах	82 191 667,03

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	1 157 280,00
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	841 626,30
АО «Россельхозбанк»	40503349B	2 408 962,78
АО «Россельхозбанк»	40803349B	2 241 120,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 126 923,18
АО «Россельхозбанк»	41503349B	2 576 970,00
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	497 350,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	191 792,64
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	157 070,90
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	1 078 350,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	512 800,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-H	151 095,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	121 500,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	202 500,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	80 800,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	161 600,00

АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	824 190,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	30 680,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	499 300,00
Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	27 399,82
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	178 473,01
Минфин РФ	25080RMFS	3 404 150,00
Минфин РФ	25081RMFS	226 550,00
Минфин РФ	26206RMFS	3 145 050,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 429 639,68
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	2 759 184,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	161 280,00
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	244 820,40
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020402590B	23 938,85
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	5 750 850,00
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	348 610,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	2 130 245,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 704 000,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	825 039,84
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	235 700,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	2 143 648,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	4 241 691,86
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	296 355,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	285 180,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	302 640,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	216 300,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	357 264,27
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	22 200,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	431 200,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	591 360,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	780 088,32
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		47 124 768,85

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	129 316 435,88

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****2 141 177 245,77 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	VTB00117-315277F025		
Дата и время отправки	03.04.2017 14:50:50	Дата и время приёма	03.04.2017 15:59:04
Подписано	'1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 03.04.2017 9:25:22 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 03.04.2017 11:48:14 UTC [00001-1] Электронная подпись верна'		