

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2017 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: 03.07.2017 17:46:05

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	4 312 623,96
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				4 319 223,96

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	1 011 ,8300000	15 000 ,00	15 177 450,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Облигация	25081RMFS	990 ,5700000	23 000 ,00	22 783 110,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Облигация	26208RMFS	994 ,4400000	89 796 ,00	89 296 734,24	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Облигация	26221RMFS	982 ,6100000	27 000 ,00	26 530 470,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				153 787 764,24	

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	586 ,6150000	52 000 ,00	30 503 980,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	798 ,5600000	49 930 ,00	39 872 100,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.06.17
Облигация	Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	400 ,8800000	7 154 ,00	2 867 895,52	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	513 ,8500000	39 749 ,00	20 425 023,65	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					93 668 999,97	

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	1 008 ,1000000	26 000 ,00	26 210 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	999 ,6000000	31 400 ,00	31 387 440,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «Россельхозбанк»	40403349B	1 003 ,7000000	15 ,00	15 055,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
АО «Россельхозбанк»	40503349B	1 006 ,2000000	42 039 ,00	42 299 641,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 018 ,2000000	56 000 ,00	57 019 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 017 ,7000000	26 000 ,00	26 460 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 007 ,8000000	57 000 ,00	57 444 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «Россельхозбанк»	42203349B	986 ,0000000	2 ,00	1 972,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	1 010 ,1000000	800 ,00	808 080,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	1 016 ,0000000	4 899 ,00	4 977 384,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
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	1 006 ,4000000	111 055 ,00	111 765 752,00	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
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 30.06.17
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	596 ,0400000	30 000 ,00	17 881 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17

АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-Н	597 ,6000000	99 444 ,00	59 427 734,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-Н	370 ,4250000	29 594 ,00	10 962 357,45	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-Н	370 ,8375000	10 000 ,00	3 708 375,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.06.17
АО «ВЭБ-лизинг»	4В02-07-43801-Н	1 005 ,9000000	83 000 ,00	83 489 700,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
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 2 145 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 018 ,4000000	60 784 ,00	61 902 425,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4В02-06-36241-R	1 007 ,4000000	64 800 ,00	65 279 520,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
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»	4В02-02-00146-A	1 015 ,2000000	5 000 ,00	5 076 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО «Газпром нефть»	4В02-07-00146-A	1 018 ,7000000	147 010 ,00	149 759 087,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "АК БАРС" БАНК	4В020402590В	1 002 ,3000000	5 868 ,00	5 881 496,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4В02-03-00027-A	1 010 ,0000000	105 000 ,00	106 050 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "Магнит"	4В02-02-60525-P-001 Р	1 016 ,1000000	35 500 ,00	36 071 550,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "Магнит"	4В02-04-60525-P-001 Р	1 008 ,4000000	84 500 ,00	85 209 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 002 ,0000000	50 000 ,00	50 100 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
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"	4В02-08-00102-A	1 013 ,0000000	5 000 ,00	5 065 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 12.05.17

ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 003 ,7000000	41 600 ,00	41 753 920,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020803251B	1 007 ,5000000	1 778 ,00	1 791 335,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
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 ,3000000	24 500 ,00	24 531 850,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	1 001 ,5000000	26 000 ,00	26 039 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	497 ,7000000	30 000 ,00	14 931 000,00	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 ,3000000	35 000 ,00	35 045 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 20.06.17
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	1 001 ,2000000	48 000 ,00	48 057 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 667 444 100,35	

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
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	Обыкновенная	10101978B	4 ,5060000	34 624 900 ,00	156 019 799,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17

ПАО "ГМК "Норильский никель"	Обыкновенная	1-01-40155-F	8 171 ,0000000	1 785 ,00	14 585 235,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.17
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					170 605 034,40	

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"	35 681 191,51
Итого средств на специальных брокерских счетах	35 681 191,51

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	1 339 780,00
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	1 765 308,00
АО «Россельхозбанк»	40403349B	364,95

АО «Россельхозбанк»	40503349B	383 816,07
АО «Россельхозбанк»	40803349B	719 040,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	333 840,00
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 013 460,00
АО «Россельхозбанк»	42203349B	44,24
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	18 672,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	112 921,95
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 356 033,90
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	3 853 608,50
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	609 280,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	2 831 360,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	1 410 400,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-03-43801-H	697 200,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-H	62 965,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	503 100,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	1 667 675,88
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	130 509,54
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	44 100,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	3 411 300,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	24 960,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	499 300,00
Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	94 862,04
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	176 883,05
Минфин РФ	24018RMFS	8 550,00
Минфин РФ	25081RMFS	582 130,00
Минфин РФ	26208RMFS	2 232 328,56
Минфин РФ	26221RMFS	768 960,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	3 187 512,96
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 062 720,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	799 680,00
ПАО «Газпром нефть»	4B02-02-00146-A	142 950,00
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	4 203 015,90
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020402590B	5 281,20
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	2 635 500,00
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	1 339 770,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	22 815,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	619 500,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	300 055,88
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	97 300,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 059 968,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020803251B	46 708,06
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	816 859,40
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	132 894,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	804 580,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	853 840,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	528 600,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	155 284,47
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	695 400,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	1 186 150,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	1 626 720,00

Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	48 975 858,55
Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	84 657 050,06

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

2 174 482 172,98 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	VTB00117-317960F025		
Дата и время отправки	04.07.2017 11:39:39	Дата и время приёма	04.07.2017 11:47:43
Подписано	'1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 03.07.2017 14:46:57 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 04.07.2017 8:38:25 UTC [00001-1] Электронная подпись верна'		