

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2017 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: 10.01.2018 12:54:02

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	95 202 457,06
Итого денежных средств на счетах				95 202 457,06

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
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	29.12.2017	Д6-55049/2017/047 (1)	42002810200470000103	281 000 000,00	92 383,56
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				281 092 383,56	

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	24019RMFS	1 026 ,6200000	30 000 ,00	30 798 600,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	25081RMFS	1 000 ,5500000	23 000 ,00	23 012 650,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	25083RMFS	998 ,0600000	50 000 ,00	49 903 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	26208RMFS	1 011 ,2100000	89 796 ,00	90 802 613,16	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	26216RMFS	1 000 ,5000000	40 000 ,00	40 020 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17

Облигация	26221RMFS	1 006 ,9300000	27 000 ,00	27 187 110,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	29011RMFS	1 042 ,7300000	149 057 ,00	155 426 205,61	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	29012RMFS	1 040 ,1200000	30 000 ,00	31 203 600,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	52001RMFS	1 087 ,2508842	100 000 ,00	108 725 088,42	Рыночная цена 2 биржи на 31.12.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				557 078 867,19	

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	462 ,1500000	52 000 ,00	24 031 800,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	555 ,4450000	49 930 ,00	27 733 368,85	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	310 ,8300000	39 749 ,00	12 355 181,67	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					64 120 350,52	

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 "АИЖК"	4B02-09-00739-A	1 005 ,1000000	472 ,00	474 407,20	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	1 003 ,1000000	800 ,00	802 480,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 28.12.17
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	1 010 ,6000000	4 899 ,00	4 950 929,40	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 28.12.17
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	1 004 ,5000000	111 055 ,00	111 554 747,50	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-03-43801-H	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-H	1 034 ,0000000	3 500 ,00	3 619 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-20-43801-H	400 ,0000000	30 000 ,00	12 000 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-21-43801-H	399 ,9200000	99 444 ,00	39 769 644,48	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 28.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-22-43801-H	250 ,3250000	29 594 ,00	7 408 118,05	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4-23-43801-H	249 ,2250000	10 000 ,00	2 492 250,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 28.12.17
АО "ВЭБ-лизинг"	4B02-07-43801-H	1 000 ,9000000	83 000 ,00	83 074 700,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 01.11.17
АО "Россельхозбанк"	40803349B	1 011 ,5000000	56 000 ,00	56 644 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17

АО "Россельхозбанк"	40903349B	1 024 ,2000000	26 000 ,00	26 629 200,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "Россельхозбанк"	41603349B	1 010 ,5000000	15 000 ,00	15 157 500,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "Россельхозбанк"	42203349B	986 ,0000000	2 ,00	1 972,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.17
АО "Россельхозбанк"	4B020303349B001P	1 020 ,0000000	20 001 ,00	20 401 020,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "Россельхозбанк"	4B020403349B001P	1 007 ,5000000	42 000 ,00	42 315 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	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-H	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 2 329 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 001 ,3000000	60 784 ,00	60 863 019,20	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	1 000 ,3000000	32 000 ,00	32 009 600,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 31.10.17
ПАО "Газпром нефть"	4B02-02-00146-A	1 010 ,4000000	5 000 ,00	5 052 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
ПАО "Газпром нефть"	4B02-07-00146-A	1 010 ,2000000	147 010 ,00	148 509 502,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 006 ,8000000	35 500 ,00	35 741 400,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
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 ,4000000	24 500 ,00	24 534 300,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 26.12.17
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	1 001 ,2000000	26 000 ,00	26 031 200,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 28.12.17

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	1 000,6000000	35 000,00	35 021 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	1 001,9000000	48 000,00	48 091 200,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
ПАО РОСБАНК	4B021702272B	1 022,4000000	55 000,00	56 232 000,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 15.12.17
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 170 551 541,53	

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 «АПРОСА» (ПАО)	Обыкновенная	1-03-40046-N	74,9900000	335 000,00	25 121 650,00	Рыночная цена 2 биржи ПАО "ММВБ" на 29.12.17
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					25 121 650,00	

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"	4 212 143,72
Итого средств на специальных брокерских счетах	4 212 143,72

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
АО "АИЖК"	4B02-09-00739-A	1 028,96
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	12 864,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021201326B	114 342,66
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 382 005,82
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	2 793 033,25
АО "ВЭБ-лизинг"	4-03-43801-H	714 000,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-09-43801-H	64 890,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-20-43801-H	340 800,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4-21-43801-H	1 129 683,84
АО "ВЭБ-лизинг"	4-22-43801-H	90 261,70
АО "ВЭБ-лизинг"	4-23-43801-H	30 500,00
АО "ВЭБ-лизинг"	4B02-07-43801-H	2 416 130,00
АО "Россельхозбанк"	40803349B	752 640,00
АО "Россельхозбанк"	40903349B	349 440,00
АО "Россельхозбанк"	41603349B	383 700,00
АО "Россельхозбанк"	42203349B	45,18

АО "Россельхозбанк"	4B020303349B001P	409 620,48
АО "Россельхозбанк"	4B020403349B001P	242 340,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	617 610,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	2 870 070,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	1 430 000,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	32 760,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	355 501,60
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	113 284,65
Минфин РФ	24019RMFS	555 300,00
Минфин РФ	25081RMFS	589 950,00
Минфин РФ	25083RMFS	776 500,00
Минфин РФ	26208RMFS	2 270 042,88
Минфин РФ	26216RMFS	337 600,00
Минфин РФ	26221RMFS	461 430,00
Минфин РФ	29011RMFS	6 431 809,55
Минфин РФ	29012RMFS	286 800,00
Минфин РФ	52001RMFS	1 000 000,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	3 225 806,88
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	813 440,00
ПАО "Газпром нефть"	4B02-02-00146-A	145 900,00
ПАО "Газпром нефть"	4B02-07-00146-A	4 289 751,80
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	1 361 780,00
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	136 482,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	815 850,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	865 800,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	267 600,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	159 784,02
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	710 100,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	1 202 600,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-08-00013-A	1 649 280,00
ПАО РОСБАНК	4B021702272B	532 950,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		45 533 109,27

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	49 745 252,99

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****2 242 912 502,85 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	VTB00117-324147F025		
Дата и время отправки	не определена	Дата и время приёма	10.01.2018 14:39:03
Подписано	'1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 10.01.2018 9:54:12 UTC [00117-5] Электронная подпись верна 2. Фомичев Илья Николаевич дата и время ЭП 10.01.2018 11:36:04 UTC [00001-50] Электронная подпись верна'		