

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2012 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: 10.01.2013 21:08:29

1. Денежные средства на счетах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (тыс. руб.)
	дата	номер		
1	2	3	4	5
ОАО "АК БАРС" Банк	14.05.2010	395/14	40701810000022000688	354 252.27833
Итого денежных средств на счетах				354 252.27833

2. Денежные средства в депозитах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (тыс. руб.)	Проценты начисленные (тыс. руб.)
	дата	номер			
1	2	3	4	5	6
ОАО "АК БАРС" Банк	16.05.2012	121/62	42006810200020000060	167 000.00000	0.00000
ОАО "АК БАРС" Банк	27.03.2012	66/62	42006810300020000038	69 000.00000	0.00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				236 000.00000	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6
ГКО-ОФЗ	25072RMFS	1 000,9820001	64 718,00	64 781.55308	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				64 781.55308	

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации, специально выпущенных Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов				0.00000

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации				0.00000

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	985,3000000	2 000,00	1 970.60000	-
Субфедеральная бумага	Московская область	RU26007MOO0	997,1000000	60 000,00	59 826.00000	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	926,5000000	40 879,00	37 874.39350	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 076,0000000	80 399,00	86 509.32400	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	1 040,8000000	4 897,00	5 096.79760	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	1 084,0000000	31 603,00	34 257.65200	-
Субфедеральная бумага	Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32044MOS0	986,9000000	5 841,00	5 764.48290	-
Субфедеральная бумага	Правительство Ярославской области	RU34009YRS0	651,6900000	17 929,00	11 684.15001	-
Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35007KOM0	500,2500000	12 200,00	6 103.05000	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					249 086.45001	

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0.00000	

8. Облигации российских хозяйственных обществ

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	988,3000000	4 999,00	4 940.51170	-
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	866,8000000	18 702,00	16 210.89360	-
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	928,1000000	7 000,00	6 496.70000	-

ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	928,4000000	34 973,00	32 468.93320	-
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	960,8000000	6 659,00	6 397.96720	-
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000000	23 400,00	0.00000	-
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0,0000000	42 340,00	0.00000	-
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	1 000,0000000	199,00	199.00000	-
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-01-01669-A	1 007,6000000	47 000,00	47 357.20000	-
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	998,3000000	5 499,00	5 489.65170	-
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	1 000,1000000	9 899,00	9 899.98990	-
ОАО "Аэрофлот"	4B02-01-00010-A	1 000,6000000	30 000,00	30 018.00000	-
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 088,4000000	127 793,00	139 089.90120	-
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	984,0000000	6 000,00	5 904.00000	-
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-02-55234-E	995,9000000	36 966,00	36 814.43940	-
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	999,5000000	2 000,00	1 999.00000	-
ОАО "ИНПРОМ"	4-02-55534-P	0,0000000	4 724,00	0.00000	-
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 005,4000000	11 050,00	11 109.67000	-
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	1 000,9000000	19 583,00	19 600.62470	-
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	996,8000000	30 000,00	29 904.00000	-
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	1 000,8000000	11 675,00	11 684.34000	-
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	998,4000000	12 600,00	12 579.84000	-
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 012,7000000	899,00	910.41730	-
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 087,2000000	92 270,00	100 315.94400	-
ОАО "Челябинский металлургический комбинат"	4-02-55005-E	981,1000000	27 000,00	26 489.70000	-
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-01-36314-R	416,6498598	24 900,00	10 374.58151	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				566 255.30541	

8.1 Ценные бумаги международных финансовых организаций

Наименование эмитента	ISIN	CFI	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	4	5	6	7	8
Итого рыночная стоимость бумаг международных финансовых организаций					0.00000	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
ОАО "ИНТЕР РАО ЕЭС"	обыкновенная	1-03-33498-E	0,0250170	635 500 000,00	15 898.30350	-
ОАО "ИНТЕР РАО ЕЭС"	обыкновенная	1-03-33498-E-003D	0,0247100	1 843 200 000,00	45 545.47200	-
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	203,8000000	175 700,00	35 807.66000	-
ОАО "Аэрофлот"	обыкновенная	1-01-00010-A	45,3300000	650 000,00	29 464.50000	-
ОАО "Группа ЛСР"	обыкновенная	1-01-55234-E	560,9000000	15 000,00	8 413.50000	-
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,3439000	132 358 996,00	45 518.25872	-
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,7336000	330 000 000,00	242 088.00000	-

ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481В	92,8500000	30 000,00	2 785.50000	-
ОАО "Уралкалий"	обыкновенная	1-01-00296-A	235,3200000	83 000,00	19 531.56000	-
ОАО "Холдинг МРСК"	обыкновенная	1-01-55385-E	1,9640000	4 441 000,00	8 722.12400	-
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	1,6024000	30 860 000,00	49 450.06400	-
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,3218000	78 646 000,00	103 954.28280	-
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	119,7500000	1 726 890,00	206 795.07750	-
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	90,4400000	70 000,00	6 330.80000	-
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					820 305.10252	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием				0.00000	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия					0.00000	

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость паев (акций, долей) индексных инвестиционных фондов						0.00000

13. Дебиторская задолженность

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	
Наименование брокера	Сумма средств (тыс. руб.)
1	2
ОАО "АК БАРС" Банк	302 704.50361
Итого средств на специальных брокерских счетах	302 704.50361

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
ОАО "Мечел"	4-04-55005-E	103.22935
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	604.63566
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	208.88000
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	1 043.59432
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	259.90077
Министерство финансов Российской Федерации	25072RMFS	2 015.31852
Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	7.40000
Московская область	RU26007MOO0	986.40000
Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	56.36447
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	272.73389
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	658.46781
Мэрия (правительство) Москвы	RU32048MOS0	156.97536
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	0.71441
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-01-01669-A	1 456.53000
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	174.86820
ОАО "Аэрофлот"	4B02-01-00010-A	535.20000
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	176.59816
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	288.81218
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	40.68000
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-02-55234-E	1 124.13606
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	159.30000
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	220.66850
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	224.02952
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	546.97375
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	964.80000
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	39.81600
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	31.21328
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	4 398.51090
ОАО "Челябинский металлургический комбинат"	4-02-55005-E	103.95000
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-01-36314-R	83.66400
Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32044MOS0	7.82694
Правительство Ярославской области	RU34009YRS0	117.43495
Республика КОМИ	RU35007KOM0	50.75200
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		17 120.37900

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0.00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	
	319 824.88261

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****2 610 505.57196****тыс. 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	VTB00117-001-126953F025		
Дата и время отправки	10.01.2013 21:31:31	Дата и время приёма	10.01.2013 21:38:54
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭЦП 10.01.2013 17:13:00 GMT [CN=048050117-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 10.01.2013 17:30:23 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		