

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2013 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: 02.07.2013 16:08:17

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	504 067 628,37
Итого денежных средств на счетах				504 067 628,37

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	1 007,4960000	244 499,00	246 331 764,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	25068RMFS	1 065,3690000	995,00	1 060 042,16	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	26212RMFS	933,8600000	72 500,00	67 704 850,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	26207RMFS	1 039,0340000	115 000,00	119 488 910,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				434 585 566,66	

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	RU34008NJG0	1 047,7000000	25 748,00	26 976 179,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	998,1000000	1 000,00	998 100,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	988,6571429	7 000,00	6 920 600,00	-
Субфедеральная бумага	Московская область	RU26007MOO0	1 004,6000000	36 965,00	37 135 039,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	985,6000000	45,00	44 352,00	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 046,9000000	67 000,00	70 142 300,00	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	1 064,2862682	29 437,00	31 329 394,88	-
Субфедеральная бумага	Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	1 032,2000000	4 685,00	4 835 857,00	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					179 942 126,68	

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	851,1000000	34 423,00	29 297 415,30	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	961,3000000	43 000,00	41 335 900,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	960,0930847	36 875,00	35 403 432,50	-
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	980,1000000	15 817,00	15 502 241,70	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	1 013,5000000	199,00	201 686,50	-
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	1 007,9000000	35 500,00	35 780 450,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 005,5000000	3 359,00	3 377 474,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Аэрофлот"	4B02-03-00010-A	1 001,2000000	16 000,00	16 019 200,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 061,6000000	113 374,00	120 357 838,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	1 005,6000000	3 989,00	4 011 338,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	1 019,6000000	2 000,00	2 039 200,00	-
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	998,7000000	29 000,00	28 962 300,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 000,2000000	23 852,00	23 856 770,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МДМ Банк"	4B020400323B	1 008,2000000	2 899,00	2 922 771,80	-

ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	1 000,5000000	4 637,00	4 639 318,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 006,6000000	43 289,00	43 574 707,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	1 009,7000000	9 674,00	9 767 837,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-16-65045-D	1 005,0000000	10 009,00	10 059 045,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 052,6000000	74 670,00	78 597 642,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	1 003,1000000	6 616,00	6 636 509,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-04-36314-R	414,9822600	1 000,00	414 982,26	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				512 758 062,06	

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 "ИНТЕР РАО ЕЭС"	обыкновенная	1-03-33498-E	0,0128700	3 048 200 000,00	39 230 334,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	95,9000000	380 000,00	36 442 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2404000	137 000 996,00	32 935 039,44	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Россети"	обыкновенная	1-01-55385-E	1,0800000	33 550 000,00	36 234 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,5003000	308 000 000,00	154 092 400,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО "Уралкалий"	обыкновенная	1-01-00296-A	218,3500000	2 000,00	436 700,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	1,2762000	30 950 000,00	39 498 390,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,0718000	52 058 000,00	55 795 764,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	87,6100000	1 849 180,00	162 006 659,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	73,1000000	595 200,00	43 509 120,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					600 180 407,64	

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	57 922 727,69
Итого средств на специальных брокерских счетах	57 922 727,69

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	1 103 257,15
ОАО "Мечел"	4-15-55005-E	1 273 230,00
ОАО "Мечел"	4-16-55005-E	1 091 868,75
ОАО "Мечел"	4B02-04-55005-E	612 908,75
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	854 576,12
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	5 130,00
Министерство финансов Российской Федерации	25068RMFS	42 526,30
Министерство финансов Российской Федерации	25076RMFS	5 136 923,99
Министерство финансов Российской Федерации	26207RMFS	3 338 450,00
Министерство финансов Российской Федерации	26212RMFS	2 212 700,00
Министерство финансов Чувашской Республики	RU31008CHU0	23 030,00
Московская область	RU26007MOO0	599 572,30
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	241 972,14
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	484 410,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	863,10
Мэрия (правительство) Москвы	RU32064MOS0	22 345,82
ОАО "АИЖК"	4-11-00739-A	670,63
ОАО "Акрон"	4-04-00207-A	373 460,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	106 043,63
ОАО "Аэрофлот"	4B02-03-00010-A	316 480,00
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	213 143,12
ОАО "Группа ЛСР"	4-04-55234-E	40 060,00
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	104 870,81
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-04-55234-E	653 080,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	470 599,96
ОАО "МДМ Банк"	4B020400323B	10 552,36
ОАО "НОМОС-БАНК"	40702209B	450 711,66
ОАО "НОМОС-БАНК"	40802209B	137 162,46
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 359 707,49
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	3 528 904,20
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-16-65045-D	43 338,97
ОАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	225 539,44
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4B02-04-36314-R	8 450,00
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	57 484,95
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		25 144 024,10

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	83 066 751,79

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

2 398 600 543,20 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	VTB00117-001-152829F025		
Дата и время отправки	02.07.2013 16:49:49	Дата и время приёма	02.07.2013 16:58:25
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭЦП 02.07.2013 16:09:06 GMT [048050117-05] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 02.07.2013 16:48:13 GMT [00001-1] ЭЦП верна		