

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2012 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: 05.07.2012 10:07:40

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	305 406.14022
Итого денежных средств на счетах				305 406.14022

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	38 000.00000	0.00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				205 000.00000	

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	26205RMFS	956,4400000	45 000,00	43 039.80000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	46014RMFS	483,2659999	27 999,00	13 530.96473	-
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	954,1580000	20 688,00	19 739.62070	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	928,9530000	20 122,00	18 692.39227	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				95 002.77770	

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	RU34007CHU0	809,9208171	6 426,00	5 204.55117	-
Субфедеральная бумага	Московская область	RU26007MOO0	987,5000000	45 000,00	44 437.50000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	958,4282454	22 589,00	21 649.93564	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	1 093,5000000	90 000,00	98 415.00000	-
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	1 074,2000000	13 139,00	14 113.91380	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	1 112,3000000	25 355,00	28 202.36650	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					212 023.26711	

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	1 007,00000000	54 413,00	54 793.89100	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	925,00000000	6 136,00	5 675.80000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
"Российский сельскохозяйственный банк" ОАО	40303349B	1 004,00000000	48 000,00	48 192.00000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	989,30000000	10 000,00	9 893.00000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,00000000	23 400,00	0.00000	-
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0,00000000	42 340,00	0.00000	-
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	1 107,00000000	59 278,00	65 620.74600	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	959,70000000	42 602,00	40 885.13940	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ИНПРОМ"	4-02-55534-P	0,00000000	4 724,00	0.00000	-
ОАО "МДМ Банк"	4B020100323B	1 015,80000000	41 450,00	42 104.91000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МТС"	4-05-04715-A	1 005,10000000	1 000,00	1 005.10000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	968,90000000	48 000,00	46 507.20000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	1 010,00000000	30 000,00	30 300.00000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	985,40000000	29 200,00	28 773.68000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	1 112,30000000	46 041,00	51 211.40430	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	4-14-00124-A	1 004,60000000	44 801,00	45 007.08460	-
ООО "Инком-Лада"	4-02-36068-R	0,00000000	16 621,00	0.00000	-
ООО "Инком-Лада"	4-03-36068-R	0,00000000	22 536,00	0.00000	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				469 969.95530	

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	0,02777700	172 900 000,00	4 801.43300	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Аэрофлот"	обыкновенная	1-01-00010-A	43,3800000	1 080 300,00	46 863.41400	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Группа ЛСР"	обыкновенная	1-01-55234-E	555,3000000	31 000,00	17 214.30000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Иркутскэнерго"	обыкновенная	1-01-00041-A	13,4776758	25 000,00	336.94189	-
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	320,9300000	238 500,00	76 541.80500	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,4660000	79 400 996,00	37 000.86414	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,7835000	192 000 000,00	150 432.00000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Татнефть"	привилегированная	2-03-00161-A	84,0700000	26 000,00	2 185.82000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ТГК-1"	обыкновенная	1-01-03388-D	0,0068130	2 150 000 000,00	14 647.95000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Холдинг МРСК"	обыкновенная	1-01-55385-E	1,7540000	27 250 000,00	47 796.50000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энел ОГК-5"	обыкновенная	1-01-50077-A	1,6356000	26 150 000,00	42 770.94000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	обыкновенная	1-01-00085-A	1,3918000	81 005 000,00	112 742.75900	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	116,0800000	1 285 000,00	149 162.80000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОГК-1	обыкновенная	1-02-65107-D	0,6382000	62 850 000,00	40 110.87000	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					742 608.39703	

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	225 491.11991
Итого средств на специальных брокерских счетах	225 491.11991

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	1 841.33592
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	195.00208
"Российский сельскохозяйственный банк" ОАО	40303349B	1 642.08000
"Хоум Кредит энд Финанс Банк", ООО	40700316B	173.60000
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	0.00000
Министерство финансов Российской Федерации	26205RMFS	618.30000
Министерство финансов Российской Федерации	46014RMFS	308.82897
Министерство финансов Российской Федерации	46017RMFS	206.25936

Министерство финансов Российской Федерации	46018RMFS	105.84172
Министерство финансов Чувашской Республики	RU34007CHU0	31.35888
Московская область	RU26007MOO0	720.00000
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	69.34823
Мэрия (правительство) Москвы	RU31062MOS0	705.60000
Мэрия (правительство) Москвы	RU25061MOS0	145.84290
Мэрия (правительство) Москвы	RU25063MOS0	208.41810
ОАО "Газпром"	4-11-00028-A	89.50978
ОАО "Группа ЛСР"	4B02-03-55234-E	1 108.93006
ОАО "МДМ Банк"	4B020100323B	434.39600
ОАО "МТС"	4-05-04715-A	132.74000
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	526.08000
ОАО "НОМОС-БАНК"	4B020102209B	949.80000
ОАО "Промсвязьбанк"	40403251B	79.13200
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-10-65045-D	2 157.02085
ОАО "Ростелеком"	4-14-00124-A	847.18691
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13 296.61176

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0.00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	238 787.73167

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

2 268 798.26903

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			
Исходящий рег. номер	VTB00117-001-105540F022		
Дата и время отправки	05.07.2012 10:08:54	Дата и время приёма	
Подписано	1. Дорогов Алексей Николаевич, дата и время ЭЦП 05.07.2012 6:08:53 GMT [CN=048050117-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		