

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2015 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, 1435126890/165801001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У047

Дата и время составления расчёта: 13.01.2016 10:41:54

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	2 001 850,00
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				2 008 450,00

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
Нижегородский филиал ПАО Банка "ФК Открытие"	29.12.2015	Д 0635-15-К	42003810601469000010	315 000 000,00	195 041,10
Нижегородский филиал ПАО Банка "ФК Открытие"	30.12.2015	Д 0641-15-К	42004810501469000009	127 000 000,00	39 317,81
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				442 234 358,91	

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	25077RMFS	999,3850000	100 000,00	99 938 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	26206RMFS	965,8770000	100 000,00	96 587 700,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	46020RMFS	760,4610000	9 986,00	7 593 963,55	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				204 120 163,55	

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	Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	783,8400000	7 154,00	5 607 591,36	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	Самарская область	RU35007SAM0	195,8000000	1 755,00	343 629,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 03.12.15
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	728,5600000	49 930,00	36 377 000,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.12.15
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	951,5000000	38 016,00	36 172 224,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	970,5000000	45,00	43 672,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 02.12.15
Облигация	Москва	RU25067MOS0	986,4000000	47 175,00	46 533 420,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	Нижегородская область	RU34007NJG0	245,2500000	56 800,00	13 930 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.11.15
Облигация	Ярославская область	RU35013YRS0	970,0000000	51 893,00	50 336 210,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Облигация	Республика КОМИ	RU35011KOM0	995,0000000	28 749,00	28 605 255,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					217 949 202,66	

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
"Газпром капитал", ООО	4-06-36400-R	993,6000000	84 499,00	83 958 206,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО «Россельхозбанк»	40503349B	1 003,2000000	67 711,00	67 927 675,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 005,1000000	58 800,00	59 099 880,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 03.12.15
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 007,8000000	50 000,00	50 390 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 004,9000000	60 000,00	60 294 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	391,4800000	45 589,00	17 847 181,72	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	993,0000000	49 000,00	48 657 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	975,6000000	73 212,00	71 425 627,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 000,0000000	49 946,00	49 946 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 003,3000000	10 000,00	10 033 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.12.15
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	995,7000000	40 000,00	39 828 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 01.07.15
Банк ВТБ (ПАО)	40501000B	1 000,0000000	32 000,00	32 000 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15

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 1 598 дней
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4B020502707B	1 005,2000000	15 315,00	15 394 638,00	Средняя цена на 22.09.15 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-Н	999,8000000	3 500,00	3 499 300,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 13.10.15
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-Н	704,1000000	5 000,00	3 520 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-Н	710,7000000	10 000,00	7 107 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 09.11.15
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-04-43801-Н	1 002,3000000	15 349,00	15 384 302,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 20.11.15
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-07-43801-Н	1 000,2000000	78 475,00	78 490 695,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-19-00078-A	987,0000000	77 200,00	76 196 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021001978B	1 001,2000000	48 000,00	48 057 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 09.12.15
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021101978B	998,9000000	32 000,00	31 964 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-15-65045-D	987,9000000	1 250,00	1 234 875,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 013,7000000	60 784,00	61 616 740,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-18-65045-D	994,4000000	10 000,00	9 944 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	975,3000000	12 200,00	11 898 660,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	984,9000000	51 211,00	50 437 713,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО «Группа ЛСР»	4B02-04-55234-E	331,6286000	50 000,00	16 581 430,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020202590B	1 002,5000000	140 000,00	140 350 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15

ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	1 002,0000000	19 972,00	20 011 944,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 008,4000000	15 717,00	15 849 022,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-01-40155-F	994,5000000	15 000,00	14 917 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	994,9000000	29 500,00	29 349 550,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	996,4000000	47 570,00	47 398 748,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "Магнит"	4-01-60525-P	996,3000000	31 350,00	31 234 005,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	965,6000000	50 000,00	48 280 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	997,8000000	22 628,00	22 578 218,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 003,2000000	41 600,00	41 733 120,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	999,2000000	99 617,00	99 537 306,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 10.11.15
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	987,9000000	6 900,00	6 816 510,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 25.11.15
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	949,9000000	24 094,00	22 886 890,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	947,5000000	26 000,00	24 635 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 24.12.15
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	945,2000000	25 201,00	23 819 985,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.08.15
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	991,0000000	9 999,00	9 909 009,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	982,7000000	30 000,00	29 481 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	1 006,3000000	2 004,00	2 016 625,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15
ПАО РОСБАНК	4B021002272B	995,7000000	70 100,00	69 798 570,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.12.15

Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ	1 723 338 230,52
---	------------------

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
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					0,00	

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"	19 339 303,73
Итого средств на специальных брокерских счетах	19 339 303,73

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
"Газпром капитал", ООО	4-06-36400-R	2 309 357,67
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	192 156,44
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	2 088,45
Администрация Самарской области	RU35009SAM0	490 312,60
АО «Россельхозбанк»	40503349B	695 391,97
АО «Россельхозбанк»	40803349B	879 648,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	748 000,00
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 239 600,00
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	172 326,42
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	479 220,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	1 125 268,44
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 673 690,46
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	343 800,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	1 634 000,00
Банк ВТБ (ПАО)	40501000B	905 280,00
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4B020502707B	957 493,80
Минфин РФ	25077RMFS	3 262 000,00
Минфин РФ	26206RMFS	304 000,00
Минфин РФ	46020RMFS	266 226,76
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	123 932,16
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	863,10
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-H	76 090,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	43 250,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	86 500,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-04-43801-H	774 510,54
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-07-43801-H	3 453 684,75
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-19-00078-A	2 894 228,00
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021001978B	2 803 200,00
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021101978B	1 662 720,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-15-65045-D	2 787,50
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	3 168 062,08
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-18-65045-D	415 600,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	95 282,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	1 238 281,98
ПАО «Группа ЛСР»	4B02-04-55234-E	394 500,00
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020202590B	6 098 400,00
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	1 164 367,60
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	389 467,26

ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-01-40155-F	409 050,00
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	804 465,00
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	1 297 233,90
ПАО "Магнит"	4-01-60525-P	934 543,50
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	608 000,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	339 872,56
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 261 728,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	1 604 829,87
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	110 400,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	785 464,40
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	847 600,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	882 035,00
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	153 084,69
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	657 300,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	122 103,72
ПАО РОСБАНК	4B021002272B	1 986 634,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU25067MOS0	262 293,00
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	174 376,00
Правительство Ярославской области	RU35013YRS0	29 060,08
Республика КОМИ	RU35011KOM0	251 553,75
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		56 087 215,45

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	75 426 519,18

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

2 665 076 924,82 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	VTB00117-292684F025		
Дата и время отправки	13.01.2016 11:21:21	Дата и время приёма	13.01.2016 12:16:11
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 13.01.2016 7:55:55 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 13.01.2016 7:42:33 UTC [00117-5] Электронная подпись верна		