

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2016 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: 01.04.2016 15:38:01

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	3 316 369,59
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				3 322 969,59

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 "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	24.03.2016	116/Лк/16	42003810900001600116	30 000 000,00	63 688,52
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	24.03.2016	115/Лк/16	42005810200001600115	250 000 000,00	561 816,94
ТАТАРСТАНСКИЙ РФ АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК" г. КАЗАНЬ	31.03.2016	067-10-09/16-20	42003810567000000018	138 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				418 625 505,46	

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	25081RMFS	951,3920000	6 892,00	6 556 993,66	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	26206RMFS	978,2220000	119 000,00	116 408 418,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	46020RMFS	790,0490000	9 986,00	7 889 429,31	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле	130 854 840,97
--	----------------

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	RU34008NJK0	790,0800000	7 154,00	5 652 232,32	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	Самарская область	RU35007SAM0	196,2000000	1 755,00	344 331,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 25.03.16
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	752,2400000	49 930,00	37 559 343,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	970,0000000	38 016,00	36 875 520,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	989,4000000	45,00	44 523,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 25.03.16
Облигация	Москва	RU25067MOS0	994,2000000	47 175,00	46 901 385,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	Нижегородская область	RU34007NJK0	246,5500000	56 800,00	14 004 040,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 16.03.16
Облигация	Ярославская область	RU35013YRS0	986,1000000	51 893,00	51 171 687,30	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Облигация	Республика КОМИ	RU35011KOM0	753,1500000	39 749,00	29 936 959,35	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации	222 490 021,17
--	----------------

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 «Россельхозбанк»	40503349B	1 005,0000000	67 500,00	67 837 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 17.03.16
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 002,0000000	58 800,00	58 917 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 002,0000000	28 443,00	28 499 886,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
АО «Россельхозбанк»	41403349B	998,0000000	202,00	201 596,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 03.02.16
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 000,8000000	60 000,00	60 048 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	194,0000000	45 589,00	8 844 266,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.02.16
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	993,0000000	49 000,00	48 657 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 12.01.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	985,2000000	73 212,00	72 128 462,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.03.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 003,0000000	49 946,00	50 095 838,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 012,6000000	10 000,00	10 126 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	968,5000000	37 000,00	35 834 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
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)	40501000В	1 000,2000000	32 000,00	32 006 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.03.16
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 1 689 дней
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4В020502707В	991,5000000	15 315,00	15 184 822,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-Н	994,5000000	3 500,00	3 480 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-20-43801-Н	941,7000000	30 000,00	28 251 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-21-43801-Н	940,0000000	50 000,00	47 000 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-Н	706,8750000	5 000,00	3 534 375,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 24.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-Н	699,3750000	10 000,00	6 993 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 16.02.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4В02-04-43801-Н	995,0000000	15 349,00	15 272 255,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4В02-07-43801-Н	1 001,1000000	78 475,00	78 561 322,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.03.16
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-19-00078-А	991,1000000	77 200,00	76 512 920,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4В021001978В	1 002,5000000	48 000,00	48 120 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4В021101978В	1 007,0000000	32 000,00	32 224 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-15-65045-D	994,2000000	1 250,00	1 242 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 019,8000000	60 784,00	61 987 523,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-18-65045-D	995,5000000	10 000,00	9 955 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	981,8000000	12 200,00	11 977 960,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16

ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	991,0000000	51 211,00	50 750 101,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО «Группа ЛСР»	4B02-04-55234-E	333,4656000	50 000,00	16 673 280,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.03.16
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	1 001,9000000	19 972,00	20 009 946,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 016,1000000	55 717,00	56 614 043,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 009,2000000	34 900,00	35 221 080,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	975,2000000	50 000,00	48 760 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	1 001,8000000	22 628,00	22 668 730,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.03.16
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 001,1000000	41 600,00	41 645 760,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	987,7000000	99 617,00	98 391 710,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
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	963,2000000	24 094,00	23 207 340,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.03.16
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	970,0000000	26 000,00	25 220 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	974,7000000	25 201,00	24 563 414,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	993,5000000	9 999,00	9 934 006,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 24.02.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	990,9000000	30 000,00	29 727 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	989,7000000	2 004,00	1 983 358,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	960,1000000	10 000,00	9 601 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.03.16
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 475 170 100,20	

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"	56 762 846,82
Итого средств на специальных брокерских счетах	56 762 846,82

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Администрация Нижегородской области	RU34008NJG0	54 441,94
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	2 088,45
Администрация Самарской области	RU35009SAM0	490 312,60
АО «Россельхозбанк»	40503349B	2 797 200,00
АО «Россельхозбанк»	40803349B	2 785 356,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 347 344,91
АО «Россельхозбанк»	41403349B	5 902,44
АО «Россельхозбанк»	41503349B	3 184 200,00
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	84 339,65
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	479 220,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	2 631 239,28
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	223 258,62
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	45 800,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	496 170,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	586 800,00
Банк ВТБ (ПАО)	40501000B	838 400,00
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4B020502707B	423 000,30
Минфин РФ	25081RMFS	66 714,56
Минфин РФ	26206RMFS	2 557 310,00
Минфин РФ	46020RMFS	94 367,70
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	787 311,36
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	77,85
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-H	184 310,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-20-43801-H	195 600,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-21-43801-H	326 000,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	120 350,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	240 700,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-04-43801-H	267 379,58
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-07-43801-H	813 001,00
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-19-00078-A	1 258 360,00
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021001978B	1 304 640,00
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021101978B	852 160,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-15-65045-D	28 187,50
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 410 188,80
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-18-65045-D	185 000,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	329 400,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	76 816,50
ПАО «Группа ЛСР»	4B02-04-55234-E	817 500,00

ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	275 813,32
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	3 033 790,65
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	331 899,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 692 500,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	946 302,96
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	2 537 184,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	4 212 802,93
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	248 055,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	274 912,54
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	296 660,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	357 350,18
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	355 064,49
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	14 100,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	25 029,96
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	120 900,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU25067MOS0	1 085 496,75
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	498 136,00
Правительство Ярославской области	RU35013YRS0	29 060,08
Республика КОМИ	RU35011KOM0	260 753,44
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		44 986 260,34

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	101 749 107,16

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

2 352 212 544,55 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	VTB00117-299391F025		
Дата и время отправки	04.04.2016 10:41:41	Дата и время приёма	04.04.2016 11:45:54
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 04.04.2016 7:40:21 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 01.04.2016 12:39:04 UTC [00117-5] Электронная подпись верна		