

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2016 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, 1435126890/165701001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

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

Дата и время составления расчёта: 01.07.2016 12:42:11

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	17 107 162,95
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				17 113 762,95

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	115/Лк/16	42005810200001600115	250 000 000,00	7 865 437,16
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	21.06.2016	282/Лк/16	42003810300001600282	30 800 000,00	80 281,97
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	28.06.2016	302/Лк/16	42005810000001600302	141 500 000,00	85 054,64
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				430 330 773,77	

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	25080RMFS	983,5340000	29 000,00	28 522 486,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	25081RMFS	955,8610000	23 000,00	21 984 803,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	26206RMFS	981,3570000	145 000,00	142 296 765,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16

Облигация	46020RMFS	862,7020000	9 740,00	8 402 717,48	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				201 206 771,48	

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	797,4400000	7 154,00	5 704 885,76	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Самарская область	RU35007SAM0	198,6200000	1 755,00	348 578,10	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	772,7200000	49 930,00	38 581 909,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	977,0000000	38 016,00	37 141 632,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	994,8000000	45,00	44 766,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 22.06.16
Облигация	Нижегородская область	RU34007NJG0	248,6750000	56 800,00	14 124 740,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Ярославская область	RU35013YRS0	851,9550000	51 893,00	44 210 500,82	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Облигация	Республика КОМИ	RU35011KOM0	763,9500000	39 749,00	30 366 248,55	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации	170 523 260,83
--	----------------

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	1 007,8000000	58 800,00	59 258 640,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.06.16
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 006,5000000	28 443,00	28 627 879,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
АО «Россельхозбанк»	41403349B	1 007,2000000	202,00	203 454,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 31.05.16
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 007,3000000	60 000,00	60 438 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
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"	4B02-01-00739-A	994,3000000	5 500,00	5 468 650,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	999,9000000	49 000,00	48 995 100,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.05.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	993,6000000	73 212,00	72 743 443,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 002,7000000	49 946,00	50 080 854,20	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 22.06.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 020,9000000	10 000,00	10 209 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.06.16
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	977,5000000	37 000,00	36 167 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 10.06.16

АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	996,0000000	40 000,00	39 840 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 08.04.16
Банк ВТБ (ПАО)	40501000B	1 000,2000000	32 000,00	32 006 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
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 1 780 дней
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4B020502707B	1 000,6000000	15 315,00	15 324 189,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 10.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-H	994,5000000	3 500,00	3 480 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 04.04.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-20-43801-H	956,4000000	30 000,00	28 692 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-21-43801-H	956,5000000	50 000,00	47 825 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	587,5000000	5 000,00	2 937 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	587,5000000	10 000,00	5 875 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-04-43801-H	1 000,2000000	15 349,00	15 352 069,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4B02-07-43801-H	1 001,6000000	78 475,00	78 600 560,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 18.04.16
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	4-19-00078-A	998,9000000	77 200,00	77 115 080,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021001978B	1 001,5000000	48 000,00	48 072 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 24.05.16
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021101978B	1 009,0000000	32 001,00	32 289 009,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 028,9000000	60 784,00	62 540 657,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-18-65045-D	999,6000000	10 000,00	9 996 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	992,4000000	12 200,00	12 107 280,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16

ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	996,7000000	51 211,00	51 042 003,70	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	1 015,3000000	22 000,00	22 336 600,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	1 001,8000000	19 972,00	20 007 949,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 25.05.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 022,1000000	105 000,00	107 320 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 018,4000000	34 900,00	35 542 160,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	985,6000000	50 000,00	49 280 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	1 002,0000000	22 628,00	22 673 256,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.05.16
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 000,1000000	41 600,00	41 604 160,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	987,7000000	99 617,00	98 391 710,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 07.04.16
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	983,6000000	24 094,00	23 698 858,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	982,2000000	26 000,00	25 537 200,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	978,9000000	25 201,00	24 669 258,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 11.04.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	999,1000000	9 999,00	9 990 000,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.04.16
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	996,8000000	30 000,00	29 904 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	989,9000000	2 004,00	1 983 759,60	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 18.04.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	988,4000000	10 000,00	9 884 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.06.16
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 541 669 050,70	

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"	29 863 534,68
Итого средств на специальных брокерских счетах	29 863 534,68

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	192 156,44
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	2 088,45
Администрация Самарской области	RU35009SAM0	490 312,60
АО «Россельхозбанк»	40503349B	596 700,00
АО «Россельхозбанк»	40803349B	737 352,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	356 675,22
АО «Россельхозбанк»	41403349B	12 146,26
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 048 800,00
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	86 163,21
АО "АИЖК"	4B02-01-00739-A	9 185,00
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	484 120,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	1 108 429,68
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 673 690,46
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	343 800,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	1 317 200,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	1 634 000,00
Банк ВТБ (ПАО)	40501000B	838 400,00
КБ "ЛОКО-Банк" (АО)	4B020502707B	957 493,80
Минфин РФ	25080RMFS	417 600,00
Минфин РФ	25081RMFS	578 220,00
Минфин РФ	26206RMFS	440 800,00
Минфин РФ	46020RMFS	259 668,40
Мэрия (правительство) Москвы	RU32049MOS0	116 709,12
Мэрия (правительство) Москвы	RU32056MOS0	863,10
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-09-43801-H	76 090,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-20-43801-H	831 300,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-21-43801-H	1 385 500,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-22-43801-H	36 000,00
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-23-43801-H	72 000,00
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	2 771 040,00
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B021101978B	1 809 656,55
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 «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	622 600,00
ПАО "АК БАРС" БАНК	4B020302590B	873 375,56
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	2 601 900,00
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	1 306 656,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	608 000,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	339 872,56
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 247 584,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	1 604 829,87
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	131 100,00
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	72 504,72
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	336 500,00
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	174 376,00
Правительство Ярославской области	RU35013YRS0	24 908,64
Республика КОМИ	RU35011KOM0	258 368,50
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		46 251 869,58

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	76 115 404,26

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

2 436 959 023,99 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)	(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00117-304771F025		
Дата и время отправки	04.07.2016 9:16:16	Дата и время приёма	04.07.2016 9:36:28
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 04.07.2016 6:15:15 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 01.07.2016 9:42:48 UTC [00117-5] Электронная подпись верна		