

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.09.2016 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: 03.10.2016 11:32:12

**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	10 051 310,56
Филиал "Газпромбанк" (АО) в г. Казань	10.09.2015	1780	40701810300470000021	6 600,00
Итого денежных средств на счетах				10 057 910,56

**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
ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	24.03.2016	115/Лк/16	42005810200001600115	250 000 000,00	15 249 316,94
ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	19.09.2016	488/Лк/16	42004810200001600488	31 550 000,00	95 770,63
ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	28.06.2016	302/Лк/16	42005810000001600302	141 500 000,00	3 997 568,31
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				442 392 655,88	

**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	991,2690000	33 000,00	32 711 877,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	25081RMFS	971,5020000	23 000,00	22 344 546,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	26206RMFS	989,2680000	145 000,00	143 443 860,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле	198 500 283,00
--	----------------

#### 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	Ярославская область	RU35013YRS0	708,5400000	52 000,00	36 844 080,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	Самарская область	RU35007SAM0	99,7800000	1 755,00	175 113,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 22.09.16
Облигация	Самарская область	RU35009SAM0	783,6000000	49 930,00	39 125 148,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJG0	399,9600000	7 154,00	2 861 313,84	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	513,0000000	39 749,00	20 391 237,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.16
Облигация	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	986,5000000	38 016,00	37 502 784,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Облигация	Нижегородская область	RU34007NJG0	249,7500000	56 800,00	14 185 800,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					151 085 476,74	

## 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	4-05-36400-R	992,5000000	35 000,00	34 737 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	1 007,0000000	48 000,00	48 336 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 28.09.16
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	1 010,1000000	32 001,00	32 324 210,10	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «Россельхозбанк»	40503349B	1 008,1000000	67 500,00	68 046 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.09.16
АО «Россельхозбанк»	40803349B	1 022,6000000	58 800,00	60 128 880,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 020,8000000	28 443,00	29 034 614,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «Россельхозбанк»	41403349B	1 011,5000000	202,00	204 323,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «Россельхозбанк»	41503349B	1 010,9000000	60 000,00	60 654 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
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	999,9000000	49 000,00	48 995 100,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 27.05.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	998,7000000	73 212,00	73 116 824,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 003,4000000	49 946,00	50 115 816,40	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 024,0000000	10 000,00	10 240 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16

АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	992,5000000	37 000,00	36 722 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	996,0000000	40 000,00	39 840 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 08.04.16
АО «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
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	773,2800000	30 000,00	23 198 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	774,0000000	50 000,00	38 700 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	601,6875000	5 000,00	3 008 437,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	600,8750000	10 000,00	6 008 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-04-43801-H	1 003,6000000	10 000,00	10 036 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	1 005,0000000	83 000,00	83 415 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
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 1 872 дней
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 030,0000000	60 784,00	62 607 520,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	997,4000000	12 200,00	12 168 280,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 008,2000000	50 000,00	50 410 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	1 015,8000000	120 010,00	121 906 158,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 29.09.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	999,4000000	35 000,00	34 979 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	1 021,1000000	105 000,00	107 215 500,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 023,9000000	34 900,00	35 734 110,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 21.09.16

ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001 P	1 004,9000000	33 001,00	33 162 704,90	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	993,1000000	50 000,00	49 655 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	1 000,8000000	22 766,00	22 784 212,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	1 015,0000000	5 000,00	5 075 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	1 001,9000000	41 600,00	41 679 040,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	1 005,4000000	99 617,00	100 154 931,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
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	993,5000000	24 094,00	23 937 389,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 23.09.16
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	994,9000000	26 000,00	25 867 400,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 13.09.16
ПАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	742,5000000	25 201,00	18 711 742,50	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
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	991,3000000	30 000,00	29 739 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 20.09.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-03-00013-A	997,5000000	5 000,00	4 987 500,00	Средняя цена на 29.09.16 (п.8.а. Приказа 06-155/пз-н).
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	998,2000000	2 004,00	2 000 392,80	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 09.09.16
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	992,0000000	10 000,00	9 920 000,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
ПАО АФК «Система»	4-03-01669-A	997,3000000	27 500,00	27 425 750,00	Рыночная цена 2 биржи ЗАО "ФБ ММВБ" на 30.09.16
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 606 174 604,50	

**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"	1 873 936,04
Итого средств на специальных брокерских счетах	1 873 936,04

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	4-05-36400-R	311 150,00
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021001978B	1 186 080,00
"Московский Кредитный Банк" (ПАО)	4B021101978B	862 746,96
АО «Россельхозбанк»	40503349B	2 425 275,00
АО «Россельхозбанк»	40803349B	2 353 176,00
АО «Россельхозбанк»	40903349B	1 138 288,86
АО «Россельхозбанк»	41403349B	5 971,12
АО «Россельхозбанк»	41503349B	2 712 600,00
АО "АИЖК"	4-09-00739-A	86 163,21
АО "АИЖК"	4B02-02-00739-A	497 350,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	2 631 239,28
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	191 792,64
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	49 100,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	505 050,00
АО "ЮниКредит Банк"	4B022200001B	512 800,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-09-43801-H	185 500,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-20-43801-H	162 000,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-21-43801-H	270 000,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-22-43801-H	101 000,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4-23-43801-H	202 000,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-04-43801-H	177 900,00
АО «ВЭБ-лизинг»	4B02-07-43801-H	824 190,00
Департамент финансов Ярославской области	RU35013YRS0	30 680,00
Министерство управления финансами Самарской области	RU35007SAM0	1 088,10
Министерство управления финансами Самарской области	RU35009SAM0	499 300,00
Министерство финансов Нижегородской области	RU34008NJK0	27 399,82
Министерство финансов Республики КОМИ	RU35011KOM0	178 473,01
Минфин РФ	25080RMFS	1 090 650,00
Минфин РФ	25081RMFS	226 550,00
Минфин РФ	26206RMFS	3 145 050,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-17-65045-D	1 429 639,68
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-30-65045-D	331 962,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	2 129 000,00
ПАО «Газпром нефть»	4B02-07-00146-A	244 820,40
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4-04-00027-A	163 100,00
ПАО "Вымпел-Коммуникации "	4B02-03-00027-A	5 750 850,00
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	342 718,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	786 743,84

ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 704 000,00
ПАО "МТС"	4-08-04715-A	958 903,92
ПАО "НЛМК"	4B02-08-00102-A	235 700,00
ПАО "Промсвязьбанк"	4B020603251B	2 537 184,00
ПАО "Ростелеком"	4-64-00124-A	4 241 691,86
ПАО "РусГидро"	4-02-55038-E	296 355,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	280 454,16
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	302 640,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	272 422,81
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-12-65018-D	357 264,27
ПАО «ФСК ЕЭС»	4-25-65018-D	22 200,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-03-00013-A	123 550,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-04-00013-A	25 551,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	123 200,00
ПАО АФК «Система»	4-03-01669-A	837 375,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32049MOS0	787 311,36
Правительство Нижегородской области	RU34007NJG0	502 112,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		47 377 313,30

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	49 251 249,34

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

**2 457 462 180,02 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 (подпись) (И.О. Фамилия)  
компания)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00117-309063F025		
Дата и время отправки	03.10.2016 15:52:52	Дата и время приёма	03.10.2016 16:07:37
Подписано	'1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 03.10.2016 12:51:25 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Дорогов Алексей Николаевич дата и время ЭП 03.10.2016 8:32:53 UTC [00117-5] Электронная подпись верна'		