

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2012 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания "РФЦ-Капитал" Д.У.
средствами пенсионных накоплений, 7444036805/744501001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У024

Дата и время составления расчёта: 02.04.2012 7:03:00

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
ОАО "Кредит Урал Банк" г. Магнитогорск	21.02.2005	54	40701810600000400568	41 849 434,57
Итого денежных средств на счетах				41 849 434,57

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
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					0,00

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
ГКО-ОФЗ	25072RMFS	1 007,0130	14 800,00	14 903 792,40	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25077RMFS	1 007,8630	20 000,00	20 157 260,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 004,3230	5 000,00	5 021 615,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	973,4810	14 000,00	13 628 734,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	943,0360	5 000,00	4 715 180,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	898,1790	46 000,00	41 316 234,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	998,1220	14 500,00	14 472 769,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				114 215 584,40	

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
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					0,00	

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
Банк ВТБ	4B020701000B	1 003,1000	20 000,00	20 062 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ
Инком-Лада	4-03-36068-R	0,0000	15 000,00	0,00	Номинал_ЦБ
МДМ Банк	40800323B	1 002,3000	10 000,00	10 023 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-01-00078-A	993,5000	20 000,00	19 870 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-06-00078-A	976,4000	65 000,00	63 466 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	1 094,8000	9 000,00	9 853 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	986,4000	13 000,00	12 823 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	986,0000	5 001,00	4 930 986,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	1 001,5000	25 000,00	25 037 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ЕВРАЗ Металл Инпром"	4-02-55534-P	0,0000	18 700,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	995,6000	34 949,00	34 795 224,40	Расч_цена_ПН

ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	993,3000	30 000,00	29 799 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 021,0000	10 000,00	10 210 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	1 001,1000	15 000,00	15 016 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	1 000,0000	25 000,00	25 000 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	993,1000	36 000,00	35 751 600,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 025,5000	20 000,00	20 510 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	1 018,0000	8 500,00	8 653 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	981,5000	5 000,00	4 907 500,00	Расч_цена_ПН
Россельхозбанк	40303349B	1 016,5000	10 000,00	10 165 000,00	Расч_цена_ПН
Ростелеком	4-04-00124-A	980,6000	5 000,00	4 903 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	4B02-01-00161-A	995,8000	20 000,00	19 916 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				385 692 710,40	

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
ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	5 438,0000	14 000,00	76 132 000,00	Расч_цена_ПН
Лукойл	обыкновенная	1-01-00077-A	1 790,2000	50 000,00	89 510 000,00	Расч_цена_ПН
Магнит	обыкновенная	1-01-60525-P	3 645,4000	4 495,00	16 386 073,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	269,1000	40 000,00	10 764 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	206,2300	40 000,00	8 249 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	обыкновенная	1-01-00010-A	47,2200	500 000,00	23 610 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	75,3500	80 000,00	6 028 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Иркутская электросетевая компания"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	389,7600	40 190,00	15 664 454,40	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	1,0829	40 000 000,00	43 316 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	95,1400	500 000,00	47 570 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	78,3300	700 000,00	54 831 000,00	Расч_цена_ПН
ОГК-2	обыкновенная	1-02-65105-D-004D	0,7468	9 103 050,00	6 798 157,74	Расч_цена_ПН
РБК Информационные Системы	обыкновенная	1-03-05214-A	39,9690	20 000,00	799 380,00	Расч_цена_ПН
Ростелеком	обыкновенная	1-01-00124-A	145,0000	500 001,00	72 500 145,00	Расч_цена_ПН
Ростелеком	привилегированная	2-01-00124-A	88,3200	100 000,00	8 832 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	обыкновенная	1-03-00161-A	195,2800	100 000,00	19 528 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	привилегированная	2-03-00161-A	101,0100	350 000,00	35 353 500,00	Расч_цена_ПН
Трубная металлургическая компания	обыкновенная	1-01-29031-H	92,0800	30 000,00	2 762 400,00	Расч_цена_ПН
Уралкалий	обыкновенная	1-01-00296-A	222,6900	250 000,00	55 672 500,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					594 306 810,14	

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
"Газпромбанк" (ОАО)(брокер)	16 803 263,45
Итого средств на специальных брокерских счетах	16 803 263,45

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Банк ВТБ	4B020701000B	278 800,00
МДМ Банк	40800323B	419 200,00
Минфин	25072RMFS	191 364,00
Минфин	25077RMFS	265 800,00
Минфин	26204RMFS	9 250,00
Минфин	46017RMFS	139 580,00
Минфин	46018RMFS	26 300,00
Минфин	46020RMFS	391 460,00

Минфин	25075RMFS	199 520,00
ММК	4B02-01-00078-A	510 400,00
ММК	4B02-06-00078-A	1 012 700,00
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	377 460,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	89 050,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	34 256,85
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	918 250,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	1 141 084,85
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	917 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	444 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	79 650,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	488 000,00
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	1 254 600,00
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	371 800,00
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	52 190,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	82 100,00
Россельхозбанк	40303349B	111 500,00
Ростелеком	4-04-00124-A	46 100,00
Татнефть	4B02-01-00161-A	31 800,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		9 884 615,70

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	26 687 879,15

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

1 162 752 418,66 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.

Начальник отдела учета операций и формирования отчетности

Дерунова В.А.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	
Исходящий рег. номер	VTB00109-019-109941F022
Дата и время отправки	02.04.2012 21:30:10
Дата и время приёма	
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна, дата и время ЭЦП 02.04.2012 16:30:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна