

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2013 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: 01.04.2013 7:02:00

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	445 899,19
Итого денежных средств на счетах				445 899,19

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	25077RMFS	1 034,9540	15 000,00	15 524 310,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 051,8080	10 000,00	10 518 080,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	1 046,8560	18 000,00	18 843 408,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	1 006,1940	19 000,00	19 117 686,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	983,4630	10 000,00	9 834 630,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	922,3120	46 000,00	42 426 352,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	1 020,8550	20 000,00	20 417 100,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				136 681 566,00	

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
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
АЛРОСА	4B02-01-40046-N	1 016,5000	5 000,00	5 082 500,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	1 016,5000	20 000,00	20 330 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	1 000,0000	25 000,00	25 000 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	1 003,3000	36 000,00	36 118 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	1 010,4000	10 000,00	10 104 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	999,6000	5 000,00	4 998 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	993,0000	30 001,00	29 790 993,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 008,2000	20 000,00	20 164 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "ЕВРАЗ Металл Инпром"	4-02-55534-P	0,0000	13 200,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 002,2000	10 000,00	10 022 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	1 011,5000	5 699,00	5 764 538,50	Расч_цена_ПН

ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	1 010,4000	12 000,00	12 124 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	1 009,6000	20 000,00	20 192 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-13-55005-E	889,5000	13 000,00	11 563 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-14-55005-E	889,2000	5 001,00	4 446 889,20	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	986,9000	63 998,00	63 159 626,20	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	999,1000	20 000,00	19 982 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 009,5000	35 000,00	35 332 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	1 011,9000	25 000,00	25 297 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	1 001,2000	30 000,00	30 036 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	1 001,2000	25 000,00	25 030 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 014,0000	30 000,00	30 420 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 013,5000	21 000,00	21 283 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	4-04-00124-A	497,0500	5 000,00	2 485 250,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	1 000,1000	15 000,00	15 001 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	999,2000	36 000,00	35 971 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	1 004,3000	25 000,00	25 107 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	1 006,5000	10 000,00	10 065 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	997,4000	10 000,00	9 974 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				564 847 596,90	

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
ОАО "Аэрофлот"	обыкновенная	1-01-00010-A	53,4500	500 000,00	26 725 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	5 244,0000	11 300,00	59 257 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	60,1800	80 000,00	4 814 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	1 998,3000	50 000,00	99 915 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	153,8000	40 000,00	6 152 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	84,4700	40 000,00	3 378 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	315,1300	80 000,00	25 210 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,3289	9 103 050,00	2 993 993,15	Расч_цена_ПН
ОАО "РБК Информационные Системы"	обыкновенная	1-03-05214-A	39,9690	20 000,00	799 380,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	121,9000	500 001,00	60 950 121,90	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	88,1800	400 000,00	35 272 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,6136	40 000 000,00	24 544 000,00	Расч_цена_ПН

ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	98,7700	500 000,00	49 385 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	75,1000	600 000,00	45 060 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	27,7800	2 364 500,00	65 685 810,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-H	83,4400	30 000,00	2 503 200,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					512 646 305,05	

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)	3 314 092,44
Итого средств на специальных брокерских счетах	3 314 092,44

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
АЛРОСА	4B02-01-40046-N	70 300,00

АЛРОСА	4B02-02-40046-N	281 200,00
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	923 750,00
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	203 760,00
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	20 600,00
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	43 300,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	498 616,62
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	745 800,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	421 600,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	18 293,79
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	38 520,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	49 400,00
ОАО " Мечел"	4-13-55005-E	92 560,00
ОАО " Мечел"	4-14-55005-E	35 607,12
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	1 009 888,44
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	494 000,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	75 950,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	822 250,00
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	924 300,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	493 250,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 146 000,00
Минфин	25077RMFS	202 350,00
Минфин	26204RMFS	20 500,00
Минфин	26209RMFS	224 820,00
Минфин	46017RMFS	179 360,00
Минфин	46018RMFS	47 900,00
Минфин	46020RMFS	400 200,00
Минфин	25075RMFS	279 000,00
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	239 400,00
ОАО "Ростелеком"	4-04-00124-A	23 500,00
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	202 200,00
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	1 262 520,00
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	268 750,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	292 500,00
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	17 900,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		12 069 845,97

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	15 383 938,41

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****1 230 005 305,55 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.

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	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00109-019-117334F025		
Дата и время отправки	02.04.2013 16:47:08	Дата и время приёма	02.04.2013 16:47:08
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна дата и время ЭЦП 01.04.2013 6:00:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 02.04.2013 10:30:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		