

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2012 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: 02.07.2012 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	37 887 613,21
Итого денежных средств на счетах				37 887 613,21

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	1 004,7110	14 800,00	14 869 722,80	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25077RMFS	989,7850	20 000,00	19 795 700,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25079RMFS	986,4020	5 000,00	4 932 010,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	977,4050	5 000,00	4 887 025,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	956,4400	20 000,00	19 128 800,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26206RMFS	977,5550	15 000,00	14 663 325,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	954,1580	14 000,00	13 358 212,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	928,9530	5 000,00	4 644 765,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	987,0640	46 000,00	45 404 944,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	985,5010	14 500,00	14 289 764,50	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				155 974 268,30	

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	1 001,1000	20 000,00	20 022 000,00	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	998,1000	10 000,00	9 981 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-01-00078-A	993,6000	20 000,00	19 872 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-06-00078-A	971,5000	65 000,00	63 147 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	978,2000	9 000,00	8 803 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	948,5000	13 000,00	12 330 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	925,0000	5 001,00	4 625 925,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	993,0000	25 000,00	24 825 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ЕВРАЗ Металл Инпром"	4-02-55534-P	0,0000	13 200,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	968,9000	34 949,00	33 862 086,10	Расч_цена_ПН

ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	971,3000	30 000,00	29 139 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 011,0000	10 000,00	10 110 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	997,3000	15 000,00	14 959 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	997,9000	25 000,00	24 947 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	976,2000	36 000,00	35 143 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 009,3000	20 000,00	20 186 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	1 012,0000	8 500,00	8 602 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	960,0000	5 000,00	4 800 000,00	Расч_цена_ПН
Россельхозбанк	40303349B	1 004,0000	10 000,00	10 040 000,00	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	990,1000	20 000,00	19 802 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				380 102 011,10	

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	5 424,0000	14 000,00	75 936 000,00	Расч_цена_ПН
Лукойл	обыкновенная	1-01-00077-A	1 797,9000	55 000,00	98 884 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	200,3000	40 000,00	8 012 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	153,9600	40 000,00	6 158 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	обыкновенная	1-01-00010-A	43,3800	500 000,00	21 690 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	74,3000	80 000,00	5 944 000,00	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	320,9300	40 000,00	12 837 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,7835	40 000 000,00	31 340 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	85,4400	500 000,00	42 720 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	61,4300	800 000,00	49 144 000,00	Расч_цена_ПН
ОГК-2	обыкновенная	1-02-65105-D	0,4660	9 103 050,00	4 242 021,30	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	116,0800	500 001,00	58 040 116,08	Расч_цена_ПН
Ростелеком	привилегированная	2-01-00124-A	81,2900	200 000,00	16 258 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	привилегированная	2-03-00161-A	84,0700	600 000,00	50 442 000,00	Расч_цена_ПН
Трубная металлургическая компания	обыкновенная	1-01-29031-H	86,3100	30 000,00	2 589 300,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					485 036 917,38	

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)	82 705 735,30
Итого средств на специальных брокерских счетах	82 705 735,30

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	194 800,00
Минфин	25072RMFS	455 100,00
Минфин	25077RMFS	632 400,00
Минфин	25079RMFS	23 000,00
Минфин	26204RMFS	102 750,00
Минфин	26205RMFS	274 800,00
Минфин	26206RMFS	30 450,00

Минфин	46017RMFS	139 580,00
Минфин	46018RMFS	26 300,00
Минфин	46020RMFS	1 182 660,00
Минфин	25075RMFS	448 340,00
ММК	4B02-01-00078-A	166 400,00
ММК	4B02-06-00078-A	2 179 450,00
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	158 670,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	413 140,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	158 931,78
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	435 250,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	383 041,04
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	308 100,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	176 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	369 450,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	20 500,00
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	536 400,00
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 107 200,00
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	258 825,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	174 350,00
Россельхозбанк	40303349B	342 100,00
Ростелеком	4-04-00124-A	128 400,00
Татнефть	4B02-01-00161-A	393 200,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		11 499 087,82

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
	350 000,00
Итого прочая дебиторская задолженность	350 000,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	94 554 823,12

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

1 153 555 633,11 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	VTB00109-019-111473F022		
Дата и время отправки	04.07.2012 11:37:21	Дата и время приёма	04.07.2012 11:37:21
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 04.07.2012 5:24:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Дерунова Виталия Александровна, дата и время ЭЦП 04.07.2012 4:43:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		