

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2013 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: 01.07.2013 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	38 421 544,71
Итого денежных средств на счетах				38 421 544,71

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	1 023,0720	15 000,00	15 346 080,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 036,3620	10 000,00	10 363 620,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	1 014,0940	18 000,00	18 253 692,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26210RMFS	985,9530	15 000,00	14 789 295,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26211RMFS	971,3140	55 000,00	53 422 270,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26212RMFS	933,8600	60 000,00	56 031 600,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	999,3200	19 000,00	18 987 080,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	966,2810	20 000,00	19 325 620,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	899,6190	46 000,00	41 382 474,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	1 012,8500	20 000,00	20 257 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				268 158 731,00	

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	1 015,1000	5 000,00	5 075 500,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	1 018,6000	20 000,00	20 372 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	1 001,7000	33 000,00	33 056 100,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	1 009,6000	10 000,00	10 096 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	996,5000	16 000,00	15 944 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	997,0000	40 000,00	39 880 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 001,9000	20 000,00	20 038 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 000,2000	10 000,00	10 002 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	1 012,4000	5 699,00	5 769 667,60	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	1 009,7000	12 000,00	12 116 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	1 012,6000	20 000,00	20 252 000,00	Расч_цена_ПН

ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	884,8000	13 000,00	11 502 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	851,1000	5 001,00	4 256 351,10	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	991,9000	63 998,00	63 479 616,20	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	1 003,6000	20 000,00	20 072 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 015,8000	35 000,00	35 553 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	1 005,7000	25 000,00	25 142 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	1 004,7000	30 000,00	30 141 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 015,8000	30 000,00	30 474 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 010,9000	21 000,00	21 228 900,00	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	1 004,6000	15 000,00	15 069 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	998,9000	36 000,00	35 960 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	1 005,5000	25 000,00	25 137 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	1 003,6000	10 000,00	10 036 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	999,9000	10 000,00	9 999 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				533 138 584,90	

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	56,4000	500 000,00	28 200 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	4 721,0000	11 300,00	53 347 300,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	63,3700	80 000,00	5 069 600,00	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	1 877,2000	50 000,00	93 860 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	95,9000	40 000,00	3 836 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	53,1100	40 000,00	2 124 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	348,8700	40 000,00	13 954 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2404	9 103 050,00	2 188 373,22	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	87,6100	500 001,00	43 805 087,61	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	73,1000	400 000,00	29 240 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,5003	40 000 000,00	20 012 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	70,0500	600 000,00	42 030 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	26,9280	1 940 000,00	52 240 320,00	Расч_цена_ПН

ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-Н	78,8600	30 000,00	2 365 800,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					393 073 060,83	

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)	42 570 774,85
Итого средств на специальных брокерских счетах	42 570 774,85

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 Банк ВТБ	4B020801000B	186 780,00
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	20 600,00
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	138 560,00

ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 402 800,00
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	337 000,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	197 300,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	146 122,36
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	307 680,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	498 000,00
ОАО " Мечел"	4-13-55005-E	416 650,00
ОАО " Мечел"	4-14-55005-E	160 282,05
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	2 158 652,54
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	35 200,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	843 850,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	280 000,00
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	314 700,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	521 700,00
Минфин	25077RMFS	477 300,00
Минфин	26204RMFS	207 500,00
Минфин	26209RMFS	565 920,00
Минфин	26210RMFS	30 750,00
Минфин	26211RMFS	1 740 200,00
Минфин	26212RMFS	1 831 200,00
Минфин	46017RMFS	179 360,00
Минфин	46018RMFS	95 800,00
Минфин	46020RMFS	1 191 400,00
Минфин	25075RMFS	622 200,00
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	723 870,00
ОАО "Ростелеком"	4-04-00124-A	64 650,00
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	508 800,00
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	544 320,00
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	789 250,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	74 300,00
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	198 600,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		18 162 796,95

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	60 733 571,80

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****1 293 525 493,24 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	VTB00109-019-119018F025		
Дата и время отправки	03.07.2013 8:12:51	Дата и время приёма	03.07.2013 8:12:51
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна дата и время ЭЦП 01.07.2013 13:21:16 GMT [048050109-05] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 02.07.2013 17:37:42 GMT [00001-1] ЭЦП верна		