

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2012 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: 02.10.2012 7:05:00

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	44 717 803,90
Итого денежных средств на счетах				44 717 803,90

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	1 003,9520	14 800,00	14 858 489,60	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25077RMFS	1 007,1090	20 000,00	20 142 180,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25079RMFS	1 000,5620	10 000,00	10 005 620,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26203RMFS	988,98699980012	10 006,00	9 895 803,92	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 004,0170	10 000,00	10 040 170,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	998,6570	30 000,00	29 959 710,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26206RMFS	1 001,4980	15 000,00	15 022 470,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26208RMFS	997,2650	30 000,00	29 917 950,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	990,2620	20 000,00	19 805 240,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	972,2470	19 000,00	18 472 693,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	939,9910	5 000,00	4 699 955,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	881,8200	46 000,00	40 563 720,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	998,7020	20 000,00	19 974 040,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				243 358 041,52	

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	1 001,2000	20 000,00	20 024 000,00	Расч_цена_ПН
Газпром нефть	4-04-00146-A	986,8000	20 000,00	19 736 000,00	Расч_цена_ПН
ГМК "Норильский никель"	4B02-03-40155-F	996,0000	4 634,00	4 615 464,00	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	1 000,1000	10 000,00	10 001 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-01-00078-A	999,0000	20 000,00	19 980 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-06-00078-A	976,9000	62 000,00	60 567 800,00	Расч_цена_ПН
ММК	4B02-07-00078-A	977,65217391304	23 000,00	22 486 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	986,5000	9 000,00	8 878 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	910,3000	13 000,00	11 833 900,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	920,8000	5 001,00	4 604 920,80	Расч_цена_ПН

ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	1 000,8000	25 000,00	25 020 000,00	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	985,0000	34 949,00	34 424 765,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	984,9000	30 000,00	29 547 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 000,6000	19 500,00	19 511 700,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 003,2000	10 000,00	10 032 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	1 002,4000	15 000,00	15 036 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	1 001,3000	25 000,00	25 032 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	990,7000	36 000,00	35 665 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	997,0000	10 000,00	9 970 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	998	20 000,00	19 960 000,00	Расчётная цена
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	995,3000	20 000,00	19 906 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 003,0000	20 000,00	20 060 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	1 009,4000	8 500,00	8 579 900,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	984,5000	10 001,00	9 845 984,50	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-07-36281-R	973,5000	14 963,00	14 566 480,50	Расч_цена_ПН
Россельхозбанк	40303349B	1 015,8000	10 000,00	10 158 000,00	Расч_цена_ПН
Ростелеком	4-04-00124-A	999,0000	5 000,00	4 995 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	4B02-01-00161-A	992,5000	20 000,00	19 850 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				514 888 114,80	

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	4 965,0000	12 000,00	59 580 000,00	Расч_цена_ПН
Лукойл	обыкновенная	1-01-00077-A	1 927,0000	50 000,00	96 350 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	218,7000	40 000,00	8 748 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	157,5000	40 000,00	6 300 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	обыкновенная	1-01-00010-A	43,4300	500 000,00	21 715 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	70,3400	80 000,00	5 627 200,00	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	351,1100	40 000,00	14 044 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,8568	40 000 000,00	34 272 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	90,8900	500 000,00	45 445 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	66,9100	800 000,00	53 528 000,00	Расч_цена_ПН
ОГК-2	обыкновенная	1-02-65105-D	0,3967	9 103 050,00	3 611 179,94	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	134,9500	500 001,00	67 475 134,95	Расч_цена_ПН
Ростелеком	привилегированная	2-01-00124-A	96,4700	400 000,00	38 588 000,00	Расч_цена_ПН
Трубная металлургическая компания	обыкновенная	1-01-29031-H	98,5200	30 000,00	2 955 600,00	Расч_цена_ПН

Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	459 038 894,89
---	----------------

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)	2 190 175,27
Итого средств на специальных брокерских счетах	2 190 175,27

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	283 200,00
Газпром нефть	4-04-00146-A	745 800,00
ГМК "Норильский никель"	4B02-03-40155-F	54 217,80
МДМ Банк	40800323B	421 600,00
Минфин	25072RMFS	194 176,00
Минфин	25077RMFS	269 800,00

Минфин	25079RMFS	222 400,00
Минфин	26203RMFS	100 260,12
Минфин	26204RMFS	20 500,00
Минфин	26205RMFS	987 000,00
Минфин	26206RMFS	310 200,00
Минфин	26208RMFS	154 200,00
Минфин	26209RMFS	249 800,00
Минфин	46017RMFS	179 360,00
Минфин	46018RMFS	27 400,00
Минфин	46020RMFS	400 200,00
Минфин	25075RMFS	279 000,00
ММК	4B02-01-00078-A	514 200,00
ММК	4B02-06-00078-A	978 360,00
ММК	4B02-07-00078-A	310 730,00
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	379 890,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	92 560,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	35 607,12
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	923 750,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	1 149 472,61
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	924 300,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	42 315,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	447 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	82 800,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	493 250,00
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	1 262 520,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	32 100,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	64 200,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	49 400,00
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	215 000,00
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	54 485,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	166 216,62
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-07-36281-R	564 853,25
Россельхозбанк	40303349B	114 000,00
Ростелеком	4-04-00124-A	47 000,00
Татнефть	4B02-01-00161-A	35 800,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13 879 623,52

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	16 069 798,79

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****1 278 072 653,90 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	VTB00109-019-113255F022		
Дата и время отправки	03.10.2012 13:42:56	Дата и время приёма	03.10.2012 13:42:56
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна, дата и время ЭЦП 03.10.2012 7:23:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 03.10.2012 7:40:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		