

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2013 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: 01.10.2013 7:08:00

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	162 395,27
Итого денежных средств на счетах				162 395,27

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	1 020,2390	15 000,00	15 303 585,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 036,3160	10 000,00	10 363 160,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	1 030,1100	18 000,00	18 541 980,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26210RMFS	995,7470	30 000,00	29 872 410,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26211RMFS	989,7060	75 000,00	74 227 950,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26212RMFS	948,4660	75 000,00	71 134 950,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	1 000,6280	19 000,00	19 011 932,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	964,4910	25 000,00	24 112 275,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	908,8230	46 000,00	41 805 858,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	1 011,0660	20 000,00	20 221 320,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				324 595 420,00	

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
АКБ "Держава" ОАО	4B020102738B	1 001,0000	40 000,00	40 040 000,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-01-40046-N	1 023,4000	5 000,00	5 117 000,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	1 022,5000	20 000,00	20 450 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	1 002,0000	25 000,00	25 050 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	1 011,5000	10 000,00	10 115 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 002,9000	40 000,00	40 116 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 006,2000	20 000,00	20 124 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 004,4000	10 000,00	10 044 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	1 011,1000	12 000,00	12 133 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	1 014,9000	20 000,00	20 298 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	847,2000	13 000,00	11 013 600,00	ЗАО "ФБ ММВБ"

ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	840,0000	5 001,00	4 200 840,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4-19-00078-A	1 006,0000	18 000,00	18 108 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	994,4000	63 998,00	63 639 611,20	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	1 006,3000	20 000,00	20 126 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "МОЭСК"	4B02-02-65116-D	1 013,2000	65,00	65 858,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 009,1000	35 000,00	35 318 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	1 002,3000	20 000,00	20 046 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	1 019,5000	25 000,00	25 487 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	1 008,5000	25 000,00	25 212 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 018,5000	30 000,00	30 555 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	1 004,5000	30 000,00	30 135 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 008,4000	21 000,00	21 176 400,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	1 002,5000	35 000,00	35 087 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	997,2000	36 000,00	35 899 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	1 007,9000	25 000,00	25 197 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	1 016,0000	10 000,00	10 160 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АК "Транснефть"	4B02-01-00206-A	1 006,0000	15 000,00	15 090 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				630 006 209,20	

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	54,2700	500 000,00	27 135 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	4 702,0000	11 300,00	53 132 600,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	64,3100	80 000,00	5 144 800,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	2 064,2000	10 000,00	20 642 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	102,0000	40 000,00	4 080 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	53,3400	40 000,00	2 133 600,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	385,0600	40 000,00	15 402 400,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2707	9 103 050,00	2 464 195,64	ЗАО "ФБ ММВБ"
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	102,6300	343 081,00	35 210 403,03	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	71,2600	374 465,00	26 684 375,90	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,5406	40 000 000,00	21 624 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"

ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	74,9700	400 000,00	29 988 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	27,5000	1 940 000,00	53 350 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-H	83,0700	30 000,00	2 492 100,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					300 282 854,57	

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)	131 622 292,22
Итого средств на специальных брокерских счетах	131 622 292,22

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
АКБ "Держава" ОАО	4B020102738B	921 200,00
АЛРОСА	4B02-01-40046-N	71 550,00

АЛРОСА	4B02-02-40046-N	286 200,00
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	141 000,00
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	22 900,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	673 200,00
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	750 400,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	424 100,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	41 400,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	54 200,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	96 200,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	37 007,40
ОАО "ММК"	4-19-00078-A	280 800,00
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	1 022 688,04
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	499 000,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-02-65116-D	2 413,45
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	84 350,00
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	578 800,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	828 250,00
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	776 000,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 152 900,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	65 700,00
Минфин	25077RMFS	205 350,00
Минфин	26204RMFS	22 600,00
Минфин	26209RMFS	228 600,00
Минфин	26210RMFS	575 700,00
Минфин	26211RMFS	776 250,00
Минфин	26212RMFS	782 250,00
Минфин	46017RMFS	182 780,00
Минфин	46018RMFS	124 750,00
Минфин	46020RMFS	408 940,00
Минфин	25075RMFS	282 800,00
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	244 860,00
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	479 500,00
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	1 270 440,00
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	274 500,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	294 900,00
ОАО "АК "Транснефть"	4B02-01-00206-A	302 100,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		15 266 578,89

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	146 888 871,11

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****1 401 935 750,15 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	VTB00109-019-121515F025		
Дата и время отправки	02.10.2013 8:17:47	Дата и время приёма	02.10.2013 8:17:47
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна дата и время ЭП 01.10.2013 6:02:19 UTC [00109-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 01.10.2013 13:51:40 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		