

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2016 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, 7444036805/745501001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У024

Дата и время составления расчёта: 03.10.2016 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
"Газпромбанк" (Акционерное общество)	05.06.2015	810-3-2-4267/2015	40701810300000024267	1 307 252,78
Итого денежных средств на счетах				1 307 252,78

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
Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	25.08.2016	7800-16/54	42005810378001601654	32 500 000,00	294 941,94
Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	28.09.2016	7800-16/67	42004810078001601667	42 000 000,00	20 678,69
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				74 815 620,63	

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	25080RMFS	991,2690	40 000,00	39 650 760,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	25081RMFS	971,5020	30 000,00	29 145 060,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26216RMFS	961,0010	20 000,00	19 220 020,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				88 015 840,00	

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
Альфа-Банк	4B020401326B	998 ,7000	40 000 ,00	39 948 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "Акрон"	4B02-03-00207-A	1 011 ,9000	10 000 ,00	10 119 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Банк ВТБ ПАО	4B022601000B	1 001 ,5000	35 000 ,00	35 052 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	999 ,4000	15 988 ,00	15 978 407,20	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	981 ,0000	8 000 ,00	7 848 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	988 ,2000	33 000 ,00	32 610 600,00	Расч_цена_ПН
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	993 ,1000	35 000 ,00	34 758 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	985 ,0000	30 000 ,00	29 550 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 008 ,2000	5 000 ,00	5 041 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "Лента"	4-03-36420-R	1 036 ,5000	15 000 ,00	15 547 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	1 000 ,0000	129 176 ,00	129 176 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "ВымпелКом"	4-01-00027-A	1 000 ,8000	20 000 ,00	20 016 000,00	Расч_цена_ПН

ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	988 ,5000	25 000 ,00	24 712 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Магнит"	4B02-01-60525-P-001 P	1 008 ,5000	15 000 ,00	15 127 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Мегафон"	4B02-05-00822-J	1 018 ,3000	15 000 ,00	15 274 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "МОЭСК"	4B02-08-65116-D	1 014 ,3000	20 000 ,00	20 286 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	988 ,5000	40 000 ,00	39 540 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	994 ,9000	35 000 ,00	34 821 500,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Сбербанк России"	4B021701481B	1 011 ,6000	33 000 ,00	33 382 800,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	992 ,0000	30 000 ,00	29 760 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Российские железные дороги	4-12-65045-D	999 ,0000	40 000 ,00	39 960 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	985 ,7000	40 000 ,00	39 428 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
"Силовые машины - ЗТЛ, ЛМЗ, Электросила, Энергомашэкспорт"	4-02-35909-H	998 ,5000	35 000 ,00	34 947 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	997 ,3000	35 000 ,00	34 905 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-25-65018-D	991 ,3000	35 000 ,00	34 695 500,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				772 486 807,20	

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
АК "АЛРОСА"	обыкновенная	1-03-40046-N	85 ,5300	100 000 ,00	8 553 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	9 889 ,0000	3 000 ,00	29 667 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0 ,0000	1 138 646 ,00	0,00	Расчётная цена
ПАО "Магнит"	обыкновенная	1-01-60525-P	10 474 ,0000	3 500 ,00	36 659 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ММК"	обыкновенная	1-03-00078-A	29 ,0000	800 000 ,00	23 200 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "МТС"	обыкновенная	1-01-04715-A	228 ,2500	200 000 ,00	45 650 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "АК "Транснефть"	обыкновенная	2-01-00206-A	136 200 ,0000	60 ,00	8 172 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0 ,3404	50 ,00	17,02	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Газпром"	обыкновенная	1-02-00028-A	135 ,0400	400 000 ,00	54 016 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	3 074 ,5000	10 000 ,00	30 745 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Мегафон"	обыкновенная	1-03-00822-J	610 ,0000	60 000 ,00	36 600 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0 ,7812	40 000 000 ,00	31 248 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Селигдар"	обыкновенная	1-01-32694-F	7 ,9200	15 693 000 ,00	124 288 560,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	12 ,0000	810 000 ,00	9 720 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "РБК Информационные Системы"	обыкновенная	1-03-05214-A	39 ,9690	20 000 ,00	799 380,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	78 ,8700	447 763 ,00	35 315 067,81	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	61 ,9000	33 ,00	2 042,70	ЗАО "ФБ ММВБ"

ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-Н	61,4000	30 000,00	1 842 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					476 477 067,53	

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
Банк ГПБ (АО)(брокер)	48 841 759,87
Итого средств на специальных брокерских счетах	48 841 759,87

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Альфа-Банк	4B020401326B	1 437 600,00
ОАО "Акрон"	4B02-03-00207-A	410 000,00
Банк ВТБ ПАО	4B022601000B	29 400,00
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	74 504,08
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	307 360,00

ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	450 450,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 192 800,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	92 100,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	212 900,00
ООО "Лента"	4-03-36420-R	149 700,00
ООО "Правмурмийское"	4-01-36417-R	1 114 788,88
Минфин	25080RMFS	1 322 000,00
Минфин	25081RMFS	295 500,00
Минфин	26216RMFS	495 600,00
ПАО "ВымпелКом"	4-01-00027-A	93 200,00
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	704 500,00
ПАО "Магнит"	4B02-01-60525-P-001P	653 550,00
ПАО "Мерафон"	4B02-05-00822-J	754 200,00
ПАО "МОЭСК"	4B02-08-65116-D	874 800,00
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	1 517 200,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	407 400,00
ПАО "Сбербанк России"	4B021701481B	1 582 350,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	369 600,00
Российские железные дороги	4-12-65045-D	1 240 800,00
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	584 000,00
"Силовые машины - ЗТЛ, ЛМЗ, Электросила, Энергомашэкспорт"	4-02-35909-H	1 367 100,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	1 065 750,00
ОАО "ФСК ЕЭС"	4-25-65018-D	25 900,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		18 825 052,96

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	67 666 812,83

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

1 480 769 400,97 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.

Директор		Малков 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	VTB00109-153359F025		
Дата и время отправки	04.10.2016 11:20:20	Дата и время приёма	04.10.2016 12:59:50
Подписано	'1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 04.10.2016 6:19:55 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Малков Владимир Александрович дата и время ЭП 04.10.2016 4:58:38 UTC [00109-8] Электронная подпись верна'		