

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2017 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: 02.10.2017 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	471 217,24
Итого денежных средств на счетах				471 217,24

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	25081RMFS	995 ,3500	190 000 ,00	189 116 500,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 000 ,5100	190 000 ,00	190 096 900,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26208RMFS	1 001 ,5400	160 000 ,00	160 246 400,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26210RMFS	987 ,9800	160 000 ,00	158 076 800,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26214RMFS	974 ,6200	50 000 ,00	48 731 000,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26216RMFS	989 ,5400	160 000 ,00	158 326 400,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46014RMFS	499 ,2500	35 000 ,00	17 473 750,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				922 067 750,00	

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
АО "АИЖК"	4B02-09-00739-A	1 002 ,1000	30 000 ,00	30 063 000,00	Расч_цена_ПН
Банк ВТБ ПАО	4B022601000B	1 002 ,7000	20 000 ,00	20 054 000,00	Расч_цена_ПН
Банк ВТБ ПАО	4B023001000B	1 010 ,2000	40 000 ,00	40 408 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 001 ,4000	26 300 ,00	26 336 820,00	Расч_цена_ПН
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	1 002 ,2000	15 000 ,00	15 033 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "МТС"	4B02-01-04715-A	999 ,4000	15 000 ,00	14 991 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	999 ,5000	49 155 ,00	49 130 422,50	Расч_цена_ПН
ПАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	998 ,5000	60 000 ,00	59 910 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-01-36241-R-001 P	1 013 ,0000	5 000 ,00	5 065 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 002 ,5000	30 000 ,00	30 075 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "Лента"	4-03-36420-R	1 028 ,0000	15 000 ,00	15 420 000,00	Расч_цена_ПН

ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	1 014 ,1000	233 476 ,00	236 768 011,60	Расч_цена_ПН
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	1 000 ,7000	30 000 ,00	30 021 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001 P	1 005 ,3000	15 000 ,00	15 079 500,00	Расч_цена_ПН
ПАО "МОЭСК"	4B02-09-65116-D	1 025 ,0000	45 000 ,00	46 125 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	1 001 ,1000	50 000 ,00	50 055 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Сбербанк"	4B021901481B	1 017 ,0000	65 000 ,00	66 105 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	1 001 ,0000	65 000 ,00	65 065 000,00	Расч_цена_ПН
Российские железные дороги	4-17-65045-D	1 011 ,6000	35 000 ,00	35 406 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	500 ,1500	38 000 ,00	19 005 700,00	Расч_цена_ПН
ПАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001 P	980 ,0000	40 000 ,00	39 200 000,00	Расч_цена_ПН
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	994 ,099575555	45 000 ,00	44 734 480,90	Расч_цена_ПН
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	999 ,89822808	55 025 ,00	55 019 400,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 009 070 335,00	

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 "АПРОСА"	обыкновенная	1-03-40046-N	81 ,8500	300 000 ,00	24 555 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	9 831 ,0000	5 000 ,00	49 155 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0 ,0000	1 138 646 ,00	0,00	Расчётная цена
ПАО "Магнит"	обыкновенная	1-01-60525-P	10 113 ,0000	4 000 ,00	40 452 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "ММК"	обыкновенная	1-03-00078-A	43 ,2050	600 000 ,00	25 923 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "НК "Роснефть"	обыкновенная	1-02-00122-A	320 ,8500	100 000 ,00	32 085 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РТ Проф-Реал"	обыкновенная	1-03-05214-A	39 ,9690	20 000 ,00	799 380,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Газпром"	обыкновенная	1-02-00028-A	122 ,1400	800 000 ,00	97 712 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	3 061 ,5000	25 000 ,00	76 537 500,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Мегафон"	обыкновенная	1-03-00822-J	645 ,6000	60 000 ,00	38 736 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	658 ,7000	43 830 ,00	28 870 821,00	Расч_цена_ПН
ПАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0 ,8532	40 000 000 ,00	34 128 000,00	Расч_цена_ПН
ПАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	69 ,1400	447 763 ,00	30 958 333,82	Расч_цена_ПН
ПАО "Селигдар"	обыкновенная	1-01-32694-F	9 ,300725106	20 588 700 ,00	191 489 839,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					671 401 873,82	

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)	124 657 859,84
Итого средств на специальных брокерских счетах	124 657 859,84

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
АО "АИЖК"	4B02-09-00739-A	58 800,00
Банк ВТБ ПАО	4B022601000B	20 200,00
Банк ВТБ ПАО	4B023001000B	78 800,00
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 016 232,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	625 500,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	208 500,00
ПАО "МТС"	4B02-01-04715-A	10 200,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	1 686 999,60

ПАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	197 400,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-01-36241-R-001P	2 600,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-06-36241-R	1 285 800,00
ООО "Лента"	4-03-36420-R	154 500,00
ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	2 073 266,88
Минфин	25081RMFS	1 903 800,00
Минфин	26204RMFS	625 100,00
Минфин	26208RMFS	1 019 200,00
Минфин	26210RMFS	3 219 200,00
Минфин	26214RMFS	1 069 500,00
Минфин	26216RMFS	3 995 200,00
Минфин	46014RMFS	103 950,00
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	852 300,00
ПАО "Магнит"	4B02-04-60525-P-001P	382 200,00
ПАО "МОЭСК"	4B02-09-65116-D	372 150,00
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	2 099 203,75
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	594 000,00
ПАО "Сбербанк"	4B021901481B	1 818 050,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	816 400,00
Российские железные дороги	4-17-65045-D	834 400,00
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	281 580,00
ПАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001P	2 356 000,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		29 761 032,23

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	154 418 892,07

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

2 757 430 068,13 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	VTB00109-163534F025		
Дата и время отправки	03.10.2017 13:43:43	Дата и время приёма	03.10.2017 13:52:05
Подписано	'1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 03.10.2017 8:43:44 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Малков Владимир Александрович дата и время ЭП 02.10.2017 8:27:41 UTC [00109-8] Электронная подпись верна'		