

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2011 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: 03.01.2012 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	219 515,74
Итого денежных средств на счетах				219 515,74

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	1 007,5370	14 800,00	14 911 547,60	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25077RMFS	985,1750	20 000,00	19 703 500,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26203RMFS	960,2820	15 002,00	14 406 150,56	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	967,0030	5 000,00	4 835 015,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	954,1890	20 000,00	19 083 780,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	949,9060	14 000,00	13 298 684,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	929,0650	5 000,00	4 645 325,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	859,3960	46 000,00	39 532 216,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	976,0830	14 500,00	14 153 203,50	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				144 569 421,66	

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
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-Н	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	40800323В	998,7000	10 000,00	9 987 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4В02-01-00078-А	992,3000	20 000,00	19 846 000,00	Расч_цена_ПН
ММК	4В02-06-00078-А	959,1000	45 000,00	43 159 500,00	Расч_цена_ПН
ММК	4В02-07-00078-А	963,0000	45 000,00	43 335 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4В02-03-55005-Е	1 019,9000	9 000,00	9 179 100,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-13-55005-Е	1 006,0000	13 000,00	13 078 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	4-14-55005-Е	1 003,7000	5 001,00	5 019 503,70	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4В02-02-00010-А	997,5000	25 000,00	24 937 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ЕВРАЗ Металл Инпром"	4-02-55534-Р	0,0000	18 700,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-А	966,9000	34 949,00	33 792 188,10	Расч_цена_ПН

ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	966,7000	30 000,00	29 001 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мосэнерго"	4-03-00085-A	998,1000	22 935,00	22 891 423,50	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 023,0000	10 000,00	10 230 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	995,6000	15 000,00	14 934 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	1 010,1000	25 000,00	25 252 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	989,9000	36 000,00	35 636 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	4-02-55038-E	974,2000	24 000,00	23 380 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 029,8000	20 000,00	20 596 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	1 020,1000	8 500,00	8 670 850,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	967,3000	5 000,00	4 836 500,00	Расч_цена_ПН
Промсвязьбанк	40403251B	983,5000	10 000,00	9 835 000,00	Расч_цена_ПН
Россельхозбанк	40303349B	1 006,7000	10 000,00	10 067 000,00	Расч_цена_ПН
Ростелеком	4-04-00124-A	980,6000	5 000,00	4 903 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	4B02-01-00161-A	985,0000	20 000,00	19 700 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				442 268 265,30	

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	4 950,0000	14 000,00	69 300 000,00	Расч_цена_ПН
Лукойл	обыкновенная	1-01-00077-A	1 699,5000	50 000,00	84 975 000,00	Расч_цена_ПН
Магнит	обыкновенная	1-01-60525-P	2 768,2000	3 000,00	8 304 600,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	265,2000	40 000,00	10 608 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "АЭРОФЛОТ"	обыкновенная	1-01-00010-A	50,2900	500 000,00	25 145 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	79,1400	42 000,00	3 323 880,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Иркутская электросетевая компания"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	обыкновенная	1-01-04715-A	181,9500	59 130,00	10 758 703,50	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	388,5700	50 000,00	19 428 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Русгидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,9649	40 000 000,00	38 596 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	79,0600	500 000,00	39 530 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	58,8500	700 000,00	41 195 000,00	Расч_цена_ПН
ОГК-2	обыкновенная	1-02-65105-D-004D	0,7385	9 103 050,00	6 722 602,43	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	153,1900	568 921,00	87 153 007,99	Расч_цена_ПН
Татнефть	обыкновенная	1-03-00161-A	156,6500	200 000,00	31 330 000,00	Расч_цена_ПН
Татнефть	привилегированная	2-03-00161-A	88,2100	150 000,00	13 231 500,00	Расч_цена_ПН
ТГК	обыкновенная	1-01-12190-E	0,006392	13 366 046,00	85 435,77	Расч_цена_ПН
Трубная металлургическая компания	обыкновенная	1-01-29031-H	71,7000	30 000,00	2 151 000,00	Расч_цена_ПН
Уралкалий	обыкновенная	1-01-00296-A	233,5300	50 000,00	11 676 500,00	Расч_цена_ПН
Энел ОГК-5	обыкновенная	1-01-50077-A	1,8278	17,00	31,07	Расч_цена_ПН

Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	504 314 140,76
---	----------------

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)	35 172 560,90
Итого средств на специальных брокерских счетах	35 172 560,90

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
МДМ Банк	40800323B	194 800,00
Минфин	25072RMFS	455 100,00
Минфин	25077RMFS	632 400,00
Минфин	26203RMFS	405 654,08
Минфин	26204RMFS	102 750,00
Минфин	26205RMFS	274 800,00

Минфин	46017RMFS	139 580,00
Минфин	46018RMFS	26 300,00
Минфин	46020RMFS	1 243 380,00
Минфин	25075RMFS	448 340,00
ММК	4B02-01-00078-A	166 400,00
ММК	4B02-06-00078-A	1 508 850,00
ММК	4B02-07-00078-A	1 412 100,00
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	158 670,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	413 140,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	158 931,78
ОАО "АЭРОФЛОТ"	4B02-02-00010-A	435 250,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-07-04715-A	383 041,04
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-08-04715-A	308 100,00
ОАО "Мосэнерго"	4-03-00085-A	615 346,05
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	176 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	369 450,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	20 500,00
ОАО "Русгидро"	4-01-55038-E	536 400,00
ОАО "Русгидро"	4-02-55038-E	357 600,00
ОАО АФК Система	4-02-01669-A	1 107 200,00
ОАО АФК Система	4-01-01669-A	258 825,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	174 350,00
Промсвязьбанк	40403251B	27 100,00
Россельхозбанк	40303349B	342 100,00
Ростелеком	4-04-00124-A	128 400,00
Татнефть	4B02-01-00161-A	393 200,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13 374 757,95

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	48 547 318,85

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

1 139 918 662,31 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
(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

Дерунова В.А.
(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00109-019-108108F022		
Дата и время отправки	13.01.2012 10:13:31	Дата и время приёма	13.01.2012 10:13:31
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 13.01.2012 5:11:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Дерунова Виталия Александровна, дата и время ЭЦП 12.01.2012 14:58:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		