

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2012 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: 09.01.2013 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	105 497,84
Итого денежных средств на счетах				105 497,84

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	1 000,9820	14 800,00	14 814 533,60	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25077RMFS	1 028,6130	15 000,00	15 429 195,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	1 048,2930	10 000,00	10 482 930,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	1 058,8920	20 000,00	21 177 840,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26206RMFS	1 037,9670	15 000,00	15 569 505,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26208RMFS	1 051,9790	20 000,00	21 039 580,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	1 058,3140	18 000,00	19 049 652,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	995,3020	19 000,00	18 910 738,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	949,6940	46 000,00	43 685 924,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	1 015,9500	20 000,00	20 319 000,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26207RMFS	1 106,3220	15 000,00	16 594 830,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				217 073 727,60	

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
АЛРОСА	4B02-01-40046-N	1 006,0000	5 000,00	5 030 000,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	1 005,6000	20 000,00	20 112 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	1 000,1000	25 000,00	25 002 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	1 000,7000	23 000,00	23 016 100,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	983,8000	25 001,00	24 595 983,80	Расч_цена_ПН
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	999,8000	20 000,00	19 996 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-03-40155-F	997,6000	10 000,00	9 976 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "ЕВРАЗ Металл Инпром"	4-02-55534-P	0,0000	13 200,00	0,00	Номинал_ЦБ
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	1 005,4000	10 000,00	10 054 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	1 004,4000	5 000,00	5 022 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	1 003,0000	12 000,00	12 036 000,00	Расч_цена_ПН

ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-Н	1 000,9000	20 000,00	20 018 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-13-55005-E	871,8000	13 000,00	11 333 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-14-55005-E	866,8000	5 001,00	4 334 866,80	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4B02-03-55005-E	995,2000	9 000,00	8 956 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4B02-07-00078-A	976,8122	24 500,00	23 931 900,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	980,9000	62 000,00	60 815 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	981,9000	5 000,00	4 909 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 012,0000	35 000,00	35 420 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	1 000,9000	25 000,00	25 022 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	996,1000	30 000,00	29 883 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	1 000,4000	25 000,00	25 010 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 007,5000	30 000,00	30 225 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	1 000,9000	15 000,00	15 013 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 012,7000	21 000,00	21 266 700,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	4-04-00124-A	994,1000	5 000,00	4 970 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	994,9000	36 000,00	35 816 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-01-01669-A	1 007,6000	8 500,00	8 564 600,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	998,3000	20 000,00	19 966 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	995,3000	10 000,00	9 953 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				550 252 050,60	

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	45,3300	500 000,00	22 665 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	5 617,0000	11 300,00	63 472 100,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	65,1500	80 000,00	5 212 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	2 005,9000	50 000,00	100 295 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	203,8000	40 000,00	8 152 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	119,3800	40 000,00	4 775 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	345,6200	40 000,00	13 824 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,3439	9 103 050,00	3 130 538,90	Расч_цена_ПН
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	119,7500	500 001,00	59 875 119,75	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	90,4400	400 000,00	36 176 000,00	Расч_цена_ПН

ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,7336	40 000 000,00	29 344 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	92,8500	500 000,00	46 425 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Сбербанк России"	обыкновенная	20301481B	67,5600	800 000,00	54 048 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	27,2500	1 940 000,00	52 865 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-H	91,6000	30 000,00	2 748 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					503 807 138,65	

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)	50 656 720,74
Итого средств на специальных брокерских счетах	50 656 720,74

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3

АЛРОСА	4B02-01-40046-N	71 550,00
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	286 200,00
ОАО "Аэрофлот"	4B02-02-00010-A	446 000,00
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	135 240,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	882 035,28
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	341 400,00
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-03-40155-F	293 400,00
ОАО "МДМ Банк"	40800323B	199 700,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-01-25642-H	129 450,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	310 680,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	503 000,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	420 290,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	161 682,33
ОАО "Мечел"	4B02-03-55005-E	163 440,00
ОАО "ММК"	4B02-07-00078-A	778 610,00
ОАО "ММК"	4B02-06-00078-A	2 103 660,00
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	10 100,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	852 250,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	286 000,00
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	321 600,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-01-00268-E	30 750,00
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	528 600,00
ОАО "НЛМК"	4B02-06-00102-A	375 750,00
Минфин	25072RMFS	460 872,00
Минфин	25077RMFS	480 300,00
Минфин	26204RMFS	209 600,00
Минфин	26205RMFS	283 200,00
Минфин	26206RMFS	36 450,00
Минфин	26208RMFS	480 800,00
Минфин	26209RMFS	569 700,00
Минфин	46017RMFS	182 780,00
Минфин	46020RMFS	1 200 140,00
Минфин	25075RMFS	625 800,00
Минфин	26207RMFS	438 750,00
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	729 120,00
ОАО "Ростелеком"	4-04-00124-A	130 200,00
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	552 240,00
ОАО АФК "Система"	4-01-01669-A	263 415,00
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	636 000,00
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	4B02-01-00161-A	200 600,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		17 111 354,61

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	67 768 075,35

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****1 339 006 490,04 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	VTB00109-019-115218F025		
Дата и время отправки	11.01.2013 16:05:19	Дата и время приёма	11.01.2013 16:05:19
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна дата и время ЭЦП 09.01.2013 4:54:00 GMT [CN=048050109-05,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭЦП 11.01.2013 9:58:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		