

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2013 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: 09.01.2014 7:06:00

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	4070181060000400568	347 054,64
Итого денежных средств на счетах				347 054,64

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
Открытое акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	27.12.2013	7800-13/145	42002810178000011354	49 000 000,00	8 215,89
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				49 008 215,89	

3. Государственные ценные бумаги Российской Федерации, обращающиеся на рынке ценных бумаг, за исключением облигаций внешних облигационных заемов 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	26209RMFS	1 004,0060	16 000,00	16 064 096,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26210RMFS	981,7590	30 000,00	29 452 770,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26211RMFS	964,2540	75 000,00	72 319 050,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26212RMFS	931,4460	75 000,00	69 858 450,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	26215RMFS	955,7280	40 000,00	38 229 120,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46017RMFS	995,2080	19 000,00	18 908 952,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46018RMFS	952,0000	25 000,00	23 800 000,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	46020RMFS	871,3400	46 000,00	40 081 640,00	Расч_цена_ПН
ГКО-ОФЗ	25075RMFS	1 011,2700	10 000,00	10 112 700,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				318 826 778,00	

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	1 000,4000	20 000,00	20 008 000,00	Расч_цена_ПН
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	1 018,4000	20 000,00	20 368 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	1 000,2000	40 000,00	40 008 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B020601000B	1 008,4000	14 000,00	14 117 600,00	Расч_цена_ПН
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	1 001,2000	30 000,00	30 036 000,00	Расч_цена_ПН
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	40501000B	1 000,5000	648,00	648 324,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 000,0000	40 000,00	40 000 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-06-36281-R	1 000,8000	35 000,00	35 028 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	1 020,1000	20 000,00	20 402 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	1 001,2000	15 000,00	15 018 000,00	Расч_цена_ПН
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	0,0000	4 500,00	0,00	Номинал_ЦБ

ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-Н	1 008,5000	12 000,00	12 102 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-Н	1 009,3000	20 000,00	20 186 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-13-55005-Е	700,0000	13 000,00	9 100 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	4-14-55005-Е	637,6000	5 001,00	3 188 637,60	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4-18-00078-А	1 013,1000	15 000,00	15 196 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ММК"	4-19-00078-А	1 004,9000	40 000,00	40 196 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020201978B	987,7000	15 000,00	14 815 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	998,4000	20 375,00	20 342 400,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-02-65116-D	1 012,4000	10 000,00	10 124 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	1 009,1000	35 000,00	35 318 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-04-04715-А	1 001,5000	20 000,00	20 030 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-07-04715-А	1 014,7000	25 000,00	25 367 500,00	Расч_цена_ПН
ОАО "МТС"	4-08-04715-А	1 004,3000	25 000,00	25 107 500,00	Расч_цена_ПН
"НОМОС-БАНК" (ОАО)	4B020602209B	990,6000	25 000,00	24 765 000,00	Расч_цена_ПН
"НОМОС-БАНК" (ОАО)	4B020502209B	994,0000	10 000,00	9 940 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-А	1 004,5000	30 000,00	30 135 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "НЛМК"	4B02-13-00102-А	997,2000	60 000,00	59 832 000,00	Расч_цена_ПН
ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	1 010,0000	58 531,00	59 116 310,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	1 002,9000	21 000,00	21 060 900,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-А	999,3000	50 000,00	49 965 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	1 008,1000	50 000,00	50 405 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	1 005,3000	36 000,00	36 190 800,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-А	1 005,7000	23 000,00	23 131 100,00	Расч_цена_ПН
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-А	1 015,7000	10 000,00	10 157 000,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				861 406 571,60	

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 "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	5 397,0000	11 300,00	60 986 100,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Группа Компаний ПИК"	обыкновенная	1-02-01556-A	70,7900	80 000,00	5 663 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0,0000	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
ОАО " Мечел"	обыкновенная	1-01-55005-E	65,4000	40 000,00	2 616 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО " Мечел"	привилегированная	2-01-55005-E	35,3800	40 000,00	1 415 200,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2551	9 103 050,00	2 322 188,06	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-А	110,9700	343 081,00	38 071 698,57	Расч_цена_ПН
ОАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-А	74,3500	500 065,00	37 179 832,75	Расч_цена_ПН
ОАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-Е	0,5676	40 000 000,00	22 704 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	28,0000	2 111 000,00	59 108 000,00	Расч_цена_ПН
ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-Н	93,5300	30 000,00	2 805 900,00	Расч_цена_ПН
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					233 671 499,38	

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)	2 620 445,63

Итого средств на специальных брокерских счетах 2 620 445,63

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	438 000,00
АЛРОСА	4B02-02-40046-N	291 000,00
ОАО Банк ВТБ	4B020801000B	234 000,00
ОАО Банк ВТБ	4B022201000B	272 700,00
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	40501000B	11 171,52
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 419 200,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-06-36281-R	612 850,00
ОАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	346 000,00
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	402 600,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-05-25642-H	313 680,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-06-25642-H	508 000,00
ОАО "Мечел"	4-13-55005-E	423 800,00
ОАО "Мечел"	4-14-55005-E	163 032,60
ОАО "ММК"	4-18-00078-A	100 050,00
ОАО "ММК"	4-19-00078-A	1 481 200,00
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020201978B	352 800,00
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020501978B	41 157,50
ОАО "МОЭСК"	4B02-02-65116-D	154 300,00
ОАО "МОЭСК"	4B02-01-65116-D	860 650,00
ОАО "МТС"	4-04-04715-A	962 000,00
ОАО "МТС"	4-07-04715-A	292 000,00
ОАО "МТС"	4-08-04715-A	273 500,00
"НОМОС-БАНК" (ОАО)	4B020602209B	494 750,00
"НОМОС-БАНК" (ОАО)	4B020502209B	448 800,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	670 800,00
ОАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	1 032 000,00
ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	71 993,13
Минфин	26209RMFS	509 760,00
Минфин	26210RMFS	72 600,00
Минфин	26211RMFS	2 100 000,00
Минфин	26212RMFS	2 115 000,00
Минфин	26215RMFS	905 200,00
Минфин	46017RMFS	186 200,00
Минфин	46018RMFS	129 500,00
Минфин	46020RMFS	1 208 880,00
Минфин	25075RMFS	314 800,00
ОАО "Россельхозбанк"	40303349B	734 370,00
ОАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	1 718 500,00
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	1 607 000,00
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	560 160,00
ОАО АФК "Система"	4-02-01669-A	736 690,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	79 100,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		25 685 074,75

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

Итого дебиторская задолженность (руб.)	28 305 520,38
---	---------------

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

1 491 565 639,89 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	VTB00109-019-123543F025		
Дата и время отправки	10.01.2014 13:24:18	Дата и время приёма	10.01.2014 13:24:18
Подписано	1. Дерунова Виталия Александровна дата и время ЭП 09.01.2014 11:27:13 UTC [00109-5] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 10.01.2014 7:03:12 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		