

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 31.12.2015 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: 06.01.2016 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	182 433,46
Итого денежных средств на счетах				182 433,46

**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
Общество с ограниченной ответственностью "Русфинанс Банк"	21.08.2015	810Д/ПН-15	42005810600008100084	30 250 000,00	1 159 610,98
Акционерное общество "Российский Сельскохозяйственный банк"	22.12.2015	7800-15/137	42003810778001500137	42 350 000,00	104 981,59
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				73 600 000,00	1 264 592,57

**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	25077RMFS	999,3850	55 000,00	54 966 175,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ГКО-ОФЗ	26203RMFS	985,9180	55 000,00	54 225 490,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				109 191 665,00	

**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	975,6000	20 000,00	19 512 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ВымпелКом"	4-02-00027-A	958,0000	2 949,00	2 825 142,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	996,4000	45 000,00	44 838 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
"Ладья-Финанс" ООО	4B02-02-36261-R	1 000,0000	130 245,00	130 245 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Межтопэнергобанк	40102956B	999,6000	3 650,00	3 648 540,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	953,4000	25 000,00	23 835 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	952,8000	25 000,00	23 820 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ММК"	4-19-00078-A	987,0000	30 000,00	29 610 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "МОЭСК"	4B02-03-65116-D	999,0000	40 000,00	39 960 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	965,6000	40 000,00	38 624 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Газпром нефть"	4-08-00146-A	998,8000	40 000,00	39 952 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "МРСК Урала"	4B02-01-32501-D	998,1000	25 000,00	24 952 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	942,2000	30 000,00	28 266 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	953,7000	40 000,00	38 148 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	984,9000	25 000,00	24 622 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "Лента"	4-03-36420-R	996,7000	15 000,00	14 950 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	1 000,0000	129 176,00	129 176 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ВымпелКом"	4-01-00027-A	978,4000	35 039,00	34 282 157,60	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Группа Черкизово"	4B02-04-10797-A	1 001,0000	19 089,00	19 108 089,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Магнит"	4-01-60525-P	996,3000	25 000,00	24 907 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"

Российские железные дороги	4-15-65045-D	987,9000	25 000,00	24 697 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	960,0000	40 000,00	38 400 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	949,9000	5 000,00	4 749 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "РусГидро"	4-01-55038-E	988,3000	40 000,00	39 532 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	974,0000	40 000,00	38 960 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				881 621 928,60	

### 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
ПАО "ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	9 173,0000	3 500,00	32 105 500,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Магнит"	обыкновенная	1-01-60525-P	11 126,0000	1 000,00	11 126 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ММК"	обыкновенная	1-03-00078-A	18,4650	2 200 000,00	40 623 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "МТС"	обыкновенная	1-01-04715-A	210,9000	250 000,00	52 725 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ОГК-2"	обыкновенная	1-02-65105-D	0,2237	50,00	11,19	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Газпром"	обыкновенная	1-02-00028-A	136,2500	200 000,00	27 250 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	2 352,6000	20 000,00	47 052 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Мегафон"	обыкновенная	1-03-00822-J	855,0000	20 000,00	17 100 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "РусГидро"	обыкновенная	1-01-55038-E	0,6674	40 000 000,00	26 696 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Селигдар"	привилегированная	2-01-32694-F	23,6000	2 669 400,00	62 997 840,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "РБК Информационные Системы"	обыкновенная	1-03-05214-A	39,9690	20 000,00	799 380,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-A	91,2400	447 763,00	40 853 896,12	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Ростелеком"	привилегированная	2-01-00124-A	68,0000	33,00	2 244,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ПАО "Сбербанк России"	обыкновенная	10301481B	101,1800	200 000,00	20 236 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ТМК"	обыкновенная	1-01-29031-H	60,7000	30 000,00	1 821 000,00	ЗАО "ФБ ММВБ"
ОАО "ИЭСК"	обыкновенная	1-01-55459-E	0	1 138 646,00	0,00	Расчётная цена
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					381 387 871,31	

### 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)	3 606 992,49
Итого средств на специальных брокерских счетах	3 606 992,49

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	307 400,00
ПАО "ВымпелКом"	4-02-00027-A	81 598,83
ПАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-04-40155-F	1 227 150,00
"Ладья-Финанс" ООО	4B02-02-36261-R	2 354 829,60
Межтопэнергобанк	40102956B	176 915,50
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	890 000,00
ОАО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	890 000,00
ОАО "ММК"	4-19-00078-A	1 124 700,00
ПАО "МОЭСК"	4B02-03-65116-D	1 313 600,00
ПАО "МТС"	4-07-04715-A	486 400,00
ПАО "Газпром нефть"	4-08-00146-A	1 388 000,00
ОАО "МРСК Урала"	4B02-01-32501-D	886 000,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	683 700,00
ОАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	705 600,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	604 500,00
ООО "Лента"	4-03-36420-R	497 250,00

ООО "Правоурмийское"	4-01-36417-R	191 180,48
Минфин	25077RMFS	1 794 100,00
Минфин	26203RMFS	1 538 900,00
ПАО "ВымпелКом"	4-01-00027-A	1 027 343,48
ПАО "Группа Черкизово"	4B02-04-10797-A	402 777,90
ПАО "Магнит"	4-01-60525-P	745 250,00
Российские железные дороги	4-15-65045-D	55 750,00
ПАО "Ростелеком"	4-65-00124-A	1 392 800,00
ПАО "РусГидро"	4-07-55038-E	163 000,00
ПАО "РусГидро"	4-01-55038-E	640 000,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	335 600,00
"Дельта-Финанс" ООО	4B02-01-00120-R	1 061 519,40
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		22 965 865,19

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	26 572 857,68

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

**1 472 821 348,62 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			
Исходящий рег. номер	VTB00109-142472F025		
Дата и время отправки	12.01.2016 12:23:23	Дата и время приёма	12.01.2016 12:23:23
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 12.01.2016 7:19:19 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Малков Владимир Александрович дата и время ЭП 11.01.2016 11:37:23 UTC [00109-8] Электронная подпись верна		