

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 31/12/14 г.**

**Пенсионный Фонд России, 7706016118/770601001**

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7722270922/770301001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08/10/03 №22-03У048

Дата и время составления расчёта: 12/01/15 20:49:23

**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
Банк ВТБ 24 (публичное акционерное общество)	07.08.2012	ДА0173/1	40701810300000010173	10 824 865,13
Акционерный коммерческий банк "Банк Москвы" (открытое акционерное общество)	28.07.2003	31-076/01/278	40701810600760000051	2 151,77
Итого денежных средств на счетах				10 827 016,90

**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
ВТБ 24 (ПАО) г.Москва	09.09.2014	001v/2014	42005810465200000014	75 000 000,00	2 209 315,07
ОАО "БАНК МОСКВЫ" г.Москва	28.08.2014	69-191/07/114-14	42005810701410000001	75 000 000,00	2 547 945,21
ОАО "СБЕРБАНК РОССИИ" Г. МОСКВА	24.12.2014	017640208	42005810938040000290	500 000 000,00	2 039 178,08
ОАО "СБЕРБАНК РОССИИ" Г. МОСКВА	24.12.2014	017640214	42003810938040000946	500 000 000,00	2 367 123,29
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				1 159 163 561,65	

**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
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				0,00	

#### 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
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34006KNA0	649,18	165 622	107 518 489,96	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Нижегородской области"	RU34008NJK0	930,6	14 807	13 779 394,20	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Нижегородской области"	RU34009NJK0	811,8	350 703	284 700 695,40	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Новосибирской области"	RU34015ANO0	951,21929289	45 820	43 584 868,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Самарской области"	RU35008SAM0	299,70956611	13 160	3 944 177,89	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Самарской области"	RU35010SAM0	937,8	128 001	120 039 337,80	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Томской области"	RU34048TMS0	997,2	249 911	249 211 249,20	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Ханты-Мансийского АО"	RU34001HMN0	960	89 900	86 304 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Ярославской области"	RU34012YRS0	922,9	69 999	64 602 077,10	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Министерство Финансов Республики Коми"	RU32010KOM0	593,4	45 000	26 703 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Министерство Финансов Республики Коми"	RU35011KOM0	960	163 996	157 436 160,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34008KNA0	875,3	30 000	26 259 000,00	Средняя цена

Гос. облигации и субъектов РФ	"Министерство финансов Республики Саха (Якутия)"	RU35006RSY0	959,9	10 600	10 174 940,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Белгородской области"	RU34006BEL0	471,1	32 941	15 518 505,10	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Белгородской области"	RU35007BEL0	895,5	46 865	41 967 607,50	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Белгородской области"	RU35008BEL0	905,7	63 907	57 880 569,90	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Вологодской области"	RU34002VLG0	477,45	73 751	35 212 414,95	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Вологодской области"	RU34003VLG0	766,4	67 916	52 050 822,40	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Воронежской области"	RU34006VRO0	895,185	90 000	80 566 650,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство г.Москвы"	RU32048MOS0	609,4	45 000	27 423 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство г.Москвы"	RU32056MOS0	890,3	1 726	1 536 657,80	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Республики Башкортостан"	RU34007BAS0	668,5	15 377	10 279 524,50	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34009KNA0	901,4	28 157	25 380 719,80	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Правительство Свердловской области"	RU34001SVS0	398,71938628	34 853	13 896 566,77	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Республика Карелия"	RU34014KAR0	342,37	224	76 690,88	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Республика Карелия"	RU34015KAR0	761,92	40 000	30 476 800,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Марий Эл	RU34006MAR0	386,2	93 776	36 216 291,20	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	министерство финансов Ставропольского края	RU34002STV0	760	37 350	28 386 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	845,19	23 315	19 705 604,85	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Омской области	RU34001OMS0	681,38	20 000	13 627 600,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Омской области	RU34002OMS0	999,4	5 700	5 696 580,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	847,6	24 948	21 145 924,80	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34016ANO0	965,8	34 700	33 513 260,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34007LIP0	609,24	5 550	3 381 282,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство республики Хакасия	RU35003HAK0	890,9	69 160	61 614 644,00	Средняя цена

Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство республики Хакасия	RU35004HAK0	974,4	10 000	9 744 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34009LIP0	919,5	85 500	78 617 250,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU35008LIP0	883,8	100 306	88 650 442,80	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Волгоградской области"	RU34005VLO0	470,1	50	23 505,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Волгоградской области"	RU35002VLO0	506,66	66 104	33 492 252,64	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	"Администрация Волгоградской области"	RU35005VLO0	941,1	21 200	19 951 320,00	Средняя цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					2 040 289 876,44	

### 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
"Администрация Муниципального Образования Город Краснодар"	RU34002KRA1	242,57500106	4 699	1 139 859,93	Средняя цена
"Мэрия г. Новосибирска"	RU34005NSB1	683,76	33 450	22 871 772,00	Средняя цена
"Мэрия г. Новосибирска"	RU35006NSB1	781,06500034	14 575	11 384 022,38	Средняя цена
Администрация г. Волгограда	RU34005VGG1	398,28	968	385 535,04	Средняя цена
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				35 781 189,35	

### 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
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4-21-00739-A	740,8	30 000	22 224 000,00	Средняя цена
"Газпром нефть" ОАО	4-12-00146-A	844,1	93 589	78 998 474,90	Средняя цена
"Газпром" ОАО	4B02-21-00028-A	979,7	76 029	74 485 611,30	Средняя цена
"Газпромбанк" ОАО	40700354B	939,6	600	563 760,00	Средняя цена
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-01-40155-F	960	37 955	36 436 800,00	Средняя цена
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-02-40155-F	924,7	3 863	3 572 116,10	Средняя цена
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-04-40155-F	951,9	12 496	11 894 942,40	Средняя цена
"ИК 5 Финанс" ООО	4B02-02-36241-R	872,3	147 365	128 546 489,50	Средняя цена
"ИК 5 Финанс" ООО	4B02-03-36241-R	937,9	600	562 740,00	Средняя цена
"Мобильные ТелеСистемы" ОАО	4-08-04715-A	963,2	3 311	3 189 155,20	Средняя цена
"НК "Роснефть" ОАО	4-05-00122-A	914,3	20 000	18 286 000,00	Средняя цена
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4B02-02-00739-A	950,9	74 145	70 504 480,50	Средняя цена
"НК "Роснефть" ОАО	4-07-00122-A	943,6	4 000	3 774 400,00	Средняя цена
"НК "Роснефть" ОАО	4-08-00122-A	881	106 996	94 263 476,00	Средняя цена
"Новолипецкий металлургический комбинат" ОАО	4B02-13-00102-A	940	9 925	9 329 500,00	Средняя цена
"Российские Железные Дороги" ОАО	4-12-65045-D	862,8	10 000	8 628 000,00	Средняя цена

"Российские Железные Дороги" ОАО	4-30-65045-D	850,4	124 020	105 466 608,00	Средняя цена
"Российский Банк поддержки малого и среднего предпринимательства", ОАО	4B020303340B	948,7	16 000	15 179 200,00	Средняя цена
"Российский Банк поддержки малого и среднего предпринимательства", ОАО	4B020403340B	944	39 500	37 288 000,00	Средняя цена
"Силовые машины" ОАО	4-02-35909-H	937,5	46 099	43 217 812,50	Средняя цена
"Транснефть" ОАО АК	4B02-03-00206-A	970,1	61 124	59 296 392,40	Средняя цена
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-13-65018-D	777,7	165 300	128 553 810,00	Средняя цена
"АК "Трансаэро" ОАО	4B02-01-00165-A	929,3	4 560	4 237 608,00	Средняя цена
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-19-65018-D	743,2	9 000	6 688 800,00	Средняя цена
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-21-65018-D	949,5	89 379	84 865 360,50	Средняя цена
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-25-65018-D	940	1	940,00	Средняя цена
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-01-25642-H	980	3 000	2 940 000,00	Средняя цена
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-03-25642-H	943,8	876	826 768,80	Средняя цена
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-06-25642-H	978,3	36 599	35 804 801,70	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020401326B	934,8	41 600	38 887 680,00	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020701326B	970	27 991	27 151 270,00	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020901326B	910,2	125 471	114 203 704,20	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021001326B	920,3	17 513	16 117 213,90	Средняя цена
"АНК "Башнефть" ОАО	4-02-00013-A	835,7	58	48 470,60	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021101326B	955,9	41 128	39 314 255,20	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021301326B	918	14 550	13 356 900,00	Средняя цена
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021401326B	933,6	33 395	31 177 572,00	Средняя цена
Банк "Финансовая корпорация Открытие", ОАО (Прежнее название "НОМОС-БАНК" ОАО)	4B020402209B	980,4	3 200	3 137 280,00	Средняя цена
Банк Интеза ЗАО	40302216B	986,4	43	42 415,20	Средняя цена
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020202289B	967,1	17 096	16 533 541,60	Средняя цена
Газпромбанк ОАО	4B021000354B	950,1	32 550	30 925 755,00	Средняя цена
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-04-55234-E	954,5	52 202	49 826 809,00	Средняя цена
ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	936,9	306 227	286 904 076,30	Средняя цена
Коммерческий банк "Центр-Инвест", ОАО	4B020202225B	994,9	70 600	70 239 940,00	Средняя цена
"Вертолеты России" ОАО	4B02-02-12310-A	900	89 766	80 789 400,00	Средняя цена
Кредит Европа Банк	4B020503311B	974,5	23 200	22 608 400,00	Средняя цена
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B020601978B	929,4	21 000	19 517 400,00	Средняя цена
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B020701978B	917,5	31 605	28 997 587,50	Средняя цена
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B021101978B	974,1	21 000	20 456 100,00	Средняя цена
МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ОАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ"	40201460B	735,9	43 302	31 865 941,80	Средняя цена
ОАО "Вертолеты России"	4-01-12310-A	960,9	74 853	71 926 247,70	Средняя цена
ОАО "Вертолеты России"	4-02-12310-A	951,1	8	7 608,80	Средняя цена
ОАО "МегаФон"	4B02-04-00822-J	978	18 353	17 949 234,00	Средняя цена
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	974,5	2 009	1 957 770,50	Средняя цена
ОАО Банк ВТБ	4B024301000B	989,1	3 074	3 040 493,40	Средняя цена
"Вымпел-Коммуникации" ОАО	4-01-00027-A	987,3	25 000	24 682 500,00	Средняя цена
ООО "ВТБ Капитал Финанс"	4-11-36408-R	1 001,8	530 000	530 954 000,00	Средняя цена
ООО "ВТБ Капитал Финанс"	4-18-36408-R	1 000	150 000	150 000 000,00	Средняя цена
ООО "Мираторг Финанс"	4B02-03-36276-R	929,6	22 203	20 639 908,80	Средняя цена

ООО "Фольксваген Банк РУС"	40703500B	900	117 855	106 069 500,00	Средняя цена
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	921,6	55 400	51 056 640,00	Средняя цена
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	935,2	34 700	32 451 440,00	Средняя цена
ООО "ХК Финанс"	4-01-36426-R	988,5	327 700	323 931 450,00	Средняя цена
Промсвязьбанк ОАО	4B020603251B	933,3	10 000	9 333 000,00	Средняя цена
Райффайзен Банк ЗАО	4B020403292B	960,2	9 600	9 217 920,00	Средняя цена
Ренессанс Капитал КБ ООО	4B020203354B	915	112 600	103 029 000,00	Средняя цена
"Вымпел-Коммуникации" ОАО	4-02-00027-A	986,9	29 771	29 380 999,90	Средняя цена
РОСБАНК АКБ ОАО	4B020702272B	1 000	100 000	100 000 000,00	Средняя цена
РОСБАНК АКБ ОАО	4B020902272B	1 009,5	600	605 700,00	Средняя цена
Россельхозбанк ОАО	42003349B	894,5	141 299	126 391 955,50	Средняя цена
Русфинанс Банк ООО	41501792B	973,1	56 000	54 493 600,00	Средняя цена
Филиал ГПБ (ОАО) в г. Санкт-Петербурге	4B020600354B	976,3	18 000	17 573 400,00	Средняя цена
ЮниКредит Банк ЗАО	4B020600001B	978	1 499	1 466 022,00	Средняя цена
"Газпром капитал" ООО	4-04-36400-R	761,7	900	685 530,00	Средняя цена
"Газпром капитал" ООО	4-05-36400-R	927,7	15 648	14 516 649,60	Средняя цена
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				3 833 088 330,30	

### 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
"АЭРОФЛОТ" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00010-A	31,81	20	636,20	Средняя цена
"Волжская ТГК" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-55113-E-015D	1,06	1	1,06	Средняя цена
"ИНТЕР РАО ЕЭС" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-04-33498-E	0,66520161	496	329,94	Средняя цена
"НОВАТЭК" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-02-00268-E	436	1	436,00	Средняя цена
"Ростелеком" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00124-A	85,54	1	85,54	Средняя цена
"Татнефть" ОАО	Обыкновенные акции АО РФ	1-03-00161-A	232,1	280	64 988,00	Средняя цена
Группа ЛСР (ОАО)	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-55234-E	454	37 730	17 129 420,00	Средняя цена
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					17 195 896,74	

### 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
Закрытое акционерное общество "Сбербанк КИБ"	20 073 879,42
Итого средств на специальных брокерских счетах	20 073 879,42

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4-21-00739-A	266 100,00
"Администрация Волгоградской области"	RU35002VLO0	515 611,20
ОАО "МегаФон"	4B02-04-00822-J	204 268,89
ОАО "РусГидро"	4-01-55038-E	31 702,02
ОАО Банк ВТБ	4B024301000B	52 473,18
ООО "ВТБ Капитал Финанс"	4-11-36408-R	37 100,00
ООО "ВТБ Капитал Финанс"	4-18-36408-R	4 500,00
ООО "Мираторг Финанс"	4B02-03-36276-R	485 801,64

ООО "Фольксваген Банк РУС"	40703500B	181 496,70
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	1 320 736,00
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	816 491,00
ООО "ХК Финанс"	4-01-36426-R	888 067,00
"Администрация Волгоградской области"	RU35005VLO0	81 196,00
Правительство республики Хакасия	RU35003HAK0	716 497,60
Правительство республики Хакасия	RU35004HAK0	221 800,00
Промсвязьбанк ОАО	4B020603251B	295 900,00
Райффайзен Банк ЗАО	4B020403292B	276 192,00
Ренессанс Капитал КБ ООО	4B020203354B	5 108 662,00
РОСБАНК АКБ ОАО	4B020702272B	5 000,00
РОСБАНК АКБ ОАО	4B020902272B	30,00
Россельхозбанк ОАО	42003349B	2 195 786,46
Русфинанс Банк ООО	41501792B	1 082 480,00
Филиал ГПБ (ОАО) в г.Санкт-Петербурге	4B020600354B	377 820,00
"Администрация Муниципального Образования Город Краснодар"	RU34002KRA1	15 929,61
ЮниКредит Банк ЗАО	4B020600001B	49 092,25
"Администрация Нижегородской области"	RU34008NJK0	503 438,00
"Администрация Нижегородской области"	RU34009NJK0	11 524 100,58
"Администрация Новосибирской области"	RU34015ANO0	606 198,60
"Администрация Самарской области"	RU35008SAM0	13 686,40
"Администрация Самарской области"	RU35010SAM0	2 910 742,74
"Администрация Томской области"	RU34048TMS0	479 829,12
"Администрация Ханты-Мансийского АО"	RU34001HMN0	2 189 964,00
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4B02-02-00739-A	705 860,40
"Администрация Ярославской области"	RU34012YRS0	1 164 783,36
"АК "Трансаэро" ОАО	4B02-01-00165-A	187 416,00
"АНК "Башнефть" ОАО	4-02-00013-A	198,94
"Вертолеты России" ОАО	4B02-02-12310-A	731 592,90
"Вымпел-Коммуникации" ОАО	4-01-00027-A	642 500,00
"Вымпел-Коммуникации" ОАО	4-02-00027-A	721 946,75
"Газпром капитал" ООО	4-04-36400-R	24 570,00
"Газпром капитал" ООО	4-05-36400-R	427 190,40
"Газпром нефть" ОАО	4-12-00146-A	610 200,28
"Газпром" ОАО	4B02-21-00028-A	1 426 304,04
"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34006KNA0	1 863 247,50
"Газпромбанк" ОАО	40700354B	10 062,00
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-01-40155-F	1 026 682,75
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-02-40155-F	104 494,15
"ГМК "Норильский никель" ОАО	4B02-04-40155-F	338 016,80
"ИКС 5 Финанс" ООО	4B02-02-36241-R	3 526 444,45
"ИКС 5 Финанс" ООО	4B02-03-36241-R	9 168,00
"Министерство Финансов Республики Коми"	RU32010KOM0	102 600,00
"Министерство Финансов Республики Коми"	RU35011KOM0	1 395 605,96
"Министерство финансов Республики Саха (Якутия)"	RU35006RSY0	266 908,00
"Мобильные ТелеСистемы" ОАО	4-08-04715-A	36 950,76
"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34008KNA0	277 800,00
"Мэрия г. Новосибирска"	RU34005NSB1	321 120,00
"Мэрия г. Новосибирска"	RU35006NSB1	183 936,50
"НК "Роснефть" ОАО	4-05-00122-A	306 400,00

"НК "Роснефть" ОАО	4-07-00122-A	90 320,00
"НК "Роснефть" ОАО	4-08-00122-A	2 415 969,68
"Новолипецкий металлургический комбинат" ОАО	4B02-13-00102-A	172 893,50
"Правительство Белгородской области"	RU34006BELO	180 516,68
"Правительство Белгородской области"	RU35007BELO	607 370,40
"Правительство Белгородской области"	RU35008BELO	37 066,06
"Правительство Вологодской области"	RU34002VLG0	150 452,04
"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34009KNA0	763 054,70
"Правительство Вологодской области"	RU34003VLG0	319 205,20
"Правительство Воронежской области"	RU34006VRO0	1 278 900,00
"Правительство г.Москвы"	RU32048MOS0	172 800,00
"Правительство г.Москвы"	RU32056MOS0	33 104,68
"Правительство Республики Башкортостан"	RU34007BAS0	74 885,99
"Правительство Свердловской области"	RU34001SVS0	75 631,01
"Республика Карелия"	RU34014KAR0	669,76
"Республика Карелия"	RU34015KAR0	557 200,00
"Российские Железные Дороги" ОАО	4-12-65045-D	94 900,00
"Российские Железные Дороги" ОАО	4-30-65045-D	941 311,80
"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34007LIP0	27 084,00
"Российский Банк поддержки малого и среднего предпринимательства", ОАО	4B020303340B	126 560,00
"Российский Банк поддержки малого и среднего предпринимательства", ОАО	4B020403340B	312 445,00
"Силовые машины" ОАО	4-02-35909-H	849 143,58
"Транснефть" ОАО АК	4B02-03-00206-A	1 289 716,40
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-13-65018-D	38 019,00
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-19-65018-D	327 330,00
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-21-65018-D	1 499 779,62
"ФСК ЕЭС" ОАО	4-25-65018-D	21,68
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-01-25642-H	79 140,00
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-03-25642-H	30 975,36
"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34009LIP0	541 215,00
"Холдинговая компания "Металлоинвест" ОАО	4-06-25642-H	938 398,36
Администрация г. Волгограда	RU34005VGG1	1 277,76
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020401326B	639 392,00
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020701326B	771 991,78
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B020901326B	3 818 082,53
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021001326B	93 519,42
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021101326B	11 515,84
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021301326B	482 914,50
АЛЬФА- БАНК ОАО	4B021401326B	1 137 099,75
Банк "Финансовая корпорация Открытие", ОАО (Прежнее название "НОМОС-БАНК" ОАО)	4B020402209B	101 920,00
"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU35008LIP0	1 661 067,36
Банк Интеза ЗАО	40302216B	848,39
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020202289B	452 189,20
Газпромбанк ОАО	4B021000354B	924 745,50
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-04-55234-E	1 219 438,72
ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	1 623 003,10
Коммерческий банк "Центр-Инвест", ОАО	4B020202225B	1 499 544,00
Кредит Европа Банк	4B020503311B	436 160,00
Министерство финансов Республики Марий Эл	RU34006MAR0	805 535,84

министерство финансов Ставропольского края	RU34002STV0	370 885,50
Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	188 152,05
"Администрация Волгоградской области"	RU34005VLO0	278,00
Минфин Омской области	RU34001OMS0	234 800,00
Минфин Омской области	RU34002OMS0	136 401,00
Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	410 893,56
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B020601978B	350 070,00
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B020701978B	488 613,30
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК ОАО	4B021101978B	1 091 160,00
МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ОАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ"	40201460B	2 242 610,58
МФ и НП НСО	RU34016ANO0	899 424,00
ОАО "Вертолеты России"	4-01-12310-A	1 150 490,61
ОАО "Вертолеты России"	4-02-12310-A	122,96
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		87 140 919,68

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	107 214 799,10

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

**7 203 560 670,48 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.

Руководитель

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-88855F025		
Дата и время отправки	14/01/15 12:24:24	Дата и время приёма	14/01/15 12:29:11
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 14.01.2015 9:23:51 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 12.01.2015 18:07:59 UTC [00126-6] Электронная подпись верна		