

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2015 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 08.10.2003 №22-03У048

Дата и время составления расчёта: 11.01.2016 14:24:48

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 | DA0173/1 | 40701810300000010173 | 45 001 491,63 |
| Акционерный коммерческий банк "Банк Москвы" (открытое акционерное общество) | 28.07.2003 | 31-076/01/278 | 40701810600760000051 | 2 157,09 |
| Итого денежных средств на счетах | | | | 45 003 648,72 |

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 |
| 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 субъектов РФ | Департамент финансов Томской области | RU34048TMS0 | 759,84 | 249 911 | 189 892 374,24 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Министерство финансов Тверской области | RU34009TVE0 | 481,40987288 | 236 | 113 612,73 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Министерство финансов Тульской области | RU34003TULO | 620,88 | 22 007 | 13 663 706,16 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Министерство финансов Тульской области | RU34004TULO | 1 009,1 | 22 000 | 22 200 200,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34006KNA0 | 383,84 | 65 622 | 25 188 348,48 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34008KNA0 | 991,6 | 33 186 | 32 907 237,60 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34009KNA0 | 994,8 | 28 157 | 28 010 583,60 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34010KNA0 | 1 025,5 | 54 898 | 56 297 899,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Красноярского края | RU34011KNA0 | 1 002,1 | 16 800 | 16 835 280,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Нижегородской области | RU34008NJG0 | 783,84 | 4 310 | 3 378 350,40 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Нижегородской области | RU34009NJG0 | 776,05 | 351 703 | 272 939 113,15 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | ДФ ЯО | RU34012YRS0 | 945,6 | 70 799 | 66 947 534,40 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Омской области | RU34002OMS0 | 806 | 46 100 | 37 156 600,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Республики Коми | RU32010KOM0 | 290,4 | 45 000 | 13 068 000,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Республики Коми | RU35011KOM0 | 995 | 163 996 | 163 176 020,00 | Средняя цена |
| Гос.облигации субъектов РФ | Минфин Республики Коми | RU35012KOM0 | 1 000 | 86 996 | 86 996 000,00 | Средняя цена |

| | | | | | | |
|-------------------------------|---|-------------|-------------|---------|----------------|--------------|
| Гос. облигации и субъектов РФ | Минфин Республики Мордовия | RU34001MOR0 | 756,64 | 24 948 | 18 876 654,72 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Минфин Хакасии | RU35003HAK0 | 910,9 | 69 160 | 62 997 844,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Минфин Хакасии | RU35004HAK0 | 1 014,1 | 10 000 | 10 141 000,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | МУФ СО | RU35008SAM0 | 191,94 | 13 160 | 2 525 930,40 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | МУФ СО | RU35010SAM0 | 868,77 | 128 001 | 111 203 428,77 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | МФ и НП НСО | RU34015ANO0 | 945 | 45 820 | 43 299 900,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | ДФ ЯО | RU35013YRS0 | 970 | 6 100 | 5 917 000,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | МФ и НП НСО | RU34016ANO0 | 998,7 | 36 016 | 35 969 179,20 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Облфин | RU35002VLO0 | 290,43 | 60 993 | 17 714 196,99 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Облфин | RU35005VLO0 | 820,335 | 21 500 | 17 637 202,50 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU34006BEL0 | 188,06 | 32 941 | 6 194 884,46 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU35007BEL0 | 918 | 56 865 | 52 202 070,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Правительство Белгородской области | RU35008BEL0 | 980,2 | 75 907 | 74 404 041,40 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы | RU32048MOS0 | 803,1 | 428 215 | 343 899 466,50 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Правительство Ханты - Мансийского автономного округа-Югры | RU34001HMN0 | 1 015,2 | 93 906 | 95 333 371,20 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Управление финансов Липецкой области | RU34007LIP0 | 390 | 5 550 | 2 164 500,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Управление финансов Липецкой области | RU34009LIP0 | 880,92 | 85 500 | 75 318 660,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | ДФБП ВО | RU34006VRO0 | 845,37 | 90 000 | 76 083 300,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Управление финансов Липецкой области | RU35008LIP0 | 748,3403362 | 100 119 | 74 923 086,12 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Министерство финансов Республики Карелия | RU34015KAR0 | 392,04 | 39 990 | 15 677 679,60 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Министерство финансов Республики Карелия | RU34016KAR0 | 753,36 | 1 000 | 753 360,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации и субъектов РФ | Министерство финансов Республики Марий Эл | RU34007MAR0 | 598,86 | 501 | 300 028,86 | Средняя цена |

| | | | | | | |
|--|--|-------------|--------|--------|------------------|--------------|
| Гос. облигации субъектов РФ | Министерство финансов Республики Саха (Якутия) | RU35006RSY0 | 781,28 | 10 600 | 8 281 568,00 | Средняя цена |
| Гос. облигации субъектов РФ | Министерство финансов Ставропольского края | RU34002STV0 | 543,78 | 39 250 | 21 343 365,00 | Средняя цена |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации | | | | | 2 201 932 577,48 | |

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 |
| мэрия города Новосибирска | RU35006NSB1 | 692,1750003 | 16 575 | 11 472 800,63 | Средняя цена |
| Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций | | | | 11 472 800,63 | |

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 |
| "Мобильные ТелеСистемы" ПАО | 4B02-01-04715-A | 1 000 | 2 | 2 000,00 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-25-65018-D | 982,7 | 60 | 58 962,00 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-07-00739-A | 244,8 | 9 | 2 203,20 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-08-00739-A | 281,4 | 102 523 | 28 849 972,20 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-09-00739-A | 391,48 | 2 | 782,96 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-10-00739-A | 469,8 | 1 582 | 743 223,60 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-11-00739-A | 647,5 | 1 000 | 647 500,00 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-16-00739-A | 919,7 | 2 558 | 2 352 592,60 | Средняя цена |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-21-00739-A | 569,46 | 55 947 | 31 859 578,62 | Средняя цена |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B020501326B | 1 004,5 | 4 571 | 4 591 569,50 | Средняя цена |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B020901326B | 982,7 | 87 499 | 85 985 267,30 | Средняя цена |
| "Силовые машины" ОАО | 4B02-01-35909-H | 1 012,2 | 69 064 | 69 906 580,80 | Средняя цена |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021101326B | 985,6 | 1 444 | 1 423 206,40 | Средняя цена |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021301326B | 1 000 | 5 000 | 5 000 000,00 | Средняя цена |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021401326B | 1 003,3 | 264 047 | 264 918 355,10 | Средняя цена |
| АО "Вертолеты России" | 4B02-02-12310-A | 958,8 | 94 783 | 90 877 940,40 | Средняя цена |
| АО "МХК "ЕвроХим" | 4-02-31153-H | 1 017,8 | 196 178 | 199 669 968,40 | Средняя цена |
| АО "ПГК" | 4-01-55521-E | 1 007 | 40 000 | 40 280 000,00 | Средняя цена |
| АО "ПГК" | 4-05-55521-E | 1 013,2 | 84 000 | 85 108 800,00 | Средняя цена |
| АО "ПКТ" | 4-01-03924-J | 999,9 | 83 500 | 83 491 650,00 | Средняя цена |
| АО "Россельхозбанк" | 4B020903349B | 1 001,3 | 3 000 | 3 003 900,00 | Средняя цена |
| АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4-02-25642-H | 953,4 | 47 020 | 44 828 868,00 | Средняя цена |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------------------------|--------------|---------|----------------|--------------|
| "Силовые машины" ОАО | 4B02-02-35909-H | 1 015,6 | 35 000 | 35 546 000,00 | Средняя цена |
| АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4-03-25642-H | 952,8 | 17 981 | 17 132 296,80 | Средняя цена |
| ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ" | 4-02-17644-J | 886,70700001 | 377 894 | 335 081 255,06 | Средняя цена |
| МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ПАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ" | 40201460B | 479,5 | 43 302 | 20 763 309,00 | Средняя цена |
| ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК" | 4B020701978B | 974 | 31 605 | 30 783 270,00 | Средняя цена |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-07-00122-A | 942,2 | 8 000 | 7 537 600,00 | Средняя цена |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-08-00122-A | 937,4 | 23 641 | 22 161 073,40 | Средняя цена |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-09-00122-A | 935 | 1 000 | 935 000,00 | Средняя цена |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-10-00122-A | 939,2 | 12 500 | 11 740 000,00 | Средняя цена |
| ОАО "НЛМК" | 4B02-13-00102-A | 953,7 | 10 446 | 9 962 350,20 | Средняя цена |
| ОАО "Полюс Золото" | 4B02-01-55192-E | 1 019,1 | 318 201 | 324 278 639,10 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-06-65018-D | 861,7 | 19 938 | 17 180 574,60 | Средняя цена |
| ОАО "Полюс Золото" | 4B02-02-55192-E | 1 019 | 360 002 | 366 842 038,00 | Средняя цена |
| ОАО "РЖД" | 4-23-65045-D | 1 020,7 | 195 973 | 200 029 641,10 | Средняя цена |
| ОАО "РЖД" | 4-28-65045-D | 910,9 | 127 100 | 115 775 390,00 | Средняя цена |
| ОАО АФК "Система" | 4-03-01669-A | 974 | 8 800 | 8 571 200,00 | Средняя цена |
| ОАО АФК "Система" | 4B02-01-01669-A-001 P | 1 017,6 | 41 000 | 41 721 600,00 | Средняя цена |
| ООО "Газпром капитал" | 4-05-36400-R | 964,8 | 2 500 | 2 412 000,00 | Средняя цена |
| ООО "ДелоПортс" | 4-01-36485-R | 1 000,5 | 146 305 | 146 378 152,50 | Средняя цена |
| ООО "ЕвразХолдинг Финанс" | 4-08-36383-R | 1 014,4 | 361 998 | 367 210 771,20 | Средняя цена |
| ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4B02-02-36241-R | 984,9 | 110 765 | 109 092 448,50 | Средняя цена |
| ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4B02-03-36241-R | 982 | 2 100 | 2 062 200,00 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-08-65018-D | 914,9 | 25 831 | 23 632 781,90 | Средняя цена |
| ООО "МегаФон Финанс" | 4-06-36027-R | 942,1 | 2 106 | 1 984 062,60 | Средняя цена |
| ООО "МегаФон Финанс" | 4-07-36027-R | 940,7 | 57 890 | 54 457 123,00 | Средняя цена |
| ООО "Мираторг Финанс" | 4B02-03-36276-R | 991,8 | 19 733 | 19 571 189,40 | Средняя цена |
| ООО "Фольксваген Банк РУС" | 40803500B | 996,1 | 1 100 | 1 095 710,00 | Средняя цена |
| ООО "Фольксваген Банк РУС" | 40903500B | 994,8 | 900 | 895 320,00 | Средняя цена |
| ООО "ХК Финанс" | 4-01-36426-R | 967,8 | 327 700 | 317 148 060,00 | Средняя цена |
| ПАО "ВымпелКом" | 4-04-00027-A | 985,5 | 2 803 | 2 762 356,50 | Средняя цена |
| ПАО "ВымпелКом" | 4B02-03-00027-A | 1 008,4 | 1 000 | 1 008 400,00 | Средняя цена |
| ПАО "Газпром нефть" | 4-04-00146-A | 944,4 | 1 500 | 1 416 600,00 | Средняя цена |
| ПАО "Газпром нефть" | 4-10-00146-A | 966,3 | 30 748 | 29 711 792,40 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-11-65018-D | 949,26635237 | 12 504 | 11 869 626,47 | Средняя цена |
| ПАО "Газпром нефть" | 4-12-00146-A | 961,7 | 95 589 | 91 927 941,30 | Средняя цена |
| ПАО "Группа ЛСР" | 4B02-04-55234-E | 331,62860003 | 52 794 | 17 508 000,31 | Средняя цена |
| ПАО "Магнит" | 4B02-11-60525-P | 1 005,2 | 2 000 | 2 010 400,00 | Средняя цена |
| ПАО "МегаФон" | 4B02-05-00822-J | 1 006,4 | 38 988 | 39 237 523,20 | Средняя цена |
| ПАО "ОГК-2" | 4B02-01-65105-D-001 P | 1 002,7 | 10 500 | 10 528 350,00 | Средняя цена |
| ПАО "ОГК-2" | 4B02-02-65105-D-001 P | 1 002,5 | 60 000 | 60 150 000,00 | Средняя цена |
| ПАО "Ростелеком" | 4-65-00124-A | 960 | 136 | 130 560,00 | Средняя цена |
| ПАО "Ростелеком" | 4-67-00124-A | 964,5 | 1 001 | 965 464,50 | Средняя цена |
| ПАО "Ростелеком" | 4B02-01-00124-A | 1 009,5 | 490 | 494 655,00 | Средняя цена |
| ПАО "РусГидро" | 4-08-55038-E | 947,5 | 31 024 | 29 395 240,00 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-13-65018-D | 898,4 | 184 416 | 165 679 334,40 | Средняя цена |
| ПАО "РусГидро" | 4-09-55038-E | 1 029,5 | 109 870 | 113 111 165,00 | Средняя цена |
| ПАО "ТрансКонтейнер" | 4-04-55194-E | 960 | 700 | 672 000,00 | Средняя цена |
| ПАО "Энел Россия" | 4B02-06-50077-A | 1 005 | 50 000 | 50 250 000,00 | Средняя цена |

| | | | | | |
|---|--------------|--------------|---------|------------------|--------------|
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-01-00013-A | 977,5 | 10 | 9 775,00 | Средняя цена |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-02-00013-A | 970,8 | 59 | 57 277,20 | Средняя цена |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-06-00013-A | 955,1 | 6 001 | 5 731 555,10 | Средняя цена |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-07-00013-A | 927 | 290 169 | 268 986 663,00 | Средняя цена |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-08-00013-A | 954 | 85 679 | 81 737 766,00 | Средняя цена |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-09-00013-A | 927 | 128 092 | 118 741 284,00 | Средняя цена |
| ПАО РОСБАНК | 4B020702272B | 1 000 | 100 000 | 100 000 000,00 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-18-65018-D | 899,84594188 | 3 992 | 3 592 185,00 | Средняя цена |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-19-65018-D | 934,4 | 10 001 | 9 344 934,40 | Средняя цена |
| Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ | | | | 4 872 614 826,22 | |

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 "НОВАТЭК" | Обыкновенные акции АО РФ | 1-02-00268-E | 595,4 | 1 | 595,40 | Средняя цена |
| ПАО "Аэрофлот" | Обыкновенные акции АО РФ | 1-01-00010-A | 56,1 | 20 | 1 122,00 | Средняя цена |
| ПАО "Интер РАО" | Обыкновенные акции АО РФ | 1-04-33498-E | 1,0925 | 496 | 541,88 | Средняя цена |
| ПАО "Ростелеком" | Обыкновенные акции АО РФ | 1-01-00124-A | 91,24 | 1 | 91,24 | Средняя цена |
| ПАО "Т Плюс" | Обыкновенные акции АО РФ | 1-01-55113-E | 0,51 | 1 | 0,51 | Средняя цена |
| Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ | | | | | 2 351,03 | |

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" | 75 941 331,50 |
| Итого средств на специальных брокерских счетах | 75 941 331,50 |

| Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | |
|---|---|--|
| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
| 1 | 2 | 3 |
| "Мобильные ТелеСистемы" ПАО | 4B02-01-04715-A | 41,58 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-25-65018-D | 1 314,60 |
| ПАО "Ростелеком" | 4-67-00124-A | 34 854,82 |
| ПАО "Ростелеком" | 4B02-01-00124-A | 5 341,00 |
| ПАО "РусГидро" | 4-08-55038-E | 1 011 382,40 |
| ПАО "РусГидро" | 4-09-55038-E | 2 495 147,70 |
| ПАО "ТрансКонтейнер" | 4-04-55194-E | 24 500,00 |
| ПАО "Энел Россия" | 4B02-06-50077-A | 464 000,00 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-01-00013-A | 36,60 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-02-00013-A | 215,94 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-06-00013-A | 201 933,65 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-07-00013-A | 9 990 518,67 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-07-00739-A | 36,45 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-08-00013-A | 2 883 098,35 |
| ПАО АНК "Башнефть" | 4-09-00013-A | 4 410 207,56 |
| ПАО РОСБАНК | 4B020702272B | 5 000,00 |

| | | |
|---|-----------------|--------------|
| Правительство Белгородской области | RU34006BEL0 | 64 564,36 |
| Правительство Белгородской области | RU35007BEL0 | 750 049,35 |
| Правительство Белгородской области | RU35008BEL0 | 66 798,16 |
| Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы | RU32048MOS0 | 1 644 345,60 |
| Правительство Ханты - Мансийского автономного округа-Югры | RU34001HMN0 | 2 170 167,66 |
| Управление финансов Липецкой области | RU34007LIP0 | 18 592,50 |
| Управление финансов Липецкой области | RU34009LIP0 | 508 725,00 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-08-00739-A | 102 523,00 |
| Управление финансов Липецкой области | RU35008LIP0 | 1 108 317,33 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-09-00739-A | 7,56 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-10-00739-A | 8 020,74 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-11-00739-A | 2 520,00 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-16-00739-A | 9 259,96 |
| АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" | 4-21-00739-A | 372 047,55 |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B020501326B | 108 195,57 |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B020901326B | 2 662 594,57 |
| "Силовые машины" ОАО | 4B02-01-35909-H | 1 489 710,48 |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021101326B | 404,32 |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021301326B | 167 550,00 |
| АО "АЛЬФА-БАНК" | 4B021401326B | 9 077 935,86 |
| АО "Вертолеты России" | 4B02-02-12310-A | 795 229,37 |
| АО "МХК "ЕвроХим" | 4-02-31153-H | 133 401,04 |
| АО "ПГК" | 4-01-55521-E | 1 294 400,00 |
| АО "ПГК" | 4-05-55521-E | 2 250 360,00 |
| АО "ПКТ" | 4-01-03924-J | 269 705,00 |
| АО "Россельхозбанк" | 4B020903349B | 59 610,00 |
| АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4-02-25642-H | 1 673 912,00 |
| "Силовые машины" ОАО | 4B02-02-35909-H | 754 950,00 |
| АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ" | 4-03-25642-H | 640 123,60 |
| Департамент финансов Томской области | RU34048TMS0 | 432 346,03 |
| ДФ ЯО | RU34012YRS0 | 1 157 563,65 |
| ДФ ЯО | RU35013YRS0 | 3 416,00 |
| ДФБП ВО | RU34006VRO0 | 1 173 600,00 |
| ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ" | 4-02-17644-J | 1 900 806,82 |
| Министерство финансов Республики Карелия | RU34015KAR0 | 279 130,20 |
| Министерство финансов Республики Карелия | RU34016KAR0 | 11 070,00 |
| Министерство финансов Республики Марий Эл | RU34007MAR0 | 836,67 |
| Министерство финансов Республики Саха (Якутия) | RU35006RSY0 | 2 332,00 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-06-65018-D | 450 598,80 |
| Министерство финансов Ставропольского края | RU34002STV0 | 297 515,00 |
| Министерство финансов Тверской области | RU34009TVE0 | 1 109,20 |
| Министерство финансов Тульской области | RU34003TUL0 | 131 381,79 |
| Министерство финансов Тульской области | RU34004TUL0 | 529 540,00 |
| Минфин Красноярского края | RU34006KNA0 | 415 387,26 |
| Минфин Красноярского края | RU34008KNA0 | 198 120,42 |
| Минфин Красноярского края | RU34009KNA0 | 771 783,37 |

| | | |
|--------------------------------------|----------------------|---------------|
| Минфин Красноярского края | RU34010KNA0 | 2 043 852,54 |
| Минфин Красноярского края | RU34011KNA0 | 312 312,00 |
| Минфин Нижегородской области | RU34008NJK0 | 115 766,60 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-08-65018-D | 583 780,60 |
| Минфин Нижегородской области | RU34009NJK0 | 9 372 884,95 |
| Минфин Омской области | RU34002OMS0 | 894 801,00 |
| Минфин Республики Коми | RU32010KOM0 | 49 950,00 |
| Минфин Республики Коми | RU35011KOM0 | 1 434 965,00 |
| Минфин Республики Коми | RU35012KOM0 | 5 233 679,36 |
| Минфин Республики Мордовия | RU34001MOR0 | 333 804,24 |
| Минфин Хакасии | RU35003HAK0 | 732 404,40 |
| Минфин Хакасии | RU35004HAK0 | 225 300,00 |
| МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ПАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ" | 40201460B | 2 258 632,32 |
| МУФ СО | RU35008SAM0 | 9 738,40 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-11-65018-D | 188 810,40 |
| МУФ СО | RU35010SAM0 | 2 650 900,71 |
| МФ и НП НСО | RU34015ANO0 | 616 279,00 |
| МФ и НП НСО | RU34016ANO0 | 843 494,72 |
| мэрия города Новосибирска | RU35006NSB1 | 188 623,50 |
| ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК" | 4B020701978B | 488 613,30 |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-07-00122-A | 182 320,00 |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-08-00122-A | 538 778,39 |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-09-00122-A | 5 010,00 |
| ОАО "НК "Роснефть" | 4-10-00122-A | 62 625,00 |
| ОАО "НЛМК" | 4B02-13-00102-A | 184 267,44 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-13-65018-D | 86 675,52 |
| ОАО "Полюс Золото" | 4B02-01-55192-E | 17 720 613,69 |
| ОАО "Полюс Золото" | 4B02-02-55192-E | 20 048 511,38 |
| ОАО "РЖД" | 4-23-65045-D | 9 716 341,34 |
| ОАО "РЖД" | 4-28-65045-D | 2 455 572,00 |
| ОАО АФК "Система" | 4-03-01669-A | 73 832,00 |
| ОАО АФК "Система" | 4B02-01-01669-A-001P | 1 109 050,00 |
| Облфин | RU35002VLO0 | 256 170,60 |
| Облфин | RU35005VLO0 | 73 530,00 |
| ООО "Газпром капитал" | 4-05-36400-R | 68 775,00 |
| ООО "ДелоПортс" | 4-01-36485-R | 1 880 019,25 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-18-65018-D | 22 315,28 |
| ООО "ЕвразХолдинг Финанс" | 4-08-36383-R | 126 699,30 |
| ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4B02-02-36241-R | 2 678 297,70 |
| ООО "ИКС 5 ФИНАНС" | 4B02-03-36241-R | 32 592,00 |
| ООО "МегаФон Финанс" | 4-06-36027-R | 52 165,62 |
| ООО "МегаФон Финанс" | 4-07-36027-R | 1 433 935,30 |
| ООО "Мираторг Финанс" | 4B02-03-36276-R | 437 875,27 |
| ООО "Фольксваген Банк РУС" | 40803500B | 25 883,00 |
| ООО "Фольксваген Банк РУС" | 40903500B | 20 898,00 |
| ООО "ХК Финанс" | 4-01-36426-R | 888 067,00 |
| ПАО "ВымпелКом" | 4-04-00027-A | 82 183,96 |
| "ФСК ЕЭС" ПАО | 4-19-65018-D | 365 936,59 |
| ПАО "ВымпелКом" | 4B02-03-00027-A | 24 780,00 |
| ПАО "Газпром нефть" | 4-04-00146-A | 26 625,00 |

| | | |
|---|----------------------|----------------|
| ПАО "Газпром нефть" | 4-10-00146-A | 1 117 074,84 |
| ПАО "Газпром нефть" | 4-12-00146-A | 645 225,75 |
| ПАО "Группа ЛСР" | 4B02-04-55234-E | 416 544,66 |
| ПАО "Магнит" | 4B02-11-60525-P | 46 160,00 |
| ПАО "МегаФон" | 4B02-05-00822-J | 840 191,40 |
| ПАО "ОГК-2" | 4B02-01-65105-D-001P | 122 430,00 |
| ПАО "ОГК-2" | 4B02-02-65105-D-001P | 699 600,00 |
| ПАО "Ростелеком" | 4-65-00124-A | 4 735,52 |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | 150 639 087,95 |

| Прочая дебиторская задолженность | |
|--|--|
| Наименование дебиторской задолженности | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
| 1 | 2 |
| Итого прочая дебиторская задолженность | 0,00 |
| Итого дебиторская задолженность (руб.) | 226 580 419,45 |

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

7 357 606 623,53 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 | VTB00126-103734F025 | | |
| Дата и время отправки | 13.01.2016 9:27:27 | Дата и время приёма | 13.01.2016 9:28:31 |
| Подписано | 1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 13.01.2016 6:26:06 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 11.01.2016 11:38:01 UTC [00126-7] Электронная подпись верна | | |