

АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ

о годовой бухгалтерской и специальной отчетности Общества с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений за 2015 год

Адресат

Генеральному директору, акционерам, иным лицам Общества с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений

СВЕДЕНИЯ ОБ АУДИРУЕМОМ ЛИЦЕ

Наименование

Обществ с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв доверительный управляющий средствами пенсионных накоплений
(ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений)

Государственный
регистрационный
номер Управляющей
компании

1027722009941

Место нахождения

123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10

Лицензии

Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами №21-000-1-00008 от 07.02.2003, выдана ФСФР РФ без ограничения срока действия

Договор
доверительного
управления

№ 22-03У048 от 08.10.2003

СВЕДЕНИЯ ОБ АУДИТОРЕ

Наименование Закрытое акционерное общество Аудиторская компания
 «Арт-Аудит» (ЗАО АК «Арт-Аудит»)

Государственный 1024101025134
регистрационный
номер

Место нахождения 123007, г. Москва, Хорошевское шоссе, 32А

Наименование Саморегулируемая организация аудиторов «Аудиторская
СРО Палата России» (Ассоциация)

Номер в реестре ОРНЗ 10201011614

Мы провели аудит прилагаемой годовой бухгалтерской и специальной отчетности Общества с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений, по договору доверительного управления средствами пенсионных накоплений с Пенсионным фондом Российской Федерации № 22-03У048 от 08.10.2003 состоящей из:

- бухгалтерского баланса по состоянию на 31.12.2015;
- отчета о финансовых результатах за 2015 год;
- пояснений к годовой бухгалтерской отчетности;
- расчета стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений по состоянию на 31.12.2015;
- расчета рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений по состоянию на 31.12.2015;
- отчета о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений за 1, 2, 3, 4 кварталы 2015 года;
- отчета об инвестировании средств пенсионных накоплений за 1, 2, 3, 4 кварталы 2015 года.

Аудит проводился в отношении годовой бухгалтерской и специальной отчетности, составленной в соответствии с требованиями:

- Федерального закона «О бухгалтерском учете» от 06.12.2011 г. № 402-ФЗ;
- Федерального закона «Об инвестировании средств для финансирования накопительной части трудовой пенсии в Российской Федерации» от 26.02.2002 № 111-ФЗ;
- Приказа ФСФР от 15.11.2005 г. № 05-63/пз-н «Об утверждении форм отчетности управляющих компаний, осуществляющих доверительное управление средствами пенсионных накоплений»;
- Приказа ФСФР от 26.12.2006 г. № 06-155/пз-н «Об утверждении порядка расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений».

Ответственность аудируемого лица за годовую бухгалтерскую и специальную отчетность

Ответственность за составление и достоверность указанной отчетности в соответствии с российскими правилами составления годовой бухгалтерской и специальной отчетности и за систему внутреннего контроля, необходимую для составления годовой бухгалтерской и специальной отчетности, не содержащей существенных искажений вследствие недобросовестных действий или ошибок, несет Руководство управляющей компании.

Ответственность аудитора

Наша ответственность заключается в выражении мнения о достоверности годовой бухгалтерской и специальной отчетности на основе проведенного нами аудита. Мы проводили аудит в соответствии с федеральными стандартами аудиторской деятельности. Данные стандарты требуют соблюдения применимых этических норм, а также планирования и проведения аудита таким образом, чтобы получить достаточную уверенность в том, что годовая бухгалтерская и специальная отчетность не содержит существенных искажений.

Аудит включал проведение аудиторских процедур, направленных на получение аудиторских доказательств, подтверждающих числовые показатели в годовой бухгалтерской и специальной отчетности и раскрытие в ней информации. Выбор аудиторских процедур является предметом нашего суждения, которое основывается на оценке риска существенных искажений, допущенных вследствие недобросовестных действий или ошибок. В процессе оценки данного риска нами рассмотрена система внутреннего контроля, обеспечивающая составление и достоверность годовой бухгалтерской и специальной отчетности, с целью выбора соответствующих аудиторских процедур, но не с целью выражения мнения об эффективности системы внутреннего контроля.

Аудит также включал оценку надлежащего характера применяемой учетной политики и правил определения стоимости активов и величины обязательств и обоснованности оценочных показателей, полученных руководством аудируемого лица, а также оценку представления годовой бухгалтерской и специальной отчетности в целом.

Мы полагаем, что полученные в ходе аудита аудиторские доказательства дают достаточные основания для выражения мнения о достоверности годовой бухгалтерской и специальной отчетности.

Мнение

По нашему мнению, годовая бухгалтерская и специальная отчетность Общества с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений по договору доверительного управления средствами пенсионных накоплений с Пенсионным фондом Российской Федерации № 22-03У048 от 08.10.2003 отражает достоверно во всех существенных отношениях его финансовое положение на 31 декабря 2015 года, результаты его финансово-хозяйственной деятельности и движение денежных средств за период с 01 января по 31 декабря 2015 года в соответствии с российскими правилами составления годовой бухгалтерской и специальной отчетности.

Руководитель департамента аудита
инвестиционных предприятий, бирж,
внебюджетных фондов

(по доверенности № 8 от 28.01.2016)

квалификационный аттестат аудитора № 01-000277,
выдан на основании решения Саморегулируемой
организации аудиторов Некоммерческого партнерства
«Аудиторская Палата России» от 12.12.2011 Приказ № 31,
на неограниченный срок.



И.В. Нестерова

«28» марта 2016 г.

Приложение № 1
к Приказу Министерства финансов
Российской Федерации
от 02.07.2010 № 66н
(в ред. Приказа Минфина РФ
от 05.10.2011 № 124н)

Бухгалтерский баланс
на 31 декабря 20 15 г.

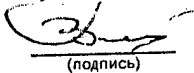
Организация <u>ООО ВТБ Капитал Пенсионный Резерв Д.У. средствами</u>	Форма по ОКУД	Коды	
<u>пенсионных накоплений</u>	Дата (число, месяц, год)	0710001	
Идентификационный номер налогоплательщика	31 12 2015	59700276	
ИНН	по ОКПО	7722270922/771001001	
Вид экономической деятельности <u>Доверительное управление</u>	по ОКВЭД	67.12.2	
Организационно-правовая форма/форма собственности <u>ООО</u>	по ОКОПФ/ОКФС	65 16	
Единица измерения: тыс. руб.	по ОКЕИ	384	
Местонахождение (адрес организации) <u>123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10</u>			

Наименование показателя ²		На 31 декабря 20 15 г. ³	На 31 декабря 20 14 г. ⁴	На 31 декабря 20 13 г. ⁵
АКТИВ				
I. ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
Нематериальные активы	1110			
Результаты исследований и разработок	1120			
Нематериальные поисковые активы	1130			
Материальные поисковые активы	1140			
Основные средства	1150			
Доходные вложения в материальные ценности	1160			
Финансовые вложения	1170			
Отложенные налоговые активы	1180			
Прочие внеоборотные активы	1190			
Итого по разделу I	1100			
II. ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
Запасы	1210			
Налог на добавленную стоимость по приобретенным ценностям	1220			
Дебиторская задолженность	1230	150 639	96 304	172 128
Финансовые вложения (за исключением денежных эквивалентов)	1240	7 086 023	7 076 355	6 958 838
Денежные средства и денежные эквиваленты	1250	120 945	30 901	15 303
Прочие оборотные активы	1260			
Итого по разделу II	1200	7 357 607	7 203 560	7 146 269
БАЛАНС	1600	7 357 607	7 203 560	7 146 269

Форма 0710001 с. 2

Наименование показателя ²		На 31 декабря 20 15 г. ³	На 31 декабря 20 14 г. ⁴	На 31 декабря 20 13 г. ⁵
ПАССИВ				
III. КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ⁶				
Уставный капитал (складочный капитал, уставный фонд, вклады товарищей)	1310			
Собственные акции, выкупленные у акционеров	1320	() ⁷	()	()
Переоценка внеоборотных активов	1340			
Добавочный капитал (без переоценки)	1350			
Резервный капитал	1360			
Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)	1370			
Итого по разделу III	1300			
IV. ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
Заемные средства	1410			
Отложенные налоговые обязательства	1420			
Оценочные обязательства	1430			
Прочие обязательства	1450	7 228 671	7 187 533	7 094 944
Итого по разделу IV	1400	7 228 671	7 187 533	7 094 944
V. КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
Заемные средства	1510			
Кредиторская задолженность	1520	128 936	16 027	51 325
Доходы будущих периодов	1530			
Оценочные обязательства	1540			
Прочие обязательства	1550			
Итого по разделу V	1500	128 936	16 027	51 325
БАЛАНС	1700	7 357 607	7 203 560	7 146 269

Руководитель



Волгин О.Н.

(расшифровка подписи)

29 января 20 16 г.



Отчет о финансовых результатах
за период с 01 января по 31 декабря 20 15 г.

Форма по ОКУД
Дата (число, месяц, год)

ООО ВТБ Капитал Пенсионный Резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений

Организация _____ по ОКПО
Идентификационный номер налогоплательщика _____ ИНН
Вид экономической деятельности _____ по ОКВЭД
Организационно-правовая форма/форма собственности _____ по ОКОПФ/ОКФС
_____ частная _____ по ОКЕИ

Единица измерения: тыс. руб

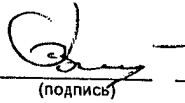
Коды		
0710002		
31	12	2015
59700276		
7722270922		
67.12.2		
65		16
384		

Пояснения	Наименование показателя	Код	За январь-декабрь 20 <u>15</u> г.	За январь-декабрь 20 <u>14</u> г.
	Выручка	2110	4 635 570	3 737 280
	Себестоимость продаж	2120	(4 682 171)	(3 765 026)
	Валовая прибыль (убыток)	2100	(46 601)	(27 746)
	Коммерческие расходы	2210		
	Управленческие расходы	2220		
	Прибыль (убыток) от продаж	2200	(46 601)	(27 746)
	Доходы от участия в других организациях	2310		9 865
	Проценты к получению	2320	263 927	192 638
	Проценты к уплате	2330		
	Прочие доходы	2340	1 210 631	480 417
	Прочие расходы	2350	(274 066)	(517 116)
	Прибыль (убыток) до налогообложения	2300	1 153 891	138 058
	Текущий налог на прибыль	2410		
	в т.ч. постоянные налоговые обязательства (активы)	2421		
	Изменение отложенных налоговых обязательств	2430		
	Изменение отложенных налоговых активов	2450		
	Прочее	2460		
	Чистая прибыль (убыток)	2400	1 153 891	138 058

Форма 0710002 с. 2

Пояснения	Наименование показателя	Код	За январь-декабрь 20 <u>15</u> г.	За январь-декабрь 20 <u>14</u> г.
	СПРАВОЧНО			
	Результат от переоценки внеоборотных активов, не включаемый в чистую прибыль (убыток) периода	2510		
	Результат от прочих операций, не включаемый в чистую прибыль (убыток) периода	2520		
	Совокупный финансовый результат периода	2500	1 153 891	138 058
	Базовая прибыль (убыток) на акцию	2900		
	Разводненная прибыль (убыток) на акцию	2910		

Руководитель

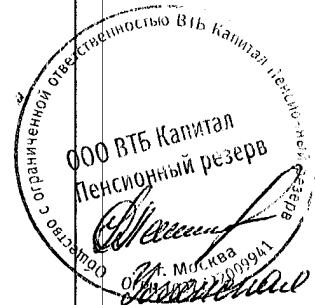
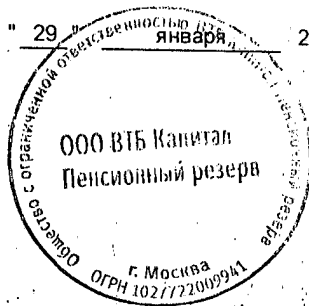


(подпись)

Волгин О.Н.

(расшифровка подписи)

" 29 " января 20 16 г.



Пояснения
к годовому бухгалтерскому отчету
в отношении доверительного управления средств пенсионных
накоплений
за 2015 год

1. Общие сведения об организации

Наименование компании: ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв (далее – Общество).

1.1. Сведения о государственной регистрации

1.1.1. Свидетельство о государственной регистрации:

Основной государственный регистрационный номер: 1027722009941

Дата регистрации (внесения записи): 24 октября 2002 года.

Наименование регистрирующего органа: Межрайонная инспекция Федеральной налоговой службы № 22 по ЮВАО г. Москвы.

1.1.3. Идентификационный номер налогоплательщика 7722270922.

1.1.4. Код причины постановки на учет 770301001.

1.2. Сведения о наличии лицензий

Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами:

Номер: 21-000-1-00108

Дата выдачи: 07.02.2003

Срок действия: бессрочная

Орган, выдавший лицензию: Федеральная служба по финансовым рынкам.

2. Основные аспекты, принципы учетной политики и методика подготовки отчетности

ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений организует деятельность по управлению средствами пенсионных накоплений на основе положений:

123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10, тел. (495) 287 6808, факс. (495) 725 5538, e-mail: pension_reserve@vtbcapital.com

ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

- Федерального закона от 24.07.2002 № 111-ФЗ «Об инвестировании средств для финансирования накопительной части трудовой пенсии в Российской Федерации»;
- Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг»;
- Постановления Правительства Российской Федерации от 12.08.2004 № 411 «Об утверждении правил переоценки рыночной стоимости инвестиционного портфеля при инвестировании средств пенсионных накоплений и правил корректировки инвестиционных портфелей управляющих компаний»;
- Постановления ФКЦБ РФ от 27.02.2004 №04-11/пс «О составе необходимых расходов по инвестированию средств пенсионных накоплений, оплачиваемых отобранными по конкурсу управляющими компаниями и государственной управляющей компанией за счет средств пенсионных накоплений, перечисляемых им Пенсионным фондом Российской Федерации».

Общество осуществляет доверительное управление средствами пенсионных накоплений от своего имени путем совершения любых юридических и фактических действий по доверительному управлению средствами пенсионных накоплений в интересах выгодоприобретателя – Пенсионного Фонда РФ, указывая при этом, что она действует в качестве доверительного управляющего.

При совершении сделок с имуществом, составляющим средства пенсионных накоплений, Общество делает пометку «Д.У. средствами пенсионных накоплений» после своего наименования.

Общество ведет отдельный учет средств пенсионных накоплений, не допуская смешения имущества средств пенсионных накоплений с другими объектами Доверительного управления, в том числе с имуществом, принадлежащим Обществу. В целях организации обособленного учета денежных средств, переданных в доверительное управление Пенсионным фондом Российской Федерации, Общество открывает отдельный счет доверительного управления для учета денежных средств составляющих портфель имущества пенсионных накоплений, в банке в российских рублях, а при необходимости, в иностранной валюте.

Отчетность по средствам пенсионных накоплений составляется по методике, указанной в Приказе ФСФР РФ от 15.11.2005 № 05-63/пз-н, Приказе ФСФР РФ от 26.12.2006 № 06-155/пз-н, а также в Приказе Минфина РФ от 22.08.2005 №107н.

Общество осуществляет на ежедневной основе расчет рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые размещены средства пенсионных накоплений, переданные в доверительное управление Пенсионным фондом Российской Федерации (далее по тексту – Фонд), и осуществляет сверку полученных результатов с результатами аналогичных расчетов ЗАО ВТБ Специализированный депозитарий.

Общество для целей ведения бухгалтерского (стоимостного) учета средств пенсионных накоплений назначает должностное лицо, ответственное за работу со средствами пенсионных накоплений, переданных в доверительное управление Фондом.

Бухгалтерская отчетность по средствам пенсионных накоплений, переданным Фондом в доверительное управление, представляется Обществом в адреса регулирующих органов и ЗАО ВТБ Специализированный депозитарий в сроки, установленные нормативными правовыми актами, за подписями руководителя, главного бухгалтера Общества и уполномоченного должностного лица, ответственного за ведение

бухгалтерского учета средств пенсионных накоплений.

Бухгалтерский учет средств пенсионных накоплений ведется на основе следующих документов:

- Основные принципы бухгалтерского учета средств пенсионных накоплений сформированы на основе: Положения по бухгалтерскому учету «Учетная политика организации» (ПБУ 1/2008), утвержденного приказом Минфина РФ от 06.10.2008 № 106н;
- Положения по бухгалтерскому учету «Учет финансовых вложений» ПБУ 19/02, утвержденного Приказом Минфина РФ от 10.12.2002 № 126н;
- Положения по бухгалтерскому учету «Учет активов и обязательств, стоимость которых выражена в иностранной валюте» (ПБУ 3/2006), утвержденного Приказом Минфина РФ от 27.11.2006 № 154н;
- Порядка расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений, утвержденного приказом ФСФР РФ от 26.12.2006 № 06 - 155/пз-н;
- Плана счетов бухгалтерского учета финансово-хозяйственной деятельности организаций и Инструкции по применению Плана счетов бухгалтерского учета финансово-хозяйственной деятельности организаций, утвержденных приказом Минфина РФ от 31.10.2000 № 94н.

Дата отражения операций при ведении стоимостного учета средств пенсионных накоплений - это дата осуществления операций со средствами пенсионных накоплений.

Точность значений по накопленному купонному доходу принимаемых к учету для государственных, корпоративных и муниципальных облигаций составляет 2 знака после запятой.

Основанием зачисления (списания) ценных бумаг в имущество считается:

- отчет депозитарного отдела Специализированного депозитария о зачислении (списании) ценных бумаг на счет депо;
- выписка Депозитария о зачислении (списании) ценных бумаг.

Средства пенсионных накоплений, переданные по договору доверительного управления средствами пенсионных накоплений, учитываются на балансовом счете 79 "Внутрихозяйственные расчеты".

Расчеты по имуществу, переданному в доверительное управление, отражаются на отдельном балансе.

Первоначальное поступление денежных средств от Фонда и поступления денежных средств от Фонда в течение отчетного года отражаются записью по дебету счета учета денежных средств и кредиту счета 79 "Внутрихозяйственные расчеты" субсчет "Расчеты по договору доверительного управления имуществом". Аналитический учет по данному субсчету ведется по каждому траншу средств, поступивших в доверительное управление.

Отражение записей по кредиту 79 счета "Внутрихозяйственные расчеты" происходит в момент зачисления на банковский счет доверительного управления средств пенсионных накоплений, переданных Фондом.

Возврат средств пенсионных накоплений отражается по дебету счета 79 "Внутрихозяйственные расчеты" субсчет "Расчеты по договору доверительного

123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10, тел. (495) 287 6808, факс. (495) 725 5538, e-mail: pension_reserve@vtbcapital.com

ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

управления имуществом" и кредиту счета учета денежных средств.

Финансовые вложения принимаются к бухгалтерскому учету по первоначальной стоимости. Первоначальной стоимостью финансовых вложений, приобретенных за плату, признается сумма фактических затрат Управляющей компании на их приобретение.

Фактическими затратами на приобретение активов в качестве финансовых вложений являются суммы стоимости покупки ценных бумаг на организованном рынке ценных бумаг.

Вознаграждения, уплачиваемые посреднической организации или иному лицу, через которое приобретены активы в качестве финансовых вложений (комиссия брокера, комиссия организатора торговли), и расходы, связанные с обслуживанием и хранением ценных бумаг, такие как оплата услуг банка и/или депозитария за хранение финансовых вложений, предоставление выписки депо и т.п., учитываются как прочие расходы на счете 91 «Прочие доходы и расходы».

Первоначальная стоимость финансовых вложений, стоимость которых при приобретении определена в иностранной валюте, определяется в рублях путем пересчета иностранной валюты по курсу Центрального банка Российской Федерации, действующему на дату их принятия к бухгалтерскому учету.

Купонный (процентный) доход по ценным бумагам отражается в бухгалтерской отчетности в составе дебиторской задолженности.

Порядок переоценки активов и обязательств

Финансовые вложения, по которым можно определить в установленном порядке текущую рыночную стоимость, отражаются в бухгалтерской отчетности на конец квартала по текущей рыночной стоимости путем корректировки их оценки на предыдущую отчетную дату.

Разница между оценкой финансовых вложений по текущей рыночной стоимости на отчетную дату и предыдущей оценкой финансовых вложений относится на результаты инвестирования средств пенсионных накоплений (в составе прочих доходов или расходов).

Финансовые вложения, по которым с момента приобретения не определяется текущая рыночная стоимость, подлежат отражению в бухгалтерском учете и в бухгалтерской отчетности на отчетную дату по первоначальной стоимости.

Если по объекту финансовых вложений, ранее оцениваемому по текущей рыночной стоимости, на отчетную дату текущая рыночная стоимость не определяется, такой объект финансовых вложений отражается в бухгалтерской отчетности по стоимости его последней оценки.

Доначисление НКД по облигациям производится ежеквартально в последний день отчетного квартала, исходя из количества дней отчетного периода и проспекта эмиссии эмитента каждого конкретного выпуска ценных бумаг.

Правила стоимостной оценки активов при выбытии

При выбытии актива, принятого к бухгалтерскому учету в качестве финансовых вложений, его средняя стоимость определяется по каждому виду ценных бумаг как

частное от деления стоимости ценных бумаг на их количество. Промежуточный результат не округляется.

Результат от инвестирования средств пенсионных накоплений Фонда, выявленный на соответствующих счетах учета, списывается ежеквартально на счет 79 "Внутрихозяйственные расчеты" субсчет "Расчеты по договору доверительного управления имуществом". По дебету указанного субсчета отражается уменьшение стоимости средств пенсионных накоплений, а по кредиту - прирост стоимости средств пенсионных накоплений.

В конце отчетного года итоговый результат от инвестирования средств пенсионных накоплений с субсчета "Прибыли/Убытки" счета 79 "Внутрихозяйственные расчеты" списывается на субсчет "ПФР" этого же счета.

Порядок признания расходов по доверительному управлению средствами пенсионных накоплений

Начисление вознаграждения Специализированного депозитария производится на день получения Обществом Поручения Пенсионного Фонда РФ об оплате услуг, предоставляемых Специализированным депозитарием.

Начисление вознаграждения Обществом производится в последний рабочий день периода, за который указанное вознаграждение начисляется.

Прочие необходимые расходы по инвестированию средств пенсионных накоплений списываются на счет 91 «Прочие доходы и расходы» в момент списания денежных средств с банковских и брокерских счетов доверительного управления.

Порядок формирования доходов по доверительному управлению средствами пенсионных накоплений

Доход по облигациям, составляющим имущество средств пенсионных накоплений, отражается в бухгалтерском учете по дебету счета 76 "Расчеты с разными дебиторами и кредиторами" и кредиту счета 91 "Прочие доходы и расходы" в момент погашения процентов (дохода) в соответствии с условиями выпуска и обращения ценных бумаг. После получения процентов (дохода) по облигациям, составляющим имущество средств пенсионных накоплений, на счета активов доверительного управления в бухгалтерском учете производится запись по дебету счетов учета денежных средств и кредиту счета 76 "Расчеты с разными дебиторами и кредиторами".

Полученные Обществом в счет увеличения средств пенсионных накоплений, переданных в доверительное управление, дивиденды по акциям, проценты по депозиту отражаются записью по дебету счетов учета денежных средств и кредиту счета 91 "Прочие доходы и расходы" после получения Обществом указанных доходов на счета активов доверительного управления.

3. Обособление средств пенсионных накоплений, переданных в доверительное управление

Обособление средств пенсионных накоплений, переданных в ДУ, и ведение по ним отдельного бухгалтерского учета подтверждается документами:

1. Договор открытия банковского счета № 40701810300000010173 в ЗАО ВТБ 24, 123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10, тел. (495) 287 6808, факс. (495) 725 5538, e-mail: pension_reserve@vtbcapital.com

ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

- владельцем которого является ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений и банковские выписки за период с 01.01.2015 г. по 31.12.2015 г.;
2. Договор открытия банковского счета № 40701810600760000051 в ОАО «Банк Москвы», владельцем которого является ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений и банковские выписки за период с 01.01.2015 г. по 31.12.2015 г.;
 3. Соглашение № 33-62/12/12 от 12.03.2012 г. с ЗАО «Сбербанк КИБ» на брокерское обслуживание на рынке ценных бумаг. Открыт специальный брокерский счет № 30411810400073000033;
 4. Отчеты об исполненных поручениях «Сбербанк КИБ» (Отчеты Брокера) ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв ДУ средствами пенсионных накоплений за период с 01.01.2015 г. по 31.12.2015 г.;
 5. Выписки депозитария ЗАО ВТБ Специализированный Депозитарий по счету Депо № 11221 доверительного управляющего, владельцем которого является ЗАО «ВТБ Капитал Управление активами» (Д.У. ПФР) за период с 01.01.2015 г. по 31.12.2015 г.;
 6. Договор об оказании специализированным депозитарием услуг Управляющей компании № 33/ДПН/2 от 10.08.2005 г.;
 7. Приказ ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв №19/ПР/3 от 31.12.2014г. «Об утверждении учетной политики для целей бухгалтерского учета средств пенсионных накоплений на 2015 год».

Финансовая (бухгалтерская) отчетность:

Ежедневный расчет стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений;

Ежедневный расчет стоимости инвестиционного портфеля;

Ежедневный отчет об инвестиционных вложениях;

Бухгалтерский баланс на 31.12.2015 г.;

Отчет о финансовых результатах за 12 месяцев 2015 г.;

Ежеквартальный отчет об инвестировании средств пенсионных накоплений;

Ежеквартальный отчет о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений.



4. Расшифровка отдельных строк обособленного баланса

4.1. Дебиторская задолженность

В составе дебиторской задолженности на 31.12.2015 г. имеется задолженность, платежи по которой ожидаются в течение 12 месяцев после отчетной даты, на общую сумму 150 639 тыс. рублей, в том числе:

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	150 639
---	---------

4.2. Финансовые вложения

В составе финансовых вложений по состоянию на 31.12.2015 г. на балансе ООО ВТБ

Капитал Пенсионный резерв ДУ средствами пенсионных накоплений находились:

Вид финансовых вложений	Оценка на 31.12.2015 (тыс. рублей)
Государственные ценные бумаги Российской Федерации	----
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	2 201 933
Облигации муниципальных образований	11 473
Облигации других российских эмитентов	4 872 615
Акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	2
Итого финансовых вложений:	7 086 023

Ценные бумаги, входящие в имущество доверительного управления средствами пенсионных накоплений, отнесены к категории Краткосрочных финансовых вложений. Торговые операции по всем ценным бумагам осуществлялись в течение отчетного года и, несмотря на срок погашения облигаций, по своему назначению и использованию могут быть отнесены к краткосрочным финансовым вложениям.

123317, г. Москва, Пресненская наб., д. 10, тел. (495) 287 6808, факс: (495) 725 5538, e-mail: pension_reserve@vtbcapital.com
ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

4.3. Денежные средства и денежные эквиваленты

В состав денежных средств и денежных эквивалентов на 31.12.2015 г. на общую сумму 120 945 тыс. рублей, входят:

Средства на расчетных счетах в банках	45 004
Средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг (у брокера)	75 941

4.4. Прочие обязательства

По учетной политике в отношении средств пенсионных накоплений результат от инвестирования средств пенсионных накоплений передается в средства пенсионных накоплений на последний календарный день года. В связи с этим сумма нераспределенной прибыли на 31 декабря 2015 г. перенесена в строку 1450 «Прочие долгосрочные обязательства».

Сумма средств пенсионных накоплений, находящихся в доверительном управлении, отражена по стр. 1450 Бухгалтерского баланса по статье «Прочие долгосрочные обязательства» в размере 7 228 671 тыс. рублей, в том числе финансовый результат от инвестирования средств пенсионных накоплений.

Генеральный директор

Волгин О.Н.

29.01.2016 г.



Расчёт стоимости чистых 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-ОЗУ048

Дата и время составления расчёта: 12.01.2016 16:00:31

Вид имущества	Код стр.	Рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства в рублях на счетах в кредитных организациях	010	45 003 648,72
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	0,00
Ценные бумаги, в том числе:	030	7 086 022 555,36
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	2 201 932 577,48
муниципальные облигации	033	11 472 800,63
облигации российских хозяйственных обществ	034	4 872 614 826,22
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	2 351,03
паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	036	0,00
облигации с ипотечным покрытием, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	037	0,00
ипотечные сертификаты участия, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	038	0,00
ценные бумаги международных финансовых организаций	039	0,00
Дебиторская задолженность, в том числе:	040	226 580 419,45
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	75 941 331,50
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	150 639 087,95
прочая дебиторская задолженность	043	0,00
Прочие активы	050	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	7 357 606 623,53
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	128 935 405,41
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	128 935 405,41
кредиторская задолженность по перечислению средств на формирование имущества, предназначенного для обеспечения уставной деятельности негосударственного пенсионного фонда	073	0,00
кредиторская задолженность по перечислению средств в негосударственный пенсионный фонд для исполнения им своих текущих обязательств	074	0,00
прочая кредиторская задолженность	075	0,00
Итого сумма обязательств	080	128 935 405,41
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	7 228 671 218,12

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)
М.П.

подпись ВТБ Капитал Пенсионный резерв
(И.О. Фамилия)
г. Москва

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-103829F015		
Дата и время отправки	13.01.2016 9:27:28	Дата и время приема	13.01.2016 9:28:31
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 13.01.2016 6:26:18 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		
	2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 12.01.2016 13:17:46 UTC [00126-7] Электронная подпись верна		

**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	RU34003TUL0	620,88	22 007	13 663 706,16	Средняя цена
Гос.облигации субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34004TUL0	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.облигаци и субъектов РФ	Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	756,64	24 948	18 876 654,72	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Минфин Хакасии	RU35003HAK0	910,9	69 160	62 997 844,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Минфин Хакасии	RU35004HAK0	1 014,1	10 000	10 141 000,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	МУФ СО	RU35008SAM0	191,94	13 160	2 525 930,40	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	МУФ СО	RU35010SAM0	868,77	128 001	111 203 428,77	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34015ANO0	945	45 820	43 299 900,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	ДФ ЯО	RU35013YRS0	970	6 100	5 917 000,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34016ANO0	998,7	36 016	35 969 179,20	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Облфин	RU35002VLO0	290,43	60 993	17 714 196,99	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Облфин	RU35005VLO0	820,335	21 500	17 637 202,50	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU34006BEL0	188,06	32 941	6 194 884,46	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU35007BEL0	918	56 865	52 202 070,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU35008BEL0	980,2	75 907	74 404 041,40	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32048MOS0	803,1	428 215	343 899 466,50	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Правительство Ханты - Мансийского автономного округа-Югры	RU34001HMN0	1 015,2	93 906	95 333 371,20	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34007LIP0	390	5 550	2 164 500,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34009LIP0	880,92	85 500	75 318 660,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	ДФБП ВО	RU34006VRO0	845,37	90 000	76 083 300,00	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU35008LIP0	748,3403362	100 119	74 923 086,12	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34015KAR0	392,04	39 990	15 677 679,60	Средняя цена
Гос.облигаци и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34016KAR0	753,36	1 000	753 360,00	Средняя цена
Гос.облигаци 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 "ППК"	4-01-55521-E	1 007	40 000	40 280 000,00	Средняя цена
АО "ППК"	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	17 132 295,80	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"	4BQ2-01-55192-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	113 111 166,00	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	RU34001HMNO	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	RU34008NJG0	115 766,60
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-08-65018-D	583 780,60
Минфин Нижегородской области	RU34009NJG0	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.

(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 приема	13.01.2016 9:28:31
Подписано	1. Лукьянов 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		



Форма отчёта
о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений
за 1 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании
7722270922/770301001

(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО - Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Структура доходов и расходов по инвестированию средств пенсионных накоплений

Наименование показателей	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего.	010	316 912.68115	316.912.68115
В том числе :			
- финансовый результат от реализации активов	011	22 483.47432	22 483.47432
- дивиденды и проценты (доход) по ценным бумагам	012	60 043.22076	60 043.22076
- проценты (доход) по банковским депозитам и средствам на счетах в кредитных организациях	013	67 356.56363	67 356.56363
- финансовый результат от переоценки активов	014	167 029.42244	167 029.42244
- другие виды доходов от операций по инвестированию средств пенсионных накоплений	015	0.00000	0.00000
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего.	020	1 332.95495	1 332.95495
В том числе :			
- оплата услуг специализированного депозитария	021	487.26358	487.26358
- оплата услуг профессиональных участников рынка ценных бумаг (брокеров, дилеров, организаторов торговли и др.)	022	791.41737	791.41737
- оплата услуг аудитора	023	54.00000	54.00000
- расходы на обязательное страхование	024	0.00000	0.00000
- оплата прочих услуг	025	0.27400	0.27400
Вознаграждение управляющей компании*	030	0.00000	0.00000

* Указывается в отчете за 4-й квартал

2. Показатели величин расходов и вознаграждения

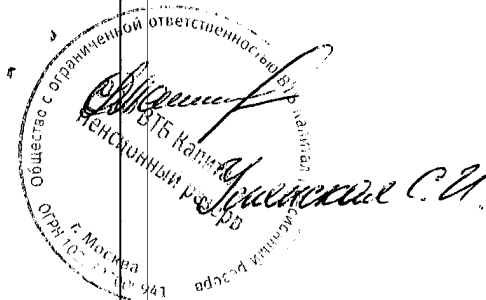
Наименование показателя	Код строки	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Средняя стоимость чистых активов, без учета вновь переданных средств	010	7 218 368.24629
Сумма вновь переданных средств, итого.	020	593 349.21771
В том числе переданные :		
в январе		0.00000
в феврале		0.00000
в марте		593 349.21771
в апреле		0.00000
в мае		0.00000
в июне		0.00000
в июле		0.00000
в августе		0.00000
в сентябре		0.00000
в октябре		0.00000
в ноябре		0.00000
в декабре		0.00000

Получено по СЭД : Отчёт о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений

Предельный размер необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	030	84 337.41571
Фактически понесенные расходы управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	040	1 332.95495
Экономия/перерасход по возмещению необходимых расходов управляющей компании (строки 030-040)	050	83 004.46076
Предельный размер оплаты услуг, оказываемых специализированным депозитарием	060	7 667.03780
Фактическая стоимость предоставленных услуг специализированным депозитарием	070	487.26358
Экономия/перерасход по оплате услуг специализированного депозитария (строки 060-070)	080	7 179.77422
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего	090	316 912.68115
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		4.3800
Вознаграждение управляющей компании **	100	0.00000
в процентах к доходу от инвестирования средств пенсионных накоплений		0.0000
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		0.0000

** Указывается в отчете за 4-й квартал

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-92437F070		
Дата и время отправки	08.04.2015 12:18:19	Дата и время приёма	08.04.2015 12:25:20
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 08.04.2015 9:18:12 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 07.04.2015 15:48:52 UTC [00126-6] Электронная подпись верна		



Форма отчёта

о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений за 2 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании
7722270922/770301001

(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО - Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Структура доходов и расходов по инвестированию средств пенсионных накоплений

Наименование показателей	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего.	010	461 865.43120	778 778.11235
В том числе :			
- финансовый результат от реализации активов	011	38 913.34485	61 396.81917
- дивиденды и проценты (доход) по ценным бумагам	012	60 810.56655	120 853.78731
- проценты (доход) по банковским депозитам и средствам на счетах в кредитных организациях	013	33 076.88241	100 433.44604
- финансовый результат от переоценки активов	014	329 064.63739	496 094.05983
- другие виды доходов от операций по инвестированию средств пенсионных накоплений	015	0.00000	0.00000
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего.	020	1 458.00565	2 790.96060
В том числе :			
- оплата услуг специализированного депозитария	021	571.00622	1 058.26980
- оплата услуг профессиональных участников рынка ценных бумаг (брокеров, дилеров, организаторов торговли и др.)	022	886.99943	1 678.41680
- оплата услуг аудитора	023	0.00000	54.00000
- расходы на обязательное страхование	024	0.00000	0.00000
- оплата прочих услуг	025	0.00000	0.27400
Вознаграждение управляющей компании*	030	0.00000	0.00000

* Указывается в отчете за 4-й квартал

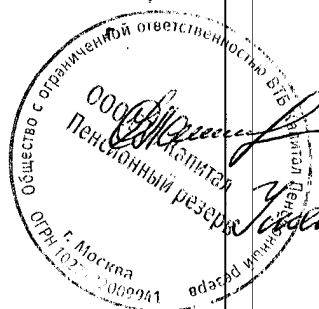
2. Показатели величин расходов и вознаграждения

Наименование показателя	Код строки	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Средняя стоимость чистых активов, без учета вновь переданных средств	010	6 785 831.16778
Сумма вновь переданных средств, итого.	020	654 966.87578
В том числе переданные :		
в январе		0.00000
в феврале		0.00000
в марте		593 349.21771
в апреле		39 569.07429
в мае		7 799.61112
в июне		14 248.97266
в июле		0.00000
в августе		0.00000
в сентябре		0.00000
в октябре		0.00000
в ноябре		0.00000
в декабре		0.00000

Предельный размер необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	030	80 012.94873
Фактически понесенные расходы управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	040	2 790.96060
Экономия/перерасход по возмещению необходимых расходов управляющей компании (строки 030-040)	050	77 221.98813
Предельный размер оплаты услуг, оказываемых специализированным депозитарием	060	7 273.90444
Фактическая стоимость предоставленных услуг специализированным депозитарием	070	1 058.26980
Экономия/перерасход по оплате услуг специализированного депозитария (строки 060-070)	080	6 215.63464
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего	090	778 778.11235
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		10.9400
Вознаграждение управляющей компании **	100	0.00000
в процентах к доходу от инвестирования средств пенсионных накоплений		0.0000
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		0.0000

** Указывается в отчете за 4-й квартал

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-95864F070		
Дата и время отправки	08.07.2015 11:30:31	Дата и время приёма	08.07.2015 11:34:08
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 08.07.2015 8:29:19 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 07.07.2015 18:17:03 UTC [00126-6] Электронная подпись верна		



Форма отчёта
о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений
за 3 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании
7722270922/770301001

(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО - Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

1. Структура доходов и расходов по инвестированию средств пенсионных накоплений

Наименование показателей	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего.	010	172 667.91781	951 446.03016
В том числе :			
- финансовый результат от реализации активов	011	-121 787.55926	-60 390.74009
- дивиденды и проценты (доход) по ценным бумагам	012	68 255.98935	189 109.77666
- проценты (доход) по банковским депозитам и средствам на счетах в кредитных организациях	013	3 558.00104	103 991.44708
- финансовый результат от переоценки активов	014	121 310.78668	617 404.84651
- другие виды доходов от операций по инвестированию средств пенсионных накоплений	015	101 330.70000	101 330.70000
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего.	020	2 561.15094	5 352.11154
В том числе :			
- оплата услуг специализированного депозитария	021	612.86345	1 671.13325
- оплата услуг профессиональных участников рынка ценных бумаг (брокеров, дилеров, организаторов торговли и др.)	022	726.70112	2 405.11792
- оплата услуг аудитора	023	0.00000	54.00000
- расходы на обязательное страхование	024	1 221.58637	1 221.58637
- оплата прочих услуг	025	0.00000	0.27400
Вознаграждение управляющей компании*	030	0.00000	0.00000

* Указывается в отчете за 4-й квартал

2. Показатели величин расходов и вознаграждения

Наименование показателя	Код строки	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Средняя стоимость чистых активов, без учета вновь переданных средств	010	6 604 766.79185
Сумма вновь переданных средств, итого.	020	656 059.08801
В том числе переданные :		
в январе		0.00000
в феврале		0.00000
в марте		593 349.21771
в апреле		39 569.07429
в мае		7 799.61112
в июне		14 248.97266
в июле		670.61070
в августе		400.00000
в сентябре		21.60153
в октябре		0.00000
в ноябре		0.00000
в декабре		0.00000

Получено по СЭД : Отчёт о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений

Предельный размер необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	030	78 026.34536
Фактически понесенные расходы управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	040	5 352.11154
Экономия/перерасход по возмещению необходимых расходов управляющей компании (строки 030-040)	050	72 674.23382
Предельный размер оплаты услуг, оказываемых специализированным депозитарием	060	7 093.30412
Фактическая стоимость предоставленных услуг специализированным депозитарием	070	1 671.13325
Экономия/перерасход по оплате услуг специализированного депозитария (строки 060-070)	080	5 422.17087
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего	090	951 446.03016
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		13.4800
Вознаграждение управляющей компании **	100	0.00000
в процентах к доходу от инвестирования средств пенсионных накоплений		0.0000
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		0.0000

** Указывается в отчете за 4-й квартал

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-100545F070		
Дата и время отправки	13.10.2015 10:10:10	Дата и время приёма	13.10.2015 10:14:02
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович [00001-1] дата и время ЭП 13.10.2015 7:09:44 UTC Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна [00126-7] дата и время ЭП 12.10.2015 16:04:01 UTC Электронная подпись верна		



Форма отчёта

о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений за 4 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании
7722270922/770301001

(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО - Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

1. Структура доходов и расходов по инвестированию средств пенсионных накоплений

Наименование показателей	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего.	010	337 908.02389	1 289 354.05405
В том числе :			
- финансовый результат от реализации активов	011	13 789.42163	-46 601.31846
- дивиденды и проценты (доход) по ценным бумагам	012	74 816.81478	263 926.59144
- проценты (доход) по банковским депозитам и средствам на счетах в кредитных организациях	013	0.00133	103 991.44841
- финансовый результат от переоценки активов	014	249 301.78615	866 706.63266
- другие виды доходов от операций по инвестированию средств пенсионных накоплений	015	0.00000	101 330.70000
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего.	020	1 175.34881	6 527.46035
В том числе :			
- оплата услуг специализированного депозитария	021	626.01263	2 297.14588
- оплата услуг профессиональных участников рынка ценных бумаг (брокеров, дилеров, организаторов торговли и др.)	022	549.33618	2 954.45410
- оплата услуг аудитора	023	0.00000	54.00000
- расходы на обязательное страхование	024	0.00000	1 221.58637
- оплата прочих услуг	025	0.00000	0.27400
Вознаграждение управляющей компании*	030	128 935.40541	128 935.40541

* Указывается в отчете за 4-й квартал

2. Показатели величин расходов и вознаграждения

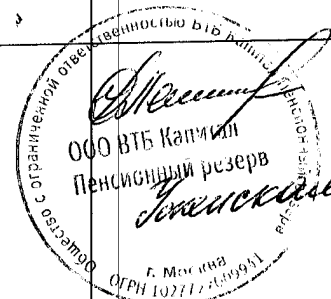
Наименование показателя	Код строки	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
Средняя стоимость чистых активов, без учета вновь переданных средств	010	6 594 337.77365
Сумма вновь переданных средств, итого.	020	660 994.99350
В том числе переданные :		
в январе		0.00000
в феврале		0.00000
в марте		593 349.21771
в апреле		39 569.07429
в мае		7 799.61112
в июне		14 248.97266
в июле		670.61070
в августе		400.00000
в сентябре		21.60153
в октябре		2 965.61010
в ноябре		0.00000
в декабре		1 970.29539

Получено по СЭД : Отчёт о доходах от инвестирования средств пенсионных накоплений

Предельный размер необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	030	77 919.49988
Фактически понесенные расходы управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений	040	6 527.46035
Экономия/перерасход по возмещению необходимых расходов управляющей компании (строки 030-040)	050	71 392.03953
Предельный размер оплаты услуг, оказываемых специализированным депозитарием	060	7 083.59090
Фактическая стоимость предоставленных услуг специализированным депозитарием	070	2 297.14588
Экономия/перерасход по оплате услуг специализированного депозитария (строки 060-070)	080	4 786.44502
Доход от инвестирования средств пенсионных накоплений, всего	090	1 289 354.05405
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		18.1600
Вознаграждение управляющей компании **	100	128 935.40541
в процентах к доходу от инвестирования средств пенсионных накоплений		10.0000
в процентах от среднегодовой стоимости чистых активов		1.8200

** Указывается в отчете за 4-й квартал

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-104382F070		
Дата и время отправки	22.01.2016 10:18:19	Дата и время приёма	22.01.2016 10:22:04
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 22.01.2016 7:17:47 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 21.01.2016 21:24:41 UTC [00126-7] Электронная подпись верна		



Форма отчёта
об инвестировании средств пенсионных накоплений
за 1 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами
пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании

7722270922/770301001

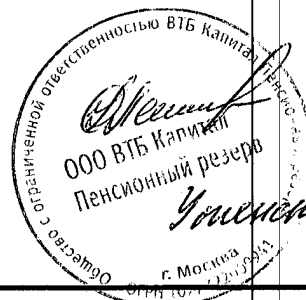
(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО -
Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Изменение стоимости чистых активов	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
1	2	3	4
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	7 187 533.38895	7 187 533.38895
Поступило средств пенсионных накоплений из Пенсионного фонда Российской Федерации за отчетный период	020	593 349.21771	593 349.21771
Получен доход от инвестирования средств пенсионных накоплений за отчетный период, всего	030	316 912.68115	316 912.68115
Перечислено средств пенсионных накоплений в Пенсионный фонд Российской Федерации за отчетный период	040	18 242.45335	18 242.45335
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего	050	1 332.95495	1 332.95495
Удержано вознаграждение управляющей компании*	060	0.00000	0.00000
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода	070	8 078 219.87951	8 078 219.87951

* для отчёта за 4 квартал



Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru			
Исходящий рег. номер	VTB00126-92439F060			
Дата и время отправки	08.04.2015 12:18:18	Дата и время приёма	08.04.2015 12:25:20	
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 08.04.2015 9:18:00 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 07.04.2015 15:48:53 UTC [00126-6] Электронная подпись верна			

Утверждена
приказом Федеральной службы
по финансовым рынкам
от 15.11.2005 № 05-63/пз-н

Форма отчёта
об инвестировании средств пенсионных накоплений
за 2 квартал 2015 года

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами
пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании

7722270922/770301001

(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО -
Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Изменение стоимости чистых активов	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
1	2	3	4
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	8 078 219.87951	7 187 533.38895
Пришло средств пенсионных накоплений из Пенсионного фонда Российской Федерации за отчетный период	020	61 617.65807	654 966.87578
Учен доход от инвестирования средств пенсионных накоплений за отчетный период, всего	030	461 865.43120	778 778.11235
Учтено средств пенсионных накоплений в Пенсионный фонд Российской Федерации за отчетный период	040	1 729 119.19653	1 747 361.64988
Учтено средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего	050	1 458.00565	2 790.96060
Учтено вознаграждение управляющей компании*	060	0.00000	0.00000
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода	070	6 871 125.76660	6 871 125.76660

отчёта за 4 квартал



Получено по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Идентификационный рег. номер	VTB00126-95862F060		
Дата и время отправки	08.07.2015 11:30:31	Дата и время приёма	08.07.2015 11:34:09
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 08.07.2015 8:29:07 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 07.07.2015 18:16:59 UTC [00126-6] Электронная подпись верна		

Утверждена
приказом Федеральной службы
по финансовым рынкам
от 15.11.2005 № 05-63/пз-н**Форма отчёта**
об инвестировании средств пенсионных накоплений
за 3 квартал 2015 годаОбщество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами
пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании

7722270922/770301001

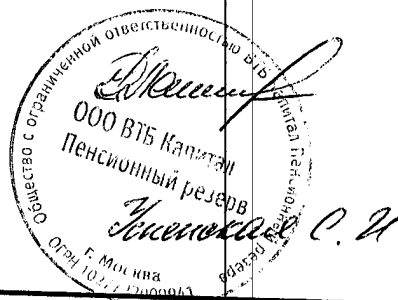
(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО -
Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Изменение стоимости чистых активов	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
1	2	3	4
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	6 871 125.76660	7 187 533.38895
Поступило средств пенсионных накоплений из Пенсионного фонда Российской Федерации за отчетный период	020	1 092.21223	656 059.08801
Получен доход от инвестирования средств пенсионных накоплений за отчетный период, всего	030	172 667.91781	951 446.03016
Перечислено средств пенсионных накоплений в Пенсионный фонд Российской Федерации за отчетный период	040	13 310.85067	1 760 672.50055
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего	050	2 561.15094	5 352.11154
Удержано вознаграждение управляющей компании*	060	0.00000	0.00000
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода	070	7 029 013.89503	7 029 013.89503

* для отчёта за 4 квартал



Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-100361F060		
Дата и время отправки	13.10.2015 10:04:04	Дата и время приёма	13.10.2015 10:05:16
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 13.10.2015 7:04:07 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		
	2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 08.10.2015 16:40:03 UTC [00126-7] Электронная подпись верна		

Утверждена
приказом Федеральной
службы
по финансовым рынкам
от 15.11.2005 № 05-63/пз-н

**Форма отчёта
об инвестировании средств пенсионных накоплений
за 4 квартал 2015 года**

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв Д.У. средствами
пенсионных накоплений

полное фирменное наименование управляющей компании

7722270922/770301001

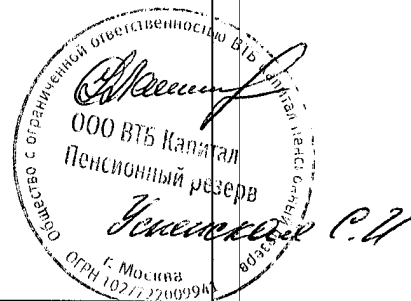
(ИНН/КПП)

Договор 22-03У048 от 08.10.2003, ПФР-Накопления ПФР-ВТБ Капитал Пенсионный Резерв ООО -
Портфель по умолчанию (дог. 22-03У048)-

Номер, дата договора доверительного управления, наименование инвестиционного портфеля

Изменение стоимости чистых активов	Код строки	За отчетный квартал (тыс. руб.)	Накопительным итогом с начала года (тыс. руб.)
1	2	3	4
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	7 029 013.89503	7 187 533.38895
Поступило средств пенсионных накоплений из Пенсионного фонда Российской Федерации за отчетный период	020	4 935.90549	660 994.99350
Получен доход от инвестирования средств пенсионных накоплений за отчетный период, всего	030	337 908.02389	1 289 354.05405
Перечислено средств пенсионных накоплений в Пенсионный фонд Российской Федерации за отчетный период	040	13 075.85207	1 773 748.35262
Удержано средств для возмещения необходимых расходов управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений, всего	050	1 175.34881	6 527.46035
Удержано вознаграждение управляющей компании*	060	128 935.40541	128 935.40541
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода	070	7 228 671.21812	7 228 671.21812

* для отчёта за 4 квартал



Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-104196F060		
Дата и время отправки	22.01.2016 10:05:06	Дата и время приёма	22.01.2016 10:13:14
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 22.01.2016 7:04:29 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 19.01.2016 10:40:32 UTC [00126-7] Электронная подпись верна		