

**Справка о стоимости чистых активов акционерного
инвестиционного фонда (стоимости чистых активов паевого
инвестиционного фонда)**

**Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный
резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв**

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда либо тип и название паевого
инвестиционного фонда)

Федеральная служба по финансовым рынкам № 0202-72729965 от 13.04.2004

(дата регистрации правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом
федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг и регистрационный номер)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование управляющей компании)

123317, Москва г, Пресненская наб, дом № 10, т.+7 (495) 287-68-16

(место нахождения, номер телефона управляющей компании)

21-000-1-00108, ФСФР, от 7 февраля 2003 г.

(номер и дата предоставления лицензии на осуществление деятельности по управлению инвестиционными
фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными
пенсионными фондами, наименование лицензирующего органа)

Дата определения стоимости чистых активов: 31.12.2015 20:00

(рублей)			
Вид имущества	Код стр.	Сумма (оценочная стоимость) на 31.12.2015 (указывается текущая дата составления справки)	Сумма (оценочная стоимость) на 30.12.2015 (указывается предыдущая дата составления справки)
1	2	3	4
Активы:			
Денежные средства на счетах - всего, в том числе:	010	2 018 435,89	2 019 435,89
- в рублях	011	2 018 435,89	2 019 435,89
- в иностранной валюте	012	0,00	0,00
Денежные средства во вкладах - всего, в том числе:	020	0,00	0,00
- в рублях	021	0,00	0,00
- в иностранной валюте	022	0,00	0,00
	030		
Государственные ценные бумаги Российской Федерации		251 300,32	251 300,32
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	040	27 220 416,75	27 220 416,75
Муниципальные ценные бумаги	050	899 827,50	899 827,50
Облигации российских хозяйственных обществ (кроме облигаций с ипотечным покрытием)	060	37 058 549,29	37 058 549,29
Акции российских акционерных обществ	070	0,00	0,00
	080		
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов		0,00	0,00
Ипотечные ценные бумаги - всего, в том числе:	090	0,00	0,00
- облигации с ипотечным покрытием	091	0,00	0,00
- ипотечные сертификаты участия	092	0,00	0,00
Векселя, выданные российскими хозяйственными обществами	100	0,00	0,00
Ценные бумаги иностранных эмитентов - всего, в том числе:	110	781 781,00	781 781,00
- ценные бумаги иностранных государств	111	0,00	0,00
- ценные бумаги международных финансовых организаций	112	781 781,00	781 781,00
- акции иностранных акционерных обществ	113	0,00	0,00
	114		
- облигации иностранных коммерческих организаций		0,00	0,00
Закладные	120	0,00	0,00
Денежные требования по обеспеченным ипотекой обязательствам из кредитных договоров или договоров займа и права залогодержателя по договорам об ипотеке (за исключением удостоверенных закладными)	130	0,00	0,00
Денежные требования по обязательствам из кредитных договоров или договоров займа, по которым кредиты (займы) предоставлены для уплаты цены по договорам участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества и права залогодержателя по договорам залога имущественных прав по указанным договорам	140	0,00	0,00
Доли в российских обществах с ограниченной ответственностью	150	0,00	0,00
Недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации, - всего, в том числе:	160	0,00	0,00

- объекты незавершенного строительства	161	0,00	0,00
Недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств, - всего, в том числе:	170	0,00	0,00
- объекты незавершенного строительства	171	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации, - всего, в том числе:	180	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	181	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств, - всего, в том числе:	190	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	191	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества	200	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из инвестиционных договоров	210	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется строительство (создание) объектов недвижимости на земельном участке, составляющем активы акционерного инвестиционного фонда или активы паевого инвестиционного фонда	220	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимости, составляющих активы акционерного инвестиционного фонда или активы паевого инвестиционного фонда	230	0,00	0,00
Проектно-сметная документация	240	0,00	0,00
Иное имущество	250	0,00	0,00
Дебиторская задолженность - всего, в том числе:	260	1 504 624,11	1 485 138,12
- средства, находящиеся у профессиональных участников рынка ценных бумаг	261	172 874,09	172 874,09
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	262	0,00	0,00
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по денежным средствам на счетах и во вкладах, а также по ценным бумагам	263	1 331 750,02	1 312 264,03
- прочая дебиторская задолженность	264	0,00	0,00
Итого сумма активов: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090 + 100 + 110 + 120 + 130 + 140 + 150 + 160 + 170 + 180 + 190 + 200 + 210 + 220 + 230 + 240 + 250 + 260)	270	69 734 934,86	69 716 448,87
Обязательства:			
Кредиторская задолженность	300	201 985,02	0,00
Резерв предстоящих расходов на выплату вознаграждения	310	286 679,98	481 077,56
Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением открытым паевым инвестиционным фондом	320	0,00	0,00
Итого сумма обязательств: (строки 300 + 310 + 320)	330	488 665,00	481 077,56
Стоимость чистых активов: (строка 270 - строка 330)	400	69 246 269,86	69 235 371,31
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) - штук	500	38 931,55083	38 931,55083
Стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда в расчете на одну акцию (расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда) (строка 400 / строка 500)	600	1 778,67	1 778,39

Генеральный директор

(подпись)

/ Волгин О.Н. /

Директор Департамента внутреннего учета

(подпись)

/ Мищенко В.Н. /

Руководитель группы обслуживания открытых паевых инвестиционных фондов

(подпись)

/ Москвичева О.В. /

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА
к справке о стоимости чистых активов

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(далее - паевой инвестиционный фонд)

на 31 декабря 2015 г.

1. Настоящая Пояснительная записка составлена в соответствии с Приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. N 05-21/пз-н «ОБ УТВЕРЖДЕНИИ ПОЛОЖЕНИЯ О ПОРЯДКЕ И СРОКАХ ОПРЕДЕЛЕНИЯ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, РАСЧЕТНОЙ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПАЕВ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, А ТАКЖЕ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ В РАСЧЕТЕ НА ОДНУ АКЦИЮ» (далее – положение).
2. За 4 квартал 2015 года не было допущено ошибок, которые привели к изменению расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более процентов.
3. В состав активов паевого инвестиционного фонда за отчетный период не входили требования и обязательства, не включаемые в расчет стоимости чистых активов, в том числе, активы, обремененные залогом, опционы, фьючерсные и форвардные контракты, премии по опционам, отсутствовали забалансовые риски.
4. По состоянию на 31.12.2015 года отсутствуют объявленные, но не полученные суммы дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда.
5. В течение отчетного периода на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда существенное влияние оказали изменения котировок следующих ценных бумаг, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

<i>ценная бумага</i>	<i>котировка</i>				<i>изменение в %</i>
	<i>дата</i>		<i>дата</i>		
Вертолеты России, БО-02, 4B02-02-12310-A	30.09.2015	86,870000	31.12.2015	95,880000	10,37
Минфин России, 20, 46020RMFS	30.09.2015	68,137300	10.11.2015	75,970100	11,50

Генеральный директор

_____/ Волгин О.Н. /
(подпись)

Директор Департамента внутреннего учета

_____/ Мищенко В.Н. /
(подпись)

Руководитель группы обслуживания открытых паевых
инвестиционных фондов
Банк ВТБ (ПАО)

_____/ Москвичева О.В. /
(подпись)

ОТЧЕТ
об изменении стоимости чистых активов
акционерного инвестиционного фонда
(стоимости чистых активов паевого
инвестиционного фонда)

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда либо тип и название паевого
инвестиционного фонда)

Федеральная служба по финансовым рынкам № 0202-72729965 от 13.04.2004

(дата и номер предоставления лицензии на осуществление деятельности инвестиционного фонда и наименование
лицензирующего органа либо дата регистрации правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом
федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг и регистрационный номер)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв, 123317, Москва г,
Пресненская наб, дом № 10, т.+7 (495) 287-68-16, 21-000-1-00108, ФСФР, от 7 февраля 2003 г.

(полное фирменное наименование управляющей компании, место нахождения, номер телефона управляющей
компании, номер и дата предоставления лицензии на осуществление деятельности по управлению инвестиционными
фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами, наименование
лицензирующего органа)

Дата составления отчета 31.12.2015 20:00 МСК

Причина изменения стоимости чистых активов	Код стр.	Сумма
1	2	3
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	60 202 661,88
Размещение акций акционерного инвестиционного фонда (выдача инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	020	0,00
Выкуп или приобретение акций акционерного инвестиционного фонда (погашение инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	030	122 058,77
Обмен инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов	040	0,00
Обмен инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда	050	0,00
Выплата дохода от доверительного управления закрытым паевым инвестиционным фондом	060	0,00
Изменение стоимости чистых активов в результате операций с активами акционерного инвестиционного фонда (активами паевого инвестиционного фонда) и изменения стоимости активов фонда	070	9 165 666,75
СТОИМОСТЬ ЧИСТЫХ АКТИВОВ НА КОНЕЦ ОТЧЕТНОГО ПЕРИОДА (строки 010 + 020 - 030 - 040 + 050 - 060 +(-) 070)	080	69 246 269,86

Генеральный директор

_____ / Волгин О.Н. /

Директор Департамента внутреннего учета

_____ / Мищенко В.Н. /

Руководитель группы обслуживания
открытых паевых инвестиционных фондов

_____ / Москвичева О.В. /

СПРАВКА О СТОИМОСТИ АКТИВОВ

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование управляющей компании
Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв
Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР
31 декабря 2015 г.

Вид активов	Код стр.	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс. рублей)	Доля от общей стоимости активов (процентов)	Доля от общего количества размещенных (выданных) ценных бумаг
1	2	3	4	5
Денежные средства на банковских счетах, всего	100	2 018,44	2,89	x
в том числе:				
- в рублях	110	2 018,44	2,89	x
40701810200030000365, ОАО Банк ВТБ		2 018,44	2,89	x
- в иностранной валюте	120	0,00		x
Денежные средства в банковских вкладах, всего	200	0,00		x
в том числе:				
- в рублях	210	0,00		x
- в иностранной валюте	220	0,00		x
Ценные бумаги, имеющие признаваемую котировку, всего	300	0,00		x
в том числе:				
Ценные бумаги российских эмитентов, включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг	310	0,00		x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	311	0,00		
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	312	0,00		
- муниципальные ценные бумаги	313	0,00		
- облигации российских хозяйственных обществ	314	0,00		x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	315	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	316	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	317	0,00		x
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	318	0,00		
Ценные бумаги российских эмитентов, не включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг	320	0,00		x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	321	0,00		
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	322	0,00		
- муниципальные ценные бумаги	323	0,00		
- облигации российских хозяйственных обществ	324	0,00		x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	325	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	326	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	327	0,00		x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	328	0,00		
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	329	0,00		
Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	400	65 430,09	93,83	x
в том числе:				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	410	251,30	0,36	
Минфин России, 14, 26214RMFS		251,30	0,36	0,0001132
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	420	27 220,42	39,03	
Главное финансовое управление Кемеровской области, 01, RU34001KEM0		636,53	0,91	0,0681000
Департамент финансов Ярославской области, 12, RU34012YRS0		2 712,93	3,89	0,0573800
комитет финансов Волгоградской области, 05, RU35005VLO0		2 378,97	3,41	0,0580000
Липецкая область, 09, RU34009LIP0		704,16	1,01	0,0160000
Министерство управления финансами Самарской области, 10, RU35010SAM0		4 343,85	6,23	0,0416667
Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 15, RU34015ANO0		1 417,50	2,03	0,0300000
Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 16, RU34016ANO0		376,51	0,54	0,0053857
Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0		1 700,68	2,44	0,0483333
Министерство финансов Красноярского края, 08, RU34008KNA0		594,96	0,85	0,0060000
Министерство финансов Красноярского края, 11, RU34011KNA0		1 803,78	2,59	0,0423529
Министерство финансов Нижегородской области, 09, RU34009NJ0		2 560,97	3,67	0,0330000
Министерство финансов Омской области, 02, RU34002OMS0		2 659,80	3,81	0,0660000
Министерство финансов Республики Коми, 11, RU35011KOM0		497,50	0,71	0,0049505
Министерство финансов Республики Коми, 12, RU35012KOM0		1 500,00	2,15	0,0136364
Правительство Белгородской области, 08, RU35008BEL0		490,10	0,70	0,0100000
Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLG0		1 420,02	2,04	0,0630000
Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры, 01, RU34001HMN0		1 015,20	1,46	0,0071429
Управление финансов Липецкой области, 08, RU35008LIP0		406,97	0,58	0,0180333
- муниципальные ценные бумаги	430	899,83	1,29	
Мэрия города Новосибирска, 06, RU35006NSB1		899,83	1,29	0,0260000
- облигации российских хозяйственных обществ	440	37 058,55	53,14	x
АЛЬФА-БАНК, БО-04, 4B020401326B		3 609,72	5,18	x
АЛЬФА-БАНК, БО-09, 4B020901326B		589,62	0,85	x
АО ПКТ, 01, 4-01-03924-J		1 999,80	2,87	x
АФК Система, 01, 4B02-01-01669-A-001P		2 035,20	2,92	x
Вертолеты России, БО-02, 4B02-02-12310-A		431,46	0,62	x
ЕвразХолдинг Финанс, 08, 4-08-36383-R		1 014,40	1,45	x
КБ Восточный, 02, 40201460B		383,60	0,55	x
Корпорация Иркут, БО-04, 4B02-04-00040-A		1 389,30	1,99	x
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК, БО-07, 4B020701978B		1 363,60	1,96	x
НК Роснефть, 08, 4-08-00122-A		2 577,85	3,70	x
ПАО ВымпелКом, 04, 4-04-00027-A		1 971,00	2,83	x
Полюс Золото, БО-01, 4B02-01-55192-E		1 070,06	1,53	x
РВК-Финанс, БО-01, 4B02-01-36320-R		2 003,20	2,87	x
РЖД, 23, 4-23-85045-D		2 245,54	3,22	x
РусГидро, 09, 4-09-55038-E		2 573,75	3,69	x
Силовые машины, БО-01, 4B02-01-35909-H		2 732,94	3,92	x

ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J		3 076,87	4,41	x
Фольксваген Банк РУС, 08, 40803500В		687,31	0,99	x
Фольксваген Банк РУС, 09, 40903500В		706,31	1,01	x
ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D		2 316,97	3,32	x
ХК МЕТАЛЛОИНВЕСТ, 03, 4-03-25642-Н		2 280,05	3,27	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	450	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	460	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	470	0,00		x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	480	0,00		
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	490	0,00		
- векселя	491	0,00		x
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	500	781,78	1,12	x
в том числе:				
- ценные бумаги иностранных государств	510	0,00		
- ценные бумаги международных финансовых организаций	520	781,78	1,12	
Международный инвестиционный банк, 04, RU000A0JUG98		781,78	1,12	0,0156200
- облигации иностранных коммерческих организаций	530	0,00		
- акции иностранных акционерных обществ	540	0,00		
Доли в уставных капиталах российских обществ с ограниченной ответственностью	600	0,00		
Недвижимое имущество	700	0,00		x
Имущественные права на недвижимое имущество	800	0,00		x
Строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	900	0,00		x
Проектно-сметная документация	1000	0,00		x
Иные доходные вложения в материальные ценности	1100	0,00		x
Дебиторская задолженность в том числе:	1200	1 504,62	2,16	x
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	1210	172,87	0,25	x
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	1220	0,00		x
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по банковским вкладам и ценным бумагам	1230	1 331,75	1,91	x
- прочая дебиторская задолженность	1240	0,00		x
ИТОГО АКТИВОВ (строки 100 + 200 + 300 + 400 + 500 + 600 + 700 + 800 + 900 + 1000 + 1100 + 1200)	1300	69 734,93	x	x

Примечание:

Облигации, составляющие активы фонда:

№	Облигация	Дата погашения	Период выплаты	Наименование фондовой биржи
1.	АЛЪФА-БАНК, БО-04, 4B020401326В	24.10.2016	Полугодие	ММВБ
2.	АЛЪФА-БАНК, БО-09, 4B020901326В	20.08.2016	Полугодие	ММВБ
3.	АО ПКТ, 01, 4-01-03924-J	09.12.2025	Полугодие	ММВБ
4.	АФК Система, 01, 4B02-01-01669-A-001P	30.09.2025	Полугодие	ММВБ
5.	Вертолеты России, БО-02, 4B02-02-12310-A	16.11.2023	Полугодие	ММВБ
6.	Главное финансовое управление Кемеровской области, 01, RU34001КЕМ0	28.11.2018	Квартал	ММВБ
7.	Департамент финансов Ярославской области, 12, RU34012YRS0	13.07.2018	Квартал	ММВБ
8.	ЕвразХолдинг Финанс, 08, 4-08-36383-R	18.06.2025	Полугодие	ММВБ
9.	КБ Восточный, 02, 40201460В	09.08.2018	Полугодие	ММВБ
10.	комитет финансов Волгоградской области, 05, RU35005VLO0	13.07.2019	Квартал	ММВБ
11.	Корпорация Иркут, БО-04, 4B02-04-00040-A	06.11.2023	Полугодие	ММВБ
12.	Липецкая область, 09, RU34009LIP0	04.06.2019	Квартал	ММВБ
13.	Международный инвестиционный банк, 04, RU000A0JUG98	06.11.2025	Полугодие	ММВБ
14.	Министерство управления финансами Самарской области, 10, RU35010SAM0	01.07.2021	Квартал	ММВБ
15.	Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 15, RU34015ANO0	30.10.2018	Квартал	ММВБ
16.	Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 16, RU34016ANO0	08.10.2019	Квартал	ММВБ
17.	Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0	09.11.2017	Квартал	ММВБ
18.	Министерство финансов Красноярского края, 08, RU34008KNA0	08.07.2018	Квартал	ММВБ
19.	Министерство финансов Красноярского края, 11, RU34011KNA0	29.10.2019	Квартал	ММВБ
20.	Министерство финансов Нижегородской области, 09, RU34009NJG0	26.08.2020	Полугодие	ММВБ
21.	Министерство финансов Омской области, 02, RU34002OMS0	15.10.2019	Квартал	ММВБ
22.	Министерство финансов Республики Коми, 11, RU35011KOM0	27.11.2019	Квартал	ММВБ
23.	Министерство финансов Республики Коми, 12, RU35012KOM0	23.06.2021	Полугодие	ММВБ
24.	Минфин России, 14, 26214RMFS	27.05.2020	Полугодие	ММВБ
25.	МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК, БО-07, 4B020701978В	30.10.2018	Полугодие	ММВБ
26.	Мэрия города Новосибирска, 06, RU35006NSB1	22.07.2020	Квартал	ММВБ
27.	НК Роснефть, 08, 4-08-00122-A	10.03.2023	Полугодие	ММВБ
28.	ПАО ВымпелКом, 04, 4-04-00027-A	08.03.2022	Полугодие	ММВБ
29.	Полюс Золото, БО-01, 4B02-01-55192-E	03.07.2025	Полугодие	ММВБ
30.	Правительство Белгородской области, 08, RU35008BELO	21.06.2021	Квартал	ММВБ
31.	Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLGO	05.12.2017	Квартал	ММВБ
32.	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры, 01, RU34001HMN0	13.10.2019	Квартал	ММВБ
33.	РВК-Финанс, БО-01, 4B02-01-36320-R	21.12.2020	Полугодие	ММВБ
34.	РЖД, 23, 4-23-65045-D	16.01.2025	Полугодие	ММВБ
35.	РусГидро, 09, 4-09-55038-E	15.04.2025	Полугодие	ММВБ
36.	Силовые машины, БО-01, 4B02-01-35909-Н	15.10.2025	Полугодие	ММВБ
37.	ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J	12.12.2017	Квартал	ММВБ
38.	Управление финансов Липецкой области, 08, RU35008LIP0	17.04.2020	Квартал	ММВБ
39.	Фольксваген Банк РУС, 08, 40803500В	19.10.2019	Полугодие	ММВБ
40.	Фольксваген Банк РУС, 09, 40903500В	20.10.2019	Полугодие	ММВБ
41.	ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D	22.06.2021	Полугодие	ММВБ
42.	ХК МЕТАЛЛОИНВЕСТ, 03, 4-03-25642-Н	27.01.2023	Полугодие	ММВБ

Генеральный директор

(подпись) / Волгин О.Н. /

Директор Департамента внутреннего учета

(подпись) / Мищенко В.Н. /

СПРАВКА
О НЕСОБЛЮДЕНИИ ТРЕБОВАНИЙ К СОСТАВУ И СТРУКТУРЕ АКТИВОВ
Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

13 апреля 2004 г. 0202-72729965

(дата и номер регистрации правил фонда)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование управляющей компании)

Лицензия Федеральной службы по финансовым рынкам на осуществление деятельности по управлению
инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами

7 февраля 2003 г. 21-000-1-00108

31 декабря 2015 г.

1. Несоблюдение требований к составу активов

Наименование имущества, приобретенного с нарушением требований к составу активов	Оценочная стоимость (тыс.рублей)	Доля в стоимости активов (процентов)	Дата приобретения	Дата отчуждения (предполагаемого отчуждения)
1	2	3	4	5

2. Несоблюдение требований к структуре активов

2.1. Несоблюдение ограничений, установленных в процентах от стоимости активов

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс.рублей)	Факт. доля в стоимости активов (процентов)	Доля в стоимости активов в соответствии с инвестиционной декларацией (процентов)	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7
Оценочная стоимость неликвидных ценных бумаг может составлять не более 10 процентов стоимости активов открытых паевых инвестиционных фондов и не более 50 процентов активов интервальных паевых инвестиционных фондов		9 287,41	13,5259	10,0000	20.11.2015	18.12.2015
	ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D	2 860,46	4,1659	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	Вертолеты России, БО-02, 4В02-02-12310-A	425,25	0,6193	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	Главное финансовое управление Кемеровской области, 01, RU34001KEM0	625,29	0,9107	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	РусГидро, 09, 4-09-55038-E	2 580,25	3,7578	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	АЛЬФА-БАНК, БО-10, 4В021001326В	592,80	0,8633	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLG0	1 413,35	2,0584	0,0000	20.11.2015	18.12.2015
	Международный инвестиционный банк, 04, RU000A0JUG98	790,00	1,1505	0,0000	20.11.2015	18.12.2015

2.2. Несоблюдение ограничений, установленных в процентах от количества размещенных (выданных) ценных бумаг

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс.рублей)	Факт. доля от количества размещенных (выданных) ценных бумаг (процентов)	Доля от количества размещенных (выданных) ценных бумаг в соответствии с инвестиционной декларацией (процентов)	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7

Генеральный директор

/ Волгин О.Н. /
(подпись)

Директор Департамента внутреннего учета

/ Мищенко В.Н. /
(подпись)

БАЛАНС ИМУЩЕСТВА, СОСТАВЛЯЮЩЕГО ПАЕВОЙ ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ФОНД

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал
Пенсионный резерв

(тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование

управляющей компании Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР

31 декабря 2015 г.

(тыс. рублей)

Имущество (обязательства)	Код стр.	На начало года	На конец года
1	2	3	4
Имущество, составляющее паевой инвестиционный фонд			
Денежные средства на банковских счетах, всего	010	1 770,56	2 018,44
в том числе:			
- в рублях	011	1 770,56	2 018,44
- в иностранной валюте	012		
Денежные средства в банковских вкладах, всего	020		
в том числе:			
- в рублях	021		
- в иностранной валюте	022		
Ценные бумаги российских эмитентов, имеющие признаваемую котировку, всего	030		
в том числе:			
- акции	031		
- облигации	032		
Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	040	56 432,81	65 430,09
в том числе:			
- акции	041	23,81	
- облигации	042	56 409,00	65 430,09
до 1 года		935,20	4 199,34
АЛЬФА-БАНК, БО-04, 4B020401326B			3 609,72
от 1 года до 3 лет		25 945,26	13 306,69
Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0		3 937,79	
ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J		3 438,42	
Минфин России, 77, 25077RMFS		3 695,49	
Минфин России, 03, 26203RMFS		3 955,47	
более 3 лет		29 528,54	47 924,07
RU35010SAM0			4 343,85
ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D		4 261,80	
- векселя	043		
- иные ценные бумаги	044		
Дебиторская задолженность в том числе:	050	2 141,84	1 504,62
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	051	1 088,64	172,87
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи	052		
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу	053	1 053,20	1 331,75
- прочая дебиторская задолженность	054		
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	060		
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	070	392,00	781,78
в том числе:			
- ценные бумаги иностранных государств	071		
- ценные бумаги международных финансовых организаций	072	392,00	781,78
- акции иностранных акционерных обществ	073		
- облигации иностранных коммерческих организаций	074		
Доли в российских обществах с ограниченной ответственностью	080		

Доходные вложения в материальные ценности, всего в том числе:	090		
- объекты недвижимого имущества, кроме строящихся и реконструируемых объектов	091		
- строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого	092		
- имущественные права на недвижимое имущество	093		
- проектно-сметная документация	094		
ИТОГО ИМУЩЕСТВО: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090)	100	60 737,21	69 734,93
Обязательства, исполнение которых осуществляется за счет			
Кредиторская задолженность	110	188,10	201,99
Резервы на выплату вознаграждений	120	346,45	286,68
Инвестиционные паи	130	60 202,66	69 246,27
ИТОГО ОБЯЗАТЕЛЬСТВА: (строки 110 + 120 + 130)	140	60 737,21	69 734,93

Генеральный директор

_____/ Волгин О.Н. /
(подпись)

Директор Департамента внутреннего учета

_____/ Мищенко В.Н. /
(подпись)

ОТЧЕТ
О ПРИРОСТЕ (ОБ УМЕНЬШЕНИИ) СТОИМОСТИ ИМУЩЕСТВА
Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование управляющей компании

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР

31 декабря 2015 г.

(тыс. рублей)

Наименование показателя	Код стр.	За отчетный период	За соответствующий период прошлого года
1	2	3	4
Выручка от продажи ценных бумаг	010	56 571,76	57 119,89
Расходы, связанные с продажей ценных бумаг	020	56 314,60	56 848,94
Результат от продажи ценных бумаг (010 - 020)	030	257,16	270,95
Выручка от продажи недвижимого имущества или передачи имущественных прав на недвижимое имущество	040	0,00	0,00
Расходы, связанные с продажей недвижимого имущества или передачей имущественных прав на недвижимое имущество	050	0,00	0,00
Результат от продажи недвижимого имущества или передачи имущественных прав на недвижимое имущество (040 - 050)	060	0,00	0,00
Выручка от продажи иного имущества	070	0,00	0,00
Расходы, связанные с продажей иного имущества	080	0,00	0,00
Результат от продажи иного имущества (070 - 080)	090	0,00	0,00
Процентный доход по банковским вкладам и ценным бумагам	100	5 993,68	4 186,92
Дивиденды по акциям	110	0,00	510,90
Прирост (уменьшение) средств в иностранной валюте	120	0,00	0,00
Выручка от сдачи недвижимого имущества в аренду	130	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, имеющих признаваемую котировку, всего	140	2,79	-1 146,84
в том числе:			
- акции	141	2,79	-1 130,70
- облигации	142	0,00	-16,14
- инвестиционные паи	143	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, не имеющих признаваемой котировки, всего	150	5 192,86	-5 917,63
в том числе:			
- акции	151	0,00	-129,97
- облигации	152	5 192,86	-5 787,67
- векселя	153	0,00	0,00
- иные ценные бумаги	154	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости недвижимого имущества или имущественных прав на недвижимое имущество	160	0,00	0,00
Вознаграждение и расходы, связанные с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом	170	2 627,27	2 591,55
в том числе резерв на выплату вознаграждений	171	2 578,91	2 548,32
Прочие доходы	180	346,45	296,76
Прочие расходы	190	0,00	0,00
Прирост имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, в результате выдачи инвестиционных паев	200	0,00	3,00
Уменьшение имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, в результате погашения или обмена инвестиционных паев	210	122,06	3 866,51
ИТОГО: прирост (+) или уменьшение (-) стоимости имущества принадлежащего акционерному инвестиционному фонду, или имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд (030 + 060 + 090 + 100 + 110 + 120 + 130 + 140 + 150 + 160+ 180 + 200 - 170 - 190 - 210)	220	9 043,61	-8 254,01

Генеральный директор

_____/ Волгин О.Н. /
(подпись)

Директор Департамента внутреннего учета

_____/ Мищенко В.Н. /
(подпись)

Отчет о владельцах акций акционерного инвестиционного фонда и владельцах инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование управляющей компании)

Дата определения владельцев инвестиционных паев 31.12.2015

Наименование показателя	Код строки	На начало отчетного года	На отчетную дату
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда, по которым зарегистрированы отчеты об итогах выпуска (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда), всего	100	39 007,87359	38 931,55083
из них:			
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находится в Российской Федерации	110	1 045,91782	969,59506
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	120	37 961,95577	37 961,95577
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находится за пределами территории Российской Федерации	130	0,00000	0,00000
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами территории Российской Федерации	140	0,00000	0,00000
находящихся у номинальных держателей	150	0,00000	0,00000
Количество лицевых счетов в реестре акционеров акционерного инвестиционного фонда (реестре владельцев инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда), всего	200	84	85
из них:			
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находится в Российской Федерации	210	82	83
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	220	1	1
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находится за пределами территории Российской Федерации	230	0	0
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами территории Российской Федерации	240	0	0
лицевых счетов номинальных держателей	250	1	1

Генеральный директор _____ / Волгин О.Н. /
(подпись)

Директор Департамента внутреннего учета _____ / Мищенко В.Н. /
(подпись)