

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2015 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Общество с ограниченной ответственностью "Управляющая компания "Альфа-Капитал" Д.У.
средствами пенсионных накоплений, 7728142469/770301001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У017

Дата и время составления расчёта: 11.01.2016 14:31:06

1. Денежные средства на счетах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (тыс. руб.)
	дата	номер		
1	2	3	4	5
АО "АЛЬФА-БАНК"	26.08.2010	б/н	40701810902750000153	2 389,48482
Итого денежных средств на счетах				2 389,48482

2. Денежные средства в депозитах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (тыс. руб.)	Проценты начисленные (тыс. руб.)
	дата	номер			
1	2	3	4	5	6
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					0,00000

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6
ГКО-ОФЗ	26203RMFS	985,918000000000	35 000,00	34 507,13000	-
ГКО-ОФЗ	26204RMFS	958,340000000000	10 000,00	9 583,40000	-
ГКО-ОФЗ	26205RMFS	915,315000000000	90 050,00	82 424,11575	-
ГКО-ОФЗ	26207RMFS	915,572000000000	61 500,00	56 307,67800	-
ГКО-ОФЗ	26208RMFS	940,383000000000	93 000,00	87 455,61900	-
ГКО-ОФЗ	26209RMFS	906,245000000000	33 500,00	30 359,20750	-
ГКО-ОФЗ	29011RMFS	1024,714000000000	70 000,00	71 729,98000	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				372 367,13025	

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации, специально выпущенных Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов				0,00000

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5
Итого рыночная стоимость облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации				0,00000

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Субфедеральная бумага	Администрация Ханты-Мансийского автономного округа	RU34001HNM0	1 015,200000000000	49 000,00	49 744,80000	-
Субфедеральная бумага	Министерство управления финансами Самарской области	RU35007SAM0	195,800000000000	30 000,00	5 874,00000	-
Субфедеральная бумага	Правительство Москвы	RU32048MOS0	803,100000000000	75 000,00	60 232,50000	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					115 851,30000	

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00000	

8. Облигации российских хозяйственных обществ

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию", ОАО	4-30-00739-A	1 001,300000000000	28 900,00	28 937,57000	-
Башнефть, Акционерная нефтяная компания, ОАО	4-07-00013-A	927,000000000000	70 000,00	64 890,00000	-
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-08-43801-H	999,300000000000	55 010,00	54 971,49300	-
ОАО "Газпром Нефть"	4-04-00146-A	944,400000000000	30 000,00	28 332,00000	-

ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B020701978B	974,000000000000	20 000,00	19 480,00000	-
ОАО "НК "Роснефть"	4-05-00122-A	960,200000000000	65 000,00	62 413,00000	-
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	949,900000000000	53 955,00	51 251,85450	-
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	974,000000000000	25 000,00	24 350,00000	-
ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"	4-03-25642-H	952,800000000000	30 000,00	28 584,00000	-
ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"	4-02-25642-H	953,400000000000	40 000,00	38 136,00000	-
ООО "Буровая компания "Евразия"	4-01-36403-R	978,500000000000	13 000,00	12 720,50000	-
Федеральная Сетевая Компания Единой Энергетической Системы ОАО	4-25-65018-D	982,700000000000	74 500,00	73 211,15000	-
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				487 277,56750	

8.1 Ценные бумаги международных финансовых организаций

Наименование эмитента	ISIN	CFI	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	4	5	6	7	8
Итого рыночная стоимость бумаг международных финансовых организаций					0,00000	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
ОАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-A	352,600000000000 ²	4 936,00	11 612,43360	-
ОАО "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	595,400000000000	28 100,00	16 730,74000	-
ОАО ГМК "Норильский никель"	обыкновенная	1-01-40155-F	173,000000000000 ⁹	465,00	4 265,44500	-
Сбербанк России ОАО	обыкновенная	10301481B	101,180000000000	120 700,00	12 212,42600	-
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					44 821,04460	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием				0,00000	

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 (тыс. руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия					0,00000	

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 (тыс. руб.)
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость паев (акций, долей) индексных инвестиционных фондов						0,00000

13. Дебиторская задолженность

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	
Наименование брокера	Сумма средств (тыс. руб.)
1	2
ЗАО "Сбербанк КИБ"	132,57667
Итого средств на специальных брокерских счетах	132,57667

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию", ОАО	4-30-00739-A	255,47600
Администрация Ханты-Мансийского автономного округа	RU34001HMN0	1 132,39000
Башнефть, Акционерная нефтяная компания, ОАО	4-07-00013-A	2 410,10000
Министерство Финансов Российской Федерации	26203RMFS	979,30000
Министерство Финансов Российской Федерации	26204RMFS	215,80000
Министерство Финансов Российской Федерации	26205RMFS	1 331,83950
Министерство Финансов Российской Федерации	26207RMFS	1 840,08000
Министерство Финансов Российской Федерации	26208RMFS	2 293,38000
Министерство Финансов Российской Федерации	26209RMFS	1 081,38000
Министерство Финансов Российской Федерации	29011RMFS	4 092,90000
Министерство управления финансами Самарской области	RU35007SAM0	35,70000
ОАО "ВЭБ-Лизинг"	4-08-43801-H	1 214,62080
ОАО "Газпром Нефть"	4-04-00146-A	532,50000
ОАО "Московский Кредитный Банк"	4B020701978B	309,20000
ОАО "НК "Роснефть"	4-05-00122-A	1 010,75000
ОАО "РусГидро"	4-07-55038-E	1 758,93300

ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	209,75000
ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"	4-02-25642-H	1 424,00000
ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"	4-03-25642-H	1 068,00000
ООО "Буровая компания "Евразия"	4-01-36403-R	23,92000
Правительство Москвы	RU32048MOS0	288,00000
Федеральная Сетевая Компания Единой Энергетической Системы ОАО	4-25-65018-D	1 632,29500
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		25 140,31430

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	
	25 272,89097

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

1 047 979,41814

тыс. 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	VTB00114-209172F025		
Дата и время отправки	12.01.2016 14:40:41	Дата и время приёма	12.01.2016 14:49:51
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 12.01.2016 11:39:28 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Литвинова Юлия Сергеевна дата и время ЭП 11.01.2016 11:32:31 UTC [00114-12] Электронная подпись верна		