

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.06.2014 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: 01.07.2014 15:11:33

**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                                  |
| ОАО "АЛЬФА-БАНК"                   | 26.08.2010                           | б/н   | 40701810902750000153        | 8 059.30232                        |
| Итого денежных средств на счетах   |                                      |       |                             | 8 059.30232                        |

**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          | 25077RMFS                                                               | 993,9660000          | 28 400,00        | 28 228.63440                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ГКО-ОФЗ          | 26205RMFS                                                               | 972,9800000          | 40 050,00        | 38 967.84900                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ГКО-ОФЗ          | 26207RMFS                                                               | 984,7000000          | 48 027,00        | 47 292.18690                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |

|                                                                                                      |           |             |           |               |                                                           |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-------------|-----------|---------------|-----------------------------------------------------------|
| ГКО-ОФЗ                                                                                              | 26208RMFS | 982,0290000 | 40 000,00 | 39 281.16000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле |           |             |           | 153 769.83030 |                                                           |

#### 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                                                                | Министерство управления финансами Самарской области | RU35007SAM0                                   | 582,0000000          | 30 000,00        | 17 460.00000                   | -                                                         |
| Субфедеральная бумага                                                                | Министерство финансов Нижегородской области         | RU34008NJG0                                   | 1 000,9000000        | 52 600,00        | 52 647.34000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации |                                                     |                                               |                      |                  | 70 107.34000                   |                                                           |

#### 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                                                            | 1 009,0000000        | 28 900,00        | 29 160.10000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| Башнефть, Акционерная нефтяная компания, ОАО          | 4-07-00013-A                                                            | 967,6000000          | 70 000,00        | 67 732.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "ВЭБ-Лизинг"                                      | 4-08-43801-H                                                            | 999,1000000          | 55 010,00        | 54 960.49100                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Вымпел-Коммуникации"                             | 4-04-00027-A                                                            | 997,5000000          | 20 000,00        | 19 950.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Вымпел-Коммуникации"                             | 4-02-00027-A                                                            | 997,0000000          | 31 500,00        | 31 405.50000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Газпром Нефть"                                   | 4-04-00146-A                                                            | 981,8000000          | 30 000,00        | 29 454.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Московский Кредитный Банк"                       | 4B020701978B                                                            | 964,5000000          | 20 000,00        | 19 290.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "НК "Роснефть"                                    | 4-05-00122-A                                                            | 987,0000000          | 65 000,00        | 64 155.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Промсвязьбанк"                                   | 4B020703251B                                                            | 1 002,8000000        | 55 000,00        | 55 154.00000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Россельхозбанк"                                  | 41503349B                                                               | 986,3000000          | 39 700,00        | 39 156.11000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |

|                                                                     |                 |               |           |               |                                                           |
|---------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------|-----------|---------------|-----------------------------------------------------------|
| ОАО "РусГидро"                                                      | 4-07-55038-E    | 978,9000000   | 39 510,00 | 38 676.33900  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО АФК "Система"                                                   | 4-03-01669-A    | 993,9000000   | 25 000,00 | 24 847.50000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"                            | 4-06-25642-H    | 999,7000000   | 50 000,00 | 49 985.00000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ООО "Буровая компания "Евразия"                                     | 4-01-36403-R    | 998,8000000   | 13 000,00 | 12 984.40000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"                                   | 4B02-04-36314-R | 83,6581500    | 20 000,00 | 1 673.16300   | -                                                         |
| ООО "Хоум Кредит энд Финанс Банк"                                   | 40700316B       | 1 006,4000000 | 23 000,00 | 23 147.20000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "РЕСО-Гарантия"                                                 | 4-03-00074-Z    | 999,8000000   | 45 000,00 | 44 991.00000  | -                                                         |
| Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ |                 |               |           | 606 721.80300 |                                                           |

### 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 "Аэрофлот - российские авиалинии" | обыкновенная          | 1-01-00010-A                                                            | 56,0300000           | 340 000,00       | 19 050.20000                   | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "Группа "ЛСР"                     | обыкновенная          | 1-01-55234-E                                                            | 587,9000000          | 6 002,00         | 3 528.57580                    | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |

|                                                                                                     |              |              |               |            |              |                                                           |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|---------------|------------|--------------|-----------------------------------------------------------|
| ОАО "ЛУКОЙЛ"                                                                                        | обыкновенная | 1-01-00077-A | 2 024,6000000 | 4 936,00   | 9 993.42560  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "МТС"                                                                                           | обыкновенная | 1-01-04715-A | 301,3100000   | 19 000,00  | 5 724.89000  | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| ОАО "НОВАТЭК"                                                                                       | обыкновенная | 1-02-00268-E | 417,6900000   | 28 100,00  | 11 737.08900 | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| Сбербанк России<br>ОАО                                                                              | обыкновенная | 10301481B    | 83,7100000    | 120 700,00 | 10 103.79700 | Открытое акционерное общество "Московская Биржа ММВБ-РТС" |
| Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ |              |              |               |            | 60 137.97740 |                                                           |

**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<br>(тыс. руб.) |
| 1                                                               | 2                            |
| ЗАО "Сбербанк КИБ"                                              | 35 407.14725                 |
| Итого средств на специальных брокерских счетах                  | 35 407.14725                 |

| Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям       |                                                                               |                                                   |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| Наименование эмитента                                                           | Государственный регистрационный<br>номер выпуска (дополнительного<br>выпуска) | Сумма дебиторской<br>задолженности<br>(тыс. руб.) |
| 1                                                                               | 2                                                                             | 3                                                 |
| "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию", ОАО                           | 4-30-00739-A                                                                  | 220.50700                                         |
| Башнефть, Акционерная нефтяная компания, ОАО                                    | 4-07-00013-A                                                                  | 2 359.00000                                       |
| Министерство Финансов Российской Федерации                                      | 25077RMFS                                                                     | 909.36800                                         |
| Министерство Финансов Российской Федерации                                      | 26205RMFS                                                                     | 567.10800                                         |
| Министерство Финансов Российской Федерации                                      | 26207RMFS                                                                     | 1 404.78975                                       |
| Министерство Финансов Российской Федерации                                      | 26208RMFS                                                                     | 961.60000                                         |
| Министерство управления финансами Самарской области                             | RU35007SAM0                                                                   | 96.00000                                          |
| Министерство финансов Нижегородской области                                     | RU34008NNG0                                                                   | 1 759.99600                                       |
| ОАО "ВЭБ-Лизинг"                                                                | 4-08-43801-H                                                                  | 822.39950                                         |
| ОАО "Вымпел-Коммуникации"                                                       | 4-02-00027-A                                                                  | 748.44000                                         |
| ОАО "Вымпел-Коммуникации"                                                       | 4-04-00027-A                                                                  | 504.40000                                         |
| ОАО "Газпром Нефть"                                                             | 4-04-00146-A                                                                  | 512.10000                                         |
| ОАО "Московский Кредитный Банк"                                                 | 4B020701978B                                                                  | 304.20000                                         |
| ОАО "НК "Роснефть"                                                              | 4-05-00122-A                                                                  | 964.60000                                         |
| ОАО "Промсвязьбанк"                                                             | 4B020703251B                                                                  | 1 774.30000                                       |
| ОАО "Россельхозбанк"                                                            | 41503349B                                                                     | 463.69600                                         |
| ОАО "РусГидро"                                                                  | 4-07-55038-E                                                                  | 1 260.36900                                       |
| ОАО АФК "Система"                                                               | 4-03-01669-A                                                                  | 191.75000                                         |
| ОАО Холдинговая компания "Металлоинвест"                                        | 4-06-25642-H                                                                  | 1 257.50000                                       |
| ООО "Буровая компания "Евразия"                                                 | 4-01-36403-R                                                                  | 14.95000                                          |
| ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"                                               | 4B02-04-36314-R                                                               | 34.40000                                          |
| ООО "Хоум Кредит энд Финанс Банк"                                               | 40700316B                                                                     | 411.70000                                         |
| ОАО "РЕСО-Гарантия"                                                             | 4-03-00074-Z                                                                  | 986.85000                                         |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям |                                                                               | 18 530.02325                                      |

| Прочая дебиторская задолженность               |                                                   |
|------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| Наименование дебиторской задолженности         | Сумма дебиторской<br>задолженности<br>(тыс. руб.) |
| 1                                              | 2                                                 |
| Итого прочая дебиторская задолженность         | 0.00000                                           |
| Итого дебиторская задолженность<br>(тыс. руб.) | 53 937.17050                                      |

**14. Итого рыночная стоимость активов,  
составляющих инвестиционный портфель  
управляющей компании****952 733.42352****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    | VTB00114-185228F025                                                                                                                                                                                                                   |                     |                    |
| Дата и время отправки   | 02.07.2014 9:44:45                                                                                                                                                                                                                    | Дата и время приёма | 02.07.2014 9:44:42 |
| Подписано               | 1. Литвинова Юлия Сергеевна дата и время ЭП 01.07.2014 11:12:28 UTC<br>[00114-12]<br>Электронная подпись верна<br>2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 02.07.2014 5:43:07 UTC<br>[00001-1]<br>Электронная подпись верна |                     |                    |