

**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 и субъектов РФ	Департамент финансов Томской области	RU34048TMS0	759,84	249 911	189 892 374,24	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тверской области	RU34009TVE0	481,40987288	236	113 612,73	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	620,88	22 007	13 663 706,16	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34004TUL0	1 009,1	22 000	22 200 200,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34006KNA0	383,84	65 622	25 188 348,48	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34008KNA0	991,6	33 186	32 907 237,60	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34009KNA0	994,8	28 157	28 010 583,60	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34010KNA0	1 025,5	54 898	56 297 899,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34011KNA0	1 002,1	16 800	16 835 280,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Нижегородской области	RU34008NJG0	783,84	4 310	3 378 350,40	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Нижегородской области	RU34009NJG0	776,05	351 703	272 939 113,15	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	ДФ ЯО	RU34012YRS0	945,6	70 799	66 947 534,40	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Омской области	RU34002OMS0	806	46 100	37 156 600,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	290,4	45 000	13 068 000,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	995	163 996	163 176 020,00	Средняя цена
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	1 000	86 996	86 996 000,00	Средняя цена

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

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

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
мэрия города Новосибирска	RU35006NSB1	692,1750003	16 575	11 472 800,63	Средняя цена
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				11 472 800,63	

8. Облигации российских хозяйственных обществ

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

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

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

8.1 Ценные бумаги международных финансовых организаций

Наименование эмитента	ISIN	CFI	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	4	5	6	7	8
Итого рыночная стоимость бумаг международных финансовых организаций					0,00	

9. Акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ

Наименование эмитента	Категория и тип акций	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
ОАО "НОВАТЭК"	Обыкновенные акции АО РФ	1-02-00268-E	595,4	1	595,40	Средняя цена
ПАО "Аэрофлот"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00010-A	56,1	20	1 122,00	Средняя цена
ПАО "Интер РАО"	Обыкновенные акции АО РФ	1-04-33498-E	1,0925	496	541,88	Средняя цена
ПАО "Ростелеком"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00124-A	91,24	1	91,24	Средняя цена
ПАО "Т Плюс"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-55113-E	0,51	1	0,51	Средняя цена
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					2 351,03	

10. Облигации с ипотечным покрытием, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием				0,00	

11. Ипотечные сертификаты участия, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах

Индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия с данным ипотечным покрытием	Наименование управляющей компании ипотечным покрытием	Регистрационный номер правил доверительного управления ипотечным покрытием	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия					0,00	

12. Паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов

Вид ценных бумаг	Наименование фонда	Наименование управляющего активами фонда	Номер выпуска или иные реквизиты ценных бумаг	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость в рублях по курсу Банка России (руб.)
1	2	3	4	5	6	7
Итого рыночная стоимость паев (акций, долей) индексных инвестиционных фондов						0,00

13. Дебиторская задолженность

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	
Наименование брокера	Сумма средств (руб.)
1	2
Закрытое акционерное общество "Сбербанк КИБ"	75 941 331,50
Итого средств на специальных брокерских счетах	75 941 331,50

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

Правительство Белгородской области	RU34006BELO	64 564,36
Правительство Белгородской области	RU35007BELO	750 049,35
Правительство Белгородской области	RU35008BELO	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	RU34008NJK0	115 766,60
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-08-65018-D	583 780,60
Минфин Нижегородской области	RU34009NJK0	9 372 884,95
Минфин Омской области	RU34002OMS0	894 801,00
Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	49 950,00
Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	1 434 965,00
Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	5 233 679,36
Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	333 804,24
Минфин Хакасии	RU35003HAK0	732 404,40
Минфин Хакасии	RU35004HAK0	225 300,00
МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ПАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ"	40201460B	2 258 632,32
МУФ СО	RU35008SAM0	9 738,40
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-11-65018-D	188 810,40
МУФ СО	RU35010SAM0	2 650 900,71
МФ и НП НСО	RU34015ANO0	616 279,00
МФ и НП НСО	RU34016ANO0	843 494,72
мэрия города Новосибирска	RU35006NSB1	188 623,50
ОАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК"	4B020701978B	488 613,30
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	182 320,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	538 778,39
ОАО "НК "Роснефть"	4-09-00122-A	5 010,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-10-00122-A	62 625,00
ОАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	184 267,44
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-13-65018-D	86 675,52
ОАО "Полюс Золото"	4B02-01-55192-E	17 720 613,69
ОАО "Полюс Золото"	4B02-02-55192-E	20 048 511,38
ОАО "РЖД"	4-23-65045-D	9 716 341,34
ОАО "РЖД"	4-28-65045-D	2 455 572,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	73 832,00
ОАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001P	1 109 050,00
Облфин	RU35002VLO0	256 170,60
Облфин	RU35005VLO0	73 530,00
ООО "Газпром капитал"	4-05-36400-R	68 775,00
ООО "ДелоПортс"	4-01-36485-R	1 880 019,25
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-18-65018-D	22 315,28
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4-08-36383-R	126 699,30
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	2 678 297,70
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-03-36241-R	32 592,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-06-36027-R	52 165,62
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	1 433 935,30
ООО "Мираторг Финанс"	4B02-03-36276-R	437 875,27
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	25 883,00
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	20 898,00
ООО "ХК Финанс"	4-01-36426-R	888 067,00
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	82 183,96
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-19-65018-D	365 936,59
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	24 780,00
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	26 625,00

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

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

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

7 357 606 623,53 руб. **

* Указывается наименование организатора торговли на рынке ценных бумаг (фондовой биржи), которым определена рыночная цена, если рыночная цена определена указанным организатором торговли (фондовой биржей).

** Рассчитывается как сумма итоговых статей по активам 1 - 13.

Руководитель

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-103734F025		
Дата и время отправки	13.01.2016 9:27:27	Дата и время приёма	13.01.2016 9:28:31
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 13.01.2016 6:26:06 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 11.01.2016 11:38:01 UTC [00126-7] Электронная подпись верна		