

Расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, пассивных инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов

Код формы по ОКУД 0420514
Месячная

Раздел I. Реквизиты управляющей компании

Полное наименование управляющей компании	Номер лицензии управляющей компании
1	2
Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв	21-000-1-00108

Раздел II. Параметры расчета собственных средств

Текущая отчетная дата	Предыдущая отчетная дата
1	2
30.11.2017	31.10.2017

Раздел III. Расчет собственных средств

в рублях

Наименование показателя	Код строки	Сумма (стоимость, величина) на текущую отчетную дату	Сумма (стоимость, величина) на предыдущую отчетную дату
1	2	3	4
Подраздел «Активы, принятые к расчету собственных средств»			
Денежные средства – всего	01	154 173 638.39	154 313 174.76
в том числе:			
на счетах в кредитных организациях	01.01	33 776 487.71	22 007 366.53
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	120 397 150.68	132 305 808.23
Ценные бумаги – всего	02	0.00	0.00
в том числе:			
облигации – всего	02.01	0.00	0.00
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	0.00	0.00
государственные ценные бумаги Российской Федерации	02.01.02	0.00	0.00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	02.01.03	0.00	0.00
муниципальные ценные бумаги	02.01.04	0.00	0.00
облигации иностранных коммерческих организаций	02.01.05	0.00	0.00
облигации иностранных государств	02.01.06	0.00	0.00
облигации международных финансовых организаций	02.01.07	0.00	0.00
акции – всего	02.02	0.00	0.00
в том числе:			
российских акционерных обществ	02.02.01	0.00	0.00
иностраных акционерных обществ	02.02.02	0.00	0.00
Недвижимое имущество	03	0.00	0.00
Дебиторская задолженность	04	14 871.71	5 087.73

Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	154 188 510.10	154 318 262.49
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	24 164 596.60	21 122 420.14
Подраздел «Размер собственных средств»			
Размер собственных средств (разность строк 05 - 06)	07	130 023 913.50	133 195 842.35
Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	22 380 326.31	22 382 877.66
Указание на соответствие размера собственных средств управляющей компании требованиям к минимальному размеру собственных средств (соответствует/ не соответствует)	СООТВЕТСТВУЕТ		

Руководитель управляющей компании (лицо, исполняющее обязанности
руководителя управляющей компании)



О.Н. Волгин

(инициалы, фамилия)

Расшифровка строки подраздела «Активы, принятые к расчету собственных средств»

01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, с которой заключен договор (договоры) банковского счета	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета	Вид банковского счета (расчетный, другие счета)	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированной с лицом, управляющей компанией (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	1000	80	RUB (Российский рубль)	Расчетный	33 761 342.71	21.90	ruAAA, Эксперт РА	Нет
2	Банк ВТБ 24 (публичное акционерное общество)	1027739207462	1623	-	RUB (Российский рубль)	Расчетный	6 345.00	0.00	ruAAA+, Эксперт РА	Нет
3	"ГАЗПРОМБАНК" (акционерное общество)	1027700167110	354	-	RUB (Российский рубль)	Расчетный	8 600.00	0.01	ruAA+, Эксперт РА; AA(RU), АКРА	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	33 776 487.71	21.91	X	X

01.02. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, в которой открыт счет по депозиту	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета по депозиту	Дата возврата денежных средств	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированной с лицом, управляющей компанией (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X

1	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	1000	80	RUB (Российский рубль)	31.01.2018	120 397 150.68	78.08	п/ААА-Эксперт РА	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	120 397 150.68	78.08	X	X

02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	OJPN эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2		4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	OJPN эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12

Итого	X	X	X	X	X			0.00	0.00	X			
-------	---	---	---	---	---	--	--	------	------	---	--	--	--

02.01.03. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование субъекта Российской Федерации, от имени которого выданы ценные бумаги	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочно и кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указанные на то, кем он присвоен)	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.04. Муниципальные ценные бумаги

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование муниципального образования, от имени которого выданы ценные бумаги, согласно уставу муниципального образования	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочно и кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указанные на то, кем он присвоен)	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого X	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.05. Облигации иностранных коммерческих организаций

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если имеется)	Код валюты	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочный кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен)	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1		3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого X	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.06. Облигации иностранных государств

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочный кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен)	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
Итого X	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого X		X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого X	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.02.01. Акции российских акционерных обществ

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого X	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.02.02. Акции иностранных акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	ТIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в котировальном списке первого уровня которой включены акции	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
		X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X
Итого	X						X	0.00	0.00		X

03. Недвижимое имущество

Номер строки	Кадастровый (условный) номер объекта или указание на то, что кадастровый (условный) номер не присвоен	Вид объекта	Назначение объекта недвижимого имущества (для земельных участков - категория земель и вид разрешенного использования)	Код государства, на территории которого расположен объект недвижимости	Адрес (местоположение) объекта	Общая стоимость актива, в рублях	Стоимость актива, принятая к расчету собственных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Полное наименование организации, с которой заключен договор об оценке	ИНН организации, с которой заключен договор об оценке	Фамилия, имя, отчество (при наличии последнего) оценщика, составившего отчет об оценке	Полное наименование организации, составившей положительное экспертное заключение на отчет об оценке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
		X	X	X	X	X	X	0.00	X	X	X	X
Итого	X							0.00	X	X		X

04. Дебиторская задолженность

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование должника	Место нахождения должника	ОГРН (ТIN) должника по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности должника, а также указание на то, кем он присвоен	Должник является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Прочие расчеты с разными дебиторами и кредиторами	Договор № 809764/2015-16 1 ДС 7 от 11.10.17	31.12.2017	ООО "СТРАХОВАЯ КОМПАНИЯ ТИНГОСТРАХ - ЖИЗНЬ"	125171, Москва ГОРОД, Ленинградское шоссе, дом № 16, строение 9	1037739872939	14 871.71	0.01	RUAAA, Эксперт РА	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	14 871.71	0.01	X	X

Расшифровки строки 06 подраздела «Обязательства»

06.01. Кредиторская задолженность (кредитор – физическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Фамилия, имя, отчество (при наличии последнего) кредитора	Сведения о документе удостоверяющем личность кредитора	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8
Итого	X	X	X	X	X	0.00	0.00

06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Место нахождения кредитора	ОГРН (ТIN) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
Итого	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00

1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Расчеты с поставщиками	Договор №А02-11 от 01.12.2011	14.12.2017	АО ВТБ КАПИТАЛ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ	123112, г. Москва, Пресненская наб., д.10	1027739323600	725 675.02	3.00
2	Прочие расчеты с различными дебиторами и кредиторами	Договор №77050102-00514/04 от 29.09.17	28.09.2018	ООО СТРАХОВАЯ КОМПАНИЯ «ВТБ СТРАХОВАНИЕ»	101000, ГОРОД МОСКВА, БУЛЬВАР ЧИСТОПРУДНЫЙ, ДОМ 8, СТРОЕНИЕ 1	1027700462514	654 673.86	2.71
Итого	X	X	X	X	X	X	1 380 348.88	5.71

06.03. Иные обязательства

Номер строки	Вид (описание) обязательства	Основание возникновения обязательства	Размер обязательства, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5
1	Резерв на выплату головной премии	Бухгалтерская справка	16 644 123.00	68.88
2	Резерв на аудиторские услуги	Бухгалтерская справка	2 994 970.00	12.39
3	Отложенное налоговое обязательство	Бухгалтерская справка	1 229 843.03	5.09
4	Резерв по неиспользованным отпускам, страховым взносам	Бухгалтерская справка	1 028 006.63	4.25
5	Резерв на услуги (прочие)	Бухгалтерская справка	317 936.50	1.32
Итого	X	X	22 214 879.16	91.93

Руководитель управляющей компании (лично, исполняющее обязанности) **руководитель**

 **О.Н. Волгин**

(инициалы, фамилия)



Пояснительная записка к справке о стоимости чистых активов ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

1. Сведения об активах, принятых к расчету собственных средств, которые переданы в доверительное управление: Нет
2. Сведения об обязательствах по сделкам, заключенным в рамках доверительного управления, принятых к расчету собственных средств: Нет
3. Сведения о событиях, в результате которых в течение отчетного месяца размер собственных средств изменился более чем на 10%: Да
4. Иная информация: Нет

Таблица: Сведения о событиях, в результате которых в течение отчетного месяца размер собственных средств изменился более чем на 10%

Номер	Сведения о событиях, в результате которых размер собственных средств	Велич
1	02.11.2017 – выдача займа в размере 20 000 000 руб.	-15
2	30.11.2017 – возврат займа в размере 20 000 000 руб.	18