

Приложение 12
к Указанию Банка России
от 16 декабря 2015 года N 3901-У
"О сроках и порядке составления и
представления в Банк России
отчетности акционерного инвестиционного
фонда и отчетности управляющей
компания инвестиционных фондов,
паевых инвестиционных фондов и
негосударственных пенсионных фондов"

Расчет
собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых 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
31.10.2016	30.09.2016

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	106 592 562,01	180 914 608,63
в том числе:		21 592 562,01	10 914 608,63
на счетах в кредитных организациях	01.01		
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	85 000 000,00	170 000 000,00
Ценные бумаги - всего	02	0,00	0,00
в том числе:		0,00	0,00
облигации - всего	02.01		
в том числе:		0,00	0,00
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01		
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
иностраннх акционерных обществ	02.02.02	0,00	0,00
Недвижимое имущество	03		
Дебиторская задолженность	04	113 580,09	9 689 093,31
Общая стоимость активов (сумма <u>строк</u> <u>01 + 02 + 03 + 04</u>)	05	106 706 142,10	190 603 701,94
Подраздел "Обязательства"			
Общая величина обязательств	06	20 927 202,25	104 849 441,18
Размер собственных средств			
Размер собственных средств (разность <u>строк 05 - 06</u>)	07	85 778 939,85	85 754 260,76
Норматив достаточности собственных средств			
Норматив достаточности собственных средств	08	10 000 000,00	10 000 000,00
Указание на соответствие размера собственных средств нормативу достаточности (СООТВЕТСТВУЕТ/ НЕ СООТВЕТСТВУЕТ)	СООТВЕТСТВУЕТ		

Расшифровки строк 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 кредитной организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	1000	-	RUB	Расчетный	21 590 543,01	20,24	BB+, S&P	нет
2	Банк ВТБ 24 (публичное акционерное общество)	1027739207462	1623	-	RUB	Расчетный	2 019,00	0,00	Ba1, Moody's	нет
Итого	x	x	x	x	x	x	21 592 562,01	20,24	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 кредитной организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Банк ВТБ (публичное акционерное общество)	1027739609391	1000	-	RUB	23.01.2017	85 000 000,00	79,66	BB+, S&P	нет
Итого	x	x	x	x	x	x	85 000 000,00	79,66	x	x

02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН 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 активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	13
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x			x	x

02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	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 долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	x	x			x	x

02.01.03. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование субъекта Российской Федерации, от имени которого выпущены 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 долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	13
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x			x	x

02.01.04. Муниципальные ценные бумаги

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование муниципального образования, от имени которого выпущены 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 долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	13
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x			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 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 долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	x	x			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)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	x	x			x	x

02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

Номер строки	Наименование эмитента	TIN эмитента	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 долгосрочной кредитоспособности выпуска (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
Итого	x	x	x	x	x	x			x	x

02.02.01. Акции российских акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Категория (тип) акций	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости и активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в котировальный список первого (высшего) уровня которой включены акции	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (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	13	14
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x			x	x	x

02.02.02. Акции иностранных акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	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 (высшего) уровня которой включены акции	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компанией (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	x	x	x	x	x	x			x	x	x

03. Недвижимое имущество

Номер строки	Кадастровый номер объекта (если имеется)	Вид объекта	Назначение объекта недвижимого имущества (для земельных участков - категория земель и вид разрешенного использования)	Код государства, на территории которого располагается 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	Оценщик/организация является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
Итого	x	x	x	x	x				x	x	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	Начисленные проценты по депозитному вкладу	Договор № 270716DJ 59982329 от 27.07.16	23.01.2017	Банк ВТБ ПАО	190000, г. Санкт-Петербург, ул. Большая Морская, 29	1027739609391	110 314,21	0,1	BB+, S&P	нет
2	Расчеты по медицинскому страхованию	Договор 77050108-00017 от 13.11.15	30.11.2016	ООО СК "ВТБ Страхование"	101000, г. Москва, Чистопрудный бульвар, д 8, стр 1	1027700462514	3 265,88	0,00	BB+, S&P	нет
Итого							113 580,09	0,1	x	X

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 (ТИН) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Авансы полученные от покупателей	Договор №1 от 28.06.2016	31.12.2016	АО ВТБ Страхование жизни	107078, г. Москва, Мясницкая ул., дом 48	1057749632753	448 446,33	2,14
2	Расчеты с поставщиками	Договор №АД-С002-16 от 01.03.2016	31.10.2016	АО ВТБ КАПИТАЛ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ	123317, Москва г., Пресненская НАБЕРЕЖНАЯ, дом № 10	1027739323600	804 093,11	3,84
Итого	x	x	x	x	x	x	1 252 539,44	5,98

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	8	9
1	Резерв на выплату годовой премии	Бухгалтерская справка	15 640 360,00	74,74
2	Резерв на аудиторские услуги	Бухгалтерская справка	2 722 702,00	13,01
3	Резерв по неиспользованным отпускам, страховым взносам	Бухгалтерская справка	992 184,36	4,74
Итого	х	х	19 355 246,36	92,49

Руководитель управляющей компании



Волгин

(инициалы, фамилия)

Волгин Олег Николаевич