

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.06.2016 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: 01.07.2016

**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	38 131 195,73
Акционерный коммерческий банк "Банк Москвы" (открытое акционерное общество)	28.07.2003	31-076/01/278	40701810600760000051	2 160,48
Итого денежных средств на счетах				38 133 356,21

**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	"Правительство Республики Башкортостан"	RU34008BAS0	764,96	100 000	76 496 000,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	392,92	3 000	1 178 760,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34006KNA0	394	28 130	11 083 220,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34009KNA0	1 020,7	30 519	31 150 743,30	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34010KNA0	1 061,4	55 898	59 330 137,20	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34011KNA0	1 043,4	16 800	17 529 120,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Нижегородской области	RU34008NJK0	797,44	3 560	2 838 886,40	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Омской области	RU34002OMS0	832,8	52 900	44 055 120,00	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	298,65	25 000	7 466 250,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	763,95	12 956	9 897 736,20	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	1 042,96477504	128 602	134 127 356,00	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	Администрация Волгоградской области	RU35002VLO0	295,26168255	38 473	11 359 602,71	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	786	10 700	8 410 200,00	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	Минфин Хакасии	RU35003HAK0	963	69 160	66 601 080,00	ММВБ
Гос.облигации и субъектов РФ	МУФ СО	RU35008SAM0	99,28	12 158	1 207 046,24	Расчет
Гос.облигации и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34015ANO0	821,27	44 420	36 480 813,40	ММВБ

Гос. облигации и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34016ANO0	1 031,2	13 705	14 132 596,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU34006BEL0	194,9	32 941	6 420 200,90	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU35008BEL0	856,8	65 584	56 192 371,20	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32048MOS0	856,5	314 565	269 424 922,50	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34007LIP0	197,54	4 673	923 104,42	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34009LIP0	709,8	199 300	141 463 140,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Администрация Волгоградской области	RU35005VLO0	696,64	21 500	14 977 760,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU35008LIP0	801,04	125 713	100 701 141,52	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	ДФ ЯО	RU35013YRS0	851,955	6 101	5 197 777,46	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Комитет финансов Санкт-Петербурга	RU25039GSP0	984,8	3 100	3 052 880,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34015KAR0	98,46	38 447	3 785 491,62	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34016KAR0	780,72	1 000	780 720,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35006RSY0	702,17	20 770	14 584 070,90	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Ставропольского края	RU34001STV0	196,76	4 850	954 286,00	ММББ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 151 802 533,97	

### 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	726,37500003	160 575	116 637 665,63	Расчет
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				116 637 665,63	

### 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	968,6	2	1 937,20	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-07-00739-A	249,575	9	2 246,18	ММББ

АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-08-00739-A	287,76	102 523	29 502 018,48	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-09-00739-A	193,82627984	1 801	349 081,13	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-10-00739-A	475,25	1 582	751 845,50	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-11-00739-A	679,07	1 000	679 070,00	ММВБ
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-16-00739-A	923,36357835	4 231	3 906 751,30	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-21-00739-A	438,84	58 202	25 541 365,68	Расчет
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	993,6	889	883 310,40	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	1 022,8	6 853	7 009 248,40	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020901326B	997	87 499	87 236 503,00	ММВБ
"Силовые машины" ОАО	4B02-01-35909-H	1 039,6	69 064	71 798 934,40	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021101326B	1 000,2	1 444	1 444 288,80	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	1 002,7	10 000	10 027 000,00	Расчет
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 020,9	86 848	88 663 123,20	Расчет
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021501326B	1 001,2	1 000	1 001 200,00	Расчет
АО "Вертолеты России"	4B02-02-12310-A	979,5	94 766	92 823 297,00	Расчет
АО "МХК "ЕвроХим"	4-02-31153-H	1 040,2	32 000	33 286 400,00	Расчет
АО "ПГК"	4-01-55521-E	1 044,8	40 000	41 792 000,00	ММВБ
АО "ПГК"	4-05-55521-E	1 048,5	84 000	88 074 000,00	Расчет
АО "ПКТ"	4-01-03924-J	1 032,3	73 502	75 876 114,60	Расчет
АО "ПКТ"	4-02-03924-J	1 047,6	82 600	86 531 760,00	ММВБ
"Силовые машины" ОАО	4B02-02-35909-H	1 038,4	35 000	36 344 000,00	ММВБ
АО "ПКТ"	4-03-03924-J	1 025,6	166 525	170 788 040,00	ММВБ
АО "Россельхозбанк"	41503349B	1 007,3	70 000	70 511 000,00	ММВБ
АО "Тойота Банк"	40103470B	1 008,9	14 500	14 629 050,00	ММВБ
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	979,7	91 550	89 691 535,00	ММВБ
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	977,5	1	977,50	Расчет
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4B02-02-25642-H	1 034	233 200	241 128 800,00	ММВБ
АО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	677,97299999	377 894	256 201 928,86	Расчет
Банк ГПБ (АО)	4B022100354B	1 007,4	78 930	79 514 082,00	Расчет
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020102495B	1 002,4	20 000	20 048 000,00	Расчет
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020502495B	1 008,9	60 000	60 534 000,00	ММВБ
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-06-65018-D	902	19 938	17 984 076,00	Расчет
КБ "МИА" (АО)	4B020303344B	1 006,1	6 270	6 308 247,00	ММВБ
ОАО "АК "Транснефть"	4B02-05-00206-A	1 011,6	160 001	161 857 011,60	ММВБ
ОАО "НК "Роснефть"	4-05-00122-A	984,1	6 600	6 495 060,00	ММВБ
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	970	392	380 240,00	Расчет
ОАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	971,5	291	282 706,50	Расчет
ОАО "НК "Роснефть"	4-09-00122-A	957,3	1 000	957 300,00	Расчет
ОАО "НК "Роснефть"	4-10-00122-A	961,3	12 500	12 016 250,00	Расчет
ОАО "РЖД"	4-28-65045-D	959,8	107 100	102 794 580,00	ММВБ
ОАО "РЖД"	4B02-07-65045-D	1 024,1	26 000	26 626 600,00	ММВБ
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	994,2	609	605 467,80	ММВБ
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-08-65018-D	932,1	25 831	24 077 075,10	Расчет

ОАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001 P	1 048	44 392	46 522 816,00	ММВБ
ООО "БКЕ"	4B02-01-36403-R-001 P	1 009,5	150 000	151 425 000,00	ММВБ
ООО "Газпром капитал"	4-04-36400-R	967,7	12 000	11 612 400,00	ММВБ
ООО "ДелоПортс"	4-01-36485-R	1 030	146 323	150 712 690,00	ММВБ
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4-08-36383-R	1 027,6	341 998	351 437 144,80	ММВБ
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	996,7	69 765	69 534 775,50	ММВБ
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-05-36241-R	1 018,3	154 300	157 123 690,00	ММВБ
ООО "Лента"	4-01-36420-R	1 022,5	70 000	71 575 000,00	Расчет
ООО "МегаФон Финанс"	4-06-36027-R	968,8	10 110	9 794 568,00	Расчет
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	965	36 890	35 598 850,00	Расчет
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-13-65018-D	941,5	185 187	174 353 560,50	Расчет
ООО "РВК-Финанс"	4B02-01-36320-R	1 015,5	169 700	172 330 350,00	Расчет
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	1 002,5	2 486	2 492 215,00	ММВБ
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	1 002,5	887	889 217,50	ММВБ
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	998,7	92 940	92 819 178,00	ММВБ
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	1 022,1	31 000	31 685 100,00	ММВБ
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	983,1	90 789	89 254 665,90	ММВБ
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 018,4	14 750	15 021 400,00	ММВБ
ПАО "Магнит"	4B02-03-60525-P-001 P	1 009,6	66 998	67 641 180,80	ММВБ
ПАО "Магнит"	4B02-11-60525-P	1 014	8 501	8 620 014,00	ММВБ
ПАО "МегаФон"	4B02-05-00822-J	1 018	39 991	40 710 838,00	ММВБ
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-18-65018-D	902,62648636	4 289	3 871 365,00	Расчет
ПАО "МОЭСК"	4B02-08-65116-D	1 004,7	71 000	71 333 700,00	Расчет
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	977,8	10 446	10 214 098,80	Расчет
ПАО "ОГК-2"	4B02-01-65105-D-001 P	1 022	8 401	8 585 822,00	ММВБ
ПАО "ОГК-2"	4B02-02-65105-D-001 P	1 021,5	57 900	59 144 850,00	ММВБ
ПАО "Полюс Золото"	4B02-01-55192-E	1 055	96 456	101 761 080,00	ММВБ
ПАО "Полюс Золото"	4B02-02-55192-E	1 053,00030587	179 786	189 314 712,99	Расчет
ПАО "Ростелеком"	4B02-01-00124-A	1 015	490	497 350,00	Расчет
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	982,2	31 024	30 471 772,80	ММВБ
ПАО "РусГидро"	4-09-55038-E	1 036,8	109 870	113 913 216,00	Расчет
ПАО "РусГидро"	4B02-04-55038-E-001 P	1 011,9	58 000	58 690 200,00	ММВБ
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-19-65018-D	955,80471389	12 198	11 658 905,90	Расчет
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-10-65134-D	1 032,6	247 600	255 671 760,00	ММВБ
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	978,9	700	685 230,00	Расчет
ПАО "Энел Россия"	4B02-06-50077-A	1 018,90540541	148 000	150 798 000,00	Расчет
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	988,4	501	495 188,40	ММВБ
ПАО АНК "Башнефть"	4-07-00013-A	972,8	279 986	272 370 380,80	ММВБ
ПАО АНК "Башнефть"	4-09-00013-A	969,8	145 705	141 304 709,00	Расчет
ПАО КБ "Восточный"	40201460B	666,7	43 302	28 869 443,40	ММВБ
ПАО РОСБАНК	41202272B	1 010,6	50	50 530,00	Расчет
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-25-65018-D	996,8	473	471 486,40	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				5 408 285 978,12	

**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	645,3	1	645,30	ММВБ
ПАО "Аэрофлот"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00010-A	84,8	20	1 696,00	ММВБ
ПАО "Интер РАО"	Обыкновенные акции АО РФ	1-04-33498-E	2,494	496	1 237,02	ММВБ
ПАО "Ростелеком"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00124-A	91,98	1	91,98	ММВБ
ПАО "Т Плюс"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-55113-E	0,54	1	0,54	Расчет
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					3 670,84	

**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"	158 487 530,88
Итого средств на специальных брокерских счетах	158 487 530,88

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	10 363,43
ПАО "Полюс Золото"	4B02-02-55192-E	10 012 282,34
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 "РусГидро"	4B02-04-55038-E-001P	1 381 560,00
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-10-65134-D	6 623 300,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	24 500,00
ПАО "Энел Россия"	4B02-06-50077-A	1 373 440,00
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	16 858,65
ПАО АНК "Башнефть"	4-07-00013-A	9 639 917,98
Администрация Волгоградской области	RU35002VLO0	156 585,11
ПАО АНК "Башнефть"	4-09-00013-A	5 016 623,15
ПАО КБ "Восточный"	40201460B	2 258 632,32
ПАО РОСБАНК	41202272B	1 430,00
Правительство Белгородской области	RU34006BEL0	64 564,36
Правительство Белгородской области	RU35008BEL0	48 532,16
Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32048MOS0	1 145 016,60
Управление финансов Липецкой области	RU34007LIP0	7 850,64
Управление финансов Липецкой области	RU34009LIP0	922 759,00
Управление финансов Липецкой области	RU35008LIP0	1 391 642,91
Администрация Волгоградской области	RU35005VLO0	59 125,00
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-07-00739-A	36,00
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-08-00739-A	96 371,62

АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-09-00739-A	3 403,89
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	2 360,00
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-16-00739-A	14 343,09
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-21-00739-A	290 427,98
"Правительство Республики Башкортостан"	RU34008BAS0	102 000,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	13 459,46
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	159 949,02
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020901326B	2 622 345,03
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021101326B	74 207,16
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021301326B	335 100,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	2 985 834,24
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021501326B	8 470,00
АО "Вертолеты России"	4B02-02-12310-A	795 086,74
АО "МХК "ЕвроХим"	4-02-31153-H	21 760,00
АО "ПГК"	4-01-55521-E	1 294 400,00
"Силовые машины" ОАО	4B02-01-35909-H	1 489 710,48
АО "ПГК"	4-05-55521-E	2 250 360,00
АО "ПКТ"	4-01-03924-J	237 411,46
АО "ПКТ"	4-02-03924-J	3 913 588,00
АО "ПКТ"	4-03-03924-J	5 247 202,75
АО "Россельхозбанк"	41503349B	1 223 600,00
АО "Тойота Банк"	40103470B	478 355,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-02-25642-H	3 259 180,00
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	35,60
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4B02-02-25642-H	6 506 280,00
АО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	1 432 218,26
"Силовые машины" ОАО	4B02-02-35909-H	754 950,00
Банк ПБ (АО)	4B022100354B	2 451 565,80
ДФ ЯО	RU35013YRS0	2 928,48
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020102495B	492 400,00
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020502495B	571 800,00
КБ "МИА" (АО)	4B020303344B	50 473,50
Комитет финансов Санкт-Петербурга	RU25039GSP0	18 879,00
Министерство финансов Республики Карелия	RU34015KAR0	67 282,25
Министерство финансов Республики Карелия	RU34016KAR0	11 070,00
Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35006RSY0	3 946,30
Министерство финансов Ставропольского края	RU34001STV0	3 734,50
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-06-65018-D	450 598,80
Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	11 010,00
Минфин Красноярского края	RU34006KNA0	178 062,90
Минфин Красноярского края	RU34009KNA0	836 525,79
Минфин Красноярского края	RU34010KNA0	311 351,86
Минфин Красноярского края	RU34011KNA0	312 312,00
Минфин Нижегородской области	RU34008NJG0	95 621,60
Минфин Омской области	RU34002OMS0	1 026 789,00
Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	27 750,00
Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	84 214,00



Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	6 891 781,18
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-08-65018-D	583 780,60
Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	143 166,00
Минфин Хакасии	RU35003HAK0	732 404,40
МУФ СО	RU35008SAM0	4 498,46
МФ и НП НСО	RU34015ANO0	507 720,60
МФ и НП НСО	RU34016ANO0	320 971,10
мэрия города Новосибирска	RU35006NSB1	1 795 228,50
ОАО "АК "Транснефть"	4B02-05-00206-A	3 099 219,37
ОАО "НК "Роснефть"	4-05-00122-A	102 630,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	8 933,68
ОАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	6 631,89
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-13-65018-D	87 037,89
ОАО "НК "Роснефть"	4-09-00122-A	5 010,00
ОАО "НК "Роснефть"	4-10-00122-A	62 625,00
ОАО "РЖД"	4-28-65045-D	2 069 172,00
ОАО "РЖД"	4B02-07-65045-D	623 740,00
ОАО АФК "Система"	4-03-01669-A	5 109,51
ОАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001P	1 200 803,60
ООО "БКЕ"	4B02-01-36403-R-001P	379 500,00
ООО "Газпром капитал"	4-04-36400-R	330 120,00
ООО "ДелоПортс"	4-01-36485-R	1 880 250,55
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4-08-36383-R	119 699,30
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-18-65018-D	23 975,51
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-02-36241-R	1 686 917,70
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-05-36241-R	4 838 848,00
ООО "Лента"	4-01-36420-R	2 569 000,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-06-36027-R	250 424,70
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	913 765,30
ООО "РВК-Финанс"	4B02-01-36320-R	188 367,00
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	57 724,92
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	20 321,17
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	2 725 000,80
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	768 180,00
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-19-65018-D	446 324,82
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	612 825,75
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	552 240,00
ПАО "Магнит"	4B02-03-60525-P-001P	1 536 934,12
ПАО "Магнит"	4B02-11-60525-P	196 203,08
ПАО "МегаФон"	4B02-05-00822-J	861 806,05
ПАО "МОЭСК"	4B02-08-65116-D	1 262 380,00
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	184 267,44
ПАО "ОГК-2"	4B02-01-65105-D-001P	97 955,66
ПАО "ОГК-2"	4B02-02-65105-D-001P	675 114,00
ПАО "Полюс Золото"	4B02-01-55192-E	5 371 634,64
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		133 095 922,92

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2

Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	291 583 453,80

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

**7 006 446 658,57 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	VTB00126-110462F025		
Дата и время отправки	01.07.2016 15:46:47	Дата и время приёма	01.07.2016 15:49:17
Подписано	'1. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 01.07.2016 12:45:31 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 01.07.2016 10:41:09 UTC [00126-7] Электронная подпись верна'		