

Расчёт стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений, по состоянию на 30.09.2013 г.**Пенсионный фонд Российской Федерации, 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)

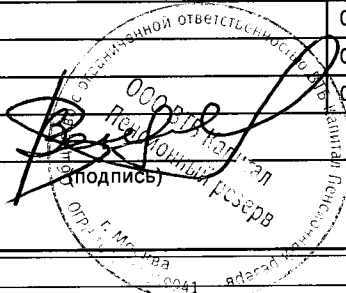
Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У048

Дата и время составления расчёта: 30.09.2013 12:07:25

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства в рублях на счетах в кредитных организациях	010	260 088,37195
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	1 169 175,33328
Ценные бумаги, в том числе:	030	5 011 238,45585
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	1 462 944,86696
муниципальные облигации	033	78 186,74000
облигации российских хозяйственных обществ	034	2 767 628,24480
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	702 478,60409
паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	036	0,00000
облигации с ипотечным покрытием, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	037	0,00000
ипотечные сертификаты участия, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	038	0,00000
ценные бумаги международных финансовых организаций	039	0,00000
Дебиторская задолженность, в том числе:	040	288 997,40662
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	218 243,92511
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	70 753,48151
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000
Прочие активы	050	0,00000
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	6 729 499,56770
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	0,00000
кредиторская задолженность по перечислению средств на формирование имущества, предназначенного для обеспечения уставной деятельности негосударственного пенсионного фонда	073	0,00000
кредиторская задолженность по перечислению средств в негосударственный пенсионный фонд для исполнения им своих текущих обязательств	074	0,00000
прочая кредиторская задолженность	075	0,00000
Итого сумма обязательств	080	0,00000
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	6 729 499,56770

Генеральный директор

Зензинов Б.В.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)
М.П.

(И.О. Фамилия)

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-71557F015		
Дата и время отправки	01.10.2013 17:30:31	Дата и время приёма	01.10.2013 20:02:53
Подписано	1. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 01.10.2013 8:29:28 UTC [00126-6] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 01.10.2013 13:26:28 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2013 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 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: 30.09.2013 12:07:25

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
Акционерный коммерческий банк "Банк Москвы" (открытое акционерное общество)	28.07.2003	31-076/01/278	40701810600760000051	2,14512
Банк ВТБ 24 (закрытое акционерное общество)	07.08.2012	ДА0173/1	40701810300000010173	260 086,22683
Итого денежных средств на счетах				260 088,37195

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
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	19.12.2012	191212DJ3449839	42006810000260000009	475 000,00000	35 292,018 21
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	15.01.2013	150113DJ4079219	42006810400260000010	280 000,00000	18 802,191 78
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	22.01.2013	220113DJ4268926	42006810700260000011	338 000,00000	22 081,123 29
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				1 169 175,33328	

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
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				0,00000	

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	"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34006KNA0	1 015,8	449 698	456 803,22840	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34007LIP0	817,44	5 550	4 536,79200	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU35008LIP0	996	8 800	8 764,80000	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация Волгоградской области"	RU35002VLO0	910,17	53 910	49 067,26470	Средняя цена

Субфедеральная бумага	"Администрация Вологодской области"	RU34002VLG0	1 042,5	35 751	37 270,41750	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Администрация Вологодской области"	RU34003VLG0	1 034,7	400	413,88000	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Администрация Краснодарского края"	RU34004KND0	1 022,2	269 754	275 742,53880	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация Нижегородской области"	RU34008NJG0	1 048,1	19 104	20 022,90240	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация Самарской области"	RU35008SAM0	661,80974057	13 260	8 775,59716	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Администрация Самарской области"	RU35009SAM0	1 003,4	30 000	30 102,00000	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация Свердловской области"	RU34001SVS0	715,19	44 799	32 039,79681	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Администрация Свердловской области"	RU34002SVS0	1 024	57 000	58 368,00000	Средняя цена

Субфедеральная бумага	"Администрация Тульской области"	RU34002TUL0	707,21	20 000	14 144,20000	ММВБ
Субфедеральная бумага	"Администрация Ярославской области"	RU34011YRS0	1 018,6	27 199	27 704,90140	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Администрация Ярославской области"	RU34012YRS0	1 000,2	70 000	70 014,00000	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Комитет финансов администрации Ленинградской области"	RU26002LEN	1 061,6	1 670	1 772,87200	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Министерство Финансов Республики Коми"	RU32010KOM0	1 024	45 000	46 080,00000	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Правительство Белгородской области"	RU34006BELO	1 016,7	56 642	57 587,92140	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Правительство Республики Башкортостан"	RU34007BAS0	1 019	19 999	20 378,98100	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Правительство Чувашской республики"	RU34009CHU0	674,70039997	87 232	58 855,46529	Средняя цена

Субфедеральная бумага	"Республика Карелия"	RU34014KAR0	768,3	224	172,09920	Средняя цена
Субфедеральная бумага	"Республика Карелия"	RU34015KAR0	1 021,2	40 000	40 848,00000	Средняя цена
Субфедеральная бумага	Правительство Нижегородской области	RU34009NJG0	1 011,3	8 003	8 093,43390	ММВБ
Субфедеральная бумага	Республика Марий Эл	RU34006MAR0	1 009,4	134 125	135 385,77500	Средняя цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 462 944,86696	

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
	RU34005VGG1	912,6	30 000	27 378,00000	ММВБ
"Администрация Муниципального Образования Город Краснодар"	RU34002KRA1	509,3	7 000	3 565,10000	Средняя цена
"Администрация Новосибирской области"	RU34005NSB1	1 021,2	33 450	34 159,14000	Средняя цена
"Администрация Новосибирской области"	RU35006NSB1	1 006,5	13 000	13 084,50000	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				78 186,74000	

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

"ФСК ЭЭС"ОАО	4-13-65018-D	980,1	161 900	158 678,19000	Средняя цена
"ФСК ЭЭС"ОАО	4-19-65018-D	1 000,2	9 000	9 001,80000	ММВБ
"ФСК ЭЭС"ОАО	4-21-65018-D	1 031,2	90 000	92 808,00000	ММВБ
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 018,5	50 000	50 925,00000	ММВБ
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4B02-01-00739-A	1 000	13 000	13 000,00000	Средняя цена
"Акрон" ОАО	4-04-00207-A	1 002,1	29 432	29 493,80720	ММВБ
"ВТБ-Лизинг Финанс" ООО	4-01-36292-R	231,07696133	1 810	418,24930	Средняя цена
"Европлан" ЗАО	4-03-56453-P	1 020,8	100 000	102 080,00000	Средняя цена
"Международный Банк Азербайджана-Москва", ООО	40103395B	1 010	112 000	113 120,00000	ММВБ
"Мираторг Финанс" ООО	4B02-03-36276-R	1 008,5	9 850	9 933,72500	ММВБ
Акционерный коммерческий банк "РОСБАНК" (открытое акционерное общество)	4B020502272B	1 021,1	7 001	7 148,72110	ММВБ
Акционерный коммерческий банк "РОСБАНК" (открытое акционерное общество)	4B020702272B	1 000	100 000	100 000,00000	Средняя цена
Газпромбанк ОАО	4B020600354B	1 001,4	18 000	18 025,20000	ММВБ

Группа ЛСР (ОАО)	4-03-55234-E	1 010	221 200	223 412,00000	ММВБ
Группа ЛСР (ОАО)	4-04-55234-E	1 020,3	19 000	19 385,70000	ММВБ
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-03-55234-E	1 003	11 968	12 003,90400	ММВБ
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-05-55234-E	997,7	32 873	32 797,39210	ММВБ
ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	1 087,8	191 000	207 769,80000	ММВБ
Закрытое акционерное общество "Банк Интеза"	40302216B	1 000,5	64 300	64 332,15000	ММВБ
Закрытое акционерное общество "Банк Русский Стандарт"	4B020202289B	1 013,5	17 096	17 326,79600	ММВБ
Закрытое акционерное общество "Банк Русский Стандарт"	4B020602289B	1 002,2	4 000	4 008,80000	Средняя цена
Коммерческий банк "Центр-Инвест", ОАО	4B020602225B	1 013,2	12 500	12 665,00000	Средняя цена
Кредит Европа Банк	4B020503311B	1 006,1	23 200	23 341,52000	ММВБ
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	1 006,5	28 000	28 182,00000	ММВБ
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-01-00027-A	1 013,1	118 870	120 427,19700	ММВБ
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-02-00027-A	1 013,6	12 799	12 973,06640	ММВБ
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-04-00027-A	1 013,6	110 000	111 496,00000	ММВБ

ОАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	1 024,3	70 000	71 701,00000	ММВБ
ОАО "НК "Роснефть"	4-04-00122-A	1 029,6	12 400	12 767,04000	ММВБ
ОАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	1 005	73 000	73 365,00000	Средняя цена
ОАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ"	40201460B	1 021,1	42 793	43 695,93230	ММВБ
Общество с ограниченной ответственностью "ВТБ Капитал Финанс"	4-02-36408-R	1 000	30 000	30 000,00000	Средняя цена
Общество с ограниченной ответственностью "ВТБ Капитал Финанс"	4-11-36408-R	1 017,2	530 000	539 116,00000	ММВБ
Общество с ограниченной ответственностью "Русфинанс Банк"	4B020301792B	1 022,4	70 000	71 568,00000	Средняя цена
Общество с ограниченной ответственностью Коммерческий банк "Ренессанс Капитал"	4B020203354B	1 005,8	112 100	112 750,18000	ММВБ
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	40202766B	1 000,3	1 005	1 005,30150	ММВБ
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	4B020102766B	997,3	5 499	5 484,15270	ММВБ
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	4B020202766B	1 010,1	85 000	85 858,50000	ММВБ
Открытое акционерное общество "Промсвязьбанк"	4B020303251B	1 002,7	29 766	29 846,36820	ММВБ
Центр по перевозке грузов в контейнерах ТрансКонтейнер	4-02-55194-E	1 009,5	94 816	95 716,75200	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				2 767 628,24480	

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 "НОВАТЭК"	обыкновенная	1-02-00268-E	385,06	1	0,38506	ММВБ
"ИНТЕР РАО ЕЭС" ОАО	обыкновенная	1-03-33498-E	0,011266	49 600	0,55879	ММВБ
"Мосэнерго" ОАО	обыкновенная	1-01-00085-A	1,0478	24 231 000	25 389,24180	ММВБ
"Территориальная генерирующая компания № 1" ОАО	обыкновенная	1-01-03388-D	0,006357	4 011 900 000	25 503,64830	ММВБ
"Энел ОГК-5" ОАО	обыкновенная	1-01-50077-A	1,1096	17 000	18,86320	ММВБ

Акционерный коммерческий Сберегательный банк Российской Федерации (открытое акционерное общество)	обыкновенная	10301481В	97,73	1 103 850	107 879,26050	ММВБ
Акционерный коммерческий Сберегательный банк Российской Федерации (открытое акционерное общество)	привилегированная	20301481В	74,97	1 221 500	91 575,85500	ММВБ
Банк ВТБ (открытое акционерное общество)	обыкновенная	10401000В	0,04281	1 646 660 000	70 493,51460	ММВБ
Группа ЛСР (ОАО)	обыкновенная	1-01-55234-Е	564,7	57 719	32 593,91930	ММВБ
ОАО "АЭРОФЛОТ"	обыкновенная	1-01-00010-А	54,27	2 420	131,33340	ММВБ
ОАО "ЛУКОЙЛ"	обыкновенная	1-01-00077-А	2 064,2	103 940	214 552,94800	ММВБ
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	обыкновенная	1-01-04715-А	321,53	117 820	37 882,66460	ММВБ
ОАО "Ростелеком"	обыкновенная	1-01-00124-А	102,63	1	0,10263	ММВБ

ОАО "Татнефть"	обыкновенная	1-03-00161-A	213,88	280	59,88640	ММВБ
ОАО "Татнефть"	привилегированная	2-03-00161-A	111,55	793 450	88 509,34750	ММВБ
ОАО «Межрегиональная распределительная сетевая компания Центра»	обыкновенная	1-01-10214-A	0,2625	30 046 000	7 887,07500	ММВБ
ОАО ТГК-5	обыкновенная	1-01-12190-E	0,0027	2	0,00001	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					702 478,60409	

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 (тыс. руб.)
1	2
ЗАО "Сбербанк КИБ"	19 608,66223
ЗАО "Сбербанк КИБ"	198 635,26288
Итого средств на специальных брокерских счетах	218 243,92511

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
	RU34005VGG1	76,50000
"ФСК ЕЭС"ОАО	4-13-65018-D	3 393,42400
"ФСК ЕЭС"ОАО	4-19-65018-D	145,08000
"ФСК ЕЭС"ОАО	4-21-65018-D	3 430,80000
ОАО "НОВАТЭК"	4B02-02-00268-E	1 921,50000
"Агентство по ипотечному жилищному кредитованию" ОАО	4B02-01-00739-A	13,52000
"Администрация (правительство) Красноярского края"	RU34006KNA0	17 520,23408
"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU34007LIP0	133,58850
"Администрация (правительство) Липецкой области"	RU35008LIP0	149,42400
"Администрация Волгоградской области"	RU35002VLO0	685,19610
"Администрация Вологодской области"	RU34002VLG0	125,12850
"Администрация Вологодской области"	RU34003VLG0	2,13600

"Администрация Краснодарского края"	RU34004KND0	3 042,82512
"Администрация Муниципального Образования Город Краснодар"	RU34002KRA1	124,25000
"Администрация Нижегородской области"	RU34008NJG0	170,21664
"Администрация Новосибирской области"	RU34005NSB1	474,65550
"Администрация Новосибирской области"	RU35006NSB1	184,73000
"Администрация Самарской области"	RU35008SAM0	25,45920
"Администрация Самарской области"	RU35009SAM0	348,30000
"Администрация Свердловской области"	RU34001SVS0	159,48444
"Администрация Свердловской области"	RU34002SVS0	404,13000
"Администрация Тульской области"	RU34002TUL0	19,80000
"Администрация Ярославской области"	RU34011YRS0	250,50279
"Администрация Ярославской области"	RU34012YRS0	1 169,00000
"Акрон" ОАО	4-04-00207-A	1 040,42120
"ВТБ-Лизинг Финанс" ООО	4-01-36292-R	4,90510
"Европлан" ЗАО	4-03-56453-P	4 500,00000
"Комитет финансов администрации Ленинградской области"	RU26002LEN	61,82340
"Международный Банк Азербайджана-Москва", ООО	40103395B	3 364,48000
"Министерство Финансов Республики Коми"	RU32010KOM0	1 220,40000
"Мираторг Финанс" ООО	4B02-03-36276-R	485,80200
"Правительство Белгородской области"	RU34006BELO	744,84230
"Правительство Республики Башкортостан"	RU34007BAS0	129,39353
"Правительство Чувашской республики"	RU34009CHU0	1 060,74112
"Республика Карелия"	RU34014KAR0	5,60896

"Республика Карелия"	RU34015KAR0	692,00000
Акционерный коммерческий банк "РОСБАНК" (открытое акционерное общество)	4B020502272B	102,98471
Акционерный коммерческий банк "РОСБАНК" (открытое акционерное общество)	4B020702272B	2,00000
Газпромбанк ОАО	4B020600354B	19,44000
Группа ЛСР (ОАО)	4-03-55234-E	1 185,63200
Группа ЛСР (ОАО)	4-04-55234-E	919,41000
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-03-55234-E	34,22848
Группа ЛСР (ОАО)	4B02-05-55234-E	511,17515
ЗАО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	876,69000
Закрытое акционерное общество "Банк Интеза"	40302216B	2 726,96300
Закрытое акционерное общество "Банк Русский Стандарт"	4B020202289B	27,35360
Закрытое акционерное общество "Банк Русский Стандарт"	4B020602289B	154,52000
Коммерческий банк "Центр-Инвест", ОАО	4B020602225B	17,50000
Кредит Европа Банк	4B020503311B	979,96800
ОАО "ГМК "Норильский никель"	4B02-02-40155-F	194,04000
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-01-00027-A	374,44050
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-02-00027-A	21,75830
ОАО "Вымпел-Коммуникации"	4-04-00027-A	346,50000
ОАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	1 907,50000
ОАО "НК "Роснефть"	4-04-00122-A	449,87200
ОАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	159,87000
ОАО КБ "ВОСТОЧНЫЙ"	40201460B	733,47202

Общество с ограниченной ответственностью "ВТБ Капитал Финанс"	4-02-36408-R	10,50000
Общество с ограниченной ответственностью "ВТБ Капитал Финанс"	4-11-36408-R	169,60000
Общество с ограниченной ответственностью "Русфинанс Банк"	4B020301792B	2 895,90000
Общество с ограниченной ответственностью Коммерческий банк "Ренессанс Капитал"	4B020203354B	1 836,19800
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	40202766B	1,36680
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	4B020102766B	74,23650
Открытое акционерное общество "ОТП Банк"	4B020202766B	660,45000
Открытое акционерное общество "Промсвязьбанк"	4B020303251B	385,76736
Правительство Нижегородской области	RU34009NJG0	64,26409
Республика Марий Эл	RU34006MAR0	2 977,57500
Центр по перевозке грузов в контейнерах ТрансКонтейнер	4-02-55194-E	2 652,00352
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		70 753,48151

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	288 997,40662

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

6 729 499,56770

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

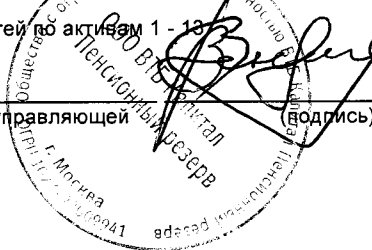
Генеральный директор

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

Зензинов Б.В.

(И.О. Фамилия)

М.П.



Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00126-71561F025		
Дата и время отправки	01.10.2013 17:27:27	Дата и время приёма	01.10.2013 17:29:29
Подписано	1. Зензинов Борис Валерьевич дата и время ЭП 01.10.2013 8:29:42 UTC [00126-6] Электронная подпись верна 2. Лукоянов Владимир Александрович дата и время ЭП 01.10.2013 13:26:19 UTC [00001-1] Электронная подпись верна		