

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.09.2016 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: 03.10.2016

**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	101 555 644,96
Акционерный коммерческий банк "Банк Москвы" (открытое акционерное общество)	28.07.2003	31-076/01/278	40701810600760000051	1 762,21
Итого денежных средств на счетах				101 557 407,17

**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	624	100 000	62 400 000,00	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Свердловской области	RU34001SVS0	199,74	3 000	599 220,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Ставропольского края	RU34001STV0	197	4 850	955 450,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тверской области	RU34009TVE0	498,2	149 994	74 727 010,80	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	396,2	3 000	1 188 600,00	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Тульской области	RU34004TUL0	932,94	8	7 463,52	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34006KNA0	396,8	28 130	11 161 984,00	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34007KNA0	685,79	7 726	5 298 413,54	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34009KNA0	1 022,6	49 128	50 238 292,80	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34010KNA0	1 071,9	55 898	59 917 066,20	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Красноярского края	RU34011KNA0	1 056,2	33 781	35 679 492,20	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Администрация Волгоградской области	RU35002VLO0	199	18 493	3 680 107,00	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Нижегородской области	RU34008NJK0	399,96	3 560	1 423 857,60	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Нижегородской области	RU34009NJK0	676,9	239 266	161 959 155,40	ММВБ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Омской области	RU34002OMS0	834,72	56 200	46 911 264,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	299,73	24 321	7 289 733,33	ММВБ

Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	513	18 940	9 716 220,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	899,64	140 308	126 226 689,12	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	592,68	10 700	6 341 676,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Минфин Хакасии	RU35003HAK0	967,7	78 359	75 828 004,30	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	МУФ СО	RU34011SAM0	899,98	142	127 797,16	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	МУФ СО	RU35008SAM0	99,25	16 063	1 594 252,75	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Администрация Волгоградской области	RU35005VLO0	699,44	21 500	15 037 960,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	МУФ СО	RU35010SAM0	707,07	1 000	707 070,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34015ANO0	821,27	44 420	36 480 813,40	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	МФ и НП НСО	RU34016ANO0	927,72	13 705	12 714 402,60	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU34006BEL0	196,9	31 273	6 157 653,70	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Белгородской области	RU35008BEL0	862,58	65 584	56 571 446,72	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32048MOS0	884,4	293 518	259 587 319,20	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34007LIP0	197,92	5 050	999 496,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU34009LIP0	710,92	199 300	141 686 356,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Управление финансов Липецкой области	RU35008LIP0	711,3	142 450	101 324 685,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Финансовое управление Тамбовской области	RU35002TMB0	1 003,5	27 500	27 596 250,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Департамент финансов Томской области	RU34048TMS0	782,16008871	102 811	80 414 660,88	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	ДФ ЯО	RU35013YRS0	708,54	106 060	75 147 752,40	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Комитет финансов Санкт-Петербурга	RU25039GSP0	984,8	3 100	3 052 880,00	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34015KAR0	99,25	18 445	1 830 666,25	Расчет
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Карелия	RU34016KAR0	586,2	1 000	586 200,00	ММББ
Гос. облигации и субъектов РФ	Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35006RSY0	706,49495019	22 684	16 026 131,45	Расчет

Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации	1 579 193 493,32
--	------------------

### 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	735,375	220 889	162 436 248,38	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				162 436 248,38	

### 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	984,9	2	1 969,80	ММВБ
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-10-00739-A	487,5	1 582	771 225,00	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-11-00739-A	485,05	1 000	485 050,00	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-16-00739-A	974,5	4 231	4 123 109,50	ММВБ
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	998,7	1 889	1 886 544,30	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	1 023,8	8 453	8 654 181,40	Расчет
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021101326B	1 004,3	1 444	1 450 209,20	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	1 024	119 991	122 870 784,00	ММВБ
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021501326B	1 001,2	1 000	1 001 200,00	Расчет
АО "Вертолеты России"	4B02-02-12310-A	993,8	94 763	94 175 469,40	ММВБ
"ФСК ЭЭС" ПАО	4-06-65018-D	902,01141697	19 944	17 989 715,70	Расчет
АО "КБ ДельтаКредит"	4B022603338B	1 010,5	406	410 263,00	ММВБ
АО "МХК "ЕвроХим"	4-02-31153-Н	1 040,1	32 000	33 283 200,00	Расчет
АО "МХК "ЕвроХим"	4B02-01-31153-Н-001 P	1 022,1	40 000	40 884 000,00	ММВБ
АО "ПГК"	4-05-55521-E	1 065,4	84 000	89 493 600,00	Расчет
АО "ПКТ"	4-01-03924-J	1 059,9	73 702	78 116 749,80	Расчет
АО "ПКТ"	4-02-03924-J	1 058,7	82 600	87 448 620,00	Расчет
АО "ПКТ"	4-03-03924-J	1 036,5	173 525	179 858 662,50	ММВБ
АО "РН Банк"	40100170B	1 010,7	20 002	20 216 021,40	ММВБ
АО "Россельхозбанк"	41503349B	1 010,9	70 000	70 763 000,00	ММВБ
АО "Тойота Банк"	40103470B	1 014	18 902	19 166 628,00	ММВБ
"ФСК ЭЭС" ПАО	4-08-65018-D	932,19458002	26 144	24 371 295,10	Расчет
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-Н	992,5	1	992,50	ММВБ
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4B02-02-25642-Н	1 049,1	266 200	279 270 420,00	ММВБ
АО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	569,52	381 866	217 480 324,32	ММВБ
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020102495B	1 002,4	20 000	20 048 000,00	Расчет
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020502495B	1 003,1	60 000	60 186 000,00	ММВБ
КБ "МИА" (АО)	4B020303344B	1 012,2	6 270	6 346 494,00	ММВБ

ОАО "РЖД"	4-28-65045-D	972,3	107 100	104 133 330,00	Расчет
ОАО "РЖД"	4B02-07-65045-D	1 031,6	26 000	26 821 600,00	ММВБ
ООО "БКЕ"	4B02-01-36403-R-001 P	1 019	150 000	152 850 000,00	Расчет
ООО "Газпром капитал"	4-04-36400-R	966,8	12 000	11 601 600,00	Расчет
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-13-65018-D	974,9	145 448	141 797 255,20	Расчет
ООО "ДелоПортс"	4-01-36485-R	1 040,7	146 323	152 278 346,10	ММВБ
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4-08-36383-R	1 044,5	382 298	399 310 261,00	ММВБ
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-05-36241-R	1 023,5	161 300	165 090 550,00	ММВБ
ООО "Лента"	4-01-36420-R	1 025	70 000	71 750 000,00	Расчет
ООО "Лента"	4-03-36420-R	1 036,5	3 500	3 627 750,00	ММВБ
ООО "МегаФон Финанс"	4-06-36027-R	978,5	137 010	134 064 285,00	ММВБ
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	978,2	36 890	36 085 798,00	ММВБ
ООО "РВК-Финанс"	4B02-01-36320-R	1 015,5	169 700	172 330 350,00	Расчет
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	1 003,5	2 486	2 494 701,00	Расчет
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	1 003,4	887	890 015,80	Расчет
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-18-65018-D	902,62648636	4 289	3 871 365,00	Расчет
ООО "Фольксваген Банк РУС"	41003500B	1 006,5	70 000	70 455 000,00	ММВБ
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	999,4	92 940	92 884 236,00	ММВБ
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	1 021,1	54 500	55 649 950,00	ММВБ
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	981	115 000	112 815 000,00	ММВБ
ПАО "Газпром нефть"	4-10-00146-A	991,8	11 200	11 108 160,00	ММВБ
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	988,5	145 086	143 417 511,00	ММВБ
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001 P	1 023,9	14 750	15 102 525,00	Расчет
ПАО "Магнит"	4B02-11-60525-P	1 009,6	8 501	8 582 609,60	ММВБ
ПАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	985	392	386 120,00	ММВБ
ПАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	971,5	291	282 706,50	Расчет
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-19-65018-D	975,3	12 198	11 896 709,40	Расчет
ПАО "НК "Роснефть"	4-09-00122-A	957,3	1 000	957 300,00	Расчет
ПАО "НК "Роснефть"	4-10-00122-A	971,8	12 500	12 147 500,00	Расчет
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	988,5	10 443	10 322 905,50	ММВБ
ПАО "ОГК-2"	4B02-01-65105-D-001 P	1 027,3	8 402	8 631 374,60	ММВБ
ПАО "ОГК-2"	4B02-02-65105-D-001 P	1 020,6	57 900	59 092 740,00	ММВБ
ПАО "Полюс Золото"	4B02-01-55192-E	1 104,8	70	77 336,00	ММВБ
ПАО "Ростелеком"	4B02-01-00124-A	1 011,8	490	495 782,00	Расчет
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	994,9	31 024	30 865 777,60	Расчет
ПАО "РусГидро"	4-09-55038-E	1 036,85927533	109 070	113 090 241,16	Расчет
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-10-65134-D	1 048,1	227 600	238 547 560,00	ММВБ
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-25-65018-D	991,3	473	468 884,90	Расчет
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-11-65134-D	1 006,8	94 894	95 539 279,20	Расчет
ПАО "Силовые машины"	4B02-01-35909-H	1 043,5	79 367	82 819 464,50	ММВБ
ПАО "Силовые машины"	4B02-02-35909-H	1 043,5	35 000	36 522 500,00	ММВБ
ПАО "Трансконтейнер"	4-04-55194-E	742,5	700	519 750,00	ММВБ
ПАО "Транснефть"	4B02-03-00206-A-001 P	1 009,3	73 404	74 086 657,20	ММВБ
ПАО "Транснефть"	4B02-05-00206-A	1 031,2	160 001	164 993 031,20	ММВБ
ПАО "Энел Россия"	4B02-06-50077-A	1 018,90540541	148 000	150 798 000,00	Расчет
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	992	501	496 992,00	ММВБ
ПАО АНК "Башнефть"	4-07-00013-A	994,9	279 989	278 561 056,10	ММВБ
ПАО АНК "Башнефть"	4-09-00013-A	993,1	145 705	144 699 635,50	ММВБ

АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-08-00739-A	292,77	102 523	30 015 658,71	Расчет
ПАО АФК "Система"	4-03-01669-A	997,3	602	600 374,60	ММВБ
ПАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001 P	1 053,4	44 393	46 763 586,20	ММВБ
ПАО КБ "Восточный"	40201460B	998,3	43 302	43 228 386,60	ММВБ
ПАО Сбербанк	4B021701481B	1 011,6	12 977	13 127 533,20	ММВБ
Филиал ПТБ (АО) в г.Санкт-Петербурге	4B022100354B	1 006,6791295	29 328	29 523 885,51	Расчет
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-09-00739-A	193,82627984	1 801	349 081,13	Расчет
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				5 275 215 102,61	

### 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	678,5	1	678,50	ММВБ
ПАО "Аэрофлот"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00010-A	117,55	20	2 351,00	ММВБ
ПАО "Интер РАО"	Обыкновенные акции АО РФ	1-04-33498-E	3,1685	496	1 571,58	ММВБ
ПАО "Ростелеком"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-00124-A	78,87	1	78,87	ММВБ
ПАО "Т Плюс"	Обыкновенные акции АО РФ	1-01-55113-E	0,475	1	0,48	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					4 680,43	

### 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"	1 370 098,47
Итого средств на специальных брокерских счетах	1 370 098,47

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	0,90
Администрация Волгоградской области	RU35005VLO0	63 425,00
ПАО "РусГидро"	4-08-55038-E	361 119,36
ПАО "РусГидро"	4-09-55038-E	5 981 398,80
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-10-65134-D	195 736,00
ПАО "СИБУР Холдинг"	4-11-65134-D	1 454 725,02
ПАО "Силовые машины"	4B02-01-35909-H	4 172 323,19
ПАО "Силовые машины"	4B02-02-35909-H	1 839 950,00
ПАО "ТрансКонтейнер"	4-04-55194-E	7 567,00
ПАО "Транснефть"	4B02-03-00206-A-001P	950 581,80
ПАО "Транснефть"	4B02-05-00206-A	7 172 844,83
ПАО "Энел Россия"	4B02-06-50077-A	5 887 440,00
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-08-00739-A	96 371,62
ПАО АНК "Башнефть"	4-06-00013-A	6 172,32
ПАО АНК "Башнефть"	4-07-00013-A	3 530 661,29
ПАО АНК "Башнефть"	4-09-00013-A	1 837 340,05

ПАО АФК "Система"	4-03-01669-A	18 330,90
ПАО АФК "Система"	4B02-01-01669-A-001P	2 599 654,08
ПАО КБ "Восточный"	40201460B	806 716,26
ПАО Сбербанк	4B021701481B	622 247,15
Правительство Белгородской области	RU34006BELO	57 855,05
Правительство Белгородской области	RU35008BELO	64 928,16
Правительство Москвы в лице Департамента финансов г. Москвы	RU32048MOS0	6 248 998,22
АО "АИЖК" или АО "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию"	4-09-00739-A	3 403,89
Управление финансов Липецкой области	RU34007LIP0	31 360,50
Управление финансов Липецкой области	RU34009LIP0	962 619,00
Управление финансов Липецкой области	RU35008LIP0	1 411 679,50
Филиал ГПБ (АО) в г.Санкт-Петербурге	4B022100354B	104 994,24
Финансовое управление Тамбовской области	RU35002TMB0	72 325,00
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	1 680,00
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
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020401326B	67 890,66
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B020501326B	452 996,27
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021101326B	37 312,96
"Правительство Республики Башкортостан"	RU34008BAS0	97 000,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021401326B	589 155,81
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B021501326B	34 430,00
АО "Вертолеты России"	4B02-02-12310-A	2 885 533,35
АО "КБ ДельтаКредит"	4B022603338B	8 136,24
АО "МХК "ЕвроХим"	4-02-31153-H	1 021 760,00
АО "МХК "ЕвроХим"	4B02-01-31153-H-001P	1 905 200,00
АО "ПГК"	4-05-55521-E	4 939 200,00
АО "ПКТ"	4-01-03924-J	2 671 697,50
АО "ПКТ"	4-02-03924-J	1 244 782,00
АО "ПКТ"	4-03-03924-J	117 997,00
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-06-65018-D	45 073,44
АО "РН Банк"	40100170B	495 849,58
АО "Россельхозбанк"	41503349B	3 164 700,00
АО "Тойота Банк"	40103470B	116 814,36
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4-03-25642-H	13,65
АО "ХК "МЕТАЛЛОИНВЕСТ"	4B02-02-25642-H	239 580,00
АО ССМО "ЛенСпецСМУ"	4-02-17644-J	1 283 069,76
Департамент финансов Томской области	RU34048TMS0	197 397,12
ДФ ЯО	RU35013YRS0	62 575,40
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020102495B	498 200,00
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО	4B020502495B	591 600,00
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-08-65018-D	59 085,44
КБ "МИА" (АО)	4B020303344B	244 091,10
Комитет финансов Санкт-Петербурга	RU25039GSP0	80 941,00
Министерство финансов Республики Карелия	RU34015KAR0	32 647,65
Министерство финансов Республики Карелия	RU34016KAR0	8 220,00



Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35006RSY0	8 846,76
Министерство финансов Свердловской области	RU34001SVS0	2 880,00
Министерство финансов Ставропольского края	RU34001STV0	3 977,00
Министерство финансов Тверской области	RU34009TVE0	724 471,02
Министерство финансов Тульской области	RU34003TUL0	11 280,00
Министерство финансов Тульской области	RU34004TUL0	154,00
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-13-65018-D	3 183 856,72
Минфин Красноярского края	RU34006KNA0	412 104,50
Минфин Красноярского края	RU34007KNA0	10 584,62
Минфин Красноярского края	RU34009KNA0	2 770 819,20
Минфин Красноярского края	RU34010KNA0	330 916,16
Минфин Красноярского края	RU34011KNA0	638 798,71
Минфин Нижегородской области	RU34008NJK0	13 634,80
Минфин Нижегородской области	RU34009NJK0	1 586 333,58
Минфин Омской области	RU34002OMS0	1 106 016,00
Минфин Республики Коми	RU32010KOM0	192 622,32
Минфин Республики Коми	RU35011KOM0	85 040,60
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-18-65018-D	115 845,89
Минфин Республики Коми	RU35012KOM0	2 838 430,84
Минфин Республики Мордовия	RU34001MOR0	109 033,00
Минфин Хакасии	RU35003HAK0	847 844,38
МУФ СО	RU34011SAM0	328,02
МУФ СО	RU35008SAM0	6 264,57
МУФ СО	RU35010SAM0	16 300,00
МФ и НП НСО	RU34015ANO0	515 716,20
МФ и НП НСО	RU34016ANO0	292 738,80
мэрия города Новосибирска	RU35006NSB1	2 507 090,15
ОАО "РЖД"	4-28-65045-D	4 282 929,00
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-19-65018-D	207 244,02
ОАО "РЖД"	4B02-07-65045-D	1 298 700,00
ООО "БКЕ"	4B02-01-36403-R-001P	4 254 000,00
ООО "Газпром капитал"	4-04-36400-R	106 680,00
ООО "ДелоПортс"	4-01-36485-R	6 970 827,72
ООО "ЕвразХолдинг Финанс"	4-08-36383-R	12 615 834,00
ООО "ИКС 5 ФИНАНС"	4B02-05-36241-R	722 624,00
ООО "Лента"	4-01-36420-R	541 100,00
ООО "Лента"	4-03-36420-R	34 930,00
ООО "МегаФон Финанс"	4-06-36027-R	690 530,40
ООО "МегаФон Финанс"	4-07-36027-R	185 925,60
"ФСК ЕЭС" ПАО	4-25-65018-D	350,02
ООО "РВК-Финанс"	4B02-01-36320-R	5 963 258,00
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40803500B	128 526,20
ООО "Фольксваген Банк РУС"	40903500B	45 582,93
ООО "Фольксваген Банк РУС"	41003500B	1 526 700,00
ПАО "ВымпелКом"	4-04-00027-A	433 100,40
ПАО "ВымпелКом"	4B02-03-00027-A	2 984 965,00
ПАО "Газпром нефть"	4-04-00146-A	4 418 300,00
ПАО "Газпром нефть"	4-10-00146-A	161 168,00
ПАО "Газпром нефть"	4-12-00146-A	4 088 523,48
ПАО "Магнит"	4B02-02-60525-P-001P	144 845,00

Администрация Волгоградской области	RU35002VLO0	51 040,68
ПАО "Магнит"	4B02-11-60525-P	446 897,57
ПАО "НК "Роснефть"	4-07-00122-A	1 203,44
ПАО "НК "Роснефть"	4-08-00122-A	893,37
ПАО "НК "Роснефть"	4-09-00122-A	25 050,00
ПАО "НК "Роснефть"	4-10-00122-A	313 125,00
ПАО "НЛМК"	4B02-13-00102-A	396 102,99
ПАО "ОГК-2"	4B02-01-65105-D-001P	341 457,28
ПАО "ОГК-2"	4B02-02-65105-D-001P	2 353 056,00
ПАО "Полюс Золото"	4B02-01-55192-E	1 810,20
ПАО "Ростелеком"	4B02-01-00124-A	19 791,10
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		144 159 190,47

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	145 529 288,94

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

**7 263 936 220,85 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	VTB00126-113440F025		
Дата и время отправки	03.10.2016 15:51:51	Дата и время приёма	03.10.2016 15:56:12
Подписано	'1. Лукьянов Владимир Александрович дата и время ЭП 03.10.2016 12:50:19 UTC [00001-1] Электронная подпись верна 2. Успенская Светлана Игоревна дата и время ЭП 03.10.2016 9:36:01 UTC [00126-7] Электронная подпись верна'		