

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2017 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Акционерное общество "Управляющая компания УРАЛСИБ" Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7702172846/770401001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У008

Дата и время составления расчёта: 03.07.2017 15:15:39

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 (ПАО)	03.07.2014	030714D20596838	40701810000260000076	5 511 719,70
Итого денежных средств на счетах				5 511 719,70

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
ОФЗ	29006RMFS	1 090,50000000	224 520,00	244 839 060,00	ММВБ
ОФЗ	29010RMFS	1 161,50000000	539 502,00	626 631 573,00	ММВБ
ОФЗ	29012RMFS	1 034,40000000	243 983,00	252 376 015,20	ММВБ
ОФЗ	46018RMFS	958,06000000	400 000,00	383 224 000,00	Средняя цена
ОФЗ	46020RMFS	902,68000000	270 000,00	243 723 600,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				1 750 794 248,20	

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
МУНОБЛ_П	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32048MOS0	915,60000000	100 000,00	91 560 000,00	ММВБ
МУНОБЛ_П	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры	RU35001HMN0	1 036,00000000	114 978,00	119 117 208,00	ММВБ
МУНОБЛ_П	Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35009RSY0	1 013,00000000	366 874,00	371 643 362,00	ММВБ
МУНОБЛ_П	Правительство Московской области	RU35010MOO0	1 062,90000000	137 086,00	145 708 709,40	ММВБ
МУНОБЛ_П	Министерство управления финансами Самарской области	RU35013SAM0	1 000,00000000	270 000,00	270 000 000,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					998 029 279,40	

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
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00	

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
Закрытое акционерное общество "Строительное объединение "М-ИНДУСТРИЯ"	4-01-16444-J	0,00000000	40 868,00	0,00	Цена приобрет.
Общество с ограниченной ответственностью "Лента"	4-03-36420-R	1 034,80000000	105 000,00	108 654 000,00	Средняя цена
акционерное общество "Федеральная пассажирская компания"	4B02-01-55465-E-001 P	1 015,90000000	75 000,00	76 192 500,00	ММВБ
Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	4B02-02-65045-D-001 P	1 012,60000000	125 000,00	126 575 000,00	ММВБ
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-03-00122-A	1 055,00000000	100 000,00	105 500 000,00	Средняя цена

публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-03-32432-H-001 P	1 079,80000000	90 599,00	97 828 800,20	ММВБ
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-04-00122-A-001 P	1 004,70000000	243 000,00	244 142 100,00	ММВБ
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-05-32432-H	1 069,90000000	194 904,00	208 527 789,60	Средняя цена
Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал"	4B02-05-36400-R	1 033,50000000	225 000,00	232 537 500,00	ММВБ
АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	4B020103349B001P	1 021,50000000	185 000,00	188 977 500,00	ММВБ
БАНК ГПБ (АО)	4B021200354B	1 018,50000000	20 000,00	20 370 000,00	ММВБ
ПАО РОСБАНК	4B021502272B	1 024,60000000	84 999,00	87 089 975,40	ММВБ
ПАО СБЕРБАНК	4B021901481B	1 004,40000000	250 200,00	251 300 880,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 747 696 045,20	

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
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					0,00	

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
ЗАО "Балтийское Финансовое Агентство"	205 228 865,42
ОАО "Брокерский дом Открытие"	61 071,61
Итого средств на специальных брокерских счетах	205 289 937,03

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Министерство финансов Российской Федерации	29006RMFS	9 966 442,80
Министерство финансов Российской Федерации	29010RMFS	334 491,24
Министерство финансов Российской Федерации	29012RMFS	2 552 062,18
Общество с ограниченной ответственностью "Лента"	4-03-36420-R	4 123 350,00
Министерство финансов Российской Федерации	46018RMFS	2 136 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	46020RMFS	6 890 400,00
акционерное общество "Федеральная пассажирская компания"	4B02-01-55465-E-001P	1 157 250,00
Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	4B02-02-65045-D-001P	1 862 500,00
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-03-00122-A	657 000,00
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-03-32432-H-001P	1 365 326,93
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-04-00122-A-001P	3 282 930,00
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-05-32432-H	3 701 226,96
Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал"	4B02-05-36400-R	7 407 000,00
АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	4B020103349B001P	4 380 800,00
БАНК ГПБ (АО)	4B021200354B	152 600,00
ПАО РОСБАНК	4B021502272B	227 797,32
ПАО СБЕРБАНК	4B021901481B	1 763 910,00
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32048MOS0	312 000,00
Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры	RU35001HMN0	114 978,00
Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35009RSY0	3 712 764,88
Правительство Московской области	RU35010MOO0	1 124 105,20

Министерство управления финансами Самарской области	RU35013SAM0	1 271 700,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		58 496 635,51
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1		2
Итого прочая дебиторская задолженность		0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)		263 786 572,54

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

4 765 817 865,04 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.

Уполномоченное лицо УК

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

Даньшина В.А.

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	
Исходящий рег. номер	VTB00152-276275F025
Дата и время отправки	03.07.2017 15:20:54
Дата и время приёма	
Подписано	'1. Успенский Андрей Маркович дата и время ЭП 03.07.2017 12:20:52 UTC [00152-5] Электронная подпись верна 2. Успенский Андрей Маркович дата и время ЭП 03.07.2017 12:20:52 UTC [00152-5] Электронная подпись верна'