

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.09.2017 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: 02.10.2017 17:25:56

**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	5 224 394,09
Итого денежных средств на счетах				5 224 394,09

**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	26221RMFS	998,51000000	443 002,00	442 341 927,02	Средняя цена
ОФЗ	26222RMFS	976,20000000	70 437,00	68 760 599,40	Средняя цена
ОФЗ	29006RMFS	1 087,32000000	222 034,00	241 422 008,88	Средняя цена
ОФЗ	29010RMFS	1 169,75000000	300 006,00	350 932 018,50	Средняя цена
ОФЗ	29012RMFS	1 036,65000000	151 620,00	157 176 873,00	Средняя цена
ОФЗ	46018RMFS	964,94000000	400 000,00	385 976 000,00	Средняя цена
ОФЗ	46020RMFS	913,91000000	270 000,00	246 755 700,00	Средняя цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				1 893 365 126,80	

**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	931,70000000	100 000,00	93 170 000,00	Средняя цена
МУНОБЛ_П	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры	RU35001HMNO	1 047,20000000	114 978,00	120 404 961,60	Средняя цена
МУНОБЛ_П	Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35009RSY0	1 018,00000000	366 874,00	373 477 732,00	Средняя цена
МУНОБЛ_П	Правительство Московской области	RU35010MCO0	1 076,40000000	137 086,00	147 559 370,40	Средняя цена
МУНОБЛ_П	Министерство управления финансами Самарской области	RU35013SAM0	1 010,00000000	270 000,00	272 700 000,00	Средняя цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 007 312 064,00	

### 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	1 028,00000000	105 000,00	107 940 000,00	Средняя цена
акционерное общество "Федеральная пассажирская компания"	4B02-01-55465-E-001 P	1 026,30000000	75 000,00	76 972 500,00	Средняя цена

Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	4B02-02-65045-D-001 P	1 027,00000000	125 000,00	128 375 000,00	Средняя цена
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-03-00122-A	1 063,40000000	100 000,00	106 340 000,00	Средняя цена
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-03-32432-H-001 P	1 120,60000000	90 599,00	101 525 239,40	Средняя цена
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-04-00122-A-001 P	1 023,80000000	243 000,00	248 783 400,00	Средняя цена
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-05-32432-H	1 099,70000000	194 904,00	214 335 928,80	Средняя цена
Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал"	4B02-05-36400-R	1 049,60000000	225 000,00	236 160 000,00	Средняя цена
АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	4B020103349B001P	1 031,50000000	185 000,00	190 827 500,00	Средняя цена
БАНК ГПБ (АО)	4B021200354B	1 016,90000000	20 000,00	20 338 000,00	Средняя цена
ПАО РОСБАНК	4B021502272B	1 029,60000000	84 999,00	87 514 970,40	Средняя цена
ПАО СБЕРБАНК	4B021901481B	1 017,00000000	250 200,00	254 453 400,00	Средняя цена
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B022001326B	1 006,60000000	107 745,00	108 456 117,00	Средняя цена
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 882 022 055,60	

### 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"	20 651 143,77
ОАО "Брокерский дом Открытие"	55 671,61
Итого средств на специальных брокерских счетах	20 706 815,38

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	26221RMFS	21 215 365,78
Министерство финансов Российской Федерации	26222RMFS	2 055 351,66
Министерство финансов Российской Федерации	29006RMFS	3 354 933,74
Министерство финансов Российской Федерации	29010RMFS	8 745 174,90
Министерство финансов Российской Федерации	29012RMFS	5 529 581,40
Общество с ограниченной ответственностью "Лента"	4-03-36420-R	1 081 500,00
Министерство финансов Российской Федерации	46018RMFS	2 208 000,00
Министерство финансов Российской Федерации	46020RMFS	2 297 700,00
акционерное общество "Федеральная пассажирская компания"	4B02-01-55465-E-001P	2 820 750,00
Открытое акционерное общество "Российские железные дороги"	4B02-02-65045-D-001P	4 541 250,00
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-03-00122-A	3 404 000,00
публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-03-32432-H-001P	1 392 506,63
публичное акционерное общество "Нефтяная компания "Роснефть"	4B02-04-00122-A-001P	8 580 330,00

публичное акционерное общество "Государственная транспортная лизинговая компания"	4B02-05-32432-H	3 759 698,16
Общество с ограниченной ответственностью "Газпром капитал"	4B02-05-36400-R	2 468 250,00
АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	4B020103349B001P	48 100,00
АО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	4B020103349B001P	8 763 450,00
БАНК ГПБ (АО)	4B021200354B	654 200,00
ПАО РОСБАНК	4B021502272B	2 328 122,61
ПАО СБЕРБАНК	4B021901481B	6 998 094,00
АО "АЛЬФА-БАНК"	4B022001326B	3 159 083,40
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы	RU32048MOS0	1 825 000,00
Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры	RU35001HMN0	143 722,50
Министерство финансов Республики Саха (Якутия)	RU35009RSY0	3 800 814,64
Правительство Московской области	RU35010MOO0	1 159 747,56
Министерство управления финансами Самарской области	RU35013SAM0	1 333 800,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		103 668 526,98

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	124 375 342,36

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

**4 912 298 982,85 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.

Уполномоченное лицо УК

Успенский А.М.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	
Исходящий рег. номер	VTB00152-280184F025
Дата и время отправки	02.10.2017 17:31:14
Дата и время приёма	
Подписано	'1. Успенский Андрей Маркович дата и время ЭП 02.10.2017 14:31:12 UTC [00152-5] Электронная подпись верна'