

**Справка о стоимости чистых активов акционерного
инвестиционного фонда (стоимости чистых активов паевого
инвестиционного фонда)**

**Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций
«Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный
резерв**

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда либо тип и название паевого
инвестиционного фонда)

Федеральная служба по финансовым рынкам № 0202-72729965 от 13.04.2004

(дата регистрации правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом
федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг и регистрационный номер)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв
(полное фирменное наименование управляющей компании)

123317, Москва г, Пресненская наб, дом № 10, т.(495) 287-68-16

(место нахождения, номер телефона управляющей компании)

21-000-1-00108, ФСФР, от 7 февраля 2003 г.

(номер и дата предоставления лицензии на осуществление деятельности по управлению
инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными
пенсионными фондами, наименование лицензирующего органа)

Дата определения стоимости чистых активов: 30.06.2015 20:00

(рублей)

Вид имущества	Код стр.	Сумма (оценочная стоимость на 30.06.2015 (указывается текущая дата составления справки)	Сумма (оценочная стоимость на 29.06.2015 (указывается предыдущая дата составления справки)
1	2	3	4
Активы:			
Денежные средства на счетах - всего, в том числе:	010	1 992 116.60	1 746 185.08
- в рублях	011	1 992 116.60	1 746 185.08
- в иностранной валюте	012	0,00	0,00
Денежные средства во вкладах - всего, в том числе:	020	0,00	0,00
- в рублях	021	0,00	0,00
- в иностранной валюте	022	0,00	0,00
	030		
Государственные ценные бумаги Российской Федерации		8 106 596.08	8 109 085.58
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	040	21 133 061.10	21 134 861.10
Муниципальные ценные бумаги	050	860 437.50	860 437.50
Облигации российских хозяйственных обществ (кроме облигаций с ипотечным покрытием)	060	27 493 319.90	27 494 933.40
Акции российских акционерных обществ	070	0,00	0,00
	080		
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов		0,00	0,00
Ипотечные ценные бумаги - всего, в том числе:	090	0,00	0,00
- облигации с ипотечным покрытием	091	0,00	0,00
- ипотечные сертификаты участия	092	0,00	0,00
Векселя, выданные российскими хозяйственными обществами	100	0,00	0,00
Ценные бумаги иностранных эмитентов - всего, в том числе:	110	396 240.00	396 240.00
- ценные бумаги иностранных государств	111	0,00	0,00
- ценные бумаги международных финансовых организаций	112	396 240.00	396 240.00
- акции иностранных акционерных обществ	113	0,00	0,00
- облигации иностранных коммерческих организаций	114	0,00	0,00
Закладные	120	0,00	0,00
Денежные требования по обеспеченным ипотекой обязательствам из кредитных договоров или договоров займа и права залогодержателя по договорам об ипотеке (за исключением удостоверенных закладными)	130	0,00	0,00
Денежные требования по обязательствам из кредитных договоров или договоров займа, по которым кредиты (займы) предоставлены для уплаты цены по договорам участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества и права залогодержателя по договорам залога имущественных прав по указанным договорам	140	0,00	0,00
Доли в российских обществах с ограниченной ответственностью	150	0,00	0,00

Недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации, - всего, в том числе:	160	0,00	0,00
- объекты незавершенного строительства	161	0,00	0,00
Недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств, - всего, в том числе:	170	0,00	0,00
- объекты незавершенного строительства	171	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории Российской Федерации, - всего, в том числе:	180	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	181	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств, - всего, в том числе:	190	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	191	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества	200	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из инвестиционных договоров	210	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется строительство (создание) объектов недвижимости на земельном участке, составляющем активы акционерного инвестиционного фонда или активы паевого инвестиционного фонда	220	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимости, составляющих активы акционерного инвестиционного фонда или активы паевого инвестиционного фонда	230	0,00	0,00
Проектно-сметная документация	240	0,00	0,00
Иное имущество	250	0,00	0,00
Дебиторская задолженность - всего, в том числе:	260	5 500 350.61	5 730 339.55
- средства, находящиеся у профессиональных участников рынка ценных бумаг	261	4 499 400.12	4 499 400.12
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	262	0,00	0,00
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по денежным средствам на счетах и во вкладах, а также по ценным бумагам	263	1 000 950.49	1 230 939.43
- прочая дебиторская задолженность	264	0,00	0,00
Итого сумма активов: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090 + 100 + 110 + 120 + 130 + 140 + 150 + 160 + 170 + 180 + 190 + 200 + 210 + 220 + 230 + 240 + 250 + 260)	270	65 482 121.79	65 472 082.21
Обязательства:			
Кредиторская задолженность	300	196 854.71	0,00
Резерв предстоящих расходов на выплату вознаграждения	310	128 539.77	318 254.33
Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением открытым паевым инвестиционным фондом	320	0,00	0,00
Итого сумма обязательств: (строки 300 + 310 + 320)	330	325 394.48	318 254.33
Стоимость чистых активов: (строка 270 - строка 330)	400	65 156 727.31	65 153 827.88
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) - штук	500	38 967.78344	38 967.78344
Стоимость чистых активов акционерного инвестиционного фонда в расчете на одну акцию (расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда) (строка 400 / строка 500)	600	1 672.07	1 671.99

Генеральный директор

/ Зензинов Б.В. /

Главный бухгалтер

/ Кузнецова Е.А. /

Руководитель группы обслуживания открытых паевых инвестиционных фондов

/ Москвичева О.В. /

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА
к справке о стоимости чистых активов

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(далее - паевой инвестиционный фонд)

на 30 июня 2015 г.

1. Настоящая Пояснительная записка составлена в соответствии с Приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. N 05-21/пз-н «ОБ УТВЕРЖДЕНИИ ПОЛОЖЕНИЯ О ПОРЯДКЕ И СРОКАХ ОПРЕДЕЛЕНИЯ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, РАСЧЕТНОЙ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПАЕВ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, А ТАКЖЕ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ В РАСЧЕТЕ НА ОДНУ АКЦИЮ» (далее – положение).
2. За 2 квартал 2015 года не было допущено ошибок, которые привели к изменению расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более процентов.
3. В состав активов паевого инвестиционного фонда за отчетный период не входили требования и обязательства, не включаемые в расчет стоимости чистых активов, в том числе, активы, обремененные залогом, опционы, фьючерсные и форвардные контракты, премии по опционам, отсутствовали забалансовые риски.
4. По состоянию на 30.06.2015 года отсутствуют объявленные, но не полученные суммы дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда.
5. В течение отчетного периода на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда существенное влияние оказали изменения котировок следующих ценных бумаг, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

<i>ценная бумага</i>	<i>котировка</i>				<i>изменение в %</i>
	<i>дата</i>		<i>дата</i>		
КБ Восточный, 02, 40201460В	31.03.2015	42.050000	30.06.2015	50.460000	20.00

Генеральный директор

_____ / Зензинов Б.В. /
(подпись)

Главный бухгалтер

_____ / Кузнецова Е.А. /
(подпись)

Руководитель группы обслуживания открытых паевых
инвестиционных фондов
ОАО Банк ВТБ

_____ / Москвичева О.В. /
(подпись)

ОТЧЕТ
об изменении стоимости чистых активов
акционерного инвестиционного фонда
(стоимости чистых активов паевого
инвестиционного фонда)

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда либо тип и название паевого
инвестиционного фонда)

Федеральная служба по финансовым рынкам № 0202-72729965 от 13.04.2004

(дата и номер предоставления лицензии на осуществление деятельности инвестиционного фонда и наименование
лицензирующего органа либо дата регистрации правил доверительного управления паевым инвестиционным
фондом

федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг и регистрационный номер)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв, 123317, Москва г,
Пресненская наб, дом № 10, т.(495) 287-68-16, 21-000-1-00108, ФСФР, от 7 февраля 2003 г.

(полное фирменное наименование управляющей компании, место нахождения, номер телефона управляющей
компания, номер и дата предоставления лицензии на осуществление деятельности по управлению
инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами,
наименование лицензирующего органа)

Дата составления отчета 30.06.2015 20:00 МСК

Причина изменения стоимости чистых активов	Код стр.	Сумма
1	2	3
Стоимость чистых активов на начало отчетного периода	010	60 202 661.88
Размещение акций акционерного инвестиционного фонда (выдача инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	020	0,00
Выкуп или приобретение акций акционерного инвестиционного фонда (погашение инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда)	030	60 665.15
Обмен инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов	040	0,00
Обмен инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда	050	0,00
Выплата дохода от доверительного управления закрытым паевым инвестиционным фондом	060	0,00
Изменение стоимости чистых активов в результате операций с активами акционерного инвестиционного фонда (активами паевого инвестиционного фонда) и изменения стоимости активов фонда	070	5 014 730.58
СТОИМОСТЬ ЧИСТЫХ АКТИВОВ НА КОНЕЦ ОТЧЕТНОГО ПЕРИОДА (строки 010 + 020 - 030 - 040 + 050 - 060 +(-) 070)	080	65 156 727.31

Генеральный директор

_____ / Зензинов Б.В. /

Главный бухгалтер

_____ / Кузнецова Е.А. /

Руководитель группы обслуживания
открытых паевых инвестиционных фондов

_____ / Москвичева О.В. /

СПРАВКА О СТОИМОСТИ АКТИВОВ

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование управляющей

компании Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР

30 июня 2015 г.

Вид активов	Код стр.	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс. рублей)	Доля от общей стоимости активов (процентов)	Доля от общего количества размещенных (выданных) ценных бумаг (долей) (процентов)
1	2	3	4	5
Денежные средства на банковских счетах, всего	100	1 992.12	3.04	x
в том числе:				
- в рублях	110	1 992.12	3.04	x
40701810200030000365, ОАО Банк ВТБ		1 992.12	3.04	x
- в иностранной валюте	120	0,00		x
Денежные средства в банковских вкладах, всего	200	0,00		x
в том числе:				
- в рублях	210	0,00		x
- в иностранной валюте	220	0,00		x
Ценные бумаги, имеющие признаваемую котировку, всего	300	32 125.37	49.06	x
в том числе:				
Ценные бумаги российских эмитентов, включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг	310	27 303.61	41.70	x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	311	5 450.29	8.32	
Минфин России, 11, 26211RMFS		5 214.63	7.96	0.0043333
Минфин России, 14, 26214RMFS		235.65	0.36	0.0001132
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	312	12 140.75	18.54	
Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0		2 245.30	3.43	0.0483333
Министерство финансов Красноярского края, 08, RU34008KNA0		593.04	0.91	0.0060000
Министерство финансов Омской области, 02, RU34002OMS0		1 999.00	3.05	0.0400000
Министерство финансов Республики Коми, 11, RU35011KOM0		490.50	0.75	0.0049505
Министерство финансов Республики Марий Эл, 06, RU34006MAR0		397.08	0.61	0.0666667
Правительство Белгородской области, 08, RU35008BEL0		477.50	0.73	0.0100000
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы, 67, RU25067MOS0		4 442.68	6.78	0.0115000
Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры, 01, RU34001HMNO		1 495.65	2.28	0.0107143
- муниципальные ценные бумаги	313	0,00		
- облигации российских хозяйственных обществ	314	9 712.58	14.83	x
КБ Ренессанс Кредит, БО-02, 4B020203354B		597.84	0.91	x
Корпорация Иркут, БО-04, 4B02-04-00040-A		1 306.35	1.99	x
МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК, БО-07, 4B020701978B		1 338.68	2.04	x
РЖД, 15, 4-15-65045-D		2 390.92	3.65	x
РусГидро, 01, 4-01-55038-E		666.04	1.02	x
ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J		3 412.75	5.21	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	315	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	316	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	317	0,00		x
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	318	0,00		
Ценные бумаги российских эмитентов, не включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг	320	4 821.76	7.36	x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	321	0,00		
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	322	0,00		
- муниципальные ценные бумаги	323	0,00		
- облигации российских хозяйственных обществ	324	4 821.76	7.36	x
АЛЬФА-БАНК, БО-09, 4B020901326B		576.84	0.88	x
КБ Центр-инвест, БО-07, 4B020702225B		489.30	0.75	x
РусГидро, 09, 4-09-55038-E		3 069.90	4.69	x
Фольксваген Банк РУС, 08, 40803500B		685.72	1.05	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	325	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	326	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	327	0,00		x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	328	0,00		
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	329	0,00		
Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	400	25 468.04	38.89	x
в том числе:				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	410	2 656.31	4.06	
Минфин России, 20, 46020RMFS		2 656.31	4.06	0.0475000
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	420	8 992.32	13.73	
Департамент финансов Ярославской области, 12, RU34012YRS0		1 729.80	2.64	0.0400000
Министерство управления финансами Самарской области, 10, RU35010SAM0		571.20	0.87	0.0050000
Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 15, RU34015ANO0		1 317.90	2.01	0.0300000
Министерство финансов Кемеровской области, 34001, RU000A0JUAZ0		618.08	0.94	0.0681000
Министерство финансов Нижегородской области, 09, RU34009NJGO		2 527.02	3.86	0.0330000
Министерство финансов Республики Карелия, 14, RU34014KAR0		431.91	0.66	0.3000000
Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLGO		1 796.41	2.74	0.0630435
- муниципальные ценные бумаги	430	860.44	1.31	
мэрия города Новосибирска, 06, RU35006NSB1		860.44	1.31	0.0260000
- облигации российских хозяйственных обществ	440	12 958.98	19.79	x
АЛЬФА-БАНК, БО-10, 4B021001326B		588.18	0.90	x

АЛЬФА-БАНК, БО-11, 4B021101326B		1 605.54	2.45	x
Вертолеты России, БО-02, 4B02-02-12310-A		390.92	0.60	x
КБ Восточный, 02, 40201460B		403.68	0.62	x
МТС или Мобильные ТелеСистемы, 08, 4-08-04715-A		2 958.00	4.52	x
НК Роснефть, 08, 4-08-00122-A		3 036.33	4.64	x
Фольксваген Банк РУС, 09, 40903500B		698.85	1.07	x
ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D		3 277.49	5.01	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	450	0,00		
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	460	0,00		
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	470	0,00		x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	480	0,00		
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	490	0,00		
- векселя	491	0,00		x
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	500	396.24	0.61	x
в том числе:				
- ценные бумаги иностранных государств	510	0,00		
- ценные бумаги международных финансовых организаций	520	396.24	0.61	
Международный инвестиционный банк, 01, RU000A0JUG56		396.24	0.61	0.0200000
- облигации иностранных коммерческих организаций	530	0,00		
- акции иностранных акционерных обществ	540	0,00		
Доли в уставных капиталах российских обществ с ограниченной ответственностью	600	0,00		
Недвижимое имущество	700	0,00		x
Имущественные права на недвижимое имущество	800	0,00		x
Строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	900	0,00		x
Проектно-сметная документация	1000	0,00		x
Иные доходные вложения в материальные ценности	1100	0,00		x
Дебиторская задолженность в том числе:	1200	5 500.35	8.40	x
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	1210	4 499.40	6.87	x
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	1220	0,00		x
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по банковским вкладам и ценным бумагам	1230	1 000.95	1.53	x
- прочая дебиторская задолженность	1240	0,00		x
ИТОГО АКТИВОВ (строки 100 + 200 + 300 + 400 + 500 + 600 + 700 + 800 + 900 + 1000 + 1100 + 1200)	1300	65 482.12	x	x

Примечание:

Облигации, составляющие активы фонда:

№	Облигация	Дата погашения	Период выплаты	Наименование фондовой биржи
1.	АЛЬФА-БАНК, БО-09, 4B020901326B	20.08.2016	Полугодие	ММВБ
2.	АЛЬФА-БАНК, БО-10, 4B021001326B	11.06.2017	Полугодие	ММВБ
3.	АЛЬФА-БАНК, БО-11, 4B021101326B	30.06.2017	Полугодие	ММВБ
4.	Вертолеты России, БО-02, 4B02-02-12310-A	16.11.2023	Полугодие	ММВБ
5.	Департамент финансов Ярославской области, 12, RU34012YRS0	13.07.2018	Квартал	ММВБ
6.	КБ Восточный, 02, 40201460B	09.08.2018	Полугодие	ММВБ
7.	КБ Ренессанс Кредит, БО-02, 4B020203354B	09.08.2015	Полугодие	ММВБ
8.	КБ Центр-инвест, БО-07, 4B020702225B	13.11.2018	Полугодие	ММВБ
9.	Корпорация Иркут, БО-04, 4B02-04-00040-A	06.11.2023	Полугодие	ММВБ
10.	Международный инвестиционный банк, 01, RU000A0JUG56	16.04.2024	полугодие	ММВБ
11.	Министерство управления финансами Самарской области, 10, RU35010SAM0	01.07.2021	Квартал	ММВБ
12.	Министерство финансов и налоговой политики Новосибирской области, 15, RU34015AN00	30.10.2018	Квартал	ММВБ
13.	Министерство финансов Кемеровской области, 34001, RU000A0JUAZ0	28.11.2018	Квартал	ММВБ
14.	Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0	09.11.2017	Квартал	ММВБ
15.	Министерство финансов Красноярского края, 08, RU34008KNA0	08.07.2018	Квартал	ММВБ
16.	Министерство финансов Нижегородской области, 09, RU34009NJG0	26.08.2020	Полугодие	ММВБ
17.	Министерство финансов Омской области, 02, RU34002OMS0	15.10.2019	Квартал	ММВБ
18.	Министерство финансов Республики Карелия, 14, RU34014KAR0	30.11.2016	Полугодие	ММВБ
19.	Министерство финансов Республики Коми, 11, RU35011KOM0	27.11.2019	Квартал	ММВБ
20.	Министерство финансов Республики Марий Эл, 06, RU34006MAR0	04.10.2015	Квартал	ММВБ
21.	Минфин России, 11, 26211RMFS	25.01.2023	Полугодие	ММВБ
22.	Минфин России, 14, 26214RMFS	27.05.2020	Полугодие	ММВБ
23.	Минфин России, 20, 46020RMFS	06.02.2036	Полугодие	ММВБ
24.	МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК, БО-07, 4B020701978B	30.10.2018	Полугодие	ММВБ
25.	МТС или Мобильные ТелеСистемы, 08, 4-08-04715-A	03.11.2020	Полугодие	ММВБ
26.	мэрия города Новосибирска, 06, RU35006NSB1	22.07.2020	Квартал	ММВБ
27.	НК Роснефть, 08, 4-08-00122-A	10.03.2023	Полугодие	ММВБ
28.	Правительство Белгородской области, 08, RU35008BELO	21.06.2021	Квартал	ММВБ
29.	Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLGO	05.12.2017	Квартал	ММВБ
30.	Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы, 67, RU25067MOS0	01.06.2016	Полугодие	ММВБ
31.	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа - Югры, 01, RU34001HMNO	13.10.2019	Квартал	ММВБ
32.	РЖД, 15, 4-15-65045-D	20.06.2016	Полугодие	ММВБ
33.	РусГидро, 01, 4-01-55038-E	12.04.2021	Полугодие	ММВБ
34.	РусГидро, 09, 4-09-55038-E	15.04.2025	Полугодие	ММВБ
35.	СМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J	12.12.2017	Квартал	ММВБ
36.	Фольксваген Банк РУС, 08, 40803500B	19.10.2019	Полугодие	ММВБ
37.	Фольксваген Банк РУС, 09, 40903500B	20.10.2019	Полугодие	ММВБ
38.	ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D	22.06.2021	Полугодие	ММВБ

Генеральный директор

(подпись)

/ Зензинов Б.В. /

Главный бухгалтер

(подпись)

/ Кузнецова Е.А. /

СПРАВКА
О НЕСОБЛЮДЕНИИ ТРЕБОВАНИЙ К СОСТАВУ И СТРУКТУРЕ АКТИВОВ
Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

13 апреля 2004 г. 0202-72729965

(дата и номер регистрации правил фонда)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование управляющей компании)

Лицензия Федеральной службы по финансовым рынкам на осуществление деятельности по управлению
инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами

7 февраля 2003 г. 21-000-1-00108

30 июня 2015 г.

1. Несоблюдение требований к составу активов

Наименование имущества, приобретенного с нарушением требований к составу активов	Оценочная стоимость (тыс.рублей)	Доля в стоимости активов (процентов)	Дата приобретения	Дата отчуждения (предполагаемо отчуждения)
1	2	3	4	5

2. Несоблюдение требований к структуре активов

2.1. Несоблюдение ограничений, установленных в процентах от стоимости активов

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс.рублей)	Факт. доля в стоимости активов (процентов)	Доля в стоимости активов в соответствии с инвестиционной декларацией (процентов)	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7
Оценочная стоимость неликвидных ценных бумаг может составлять не более 10 процентов стоимости активов открытых паевых инвестиционных фондов и не более 50 процентов активов интервальных паевых инвестиционных фондов		7 656.04	11.7448	10.0000	28.05.2015	16.06.2015
	ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D	3 296.43	5.0569	0.0000	28.05.2015	16.06.2015
	Вертолеты России, БО-02, 4В02-02-12310-А	390.92	0.5997	0.0000	28.05.2015	16.06.2015
	НК Роснефть, 08, 4-08-00122-А	2 988.15	4.5840	0.0000	28.05.2015	16.06.2015
	АЛЬФА-БАНК, БО-10, 4В021001326В	585.06	0.8975	0.0000	28.05.2015	16.06.2015
	Международный инвестиционный банк, 01, RU000A0JUG56	395.48	0.6067	0.0000	28.05.2015	16.06.2015
Оценочная стоимость неликвидных ценных бумаг может составлять не более 10 процентов стоимости активов открытых паевых инвестиционных фондов и не более 50 процентов активов интервальных паевых инвестиционных фондов		9 023.00	13.8089	10.0000	19.06.2015	-
	Фольксваген Банк РУС, 09, 40903500В	698.85	1.0695	0.0000	19.06.2015	-

	РусГидро, 09, 4-09-55038-Е	3 070.80	4.6996	0.0000	19.06.2015	-
	Вертолеты России, БО-02, 4В02-02-12310-А	390.92	0.5983	0.0000	19.06.2015	-
	АЛЬФА-БАНК, БО-09, 4В020901326В	576.06	0.8816	0.0000	19.06.2015	-
	КБ Центр-инвест, БО-07, 4В020702225В	488.75	0.7480	0.0000	19.06.2015	-
	Международный инвестиционный банк, 01, RU000A0JUG56	395.68	0.6056	0.0000	19.06.2015	-
	АЛЬФА-БАНК, БО-11, 4В021101326В	1 605.54	2.4571	0.0000	19.06.2015	-
	Правительство Вологодской области, 03, RU34003VLG0	1 796.41	2.7492	0.0000	19.06.2015	-

2.2. Несоблюдение ограничений, установленных в процентах от количества размещенных (выданных) ценных бумаг

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс.рублей)	Факт. доля от количества размещенных (выданных) ценных бумаг (процентов)	Доля от количества размещенных (выданных) ценных бумаг в соответствии с инвестиционной декларацией (процентов)	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7

Генеральный директор

_____ / Зензинов Б.В. /
(подпись)

Главный бухгалтер

_____ / Кузнецова Е.А. /
(подпись)

**БАЛАНС ИМУЩЕСТВА,
СОСТАВЛЯЮЩЕГО ПАЕВОЙ ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ФОНД**

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал
Пенсионный резерв

(тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование

управляющей компании Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР

30 июня 2015 г.

(тыс. рублей)

Имущество (обязательства)	Код стр.	На начало года	На конец года
1	2	3	4
Имущество, составляющее паевой инвестиционный фонд			
Денежные средства на банковских счетах, всего	010	1 770.56	1 992.12
в том числе:			
- в рублях	011	1 770.56	1 992.12
- в иностранной валюте	012	0.00	0,00
Денежные средства в банковских вкладах, всего	020	0.00	0,00
в том числе:			
- в рублях	021	0.00	0,00
- в иностранной валюте	022	0.00	0,00
Ценные бумаги российских эмитентов, имеющие признаваемую котировку, всего	030	0.00	32 125.37
в том числе:			
- акции	031	0.00	0,00
- облигации	032	0.00	32 125.37
до 1 года		0.00	7 828.52
Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы, 67, RU25067MOSO		0.00	4 442.68
от 1 года до 3 лет		0.00	6 234.88
ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J		0.00	3 412.75
более 3 лет		0.00	18 061.97
Минфин России, 11, 26211RMFS		0.00	5 214.63
Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	040	56 432.81	25 468.04
в том числе:			
- акции	041	23.81	0,00
- облигации	042	56 409.00	25 468.04
до 1 года		935.20	0.00
от 1 года до 3 лет		25 945.26	4 422.03
Министерство финансов Краснодарского края, 04, RU34004KND0		3 937.79	0.00
ССМО ЛенСпецСМУ, 02, 4-02-17644-J		3 438.42	0.00
Минфин России, 77, 25077RMFS		3 695.49	0.00
Минфин России, 03, 26203RMFS		3 955.47	0.00
более 3 лет		29 528.54	21 046.01
ФСК ЕЭС, 13, 4-13-65018-D		4 261.80	3 277.49
- векселя	043	0.00	0,00
- иные ценные бумаги	044	0.00	0,00
Дебиторская задолженность в том числе:	050	2 867.68	5 500.35
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг			
ООО "ВТБ Капитал Брокер"	051	1 814.48	4 499.40
1000866		0.00	4 499.40
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	052	0.00	0,00
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по банковским вкладам и ценным бумагам	053	1 053.20	1 000.95
- прочая дебиторская задолженность	054	0.00	0,00
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	060	0.00	0,00
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	070	392.00	396.24

в том числе:			
- ценные бумаги иностранных государств	071	0.00	0,00
- ценные бумаги международных финансовых организаций	072	392.00	396.24
- акции иностранных акционерных обществ	073	0.00	0,00
- облигации иностранных коммерческих организаций	074	0.00	0,00
Доли в российских обществах с ограниченной ответственностью	080	0.00	0,00
Доходные вложения в материальные ценности, всего в том числе:	090	0.00	0,00
- объекты недвижимого имущества, кроме строящихся и реконструируемых объектов	091	0.00	0,00
- строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	092	0.00	0,00
- имущественные права на недвижимое имущество	093	0.00	0,00
- проектно-сметная документация	094	0.00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВО: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090)	100	61 463.05	65 482.12
Обязательства, исполнение которых осуществляется за счет имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд			
Кредиторская задолженность	110	913.94	196.85
Резервы на выплату вознаграждений	120	346.45	128.54
Инвестиционные паи	130	60 202.66	65 156.73
ИТОГО ОБЯЗАТЕЛЬСТВА: (строки 110 + 120 + 130)	140	61 463.05	65 482.12

Генеральный директор

_____ / Зензинов Б.В. /
(подпись)

Главный бухгалтер

_____ / Кузнецова Е.А. /
(подпись)

ОТЧЕТ
О ПРИРОСТЕ (ОБ УМЕНЬШЕНИИ) СТОИМОСТИ ИМУЩЕСТВА
Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Накопительный резерв» под
управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Полное фирменное наименование управляющей компании

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

Лицензия Управляющей компании: 21-000-1-00108 от 7 февраля 2003 г., ФСФР

30 июня 2015 г.

(тыс. рублей)

Наименование показателя	Код стр.	За отчетный период	За соответствующий период прошлого года
1	2	3	4
Выручка от продажи ценных бумаг	010	16 212.83	13 653.47
Расходы, связанные с продажей ценных бумаг	020	15 998.63	13 397.96
Результат от продажи ценных бумаг (010 - 020)	030	214.20	255.51
Выручка от продажи недвижимого имущества или передачи имущественных прав на недвижимое имущество	040	0,00	0,00
Расходы, связанные с продажей недвижимого имущества или передачей имущественных прав на недвижимое имущество	050	0,00	0,00
Результат от продажи недвижимого имущества или передачи имущественных прав на недвижимое имущество (040 - 050)	060	0,00	0,00
Выручка от продажи иного имущества	070	0,00	0,00
Расходы, связанные с продажей иного имущества	080	0,00	0,00
Результат от продажи иного имущества (070 - 080)	090	0,00	0,00
Процентный доход по банковским вкладам и ценным бумагам	100	2 876.62	1 922.98
Дивиденды по акциям	110	0,00	166.99
Прирост (уменьшение) средств в иностранной валюте	120	0,00	0,00
Выручка от сдачи недвижимого имущества в аренду	130	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, имеющих признаваемую котировку, всего	140	2 056.41	-2 217.05
в том числе:			
- акции	141	2.79	-1 117.65
- облигации	142	2 053.61	-1 099.40
- инвестиционные паи	143	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, не имеющих признаваемой котировки, всего	150	763.36	-145.98
в том числе:			
- акции	151	0,00	0,00
- облигации	152	763.36	-145.98
- векселя	153	0,00	0,00
- иные ценные бумаги	154	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости недвижимого имущества или имущественных прав на недвижимое имущество	160	0,00	0,00
Вознаграждение и расходы, связанные с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом	170	1 242.30	1 293.88
в том числе резерв на выплату вознаграждений	171	1 230.22	1 281.06
Прочие доходы	180	346.45	295.79
Прочие расходы	190	0,00	0,00
Прирост имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, в результате выдачи инвестиционных паев	200	0,00	2,00
Уменьшение имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, в результате погашения или обмена инвестиционных паев	210	60.67	3 367.60
ИТОГО: прирост (+) или уменьшение (-) стоимости имущества принадлежащего акционерному инвестиционному фонду, или имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд (030 + 060 + 090 + 100 + 110 + 120 + 130 + 140 + 150 + 160+ 180 + 200 - 170 - 190 - 210)	220	4 954.07	-4 381.23

Генеральный директор

_____/ Зензинов Б.В. /
(подпись)

Главный бухгалтер

_____/ Кузнецова Е.А. /
(подпись)

Отчет о владельцах акций акционерного инвестиционного фонда и владельцах инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда
Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций
«Накопительный резерв» под управлением ООО ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда или тип и название паевого инвестиционного фонда)

Общество с ограниченной ответственностью ВТБ Капитал Пенсионный резерв

(полное фирменное наименование управляющей компании)

Дата определения владельцев инвестиционных паев 30.06.2015

Наименование показателя	Код строки	На начало отчетного года	На отчетную дату
Количество размещенных акций акционерного инвестиционного фонда, по которым зарегистрированы отчеты об итогах выпуска (количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда), всего	100	39 007.87359	38 967.78344
из них:			
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находится в Российской Федерации	110	1 045.91782	1 005.82767
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	120	37 961.95577	37 961.95577
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находится за пределами территории Российской Федерации	130	0.00000	0.00000
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами территории Российской Федерации	140	0.00000	0.00000
находящихся у номинальных держателей	150	0.00000	0.00000
Количество лицевых счетов в реестре акционеров акционерного инвестиционного фонда (реестре владельцев инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда), всего	200	84	84
из них:			
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находится в Российской Федерации	210	82	82
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	220	1	1
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находится за пределами территории Российской Федерации	230	0	0
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, которому переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами территории Российской Федерации	240	0	0
лицевых счетов номинальных держателей	250	1	1

Генеральный директор

_____/ Зензинов Б.В. /
(подпись)

Главный бухгалтер

_____/ Кузнецова Е.А. /
(подпись)