

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 31.03.2009 г.

Полное наименование, ИНН/КПП
учредителя управления

7706016118 770601001 Пенсионный фонд Российской Федерации

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании

7722270922 770201001 Общество с ограниченной
ответственностью «Пенсионный резерв»
Д.У. средствами пенсионных накоплений

Дата и номер договора доверительного управления

08.10.2003

22-03У048

Дата и время составления расчета

01.04.2009 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	29 168,73455
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	274 750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 088 326,92586
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	362 869,55853
муниципальные облигации	033	96 873,85140
облигации российских хозяйственных обществ	034	428 312,65739
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	200 270,85854
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
Дебиторская задолженность, в том числе:	040	21 098,82124
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	3 327,08676
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	17 771,73448
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000
Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1 413 344,48165
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
1	2	3,00000

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	1 413 344,48165

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Корпушенков В.А.

(И.О. Фамилия)

Расчет
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию
на **31.03.2009** г.

Полное наименование, ИНН/КПП

учредителя управления **7706016118** **770601001** Пенсионный фонд Российской Федерации

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании

7722270922 **770201001** Общество с ограниченной ответственностью
«Пенсионный резерв» Д.У. средствами
пенсионных накоплений

Дата и номер договора доверительного управления

08.10.2003 22-03У048

Дата и время составления расчета

01.04.2009 10:00:00

1. Денежные средства на счетах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счета		Реквизиты банковского счета	Сумма денежных средств (тыс. руб.)
	дата	номер		
1	2	3	4	5
ОАО "Банк Москвы"	28/07/2003	31-076/01/278	40701810600760000051	29 168,73455
Итого денежных средств на счетах				29 168,73455

2. Денежные средства в депозитах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счета		Реквизиты банковского счета	Сумма вклада (тыс. руб.)	Проценты начисленные (тыс. руб.)
	дата	номер			
1	2	3	4	5	6
ОАО "РОСБАНК"	03.10.2006	GS/06/148	42006810600000016775	100 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	06.09.2007	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	07.08.2007	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.2007	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19 750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	28.11.2006	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.2006	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.2006	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.04.2006	22-101/07/1	42006810900760000001	25 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994	42003810000001004994	50 000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					274 750,00000

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 расчета 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 расчета рыночной цены *
1	2	3	4	5	6	7
Облигация	Башкорт5об	RU25005BAS0	984,900	26114	25 719,67860	ММВБ
Облигация	БелгОб 3об	RU31001BEL0	890,000	10000	8 900,00000	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	872,800	35215	30 735,65200	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	985,000	31087	30 620,69500	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	890,100	16724	14 886,03240	ММВБ
Облигация	МГор41-об	RU27041MOS	939,000	50000	46 950,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	992,000	8544	8 475,64800	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	450,750	5000	2 253,75000	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	367,2750	49169	18 058,54448	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	839,700	47153	39 594,37410	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	670,875	10160	6 816,09000	ММВБ
Облигация	ТульскОб 1	RU31001TUL0	986,600	37625	37 120,82500	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	404,160	9600	3 879,93600	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	773,040	21000	16 233,84000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	750,100	3000	2 250,30000	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	848,200	25700	21 798,74000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	649,875	15678	10 188,74025	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	837,900	45813	38 386,71270	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					362 869,55853	

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчета рыночной цены *
1	2	3	4	5	6
Казань06об	RU31003KZN1	973,900	60990	59 398,16100	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	997,400	28196	28 122,69040	ММВБ
Новсиб 4об	RU31004NSB1	940,000	9950	9 353,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				96 873,85140	

8. Облигации российских хозяйственных обществ

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	Источник расчета рыночной цены *
1	2	3	4	5	6
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-А	739,200	16874,000	12 473,26080	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-А	968,500	26300,000	25 471,55000	ММВБ
Возрожд 01	40101439В	934,500	5000,000	4 672,50000	ММВБ
ГАЗПРОМ А6	4-06-00028-А	989,100	58600,000	57 961,26000	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	961,100	40345,000	38 775,57950	ММВБ
Зенит 3обл	40303255В	996,200	21912,000	21 828,73440	ММВБ
ДальСвз3об	4-11-30166-Ф	296,370	1750,000	518,64750	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-Р	30,100	4100,000	123,41000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-Р	3,300	2000,000	6,60000	ММВБ

МГТС-04 об	4-04-00083-A	990,500	3740,000	3 704,47000	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	592,260	20000,000	11 845,20000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	877,200	58500,000	51 316,20000	ММВБ
М-ИНДУСТР	4-01-16444-J	246,100	155,000	38,14550	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	979,900	27240,000	26 692,47600	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	809,600	31056,000	25 142,93760	ММВБ
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	970,800	19500,000	18 930,60000	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	911,900	16735,000	15 260,64650	ММВБ
РосселхБ 3	40303349B	960,800	23000,000	22 098,40000	ММВБ
СибТлк-боб	4-06-00195-A	871,000	4,000	3,48400	ММВБ
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	888,042	1951,000	1 732,57059	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	937,200	15355,000	14 390,70600	ММВБ
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	883,900	4990,000	4 410,66100	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	957,400	74070,000	70 914,61800	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				428 312,65739	

**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 расчета рыночной цены *
1	2	3	4	5	6	7
Аэрофлот	ао	1-01-00010-A	38,99000	100500	3 918,49500	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 292,52000	44200	57 129,38400	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	144,91000	26978	3 909,38198	ММВБ
Мосэнерго а.о.	ао	1-01-00085-A	0,89100	9621900	8 573,11290	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	0,81400	1500000	1 221,00000	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	0,75400	14050000	10 593,70000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	20,83000	1350000	28 120,50000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	9,85000	400000	3 940,00000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	6,25600	621400	3 887,47840	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	0,40700	12647500	5 147,53250	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	0,32800	978500	320,94800	ММВБ
Татнефть Зао	ао	1-03-00161-A	82,21000	580000	47 681,80000	ММВБ
Татнефть Зап	ап	2-03-00161-A	31,59365	395000	12 479,49175	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,00360	2	0,00001	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	0,34000	35240100	11 981,63400	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	0,22400	6100000	1 366,40000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					200 270,85854	

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 расчета рыночной цены *
1	2	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 расчета 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	
ОАО "Альфа-Банк"	3 327,08676	
Итого средств на специальных брокерских счетах	3 327,08676	
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
Казань06об	RU31003KZN1	440,95770
Новсиб 3об	RU31003NSB1	722,94544
Новсиб 4об	RU31004NSB1	13,93000
Башкорт5об	RU25005BAS0	837,99826
БелгОб 3об	RU31001BEL0	110,20000
Карелия 2	RU34010KAR0	1 292,39050
КраснодКр2	RU34002KND0	686,40096
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	611,76392
МГор41-об	RU27041MOS	657,50000
Мос.обл.4в	RU25004MOO	180,27840
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	124,65000
НовсибО-05	RU34013ANO0	53,10252
СамарОбл 3	RU25003SAM0	461,62787
Томск.об-4	RU34030TMS0	138,78560
ТульскОб 1	RU31001TUL0	832,26500
Хабаровскб	RU31006HAB0	93,50400
Якут-06 об	RU25006RSY	216,30000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	49,02000
Чувашия-06	RU31006CHU0	381,38800
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	388,97118
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	771,03279
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	374,09658
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	120,98000
Возрожд 01	40101439B	33,10000
ГАЗПРОМ А6	4-06-00028-A	602,40800
ГСС 01	4-01-21927-Н	43,57260
Зенит 3обл	40303255B	826,08240
ДальСвз3об	4-11-30166-F	14,59500
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	127,75600
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	120,52000
МГТС-04 об	4-04-00083-A	116,38880
МГТС-05 об	4-05-00083-A	294,20000
Мечел 2об	4-02-55005-E	1 399,90500
М-ИНДУСТР	4-01-16444-J	2,18550
Мосэнерго1	4-02-00085-A	78,72360
Мосэнерго2	4-03-00085-A	214,90752
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	721,30500
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	112,96125
РосселхБ 3	40303349B	184,92000
СибТлк-6об	4-06-00195-A	0,01284
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	29,06990
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	169,67275
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	135,07930
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	2 984,28030

Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	17 771,73448
Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Денежные средства в пути	0,00000
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	21 098,82124

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1 413 344,48165 тыс. руб.**

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Корпушенков В.А.

(И.О. Фамилия)

М.П.

* 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.