

**Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 30.09.2008 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

01.10.2008 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	4 798,37188
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	274 750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 208 347,73507
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	308 193,13666
муниципальные облигации	033	106 767,28960
облигации российских хозяйственных обществ	034	530 262,83020
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	263 124,47861
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	35 742,82832
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	16 770,56841
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	18 972,25991
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000
Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1 523 638,93527

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	1 523 638,93527

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 **30.09.2008** 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

01.10.2008 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	4 798,37188
Итого денежных средств на счетах				4 798,37188

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	4200681060000016775	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	42004810300001004994	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	БелгОб 3об	RU31001BEL0	890,100	10000	8 901,00000	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	962,900	35215	33 908,52350	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	996,000	362	360,55200	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр3	RU34003KNA0	498,900	31020	15 475,87800	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1104,700	16724	18 475,00280	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1003,700	8544	8 575,61280	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	492,400	5000	2 462,00000	ММВБ
Облигация	НижгорОбл2	RU34002NJG0	299,370	50040	14 980,47480	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	607,0625	29169	17 707,40606	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	944,600	35000	33 061,00000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	912,700	10160	9 273,03200	ММВБ
Облигация	ТульскОб 1	RU31001TUL0	986,200	37625	37 105,77500	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	707,280	9600	6 789,88800	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	984,900	21000	20 682,90000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	927,700	3000	2 783,10000	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	938,100	25700	24 109,17000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	716,250	16010	11 467,16250	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	918,400	45813	42 074,65920	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					308 193,13666	

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	964,200	59990	57 842,35800	ММВБ
КрасЯрск05	RU31005KRN1	997,400	10000	9 974,00000	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1009,600	28196	28 466,68160	ММВБ
Новсиб 4об	RU31004NSB1	998,500	10500	10 484,25000	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				106 767,28960	

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-2	4-44-00137-А	990,500	15000,000	14 857,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-А	931,400	16874,000	15 716,44360	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-А	949,300	10000,000	9 493,00000	ММВБ
Возрожд 01	40101439В	886,400	5000,000	4 432,00000	ММВБ
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-А	989,000	50000,000	49 450,00000	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	964,300	40345,000	38 904,68350	ММВБ
Зенит 3обл	40303255В	1002,100	21912,000	21 958,01520	ММВБ
Зенит 4обл	40403255В	996,400	10000,000	9 964,00000	ММВБ
ДальСвз3об	4-11-30166-Ф	598,860	1750,000	1 048,00500	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-Р	938,700	1000,000	938,70000	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-Р	970,100	25000,000	24 252,50000	ММВБ

Инпром 03	4-03-55534-P	981,500	22373,000	21 959,09950	ММВБ
МГТС-04 об	4-04-00083-A	1000,200	3740,000	3 740,74800	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	800,000	20000,000	16 000,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	834,000	58500,000	48 789,00000	ММВБ
МИА-3об	40303344B	995,100	22000,000	21 892,20000	ММВБ
М-ИНДУСТР	4-01-16444-J	936,000	155,000	145,08000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	952,600	27240,000	25 948,82400	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	956,700	31056,000	29 711,27520	ММВБ
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	976,200	19500,000	19 035,90000	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	976,800	19195,000	18 749,67600	ММВБ
ПАВА 02 об	4-02-10682-F	998,200	22800,000	22 758,96000	ММВБ
7Контин-02	4-02-00462-H	928,400	5000,000	4 642,00000	ММВБ
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	984,900	1996,000	1 965,86040	ММВБ
ТатфондБ 3	40303058B	964,600	12000,000	11 575,20000	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	979,700	999,000	978,72030	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	938,100	20305,000	19 048,12050	ММВБ
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	934,000	5000,000	4 670,00000	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	951,700	71070,000	67 637,31900	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				530 262,83020	

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	59,21000	118000	6 986,78000	ММВБ
ИркЭнерго	ао	1-01-00041-A	12,75900	200000	2 551,80000	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 448,52000	50000	72 426,00000	ММВБ
Мосэнерго а.о.	ао	1-01-00085-A	1,43900	8484700	12 209,48330	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	1,55000	1500000	2 325,00000	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	19,50000	200000	3 900,00000	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	0,76200	9450000	7 200,90000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	41,44000	1500000	62 160,00000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	23,91000	400000	9 564,00000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	14,09900	521400	7 351,21860	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	0,75100	21747500	16 332,37250	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	0,67400	2100000	1 415,40000	ММВБ
Татнефть Зао	ао	1-03-00161-A	89,38000	470000	42 008,60000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,00590	2	0,00001	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	0,44200	33240100	14 692,12420	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	0,32800	6100000	2 000,80000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					263 124,47861	

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"	16 770,56841	
Итого средств на специальных брокерских счетах	16 770,56841	
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	446,92550
КрасЯрк05	RU31005KRN1	339,00000
Новсиб 3об	RU31003NSB1	732,25012
Новсиб 4об	RU31004NSB1	17,11500
БелгОб 3об	RU31001BEL0	110,20000
Карелия 2	RU34010KAR0	1 292,39050
КраснодКр2	RU34002KND0	8,09432
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	461,57760
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	624,30692
Мос.обл.4в	RU25004MOO	180,27840
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	124,65000
НижгорОбл2	RU34002NJG0	600,98040
НовсибО-05	RU34013ANO0	56,00448
СамарОбл 3	RU25003SAM0	342,65000
Томск.об-4	RU34030TMS0	187,04560
ТульскОб 1	RU31001TUL0	43,64500
Хабаровскб	RU31006HAB0	178,08000
Якут-06 об	RU25006RSY	270,48000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	49,02000
Чувашия-06	RU31006CHU0	393,72400
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	397,20810
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	885,10716
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	400,95000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	467,57854
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	46,00000
Возрожд 01	40101439B	33,10000
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	540,50000
ГСС 01	4-01-21927-H	43,57260
Зенит 3обл	40303255B	826,08240
Зенит 4обл	40403255B	485,50000
ДальСвз3об	4-11-30166-F	29,19000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	5,42000
Инпром 02	4-02-55534-P	452,00000
Инпром 03	4-03-55534-P	724,21401
МГТС-04 об	4-04-00083-A	116,38880
МГТС-05 об	4-05-00083-A	392,20000
Мечел 2об	4-02-55005-E	1 399,90500
МИА-3об	40303344B	158,18000
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	129,56625
ПАВА 02 об	4-02-10682-F	421,57200

7Контин-02	4-02-00462-Н	110,05000
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	29,74040
ТатфондБ 3	40303058В	161,76000
ТМК-02 обл	4-02-29031-Н	1,45854
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	224,37025
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-А	135,35000
ЮТК-03 об.	4-07-00062-А	2 879,75640
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		18 972,25991
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.)		35 742,82832

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1 523 638,93527 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.