

Приложение № 2
к Порядку расчета рыночной
стоимости активов и стоимости чистых
активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на _ 31.12.2010 г.

Полное наименование, ИНН/КПП
учредителя управления 7706016118 770601001 Пенсионный фонд Российской Федерации

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании 7722270922 771001001 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 01.01.2011 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	55322,96198
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	279118,75068
Ценные бумаги, в том числе:	030	3194049,10326
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	699797,71772
муниципальные облигации	033	0,00000
облигации российских хозяйственных обществ	034	1920654,35937
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	573597,02617
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	58347,98912
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	9779,56673
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	48568,42239
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	3586838,80504
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	48433,59255
1	2	3
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	48433,59255
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	48433,59255
Итого стоимость чистых активов (строки 060 - 080)	090	3538405,21249

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Зензинов Б.В.

(И.О. Фамилия)

Приложение № 1
к Порядку расчета рыночной
стоимости активов и стоимости чистых
активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений

Расчет
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию
на **31.12.2010** г.

Полное наименование, ИНН/КПП
учредителя управления 7706016118 770601001 Пенсионный фонд Российской Федерации

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании 7722270922 771001001 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 01.01.2011 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	55322,96198
Итого денежных средств на счетах				55322,96198

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 "Банк Москвы"	16.07.2010	31-011/07/232-10	42006810000110000001	7000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	30.09.2010	31-088/07/464-10	42105810400880000023	7000,00000	118,75068
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (12)	42006810600000004994	102000,00000	0,00000
Банк Зенит	04.03.2010	002/28.01/ПР	42005810500003010620	100000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					279118,75068

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 5об	RU24003BEL0	1022,000	69457	70985,05400	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	501,350	28874	14475,97990	ММВБ
Облигация	Карелия 12	RU34012KAR0	316,770	63505	20116,47885	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	712,500	31087	22149,48750	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр4	RU34004KNA0	735,630	26028	19146,97764	ММВБ
Облигация	ЛипецкОблб	RU34006LIP0	764,250	79391	60674,57175	Расчетная
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1147,000	16724	19182,42800	ММВБ
Облигация	МГор49-об	RU32049MOS0	998,000	35000	34930,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.7в	RU26007MOO0	990,200	100000	99020,00000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1006,800	63009	63437,46120	Расчетная
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	251,2500000	195680	49164,60000	ММВБ
Облигация	Томск.об-7	RU34037TMS0	649,920	75336	48962,37312	ММВБ
Облигация	Якут-07 об	RU35002RSY0	804,960	72406	58283,93376	ММВБ
Облигация	ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	1072,24561934	66200	70982,66000	Расчетная
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	1000,200	25700	25705,14000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	350,630	64400	22580,57200	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					699797,71772	

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
Новсиб 4об	RU31004NSB1	0,000	0	0,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00000	

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
АЛРОСА 21	4-21-40046-N	1007,80000000	198000,000	199544,40000	ММВБ
АЛРОСА 23	4-23-40046-N	1023,40000000	85000,000	86989,00000	ММВБ
ВТБ БО-01	4В020101000В	1000,90000000	62000,000	62055,80000	ММВБ
ВТБ БО-02	4В020201000В	1012,30000000	50000,000	50615,00000	ММВБ
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	615,64179270	100000,000	61564,17927	ММВБ
ЛСР 02 обл	4-02-55234-E	1006,00000000	21600,000	21729,60000	ММВБ
ГазпрнфБО5	4В02-05-00146-А	998,70000000	1000,000	998,70000	ММВБ
ГазпрнфБО6	4В02-06-00146-А	1003,50000000	80001,000	80281,00350	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	1011,50000000	40345,000	40808,96750	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000000	4100,000	0,00000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000000	2000,000	0,00000	ММВБ
Мечел 13об	4-13-55005-E	1009,10000000	211347,000	213270,25770	ММВБ

Мечел 14об	4-14-55005-E	1009,60000000	70000,000	70672,00000	ММВБ
ММК БО-1	4B02-01-00078-A	998,40000000	33800,000	33745,92000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1043,10000000	21000,000	21905,10000	ММВБ
МТС 08	4-08-04715-A	996,80000000	100000,000	99680,00000	ММВБ
НЛМК БО-1	4B02-01-00102-A	1055,10000000	30000,000	31653,00000	ММВБ
НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	1046,20000000	26198,000	27408,34760	ММВБ
РЖД-18 обл	4-18-65045-D	1140,00000000	70000,000	79800,00000	ММВБ
СЗТелекбоб	4-06-00119-A	1077,00000000	147000,000	158319,00000	Расчетная
СибТлк-8об	4-08-00195-A	1016,60000000	41950,000	42646,37000	ММВБ
Система-02	4-02-01669-A	1112,00000000	141399,000	157235,68800	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-A	998,90000000	21345,000	21321,52050	Расчетная
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	708,82000000	77665,000	55050,50530	ММВБ
ЯкутскЭБО1	4B02-01-00304-A	1011,20000000	300000,000	303360,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1920654,35937	

**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	79,13000	1241620	98249,39060	ММВБ
ВолгаТлк	ао	1-01-00137-A	139,78000	100000	13978,00000	ММВБ
ГМКНорНик	ао	1-01-40155-F	7 183,67000	7388	53072,95396	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	880,07000	27374	24091,03618	ММВБ
МТС-ао	ао	1-01-04715-A	259,91000	233230	60618,80930	ММВБ
Новатэк ао	ао	1-02-00268-E	330,99000	267411	88510,36689	ММВБ
ОГК-1 ао	ао	1-02-65107-D	1,21800	30874400	37605,01920	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	1,63900	40050000	65641,95000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	104,05000	990000	103009,50000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01820	2	0,00004	ММВБ
УралСвИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,44100	20000000	28820,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					573597,02617	

**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"	9779,56673
	Итого средств на специальных брокерских счетах	9779,56673
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
БелгОб 5об	RU24003BEL0	728,60393
Карелия 2	RU34010KAR0	236,76680
Карелия 12	RU34012KAR0	288,31270
КраснодКр2	RU34002KND0	53,78051
КраснЯрКр4	RU34004KNA0	277,97904
ЛипецкОблб	RU34006LIP0	336,61784
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	115,39560
МГор49-об	RU32049MOS0	130,55000
Мос.обл.7в	RU26007MOO0	1578,00000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	655,92369
Томск.об-4	RU34030TMS0	46,96320
Томск.об-7	RU34037TMS0	547,69272
Якут-07 об	RU35002RSY0	879,00884
ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	150,93600
Чувашия-06	RU31006CHU0	372,13600
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	293,02000
АЛРОСА 21	4-21-40046-N	358,38000
АЛРОСА 23	4-23-40046-N	166,60000
ВТБ БО-01	4B020101000B	181,04000
ВТБ БО-02	4B020201000B	146,00000
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	599,00000
ЛСР 02 обл	4-02-55234-E	1182,38400
ГазпрнфБО5	4B02-05-00146-A	15,67000
ГазпрнфБО6	4B02-06-00146-A	1253,61567
ГСС 01	4-01-21927-H	1012,25605
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000
Мечел 13об	4-13-55005-E	6659,54397
Мечел 14об	4-14-55005-E	2205,70000
ММК БО-1	4B02-01-00078-A	274,79400
Мосэнерго1	4-02-00085-A	776,79000
МТС 08	4-08-04715-A	1005,00000
НЛМК БО-1	4B02-01-00102-A	192,30000
НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	455,32124
РЖД-18 обл	4-18-65045-D	3484,60000
СЗТелекбоб	4-06-00119-A	2732,73000
СибТлк-8об	4-08-00195-A	1539,56500
Система-02	4-02-01669-A	7771,28904
УрСИ сер08	4-11-00175-A	377,16615

ЦентрТел-5	4-20-00194-А	1689,99040
ЯкутскЭБО1	4B02-01-00304-А	7797,00000
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		48568,42239
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.)		58347,98912

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 3586838,80504 тыс. руб.**

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Зензинов Б.В.

(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.