

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 30.09.07 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

01.10.2007 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	59937,49236
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	224750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1011067,26582
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	293540,04560
муниципальные облигации	033	39999,92480
облигации российских хозяйственных обществ	034	350139,24900
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	327388,04642
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	36453,03602
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	21514,86164
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	13038,17438
прочая дебиторская задолженность	043	1900,00000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1332207,79420
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
1	2	3
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	1332207,79420

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Корпушенков В.А.

(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 **30.09.07** 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

01.10.2007 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	59937,49236
Итого денежных средств на счетах				59937,49236

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"	03.10.06	GS/06/148	42006810600000016775	10000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	06.09.07	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	07.08.07	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.07	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	28.11.06	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.06	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.06	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.04.06	22-101/07/1	42006810900760000001	25000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					224750,00000

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	КраснЯрКр3	RU34003KNA0	991,000	31020	30740,82000	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1266,200	16724	21175,92880	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1066,900	8544	9115,59360	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	786,450	5000	3932,25000	ММВБ
Облигация	НижегорОбл2	RU34002NJG0	811,360	30040	24373,25440	ММВБ
Облигация	НовсибОбл2	RU25012ANO0	1011,300	7000	7079,10000	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	1001,700	29169	29218,58730	ММВБ
Облигация	ТульскОб 1	RU31001TUL0	1029,700	37625	38742,46250	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	1001,500	10160	10175,24000	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	1001,000	9600	9609,60000	ММВБ
Облигация	ХантМан5об	RU25005HMN	1039,900	4500	4679,55000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	1043,100	21000	21905,10000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1009,100	35000	35318,50000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	1009,100	3000	3027,30000	ММВБ
Облигация	ЯНАО-1 об	RU24001YML	1030,000	26100	26883,00000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	986,200	7510	7406,36200	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	993,000	10229	10157,39700	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					293540,04560	

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
КрасЯрк05	RU31005KRN1	1014,600	10000	10146,00000	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1058,800	28196	29853,92480	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				39999,92480	

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
БанкСОЮ301	40102307B	995,300	1500,000	1492,95000	ММВБ
БанкСОЮ302	40202307B	998,100	15000,000	14971,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-А	1002,700	15000,000	15040,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-А	1020,500	16874,000	17219,91700	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-А	1002,900	10000,000	10029,00000	ММВБ
ГАЗПРОМ А5	4-05-00028-А	1000,100	3910,000	3910,39100	ММВБ

ДальСвзЗоб	4-11-30166-F	1009,200	1750,000	1766,10000	ММВБ
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	1015,300	35000,000	35535,50000	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-P	991,900	25000,000	24797,50000	ММВБ
Инпром 03	4-03-55534-P	995,700	22373,000	22276,79610	ММВБ
МГТС-04 об	4-04-00083-A	1002,500	3740,000	3749,35000	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	1002,200	20000,000	20044,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	1011,800	30000,000	30354,00000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	993,000	21540,000	21389,22000	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	1006,900	30056,000	30263,38640	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	1012,300	19195,000	19431,09850	ММВБ
СевСтАвто	4-01-02461-D	995,000	1996,000	1986,02000	ММВБ
ТатфондБ 3	40303058B	998,000	12000,000	11976,00000	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	1000,000	20000,000	20000,00000	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	998,600	27000,000	26962,20000	ММВБ
УралСвзИн4	4-07-00175-A	1002,000	16910,000	16943,82000	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				350139,24900	

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
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	2 074,09000	32500	67407,92500	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	3,88600	694581	2699,14177	ММВБ
РАО ЕЭС	ао	1-01-00034-A	30,43400	1550000	47172,70000	ММВБ
РАО ЕЭС-п	ап	2-01-00034-A	26,44800	695000	18381,36000	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	65,64000	200000	13128,00000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	102,81000	400000	41124,00000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	69,53000	370000	25726,10000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	38,87700	288500	11216,01450	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	2,66200	7020600	18688,83720	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	1,71800	2100000	3607,80000	ММВБ
Татнфт ЗАО	ао	1-03-00161-A	138,83000	490000	68026,70000	ММВБ
ТГК-5-009D	ао	1-01-12190-E-009D	0,02810	1	0,00003	ММВБ
ТГК-5-010D	ао	1-01-12190-E-010D	0,02810	1	0,00003	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,02810	22927683	644,26789	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,55300	3000000	4659,00000	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	0,96200	5100000	4906,20000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					327388,04642	

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 "Банк Москвы"	21514,86164
Итого средств на специальных брокерских счетах		21514,86164
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
КрасЯрск05	RU31005KRN1	384,20000
Новсиб 3об	RU31003NSB1	732,25012
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	1064,91660
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	612,76736
Мос.обл.4в	RU25004MOO	175,06656
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	184,95000
НижгорОбл2	RU34002NJG0	986,51360
НовсибОбл2	RU25012ANO0	79,10000
НовсибО-05	RU34013ANO0	81,38151
ТульскОб 1	RU31001TUL0	823,61125
Томск.об-4	RU34030TMS0	213,76640
Хабаровск6	RU31006HAB0	271,39200
ХантМан5об	RU25005HMN	184,95000
Якут-06 об	RU25006RSY	258,93000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	327,95000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	47,70000
ЯНАО-1 об	RU24001YML	400,37400
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	253,53760
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	212,04717
БанкСОЮ301	40102307B	25,09500
БанкСОЮ302	40202307B	615,75000
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	394,20000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	459,81650
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	41,60000
ГАЗПРОМ А5	4-05-00028-A	140,48630
ДальСвз3об	4-11-30166-F	47,82750
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	83,65000
Инпром 02	4-02-55534-P	440,00000
Инпром 03	4-03-55534-P	713,25124
МГТС-04 об	4-04-00083-A	114,93020
МГТС-05 об	4-05-00083-A	482,40000
Мечел 2об	4-02-55005-E	704,10000
Мосэнерго1	4-02-00085-A	53,41920
Мосэнерго2	4-03-00085-A	195,36400
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	120,35265
СевСтАвто	4-01-02461-D	28,88212
ТатфондБ 3	40303058B	131,52000
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	20,80000

ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	235,17000
УралСвзИн4	4-07-00175-А	694,15550
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13038,17438
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1		2
Денежные средства в пути		1900,00000
Итого прочая дебиторская задолженность		1900,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)		36453,03602

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1332207,79420 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.