

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ  
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 30.06.2006**

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

Дата и номер договора доверительного управления 08 октября 2003 № 22- 03У048

Наименование инвестиционного портфеля

Дата и время составления отчета

01.07.2006

10:00

Вид актива/обязательства	Код	Оценка на текущую отчетную дату (рублей)	Оценка на начало отчетного года (рублей) <*>
1	2	3	4
<b>Активы:</b>			
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	372 074,17	6 966 814,04
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	35 000 000,00	30 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	497 558 743,54	279 162 168,56
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	217 963 093,10	113 914 589,30
облигации муниципальных образований	033	39 757 175,60	23 305 200,00
облигации российских хозяйственных обществ	034	91 765 779,00	71 951 238,50
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	148 072 695,84	69 991 140,76
паи (акции, доли)индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	036	0,00	0,00
ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	037	0,00	0,00
Дебиторская задолженность	040	16 499 861,76	6 226 907,51
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	9 164 724,06	1 268 799,97
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	7 335 137,70	4 958 107,54
- прочая дебиторская задолженность	043	0,00	0,00
Прочие активы	050	0,00	0,00
<b>ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010+020+030 + 040 + 050)</b>	<b>060</b>	<b>549 430 679,47</b>	<b>322 355 890,11</b>
<b>Обязательства:</b>			
Кредиторская задолженность, в том числе	070	0,00	5 421 609,14
- обязательства перед профессиональными участниками рынка ценных бумаг	071	0,00	0,00
- кредиторская задолженность по возмещению расходов и выплате вознаграждения	072	0,00	5 421 609,14
- прочая кредиторская задолженность	073	0,00	
Итого сумма обязательств	080	0,00	5 421 609,14
<b>ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)</b>	<b>090</b>	<b>549 430 679,47</b>	<b>316 934 280,97</b>

Уполномоченное должностное лицо управляющей компании

Уполномоченное должностное лицо специализированного депозитария



Бензинов Б.В. /

<\*> Для первого года инвестирования указывается оценка на дату передачи средств пенсионных накоплений в доверительное управление.

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ за 30.06.2006**

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

Дата и номер договора доверительного управления 08 октября 2003 № 22-03У048

Наименование инвестиционного портфеля

Дата и время составления отчета

01.07.2006

10:00

Вид имущества	Код стр.	Оценка на текущую отчетную дату рублей	Оценка на начало отчетного года рублей	Доля от рыночной стоимости инвестиционного портфеля
1	2	3	4	5
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	372 074,17	6 966 814,04	0,0677
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	35 000 000,00	30 000 000,00	6,3702
Государственные ценные бумаги Российской Федерации	030	0,00	0,00	0,0000
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	031	0,00	0,00	0,0000
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	040	217 963 093,10	113 914 589,30	39,6707
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	39 757 175,60	23 305 200,00	7,2361
Облигации российских хозяйственных обществ	060	91 765 779,00	71 951 238,50	16,7020
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	061	0,00	0,00	0,0000
Акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	070	148 072 695,84	69 991 140,76	26,9502
Паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	080	0,00	0,00	0,0000
Ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	090	0,00	0,00	0,0000
в том числе обеспеченные государственной гарантией Российской Федерации	091	0,00	0,00	0,0000
Дебиторская задолженность в том числе:	100	16 499 861,76	6 226 907,51	3,0031
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	9 164 724,06	1 268 799,97	1,6680
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	7 335 137,70	4 958 107,54	1,3350
- прочая дебиторская задолженность	103	0,00	0,00	0,0000
Прочие активы	110	0,00	0,00	0,0000
<b>ИТОГО рыночная стоимость инвестиционного портфеля:</b> (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090 + 100 + 110)	<b>120</b>	<b>549 430 679,47</b>	<b>322 355 890,11</b>	<b>100,0000</b>

Уполномоченное должностное лицо  
управляющей компании

подпись

Уполномоченное должностное лицо  
специализированного депозитария

подпись



<\*> Для первого года инвестирования указывается оценка на дату передачи средств пенсионных накоплений в доверительное управление.