

РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ за 30.09.2005

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

01.10.2005

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	20 662 067,57	30 404 779,26	7,6555
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	20 000 000,00	10 000 000,00	7,4102
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	90 174 732,60	50 530 826,10	33,4107
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	15 320 332,50	6 350 445,80	5,6763
Облигации российских хозяйственных обществ	060	63 507 371,40	22 966 891,70	23,5301
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	55 643 212,67	36 533 383,88	20,6164
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	4 590 232,61	2 405 780,38	1,7007
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	885 256,97	211 163,24	0,3280
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	3 704 975,64	2 194 617,14	1,3727
- прочая дебиторская задолженность	103	0,00	0,00	0,0000
Прочие активы	110	0,00	0,00	0,0000
ИТОГО рыночная стоимость инвестиционного портфеля: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080 + 090 + 100 + 110)	120	269 897 949,35	159 192 107,12	100,0000

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании

подпись

Уполномоченное должностное лицо
специализированного депозитария

подпись



Зензинов Б.В./

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

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 30.09.2005**

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

01.10.2005

10:00

Вид актива/обязательства	Код стр.	Оценка на текущую отчетную дату (рублей)	Оценка на начало отчетного года (рублей) <*>
1	2	3	4
Активы:			
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	20 662 067,57	30 404 779,26
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	20 000 000,00	10 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	224 645 649,17	116 381 547,48
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	90 174 732,60	50 530 826,10
облигации муниципальных образований	033	15 320 332,50	6 350 445,80
облигации российских хозяйственных обществ	034	63 507 371,40	22 966 891,70
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	55 643 212,67	36 533 383,88
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	4 590 232,61	2 405 780,38
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	885 256,97	211 163,24
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	3 704 975,64	2 194 617,14
- прочая дебиторская задолженность	043	0,00	0,00
Прочие активы	050	0,00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010+020+030 + 040 + 050)	060	269 897 949,35	159 192 107,12
Обязательства:			
Кредиторская задолженность, в том числе	070	0,00	175 946,42
- обязательства перед профессиональными участниками рынка ценных бумаг	071	0,00	0,00
- кредиторская задолженность по возмещению расходов и выплате вознаграждения	072	0,00	175 946,42
- прочая кредиторская задолженность	073	0,00	
Итого сумма обязательств	080	0,00	175 946,42
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	269 897 949,35	159 016 160,70

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании

Уполномоченное должностное лицо
специализированного депозитария



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