

РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ за 30.09.2006

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

01.10.2006

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	20 328 704,24	6 966 814,04	2,8726
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	25 000 000,00	30 000 000,00	3,5327
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	261 848 345,00	113 914 589,30	37,0014
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	49 082 298,00	23 305 200,00	6,9357
Облигации российских хозяйственных обществ	060	140 385 811,20	71 951 238,50	19,8377
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	186 587 367,06	69 991 140,76	26,3664
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	24 439 321,37	6 226 907,51	3,4535
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	14 335 620,71	1 268 799,97	2,0257
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	10 103 700,66	4 958 107,54	1,4277
- 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	707 671 846,87	322 355 890,11	100,0000

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.

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 30.09.2006**

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

01.10.2006

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	20 328 704,24	6 966 814,04
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	25 000 000,00	30 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	637 903 821,26	279 162 168,56
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	261 848 345,00	113 914 589,30
облигации муниципальных образований	033	49 082 298,00	23 305 200,00
облигации российских хозяйственных обществ	034	140 385 811,20	71 951 238,50
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	186 587 367,06	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	24 439 321,37	6 226 907,51
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	14 335 620,71	1 268 799,97
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	10 103 700,66	4 958 107,54
- прочая дебиторская задолженность	043	0,00	0,00
Прочие активы	050	0,00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010+020+030 + 040 + 050)	060	707 671 846,87	322 355 890,11
Обязательства:			
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
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	707 671 846,87	316 934 280,97

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании

Зензинов Б.В. /

Уполномоченное должностное лицо
специализированного депозитария



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