

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 31.03.2008 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

01.04.2008 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	261901,19529
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	249750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1095590,52129
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	266631,23165
муниципальные облигации	033	98806,22300
облигации российских хозяйственных обществ	034	430099,52760
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	300053,53904
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	38817,24654
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	24976,66985
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	13840,57669
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000
Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1646058,96312
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	1646058,96312

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Корпушенков В.А.

(И.О. Фамилия)

Расчет
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию
на **31.03.2008** 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

01.04.2008 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	261901,19529
Итого денежных средств на счетах				261901,19529

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 ЗЕНИТ"	02.10.2007	001/28.01/ПР	42005810900001010620	25000,00000	0,00000
ОАО "РОСБАНК"	03.10.2006	GS/06/148	42006810600000016775	100000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	06.09.2007	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	07.08.2007	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.2007	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	28.11.2006	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.2006	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.2006	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.04.2006	22-101/07/1	42006810900760000001	25000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					249750,00000

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	КраснЯрКрЗ	RU34003KNA0	495,500	31020	15370,41000	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-Зоб	RU26002LEN	1168,000	16724	19533,63200	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1040,900	8544	8893,44960	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	519,650	5000	2598,25000	ММВБ
Облигация	НижгорОбл2	RU34002NJG0	503,850	50040	25212,65400	ММВБ
Облигация	НовсиБО-05	RU34013ANO0	873,9500	29169	25492,24755	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	981,800	35000	34363,00000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	959,700	10160	9750,55200	ММВБ
Облигация	ТульскОб 1	RU31001TUL0	990,700	37625	37275,08750	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	690,760	9600	6631,29600	ММВБ
Облигация	ХантМан5об	RU25005HMN	1010,600	4500	4547,70000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	1015,900	21000	21333,90000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	963,800	3000	2891,40000	ММВБ
Облигация	ЯНАО-1 об	RU24001YML	1009,700	26100	26353,17000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	962,400	7510	7227,62400	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	971,000	19729	19156,85900	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					266631,23165	

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
КазаньОбоб	RU31003KZN1	989,100	59990	59336,10900	ММВБ
КрасЯрск05	RU31005KRN1	996,300	10000	9963,00000	ММВБ
Новсиб Зоб	RU31003NSB1	1046,500	28196	29507,11400	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				98806,22300	

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
БанкСОЮЗ01	40102307B	1000,500	1500,000	1500,75000	ММВБ
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	995,900	15000,000	14938,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	989,500	16874,000	16696,82300	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	977,600	10000,000	9776,00000	ММВБ
ДальСвзЗоб	4-11-30166-F	796,080	1750,000	1393,14000	ММВБ
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	993,200	35000,000	34762,00000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	983,300	1000,000	983,30000	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-P	977,400	25000,000	24435,00000	ММВБ
Инпром 03	4-03-55534-P	983,700	22373,000	22008,32010	ММВБ

МГТС-04 об	4-04-00083-A	1007,200	3740,000	3766,92800	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	999,100	20000,000	19982,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	992,500	30000,000	29775,00000	ММВБ
МИА-2об	40203344B	997,000	20000,000	19940,00000	ММВБ
МИА-3об	40303344B	997,300	22000,000	21940,60000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	988,400	27240,000	26924,01600	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	977,800	31056,000	30366,55680	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	1000,800	19195,000	19210,35600	ММВБ
СевСтАвто	4-01-02461-D	989,700	1996,000	1975,44120	ММВБ
ТатфондБ 3	40303058B	1000,000	12000,000	12000,00000	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	988,500	20579,000	20342,34150	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	1003,700	37000,000	37136,90000	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	986,500	61070,000	60245,55500	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				430099,52760	

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
ИркЭнерго	ао	1-01-00041-A	21,13800	200000	4227,60000	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 975,09000	37000	73078,33000	ММВБ
РАО ЕЭС	ао	1-01-00034-A	23,91200	1550000	37063,60000	ММВБ
РАО ЕЭС-п	ап	2-01-00034-A	20,58700	695000	14307,96500	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	57,34000	200000	11468,00000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	73,70000	400000	29480,00000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	47,36000	400000	18944,00000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	29,93200	288500	8635,38200	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	2,27000	7320600	16617,76200	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	1,57000	2100000	3297,00000	ММВБ
Татнфт ЗАО	ао	1-03-00161-A	151,66000	490000	74313,40000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01950	2	0,00004	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,25700	3000000	3771,00000	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	0,79500	6100000	4849,50000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					300053,53904	

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"	24976,66985	
Итого средств на специальных брокерских счетах	24976,66985	
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
Казань06об	RU31003KZN1	433,72770
КрасЯрск05	RU31005KRN1	339,00000
Новсиб 3об	RU31003NSB1	732,25012
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	458,78580
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	618,62076
Мос.обл.4в	RU25004MOO	177,62976
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	123,95000
НижгорОбл2	RU34002NJG0	1027,32120
НовсибО-05	RU34013ANO0	72,63081
СамарОбл 3	RU25003SAM0	335,30000
Томск.об-4	RU34030TMS0	187,04560
ТулскОб 1	RU31001TUL0	34,99125
Хабаровскб	RU31006HAB0	176,73600
ХантМан5об	RU25005HMN	186,39000
Якут-06 об	RU25006RSY	264,60000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	48,36000
ЯНАО-1 об	RU24001YML	393,32700
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	255,11470
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	389,25317
БанкСОЮ301	40102307B	25,47000
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	397,65000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	463,69752
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	43,80000
ДальСвз3об	4-11-30166-F	38,58750
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	92,05000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	5,12000
Инпром 02	4-02-55534-P	446,00000
Инпром 03	4-03-55534-P	718,62076
МГТС-04 об	4-04-00083-A	115,67820
МГТС-05 об	4-05-00083-A	486,40000
Мечел 2об	4-02-55005-E	711,00000
МИА-2об	40203344B	249,80000
МИА-3об	40303344B	153,34000
Мосэнерго1	4-02-00085-A	73,27560
Мосэнерго2	4-03-00085-A	208,38576
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	124,95945
СевСтАвто	4-01-02461-D	29,30128
ТатфондБ 3	40303058B	157,92000
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	25,72375
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	398,86000
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	2619,90300
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13840,57669

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.)	38817,24654

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1646058,96312 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.