

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 30.06.2008 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

01.07.2008 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	3 139,95
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	274 945,08
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 367 755,87
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	349 135,05
муниципальные облигации	033	109 881,28
облигации российских хозяйственных обществ	034	643 908,85
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	264 830,69
паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	036	0,00
облигации с ипотечным покрытием, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	037	0,00
ипотечные сертификаты участия, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	038	0,00
Дебиторская задолженность, в том числе:	040	53 083,15
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	33 970,38
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	19 112,77
прочая дебиторская задолженность	043	0,00
Прочие активы	050	0,00
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1 698 924,06

Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00
1	2	3,00
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	0,00
кредиторская задолженность по перечислению средств на формирование имущества, предназначенного для обеспечения уставной деятельности негосударственного пенсионного фонда	073	0,00
кредиторская задолженность по перечислению средств в негосударственный пенсионный фонд для исполнения им своих текущих обязательств	074	0,00
прочая кредиторская задолженность	075	0,00
Итого сумма обязательств	080	0,00
Итого стоимость чистых активов (строки 060 - 080)	090	1 698 924,06

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 **30.06.2008** 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

01.07.2008 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	3139,95
Итого денежных средств на счетах				3139,95

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"	03.10.2006	GS/06/148	42006810600000016775	10000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	06.09.2007	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	07.08.2007	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	11.04.2007	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19750,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	28.11.2006	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	21.11.2006	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	13.10.2006	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20000,00000	0,00
ОАО "Банк Москвы"	21.04.2006	22-101/07/1	42006810900760000001	25000,00000	0,00
ТрансКредитБанк	05.06.2008	ГС-4994	42003810700000004994	50000,00000	195,08
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					274 945,08

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				0,00	

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				0,00

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				0,00

**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	БелгОб 3об	RU31001BEL0	994,800	10000	9 948,00	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	992,200	35000	34 727,00	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр3	RU34003KNA0	498,050	31020	15 449,51	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1162,500	16724	19 441,65	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1032,500	8544	8 821,68	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	516,150	5000	2 580,75	ММВБ
Облигация	НижгорОбл2	RU34002NJG0	302,520	50040	15 138,10	ММВБ
Облигация	НовсиБО-05	RU34013ANO0	749,6250	29169	21 865,81	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	987,600	35000	34 566,00	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	973,400	10160	9 889,74	ММВБ
Облигация	ТульскОб 1	RU31001TUL0	1008,800	37625	37 956,10	ММВБ
Облигация	Хабаровскб	RU31006HAB0	700,140	9600	6 721,34	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	1026,600	21000	21 558,60	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	972,300	3000	2 916,90	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	962,500	25700	24 736,25	ММВБ
Облигация	ЯНАО-1 об	RU24001YML	1003,200	26100	26 183,52	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	725,400	16010	11 613,65	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	982,700	45813	45 020,44	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					349 135,05	

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
Казань0боб	RU31003KZN1	996,500	59990	59 780,04	ММВБ
КрасЯрск05	RU31005KRN1	999,700	10000	9 997,00	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1049,200	28196	29 583,24	ММВБ
Новсиб 4об	RU31004NSB1	1002,000	10500	10 521,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				109 881,28	

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
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-А	1000,500	15000,000	15 007,50	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-А	994,900	16874,000	16 787,94	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-А	999,800	10000,000	9 998,00	ММВБ
Возрожд 01	40101439В	1000,500	5000,000	5 002,50	ММВБ
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-А	1011,400	47433,000	47 973,74	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	976,000	40000,000	39 040,00	ММВБ
Зенит 3обл	40303255В	1006,800	21912,000	22 061,00	ММВБ
Зенит 4обл	40403255В	1002,500	10000,000	10 025,00	ММВБ

ДальСвзЗоб	4-11-30166-F	605,880	1750,000	1 060,29	ММВБ
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	993,300	42000,000	41 718,60	ММВБ
ИнкомЛадаЗ	4-03-36068-R	1001,800	1000,000	1 001,80	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-P	991,900	25000,000	24 797,50	ММВБ
Инпром 03	4-03-55534-P	995,800	22373,000	22 279,03	ММВБ
МГТС-04 об	4-04-00083-A	1000,200	3740,000	3 740,75	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	800,000	20000,000	16 000,00	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	997,200	58500,000	58 336,20	ММВБ
МИА-2об	40203344B	999,800	20000,000	19 996,00	ММВБ
МИА-3об	40303344B	997,700	22000,000	21 949,40	ММВБ
М-ИНДУСТР	4-01-16444-J	1014,400	155,000	157,23	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	993,400	27240,000	27 060,22	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	983,400	31056,000	30 540,47	ММВБ
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	985,900	19500,000	19 225,05	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	992,400	19195,000	19 049,12	ММВБ
ПАВА 02 об	4-02-10682-F	1020,900	22800,000	23 276,52	ММВБ
7Контин-02	4-02-00462-H	989,300	5000,000	4 946,50	ММВБ
СевСтАвто	4-01-02461-D	984,900	1996,000	1 965,86	ММВБ
ТатфондБЗ	40303058B	1015,500	12000,000	12 186,00	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	996,200	20579,000	20 500,80	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	1014,200	37000,000	37 525,40	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	994,800	71070,000	70 700,44	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				643 908,85	

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
Аэрофлот	ао	1-01-00010-A	77,88000	10000	778,80	ММВБ
ИркЭнерго	ао	1-01-00041-A	20,43700	200000	4 087,40	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	2 317,31000	30000	69 519,30	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	2,77400	1804800	5 006,52	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	50,38000	200000	10 076,00	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	74,63000	750000	55 972,50	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	45,42000	400000	18 168,00	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	29,32700	288700	8 466,70	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	2,13200	7320600	15 607,52	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	1,33200	2100000	2 797,20	ММВБ
Татнфт ЗАО	ао	1-03-00161-A	176,57000	375000	66 213,75	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01730	2	0,00	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,22800	3000000	3 684,00	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	0,73000	6100000	4 453,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					264 830,69	

**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				0,00	

**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					0,00	

**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						0,00

13. Дебиторская задолженность

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах		
Наименование брокера	Сумма средств (тыс. руб.)	
1	2	
ОАО "Альфа-Банк"	33 970,38	
Итого средств на специальных брокерских счетах	33 970,38	
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	433,73
КрасЯрк05	RU31005KRN1	150,00
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1 575,87
Новсиб 4об	RU31004NSB1	14,70
БелгОб 3об	RU31001BEL0	107,90
Карелия 2	RU34010KAR0	572,60
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	227,07
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	97,33
Мос.обл.4в	RU25004MOO	177,63
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	61,65
НижгорОбл2	RU34002NJG0	232,19
НовсибО-05	RU34013ANO0	62,42
СамарОбл 3	RU25003SAM0	335,30
Томск.об-4	RU34030TMS0	7,82
ТульскОб 1	RU31001TUL0	34,99
Хабаровскб	RU31006HAB0	51,07
Якут-06 об	RU25006RSY	264,60
Саха(Якут)	RU35001RSY0	48,36
Чувашия-06	RU31006CHU0	388,07
ЯНАО-1 об	RU24001YML	1 044,00
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	170,19
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	903,89
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	91,05
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	106,14
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	43,80
Возрожд 01	40101439B	143,45
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	1 474,22
ГСС 01	4-01-21927-H	817,20
Зенит 3обл	40303255B	279,38
Зенит 4обл	40403255B	236,00
ДальСвз3об	4-11-30166-F	6,44
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	1 025,64
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	5,12
Инпром 02	4-02-55534-P	994,50
Инпром 03	4-03-55534-P	219,48
МГТС-04 об	4-04-00083-A	49,48
МГТС-05 об	4-05-00083-A	105,80
Мечел 2об	4-02-55005-E	161,46
МИА-2об	40203344B	245,00
МИА-3об	40303344B	153,34
М-ИНДУСТР	4-01-16444-J	6,87
Мосэнерго1	4-02-00085-A	585,12
Мосэнерго2	4-03-00085-A	800,62
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	352,56

ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	546,10
ПАВА 02 об	4-02-10682-F	406,07
7Контин-02	4-02-00462-Н	11,75
СевСтАвто	4-01-02461-D	69,12
ТатфондБ 3	40303058В	157,92
ТМК-02 обл	4-02-29031-Н	415,70
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	1 284,64
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	1 357,44
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		19 112,77
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1		2
Денежные средства в пути		0,00
Итого прочая дебиторская задолженность		0,00
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)		53 083,15

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1 698 924,06 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.