

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ  
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 31.12.2006**

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 09.01.2007 10:00

Вид актива/обязательства	Код стр.	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	972 574,52	6 966 814,04
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	130 000 000,00	30 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	696 648 542,44	279 162 168,56
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	227 767 375,90	113 914 589,30
облигации муниципальных образований	033	19 659 513,20	23 305 200,00
облигации российских хозяйственных обществ	034	209 651 597,20	71 951 238,50
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	239 570 056,14	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	24 487 450,02	6 226 907,51
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	16 007 992,29	1 268 799,97
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	8 479 457,73	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>852 108 566,98</b>	<b>322 355 890,11</b>
<b>Обязательства:</b>			
Кредиторская задолженность, в том числе	070	11 388 957,69	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	11 388 957,69	5 421 609,14
- прочая кредиторская задолженность	073	0,00	
<b>Итого сумма обязательств</b>	<b>080</b>	<b>11 388 957,69</b>	<b>5 421 609,14</b>
<b>ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)</b>	<b>090</b>	<b>840 719 609,29</b>	<b>316 934 280,97</b>

Уполномоченное должностное лицо  
управляющей компании

Уполномоченное должностное лицо  
специализированного депозитария



Иванов В.В. /

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

РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ за 31.12.2006

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

09.01.2007

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	972 574,52	6 966 814,04	0,1141
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	130 000 000,00	30 000 000,00	15,2563
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	227 767 375,90	113 914 589,30	26,7299
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	19 659 513,20	23 305 200,00	2,3072
Облигации российских хозяйственных обществ	060	209 651 597,20	71 951 238,50	24,6039
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	239 570 056,14	69 991 140,76	28,1150
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	24 487 450,02	6 226 907,51	2,8737
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	16 007 992,29	1 268 799,97	1,8786
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	8 479 457,73	4 958 107,54	0,9951
- 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	852 108 566,98	322 355 890,11	100,0000

Уполномоченное должностное лицо  
управляющей компании

подпись

Зеленин Б.В./

Уполномоченное должностное лицо  
специализированного депозитария

подпись



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