

Приложение № 2
к Порядку расчета рыночной
стоимости активов и стоимости чистых
активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений

**Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на _ 31.12.2009 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 г. 22-03У048

Дата и время составления расчета 01.01.2010 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	17 283,30803
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	381 750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 894 004,68673
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	492 574,03783
муниципальные облигации	033	15 925,49910
облигации российских хозяйственных обществ	034	1 020 140,20333
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	365 364,94647
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	68 079,15453
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	10 787,91525
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	33 047,33928
прочая дебиторская задолженность	043	24 243,90000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	2 361 117,14929
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	50 525,04464
1	2	3,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	50 525,04464
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	50 525,04464
Итого стоимость чистых активов (строки 060 - 080)	090	2 310 592,10465

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

В.А. Корпушенков

(И.О. Фамилия)

Приложение № 1
к Порядку расчета рыночной
стоимости активов и стоимости чистых
активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений

Расчет
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию
на **31.12.2009** 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 г. **22-03У048**
Дата и время составления расчета **01.01.2010 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	17 283,30803
Итого денежных средств на счетах				17 283,30803

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 Москвы"	07.08.2007	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.2007	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19 750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	25.11.2009	31-076/07/603-09	42004810300760000014	20 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	02.12.2009	31-076/07/619-09	42004810900760000016	15 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	29.12.2009	31-076/07/702-09	42005810100760000019	102 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (7)	42005810800005004994	50 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (8)	42004810800006004994	30 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (9)	42005810100006004994	30 000,00000	0,00000
ОАО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	27.07.2009	42-1-06/106-2009	42005810300000000088	100 000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					381 750,00000

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	Башкорт6об	RU25006BAS0	969,400	3120	3024,52800	ММВБ
Облигация	БелгОб 3об	RU31001BEL0	992,600	10000	9926,00000	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	731,850	47756	34950,22860	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	998,69859395	31087	31046,54319	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр4	RU34004KNA0	1028,80000000	67979	69936,79520	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1052,800	16724	17607,02720	ММВБ
Облигация	МГор38-об	RU26038MOS	992,200	1000	992,20000	ММВБ
Облигация	МГор41-об	RU27041MOS	992,400	57922	57481,79280	ММВБ
Облигация	МГор50-об	RU25050MOS0	990,000	50000	49500,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	500,600	5000	2503,00000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1000,000	47753	47753,00000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 5	RU35005SAM0	980,900	72000	70624,80000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	480,950	10160	4886,45200	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	400,720	21000	8415,12000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	912,500	3000	2737,50000	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	917,500	25700	23579,75000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	576,300	16139	9300,90570	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	597,780	80813	48308,39514	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					492574,03783	

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
Новсиб 4об	RU31004NSB1	989,100	16101	15925,49910	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				15925,49910	

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-3	4-45-00137-A	398,28000000	72178,000	28 747,05384	ММВБ
Возрожд 01	40101439B	999,800	5000,000	4 999,00000	ММВБ
ВТБ - 5 об	40401000B	1024,400	5900,000	6 043,96000	ММВБ
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	775,470844	82282,000	63 807,29199	ММВБ
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	1004,300	29116,000	29 241,19880	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-H	1019,000	40345,000	41 111,55500	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,000	4100,000	0,00000	ММВБ

ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,000	2000,000	0,00000	ММВБ
ЛукойлЗобл	4-03-00077-A	981,600	18098,000	17 764,99680	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	197,420	20000,000	3 948,40000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	985,900	58500,000	57 675,15000	ММВБ
Мечел 4об	4-04-55005-E	1126,500	44883,000	50 560,69950	ММВБ
Мечел 5об	4-05-55005-E	990,000	1000,000	990,00000	ММВБ
МосэнрБО2	4В02-02-00085-A	1019,100	1700,000	1 732,47000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1048,000	72240,000	75 707,52000	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	932,200	31056,000	28 950,40320	ММВБ
МОЭК-01	4-01-55039-E	1007,500	76624,000	77 198,68000	ММВБ
МТС 01	4-01-04715-A	1017,600	11830,000	12 038,20800	ММВБ
МТС 03	4-03-04715-A	1003,300	30000,000	30 099,00000	ММВБ
МТС 04	4-04-04715-A	1089,000	15000,000	16 335,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1043,400	28000,000	29 215,20000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-1	4В02-01-50077-A	1015,000	10000,000	10 150,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-2	4В02-02-50077-A	1019,900	10000,000	10 199,00000	ММВБ
РЖД-06обл	4-06-65045-D	993,800	30000,000	29 814,00000	ММВБ
РЖД-08обл	4-08-65045-D	1000,300	20000,000	20 006,00000	ММВБ
РЖД-09обл	4-09-65045-D	1024,400	25000,000	25 610,00000	ММВБ
РЖД-12обл	4-12-65045-D	1105,900	30000,000	33 177,00000	ММВБ
РосселхБ 3	40303349В	1000,500	75000,000	75 037,50000	ММВБ
РосселхБ 7	40703349В	1030,900	50,000	51,54500	ММВБ
СЗТелек4об	4-04-00119-A	709,200	995,000	705,65400	ММВБ
СибТлк-6об	4-06-00195-A	995,7000	102138,000	101 698,80660	ММВБ
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	1000,100	1951,000	1 951,19510	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	1000,700	15355,000	15 365,74850	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-A	1004,000	20800,000	20 883,20000	ММВБ
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	973,300	4990,000	4 856,76700	ММВБ
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	994,400	95000,000	94 468,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 020 140,20333	

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	52,92000	233500	12 356,82000	ММВБ
ВолгаТлк-п	ап	2-01-00137-A	67,88906	260000	17 651,15560	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 692,22000	39100	66 165,80200	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	482,63000	36863	17 791,18969	ММВБ
Новатэк ао	ао	1-02-00268-E	170,14000	491100	83 555,75400	ММВБ
Энел ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	2,13800	2970500	6 350,92900	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	1,13500	20050000	22 756,75000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481В	82,77000	659784	54 610,32168	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	1,11400	978500	1 090,04900	ММВБ
Татнефть Зап	ап	2-03-00161-A	75,32000	1054689	79 439,17548	ММВБ
ТГК-1	ао	1-01-03388-D	0,01650	218000000	3 597,00000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01180	2	0,00002	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					365 364,94647	

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"	10 787,91525	
Итого средств на специальных брокерских счетах	10 787,91525	
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
Новсиб 4об	RU31004NSB1	25,92261
Башкортбоб	RU25006BAS0	20,56080
БелгОб 3об	RU31001BEL0	114,80000
Карелия 2	RU34010KAR0	594,56220
КраснодКр2	RU34002KND0	77,40663
КраснЯрКр4	RU34004KNA0	1 062,51177
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	112,21804
МГор38-об	RU26038MOS	1,37000
МГор41-об	RU27041MOS	1 954,86750
МГор50-об	RU25050MOS0	142,50000
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	63,70000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	487,08060
СамарОбл 5	RU35005SAM0	128,16000
Томск.об-4	RU34030TMS0	4,87680
Якут-06 об	RU25006RSY	112,77000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	50,31000
Чувашия-06	RU31006CHU0	379,58900
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	133,63092
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	1 242,09581
ВлгГлкВТ-3	4-45-00137-A	201,37662
Возрожд 01	40101439B	147,10000
ВТБ - 5 об	40401000B	169,74300
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	832,69384
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	924,43300
ГСС 01	4-01-21927-Н	1 624,69315
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000
ЛукойлЗобл	4-03-00077-A	73,83984
МГТС-05 об	4-05-00083-A	64,80000
Мечел 2об	4-02-55005-E	201,82500
Мечел 4об	4-04-55005-E	1 471,71357
Мечел 5об	4-05-55005-E	24,66000
МосэнрБО2	4B02-02-00085-A	67,20100
Мосэнерго1	4-02-00085-A	2 646,87360
Мосэнерго2	4-03-00085-A	820,18896
МОЭК-01	4-01-55039-E	2 380,70768
МТС 01	4-01-04715-A	317,87210
МТС 03	4-03-04715-A	64,50000

МТС 04	4-04-04715-A	1 555,65000
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	855,12000
Энел ОГК-5 БО-1	4B02-01-50077-A	521,40000
Энел ОГК-5 БО-2	4B02-02-50077-A	521,40000
РЖД-06обл	4-06-65045-D	302,10000
РЖД-08обл	4-08-65045-D	819,80000
РЖД-09обл	4-09-65045-D	397,50000
РЖД-12обл	4-12-65045-D	428,70000
РосселхБ 3	40303349B	2 006,25000
РосселхБ 7	40703349B	0,30600
СЗТелек4об	4-04-00119-A	3,48250
СибТлк-6об	4-06-00195-A	2 864,97090
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	68,85079
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	545,25605
УрСИ сер08	4-11-00175-A	465,08800
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	19,46100
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	2 928,85000
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		33 047,33928
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1		2
Денежные средства в пути		24 243,90000
Итого прочая дебиторская задолженность		24 243,90000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)		68 079,15453

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 2 361 117,14929 тыс. руб.**

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

В.А. Корпушенков

(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.