

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 30.06.2009 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 22-03У048

Дата и время составления расчета 01.07.2009 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	522 899,40086
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	269 750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 164 917,86114
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	365 008,67254
муниципальные облигации	033	103 865,31480
облигации российских хозяйственных обществ	034	484 023,78432
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	212 020,08948
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	99 595,21998
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	43 333,56900

дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	18 636,65098
прочая дебиторская задолженность	043	37 625,00000
Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	2 057 162,48198
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
1	2	3,00000
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	2 057 162,48198

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Корпушенков В.А.

(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 **30.06.2009** 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 22-03У048
Дата и время составления расчета 01.07.2009 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	522 899,40086
Итого денежных средств на счетах				522 899,40086

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	100 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	06.09.2007	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10 000,00000	0,00000
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"	28.11.2006	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.2006	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20 000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.2006	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (5)	42005810900002004994	30 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (6)	42005810200003004994	40 000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					269 750,00000

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	Башкорт5об	RU25005BAS0	986,200	26114	25 753,62680	ММВБ
Облигация	БелОб 3об	RU31001BEL0	990,000	10000	9 900,00000	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	925,300	35215	32 584,43950	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	996,500	31087	30 978,19550	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	903,100	16724	15 103,44440	ММВБ
Облигация	МГор38-об	RU26038MOS	984,700	1000	984,70000	ММВБ
Облигация	МГор41-об	RU27041MOS	975,400	50000	48 770,00000	ММВБ
Облигация	МГор50-об	RU25050MOS0	877,000	30000	26 310,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	484,350	5000	2 421,75000	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	248,300	49169	12 208,66270	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	875,500	47153	41 282,45150	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	660,900	10160	6 714,74400	ММВБ
Облигация	Хабаровскб	RU31006HAB0	384,000	9600	3 686,40000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	591,180	21000	12 414,78000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	807,700	3000	2 423,10000	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	810,000	25700	20 817,00000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	686,400	16139	11 077,80960	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	869,580	70813	61 577,56854	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					365 008,67254	

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
Казань06об	RU31003KZN1	995,600	60990	60 721,64400	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1000,300	28196	28 204,45880	ММВБ
Новсиб 4об	RU31004NSB1	974,000	15338	14 939,21200	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				103 865,31480	

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-А	584,280	16874,000	9 859,14072	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-А	997,300	36300,000	36 201,99000	ММВБ
Возрожд 01	40101439В	965,700	5000,000	4 828,50000	ММВБ
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-А	991,500	2407,000	2 386,54050	ММВБ
ГАЗПРОМ А6	4-06-00028-А	999,800	51091,000	51 080,78180	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	984,300	40345,000	39 711,58350	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-Р	30,100	4100,000	123,41000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-Р	3,300	2000,000	6,60000	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-А	394,840	20000,000	7 896,80000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-Е	903,900	58500,000	52 878,15000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-А	998,900	27240,000	27 210,03600	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-А	887,500	31056,000	27 562,20000	ММВБ
ОГК-5 об-1	4-01-50077-А	990,600	24500,000	24 269,70000	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-Д	967,400	16735,000	16 189,43900	ММВБ
Росселхб 3	40303349В	974,000	25000,000	24 350,00000	ММВБ
СибТлк-6об	4-06-00195-А	965,900	66653,000	64 380,13270	ММВБ
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-Д	899,100	1951,000	1 754,14410	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	968,800	15355,000	14 875,92400	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-А	972,600	1000,000	972,60000	ММВБ
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-А	911,700	4990,000	4 549,38300	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-А	984,700	74070,000	72 936,72900	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				484 023,78432	

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-А	34,03000	100500	3 420,01500	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-А	1 435,17000	22000	31 573,74000	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-Е	246,72000	26978	6 656,01216	ММВБ
Мосэнерго а.о.	ао	1-01-00085-А	1,44600	2321900	3 357,46740	ММВБ
ОГК-1 ао	ао	1-02-65107-Д	0,57900	16000000	9 264,00000	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-А	1,18400	3100000	3 670,40000	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-Е	1,18000	14050000	16 579,00000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481В	39,67000	1350000	53 554,50000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481В	26,67000	400000	10 668,00000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-А	8,96100	621400	5 568,36540	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-А	0,66200	12647500	8 372,64500	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-А	0,47700	978500	466,74450	ММВБ
Татнефть Зао	ао	1-03-00161-А	126,69000	150000	19 003,50000	ММВБ
Татнефть Зап	ап	2-03-00161-А	39,01000	570000	22 235,70000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-Е	0,00870	2	0,00002	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-А	0,43000	41000000	17 630,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					212 020,08948	

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"	43 333,56900	
Итого средств на специальных брокерских счетах	43 333,56900	
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	427,53990
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1 566,56976
Новсиб 4об	RU31004NSB1	21,16644
Башкорт5об	RU25005BAS0	315,71826
БелгОб 3об	RU31001BEL0	110,20000
Карелия 2	RU34010KAR0	569,42655
КраснодКр2	RU34002KND0	65,59357
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	101,01296
МГор38-об	RU26038MOS	50,96000
МГор41-об	RU27041MOS	1 654,50000
МГор50-об	RU25050MOS0	78,90000
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	62,35000
НовсибО-05	RU34013ANO0	35,40168
СамарОбл 3	RU25003SAM0	461,62787
Томск.об-4	RU34030TMS0	271,88160
ТульскОб 1	RU31001TUL0	805,92750
Хабаровскб	RU31006HAB0	27,26400
Якут-06 об	RU25006RSY	162,33000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	49,02000
Чувашия-06	RU31006CHU0	381,38800
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	162,51973
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	1 191,78279
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	65,97734
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	166,98000
Возрожд 01	40101439B	144,65000
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	75,33910
ГАЗПРОМ А6	4-06-00028-A	1 410,62251
ГСС 01	4-01-21927-Н	833,12425
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	127,75600
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	164,52000
МГТС-05 об	4-05-00083-A	122,80000
Мечел 2об	4-02-55005-E	174,91500
Мосэнерго1	4-02-00085-A	590,83560
Мосэнерго2	4-03-00085-A	807,14544
ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	448,10500
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	480,12715
РосселхБ 3	40303349B	658,50000
СибТлк-6об	4-06-00195-A	1 833,62403
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	67,99235
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	537,11790
УрСИ сер08	4-11-00175-A	21,83000
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	16,86620
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	1 314,74250

Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	18 636,65098
Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
Денежные средства в пути	37 625,00000
Итого прочая дебиторская задолженность	37 625,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	99 595,21998

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 2 057 162,48198 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.