

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 31.12.2005**

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

01.01.2006

10:00

Вид актива/обязательства	Код стр.	Оценка на текущую отчетную дату (рублей)	Оценка на начало отчетного года (рублей) <*>
1	2	3	4
Активы:			
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	6 966 814,04	30 404 779,26
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	30 000 000,00	10 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	279 162 168,56	116 381 547,48
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	113 914 589,30	50 530 826,10
облигации муниципальных образований	033	23 305 200,00	6 350 445,80
облигации российских хозяйственных обществ	034	71 951 238,50	22 966 891,70
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	69 991 140,76	36 533 383,88
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	6 226 907,51	2 405 780,38
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	1 268 799,97	211 163,24
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	4 958 107,54	2 194 617,14
- прочая дебиторская задолженность	043	0,00	0,00
Прочие активы	050	0,00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010+020+030 + 040 + 050)	060	322 355 890,11	159 192 107,12
Обязательства:			
Кредиторская задолженность, в том числе	070	5 421 609,14	175 946,42
- обязательства перед профессиональными участниками рынка ценных бумаг	071	0,00	0,00
- кредиторская задолженность по возмещению расходов и выплате вознаграждения	072	5 421 609,14	175 946,42
- прочая кредиторская задолженность	073	0,00	
Итого сумма обязательств	080	5 421 609,14	175 946,42
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	316 934 280,97	159 016 160,70

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании

/ Зензинов Б.В./

Уполномоченное должностное лицо
специализированного депозитария

подпись



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

РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ за 31.12.2005

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

01.01.2006

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	6 966 814,04	30 404 779,26	2,1612
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	30 000 000,00	10 000 000,00	9,3065
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	113 914 589,30	50 530 826,10	35,3381
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	23 305 200,00	6 350 445,80	7,2296
Облигации российских хозяйственных обществ	060	71 951 238,50	22 966 891,70	22,3204
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	69 991 140,76	36 533 383,88	21,7124
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	6 226 907,51	2 405 780,38	1,9317
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	1 268 799,97	211 163,24	0,3936
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	4 958 107,54	2 194 617,14	1,5381
- 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	322 355 890,11	159 192 107,12	100,0000

Уполномоченное должностное лицо управляющей компании

подпись

Зензинов Б.В./

Уполномоченное должностное лицо специализированного депозитария

подпись



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