

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 30.06.2010 г.

Полное наименование, ИНН/КПП
учредителя управления 7706016118 770601001 **Пенсионный фонд Российской Федерации**

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании 7722270922 771001001 **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 01.07.2010 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	173 438,26021
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	371 695,89041
Ценные бумаги, в том числе:	030	2 664 556,85624
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	869 035,33096
муниципальные облигации	033	0,00000
облигации российских хозяйственных обществ	034	1 221 770,43258
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	573 751,09270
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	74 223,57560
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	32 999,61925
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	41 223,95635
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000
Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	3 283 914,58246

1	2	3
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
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	3 283 914,58246

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 **30.06.2010** г.

Полное наименование, ИНН/КПП
учредителя управления 7706016118 770601001 **Пенсионный фонд Российской Федерации**

Полное фирменное наименование,
ИНН/КПП управляющей компании 7722270922 771001001 **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 **01.07.2010 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	173 438,26021
Итого денежных средств на счетах				173 438,26021

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 "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (10)	42004810100007004994	100 000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (11)	42004810400008004994	50 000,00000	0,00000
Банк Зенит	04.03.2010	002/28.01/ПР	42005810500003010620	100 000,00000	0,00000
ОАО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	27.07.2009	42-1-06/106-2009	42005810300000000088	100 000,00000	6 695,89041
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					371 695,89041

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	БелгОб 3об	RU31001BEL0	1 011,300	84 732	85 689,47160	ММВБ
Облигация	БелгОб 5об	RU24003BEL0	1 004,000	47 457	47 646,82800	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	753,075	60 874	45 842,68755	ММВБ
Облигация	Карелия 12	RU34012KAR0	1 059,200	42 275	44 777,68000	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	950,000	31 087	29 532,65000	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр4	RU34004KNA0	1 057,700	26 028	27 529,81560	ММВБ
Облигация	ЛипецкОбл6	RU34006LIP0	761,250	79 391	60 436,39875	Расчетная
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1 155,000	16 724	19 316,22000	ММВБ
Облигация	МГор41-об	RU27041MOS	1 003,300	38 922	39 050,44260	ММВБ
Облигация	НижгорОбл4	RU34004NJG0	752,625	1 000	752,62500	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1 009,100	56 501	57 015,15910	Расчетная
Облигация	СамарОбл 5	RU35005SAM0	871,250	100 792	87 815,03000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	498,600	195 680	97 566,04800	ММВБ
Облигация	Томск.об-7	RU34037TMS0	864,080	75 336	65 096,33088	ММВБ
Облигация	Якут-07 об	RU35002RSY0	996,200	72 406	72 130,85720	ММВБ
Облигация	ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	1 068,800	49 500	52 905,60000	Расчетная
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	997,900	25 700	25 646,03000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	600,120	17 139	10 285,45668	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					869 035,33096	

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
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00000	

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
Аэрофл БО1	4B02-01-00010-A	1006,30000000	62 969	63 365,70470	ММВБ
ВТБ БО-01	4B020101000B	1008,40000000	70 000	70 588,00000	ММВБ
ВТБ БО-02	4B020201000B	1000,00000000	50 000	50 000,00000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	201,06000000	35 178	7 072,88868	ММВБ
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	706,78948802	142 212	100 513,94667	ММВБ
ГазпрнфБО6	4B02-06-00146-A	996,30000000	60 001	59 778,99630	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-H	1020,40000000	40 345	41 168,03800	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000000	4 100	0,00000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000000	2 000	0,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	1003,50000000	42 986	43 136,45100	ММВБ
Мечел 4об	4-04-55005-E	1182,50000000	24 883	29 424,14750	ММВБ
МосэнрБО2	4B02-02-00085-A	1012,10000000	1 700	1 720,57000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1072,60000000	72 240	77 484,62400	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	1000,80000000	31 056	31 080,84480	ММВБ
МТС 03	4-03-04715-A	1009,90000000	30 000	30 297,00000	ММВБ

НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	1078,60000000	20 000	21 572,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1065,90000000	16 500	17 587,35000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-1	4B02-01-50077-A	1005,70000000	10 000	10 057,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-2	4B02-02-50077-A	1005,80000000	10 000	10 058,00000	ММВБ
РЖД-23 обл	4-23-65045-D	1052,60000000	79 699	83 891,16740	ММВБ
СЗТелек4об	4-04-00119-A	755,47500000	995	751,69763	ММВБ
СЗТелек6об	4-06-00119-A	1075,40000000	50 000	53 770,00000	ММВБ
СибТлк-6об	4-06-00195-A	1007,20000000	102 138	102 873,39360	ММВБ
СибТлк-8об	4-08-00195-A	1021,70000000	40 000	40 868,00000	ММВБ
Система-01	4-01-01669-A	1043,00000000	5 949	6 204,80700	ММВБ
Система-02	4-02-01669-A	1136,40000000	128 399	145 912,62360	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	1019,40000000	15 355	15 652,88700	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-A	1000,20000000	20 000	20 004,00000	ММВБ
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	921,15000000	94 378	86 936,29470	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1 221 770,43258	

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	56,71000	1 254 777	71 158,40367	ММВБ
ГМКНорник	ао	1-01-40155-F	4 615,01000	13 900	64 148,63900	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 635,15000	6 508	10 641,55620	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	602,83000	102 592	61 845,53536	ММВБ
Новатэк ао	ао	1-02-00268-E	209,08000	506 768	105 955,05344	ММВБ
ОГК-1 ао	ао	1-02-65107-D	1,11000	30 874 400	34 270,58400	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	67,25000	350 000	23 537,50000	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	1,53400	40 050 000	61 436,70000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	77,18000	900 000	69 462,00000	ММВБ
Татнефть Зап	ап	2-03-00161-A	68,59000	1 039 439	71 295,12101	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01240	2	0,00002	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					573 751,09270	

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"	32 999,61925	
Итого средств на специальных брокерских счетах	32 999,61925	
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
БелгОб 3об	RU31001BEL0	953,23500
БелгОб 5об	RU24003BEL0	487,85796
Карелия 2	RU34010KAR0	729,27052
Карелия 12	RU34012KAR0	595,65475
КраснодКр2	RU34002KND0	66,52618
КраснЯрКр4	RU34004KNA0	389,89944
ЛипецкОбл6	RU34006LIP0	307,24317
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	106,69912
МГор41-об	RU27041MOS	1 287,92898
НижгорОбл4	RU34004NJG0	5,76000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	564,44499
СамарОбл 5	RU35005SAM0	131,02960
Томск.об-4	RU34030TMS0	2 938,95040
Томск.об-7	RU34037TMS0	757,88016
Якут-07 об	RU35002RSY0	1 067,98850
ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	84,64500
Чувашия-06	RU31006CHU0	374,44900
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	130,08501
Аэрофл БО1	4B02-01-00010-A	1 055,99013
ВТБ БО-01	4B020101000B	175,00000
ВТБ БО-02	4B020201000B	125,00000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	47,49030
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	1 268,53104
ГазпрнфБО6	4B02-06-00146-A	916,81528
ГСС 01	4-01-21927-H	1 608,15170
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000
Мечел 2об	4-02-55005-E	140,13436
Мечел 4об	4-04-55005-E	802,97441
МосэнрБО2	4B02-02-00085-A	66,65700
Мосэнерго1	4-02-00085-A	2 622,31200
Мосэнерго2	4-03-00085-A	813,66720
МТС 03	4-03-04715-A	52,50000
НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	335,80000
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	498,46500
Энел ОГК-5 БО-1	4B02-01-50077-A	518,10000
Энел ОГК-5 БО-2	4B02-02-50077-A	518,10000
РЖД-23 обл	4-23-65045-D	2 869,16400
СЗТелек4об	4-04-00119-A	3,31335
СЗТелек6об	4-06-00119-A	897,50000
СибТлк-6об	4-06-00195-A	2 837,39364
СибТлк-8об	4-08-00195-A	1 447,20000

Система-01	4-01-01669-А	176,38785
Система-02	4-02-01669-А	6 952,80585
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	552,47290
УрСИ сер08	4-11-00175-А	345,20000
ЦентрТел-5	4-20-00194-А	2 597,28256
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		41 223,95635
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1		2
Денежные средства в пути		0,00000
Итого прочая дебиторская задолженность		0,00000
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)		74 223,57560

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 3 283 914,58246 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.