

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 31.12.2007 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

01.01.2008 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	3418,40501
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	249750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1158073,72191
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	266188,66240
муниципальные облигации	033	90236,04720
облигации российских хозяйственных обществ	034	454134,76640
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	347514,24591
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	69712,81768
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	56046,28866
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	13495,70710
прочая дебиторская задолженность	043	170,82192

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1480954,94460
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	7943,23363
1	2	3
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения специализированному депозитарию	071	0,00000
кредиторская задолженность по выплате вознаграждения управляющей компании	072	7943,23363
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	7943,23363
Итого стоимость чистых активов (строки 060 - 080)	090	1473011,71097

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 **31.12.2007** 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

01.01.2008 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	3418,40501
Итого денежных средств на счетах				3418,40501

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 ЗЕНИТ"	02.10.2007	001/28.01/ПР	42005810900001010620	25000,00000	170,82192
ОАО "РОСБАНК"	03.10.2006	GS/06/148	42006810600000016775	100000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	06.09.2007	31-076/07/679-07	42006810300760000012	10000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	07.08.2007	31-076/07/589-07	42006810700760000010	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.2007	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	28.11.2006	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.2006	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.2006	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.04.2006	22-101/07/1	42006810900760000001	25000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					249920,82192

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	КраснЯрКрЗ	RU34003KNA0	499,650	31020	15499,14300	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1243,700	16724	20799,63880	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1055,400	8544	9017,33760	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	532,250	5000	2661,25000	ММВБ
Облигация	НижгорОбл2	RU34002NJK0	508,200	50040	25430,32800	ММВБ
Облигация	НовсиБО-05	RU34013ANO0	995,600	29169	29040,65640	ММВБ
Облигация	ТулскОб 1	RU31001TUL0	1014,000	37625	38151,75000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	985,800	10160	10015,72800	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	696,360	9600	6685,05600	ММВБ
Облигация	ХантМан5об	RU25005HMN	1019,100	4500	4585,95000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	1035,100	21000	21737,10000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1010,500	35000	35367,50000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	1014,900	3000	3044,70000	ММВБ
Облигация	ЯНАО-1 об	RU24001YML	1018,300	26100	26577,63000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	988,500	7510	7423,63500	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	992,400	10229	10151,25960	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					266188,66240	

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	1001,800	49990	50079,98200	ММВБ
КрасЯрк05	RU31005KRN1	1002,300	10000	10023,00000	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1068,700	28196	30133,06520	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				90236,04720	

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
БанкСОЮЗ01	40102307B	1001,000	1500,000	1501,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	1002,500	15000,000	15037,50000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	1025,900	16874,000	17311,03660	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	1000,700	10000,000	10007,00000	ММВБ
ДальСвз3об	4-11-30166-F	805,360	1750,000	1409,38000	ММВБ
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	1022,700	35000,000	35794,50000	ММВБ

ИнкомЛада2	4-02-36068-R	1005,900	21000,000	21123,90000	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-P	997,100	25000,000	24927,50000	ММВБ
Инпром 03	4-03-55534-P	997,100	22373,000	22308,11830	ММВБ
МГТС-04 об	4-04-00083-A	999,900	3740,000	3739,62600	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	998,500	20000,000	19970,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	1020,800	30000,000	30624,00000	ММВБ
МИА-2об	40203344B	998,000	20000,000	19960,00000	ММВБ
МИА-3об	40303344B	1000,500	22000,000	22011,00000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1001,600	27240,000	27283,58400	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	1003,900	30056,000	30173,21840	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	1000,100	19195,000	19196,91950	ММВБ
СевСтАвто	4-01-02461-D	1007,100	1996,000	2010,17160	ММВБ
ТатфондБ 3	40303058B	1002,400	12000,000	12028,80000	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-H	1000,100	20000,000	20002,00000	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	1001,300	37000,000	37048,10000	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	1001,600	60570,000	60666,91200	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				454134,76640	

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
ИркЭнерго	ао	1-01-00041-A	29,44800	180000	5300,64000	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	2 080,46000	33500	69695,41000	ММВБ
ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	4,31900	694581	2999,89534	ММВБ
РАО ЕЭС	ао	1-01-00034-A	31,70700	1550000	49145,85000	ММВБ
РАО ЕЭС-п	ап	2-01-00034-A	28,00000	695000	19460,00000	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	71,10000	200000	14220,00000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481B	102,79000	400000	41116,00000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481B	69,72000	370000	25796,40000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	42,25100	288500	12189,41350	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	2,88000	7020600	20219,32800	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	2,01000	2100000	4221,00000	ММВБ
Татнфт Зао	ао	1-03-00161-A	148,72000	490000	72872,80000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,02200	22927683	504,40903	ММВБ
ТГК-5-009D	ао	1-01-12190-E-009D	0,02000	1	0,00002	ММВБ
ТГК-5-010D	ао	1-01-12190-E-010D	0,02000	1	0,00002	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,52200	3000000	4566,00000	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	1,02100	5100000	5207,10000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					347514,24591	

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"		56046,28866
Итого средств на специальных брокерских счетах		56046,28866
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	361,42770
КрасЯрск05	RU31005KRN1	152,10000
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1585,17912
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	227,06640
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	97,33368
Мос.обл.4в	RU25004MOO	177,62976
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	61,65000
НижгорОбл2	RU34002NJG0	403,82280
НовсибО-05	RU34013ANO0	83,13165
ТульскОб 1	RU31001TUL0	34,99125
Томск.об-4	RU34030TMS0	9,75360
Хабаровск6	RU31006HAB0	51,07200
ХантМан5об	RU25005HMN	51,79500
Якут-06 об	RU25006RSY	264,60000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	335,30000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	48,36000
ЯНАО-1 об	RU24001YML	1058,35500
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	110,02150
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	214,39984
БанкСОЮ301	40102307B	25,47000
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	91,05000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	106,13746
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	43,80000
ДальСвз3об	4-11-30166-F	8,57500
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	854,70000
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	310,59000
Инпром 02	4-02-55534-P	994,50000
Инпром 03	4-03-55534-P	219,47913
МГТС-04 об	4-04-00083-A	49,48020
МГТС-05 об	4-05-00083-A	132,20000
Мечел 2об	4-02-55005-E	82,80000
МИА-2об	40203344B	254,40000
МИА-3об	40303344B	153,34000
Мосэнерго1	4-02-00085-A	585,11520
Мосэнерго2	4-03-00085-A	774,84368
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	546,09775
СевСтАвто	4-01-02461-D	69,12148
ТатфондБ 3	40303058B	158,40000

ТМК-02 обл	4-02-29031-Н	404,00000
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	1063,75000
ЮТК-03 об.	4-07-00062-А	1239,86790
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		13495,70710
Прочая дебиторская задолженность		
Наименование дебиторской задолженности		Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1		2
Денежные средства в пути		170,82192
Итого прочая дебиторская задолженность		170,82192
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)		69712,81768

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений **1480954,94460** 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.