

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 _ 30.09.2010 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 01.10.2010 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	9242,49756
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	272000,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	3001866,84786
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	896038,14612
муниципальные облигации	033	0,00000
облигации российских хозяйственных обществ	034	1428193,40042
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	677635,30132
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	132201,64234
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	88747,08620
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	43454,55614
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	3415310,98776
Обязательства:		
Кредиторская задолженность, в том числе:	070	0,00000
1	2	3
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	3415310,98776

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Зензинов Б.В.

(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 **30.09.2010** 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 01.10.2010 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	9242,49756
Итого денежных средств на счетах				9242,49756

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"	16.07.2010	31-011/07/232-10	42006810000110000001	70000,00000	0,00000
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (12)	42006810600000004994	102000,00000	0,00000
Банк Зенит	04.03.2010	002/28.01/ПР	42005810500003010620	100000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					272000,00000

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	БелгОб 3об	RU31001BEL0	1004,200	86287	86649,40540	Расчетная
Облигация	БелгОб 5об	RU24003BEL0	1021,500	47457	48477,32550	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	756,000	17874	13512,74400	ММВБ
Облигация	Карелия 12	RU34012KAR0	634,740	52275	33181,03350	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	950,000	31087	29532,65000	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр4	RU34004KNA0	1050,100	26028	27332,00280	ММВБ
Облигация	ЛипецкОбл6	RU34006LIP0	754,875	79391	59930,28113	Расчетная
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1165,500	16724	19491,82200	ММВБ
Облигация	Мос.обл.6в	RU25006MOO0	1012,300	30000	30369,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.7в	RU26007MOO0	979,100	9407	9210,39370	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1013,100	56009	56742,71790	Расчетная
Облигация	СамарОбл 5	RU35005SAM0	879,155	93642	82325,83251	ММВБ
Облигация	СамарОбл 6	RU34006SAM0	1160,200	32799	38053,39980	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	501,2500000	195680	98084,60000	ММВБ
Облигация	Томск.об-7	RU34037TMS0	864,080	75336	65096,33088	ММВБ
Облигация	Якут-07 об	RU35002RSY0	1000,500	72406	72442,20300	ММВБ
Облигация	ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	1072,3000000	57200	61335,56000	Расчетная
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	993,400	25700	25530,38000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	601,560	64400	38740,46400	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					896038,14612	

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	0,000	0	0,00000	ММВБ
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	1006,0000000	75960,000	76415,76000	ММВБ
Аэрофл БО2	4B02-02-00010-A	1011,8000000	10000,000	10118,00000	ММВБ
АИЖК 3об	4-03-00739-A	400,8400000	700,000	280,58800	ММВБ
ВТБ БО-01	4B020101000B	1007,9000000	62000,000	62489,80000	ММВБ
ВТБ БО-02	4B020201000B	1014,2000000	50000,000	50710,00000	ММВБ
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	201,1000000	35178,000	7074,29580	ММВБ
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	696,33545601	142212,000	99027,25787	ММВБ
ЛСР 02 обл	4-02-55234-E	1019,8000000	15000,000	15297,00000	ММВБ
ГазпрнфБО5	4B02-05-00146-A	1004,2000000	1000,000	1004,20000	ММВБ

ГазпрнфБОб	4B02-06-00146-A	1005,20000000	80001,000	80417,00520	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	1009,20000000	40345,000	40716,17400	ММВБ
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000000	4100,000	0,00000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000000	2000,000	0,00000	ММВБ
ЛукойлЗобл	4-03-00077-A	1014,70000000	22000,000	22323,40000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	1010,20000000	45986,000	46455,05720	ММВБ
Мечел БО-2	4B02-02-55005-E	1011,40000000	50000,000	50570,00000	ММВБ
Мечел БО-3	4B02-03-55005-E	1018,00000000	27000,000	27486,00000	ММВБ
Мечел 4об	4-04-55005-E	1176,10000000	24883,000	29264,89630	ММВБ
Мечел 5об	4-05-55005-E	1070,30000000	40000,000	42812,00000	ММВБ
МОЭСК-01	4-01-65116-D	1015,00000000	32005,000	32485,07500	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1060,70000000	75540,000	80125,27800	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	1013,00000000	31056,000	31459,72800	ММВБ
МТС 03	4-03-04715-A	1020,10000000	50000,000	51005,00000	ММВБ
МТС 04	4-04-04715-A	1065,10000000	50000,000	53255,00000	ММВБ
НЛМК БО-1	4B02-01-00102-A	1055,10000000	30000,000	31653,00000	ММВБ
НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	1076,70000000	26198,000	28207,38660	ММВБ
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1062,80000000	16500,000	17536,20000	ММВБ
РЖД-23 обл	4-23-65045-D	1066,50000000	66494,000	70915,85100	ММВБ
СЗТелек4об	4-04-00119-A	755,47500000	995,000	751,69763	ММВБ
СЗТелек6об	4-06-00119-A	1078,20000000	50000,000	53910,00000	Расчетная
СибТлк-8об	4-08-00195-A	1026,80000000	41950,000	43074,26000	ММВБ
Система-01	4-01-01669-A	1054,30000000	5949,000	6272,03070	ММВБ
Система-02	4-02-01669-A	1135,00000000	141399,000	160487,86500	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	1012,20000000	15355,000	15542,33100	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-A	1008,20000000	21345,000	21520,02900	Расчетная
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	715,54000000	94378,000	67531,23412	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				1428193,40042	

**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	65,78000	1454777	95695,23106	ММВБ
ВолгаТлк	ао	1-01-00137-A	114,83000	100000	11483,00000	ММВБ
ГМКНорНик	ао	1-01-40155-F	5 156,03000	16900	87136,90700	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	755,98000	102592	77557,50016	ММВБ
Новатэк ао	ао	1-02-00268-E	233,81000	485000	113397,85000	ММВБ
ОГК-1 ао	ао	1-02-65107-D	1,08700	30874400	33560,47280	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	1,56300	40050000	62598,15000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481В	84,93000	1285500	109177,51500	ММВБ
Татнфт Зап	ап	2-03-00161-A	73,93000	854439	63168,67527	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01650	2	0,00003	ММВБ
УралСвИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,19300	20000000	23860,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					677635,30132	

**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"		88747,08620
Итого средств на специальных брокерских счетах		88747,08620
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	990,57476
БелгОб 5об	RU24003BEL0	1442,21823
Карелия 2	RU34010KAR0	473,30352
Карелия 12	RU34012KAR0	458,45175
КраснодКр2	RU34002KND0	575,73124
КраснЯрКр4	RU34004KNA0	397,96812
ЛипецкОбл6	RU34006LIP0	1655,30235
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	622,96900
Мос.обл.6в	RU25006MOO0	1205,70000
Мос.обл.7в	RU26007MOO0	334,04257
СамарОбл 3	RU25003SAM0	571,29180
СамарОбл 5	RU35005SAM0	142,33584
СамарОбл 6	RU34006SAM0	647,12427
Томск.об-4	RU34030TMS0	1802,21280
Томск.об-7	RU34037TMS0	757,88016
Якут-07 об	RU35002RSY0	1083,19376
ХМАО-Югры7	RU25007HMN0	1597,02400
Чувашия-06	RU31006CHU0	379,58900
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	1121,84800
Аэрофл БО1	4B02-01-00010-A	2758,10760
Аэрофл БО2	4B02-02-00010-A	363,10000
АИЖК 3об	4-03-00739-A	5,55100
ВТБ БО-01	4B020101000B	168,02000
ВТБ БО-02	4B020201000B	135,50000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	198,40392
ВТБ-ЛизФ01	4-01-36292-R	1295,55132
ЛСР 02 обл	4-02-55234-E	310,65000
ГазпрнфБО5	4B02-05-00146-A	33,30000
ГазпрнфБО6	4B02-06-00146-A	2664,03330
ГСС 01	4-01-21927-H	71,41065
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000
Лукойл3обл	4-03-00077-A	479,38000
Мечел 2об	4-02-55005-E	1134,93448
Мечел БО-2	4B02-02-55005-E	213,50000
Мечел БО-3	4B02-03-55005-E	1117,80000
Мечел 4об	4-04-55005-E	815,91357
Мечел 5об	4-05-55005-E	986,40000
МОЭСК-01	4-01-65116-D	162,26535

Мосэнерго1	4-02-00085-A	413,95920
Мосэнерго2	4-03-00085-A	227,95104
МТС 03	4-03-04715-A	1096,00000
МТС 04	4-04-04715-A	3097,50000
НЛМК БО-1	4B02-01-00102-A	913,50000
НЛМК БО-5	4B02-05-00102-A	1149,56824
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1007,82000
РЖД-23 обл	4-23-65045-D	918,28214
СЗТелек4об	4-04-00119-A	3,48250
СЗТелек6об	4-06-00119-A	913,50000
СибТлк-8об	4-08-00195-A	534,86250
Система-01	4-01-01669-A	33,37389
Система-02	4-02-01669-A	2514,07422
ТМК-03 обл	4-03-29031-H	181,34255
УрСИ сер08	4-11-00175-A	771,83520
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	504,92230
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		43454,55614
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.)		132201,64234

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений _____ 3415310,98776 тыс. руб.**

Генеральный директор

(наименование должности уполномоченного лица
управляющей компании)

(подпись)

Зензинов Б.В.

(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.