

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 30.09.2009 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 01.10.2009 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	6 039,20419
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	411 750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	1 749 265,94883
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	477 954,46381
муниципальные облигации	033	14 782,76440
облигации российских хозяйственных обществ	034	934 761,90314
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	321 766,81748
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	31 719,09280
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	3 561,89452
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	28 157,19828
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	2 198 774,24582
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	2 198 774,24582

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 30.09.2009 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 01.10.2009 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	6 039,20419
Итого денежных средств на счетах				6 039,20419

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 "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 "Банк Москвы"	18.09.2009	31-076/07/463-09	42003810400760000038	102 000,00000	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
ОАО "ТрансКредитБанк"	05.06.2008	ГС-4994 (7)	42005810800005004994	50 000,00000	0,00000
ОАО "РОССЕЛЬХОЗБАНК"	27.07.2009	42-1-06/106-2009	42005810300000000088	100 000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					411 750,00000

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	999,600	26 114	26 103,55440	ММВБ
Облигация	Башкорт6об	RU25006BAS0	969,400	3 120	3 024,52800	ММВБ
Облигация	БелгОб 3об	RU31001BEL0	949,500	10 000	9 495,00000	ММВБ
Облигация	Карелия 2	RU34010KAR0	960,000	40 815	39 182,40000	ММВБ
Облигация	КраснодКр2	RU34002KND0	998,699	31 087	31 046,54319	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	948,300	16 724	15 859,36920	ММВБ
Облигация	МГор38-об	RU26038MOS	992,200	1 000	992,20000	ММВБ
Облигация	МГор41-об	RU27041MOS	991,800	57 922	57 447,03960	ММВБ
Облигация	МГор50-об	RU25050MOS0	939,100	50 000	46 955,00000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	485,850	5 000	2 429,25000	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	123,275	49 169	6 061,30848	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	899,200	47 153	42 399,97760	ММВБ
Облигация	СамарОбл 5	RU35005SAM0	926,200	72 000	66 686,40000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	694,050	10 160	7 051,54800	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	395,600	9 600	3 797,76000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	594,240	21 000	12 479,04000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	869,100	3 000	2 607,30000	ММВБ
Облигация	Чувашия-06	RU31006CHU0	844,800	25 700	21 711,36000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	699,525	16 139	11 289,63398	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-07	RU34007YRS0	882,720	80 813	71 335,25136	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					477 954,46381	

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	963,800	15 338	14 782,76440	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				14 782,76440	

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	588,11645	72 178	42 449,06904	ММВБ
Возрожд 01	40101439В	988,90000	5 000	4 944,50000	ММВБ
ВТБ - 5 об	40401000В	1 031,50000	5 900	6 085,85000	ММВБ
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-А	1 000,10000	15 000	15 001,50000	ММВБ
ГСС 01	4-01-21927-Н	999,90000	40 345	40 340,96550	ММВБ

ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000	4 100	0,00000	ММВБ
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000	2 000	0,00000	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	394,84000	20 000	7 896,80000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	961,60000	58 500	56 253,60000	ММВБ
МосэнрБО2	4В02-02-00085-A	1 000,90000	1 700	1 701,53000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1 014,50000	72 240	73 287,48000	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	917,40000	31 056	28 490,77440	ММВБ
МОЭК-01	4-01-55039-E	1 023,70000	71 197	72 884,36890	ММВБ
МТС 03	4-03-04715-A	990,20000	30 000	29 706,00000	ММВБ
МТС 04	4-04-04715-A	1 070,00000	15 000	16 050,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1 008,40000	28 000	28 235,20000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-1	4В02-01-50077-A	1 014,50000	10 000	10 145,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 БО-2	4В02-02-50077-A	1 004,50000	10 000	10 045,00000	ММВБ
РЖД-06обл	4-06-65045-D	966,70000	30 000	29 001,00000	ММВБ
РЖД-08обл	4-08-65045-D	965,00000	20 000	19 300,00000	ММВБ
РЖД-09обл	4-09-65045-D	1 025,50000	25 000	25 637,50000	ММВБ
РЖД-12обл	4-12-65045-D	1 074,90000	30 000	32 247,00000	ММВБ
РосселхБ 3	40303349В	991,90000	75 000	74 392,50000	ММВБ
РосселхБ 7	40703349В	1 025,00000	50	51,25000	ММВБ
СЗТелек4об	4-04-00119-A	953,00000	995	948,23500	ММВБ
СибТлк-6об	4-06-00195-A	991,00000	102 138	101 218,75800	ММВБ
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	958,80000	1 951	1 870,61880	ММВБ
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	989,50000	15 355	15 193,77250	ММВБ
УрСИ сер08	4-11-00175-A	993,40000	21 000	20 861,40000	ММВБ
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	873,40000	4 990	4 358,26600	ММВБ
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	969,80000	95 000	92 131,00000	ММВБ
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	999,50000	74 070	74 032,96500	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				934 761,90314	

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	45,60000	160 500	7 318,80000	ММВБ
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 643,91000	54 747	89 999,14077	ММВБ
Мечел ао	ао	1-01-55005-E	481,93000	30 563	14 729,22659	ММВБ
Мосэнерго а.о.	ао	1-01-00085-A	2,80400	1 321 900	3 706,60760	ММВБ
ОГК-1 ао	ао	1-02-65107-D	0,65000	16 000 000	10 400,00000	ММВБ
Энел ОГК-5 ао	ао	1-01-50077-A	1,58800	3 100 000	4 922,80000	ММВБ
РусГидро	ао	1-01-55038-E	1,04700	20 050 000	20 992,35000	ММВБ
Сбербанк	ао	10301481В	60,77000	850 000	51 654,50000	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20301481В	37,42000	400 000	14 968,00000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	12,26500	621 400	7 621,47100	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	1,02400	12 647 500	12 951,04000	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	0,75900	978 500	742,68150	ММВБ
Татнефть Зао	ао	1-03-00161-A	129,68000	165 000	21 397,20000	ММВБ
Татнефть Зап	ап	2-03-00161-A	46,58000	700 000	32 606,00000	ММВБ
ТГК-5	ао	1-01-12190-E	0,01080	2	0,00002	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	0,67700	41 000 000	27 757,00000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					321 766,81748	

**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"	3561,89452
	Итого средств на специальных брокерских счетах	3561,89452
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
Новсиб 4об	RU31004NSB1	24,69418
Башкорт5об	RU25005BAS0	843,74334
Башкорт6об	RU25006BAS0	82,27440
БелгОб 3об	RU31001BEL0	112,50000
Карелия 2	RU34010KAR0	1 469,74815
КраснодКр2	RU34002KND0	613,96825
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	617,45008
МГор38-об	RU26038MOS	26,30000
МГор41-об	RU27041MOS	787,15998
МГор50-об	RU25050MOS0	1 139,50000
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	125,35000
НовсибО-05	RU34013ANO0	19,17591
СамарОбл 3	RU25003SAM0	471,05847
СамарОбл 5	RU35005SAM0	110,16000
Томск.об-4	RU34030TMS0	140,30960
Хабаровскб	RU31006HAB0	95,04000
Якут-06 об	RU25006RSY	165,69000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	49,65000
Чувашия-06	RU31006CHU0	387,04200
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	376,03870
ЯрОбл-07	RU34007YRS0	1 283,31044
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	1 210,42506
Возрожд 01	40101439B	34,35000
ВТБ - 5 об	40401000B	167,32400
ГАЗПРОМ А4	4-04-00028-A	165,60000
ГСС 01	4-01-21927-H	99,65215
ИнкомЛада2	4-02-36068-R	0,00000
ИнкомЛада3	4-03-36068-R	0,00000
МГТС-05 об	4-05-00083-A	445,40000
Мечел 2об	4-02-55005-E	1 413,36000
МосэнрБО2	4B02-02-00085-A	18,13900
Мосэнерго1	4-02-00085-A	371,31360
Мосэнерго2	4-03-00085-A	221,42928
МОЭК-01	4-01-55039-E	2 177,20426
МТС 03	4-03-04715-A	708,00000
МТС 04	4-04-04715-A	922,35000
Энел ОГК-5 об-1	4-01-50077-A	1 041,32000
Энел ОГК-5 БО-1	4B02-01-50077-A	213,90000

Энел ОГК-5 БО-2	4B02-02-50077-A	213,90000
РЖД-06обл	4-06-65045-D	845,70000
РЖД-08обл	4-08-65045-D	391,20000
РЖД-09обл	4-09-65045-D	1 229,75000
РЖД-12обл	4-12-65045-D	1 530,90000
РосселхБ 3	40303349В	618,00000
РосселхБ 7	40703349В	2,02550
СЗТелек4об	4-04-00119-A	4,41780
СибТлк-6об	4-06-00195-A	354,41886
СОЛЛЕРС1	4-01-02461-D	29,49912
ТМК-03 обл	4-03-29031-Н	173,66505
УрСИ сер08	4-11-00175-A	966,63000
ЧТПЗ 01об	4-01-00182-A	136,37670
ЦентрТел-5	4-20-00194-A	702,05000
ЮТК-03 об.	4-07-00062-A	2 808,73440
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		28 157,19828
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.)		31 719,09280

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 2 198 774,24582 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.