

**РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ, В КОТОРЫЕ
ИНВЕСТИРОВАНЫ СРЕДСТВА ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ за 31.03.07**

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

01.04.07

10:00

Вид актива/обязательства	Код	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	45 621 620,49	972 574,52
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	145 000 000,00	130 000 000,00
Ценные бумаги, в том числе	030	690 877 039,75	696 648 542,44
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	240 853 957,50	227 767 375,90
облигации муниципальных образований	033	19 184 502,00	19 659 513,20
облигации российских хозяйственных обществ	034	184 791 925,20	209 651 597,20
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	246 046 655,05	239 570 056,14
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	184 805 109,64	24 487 450,02
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	041	175 288 873,08	16 007 992,29
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	042	9 516 236,56	8 479 457,73
- прочая дебиторская задолженность	043	0,00	0,00
Прочие активы	050	0,00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВА: (строки 010+020+030 + 040 + 050)	060	1 066 303 769,88	852 108 566,98
Обязательства:			
Кредиторская задолженность, в том числе	070	0,00	11 388 957,69
- обязательства перед профессиональными участниками рынка ценных бумаг	071	0,00	0,00
- кредиторская задолженность по возмещению расходов и выплате вознаграждения	072	0,00	11 388 957,69
- прочая кредиторская задолженность	073	0,00	0,00
Итого сумма обязательств	080	0,00	11 388 957,69
ИТОГО стоимость чистых активов: (строки 060 - 080)	090	1 066 303 769,88	840 719 609,29

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании

_____ / Зензинов Б.В. /
подпись

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 31.03.07

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

09.04.07

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	45 621 620,49	972 574,52	4,2785
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	145 000 000,00	130 000 000,00	13,5984
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	240 853 957,50	227 767 375,90	22,5877
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000
Облигации муниципальных образований	050	19 184 502,00	19 659 513,20	1,7992
Облигации российских хозяйственных обществ	060	184 791 925,20	209 651 597,20	17,3301
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	246 046 655,05	239 570 056,14	23,0747
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	184 805 109,64	24 487 450,02	17,3314
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	175 288 873,08	16 007 992,29	16,4389
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	9 516 236,56	8 479 457,73	0,8925
- 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	1 066 303 769,88	852 108 566,98	100,0000

Уполномоченное должностное лицо
управляющей компании _____ / Зензинов Б.В./

подпись

Уполномоченное должностное лицо
специализированного депозитария _____ / _____ /

подпись

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