

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)

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 | КраснЯрКр3 | 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 | НижегОбл2 | 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.