

Расчет
стоимости чистых активов, в которые инвестированы
средства пенсионных накоплений, по состоянию
на 30.06.07 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 01.07.2007 10:00:00

Вид имущества	Код стр.	Тыс. рублей
1	2	3
Активы:		
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	1604,90536
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	199750,00000
Ценные бумаги, в том числе:	030	832631,77880
государственные ценные бумаги Российской Федерации	031	0,00000
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	032	248893,98120
муниципальные облигации	033	41010,53760
облигации российских хозяйственных обществ	034	293532,35250
акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	035	249194,90750
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	37684,16453
средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах	041	27484,79248
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	042	10199,37205
прочая дебиторская задолженность	043	0,00000

Прочие активы	050	0,00000
Итого имущества (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050)	060	1071670,84869
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	1071670,84869

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

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию
на **30.06.07** 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 **01.07.2007 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	1604,90536
Итого денежных средств на счетах				1604,90536

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 "РОСБАНК"	03.10.06	GS/06/148	42006810600000016775	10000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	11.04.07	31-076/07/256-07	42006810400760000006	19750,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	28.11.06	31-076/07/956-06	42006810800760000004	15000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.11.06	31-076/07/915-06	42006810500760000003	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	13.10.06	31-076/07/783-06	42006810200760000002	20000,00000	0,00000
ОАО "Банк Москвы"	21.04.06	22-101/07/1	42006810900760000001	25000,00000	0,00000
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)					199750,00000

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	Башкорт4об	RU25004BAS	1003,900	62	62,24180	ММВБ
Облигация	КраснЯрКр3	RU34003KNA0	996,700	16020	15967,13400	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-2об	RU26001LEN	1210,600	3760	4551,85600	ММВБ
Облигация	ЛенОбл-3об	RU26002LEN	1252,000	16724	20938,44800	ММВБ
Облигация	Мос.обл.3в	RU25003MOO	1008,200	7500	7561,50000	ММВБ
Облигация	Мос.обл.4в	RU25004MOO	1080,700	8544	9233,50080	ММВБ
Облигация	Мос.обл.5в	RU34005MOO0	797,925	5000	3989,62500	ММВБ
Облигация	НижгорОбл2	RU34002NJG0	820,080	23500	19271,88000	ММВБ
Облигация	НовсибОбл2	RU25012ANO0	1026,600	7000	7186,20000	ММВБ
Облигация	НовсибО-05	RU34013ANO0	1017,400	29169	29676,54060	ММВБ
Облигация	ТулскОб 1	RU31001TUL0	1028,400	14150	14551,86000	ММВБ
Облигация	Томск.об-4	RU34030TMS0	999,100	10160	10150,85600	ММВБ
Облигация	Хабаровск6	RU31006HAB0	1008,300	9600	9679,68000	ММВБ
Облигация	ХантМан5об	RU25005HMN	1062,500	4500	4781,25000	ММВБ
Облигация	Якут-06 об	RU25006RSY	1066,100	21000	22388,10000	ММВБ
Облигация	СамарОбл 3	RU25003SAM0	1028,700	30000	30861,00000	ММВБ
Облигация	Саха(Якут)	RU35001RSY0	1038,100	3000	3114,30000	ММВБ
Облигация	ЯНАО-1 об	RU24001YML	1037,300	25000	25932,50000	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-06	RU34006YRS0	1004,400	7510	7543,04400	ММВБ
Облигация	ЯрОбл-02	RU25002YRS0	1001,700	1450	1452,46500	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					248893,98120	

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
КрасЯрск05	RU31005KRN1	1011,900	10000	10119,00000	ММВБ
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1095,600	28196	30891,53760	ММВБ
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				41010,53760	

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	1013,300	1500,000	1519,95000	ММВБ
БанкСОЮЗ02	40202307B	1002,300	15000,000	15034,50000	ММВБ
ВлгТлжВТ-2	4-44-00137-A	1018,200	15000,000	15273,00000	ММВБ

ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	1033,700	16874,000	17442,65380	ММВБ
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	1021,700	10000,000	10217,00000	ММВБ
ГАЗПРОМ А5	4-05-00028-A	1005,100	3910,000	3929,94100	ММВБ
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	1044,000	35000,000	36540,00000	ММВБ
Инпром 02	4-02-55534-P	1001,900	20000,000	20038,00000	ММВБ
Инпром 03	4-03-55534-P	1005,600	22373,000	22498,28880	ММВБ
МГТС-04 об	4-04-00083-A	1002,500	3740,000	3749,35000	ММВБ
МГТС-05 об	4-05-00083-A	1002,200	20000,000	20044,00000	ММВБ
Мечел 2об	4-02-55005-E	1032,300	30000,000	30969,00000	ММВБ
Мосэнерго1	4-02-00085-A	1012,200	11540,000	11680,78800	ММВБ
Мосэнерго2	4-03-00085-A	1027,900	30056,000	30894,56240	ММВБ
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	1026,100	4195,000	4304,48950	ММВБ
ТатфондБ 3	40303058В	1008,800	12000,000	12105,60000	ММВБ
ТМК-02 обл	4-02-29031-Н	1009,000	20000,000	20180,00000	ММВБ
УралСвзИн4	4-07-00175-A	1011,900	16910,000	17111,22900	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				293532,35250	

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
ЛУКОЙЛ	ао	1-01-00077-A	1 973,46000	24000	47363,04000	ММВБ
РАО ЕЭС	ао	1-01-00034-A	34,79700	950000	33057,15000	ММВБ
РАО ЕЭС-п	ап	2-01-00034-A	30,42500	695000	21145,37500	ММВБ
Ростел -ап	ап	2-01-00124-A	75,23000	110000	8275,30000	ММВБ
Сбербанк	ао	10201481В	100 065,75000	250	25016,43750	ММВБ
Сбербанк-п	ап	20201481В	1 520,32000	15000	22804,80000	ММВБ
СЗТелек-ао	ао	1-02-00119-A	44,43000	288500	12818,05500	ММВБ
СибТлк-ао	ао	1-04-00195-A	2,85300	7000000	19971,00000	ММВБ
СибТлк-ап	ап	2-04-00195-A	1,95400	2100000	4103,40000	ММВБ
Татнфт Зао	ао	1-03-00161-A	117,75000	379000	44627,25000	ММВБ
УралСВИ-ао	ао	1-07-00175-A	1,56800	3000000	4704,00000	ММВБ
УралСВИ-ап	ап	2-01-00175-A	1,04100	5100000	5309,10000	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					249194,90750	

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 "Банк Москвы"	27484,79248	
Итого средств на специальных брокерских счетах	27484,79248	
Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
КрасЯрск05	RU31005KRN1	170,00000
Новсиб 3об	RU31003NSB1	1707,26780
Башкорт4об	RU25004BAS	1,45824
КраснЯрКр3	RU34003KNA0	267,21360
ЛенОбл-2об	RU26001LEN	24,55280
ЛенОбл-3об	RU26002LEN	85,96136
Мос.обл.3в	RU25003MOO	298,35000
Мос.обл.4в	RU25004MOO	172,50336
Мос.обл.5в	RU34005MOO0	90,40000
НижгорОбл2	RU34002NJG0	298,45000
НовсибОбл2	RU25012ANO0	76,51000
НовсибО-05	RU34013ANO0	74,67264
ТульскОб 1	RU31001TUL0	306,48900
Томск.об-4	RU34030TMS0	8,94080
Хабаровскб	RU31006HAB0	77,85600
ХантМан5об	RU25005HMN	48,82500
Якут-06 об	RU25006RSY	253,05000
СамарОбл 3	RU25003SAM0	274,80000
Саха(Якут)	RU35001RSY0	47,04000
ЯНАО-1 об	RU24001YML	993,25000
ЯрОбл-06	RU34006YRS0	106,86730
ЯрОбл-02	RU25002YRS0	44,67450
БанкСОЮ301	40102307B	24,70500
БанкСОЮ302	40202307B	299,25000
ВлгТлкВТ-2	4-44-00137-A	84,30000
ВлгТлкВТ-3	4-45-00137-A	98,20668
ВлгТлкВТ-4	4-46-00137-A	39,40000
ГАЗПРОМ А5	4-05-00028-A	65,76620
ИРКУТ-03об	4-03-00040-A	838,25000
Инпром 02	4-02-55534-P	955,60000
Инпром 03	4-03-55534-P	208,51636
МГТС-04 об	4-04-00083-A	48,02160
МГТС-05 об	4-05-00083-A	124,40000
Мечел 2об	4-02-55005-E	69,00000
Мосэнерго1	4-02-00085-A	243,14780
Мосэнерго2	4-03-00085-A	762,22016
ОМЗ-5 об	4-05-30174-D	117,33415
ТатфондБ 3	40303058B	128,16000

ТМК-02 обл	4-02-29031-Н	395,60000
УралСвзИн4	4-07-00175-А	268,36170
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		10199,37205
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.)		37684,16453

14. Итого рыночная стоимость активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений 1071670,84869 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.