

**Расчет  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы  
средства пенсионных накоплений  
по состоянию на 30 Сентября 2007 г.**

Полное наименование, ИНН/КПП  
учредителя управления

ОАО Управляющая компания "Ингосстрах-  
Инвестиции" ДУ средствами пенсионных накоплений

Полное фирменное наименование,  
ИНН/КПП управляющей компании

ОАО Управляющая компания "Ингосстрах-  
Инвестиции" ДУ средствами пенсионных накоплений,  
ИНН 7705136973

Дата и номер договора доверительного управления

08.10.2003 № 22-03У033

Дата и время составления расчета

1 Октября 2007 г. 11.00

**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
АКБ "СОЮЗ" (ОАО)	12.03.04	3067205/ДУПН	40701810000010000036	1 822 471,28
Итого денежных средств на счетах				1 822 471,28

**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 "ТрансКредитБанк"	20.12.06	Д4/7993/12-	42006810100100007993	4 300 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				4 300 000,00	

**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				0,00	

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

**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 специального				0,000

### 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				

### 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.)	
1	2	3	4	5	6	
Облигация	Правительство Москвы	RU27041MOS	1061.5	500	530 750,00	ММВБ
Облигация	Администрация Московской области обл., вып.5	RU34005MOO0	786.45	2500	1 966 125,00	ММВБ
Облигация	Новосибирская область	RU34013ANO0	1001.7	2000	2 003 400,00	ММВБ
Облигация	Администрация Тульской области	RU31001TUL0	1029.7	1000	1 029 700,00	ММВБ
Облигация	Минфин Хабаровского края	RU31006HAB0	1001	2000	2 002 000,00	ММВБ
Облигация	Министерство финансов ХМАО	RU25005HMN	1039.9	302	314 049,80	ММВБ
Облигация	Правительство Чувашской республики	RU31005CHU0	1017.5	1000	1 017 500,00	ММВБ
Облигация	Администрация Ярославской области обл., вып.7	RU34007YRS0	993	1990	1 976 070,00	ММВБ
Облигация	Ярославская область	RU31004YRS0	1050	250	262 500,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					11 102 094,80	

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

### 7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (тыс. руб.)	
1	2	3	4	5	
Администрация г. Красноярск	RU31005KRN1	1014.6	2000	2 029 200,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации				2 029 200,00	

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

### 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
АКБ "СОЮЗ" ОАО	40102307B	995.3	1500	1 492 950,00	ММВБ
ОАО "ВолгаТелеком"	4-45-00137-A	1020.5	1700	1 734 850,00	ММВБ
ОАО "Газпром"	4-04-00028-A	1025.6	1800	1 846 080,00	ММВБ
ОАО "Инпром"	4-02-55534-P	991.9	2200	2 182 180,00	ММВБ
ОАО "Научно-производственная корпорация "Иркут"	4-03-00040-A	1015.3	2000	2 030 600,00	ММВБ
ОАО Инвестиционный банк "КИТ Финанс"	40101911B	998.2	1000	998 200,00	ММВБ
ОАО "Мечел" обл., вып.2	4-02-55005-E	1011.8	2290	2 317 022,00	ММВБ
ОАО "Московский Кредитный Банк" обл, вып 02	40201978B	994.6	1800	1 790 280,00	ММВБ
ОАО АИКБ "Новая Москва"	40302209B	997.1	500	498 550,00	ММВБ
ОАО "ПАВА" обл., вып.2	4-02-10682-F	1016	2100	2 133 600,00	ММВБ
ОАО АКБ "Русский межрегиональный банк развития"	40103073B	980.7	1500	1 471 050,00	ММВБ
ООО "Сорус Капитал" обл., вып.1	4-01-36181-R	992	2450	2 430 400,00	ММВБ
ООО КБ "Судостроительный банк"	40102999B	985.5	2100	2 069 550,00	ММВБ
АИКБ "Татфондбанк"	40303058B	998	500	499 000,00	ММВБ
ОАО "Трубная Металлургическая компания" обл., вып.3	4-03-29031-H	998.6	2000	1 997 200,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских				25 491 512,00	

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

### 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
Иркутскэнерго	Обыкновенная	1-01-00041-A	23.234	75000	1 742 550,00	ММВБ
ОАО "ЛУКОЙЛ"	Обыкновенная	1-01-00077-A	2074.09	1040	2 157 053,60	ММВБ
ОАО "МосЭнерго"	Обыкновенная	1-01-00085-A	6.255	100000	625 500,00	ММВБ
ОАО "Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии" ао	Обыкновенная	1-01-50077-A	3.886	18858	73 282,19	ММВБ
ОАО ОГК-5 ао доп.	Обыкновенная	1-01-50077-A-005D	3.886	1	3,89	ММВБ
РАО ЕЭС России	Привилегированная	2-01-00034-A	26.448	50000	1 322 400,00	ММВБ
РАО Ростелеком	Привилегированная	2-01-00124-A	65.64	15000	984 600,00	ММВБ
ОАО Сбербанк России ао вып.3	Обыкновенная	10301481B	102.81	1990	204 591,90	ММВБ
Сбербанк России ап	Привилегированная	20301481B	69.53	7000	486 710,00	ММВБ
Северо-Западный Телеком ао	Обыкновенная	1-02-00119-A	38.877	12000	466 524,00	ММВБ
ОАО "Территориальная генерирующая компания №5" ао	Обыкновенная	1-01-12190-E	0.028	622514	17 492,64	ММВБ
УралСвИ	Обыкновенная	1-07-00175-A	1.553	200000	310 600,00	ММВБ
Итого акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					8 391 308,22	

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

### 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					

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

### 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						

\* Указывается наименование российского организатора торговли, которым определена рыночная цена, а если рыночная цена не определена, указывается - "Цена приобретения".

**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

**13. Дебиторская задолженность**

Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах

Наименование брокера	Сумма средств (тыс. руб.)
1	2
Компания Брокеркредитсервис	14 507,68
<b>Итого средств на специальных брокерских счетах</b>	<b>14 507,68</b>

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям

Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2	3
АКБ "СОЮЗ" ОАО	40102307B	25 095,00
ОАО "ВолгаТелеком"	4-45-00137-A	46 325,00
ОАО "Газпром"	4-04-00028-A	18 648,00
Правительство Москвы	RU27041MOS	8 495,00
ОАО "Инпром"	4-02-55534-P	38 720,00
ОАО "Научно-производственная корпорация "Иркут"	4-03-00040-A	4 780,00
ОАО Инвестиционный банк "КИТ Финанс"	40101911B	28 490,00
Администрация г. Красноярск	RU31005KRN1	76 840,00
ОАО "Мечел" обл., вып.2	4-02-55005-E	53 746,30
ОАО "Московский Кредитный Банк" обл., вып 02	40201978B	58 986,00
Администрация Московской области обл., вып.5	RU34005MOOO	92 475,00
Новосибирская область	RU34013ANOO	5 580,00
ОАО АИКБ "Новая Москва"	40302209B	11 640,00
ОАО "ПАВА" обл., вып.2	4-02-10682-F	34 524,00
ОАО АКБ "Русский межрегиональный банк развития"	40103073B	4 110,00
ООО "Сорус Капитал" обл., вып.1	4-01-36181-R	35 598,50
ООО КБ "Судостроительный банк"	40102999B	49 308,00
АИКБ "Татфондбанк"	40303058B	5 480,00
ОАО "Трубная Металлургическая компания" обл., вып.3	4-03-29031-H	17 420,00
Администрация Тульской области	RU31001TULO	21 890,00
Минфин Хабаровского края	RU31006HABO	56 540,00
Министерство финансов ХМАО	RU25005HMN	12 412,20
Правительство Чувашской республики	RU31005CHUO	24 950,00
Администрация Ярославской области обл., вып.7	RU34007YRSO	41 252,70
Ярославская область	RU31004YRSO	9 205,00
<b>Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям</b>		<b>782 510,70</b>

Прочая дебиторская задолженность

Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
	0,00
<b>Итого прочая дебиторская задолженность</b>	<b>0,00</b>
<b>Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)</b>	<b>797 018,38</b>

**14. Итого рыночная стоимость активов, составляющих инвестиционный портфель управляющей компании**

**53 933 604,68**

**тыс. руб. \***

\* Рассчитывается как сумма итоговых статей по активам 1 - 13.

Руководитель бэк-офиса  
Управляющей компании

Яковлева И.Ю.

(подпись)

(доверенность б/н от 04.06.07)

м.п.