

**Расчет
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства
пенсионных накоплений, по состоянию на
30.06.2009 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Открытое акционерное общество Управляющая компания "Ингосстрах - Инвестиции"
Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7705136973/775001001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: 2003-10-08 22-03У033

Дата и время составления расчёта: 01.07.2009 11:00:00

1. Денежные средства на счетах

| Наименование кредитной организации | Реквизиты договора банковского счета | | Реквизиты банковского счета | Сумма денежных средств (руб.) |
|------------------------------------|--------------------------------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|
| | дата | номер | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| "РОСБАНК" АКБ | 30.10.08 | 486773/RUR/13 | 40701810687830000080 | 254 906,70 |
| Итого денежных средств на счетах | | | | 254 906,70 |

2. Денежные средства в депозитах

| Наименование кредитной организации | Реквизиты договора банковского вклада | | Реквизиты банковского счета | Сумма вклада (руб.) | Проценты начисленные (руб.) |
|---|---------------------------------------|-------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | дата | номер | | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты) | | | | | 0,00 |

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 (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|------------------|---|----------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |

| | |
|--|------|
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле | 0,00 |
|--|------|

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 (руб.) |
|---|---|--------------------------|------------------|---------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации, специально выпущенных Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов | | | | 0,00 |

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 (руб.) |
|--|---|----------------------|------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации | | | | 0,00 |

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 (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|-----------------------|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Субфедеральная бумага | Волгоградская область (Администрация) | RU34001VLOO | 696,0000000 | 1200.00 | 835 200,00 | - |
| Субфедеральная бумага | г.Москва | RU25050MOS0 | 877,0000000 | 1200.00 | 1 052 400,00 | Закртое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Субфедеральная бумага | Ленинградская область | RU26002LEN | 903,1000000 | 600.00 | 541 860,00 | - |

| | | | | | | |
|--|--|-------------|-------------|---------|--------------|--|
| Субфедеральная бумага | Республика Башкортостан | RU25005BAS0 | 990,3000000 | 5.00 | 4 951,50 | - |
| Субфедеральная бумага | Республика Саха (Якутия) (Министерство финансов) | RU34003RSY0 | 963,4000000 | 1000.00 | 963 400,00 | Закртое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации | | | | | 3 397 811,50 | |

7. Муниципальные облигации

| Наименование муниципального образования | Государственный регистрационный номер выпуска | Рыночная цена (руб.) | Количество (шт.) | Рыночная стоимость (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| г.Казань | RU31003KZN1 | 995,6000000 | 1000.00 | 995 600,00 | Закртое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций | | | | 995 600,00 | |

8. Облигации российских хозяйственных обществ

| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | Рыночная цена (руб.) | Количество (шт.) | Рыночная стоимость (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|-----------------------|---|----------------------|------------------|---------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| "Возрождение" АКБ ОАО | 40101439В | 965,7000000 | 1400.00 | 1 351 980,00 | Закртое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Газпром" ОАО | 4-04-00028-А | 991,5000000 | 1200.00 | 1 189 800,00 | Закртое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Дикая Орхидея" ЗАО | 4-01-14135-Н | 657,2602740 | 1994.00 | 1 310 576,99 | - |

| | | | | | |
|--|--------------|-------------|---------|--------------|--|
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-02-36068-R | 30,1000000 | 630.00 | 18 963,00 | - |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-03-36068-R | 3,3000000 | 1275.00 | 4 207,50 | - |
| "Иркутское Авиационное Производственное Объединение" | 4-03-00040-A | 969,5000000 | 1309.00 | 1 269 075,50 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "ЛУКОЙЛ" Нефтяная компания" ОАО | 4-04-00077-A | 774,3000000 | 1200.00 | 929 160,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Мечел" ОАО | 4-02-55005-E | 903,9000000 | 1300.00 | 1 175 070,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии" ОАО | 4-01-50077-A | 990,6000000 | 1400.00 | 1 386 840,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Россельхозбанк" КБ ОАО | 40303349В | 974,0000000 | 1200.00 | 1 168 800,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Седьмой континент" ОАО | 4-02-00462-Н | 860,0000000 | 1349.00 | 1 160 140,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Сибирьтелеком" ОАО | 4-06-00195-A | 965,9000000 | 1400.00 | 1 352 260,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Сорус Капитал", ООО | 4-01-36181-R | 0,0000001 | 2000.00 | 0,00 | - |
| "Судостроительный банк" КБ ООО | 40102999В | 998,8000000 | 1500.00 | 1 498 200,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Трубная Металлургическая Компания" ОАО | 4-03-29031-Н | 968,8000000 | 1400.00 | 1 356 320,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |

| | | | | | |
|---|--------------|-------------|---------|---------------|---|
| "Челябинский трубопрокатный завод" ОАО | 4-01-00182-A | 911,7000000 | 680.00 | 619 956,00 | Закрывое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Южная телекоммуникационная компания" ОАО | 4-07-00062-A | 984,7000000 | 1300.00 | 1 280 110,00 | Закрывое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| ОАО "МОЭСК" | 4-01-65116-D | 894,6000000 | 1400.00 | 1 252 440,00 | - |
| Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ | | | | 18 323 898,99 | |

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 (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|--|-----------------------|---|----------------------|------------------|---------------------------|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| "Иркутские электрические сети" ОАО | обыкновенная | 1-01-55438-E | 0,0000000 | 63143.00 | 0,00 | - |
| Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии | обыкновенная | 1-01-50077-A | 1,1840000 | 1.00 | 1,18 | Закрывое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого акций Российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ | | | | | 1,18 | |

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 (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием | | | | 0,00 | |

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 (руб.) | Источник расчета рыночной цены* |
|---|---|--|----------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия | | | | | 0,00 | |

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 (руб.) |
|--|--------------------|--|---|----------------------|------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Итого рыночная стоимость паев (акций, долей) индексных инвестиционных фондов | | | | | | 0,00 |

13. Дебиторская задолженность

| Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах | |
|---|----------------------|
| Наименование брокера | Сумма средств (руб.) |
| 1 | 2 |
| "Брокеркредитсервис" ООО | 6 406 074,50 |
| Итого средств на специальных брокерских счетах | 6 406 074,50 |

| Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | |
|---|---|--|
| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
| 1 | 2 | 3 |
| "Возрождение" АКБ ОАО | 40101439В | 40 502,00 |

| | | |
|---|--------------|------------|
| "Газпром" ОАО | 4-04-00028-A | 37 560,00 |
| "Дикая Орхидея" ЗАО | 4-01-14135-H | 0,00 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-02-36068-R | 19 630,80 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-02-36068-R | 0,00 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-03-36068-R | 104 881,50 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-03-36068-R | 0,00 |
| "Иркутское Авиационное Производственное Объединение" | 4-03-00040-A | 32 279,94 |
| "ЛУКОЙЛ" Нефтяная компания" ОАО | 4-04-00077-A | 4 620,00 |
| "Мечел" ОАО | 4-02-55005-E | 3 887,00 |
| "Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии" ОАО | 4-01-50077-A | 25 606,00 |
| "Россельхозбанк" КБ ОАО | 40303349B | 31 608,00 |
| "Седьмой континент" ОАО | 4-02-00462-H | 3 453,44 |

| | | |
|---|--------------|------------|
| "Сибирьтелеком" ОАО | 4-06-00195-A | 38 514,00 |
| "Судостроительный банк" КБ ООО | 40102999B | 72 870,00 |
| "Трубная Металлургическая Компания" ОАО | 4-03-29031-H | 48 972,00 |
| "Челябинский трубопрокатный завод" ОАО | 4-01-00182-A | 2 298,40 |
| "Южная телекоммуникационная компания" ОАО | 4-07-00062-A | 23 075,00 |
| Волгоградская область (Администрация) | RU34001VLO0 | 8 784,00 |
| г.Казань | RU31003KZN1 | 7 010,00 |
| г.Москва | RU25050MOS0 | 3 156,00 |
| Ленинградская область | RU26002LEN | 3 624,00 |
| ОАО "МОЭСК" | 4-01-65116-D | 34 580,00 |
| Республика Башкортостан | RU25005BAS0 | 60,45 |
| Республика Саха (Якутия) (Министерство финансов) | RU34003RSY0 | 7 960,00 |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | 554 932,53 |

| |
|----------------------------------|
| Прочая дебиторская задолженность |
|----------------------------------|

| Наименование дебиторской задолженности | Сумма дебиторский задолженности (руб.) |
|--|--|
| 1 | 2 |
| Итого прочая дебиторская задолженность | 0,00 |
| Итого дебиторская задолженность (руб.) | 6 961 007,03 |

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

29 933 225,40

руб.*

Начальник управления учета операций и отчетности ОАО УК
"Ингосстрах - инвестиции"

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей
компании)

(подпись)

С.В. Баранова
(доверенность № 370-
01/2008 от 19.01.2009 г.)
(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