

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.03.2008 г.**

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7703007972/770301001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Открытое акционерное общество Управление Управляющая компания "Ингосстрах - Инвестиции" Д.У.

средствами пенсионных накоплений, 7705136973/775001001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У033

Дата и время составления расчёта: 01.04.2008 11:00:00

1. Денежные средства на счетах

| Наименование кредитной организации | Реквизиты договора банковского счёта | | Реквизиты банковского счёта | Сумма денежных средств (руб.) |
|------------------------------------|--------------------------------------|--------------|-----------------------------|-------------------------------|
| | дата | номер | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| АКБ "СОЮЗ" (ОАО) | 12.03.2004 | 3067205/ДУПН | 4,07018E+19 | 2 646 401,68 |
| Итого денежных средств на счетах | | | | 2 646 401,68 |

2. Денежные средства в депозитах

| Наименование кредитной организации | Реквизиты договора банковского вклада | | Реквизиты банковского счёта | Сумма вклада (руб.) | Проценты начисленные (руб.) |
|---|---------------------------------------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | дата | номер | | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| "ТрансКредитБанк" | 20.12.2006 | Д4/7993/12-2-2006 | 4,20068E+19 | 4 300 000,00 | 0 |
| Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты) | | | | 4 300 000,00 | 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 (руб.) | Источник расчёта рыночной цены * |
|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле | | | | 0 | |

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 |

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 облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации 0

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 расчёта рыночной цены * |
|--|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Субфедеральная бумага | Ярославская область | RU31004YRS0 | 1 018,9000000 | 250 | 254 725,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации | | | | | 254 725,00 | |

7. Муниципальные облигации

| Наименование муниципального образования | Государственный регистрационный номер выпуска | Рыночная цена (руб.) | Количество (шт.) | Рыночная стоимость (руб.) | Источник расчёта рыночной цены * |
|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций | | | | 0 | |

8. Облигации российских хозяйственных обществ

| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | Рыночная цена (руб.) | Количество (шт.) | Рыночная стоимость (руб.) | Источник расчёта рыночной цены * |
|-------------------------|---|----------------------|------------------|---------------------------|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| "Группа Джей Эф Си" ЗАО | 4-01-10255-J | 980,5 | 2 500,00 | 2 451 250,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Дикая Орхидея" ЗАО | 4-01-14135-H | 1 001,9000000 | 1 772,00 | 1 775 366,80 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-03-36068-R | 983,3 | 1 275,00 | 1 253 707,50 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-02-36068-R | 999,7 | 600 | 599 820,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Инпром" ОАО | 4-02-55534-P | 977,4 | 2 500,00 | 2 443 500,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |

| | | | | | |
|---|--------------|---------------|----------|--------------|---|
| "Иркутское Авиационное Производственное Объединение" | 4-03-00040-A | 993,2 | 1 309,00 | 1 300 098,80 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "КИТ Финанс ИБ" ОАО | 40101911В | 995,9 | 1 278,00 | 1 272 760,20 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "КИТ Финанс ИБ" ОАО | 40201911В | 998,1 | 500 | 499 050,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Мастер-банк" КБ ОАО | 40202176В | 999,7 | 1 747,00 | 1 746 475,90 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Московский Кредитный банк" ОАО | 40201978В | 999,9 | 2 600,00 | 2 599 740,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Русский межрегиональный банк развития" АКБ ЗАО | 40103073В | 979,2 | 2 500,00 | 2 448 000,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "СОК-Автокомпонент" ООО | 4-01-36078-R | 1 000,5000000 | 490 | 490 245,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Сорус Капитал", ООО | 4-01-36181-R | 1 000,3000000 | 2 500,00 | 2 500 750,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Судостроительный банк" КБ ООО | 40102999В | 988,1 | 1 400,00 | 1 383 340,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Татфондбанк" АИКБ ОАО | 40303058В | 1 000,0000000 | 2 600,00 | 2 600 000,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |

| | | | | | |
|---|-----------|-------|----------|---------------|---|
| "УРСА Банк" ОАО | 40300323В | 967,2 | 1 749,00 | 1 691 632,80 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "ХКФ Банк" ООО | 40300316В | 992,5 | 2 500,00 | 2 481 250,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Коммерческий банк "Юниаструм Банк" ООО | 40202771В | 992,8 | 1 381,00 | 1 371 056,80 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ | | | | 30 908 043,80 | |

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 расчёта рыночной цены * |
|---|-----------------------|---|----------------------|------------------|---------------------------|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| "Иркутскэнерго" ОАО | обыкновенная | 1-01-00041-A | 21,138 | 75 000,00 | 1 585 350,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "ЛУКОЙЛ" Нефтяная компания" ОАО | обыкновенная | 1-01-00077-A | 1 975,0900000 | 1 100,00 | 2 172 599,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии" ОАО | обыкновенная | 1-01-50077-A | 2,781 | 1 | 2,78 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "РАО "ЕЭС России" ОАО | обыкновенная | 1-01-00034-A | 23,912 | 27 000,00 | 645 624,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Сбергательный банк РФ" ОАО | обыкновенная | 10301481В | 73,7 | 14 000,00 | 1 031 800,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |

| | | | | | | |
|---|-------------------|--------------|--------|-----------|--------------|---|
| "Сбергательный банк РФ" ОАО | привилегированная | 20301481В | 47,36 | 8 000,00 | 378 880,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Северо-западный телеком" ОАО | обыкновенная | 1-02-00119-А | 29,932 | 11 800,00 | 353 197,60 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| "Татнефть" ОАО | обыкновенная | 1-03-00161-А | 151,66 | 3 000,00 | 454 980,00 | Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа" |
| Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ | | | | | 6 622 433,38 | |

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 расчёта рыночной цены * |
|--|---|----------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Итого рыночная стоимость облигаций с ипотечным покрытием | | | | 0 | |

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 расчёта рыночной цены * |
|---|---|--|----------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Итого рыночная стоимость ипотечных сертификатов участия | | | | | 0 | |

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 |

13. Дебиторская задолженность

| Средства пенсионных накоплений на специальных брокерских счетах | |
|---|----------------------|
| Наименование брокера | Сумма средств (руб.) |
| 1 | 2 |
| "Брокеркредитсервис" ООО | 306 857,41 |
| Итого средств на специальных брокерских счетах | 306 857,41 |

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям

| Наименование эмитента | Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска) | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
|---|---|--|
| 1 | 2 | 3 |
| "Группа Джей Эф Си" ЗАО | 4-01-10255-J | 100 100,00 |
| "Дикая Орхидея" ЗАО | 4-01-14135-H | 51 122,20 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-03-36068-R | 6 528,00 |
| "Инком-Лада" (ООО) | 4-02-36068-R | 9 246,00 |
| "Инпром" ОАО | 4-02-55534-P | 44 600,00 |
| "Иркутское Авиационное Производственное Объединение" | 4-03-00040-A | 3 442,67 |
| "КИТ Финанс ИБ" ОАО | 40101911B | 36 410,22 |
| "КИТ Финанс ИБ" ОАО | 40201911B | 1 920,00 |
| "Мастер-банк" КБ ОАО | 40202176B | 70 998,08 |
| "Московский Кредитный банк" ОАО | 40201978B | 95 030,00 |
| "Русский межрегиональный банк развития" АКБ ЗАО | 40103073B | 7 525,00 |
| "СОК-Автокомпонент" ООО | 4-01-36078-R | 25 455,50 |
| "Сорус Капитал", ООО | 4-01-36181-R | 43 550,00 |
| "Судостроительный банк" КБ ООО | 40102999B | 33 250,00 |
| "Татфондбанк" АИКБ ОАО | 40303058B | 34 216,00 |
| "УРСА Банк" ОАО | 40300323B | 53 361,99 |
| "ХКФ Банк" ООО | 40300316B | 7 125,00 |
| Коммерческий банк "Юниаструм Банк" ООО | 40202771B | 68 456,17 |
| Ярославская область | RU31004YRS0 | 9 205,00 |
| Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям | | 701 541,83 |

Прочая дебиторская задолженность

| Наименование дебиторской задолженности | Сумма дебиторской задолженности (руб.) |
|--|--|
| 1 | 2 |
| Итого прочая дебиторская задолженность | 0 |
| Итого дебиторская задолженность (руб.) | 1 008 399,24 |

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

45 740 003,10 руб. **

* 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.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

