

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2008 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: от 08.10.2003 №22-03У033

Дата и время составления расчёта: 01.07.2008 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	240 854,05
Итого денежных средств на счетах				240 854,05

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	

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	Ленинградская область	RU26002LEN	1 162,5000000	221	256 912,50	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
Субфедеральная бумага	Ярославская область	RU31004YRS0	1 021,4000000	1 947,00	1 988 665,80	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					2 245 578,30	

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	995	2 000,00	1 990 000,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Дикая Орхидея" ЗАО	4-01-14135-H	1 005,4000000	2 000,00	2 010 800,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Инком-Лада" (ООО)	4-02-36068-R	1 006,7000000	725	729 857,50	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Инком-Лада" (ООО)	4-03-36068-R	1 001,8000000	1 275,00	1 277 295,00	-

"Инпром" ОАО	4-02-55534-P	991,9	2 000,00	1 983 800,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Иркутское Авиационное Производственное Объединение"	4-03-00040-A	993,3	1 309,00	1 300 229,70	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"КИТ Финанс ИБ" ОАО	40101911В	1 001,6000000	1 500,00	1 502 400,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"КИТ Финанс ИБ" ОАО	40201911В	1 001,5000000	500	500 750,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Мастер-банк" КБ ОАО	40302176В	1 000,6000000	253	253 151,80	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Московский Кредитный банк" ОАО	40201978В	1 007,5000000	2 000,00	2 015 000,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Русский межрегиональный банк развития" АКБ ЗАО	40103073В	984,5	2 000,00	1 969 000,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Седьмой континент" ОАО	4-02-00462-Н	989,3	2 000,00	1 978 600,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Сорус Капитал", ООО	4-01-36181-R	1 004,9000000	2 000,00	2 009 800,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Судостроительный банк" КБ ООО	40102999В	987,7	2 000,00	1 975 400,00	-
"УРСА Банк" ОАО	40300323В	1 000,2000000	2 000,00	2 000 400,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"

"ХКФ Банк" ООО	40300316В	999,2	2 000,00	1 998 400,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
Коммерческий банк "Юниаструм Банк" ООО	40202771В	999,1	2 000,00	1 998 200,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4-01-36314-R	1 014,5000000	2 000,00	2 029 000,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				29 522 084,00	

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	20,437	61 000,00	1 246 657,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"ЛУКОЙЛ" Нефтяная компания" ОАО	обыкновенная	1-01-00077-A	2 317,3100000	1 000,00	2 317 310,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Пятая генерирующая компания оптового рынка электроэнергии" ОАО	обыкновенная	1-01-50077-A	2,774	1	2,77	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Северо-западный телеком" ОАО	привилегированная	2-02-00119-A	18,641	75 000,00	1 398 075,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Северо-западный телеком" ОАО	обыкновенная	1-02-00119-A	29,327	11 800,00	346 058,60	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"

"Сибирьтелеком" ОАО	обыкновенная	1-04-00195-A	2,132	656 400,00	1 399 444,80	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Татнефть" ОАО	обыкновенная	1-03-00161-A	176,57	1 000,00	176 570,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
"Уралсвязьинформ" ОАО	обыкновенная	1-07-00175-A	1,228	1 407 500,00	1 728 410,00	Закрытое акционерное общество "Московская межбанковская валютная биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					8 612 528,17	

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	1 856 300,95
Итого средств на специальных брокерских счетах	1 856 300,95

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	33 960,00
"Дикая Орхидея" ЗАО	4-01-14135-H	57 700,00
"Инком-Лада" (ООО)	4-03-36068-R	6 528,00
"Инком-Лада" (ООО)	4-02-36068-R	11 172,25
"Инпром" ОАО	4-02-55534-P	79 560,00
"Иркутское Авиационное Производственное Объединение"	4-03-00040-A	31 965,78
"КИТ Финанс ИБ" ОАО	40201911B	14 385,00
"КИТ Финанс ИБ" ОАО	40101911B	4 935,00
"Мастер-банк" КБ ОАО	40302176B	2 072,07
"Московский Кредитный банк" ОАО	40201978B	15 760,00
"Русский межрегиональный банк развития" АКБ ЗАО	40103073B	55 900,00
"Седьмой континент" ОАО	4-02-00462-H	4 700,00
"Сорус Капитал", ООО	4-01-36181-R	34 840,00
"Судостроительный банк" КБ ООО	40102999B	96 620,00
"УРСА Банк" ОАО	40300323B	13 160,00
"ХКФ Банк" ООО	40300316B	5 700,00
Коммерческий банк "Юниаструм Банк" ООО	40202771B	44 200,00
Ленинградская область	RU26002LEN	1 286,22
ООО "Лизинговая компания УРАЛСИБ"	4-01-36314-R	3 180,00
Ярославская область	RU31004YRSO	19 197,42
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		536 821,74

Прочая дебиторская задолженность

Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0
Итого дебиторская задолженность (руб.)	2 393 122,69

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

47 314 167,21 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.

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

Е.В. Варакина (доверенность №
47-114/2007 от 20.11.2007 г.)

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.