

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

Полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления	<u>ОАО Управляющая компания "Пифагор" ДУ средствами пенсионных накоплений</u>
Полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании	<u>ОАО Управляющая компания "Пифагор" ДУ средствами пенсионных накоплений, ИНН 7705136973</u>
Дата и номер договора доверительного управления	<u>08.10.2003 № 22-ОЗУ033</u>
Дата и время составления расчета	<u>2 Июля 2007 г. 11.00</u>

### 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	91 495,19
Итого денежных средств на счетах				91 495,19

### 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
ГКО-ОФЗ	46002RMFS	1095.541	5000	5 477 705,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг				5 477 705,00	

\* 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	Администрация Воронежской области	RU31002VRO0	1079.5	1710	1 845 945,00	ММВБ
Облигация	Правительство Москвы	RU27039MOS	1104.5	500	552 250,00	ММВБ
Облигация	Правительство Москвы	RU27041MOS	1077.8	500	538 900,00	ММВБ
Облигация	Министерство финансов Республики Коми	RU24006KOM	1131.8	1300	1 471 340,00	ММВБ
Облигация	Новосибирская область	RU34013ANO0	1017.4	2000	2 034 800,00	ММВБ
Облигация	Администрация Тульской области	RU31001TULO	1028.4	1000	1 028 400,00	ММВБ
Облигация	Минфин Хабаровского края	RU31006HAB0	1008.3	2000	2 016 600,00	ММВБ
Облигация	Министерство финансов ХМАО	RU25005HMN	1062.5	302	320 875,00	ММВБ
Облигация	Правительство Чувашской республики	RU31005CHU0	1037.9	1000	1 037 900,00	ММВБ
Облигация	Ярославская область	RU31004YRS0	1055.7	250	263 925,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					11 110 935,00	

\* 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	1011.9	2000	2 023 800,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации				2 023 800,00	

\* 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	1013.3	1500	1 519 950,00	ММВБ
ОАО "ВолгаТелеком"	4-45-00137-A	1033.7	1700	1 757 290,00	ММВБ
ОАО "Газпром"	4-04-00028-A	1049.7	800	839 760,00	ММВБ
ОАО "Инпром"	4-02-55534-P	1001.9	1700	1 703 230,00	ММВБ
ОАО "Научно-производственная корпорация "Иркут"	4-03-00040-A	1044	1000	1 044 000,00	ММВБ
ОАО Инвестиционный банк "КИТ Финанс"	40101911B	1032.2	1000	1 032 200,00	ММВБ
АИКБ "НОВАЯ МОСКВА"	40202209B	1002.5	1500	1 503 750,00	ММВБ
ОАО АИКБ "Новая Москва"	40302209B	1002.8	500	501 400,00	ММВБ
ОАО "ПАВА" обл., вып.2	4-02-10682-F	1032.4	1600	1 651 840,00	ММВБ
ОАО АКБ "Русский межрегиональный банк развития"	40103073B	1017	1500	1 525 500,00	ММВБ
ООО КБ "Судостроительный банк"	40102999B	1005.9	600	603 540,00	ММВБ
АИКБ "Татфондбанк"	40303058B	1008.8	500	504 400,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских				14 186 860,00	

\* 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	27.41	75000	2 055 750,00	ММВБ
ОАО "ЛУКОЙЛ"	Обыкновенная	1-01-00077-A	1973.46	600	1 184 076,00	ММВБ
ОАО "МосЭнерго"	Обыкновенная	1-01-00085-A	6.079	200000	1 215 800,00	ММВБ
РАО ЕЭС России	Привилегированная	2-01-00034-A	30.425	65000	1 977 625,00	ММВБ
РАО Ростелеком	Привилегированная	2-01-00124-A	75.23	15000	1 128 450,00	ММВБ
Сбербанк России	Привилегированная	20201481B	1520.32	500	760 160,00	ММВБ
Северо-Западный Телеком ао	Обыкновенная	1-02-00119-A	44.43	12000	533 160,00	ММВБ
УралСви	Обыкновенная	1-07-00175-A	1.568	200000	313 600,00	ММВБ
Итого акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					9 168 621,00	

\* 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	613 380,09
Итого средств на специальных брокерских счетах	613 380,09

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	24 705,00
ОАО "ВолгаТелеком"	4-45-00137-A	9 894,00
Администрация Воронежской области	RU31002VRO0	7 301,70
ОАО "Газпром"	4-04-00028-A	24 504,00
Правительство Москвы	RU27039MOS	21 920,00
Правительство Москвы	RU27041MOS	20 685,00
ОАО "Инпром"	4-02-55534-P	81 226,00
ОАО "Научно-производственная корпорация "Иркут"	4-03-00040-A	23 950,00
ОАО Инвестиционный банк "КИТ Финанс"	40101911B	3 290,00
Министерство финансов Республики Коми	RU24006KOM	37 024,00
Администрация г. Красноярск	RU31005KRN1	34 000,00
Новосибирская область	RU34013ANO0	5 120,00
АИКБ "НОВАЯ МОСКВА"	40202209B	55 635,00
ОАО АИКБ "Новая Москва"	40302209B	1 245,00
Министерство финансов РФ	46002RMFS	167 700,00
ОАО "ПАВА" обл., вып.2	4-02-10682-F	25 200,00
ОАО АКБ "Русский межрегиональный банк развития"	40103073B	41 100,00
ООО КБ "Судостроительный банк"	40102999B	30 552,00
АИКБ "Татфондбанк"	40303058B	5 340,00
Администрация Тульской области	RU31001TULO	21 660,00
МинФин Хабаровского края	RU31006HAB0	16 220,00
Министерство финансов ХМАО	RU25005HMN	3 276,70
Правительство Чувашской республики	RU31005CHU0	5 160,00
Ярославская область	RU31004YRS0	2 590,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		669 298,40

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (тыс. руб.)
1	2
	0,00
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (тыс. руб.)	1 282 678,49

**14. Итого рыночная стоимость активов, составляющих инвестиционный портфель управляющей компании** 47 642 094,68 тыс. руб. \*

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

Руководитель бэк-офиса  
Управляющей компании "Пифагор"

Яковлева И.Ю.  
(подпись) (доверенность б/н от 04.06.07)

м.п.