

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2009 г.**

Пенсионный фонд России, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Закрытое акционерное общество `Объединенная Финансовая Группа ИНВЕСТ` Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7710186602/770701001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У043

Дата и время составления расчёта: 11.01.2010 10:04:00

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
МОСКОВСКИЙ ФИЛИАЛ ОАО АКБ "РОСБАНК"	16.01.2004	16828/RUR/04	40701810487830000015	8 748,98
Итого денежных средств на счетах				8 748,98

2. Денежные средства в депозитах

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского счёта		Реквизиты банковского счёта	Сумма денежных средств (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 расчёта 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 облигаций внешних облигационных займов 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 расчёта рыночной цены*
1	2	3	4	5	6	7
Облигации	Москва	RU27039MOS	944,5000000	1 200,00	1 133 400,00	ММВБ
Облигации	Министерство Финансов Республики Саха (Якутия)	RU25006RSY	400,7200000	600,00	240 432,00	ММВБ
Облигации	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMNO	1 022,2000000	800,00	817 760,00	ММВБ
Облигации	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMNO	1 027,5000000	800,00	822 000,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					3 013 592,00	

7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены*
1	3	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				0,00	

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	3	3	4	5	6
ОАО "АК "Транснефть"	4-01-00206-A	1 014,1000000	1 000,00	1 014 100,00	
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 070,9000000	1 200,00	1 285 080,00	ММВБ
ОАО "Газпром нефть"	4-03-00146-A	1 118,6000000	1 000,00	1 118 600,00	ММВБ
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	1 004,9000000	2 000,00	2 009 800,00	ММВБ
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 028,0000000	1 400,00	1 439 200,00	ММВБ
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-12-65045-D	1 105,9000000	2 000,00	2 211 800,00	ММВБ
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40303349B	1 000,5000000	1 000,00	1 000 500,00	ММВБ
ОАО "Северсталь"	4B02-01-00143-A	1 054,4000000	1 500,00	1 581 600,00	ММВБ
ОАО "СОЛЛЕРС"	4-01-02461-D	1 000,1000000	500,00	500 050,00	ММВБ
ОАО "ТрансКредитБанк"	40302142B	1 000,2000000	1 300,00	1 300 260,00	ММВБ
ОАО "Федеральная Сетевая компания ЕЭС"	4-04-65018-D	974,4000000	1 000,00	974 400,00	ММВБ
ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	1 043,4000000	1 000,00	1 043 400,00	ММВБ
ОАО "Энел ОГК-5"	4B02-02-50077-A	1 019,9000000	840,00	856 716,00	

ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-07-00739-A	895,4000000	650,00	582 010,00	
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-08-00739-A	925,1000000	200,00	185 020,00	
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-09-00739-A	907,0000000	200,00	181 400,00	ММВБ
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 078,8000000	2 400,00	2 589 120,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				19 873 056,00	

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
ОАО "Аэрофлот - российские авиалинии"	АОИ	1-01-00010-A	52,9200000	13 845,00	732 677,40	ММВБ
ОАО "НК Лукойл"	АОИ	1-01-00077-A	1 692,2200000	845,00	1 429 925,90	ММВБ
ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	АОИ	1-03-00161-A	139,6200000	8 400,00	1 172 808,00	ММВБ
ОАО "ТГК-1"	АОИ	1-01-03388-D	0,0165000	79 000 000,00	1 303 500,00	ММВБ
ОАО "Энел ОГК-5"	АОИ	1-01-50077-A	2,1380000	179 400,00	383 557,20	ММВБ
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АОИ	10301481B	82,7700000	25 500,00	2 110 635,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					7 133 103,50	

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	3	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 расчёта 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
ОАО АКБ "РОСБАНК" ПФР Фонд.Бир.РТ-0000-80856 от 21.09.09 г.	1 197 968,94
Итого средств на специальных брокерских счетах	1 197 968,94

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Министерство Финансов Республики Саха (Якутия) Москва	RU25006RSY	3 222,00
ОАО "АК "Транснефть"	RU27039MOS	42 876,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-01-00206-A	82 880,00
ОАО "Газпром нефть"	4-02-01669-A	65 460,00
ОАО "Мосэнерго"	4-03-00146-A	65 870,00
ОАО "НЛМК"	4-04-00085-A	15 160,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4B02-05-00102-A	23 912,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	4-12-65045-D	28 580,00
ОАО "Северсталь"	40303349B	26 750,00
ОАО "СОЛЛЕРС"	4B02-01-00143-A	57 540,00
ОАО "ТрансКредитБанк"	4-01-02461-D	17 645,00
ОАО "Федеральная Сетевая компания ЕЭС"	40302142B	62 270,00
ОАО "Энел ОГК-5"	4-04-65018-D	16 800,00
ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	30 540,00
ОАО "Энел ОГК-5"	4B02-02-50077-A	43 797,60
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-07-00739-A	10 530,00
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-08-00739-A	668,00
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-09-00739-A	1 888,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	169 896,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMNO	1 592,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMNO	1 656,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		769 532,60

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2

Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	1 967 501,54

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

31 996 002,02 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.

Заместитель генерального директора

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

Миклашевский И.Р.

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	ODK00112-84302F022		
Дата и время отправки	12.01.2010 10:08:09	Дата и время приёма	12.01.2010 10:08:29
Подписано	1. Алексеев Борислав Борисович, дата и время ЭЦП 11.01.2010 10:31:00 [CN=048050112-03,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] 2. Лукьянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 12.01.2010 7:08:00 [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU]		