

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2010 г.**

Пенсионный фонд России, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Закрытое акционерное общество `Объединенная Финансовая Группа ИНВЕСТ` Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7710186602/775001001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

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

Дата и время составления расчёта: 05.01.2011 10:34:00

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	1 661 672,42
Итого денежных средств на счетах				1 661 672,42

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
Облигации	25072RMFS	1 016,3970000	3 000,00	3 049 191,00	
Облигации	25073RMFS	1 011,4860000	2 000,00	2 022 972,00	
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				5 072 163,00	

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	Красноярский Край	RU34004KNA0	735,6300000	2 000,00	1 471 260,00	
Облигации	Самарская область	RU35005SAM0	868,9550000	2 000,00	1 737 910,00	
Облигации	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMN0	1 072,3000000	800,00	857 840,00	
Облигации	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMN0	1 115,7000000	800,00	892 560,00	
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					4 959 570,00	

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
Внешэкономбанк	4-06-00004-T	990,3000000	1 000,00	990 300,00	
Внешэкономбанк	4-08-00004-T	996,5000000	1 000,00	996 500,00	
ЗАО "Алроса" АК"	4-21-40046-N	1 007,8000000	1 500,00	1 511 700,00	
ОАО "АК "Транснефть"	4-01-00206-A	1 033,4000000	1 000,00	1 033 400,00	
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 112,0000000	1 200,00	1 334 400,00	
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	1 086,1000000	1 200,00	1 303 320,00	
ОАО "Банк ВТБ"	4B020101000B	1 000,9000000	500,00	500 450,00	
ОАО "Банк ВТБ"	4B020201000B	1 012,3000000	500,00	506 150,00	
ОАО "Банк ВТБ"	4B020501000B	1 003,6000000	900,00	903 240,00	
ОАО "Газпром нефть"	4-03-00146-A	1 119,6000000	1 000,00	1 119 600,00	
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	1 093,5000000	2 000,00	2 187 000,00	
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	1 054,2000000	2 000,00	2 108 400,00	
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 046,2000000	1 400,00	1 464 680,00	
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-12-65045-D	1 075,0000000	720,00	774 000,00	
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41003349B	1 027,4000000	1 000,00	1 027 400,00	

ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41103349B	1 026,7000000	1 000,00	1 026 700,00	
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40303349B	1 038,7000000	1 000,00	1 038 700,00	
ОАО "Северсталь"	4B02-02-00143-A	1 044,8000000	1 400,00	1 462 720,00	
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	1 046,3000000	1 000,00	1 046 300,00	
ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	1 041,1000000	1 000,00	1 041 100,00	
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 047,4000000	470,00	492 278,00	
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				23 868 338,00	

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 "Мечел"	АОИ	1-01-55005-E	880,0700000	807,00	710 216,49	
ОАО "Аэрофлот - российские авиалинии"	АОИ	1-01-00010-A	79,1300000	16 845,00	1 332 944,85	
ОАО "МТС"	АОИ	1-01-04715-A	259,9100000	2 282,00	593 114,62	
ОАО "НК Лукойл"	АОИ	1-01-00077-A	1 736,5500000	350,00	607 792,50	
ОАО "НОВАТЭК"	АОИ	1-02-00268-E	330,9900000	2 060,00	681 839,40	
ОАО "ТГК-1"	АОИ	1-01-03388-D	0,0214000	79 000 000,00	1 690 600,00	
ОАО "Энел ОГК-5"	АОИ	1-01-50077-A	2,8170000	179 400,00	505 369,80	
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АОИ	10301481B	104,0500000	24 598,00	2 559 421,90	
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АПИ	20301481B	75,2400000	6 735,00	506 741,40	
Полиметалл	АОИ	1-02-00412-D	568,9300000	2 461,00	1 400 136,73	
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					10 588 177,69	

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
Итого средств на специальных брокерских счетах	
	0,00

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Внешэкономбанк	4-06-00004-T	14 280,00
Внешэкономбанк	4-08-00004-T	12 480,00
ЗАО "Алроса" АК"	4-21-40046-N	2 715,00
Красноярский Край	RU34004KNAO	21 360,00
МинФин РФ	25072RMFS	91 680,00
МинФин РФ	25073RMFS	55 940,00
ОАО "АК "Транснефть"	4-01-00206-A	59 030,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	65 952,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	11 916,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020101000B	1 460,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020201000B	1 460,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020501000B	2 628,00
ОАО "Газпром нефть"	4-03-00146-A	66 270,00
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	2 160,00
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	15 720,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	24 332,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-12-65045-D	10 584,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40303349B	33 960,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41003349B	35 010,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41103349B	34 770,00
ОАО "Северсталь"	4B02-02-00143-A	49 742,00
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	35 530,00
ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	30 880,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	33 468,70
Самарская область	RU35005SAMO	3 460,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMNO	1 824,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMNO	1 896,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		720 507,70

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	720 507,70

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

46 870 428,81 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

Миклашевский И.Р.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00112-103970F022		
Дата и время отправки	18.01.2011 16:47:47	Дата и время приёма	18.01.2011 17:31:39
Подписано	1. Алексеев Борислав Борисович, дата и время ЭЦП 08.01.2011 10:42:00 GMT [CN=048050112-03,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукьянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 18.01.2011 13:23:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		