

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2011 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: 10.01.2012 10:23:00

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	2 737 639,69
Итого денежных средств на счетах				2 737 639,69

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
ОАО "Банк ВТБ"	02.12.2011	021211DJ461554	42004810800030000127	8 000 000,00	0,00
ОАО "Банк ВТБ"	30.11.2011	301111DJ313981	42004810600030000110	4 300 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				12 300 000,00	

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
Облигации	25075RMFS	976,0830000	3 600,00	3 513 898,80	Расчётная цена
Облигации	25077RMFS	985,1750000	3 600,00	3 546 630,00	Расчётная цена
Облигации	26203RMFS	960,2820000	3 600,00	3 457 015,20	Расчётная цена
Облигации	26204RMFS	967,0030000	4 000,00	3 868 012,00	Расчётная цена
Облигации	26206RMFS	969,8620000	4 000,00	3 879 448,00	Расчётная цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				18 265 004,00	

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	Мэрия (правительство) Москвы	RU31054MOS0	1 005,0000000	3 000,00	3 015 000,00	Расчётная цена
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					3 015 000,00	

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	945,0000000	1 000,00	945 000,00	Расчётная цена
Внешэкономбанк	4-08-00004-T	993,5000000	1 200,00	1 192 200,00	Расчётная цена
ЗАО "Коммерческий банк ДельтаКредит"	40603338B	964,6000000	1 500,00	1 446 900,00	Расчётная цена
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-04-01669-A	683,1022750	2 400,00	1 639 445,46	Расчётная цена
ОАО "Алроса" АК"	4-21-40046-N	1 003,5000000	1 500,00	1 505 250,00	Расчётная цена
ОАО "Алроса" АК"	4-23-40046-N	1 007,6000000	700,00	705 320,00	Расчётная цена
ОАО "Банк Санкт-Петербург"	4B020200436B	999,5000000	2 000,00	1 999 000,00	Расчётная цена
ОАО "Магнит"	4B02-06-60525-P	973,1000000	2 000,00	1 946 200,00	Расчётная цена
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-04-04715-A	977,1000000	2 000,00	1 954 200,00	Расчётная цена

ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	1 027,7000000	2 000,00	2 055 400,00	Расчётная цена
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40703349B	970,5000000	1 300,00	1 261 650,00	Расчётная цена
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	1 028,1000000	1 000,00	1 028 100,00	Расчётная цена
ОАО "Теле2-Санкт-Петербург"	4-03-00740-D	929,1000000	2 200,00	2 044 020,00	Расчётная цена
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-09-00739-A	984,5000000	1 200,00	1 181 400,00	Расчётная цена
ООО "Хоум Кредит энд Финанс Банк"	4B020100316B	1 001,0000000	1 800,00	1 801 800,00	Расчётная цена
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				22 705 885,46	

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
Магнит ОАО	АОИ	1-01-60525-P	2 768,2000000	273,00	755 718,60	Расчётная цена
ОАО "Мечел"	АОИ	1-01-55005-E	265,2000000	807,00	214 016,40	Расчётная цена
ОАО "Аэрофлот - российские авиалинии"	АОИ	1-01-00010-A	50,2900000	16 845,00	847 135,05	Расчётная цена
ОАО "МТС"	АОИ	1-01-04715-A	181,9500000	4 792,00	871 904,40	Расчётная цена
ОАО "НК Лукойл"	АОИ	1-01-00077-A	1 699,5000000	700,00	1 189 650,00	Расчётная цена
ОАО "НОВАТЭК"	АОИ	1-02-00268-E	388,5700000	3 560,00	1 383 309,20	Расчётная цена
ОАО "ТГК-1"	АОИ	1-01-03388-D	0,0094280	81 900 000,00	772 153,20	Расчётная цена
ОАО "Энел ОГК-5"	АОИ	1-01-50077-A	1,8278000	253 400,00	463 164,52	Расчётная цена
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АОИ	10301481B	79,0600000	19 448,00	1 537 558,88	Расчётная цена
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АПИ	20301481B	58,8500000	35,00	2 059,75	Расчётная цена
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					8 036 670,00	

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.)	101 222,81
ОАО АКБ "РОСБАНК" ПФР Цб.Гос. (РТ-0000-80856/ГЦБ от 21.09.09 г.)	25 298,13
Итого средств на специальных брокерских счетах	126 520,94

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	14 500,00
Внешэкономбанк	4-08-00004-T	15 204,00
ЗАО "Коммерческий банк ДельтаКредит"	40603338B	2 955,00
МинФин РФ	25075RMFS	111 312,00
МинФин РФ	25077RMFS	113 832,00
МинФин РФ	26203RMFS	97 344,00
МинФин РФ	26204RMFS	82 200,00
МинФин РФ	26206RMFS	8 120,00
Мэрия (правительство) Москвы	RU31054MOS0	76 920,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-04-01669-A	35 520,00
ОАО "Алроса" АК"	4-21-40046-N	3 045,00
ОАО "Алроса" АК"	4-23-40046-N	1 547,00
ОАО "Банк Санкт-Петербург"	4B020200436B	39 460,00
ОАО "Магнит"	4B02-06-60525-P	28 460,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	4-04-04715-A	94 940,00
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	16 280,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40703349B	4 394,00
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	35 790,00
ОАО "Теле2-Санкт-Петербург"	4-03-00740-D	4 048,00
ОАО Агентство по ипотечному жилищному кредитованию	4-09-00739-A	11 328,00
ООО "Хоум Кредит энд Финанс Банк"	4B020100316B	31 986,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		829 185,00

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	955 705,94

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

68 015 905,09 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.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00112-133800F022		
Дата и время отправки	12.01.2012 12:12:12	Дата и время приёма	12.01.2012 12:19:35
Подписано	1. Лукьянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 12.01.2012 8:09:00 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Алексеев Борислав Борисович, дата и время ЭЦП 12.01.2012 7:57:00 GMT [CN=048050112-03,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		