

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2010 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: 01.10.2010 10:59:00

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	6 723 068,08
Итого денежных средств на счетах				6 723 068,08

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	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMNO	1 072,3000000	800,00	857 840,00	
Облигации	Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMNO	1 102,6000000	800,00	882 080,00	
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 739 920,00	

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	1 050,7000000	1 000,00	1 050 700,00	
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	1 135,0000000	1 200,00	1 362 000,00	ММВБ
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	1 104,9000000	1 200,00	1 325 880,00	ММВБ
ОАО "Банк ВТБ"	4B020101000B	1 007,9000000	500,00	503 950,00	ММВБ
ОАО "Банк ВТБ"	4B020201000B	1 014,2000000	500,00	507 100,00	ММВБ
ОАО "Банк ВТБ"	4B020501000B	1 006,4000000	900,00	905 760,00	ММВБ
ОАО "Газпром нефть"	4-03-00146-A	1 143,4000000	1 000,00	1 143 400,00	ММВБ
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	1 119,7000000	2 000,00	2 239 400,00	ММВБ
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	1 067,5000000	2 000,00	2 135 000,00	
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	1 076,7000000	1 400,00	1 507 380,00	ММВБ
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-12-65045-D	1 099,6000000	720,00	791 712,00	ММВБ
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41003349B	1 039,4000000	1 000,00	1 039 400,00	ММВБ
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41103349B	1 038,2000000	1 000,00	1 038 200,00	ММВБ
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40303349B	1 048,7000000	1 000,00	1 048 700,00	ММВБ
ОАО "Северсталь"	4B02-02-00143-A	1 050,6000000	1 400,00	1 470 840,00	ММВБ
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	1 049,4000000	1 000,00	1 049 400,00	

ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	1 062,800000	1 000,00	1 062 800,00	ММВБ
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	1 070,800000	470,00	503 276,00	ММВБ
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				20 684 898,00	

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	755,9800000	807,00	610 075,86	ММВБ
ОАО "Аэрофлот - российские авиалинии"	АОИ	1-01-00010-A	65,7800000	16 845,00	1 108 064,10	ММВБ
ОАО "НОВАТЭК"	АОИ	1-02-00268-E	233,8100000	800,00	187 048,00	ММВБ
ОАО "ТГК-1"	АОИ	1-01-03388-D	0,0225000	79 000 000,00	1 777 500,00	ММВБ
ОАО "Энел ОГК-5"	АОИ	1-01-50077-A	2,7100000	179 400,00	486 174,00	ММВБ
ОАО АКБ СБЕРБАНК	АОИ	10301481B	84,9300000	24 598,00	2 089 108,14	ММВБ
Полиметалл	АОИ	1-02-00412-D	462,2200000	2 461,00	1 137 523,42	ММВБ
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					7 395 493,52	

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.)	8 092 317,96
Итого средств на специальных брокерских счетах	8 092 317,96

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
ОАО "АК "Транснефть"	4-01-00206-A	34 460,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-02-01669-A	21 336,00
ОАО "Акционерная финансовая корпорация "Система"	4-03-01669-A	48 900,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020101000B	1 355,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020201000B	1 355,00
ОАО "Банк ВТБ"	4B020501000B	2 439,00
ОАО "Газпром нефть"	4-03-00146-A	29 100,00
ОАО "Газпром"	4-13-00028-A	66 860,00
ОАО "Мосэнерго"	4-04-00085-A	66 280,00
ОАО "НЛМК"	4B02-05-00102-A	61 432,00
ОАО "Российские Железные Дороги"	4-12-65045-D	37 036,80
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	40303349B	10 640,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41003349B	12 330,00
ОАО "Российский сельскохозяйственный банк"	41103349B	12 080,00
ОАО "Северсталь"	4B02-02-00143-A	15 330,00
ОАО "Северсталь"	4B02-04-00143-A	10 950,00
ОАО "Энел ОГК-5"	4-01-50077-A	61 080,00
ООО "ВымпелКом-Инвест"	4-03-36281-R	15 463,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25007HMNO	22 336,00
Ханты-Мансийский Автономный Округ	RU25008HMNO	23 200,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		553 962,80

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	8 646 280,76

**14. Итого рыночная стоимость активов,
составляющих инвестиционный портфель
управляющей компании****45 189 660,36 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	ODK00112-98314F022		
Дата и время отправки	01.10.2010 16:22:22	Дата и время приёма	01.10.2010 16:26:13
Подписано	1. Алексеев Борислав Борисович, дата и время ЭЦП 01.10.2010 8:08:00 [CN=048050112-03,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 01.10.2010 12:22:00 [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		