

**Расчёт  
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,  
по состоянию на 30.06.2007 г.**

**Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/ 770601001**

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Государственная корпорация "Банк развития и внешнеэкономической деятельности  
(Внешэкономбанк)" Д.У. средствами пенсионных накоплений, 7750004150/775001001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 31.12.2003 №22-03Г065

Дата и время составления расчёта: 02.07.2007 12:35:29

**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
EUROCLEAR BANK S.A./N.V./BRUSSELS	0		687-11156-00-29	853 132 055,01
ЗАО РП ММВБ	08.01.2003	487	40701810005100000399	843 676 830,68
ЗАО РП ММВБ	25.03.2003	68	40701840305100000399	0,00
ОАО Внешторгбанк	10.12.2003	1116/840	40701840200060000101	434 803 977,96
ОАО Внешторгбанк	27.12.2004	1699	40701978300060000067	5 680 763 818,50
ООО "Дойче Банк"	26.03.2007	б/н	40701840700000000052	1 036 383 378,25
ОПЕРУ МГТУ Банка России	14.01.2004	б/н	40701810000000000060	6 258 173 721,88
Итого денежных средств на счетах				15 106 933 782,28

**2. Денежные средства в депозитах**

Наименование кредитной организации	Реквизиты договора банковского вклада		Реквизиты банковского счёта	Сумма вклада (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
ОФЗ	25057RMFS	1 037,926	8 605 423	8 931 792 272,70	ММВБ
ОФЗ	25058RMFS	1 008,462	2 705 022	2 727 911 896,16	ММВБ
ОФЗ	25059RMFS	1 005,087	6 427 600	6 460 297 201,20	ММВБ
ОФЗ	25060RMFS	1 002,543	55 291	55 431 605,01	ММВБ
ОФЗ	26198RMFS	991,471	13 910 042	13 791 403 251,78	ММВБ
ОФЗ	27026RMFS	1 012,131	2 429 317	2 458 787 044,53	ММВБ
ОФЗ	46001RMFS	774,2085	1 644 129	1 272 898 646,90	ММВБ
ОФЗ	46002RMFS	1 095,541	17 114 958	18 750 138 202,28	ММВБ
ОФЗ	46003RMFS	1 098,481	10 438 259	11 466 229 184,58	ММВБ
ОФЗ	46005RMFS	485,859	349 510	169 812 579,09	ММВБ
ОФЗ	46010RMFS	880,75	4 446 801	3 916 519 980,75	ММВБ
ОФЗ	46011RMFS	861,466	4 618 357	3 978 557 531,36	ММВБ
ОФЗ	46012RMFS	655,821	3 906 110	2 561 708 966,31	ММВБ
ОФЗ	46014RMFS	1 093,545	20 146 705	22 031 328 519,23	ММВБ
ОФЗ	46017RMFS	1 066,985	21 682 428	23 134 825 439,58	ММВБ
ОФЗ	46018RMFS	1 118,119	23 029 271	25 749 465 461,25	ММВБ
ОФЗ	46020RMFS	1 028,902	3 041 167	3 129 062 808,63	ММВБ

ОФЗ	46021RMFS	1 006,388	5 164 821	5 197 813 876,55	ММВБ
ОФЗ	48001RMFS	1 059,298	4 612 038	4 885 522 629,32	ММВБ
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				160 669 507 097,2	1

#### 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
ГСО	39001RMFS	1 015,999	52 000 000	52 831 948 000,00
ГСО	35001RMFS	994,2642817	350 000	347 992 498,60
ГСО	39002RMFS	999,364	13 000 000	12 991 732 000,00
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации, специально выпущенных Правительством Российской Федерации для размещения средств институциональных инвесторов				66 171 672 498,60

#### 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
Еврооблигации	МК-0-СМ-119 (XS0088543193)	45 487,628076	64 000	2 911 208 196,86
Еврооблигации	СК-0-СМ-128 (XS0114288789)	28,29025163946	528 027 000	14 938 016 702,45
Итого рыночная стоимость облигаций внешних облигационных займов Российской Федерации				17 849 224 899,31

#### 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
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					0,00	

#### 7. Муниципальные облигации

Наименование муниципального образования	Государственный регистрационный номер выпуска	Рыночная цена (руб.)	Количество (шт.)	Рыночная стоимость (руб.)	Источник расчёта рыночной цены *
1	2	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	2	3	4	5	6
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				0,00	

**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
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					0,00	

**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	2	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
Минфин РФ	25057RMFS	115 140 559,74
Минфин РФ	25058RMFS	27 564 174,18
Минфин РФ	25059RMFS	70 896 428,00
Минфин РФ	25060RMFS	518 629,58
Минфин РФ	26198RMFS	544 160 843,04

Минфин РФ	27026RMFS	7 919 573,42
Минфин РФ	46001RMFS	5 738 010,21
Минфин РФ	46002RMFS	574 035 691,32
Минфин РФ	46003RMFS	468 990 976,87
Минфин РФ	46005RMFS	0,00
Минфин РФ	46010RMFS	0,00
Минфин РФ	46011RMFS	0,00
Минфин РФ	46012RMFS	20 311 772,00
Минфин РФ	46014RMFS	536 506 754,15
Минфин РФ	46017RMFS	227 231 845,44
Минфин РФ	46018RMFS	96 492 645,49
Минфин РФ	46020RMFS	78 188 403,57
Минфин РФ	46021RMFS	146 009 489,67
Минфин РФ	48001RMFS	222 300 231,60
Минфин РФ	МК-0-СМ-119 (XS0088543193)	3 511 003,20
Минфин РФ	СК-0-СМ-128 (XS0114288789)	254 315 482,24
Минфин РФ	39001RMFS	1 791 920 000,00
Минфин РФ	35001RMFS	3 860 500,00
Минфин РФ	39002RMFS	133 250 000,00
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		5 328 863 013,72

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	5 328 863 013,72

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

**265 126 201 291,12 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.

Директор Департамента доверительного управления	Попов А.В.
(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)	(И.О. Фамилия)
	(подпись)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	100-14-15835F022		
Дата и время отправки	04.07.2007 11:18:16	Дата и время приёма	04.07.2007 11:18:16
Подписано	1. Лукоянов Владимир Александрович [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] 2. Попов Александр Викторович [CN=048050100-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU]		