

Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2007 г.

Пенсионный фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания "АК БАРС КАПИТАЛ" Д.У.
средствами пенсионных накоплений, 1435126890/165601001

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У047

Дата и время составления расчёта: 10.01.2008 17:58:00

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
ОАО "АК БАРС" Банк	23.01.2004	52/14	40702810800027000688	3 695 184,35
Итого денежных средств на счетах				3 695 184,35

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
ОАО "ТрансКредитБанк"	27.10.2006	Д4/7865/10-2006	42006810600000007865	30 000 000,00	0,00
Филиал ОАО "УРАЛСИБ" в г. Воронеж	29.12.2007	82	42003810844000000082	30 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				60 000 000,00	

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
ОФЗ 46001	46001RMFS	509,87550	13 000	6 628 381,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОФЗ 46002	46002RMFS	1 082,86400	7 834	8 483 156,58	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОФЗ 46003	46003RMFS	1 075,97800	8 500	9 145 813,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОФЗ 46014	46014RMFS	1 080,08900	27 999	30 241 411,91	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОФЗ 46017	46017RMFS	1 061,35200	30 000	31 840 560,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОФЗ 46018	46018RMFS	1 104,10300	26 640	29 413 303,92	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг Российской Федерации в инвестиционном портфеле				115 752 626,91	

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
Субфедеральная бумага	Администрация Тульской области	RU31001TUL0	1 014,00000	799	810 186,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Ярославская область	RU34007YRS0	992,40000	18 962	18 817 888,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Нижегородской области	RU34003NJG0	1 011,30000	25 000	25 282 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Министерство Финансов Республики Саха (Якутия)	RU35001RSY0	1 014,90000	1 000	1 014 900,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Ярославская область	RU31004YRS0	1 028,30000	19 704	20 261 623,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35008KOM0	1 000,30000	1 980	1 980 594,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Чувашская республика	RU31005CHU0	999,40000	7 300	7 295 620,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Ленинградская область	RU26002LEN	1 243,70000	7 000	8 705 900,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Самарской области	RU25003SAM0	1 010,50000	27 005	27 288 552,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Правительство Новосибирской области	RU34013ANO0	995,60000	29 664	29 533 478,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Правительство Московской области	RU34005MOO0	532,25000	20 134	10 716 321,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Правительство г.Москвы	RU32044MOS0	1 078,20000	10 999	11 859 121,80	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Республика КОМИ	RU35007KOM0	1 061,00000	7 805	8 281 105,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Нижегородской области	RU34002NJG0	508,20000	761	386 740,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Правительство Московской области	RU25004MOO	1 055,40000	19 144	20 204 577,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Администрация Ямало-Ненецкого автономного округа	RU24001YML	1 018,30000	4 500	4 582 350,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Субфедеральная бумага	Ханты-Мансийский автономный округ	RU25005HMN	1 019,10000	4 820	4 912 062,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					201 933 521,00	

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

Администрация г. Новосибирска	RU31003NSB1	1 068,70000	13 000	13 893 100,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость муниципальных облигаций				13 893 100,00	

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
ЗАО "Группа Джей Эф Си"	4-01-10255-J	988,10000	20 770	20 522 837,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	1 000,90000	250	250 225,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	1 038,40000	26 239	27 246 577,60	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ЗАО АКБ "Русь-Банк"	40103073B	980,20000	35 002	34 308 960,40	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
КБ "Русский Международный Банк" (ООО)	40103123B	996,00000	32 000	31 872 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Банк "Возрождение"	40101439B	990,90000	25 000	24 772 500,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Дальсвязь"	4-11-30166-F	805,36000	1 870	1 506 023,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ИНПРОМ"	4-03-55534-P	997,10000	5 490	5 474 079,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ИНПРОМ"	4-02-55534-P	997,10000	8 189	8 165 251,90	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Мастер-Банк"	40202176B	1 000,30000	9 500	9 502 850,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "ПАВА"	4-02-10682-F	1 008,30000	18 030	18 179 649,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО "Татфондбанк" АИКБ	40303058B	1 002,40000	28 000	28 067 200,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "УРСА Банк"	40500323B	965,10000	39 950	38 555 745,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Инком-Лада"	4-03-36068-R	996,00000	28 894	28 778 424,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Коммерческий банк "Судостроительный банк"	40202999B	991,60000	7 840	7 774 144,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "Сорус Капитал"	4-01-36181-R	1 003,80000	39 704	39 854 875,20	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "ХКФ Банк"	40400316B	987,90000	1 615	1 595 458,50	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "ХКФ Банк"	40200316B	963,30000	27 741	26 722 905,30	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО "ХКФ Банк"	40300316B	987,60000	12 000	11 851 200,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ООО Коммерческий банк "Юниаструм Банк"	40202771B	998,40000	26 095	26 053 248,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				391 054 153,10	

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 "Иркутскэнерго"	Акция обыкновенная	1-01-00041-A	29,44800	550 000	16 196 400,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Нефтяная компания ЛУКОЙЛ"	Акция обыкновенная	1-01-00077-A	2 080,46000	19 500	40 568 970,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Сберегательный банк РФ"	Акция обыкновенная	10301481B	102,79000	400 000	41 116 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"

ОАО "Северо-западный телеком"	Акция обыкновенная	1-02-00119-A	42,25100	720 000	30 420 720,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО "Энергетики и электрификации "Мосэнерго"	Акция обыкновенная	1-01-00085-A	5,92900	100 000	592 900,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО Сибирьтелеком	Акция привилегированная	2-04-00195-A	2,01000	13 000 000	26 130 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО Сибирьтелеком	Акция обыкновенная	1-04-00195-A	2,88000	3 000 000	8 640 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО"Ростелеком"	Акция привилегированная	2-01-00124-A	71,10000	270 000	19 197 000,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
ОАО"Уралсвязьинформ"	Акция привилегированная	2-01-00175-A	1,02100	39 300 000	40 125 300,00	ЗАО "Московская Межбанковская Валютная Биржа"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					222 987 290,00	

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
ОАО "АК БАРС" Банк	772 058,83
ОАО "АК БАРС" Банк	13 238 603,81
Итого средств на специальных брокерских счетах	14 010 662,64

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Администрация г. Новосибирска	RU31003NSB1	730 860,00
Администрация Нижегородской области	RU34003NJG0	387 750,00
Администрация Нижегородской области	RU34002NJG0	6 141,27
Администрация Самарской области	RU25003SAM0	258 707,90
Администрация Тульской области	RU31001TUL0	743,07
Администрация Ямало-Ненецкого автономного округа	RU24001YML	182 475,00
ЗАО "Группа Джей Эф Си"	4-01-10255-J	352 674,60
ЗАО "Дикая Орхидея"	4-01-14135-H	7 212,50
ЗАО "Строительное объединение "М-Индустрия"	4-01-16444-J	1 162 387,70
ЗАО АКБ "Русь-Банк"	40103073B	978 305,90
КБ "Русский Международный Банк" (ООО)	40103123B	636 480,00
Ленинградская область	RU26002LEN	40 740,00
Министерство Финансов Республики Саха (Якутия)	RU35001RSY0	16 120,00
Министерство Финансов Российской Федерации	46018RMFS	124 941,60
Министерство Финансов Российской Федерации	46017RMFS	309 000,00
Министерство Финансов Российской Федерации	46003RMFS	386 580,00
Министерство Финансов Российской Федерации	46014RMFS	759 612,87
Министерство Финансов Российской Федерации	46002RMFS	266 591,02
Министерство Финансов Российской Федерации	46001RMFS	33 800,00
ОАО "Банк "Возрождение"	40101439B	717 250,00
ОАО "Дальсвязь"	4-11-30166-F	9 163,00
ОАО "ИНПРОМ"	4-03-55534-P	53 856,90
ОАО "ИНПРОМ"	4-02-55534-P	325 758,42
ОАО "Мастер-Банк"	40202176B	113 715,00
ОАО "ПАВА"	4-02-10682-F	308 673,60
ОАО "Татфондбанк" АИКБ	40303058B	369 600,00
ОАО "УРСА Банк"	40500323B	759 050,00
ООО "Инком-Лада"	4-03-36068-R	147 937,28
ООО "Коммерческий банк "Судостроительный банк"	40202999B	34 652,80
ООО "Сорус Капитал"	4-01-36181-R	691 643,68
ООО "ХКФ Банк"	40400316B	33 026,75
ООО "ХКФ Банк"	40200316B	337 330,56
ООО "ХКФ Банк"	40300316B	34 200,00
ООО Коммерческий банк "Юниаструм Банк"	40202771B	584 528,00
Правительство г.Москвы	RU32044MOS0	21 118,08
Правительство Московской области	RU34005MOO0	248 252,22
Правительство Московской области	RU25004MOO	398 003,76
Правительство Новосибирской области	RU34013ANO0	84 542,40
Республика КОМИ	RU35008KOM0	50 767,20
Республика КОМИ	RU35007KOM0	81 250,05
Ханты-Мансийский автономный округ	RU25005HMN	55 478,20
Чувашская республика	RU31005CHU0	40 807,00
Ярославская область	RU34007YRS0	397 443,52
Ярославская область	RU31004YRS0	209 650,56
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		12 748 822,41

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	26 759 485,05

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

1 036 075 360,41 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.

Генеральный директор	Ляшедько А.Л.
(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)	(подпись) (И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	117-28091F022		
Дата и время отправки	15.01.2008 8:17:17	Дата и время приёма	15.01.2008 8:53:47
Подписано	1. Ляшедько Антон Леонидович [CN=048050117-04, OU=External Users, O=JSC Vneshtorgbank, ST=MSK, C=RU] 2. Лукоянов Владимир Александрович [CN=048050000-01, OU=External Users, O=JSC Vneshtorgbank, ST=MSK, C=RU]		