

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.06.2012 г.**

Пенсионный Фонд Российской Федерации, 7706016118/770601001

(полное наименование, ИНН/КПП учредителя управления)

**Общество с ограниченной ответственностью `Управляющая компания `ОТКРЫТИЕ` Д.У.
средствами пенсионных накоплений, 7705394773/775001001**

(полное фирменное наименование, ИНН/КПП управляющей компании)

Дата и номер договора доверительного управления: от 08.10.2003 №22-03У062

Дата и время составления расчёта: 01.07.2012 12:00:00

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 Банк "ОТКРЫТИЕ"	01.09.2010	73-538ДУ	40701810373000000538	11 638 278,23
Итого денежных средств на счетах				11 638 278,23

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
Номос-Банк ОАО	29.12.2011	Д1111-11	42005810900004000007	20 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				20 000 000,00	

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
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
Субфедеральная бумага	Администрация Самарской области	RU35007SAM0	974,6000000	19 950,00	19 443 270,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Субфедеральная бумага	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	400,2000000	450,00	180 090,00	-
Субфедеральная бумага	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	700,7000000	2 000,00	1 401 400,00	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					21 024 760,00	

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
Банк Зенит ОАО	4B020703255B	992,7000000	8 000,00	7 941 600,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Интеза, ЗАО	40302216B	998,1000000	7 000,00	6 986 700,00	-
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020202289B	995,7000000	4 000,00	3 982 800,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020102289B	1 010,4000000	4 751,00	4 800 410,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	997,2000000	8 000,00	7 977 600,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Буровая компания "Евразия", ООО	4-01-36403-R	977,2000000	900,00	879 480,00	-
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	990,7000000	4 135,00	4 096 544,50	-
ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	981,5000000	4 086,00	4 010 409,00	-
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	959,7000000	4 460,00	4 280 262,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Кредит Европа Банк, ЗАО	4B020103311B	979,5000000	8 000,00	7 836 000,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	995,0000000	190,00	189 050,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"

Мечел ОАО	4-05-55005-E	1 006,0000000	1 088,00	1 094 528,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	998,9000000	6 000,00	5 993 400,00	-
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	998,2000000	412,00	411 258,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
МТС ОАО	4-07-04715-A	968,9000000	5 900,00	5 716 510,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОАО "Вымпелком "	4-04-00027-A	971,9000000	2 556,00	2 484 176,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОТП Банк, ОАО	40202766B	954,0000000	7 352,00	7 013 808,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	936,7000000	4 000,00	3 746 800,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020203251B	996,4000000	8 700,00	8 668 680,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Промсвязьбанк ОАО АКБ	40403251B	985,4000000	872,00	859 268,80	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Татфондбанк АИКБ ОАО	4B020103058B	1 001,3000000	2 500,00	2 503 250,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Транснефть АК ОАО	4-03-00206-A	1 083,2000000	4 483,00	4 855 985,60	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				96 328 521,10	

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
ИНТЕР РАО ЕЭС ОАО	обыкновенная	1-03-33498-E	0,0277700	262 900 000,00	7 300 733,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ЛУКОЙЛ НК ОАО	обыкновенная	1-01-00077-A	1 797,9000000	14 900,00	26 788 710,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Мечел ОАО	обыкновенная	1-01-55005-E	200,3000000	53 537,00	10 723 461,10	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
МТС ОАО	обыкновенная	1-01-04715-A	231,5200000	53 790,00	12 453 460,80	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
НОВАТЭК ОАО	обыкновенная	1-02-00268-E	320,9300000	35 920,00	11 527 805,60	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Ростелеком ОАО	обыкновенная	1-01-00124-A	116,0800000	43 090,00	5 001 887,20	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Ростелеком ОАО	привилегированная	2-01-00124-A	81,2900000	56 300,00	4 576 627,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
РусГидро ОАО	обыкновенная	1-01-55038-E	0,7835000	12 934 000,00	10 133 789,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
СБЕРБАНК РОССИИ ОАО	обыкновенная	10301481B	85,4400000	315 000,00	26 913 600,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Татнефть ОАО	обыкновенная	1-03-00161-A	178,6200000	75 480,00	13 482 237,60	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Уралкалий ОАО	обыкновенная	1-01-00296-A	245,7200000	51 490,00	12 652 122,80	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Холдинг МРСК	обыкновенная	1-01-55385-E	1,7540000	2 008 000,00	3 522 032,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Итого рыночная стоимость акций российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ					145 076 466,10	

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
АЛОР ИНВЕСТ ЗАО	111 586,84
Итого средств на специальных брокерских счетах	111 586,84

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Администрация Самарской области	RU35007SAM0	98 154,00
Банк Зенит ОАО	4B020703255B	159 280,00
Банк Интеза, ЗАО	40302216B	139 790,00
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020102289B	71 597,57
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020202289B	93 680,00
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	160 320,00
Буровая компания "Евразия", ООО	4-01-36403-R	38 313,00
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	16 953,50

ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	75 100,68
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	116 093,80
Кредит Европа Банк, ЗАО	4B020103311B	113 600,00
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	4 723,40
Мечел ОАО	4-05-55005-E	27 569,92
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	261 900,00
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	6 863,92
МТС ОАО	4-07-04715-A	64 664,00
ОАО "Вымпелком "	4-04-00027-A	63 209,88
ОТП Банк, ОАО	40202766B	157 847,44
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	131 560,00
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	3 096,00
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	21 540,00
Промсвязьбанк ОАО АКБ	40403251B	2 363,12
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020203251B	269 004,00
Татфондбанк АИКБ ОАО	4B020103058B	119 575,00
Транснефть АК ОАО	4-03-00206-A	344 070,25
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		2 560 869,48

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	
	2 672 456,32

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

296 740 481,75 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.

Начальник Управления внутреннего учета

Авакян А.А.

(Наименование должности уполномоченного лица управляющей компании)

(подпись)

(И.О. Фамилия)

М.П.

Принято по СЭД с адреса			
Исходящий рег. номер	VTB00154-177320F022		
Дата и время отправки	02.07.2012 20:42:00	Дата и время приёма	
Подписано	1. Рудоманенко Денис Юрьевич, дата и время ЭЦП 02.07.2012 16:41:57 GMT [CN=048050154-04,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		