

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 30.09.2011 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: 01.10.2011 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	612 574,93
Итого денежных средств на счетах				612 574,93

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
Субфедеральная бумага	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	803,2000000	450,00	361 440,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Субфедеральная бумага	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	810,0800000	2 000,00	1 620 160,00	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 981 600,00	

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
Акционерный коммерческий банк содействия коммерции и бизнесу ОАО	4B020300705B	998,8000000	8 000,00	7 990 400,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк ВТБ ОАО	40501000B	998,9000000	1 000,00	998 900,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Зенит ОАО	40303255B	1 001,2000000	1 060,00	1 061 272,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Зенит ОАО	4B020603255B	984,0000000	6 994,00	6 882 096,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Зенит ОАО	40703255B	1 007,1000000	2 000,00	2 014 200,00	-
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	993,7000000	8 000,00	7 949 600,00	-
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	1 016,2000000	4 135,00	4 201 987,00	-
ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	1 021,3000000	4 140,00	4 228 182,00	-
Газпром нефть ОАО	4-03-00146-A	1 069,3000000	9,00	9 623,70	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Гражданские самолеты Сухого ЗАО	4B02-03-21927-H	999,6000000	9 000,00	8 996 400,00	-
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	985,2000000	4 460,00	4 393 992,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	1 010,0000000	190,00	191 900,00	-
Мастер-Банк ОАО КБ	40302176B	600,7200000	3 700,00	2 222 664,00	-

МДМ Банк ОАО	4B020200323B	987,7000000	6 811,00	6 727 224,70	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Мечел ОАО	4-05-55005-E	1 039,8000000	1 088,00	1 131 302,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Мечел ОАО	4B02-03-55005-E	1 025,3000000	2 000,00	2 050 600,00	-
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	1 001,2000000	6 000,00	6 007 200,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	971,0000000	412,00	400 052,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
МТС ОАО	4-05-04715-A	1 053,9000000	7 286,00	7 678 715,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Открытого акционерного общества "Санкт-Петербург Телеком"	4-02-00740-D	992,3000000	5 000,00	4 961 500,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	975,4000000	4 000,00	3 901 600,00	-
ОТП Банк, ОАО	40202766B	985,2000000	7 351,00	7 242 205,20	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020303251B	1 005,4000000	6 660,00	6 695 964,00	-
РВК-Финанс ООО	4-03-36320-R	999,9000000	15 090,00	15 088 491,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Российские Железные Дороги ОАО	4-15-65045-D	1 042,3000000	5 000,00	5 211 500,00	-
Ростелеком ОАО	4-09-00124-A	1 010,1000000	330,00	333 333,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Транснефть АК ОАО	4-03-00206-A	1 104,7000000	6 012,00	6 641 456,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				125 212 360,80	

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	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	78 488 127,38
Итого средств на специальных брокерских счетах	78 488 127,38

Дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		
Наименование эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска (дополнительного выпуска)	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2	3
Акционерный коммерческий банк содействия коммерции и бизнесу ОАО	4B020300705B	244 640,00
Банк ВТБ ОАО	40501000B	15 580,00
Банк Зенит ОАО	40703255B	38 140,00
Банк Зенит ОАО	40303255B	33 400,60
Банк Зенит ОАО	4B020603255B	176 458,62
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	5 040,00
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	106 683,00
ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	163 861,20
Газпром нефть ОАО	4-03-00146-A	265,50
Гражданские самолеты Сухого ЗАО	4B02-03-21927-H	319 410,00
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	9 276,80
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	773,30
Мастер-Банк ОАО КБ	40302176B	58 867,00
МДМ Банк ОАО	4B020200323B	10 625,16
Мечел ОАО	4-05-55005-E	27 200,00
Мечел ОАО	4B02-03-55005-E	83 340,00
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	127 260,00
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	15 169,84
МТС ОАО	4-05-04715-A	187 760,22
Открытого акционерного общества "Санкт-Петербург Телеком"	4-02-00740-D	112 750,00
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	51 400,00
ОТП Банк, ОАО	40202766B	4 998,68
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	6 115,50
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	24 280,00
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020303251B	81 585,00
РВК-Финанс ООО	4-03-36320-R	509 740,20

Российские Железные Дороги ОАО	4-15-65045-D	136 650,00
Ростелеком ОАО	4-09-00124-A	8 533,80
Транснефть АК ОАО	4-03-00206-A	593 564,76
Транснефть АК ОАО	4-03-00206-A	3 366,72
Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям		3 156 735,90

Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	81 644 863,28

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

209 451 399,01 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	operedo@odk.ru		
Исходящий рег. номер	VTB00154-131031F022		
Дата и время отправки	04.10.2011 10:53:54	Дата и время приёма	04.10.2011 11:14:43
Подписано	1. Рудоманенко Денис Юрьевич, дата и время ЭЦП 03.10.2011 12:04:55 GMT [CN=048050154-04,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 04.10.2011 6:51:30 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		