

**Расчёт
рыночной стоимости активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений,
по состоянию на 31.12.2011 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: 01.01.2012 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	24 951 615,70
Итого денежных средств на счетах				24 951 615,70

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 ЗАО	29.12.2011	Д1110-11	42005810600004000006	20 000 000,00	0,00
Номос-Банк ЗАО	29.12.2011	Д1111-11	42005810900004000007	20 000 000,00	0,00
Итого денежных средств в депозитах (включая начисленные проценты)				40 000 000,00	

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	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	600,2400000	450,00	270 108,00	-
Субфедеральная бумага	Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	693,9100000	2 000,00	1 387 820,00	-
Итого рыночная стоимость государственных ценных бумаг субъектов Российской Федерации					1 657 928,00	

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	1 000,0000000	3 480,00	3 480 000,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Зенит ОАО	4B020603255B	987,5000000	6 994,00	6 906 575,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Зенит ОАО	40703255B	997,2000000	2 000,00	1 994 400,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020102289B	1 009,9000000	9 689,00	9 784 921,10	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	998,4000000	8 000,00	7 987 200,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	990,7000000	4 135,00	4 096 544,50	-
ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	978,6000000	4 086,00	3 998 559,60	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Гражданские самолеты Сухого ЗАО	4B02-03-21927-H	982,9000000	9 000,00	8 846 100,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	972,5000000	4 460,00	4 337 350,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Кредит Европа Банк, ЗАО	4B020103311B	995,0000000	8 000,00	7 960 000,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	996,8000000	190,00	189 392,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"

Мечел ОАО	4-05-55005-E	1 024,6000000	1 088,00	1 114 764,80	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Мечел ОАО	4B02-03-55005-E	1 019,9000000	2 000,00	2 039 800,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	1 009,4000000	6 000,00	6 056 400,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	986,2000000	412,00	406 314,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Открытого акционерного общества "Санкт-Петербург Телеком"	4-02-00740-D	938,2000000	6 600,00	6 192 120,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	936,3000000	4 000,00	3 745 200,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
ОТП Банк, ОАО	40202766B	981,2000000	7 352,00	7 213 782,40	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020303251B	988,9000000	11 660,00	11 530 574,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Промсвязьбанк ОАО АКБ	40403251B	983,5000000	872,00	857 612,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
РВК-Финанс ООО	4-03-36320-R	992,6000000	15 090,00	14 978 334,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Российские Железные Дороги ОАО	4-15-65045-D	1 021,3000000	5 000,00	5 106 500,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Ростелеком ОАО	4-09-00124-A	994,2000000	330,00	328 086,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Татфондбанк АИКБ ОАО	4B020103058B	991,1000000	2 500,00	2 477 750,00	ЗАО "Фондовая биржа ММВБ"
Итого рыночная стоимость облигаций российских хозяйственных обществ				121 628 279,80	

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	42 841 235,42
Итого средств на специальных брокерских счетах	42 841 235,42

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	27 909,60
Банк Зенит ОАО	40703255B	78 460,00
Банк Зенит ОАО	4B020603255B	48 608,30
Банк Русский Стандарт ЗАО	4B020102289B	146 013,23
БНП ПАРИБА Банк, ЗАО	40103407B	160 320,00
Водоканал-Финанс ООО	4-01-36398-R	16 953,50
ВЭБ-Лизинг ОАО	4-04-43801-H	75 100,68
Гражданские самолеты Сухого ЗАО	4B02-03-21927-H	136 260,00
Группа ЛСР ОАО	4B02-03-55234-E	116 093,80
Кредит Европа Банк, ЗАО	4B020103311B	115 360,00
Магнит ОАО	4B02-04-60525-P	4 723,40
Мечел ОАО	4-05-55005-E	27 569,92
Мечел ОАО	4B02-03-55005-E	35 260,00
Минерально-химическая компания "ЕвроХим", ОАО	4-02-31153-H	261 900,00
Московский Кредитный Банк ОАО	4B020401978B	6 954,56
Открытого акционерного общества "Санкт-Петербург Телеком"	4-02-00740-D	12 144,00
ОТП Банк, ОАО	40202766B	157 847,44
ОТП Банк, ОАО	4B020102766B	131 560,00
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35001RSY0	4 644,00
Правительство республика Саха (Якутия)	RU35002RSY0	21 540,00
Промсвязьбанк ОАО АКБ	40403251B	2 363,12
Промсвязьбанк ОАО АКБ	4B020303251B	395 623,80
РВК-Финанс ООО	4-03-36320-R	174 893,10
Российские Железные Дороги ОАО	4-15-65045-D	7 100,00
Ростелеком ОАО	4-09-00124-A	2 184,60
Татфондбанк АИКБ ОАО	4B020103058B	1 300,00

Итого дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по облигациям	2 168 687,05
Прочая дебиторская задолженность	
Наименование дебиторской задолженности	Сумма дебиторской задолженности (руб.)
1	2
Итого прочая дебиторская задолженность	0,00
Итого дебиторская задолженность (руб.)	45 009 922,47

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

233 247 745,97 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	VTB00154-147484F022		
Дата и время отправки	23.01.2012 16:07:07	Дата и время приёма	23.01.2012 16:25:15
Подписано	1. Рудоманенко Денис Юрьевич, дата и время ЭЦП 11.01.2012 13:22:12 GMT [CN=048050154-04,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна 2. Лукоянов Владимир Александрович, дата и время ЭЦП 23.01.2012 12:03:47 GMT [CN=048050000-01,OU=External Users,O=JSC Vneshtorgbank,ST=MSK,C=RU] ЭЦП верна		