

# КАПИТАЛЪ

УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ

## Расчет стоимости инвестиционного портфеля за 30 сентября 2006 года

### Общество с ограниченной ответственностью "Управляющая компания "КапиталЪ". (Д.У. Средствами пенсионных накоплений для финансирования накопительной части трудовой пенсии)

(полное фирменное наименование управляющей компании)

Даты и номер договора доверительного управления

08.10.2003 г. №22-03У019

Наименование инвестиционного портфеля: ПФР-накопления-КапиталЪ УК ООО - Портфель по умолчанию

Дата и время составления отчета

03.10.2006 г. 17:43:23

Вид имущества	Код стр.	Оценка на текущую отчетную дату (рублей)	Оценка на начало отчетного года (рублей)	Доля от рыночной стоимости инвестиционного портфеля
1	2	3	4	5
Денежные средства на счетах в кредитных организациях	010	30 200 772,31	22 402 637,54	5,5484%
в том числе в иностранной валюте	011	0,00	0,00	0,0000%
Депозиты в рублях в кредитных организациях	020	0,00	15 000 000,00	0,0000%
Государственные ценные бумаги Российской Федерации	030	89 108 527,00	153 026 778,00	16,3708%
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	031	0,00	0,00	0,0000%
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	040	216 851 479,20	155 946 798,38	39,8394%
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	041	0,00	0,00	0,0000%
Облигации муниципальных образований	050	0,00	0,00	0,0000%
Облигации российских хозяйственных обществ	060	133 301 890,00	165 188 741,40	24,4899%
в том числе обязательства по которым выражены в иностранной валюте	061	0,00	0,00	0,0000%
Акции российских эмитентов, созданных в форме открытых акционерных обществ	070	9 335 802,57	43 562 283,40	1,7151%
Паи (акции, доли) индексных инвестиционных фондов, размещающих средства в государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации и акции иностранных эмитентов	080	0,00	0,00	0,0000%
Ипотечные ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах	090	0,00	0,00	0,0000%
в том числе обеспеченные государственной гарантией Российской Федерации	091	0,00	0,00	0,0000%
Дебиторская задолженность, в том числе	100	65 516 192,85	17 345 109,25	12,0365%
средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	101	58 257 285,79	7 618 446,12	10,7029%
дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по ценным бумагам	102	7 258 907,06	9 726 663,13	1,3336%
прочая дебиторская задолженность	103	0,00	0,00	0,0000%
Прочие активы	110	0,00	0,00	0,0000%
ИТОГО рыночная стоимость инвестиционного портфеля: (строки 010 + 020 + 030 + 040 + 050 + 060 + 070 + 080+090+100+110)	120	544 314 663,93	572 472 347,97	100,0000%