



ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО

**УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ
БАНКА МОСКВЫ**

123001, г. Москва, Трехпрудный переулок, д. 9, стр.1.

Приложение к Справке о стоимости чистых активов ЗАО «УК Банка Москвы» Д.У. ПИФ «Волхонка – российские облигации» по состоянию на 30 июня 2010 года

**Пояснительная записка
к финансовой документации по открытому паевому инвестиционному фонду облигаций
«Волхонка – фонд облигаций» под управлением ЗАО «УК Банка Москвы»**

Составлена по состоянию на 30 июня 2010 года 20 часов–00 минут

Порядок оценки активов и обязательств, а также порядок расчета стоимости чистых активов осуществляется в соответствии с требованиями нормативных документов ФСФР (ФКЦБ), а также учетной политикой ПИФ «Волхонка – фонд облигаций» и Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов, расчетной стоимости инвестиционного пая ПИФ «Волхонка – фонд облигаций» под управлением ЗАО «УК Банка Москвы» на 2010 год.

Стоимость чистых активов определяется как стоимость имущества фонда за вычетом суммы обязательств фонда, включающих в себя кредиторскую задолженность и резервы предстоящих расходов.

Выручка от продажи ценных бумаг определяется исходя из фактической цены реализации имущества. Расходы, связанные с продажей ценных бумаг, определяются исходя из балансовой стоимости ценных бумаг без проведения переоценки.

Расчетная стоимость одного пая определяется ежедневно, путем деления стоимости чистых активов на общее количество паев фонда.

За 2-й квартал 2010 год фактов ошибок, приведших к изменению стоимости инвестиционного пая на 0,5 и более процентов, не выявлено.

За 2-й квартал 2010 год не было существенных (на 10 и более процентов) изменений признаваемых котировок ценных бумаг, составляющих активы ПИФ «Волхонка - фонд облигаций» на начало и конец отчетного квартала (в случае продажи в отчетном квартале ценных бумаг, входящих в имущество фонда на начало отчетного квартала, расчет осуществляется по котировкам, предшествующим дню выбытия).

Забалансовых рисков по ПИФ «Волхонка – фонд облигаций» не возникало, в виду отсутствия активов, обремененных залогом, а так же отсутствия операций с опционами, фьючерсными и форвардными контрактами.

Иных событий и сведений, способных существенно повлиять на расчетную стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда, нет.

Генеральный директор

Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер

И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО «ПРСД



СПРАВКА
о стоимости чистых активов открытого паевого инвестиционного фонда облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"

30 Июнь, 2010

Управляющая компания: Закрытое акционерное общество "Управляющая компания Банка Москвы"

Лицензия Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 04 февраля 1997 года.

Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

Юридический адрес: 123001, г. Москва, Трехпрудный переулок, д. 9, стр.1.

Время определения стоимости чистых активов: 20:00 московского времени

рублей

Вид имущества	Код стр.	Сумма (оценочная стоимость) на 30.06.2010	Сумма (оценочная стоимость) на 29.06.2010
1	2	3	4
АКТИВЫ:			
Денежные средства на счетах - всего, в том числе:	010	3 944 747,05	3 930 949,87
- в рублях	011	3 944 747,05	3 930 949,87
- в иностранной валюте	012	0,00	0,00
Денежные средства во вкладах - всего, в т.ч.	020	13 000 000,00	13 000 000,00
- в рублях	021	13 000 000,00	13 000 000,00
- в иностранной валюте	022	0,00	0,00
Государственные ценные бумаги РФ	030	0,00	0,00
Государственные ценные бумаги субъектов РФ	040	0,00	0,00
Муниципальные ценные бумаги	050	0,00	0,00
Облигации российских хозяйственных обществ (кроме облигаций с ипотечным покрытием)	060	37 093 795,57	33 919 451,32
Акции российских акционерных обществ	070	0,00	0,00
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	080	0,00	0,00
Ипотечные ценные бумаги - всего, в т.ч.	090	0,00	0,00
- облигации с ипотечным покрытием	091	0,00	0,00
- ипотечные сертификаты участия	092	0,00	0,00
Векселя, выданные российскими хозяйственными обществами	100	0,00	0,00
Ценные бумаги иностранных эмитентов - всего, в т.ч.	110	0,00	0,00
- ценные бумаги иностранных государств	111	0,00	0,00
- ценные бумаги международных финансовых организаций	112	0,00	0,00
- акции иностранных акционерных обществ	113	0,00	0,00
- облигации иностранных коммерческих организаций	114	0,00	0,00
Закладные	120	0,00	0,00
Денежные требования по обеспеченным ипотекой обязательствам из кредитных договоров и прав залогодержателя по договорам об ипотеке (за исключением удостоверенных закладными)	130	0,00	0,00
Денежные требования по обеспеченным ипотекой обязательствам из кредитных договоров или договоров займа, по которым кредиты (займы) предоставлены для уплаты цены по договорам участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества и права залогодержателя по договорам залога имущественных прав по указанным договорам	140	0,00	0,00
Доли в российских обществах с ограниченной ответственностью	150	0,00	0,00
Недвижимое имущество, находящееся на территории РФ - всего, в т.ч.	160	0,00	0,00
- объекты незавершенного строительства	161	0,00	0,00
Недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств - всего, в т.ч.	170	0,00	0,00
- объекты незавершенного строительства	171	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории РФ - всего, в т.ч.	180	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	181	0,00	0,00
Имущественные права на недвижимое имущество, находящееся на территории иностранных государств - всего, в т.ч.	190	0,00	0,00
- право аренды недвижимого имущества	191	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам договоров участия в долевом строительстве недвижимого имущества.	200	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из инвестиционных договоров	210	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется строительство (создание) объектов недвижимости на земельном участке, составляющем активы паевого инвестиционного фонда	220	0,00	0,00
Имущественные права по обязательствам из договоров, на основании которых осуществляется реконструкция объектов недвижимости, составляющем активы паевого инвестиционного фонда	230	0,00	0,00
Проектно-сметная документация	240	0,00	0,00
Иное имущество	250	0,00	0,00
Дебиторская задолженность, в т.ч.	260	890 365,18	4 116 950,53
средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг	261	6 340,51	3 141 340,89
дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	262	0,00	0,00
дебиторская задолженность по процентному (купонному доходу) по денежным средствам на счетах и во вкладах, а также по ценным бумагам	263	884 024,67	975 609,64
прочая дебиторская задолженность	264	0,00	0,00
ИТОГО СУММА АКТИВОВ (стр. 010+ 020+ 030+ 040+ 050+ 060+ 070+ 080+ 090+ 100+ 110+ 120+ 130+ 140+ 150+ 160+ 170+ 180+ 190+ 200+ 210+ 220+ 230+240+250+260)	270	54 928 907,80	54 967 351,72
ОБЯЗАТЕЛЬСТВА:			
Кредиторская задолженность	300	60 457,59	60 433,94
Резерв предстоящих расходов на выплату вознаграждения	310	234 331,58	231 785,07
Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением открытым паевым инвестиционным фондом	320	0,00	0,00
ИТОГО СУММА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ (стр.300+310+320)	330	294 789,17	292 219,01
ИТОГО СТОИМОСТЬ ЧИСТЫХ АКТИВОВ (стр.270-330)	400	54 634 118,63	54 675 132,71
Количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда - штук	500	57 333,54856	57 437,17701
РАСЧЕТНАЯ СТОИМОСТЬ ПАЯ (стр.400/500)	600	952,92	951,91

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



СПРАВКА
о стоимости активов открытого паевого инвестиционного фонда облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"
30 Июнь, 2010

Управляющая компания: ЗАО "УК Банка Москвы"

Лицензия ФКЦБ России на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 0.
Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

Вид имущества	Код стр.	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс. руб)	Доля от общей стоимости активов (%)	Доля от общего количества размещенных ценных бумаг	Дата погашения облигаций
	2	3	4	5	6
АКТИВЫ:					
Денежные средства, всего	100	3 944,75	7,18		
в рублях	110	3 944,75	7,18		
ОАО "Банк Москвы"		3 944,75	7,18		
в иностранной валюте	120	0,00	0,00		
Денежные средства в банковских вкладах, всего	200	13 000,00	23,67		
в рублях	210	13 000,00	23,67		
<i>ОАО "Банк Москвы", счет для зачисления №42006810200760000015</i>		<i>13 000,00</i>	<i>23,67</i>		<i>03.07.2011</i>
в иностранной валюте	220	0,00	0,00		
Ценные бумаги, имеющие признаваемую котировку, в т.ч.	300	36 093,60	65,71		
ценные бумаги российских эмитентов, включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг:	310	25 867,80	47,09		
гос. ценные бумаги РФ	311	0,00	0,00		
гос. ценные бумаги субъектов РФ	312	0,00	0,00		
муниципальные ценные бумаги	313	0,00	0,00		
облигации рос. хоз. обществ	314	25 867,80	47,09		
<i>НЛМК БО-5 № гос. рег.: 4В02-05-00102-А</i>		<i>6 471,60</i>	<i>11,78</i>		<i>30.10.2012</i>
<i>Аэрофл БО1 № гос. рег.: 4В02-01-00010-А</i>		<i>5 031,50</i>	<i>9,16</i>		<i>08.04.2013</i>
<i>Мосэнерго1 № гос. рег.: 4-02-00085-А</i>		<i>3 539,58</i>	<i>6,44</i>		<i>13.09.2011</i>
<i>СибТлк-6об № гос. рег.: 4-06-00195-А</i>		<i>2 014,40</i>	<i>3,67</i>		<i>16.09.2010</i>
<i>СибТлк-8об № гос. рег.: 4-08-00195-А</i>		<i>1 992,32</i>	<i>3,63</i>		<i>08.08.2013</i>
<i>Система-02 № гос. рег.: 4-02-01669-А</i>		<i>6 818,40</i>	<i>12,41</i>		<i>12.08.2014</i>
обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ	315	0,00	0,00		
обыкновенные акции акционерных инвестиционных	316	0,00	0,00		
привилегированные акции ОАО	317	0,00	0,00		
инвестиционные паи ПИФ	318	0,00	0,00		
ценные бумаги российских эмитентов, не включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг	320	10 225,80	18,62		
государственные ценные бумаги	321	0,00	0,00		
гос. ценные бумаги субъектов РФ	322	0,00	0,00		
муниципальные ценные бумаги РФ	323	0,00	0,00		
облигации рос.хоз. обществ	324	10 225,80	18,62		

<i>ВТБ БО2 № гос. рег.: 4В020201000В</i>		<i>3 125,00</i>	<i>5,69</i>		<i>15.03.2013</i>
<i>ГазпрнфБО5 № гос. рег.: 4В02-05-00146-А</i>		<i>4 987,50</i>	<i>9,08</i>		<i>09.04.2013</i>
<i>ВТБ-ЛизФ01 № гос. рег.: 4-01-36292-Р</i>		<i>2 113,30</i>	<i>3,85</i>		<i>06.11.2014</i>
<i>обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ</i>	325	0,00	0,00		
<i>обыкновенные акции акционерных инвестиционных</i>	326	0,00	0,00		
<i>привилегированные акции ОАО</i>	327	0,00	0,00		
<i>обыкновенные акции ЗАО</i>	328	0,00	0,00		
<i>инвестиционные паи ПИФ</i>	329	0,00	0,00		
Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	400	1 000,20	1,82		
<i>гос. ценные бумаги РФ</i>	410	0,00	0,00		
<i>гос. ценные бумаги субъектов РФ</i>	420	0,00	0,00		
<i>муниципальные ценные бумаги РФ</i>	430	0,00	0,00		
<i>облигации росс.хоз. обществ</i>	440	1 000,20	1,82		
<i>УрСИ сер08 № гос. рег.: 4-11-00175-А</i>		<i>1 000,20</i>	<i>1,82</i>		<i>03.04.2013</i>
<i>обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ</i>	450	0,00	0,00		
<i>обыкновенные акции АИФ</i>	460	0,00	0,00		
<i>привилегированные акции ОАО</i>	470	0,00	0,00		
<i>обыкновенные акции ЗАО</i>	480	0,00	0,00		
<i>инвестиционные паи ПИФ</i>	490	0,00	0,00		
<i>векселя</i>	491	0,00	0,00		
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	500	0,00	0,00		
<i>ценные бумаги иностранных государств</i>	510	0,00	0,00		
<i>ценные бумаги международных финансовых организаций</i>	520	0,00	0,00		
<i>облигации иностранных коммерческих организаций</i>	530	0,00	0,00		
<i>акции иностранных АО</i>	540	0,00	0,00		
Доля в уставных капиталах российских ООО	600	0,00	0,00		
Недвижимое имущество	700	0,00	0,00		
Имущественные права на недвижимое имущество	800	0,00	0,00		
Строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	900	0,00	0,00		
Проектно-сметная документация	1000	0,00	0,00		
Иные доходные вложения в материальные ценности	1100	0,00	0,00		
Дебиторская задолженность, в т.ч.	1200	890,37	1,62		
<i>средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг</i>	1210	6,34	0,01		
<i>ОАО "Банк Москвы"</i>		6,34	0,01		
<i>дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества</i>	1220	0,00	0,00		
<i>дебиторская задолженность по процентному (купонному доходу) по банковским вкладам и ценным бумагам</i>	1230	884,02	1,61		
<i>прочая дебиторская задолженность</i>	1240	0,00	0,00		
ИТОГО АКТИВОВ:	1300	54 928,91	100,00		

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



БАЛАНС ИМУЩЕСТВА
составляющего открытый паевой инвестиционный фонд облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"

30 Июнь, 2010

Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

тыс. рублей

Имущество (обязательства)	Код стр.	31.12.2009	30.06.2010
1	2	3	4
Имущество, составляющее паевой инвестиционный фонд			
Денежные средства на банковских счетах, всего	10	1 482,95	3 944,75
в рублях	11	1 482,95	3 944,75
в ОАО "Банк Москвы"			3 944,75
в иностранной валюте	12	0,00	0,00
Денежные средства в банковских вкладах в т.ч.	20	8 200,00	13 000,00
в рублях	21	8 200,00	13 000,00
Депозитный договор №31-076/07/704-09 от 29.12.09г., срок действия до 03.07.2011г.		8 200,00	13 000,00
в иностранной валюте	22	0,00	0,00
Ценные бумаги российских эмитентов, имеющие признаваемую котировку, всего	30	45 435,02	36 093,60
акции, в т.ч. более 5%	31	0,00	0,00
облигаций, в т.ч. более 5% :	32	45 435,02	36 093,60
сроком погашения до 1 года:		0,00	0,00
сроком погашения от 1 года до 3-х лет:		0,00	19 615,60
Аэрофл БО1 № гос. рег.: 4B02-01-00010-A			5 031,50
ВТБ БО2 № гос. рег.: 4B020201000B			3 125,00
Газпром БО5 № гос. рег.: 4B02-05-00146-A			4 987,50
НЛМК БО-5 № гос. рег.: 4B02-05-00102-A			6 471,60
сроком погашения свыше 3-х лет:		45 435,02	16 478,00
Газпром А4 № гос. рег.: 4-04-00028-A		4 519,35	
РЖД-09обл № гос. рег.: 4-09-65045-D		5 122,00	
ЛукойлЗобл № гос. рег.: 4-03-00077-A		5 889,60	
ВК-Инвест1 № гос. рег.: 4-01-36281-R		4 006,00	
ВТБ-6 об № гос. рег.: 40501000B		3 032,60	
МОЭК-01 № гос. рег.: 4-01-55039-E		5 037,50	
МТС 01 № гос. рег.: 4-01-04715-A		6 756,86	
Система-01 № гос. рег.: 4-01-01669-A		5 896,45	
Система-02 № гос. рег.: 4-02-01669-A			6 818,40
Мосэнерго1 № гос. рег.: 4-02-00085-A			3 539,58
Ценные бумаги российских эмитентов не имеющие признаваемую котировку, всего	40	2 000,80	1 000,20
акции, в т.ч. более 5%	41	0,00	0,00
облигаций, в т.ч. более 5% :	42	2 000,80	1 000,20
сроком погашения до 1 года:		0,00	0,00
сроком погашения от 1 года до 3-х лет:		0,00	0,00
сроком погашения свыше 3-х лет:		2 000,80	1 000,20
векселя	43	0,00	0,00
иные ценные бумаги	44	0,00	0,00
Дебиторская задолженность, в т.ч.	50	2 972,50	890,37
средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг	51	1 538,50	6,34
дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	52	0,00	0,00
дебиторская задолженность по процентному (купонному доходу) по банковским вкладам и ценным бумагам	53	1 434,01	884,02
прочая дебиторская задолженность	54	0,00	0,00
Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	60	0,00	0,00
Ценные бумаги иностранных эмитентов, в т.ч.	70	0,00	0,00
ценные бумаги иностранных государств	71	0,00	0,00
ценные бумаги международных финансовых организаций	72	0,00	0,00
акции иностранных АО	73	0,00	0,00
облигации иностранных коммерческих организаций	74	0,00	0,00
Доли в российских ООО	80	0,00	0,00
Вложения в материальные ценности в т.ч.	90	0,00	0,00
объекты недвижимого имущества, кроме строящихся и реконструируемых объектов	91	0,00	0,00
строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	92	0,00	0,00
имущественные права на недвижимое имущество	93	0,00	0,00
проектно-сметная документация	94	0,00	0,00
ИТОГО ИМУЩЕСТВО:	100	60 091,28	54 928,91
(стр.10+20+30+40+50+60+70+80+90)			
Обязательства, исполнение которых осуществляется за счет имущества, составляющего инвестиционный фонд:			
Кредиторская задолженность	110	64,46	60,46
Резервы предстоящих расходов и платежей	120	164,18	234,33
Инвестиционные паи	130	59 862,64	54 634,12
ИТОГО ОБЯЗАТЕЛЬСТВА (стр.110+120+130)	140	60 091,28	54 928,91

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



СПРАВКА
о приросте (об уменьшении) стоимости имущества
открытого паевого инвестиционного фонда облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"

30 Июнь, 2010

Закрытое акционерное общество "Управляющая компания Банка Москвы"

Лицензия ФКЦБ России на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 04 февраля 1997 года

Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

тыс. рублей

Наименование показателя	Код стр.	За отчетный период 01.01.2010 - 30.06.2010	За соответствующий период прошлого года
1	2	3	4
Выручка от продажи ценных бумаг	10	225 661,78	20 785,98
Расходы, связанные с продажей ценных бумаг	20	225 437,28	20 855,84
Результат от продажи ценных бумаг (010 - 020)	30	224,51	-69,86
Выручка от продажи недвижимого имущества или передачи прав на недвижимое имущество	40	0,00	0,00
Расходы, связанные с продажей нед.имущества или передачи имущественных прав на нед.имущество	50	0,00	0,00
Результат от продажи недвижимого имущества или передачи имущественных прав на недвижимое имущество (стр.40-50)	60	0,00	0,00
Выручка от продажи иного имущества	70	0,00	0,00
Расходы связанные с продажей иного имущества	80	0,00	0,00
Результат от продажи иного имущества (стр.70-80)	90	0,00	0,00
Процентный доход по банковским вкладам и ценным бумагам	100	3 392,00	1 094,56
Дивиденды по акциям	110	0,00	0,00
Прирост (уменьшение) средств в иностранной валюте	120	0,00	0,00
Выручка от сдачи недвижимого имущества в аренду	130	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, имеющих признаваемую котировку, всего	140	652,71	-154,00
акции	141	0,00	0,00
облигации	142	652,71	-154,00
инвестиционные паи	143	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, не имеющих признаваемую котировку, всего	150	-17,58	366,59
акции	151	0,00	0,00
облигации	152	-17,58	366,59
векселя	153	0,00	0,00
иные ценные бумаги	154	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости недвижимого имущества или имущественных прав на недвижимое имущество	160	0,00	0,00
Вознаграждение и расходы связанные с управлением Д.У.ПИФ в т.ч	170	615,70	191,11
резерв на выплату вознаграждений	171	604,44	183,12
Прочие доходы	180	164,24	614,95
Прочие расходы	190	0,00	0,00
Прирост имущества ПИФ в результате выдачи инвест.паев	200	237 542,19	71 842,42
Уменьшение имущества ПИФ в результате погашения или обмена инвестиционных паев	210	246 570,88	26 293,87
ИТОГО прирост(+) или уменьшение (-) стоимости имущества (стр. 30+60+90+100+110+120+130+140+150+160+180+200-170-210)	220	-5 228,52	47 209,69

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



**Отчет об изменении стоимости чистых активов
открытого паевого инвестиционного фонда облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"
30 Июнь, 2010**

Лицензия ФКЦБ России на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 04 февраля 1997 года Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

Причина изменения стоимости чистых активов	Код строки	Сумма, рублей
Стоимость чистых активов на 31.12.2009	10	59 862 635,62
Выдача инвестиционных паев	20	5 899 795,06
Погашение инвестиционных паев	30	8 768 718,82
Обмен инвестиционных паев данного фонда на инвестиционные паи другого фонда	40	237 802 156,53
Обмен инвестиционных паев других фондов на инвестиционные паи данного фонда	50	231 642 395,00
Выплата дохода от доверительного управления закрытым паевым фондом	60	0,00
Изменение стоимости чистых активов в результате операций с активами фонда и изменения стоимости имущества фонда	70	3 800 168,30
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода на 30.06.10 (строки 10+20-30-40+50-60+(-)70)	80	54 634 118,63

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



СПРАВКА
о несоблюдении требований к составу и структуре активов
открытого паевого инвестиционного фонда Облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"

30 Июнь, 2010

Закрытое акционерное общество "Управляющая компания Банка Москвы"

Лицензия ФКЦБ России на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми

инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 04 февраля 1997 года

Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

рублей

1. Несоблюдение требований к составу активов

Активы приобретенные с нарушением требований к составу активов	Оценочная стоимость	Доля в стоимости активов	Дата приобретения	отчуждения (предполагаемо)
1	2	3	4	5
-	-	-	-	-

2. Несоблюдение требований к структуре активов

2.1 Несоблюдение ограничений, установленных в % от стоимости активов

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества	Фактическая доля в стоимости активов(%)	Доля стоимости активов в соответствии с инвестиционной декларацией	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7
Денежные средства, находящиеся во вкладах в одной кредитной организации	АКБ "Банк Москвы"	23 000 000,00	25,55%	25,00%	03.06.10	04.06.10
Оценочная стоимость ценных бумаг одного эмитента	АэрофлБО1 № гос. рег.: 4B02-01-00010-A АэрофлБО2 № гос. рег.: 4B02-02-00010-A	10 001 496,50	15,82%	15,00%	11.06.10	16.06.10
Оценочная стоимость ценных бумаг одного эмитента	НЛМК БО-5 № гос. рег.: 4B02-05-00102-A	10 667 000,00	16,88%	15,00%	11.06.10	17.06.10
Оценочная стоимость ценных бумаг одного эмитента	Система-02 № гос. рег.: 4-02-01669-A	11 366 000,00	17,98%	15,00%	11.06.10	18.06.10
Оценочная стоимость ценных бумаг одного эмитента	Мечел-02об № гос. рег.: 4-02-55005-E	10 009 000,00	15,83%	15,00%	11.06.10	21.06.10
Оценочная стоимость ценных бумаг одного эмитента	АэрофлБО1 № гос. рег.: 4B02-01-00010-A АэрофлБО2 № гос. рег.: 4B02-02-00010-A	8 001 487,50	15,34%	15,00%	21.06.10	24.06.10

2.2. Несоблюдение ограничений, установленных в % от количества размещенных (выданных) ценных бумаг

Содержание ограничения	Наименование активов, по которым выявлено нарушение или несоответствие	Сумма ден. средств или стоимость иного имущества	Фактическая доля в стоимости активов(%)	Доля стоимости активов в соответствии с инвестиционной декларацией	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7

Генеральный директор _____ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____



ОТЧЕТ
о владельцах инвестиционных паев
открытого паевого инвестиционного фонда облигаций
"ВОЛХОНКА - фонд облигаций" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"
30 Июнь, 2010

Закрытое акционерное общество "Управляющая компания Банка Москвы"

Лицензия ФКЦБ России на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми

инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00014 от 04 февраля 1997 года

Правила фонда зарегистрированы ФСФР России 26.01.2005 за № 0320-76004058 (в ред. изменений и дополнений от 21.04.2005 за № 0320-76004058-1, от 04.08.2005 за № 0320-76004058-2, от 10.08.2006 за № 0320-76004058-3, от 26.12.2006 за № 0320-76004058-4, от 15.03.2007 г. за № 0320-76004058-5, от 08.05.2007 г. за № 0320-76004058-6, от 04.10.2007 г. за № 0320-76004058-7, от 21.02.2008 г. за № 0320-76004058-8, от 15.10.2009 г. за № 0320-76004058-9, от 02.03.2010 за № 0320-76004058-10, от 22.06.2010 за № 0320-76004058-11)

Наименование показателей	Код стр.	На начало	На отчетную дату
		отчетного года	30.06.2010
1	2	3	4
Количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда, всего	100	66 369,80035	57 333,54856
из них:			
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находятся в Российской Федерации	110	66 015,91891	55 647,13105
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	120	0,00000	1 676,04083
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находятся за пределами Российской Федерации	130	353,88144	10,37668
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находятся за пределами Российской Федерации	140	0,00000	0,00000
находящиеся у номинальных держателей	150	0,00000	0,00000
Количество лицевых счетов в реестре владельцев инвестиционных паев ПИФа, всего	200	1 937	720
из них:			
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находятся в Российской Федерации	210	1 923	709
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	220	5	3
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находятся за пределами Российской Федерации	230	7	6
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находятся за пределами Российской Федерации	240	0	0
лицевых счетов номинальных держателей	250	2	2

Генеральный директор _____ Е.А.Касьянова

Главный бухгалтер _____ И.М. Ушакова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" _____