



ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО

**УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ  
БАНКА МОСКВЫ**

103009, Россия, Москва, Тверская ул., 8/2, стр. 1

*Приложение к Справке о стоимости чистых активов ЗАО «УК Банка Москвы» Д.У. ПИФ «Волхонка – российские облигации» по состоянию на 30 июня 2009 года*

**Пояснительная записка**

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

Составлена по состоянию на 30 июня 2009 года 20 часов–00 минут

Порядок оценки активов и обязательств, а так же порядок расчета стоимости чистых активов осуществляется в соответствии с требованиями нормативных документов ФСФР (ФКЦБ), а так же учетной политикой ПИФ «Волхонка – российские облигации» и Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов, расчетной стоимости инвестиционного пая ПИФ «Волхонка – российские облигации» под управлением ЗАО «УК Банка Москвы» на 2009 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 2009 год фактов ошибок, приведших к изменению стоимости инвестиционного пая на 0,5 и более процентов, не выявлено.

За 2-й квартал 2009 год были существенные (на 10 и более процентов) изменения признаваемых котировок следующих ценных бумаг, составляющих активы ПИФ «Волхонка» 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):

Белон 02	71.37%
ГАЗФин 01	13.14%

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

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

**Генеральный директор**

**Е.А. Касьянова**

**Главный бухгалтер**

**И.К. Корноухова**

**Уполномоченный представитель ЗАО «ПРСД**



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

30 Июнь, 2009

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)

Место нахождения: г. Москва, Кузнецкий мост, д.17 телефон: (495) 925-8000 (д.20-617)

Юридический адрес: 125009, г.Москва, ул.Тверская, д.8/2, стр.1

Время определения стоимости чистых активов: 20-00 московского времени

рублей

Вид имущества	Код стр.	Сумма (оценочная стоимость) на 30.06.2009	Сумма (оценочная стоимость) на 29.06.2009
1	2	3	4
<b>АКТИВЫ:</b>			
<b>Денежные средства на счетах - всего, в том числе:</b>	010	71 346,26	711 485,98
- в рублях	011	71 346,26	711 485,98
- в иностранной валюте	012	0,00	0,00
<b>Денежные средства во вкладах - всего, в т.ч.</b>	020	0,00	0,00
- в рублях	021	0,00	0,00
- в иностранной валюте	022	0,00	0,00
<b>Государственные ценные бумаги РФ</b>	030	0,00	0,00
<b>Государственные ценные бумаги субъектов РФ</b>	040	0,00	0,00
<b>Муниципальные ценные бумаги</b>	050	0,00	0,00
<b>Облигации российских хозяйственных обществ (кроме облигаций с ипотечным покрытием)</b>	060	55 367 318,00	54 203 072,30
<b>Акции российских акционерных обществ</b>	070	0,00	0,00
<b>Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов</b>	080	0,00	0,00
<b>Ипотечные ценные бумаги - всего, в т.ч.</b>	090	0,00	0,00
- облигации с ипотечным покрытием	091	0,00	0,00
- ипотечные сертификаты участия	092	0,00	0,00
<b>Векселя, выданные российскими хозяйственными обществами</b>	100	0,00	0,00
<b>Ценные бумаги иностранных эмитентов - всего, в т.ч.</b>	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
<b>Закладные</b>	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
<b>Иное имущество</b>	250	0,00	0,00
<b>Дебиторская задолженность, в т.ч.</b>	260	7 131 369,42	8 265 203,71
средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг	261	5 809 110,92	7 014 717,15
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	1 322 258,50	1 248 206,56
прочая дебиторская задолженность	264	0,00	2 280,00
<b>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)</b>	270	62 570 033,68	63 179 761,99
<b>ОБЯЗАТЕЛЬСТВА:</b>			
<b>Кредиторская задолженность</b>	300	14 472,98	692 294,32
<b>Резерв предстоящих расходов на выплату вознаграждения</b>	310	75 410,98	72 503,98
<b>Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением открытым паевым инвестиционным фондом</b>	320	0,00	0,00
<b>ИТОГО СУММА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ (стр.300+310+320)</b>	330	89 883,96	764 798,30
<b>ИТОГО СТОИМОСТЬ ЧИСТЫХ АКТИВОВ (стр.270-330)</b>	400	62 480 149,72	62 414 963,69
<b>Количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда - штук</b>	500	75 101,47623	75 052,96356
<b>РАСЧЕТНАЯ СТОИМОСТЬ ПАЯ (стр.400/500)</b>	600	831,94	831,61

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



## СПРАВКА

**о стоимости активов открытого паевого инвестиционного фонда облигаций  
"ВОЛХОНКА - российские облигации" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"  
30 Июнь, 2009****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)

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
<b>АКТИВЫ:</b>					
<b>Денежные средства, всего</b>	100	71,35	0,11		
в рублях в ОАО "Банк Москвы"	110	71,35	0,11		
в иностранной валюте	120	0,00	0,00		
<b>Денежные средства в банковских вкладах, всего</b>	200	0,00	0,00		
в рублях	210	0,00	0,00		
в иностранной валюте	220	0,00	0,00		
<b>Ценные бумаги, имеющие признаваемую котировку, в т.ч.</b>	300	52 005,07	83,11		
ценные бумаги российских эмитентов, включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг:	310	38 694,83	61,84		
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 росс. хоз. обществ	314	38 694,83	61,84		
<i>ЦентрТел-4 № гос. рег.: 4-19-00194-А</i>		6 018,60	9,62		21.08.2009
<i>РЖД-09обл № гос. рег.: 4-09-65045-D</i>		3 509,45	5,61		13.11.2013
<i>РЖД-11обл № гос. рег.: 4-11-65045-D</i>		2 512,50	4,02		18.11.15
<i>ГАЗПРОМ А6 № гос. рег.: 4-06-00028-А</i>		5 998,80	9,59		06.08.09
<i>ВлгТлкВТ-4 № гос. рег.: 4-46-00137-А</i>		4 836,91	7,73		03.09.13
<i>Лукойл2обл № гос. рег.: 4-02-00077-А</i>		5 961,60	9,53		17.11.09
<i>СибТлк-6об № гос. рег.: 4-06-00195-А</i>		1 931,80	3,09		16.09.2010
<i>МТС 04 № гос. рег.: 4-04-04715-А</i>		6 141,00	9,81		13.05.2014
<i>Кокс 01 № гос. рег.4-01-10799-F</i>		1 784,17	2,85		16.07.2009
обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ	315	0,00	0,00		
обыкновенные акции акционерных инвестиционных	316	0,00	0,00		
привелигированные акции ОАО	317	0,00	0,00		
инвестиционные паи ПИФ	318	0,00	0,00		
<b>ценные бумаги российских эмитентов, не включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг</b>	<b>320</b>	<b>13 310,24</b>	<b>21,27</b>		
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 росс.хоз. обществ	324	13 310,24	21,27		
<i>ВТБ-5 об № гос. рег.: 40401000В</i>		6 112,20	9,77		17.10.13

<i>Белон 02 № гос. рег.: 4-02-36138-R</i>		<i>1 469,10</i>	<i>2,35</i>		<i>23.02.2012</i>
<i>МОЭК-01 № гос. рег.: 4-01-55039-E</i>		<i>1 021,40</i>	<i>1,63</i>		<i>25.07.2013</i>
<i>ГАЗфин 01 (4-01-36115-R)</i>		<i>776,34</i>	<i>1,24</i>		<i>08.02.2011</i>
<i>САНОС-02об № гос. рег.: 4-02-30120-D</i>		<i>3 931,20</i>	<i>6,28</i>		<i>10.11.2009</i>
<i>обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ</i>	325	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<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		
<b>Ценные бумаги российских эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего</b>	<b>400</b>	<b>3 362,25</b>	<b>5,37</b>		
<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	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<i>облигации росс.хоз. обществ</i>	440	<b>3 362,25</b>	<b>5,37</b>		
<i>ФСК ЕЭС-02 № гос. рег.: 4-02-65018-D</i>		<i>1 663,23</i>	<i>2,66</i>		<i>22.06.2010</i>
<i>ЧТПЗ 03об № гос. рег.: 4-03-00182-A</i>		<i>1 699,02</i>	<i>2,72</i>		<i>21.04.2015</i>
<i>обыкновенные акции ОАО, за искл. акций АИФ</i>	450	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<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		
<b>Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего</b>	<b>500</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<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		
<b>Доля в уставных капиталах российских ООО</b>	<b>600</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Недвижимое имущество</b>	<b>700</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Имущественные права на недвижимое имущество</b>	<b>800</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества</b>	<b>900</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Проектно-сметная документация</b>	<b>1000</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Иные доходные вложения в материальные ценности</b>	<b>1100</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
<b>Дебиторская задолженность, в т.ч.</b>	<b>1200</b>	<b>7 131,37</b>	<b>11,40</b>		
<i>средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг ОАО "Банк Москвы"</i>	1210	5 809,11	9,28		
<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	1 322,26	2,11		
<i>прочая дебиторская задолженность</i>	1240	0,00	0,00		
<b>ИТОГО АКТИВОВ:</b>	<b>1300</b>	<b>62 570,03</b>	<b>100,00</b>		

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



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

**30 Июнь, 2009**

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)

тыс. рублей

Имущество (обязательства)	Код стр.	31.12.2008	30.06.2009
1	2	3	4
<b>Имущество, составляющее паевой инвестиционный фонд</b>			
Денежные средства на банковских счетах, всего	10	2 003,17	71,35
в рублях ОАО "Банк Москвы"	11	2 003,17	71,35
в иностранной валюте	12	0,00	0,00
Денежные средства в банковских вкладах в т.ч.	20	0,00	0,00
в рублях	21	0,00	0,00
в иностранной валюте	22	0,00	0,00
Ценные бумаги российских эмитентов, имеющие признаваемую котировку, всего	30	11 960,81	52 005,07
акции, в т.ч. более 5%	31	0,00	0,00
<b>облигации, в т.ч. более 5% :</b>	32	11 960,81	52 005,07
сроком погашения до 1 года:		0,00	0,00
сроком погашения от 1 года до 3-х лет:		1 674,85	1 784,17
Кокс 01(4-01-10799-F)		1 674,85	
сроком погашения свыше 3-х лет:		10 285,96	50 220,90
ФСК ЭЭС-02 № гос. рег.: 4-02-65018-D		2 694,90	
ЮТК-07 об. № гос. рег.: 4-07-00062-A		915,30	
МТС 03 № гос. рег.: 4-03-04715-A		911,10	
Газпром А4 № гос. рег.: 4-04-00028-A		1 941,40	
ГАЗфин 01 (4-01-36115-R)		1 447,60	
Белон 02 (4-02-36138-R)		1 943,00	
ЦентрТел-4 № гос. рег.: 4-19-00194-A			6 018,60
РЖД-09обл № гос. рег.: 4-09-65045-D			3 509,45
САНОС-02об № гос. рег.: 4-02-30120-D			3 931,20
ГАЗПРОМ А6 № гос. рег.: 4-06-00028-A			5 998,80
ВлгТлкВТ-4 № гос. рег.: 4-46-00137-A			4 836,91
Лукойл2обл № гос. рег.: 4-02-00077-A			5 961,60
МТС 04 № гос. рег.: 4-04-04715-A			6 141,00
ВТБ-5 об № гос. рег.: 40401000В			6 112,20
Ценные бумаги российских эмитентов не имеющие признаваемую котировку, всего	40	1 459,26	3 362,25
акции, в т.ч. более 5%	41	0,00	0,00
<b>облигации, в т.ч. более 5% :</b>	42	1 459,26	3 362,25
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:		1 459,26	3 362,25
ЧТПЗ 03об № гос. рег.: 4-03-00182-A		1 459,26	
ФСК ЭЭС-02 № гос. рег.: 4-02-65018-D			1 663,23
векселя	43	0,00	0,00
иные ценные бумаги	44	0,00	0,00
Дебиторская задолженность, в т.ч.	50	579,36	7 131,37
средства, переданные проф. участникам рынка ценных бумаг	51	242,11	5 809,11
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	334,97	1 322,26
прочая дебиторская задолженность	54	2,28	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
<b>ИТОГО ИМУЩЕСТВО:</b>	100	16 002,60	62 570,03
(стр.10+20+30+40+50+60+70+80+90)			
<b>Обязательства, исполнение которых осуществляется за счет имущества, составляющего инвестиционный фонд:</b>			
Кредиторская задолженность	110	117,18	14,47
Резервы предстоящих расходов и платежей	120	614,95	75,41
Инвестиционные паи	130	15 270,46	62 480,15
<b>ИТОГО ОБЯЗАТЕЛЬСТВА (стр.110+120+130)</b>	140	16 002,60	62 570,03

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



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

**30 Июнь, 2009**

**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 № тыс. рублей*

Наименование показателя	Код стр.	За отчетный период 01.01.2009 - 30.06.2009	За соответствующий период прошлого года
1	2	3	4
Выручка от продажи ценных бумаг	10	20 785,98	316 106,05
Расходы, связанные с продажей ценных бумаг	20	20 855,84	317 270,56
Результат от продажи ценных бумаг ( 010 - 020 )	30	-69,86	-1 164,51
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	1 094,56	7 487,46
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	-154,00	-1 040,24
акции	141	0,00	0,00
облигации	142	-154,00	-1 040,24
инвестиционные паи	143	0,00	0,00
Прирост (+) или уменьшение (-) стоимости ценных бумаг, не имеющих признаваемую котировку, всего	150	366,59	612,94
акции	151	0,00	0,00
облигации	152	366,59	612,94
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	191,11	1 558,25
резерв на выплату вознаграждений	171	183,12	1 536,98
Прочие доходы	180	614,95	1 964,23
Прочие расходы	190	0,00	0,00
Прирост имущества ПИФ в результате выдачи инвест.паев	200	71 842,42	700 839,25
Уменьшение имущества ПИФ в результате погашения или обмена инвестиционных паев	210	26 293,87	537 692,47
<b>ИТОГО прирост(+)</b> или уменьшение (-) стоимости имущества (стр. 30+60+90+100+110+120+130+140+150+160+180+200-170-210)	220	47 209,69	169 448,40

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО

УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ

БАНКА МОСКВЫ

103009, Россия, Москва, Тверская ул., 8/2, стр. 1

Приложение №2  
к Справке о стоимости чистых активов

**Отчет об изменении стоимости чистых активов  
открытого паевого инвестиционного фонда облигаций  
"ВОЛХОНКА - российские облигации" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"  
30 Июнь, 2009**

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)

Причина изменения стоимости чистых активов	Код строки	Сумма, рублей
Стоимость чистых активов на <b>31.12.2008</b>	10	15 270 463,23
Выдача инвестиционных паев	20	822 211,69
Погашение инвестиционных паев	30	3 923 011,61
Обмен инвестиционных паев данного фонда на инвестиционные паи другого фонда	40	22 370 857,78
Обмен инвестиционных паев других фондов на инвестиционные паи данного фонда	50	71 020 210,41
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	1 661 133,78
Стоимость чистых активов на конец отчетного периода на <b>30.06.09</b> (строки 10+20-30-40+50-60+(-)70)	80	62 480 149,72

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А. Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



**СПРАВКА**  
**о несоблюдении требований к составу и структуре активов**  
**открытого паевого инвестиционного фонда Облигаций**  
**"ВОЛХОНКА - российские облигации" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"**  
**30 Июнь, 2009**

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)

Место нахождения: г. Москва, Кузнецкий мост, д.17 телефон: (495) 925-8000 (д.20-617)

рублей

1. Несоблюдение требований к составу активов				
Активы приобретенные с нарушением требований к составу активов	Оценочная стоимость	Доля в стоимости активов	Дата приобретения	отчуждения (предполагаемого)
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 инвестиционно	Дата возникновения нарушения или несоответствия	Дата устранения нарушения или несоответствия
1	2	3	4	5	6	7
Оценочная стоимость ценных бумаг, не имеющих признаваемой котировки	КОКС-01 per.№ 4-01-10799-F, ФСК ЕЭС per.№4-02-65018-D	3 430 003,60	13,16%	10,00%	04.06.2009	08.06.2009

**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.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_



**ОТЧЕТ**  
**о владельцах инвестиционных паев**  
**открытого паевого инвестиционного фонда облигаций**  
**"ВОЛХОНКА - российские облигации" под управлением ЗАО "УК Банка Москвы"**  
**30 Июнь, 2009**

**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)*

Наименование показателей	Код стр.	На начало отчетного года	На отчетную дату 30.06.2009
1	2	3	4
<b>Количество выданных инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда, всего</b>	<b>100</b>	<b>19 309,21055</b>	<b>75 101,47623</b>
<b>из них:</b>			
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находятся в Российской Федерации	110	18 955,32049	74 747,58617
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	0,00000
принадлежащих физическим лицам, место жительства (регистрации) которых находятся за пределами Российской Федерации	130	353,89006	353,89006
принадлежащих юридическим лицам, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами Российской Федерации	140	0,00000	0,00000
находящиеся у номинальных держателей	150	0,00000	0,00000
<b>Количество лицевых счетов в реестре владельцев инвестиционных паев ПИФа, всего</b>	<b>200</b>	<b>1 798</b>	<b>1 858</b>
<b>из них:</b>			
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находятся в Российской Федерации	210	1 785	1 845
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится в Российской Федерации	220	4	4
лицевых счетов физических лиц, место жительства (регистрации) которых находятся за пределами Российской Федерации	230	7	7
лицевых счетов юридических лиц, место нахождения постоянно действующего исполнительного органа (юридического лица, корпорации переданы функции единоличного исполнительного органа) которых находится за пределами Российской Федерации	240	0	0
лицевых счетов номинальных держателей	250	2	2

Генеральный директор \_\_\_\_\_ Е.А.Касьянова

Главный бухгалтер \_\_\_\_\_ И.К. Корноухова

Уполномоченный представитель ЗАО "ПРСД" \_\_\_\_\_