

Отчет о составе и структуре имущества
на 31.07.2015 23:59

Инвестор: НП "СРО АУ СЗ"
Договор: ДДУЮ089/1 от 29.07.2013

Финансовый инструмент	Код финансов. инструмента	Тип вложения	Уровень котировального листа	Место хранения	Количество	Балансовая стоимость, руб.*	Дата котировки	Текущая оценка 1 бумага RUR**	Текущая оценка RUR**	Процент от всего по оценке	Дата погашения	Эффективная доходность к погашению (оферте)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
25077RMFS ОФЗ 25077	ОФЗ-обл25077	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	2 000	1 971 794,00	31.07.2015	992,49	1 984 974,00	5,92%	30.01.2016	9,30%
25077RMFS ОФЗ 25077 НКД	ОФЗ-обл25077	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	-	31.07.2015	1,81	3 620,00	0,01%	30.01.2016	-
25081RMFS ОФЗ 25081	ОФЗ 25081	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	2 650	2 384 964,10	31.07.2015	906,05	2 401 043,10	7,16%	31.01.2016	10,84%
25081RMFS ОФЗ 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	65 720,10	31.07.2015	30,07	79 685,50	0,24%	05.08.2015	-
26206RMFS ОФЗ 26206	ОФЗ 26206	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	3 000	2 805 889,00	31.07.2015	951,23	2 853 687,00	8,50%	14.06.2017	10,58%
26206RMFS ОФЗ 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	7 950,00	31.07.2015	8,92	26 760,00	0,08%	15.12.2015	-
26211RMFS ОФЗ 26211	ОФЗ-обл26211	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	1 500	1 303 553,50	31.07.2015	622,05	1 233 081,00	3,67%	25.01.2016	10,70%
26211RMFS ОФЗ 26211 НКД	ОФЗ-обл26211	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	40 000,00	31.07.2015	33,94	50 910,00	0,15%	05.08.2015	-
46021RMFS ОФЗ 46021	ОФЗ 46021	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	290	246 504,07	31.07.2015	879,72	255 119,09	0,76%	09.08.2016	10,88%
46021RMFS ОФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	6 072,90	31.07.2015	26,61	7 426,90	0,02%	12.08.2015	-
6040018RMFS ОФЗ 6040018	ОФЗ-обл604018	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ	650	623 333,20	31.07.2015	620,47	533 306,15	1,59%	24.11.2021	11,41%
6040018RMFS ОФЗ 604018 НКД по всем федеральным облигациям	ОФЗ-обл604018	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	3 116,50	31.07.2015	10,33	6 714,50	0,02%	02.05.2016	-
						9 295 018,97			9 436 327,24	28,12%		10,44%
				ИК_ММВБ_ДУ средствами компенсационного фонда СРО АУ СЗ	484 688,61	484 688,61			484 688,61	1,44%		-
Денеги в бумажной форме по всем денежным средствам в бумажной				Денеги	-	484 688,61			484 688,61	1,44%		-
"Банк Советский" ЗАО, договор №Д86-14 от 11.08.2014 г.				Депозиты	А	6 700 000	7 025 067,67		7 056 384,93	21,03%	05.05.2015	5,63%
"Банк Советский" ЗАО, договор №Д87-14 от 15.08.2014 г.				Депозиты	А	250 000	14 268 679,69		15 197 110,00	45,29%	05.05.2015	2,98%
						21 293 767,35			22 253 494,93	66,32%		3,83%
ис 40701840100000293 ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ				Денеги	А	4 449,19	4 449,19		4 449,19	0,01%		-
ис 40701840700100000293 ДУ средствами компенсационного фонда ИК_ММВБ				Денеги	А	23 350	1 330 490,00	31.07.2015	1 377 430,51	4,10%		-
						1 334 839,19			1 381 879,70	4,12%		-
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:						32 408 412,12			33 856 390,48	100,00%		

Итоговая статистика	Балансовая стоимость, руб.*	Процент от всего по балансовой	Оценочная стоимость, руб.*	Процент от всего по оценке
ЦБ, обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	9 170 177,87	28,30%	9 261 210,34	27,60%
ЦБ, входящие в котировальные списки, в т.ч.	-	-	-	-
Федеральные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
План	-	-	-	-
Внесписочные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
План	-	-	-	-
Имевшие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета	9 170 177,87	28,30%	9 261 210,34	27,60%
Федеральные ЦБ	9 170 177,87	28,30%	9 261 210,34	27,60%
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
План	-	-	-	-
Не имевшие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета	-	-	-	-
Федеральные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
План	-	-	-	-
ЦБ, не обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	21 293 767,35	65,70%	22 253 494,93	66,32%
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
План	-	-	-	-
Векселя	-	-	-	-
Депозитные сертификаты (депозиты)	21 293 767,35	65,70%	22 253 494,93	66,32%

Средневзвешенная доходность долговых ЦБ и депозитов к погашению (оферте) - 5,80%

Средневзвешенная длина портфеля долговых ЦБ и депозитов до погашения, дни - 323

* Балансовая стоимость приведена с учетом накопленных процентов и дивидендов
** Оценка долговых обязательств (в случае отсутствия котировки) произведена с учетом срока их обращения с момента постановки на баланс

Справочно: денежных средств на расчетных счетах (в рублях)

И.о. генерального директора
на основании приказа
№ 4407-15 от 29.07.2015 г.

М.П.

