

Отчет о составе и структуре имущества
на 31.07.2015 23:59

Инвестор: НП "СРО АУ СЗ"
Договор: ДДУКО89/1 от 29.07.2013

Финансовый инструмент	Код финансового инструмента	Тип вложения	Уровень котировального листа	Место хранения	Количество	Балансовая стоимость, руб.*	Дата котировки	Текущая оценка 1 бумаги RUB**	Текущая сумма RUB**	Процент от всего по оценке	Дата погашения	Эффективная доходность к погашению (офферте)
25077RMFS QF3 25077	ОФЗ-обл25077	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	2 000	1 971 794.00	31.07.2015	992.49	1 984 974.00	5.92%	30.01.2016	9.30%
25077RMFS QF3 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 QF3 25081	ОФЗ 25081	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	2 650	2 384 904.10	31.07.2015	906.06	2 401 043.10	7.16%	31.01.2016	10.84%
25081RMFS QF3 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	66 720.00	31.07.2015	30.07	79 685.50	0.24%	06.08.2015	-
26206RMFS QF3 26206	ОФЗ 26206	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	3 000	2 828 989.00	31.07.2015	951.23	2 853 687.00	8.50%	14.06.2017	10.58%
26206RMFS QF3 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	7 900.00	31.07.2015	8.92	26 760.00	0.08%	16.12.2015	-
26211RMFS QF3 26211	ОФЗ-обл26211	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	1 500	1 201 553.30	31.07.2015	822.06	1 233 081.00	3.67%	31.01.2016	10.78%
26211RMFS QF3 26211 НКД	ОФЗ-обл26211	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	42 000.00	31.07.2015	33.94	50 910.00	0.15%	06.08.2015	-
46021RMFS QF3 46021	ОФЗ 46021	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	290	246 524.07	31.07.2015	879.72	256 119.09	0.76%	06.08.2016	10.88%
46021RMFS QF3 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	6 072.90	31.07.2015	26.61	7 426.90	0.02%	17.06.2015	-
6040018RMFS QF3 604018	ОФЗ-обл604018	Облигация	I уровень/A1	ДУ средствами компенсационного фонда ИК ММББ	650	620 339.20	31.07.2015	820.47	533 306.35	1.59%	24.11.2021	11.41%
6040018RMFS QF3 604018 НКД	ОФЗ-обл604018	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	3 156.00	31.07.2015	10.33	1 174.80	0.00%	30.06.2016	-
по всем облигационным инструментам						9 295 016.97			9 295 016.97			10.44%
Денежные средства и депозиты в Банке						484 688.61			484 688.61	1.44%		
по всем депозитам						484 688.61			484 688.61	1.44%		
"Банк Советский" ЗАО, договор №Д86-14 от 11.08.2014		Депозиты	A	"Банк Советский" ЗАО, договор №Д86-14 от 11.08.2014	6 700 000	7 025 067.67			7 059 384.93	11.03%	06.05.2015	5.63%
"Банк Советский" ЗАО, договор №Д87-14 от 15.08.2014		Депозиты	A	"Банк Советский" ЗАО, договор №Д87-14 от 15.08.2014	250 000	14 268 679.68			15 197 110.00	45.29%	06.05.2015	2.86%
по всем депозитам						21 293 767.35			22 253 494.93	66.32%		3.83%
ис 40701810400100000283 ДУ средствами компенсации		Денежные средства		ДУ средствами компенсационного счета НП "СРО АУ СЗ"	4 449.19	4 449.19			4 449.19	0.01%		
ис 40701840700100000287 ДУ средствами компенсации		Денежные средства		ДУ средствами компенсационного счета НП "СРО АУ СЗ"	23 350	1 330 450.00	31.07.2015		1 377 430.51	4.10%		
по всем прочим вложениям						1 330 450.00			1 377 430.51	4.10%		
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:						32 408 412.12			33 556 390.48	100.00%		

ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ:

32 408 412.12

33 556 390.48

100.00%

Итоговая статистика	Балансовая стоимость, руб.*	Процент от всего по балансу	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				
Пай				
Внебюджетные ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Пай				
Имущество 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				
Пай				
Не имеющее рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета				
Федеральные ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Пай				
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				
Пай				
Вексели				
Депозитные сертификаты (депозиты)	21 293 767.35	65.70%	22 253 494.93	66.32%

Средневзвешенная доходность долговых ЦБ и депозитов к погашению (офферте) - 5.80%

Средневзвешенная длина портфеля долговых ЦБ и депозитов до погашения, дни - 324

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

Справочно: денежные средства на расчетных счетах (в рублях)

И.о. генерального директора
на основании приказа
№ 44/07-15 от 29.07.2015 г.

М.П.