

Отчет о составе и структуре имущества
на 29.01.2016 23:59

Инвестор: Союз "СРО АУ СЗ"
Договор: ДДУ0089/1 от 29.07.2013

Код финансового инструмента	Тип вложения	Уровень котировального листа	Место хранения	Количество	Балансовая стоимость, руб.*	Дата котировки	Текущая стоимость 1 единицы RUB**	Текущая оценка RUB**	Процент от всего портфеля	Дата погашения	Эффективная доходность в годовом исчислении (офорта)
24018RMFS ОФЗ 24018	ОФЗ 24018	Итого	Уровень А1	ММББ	2 000	2 038 855 95	29.01.2016	1 022 84	2 045 886 00	5.07%	27.12.2017
24018RMFS ОФЗ 24018 НКД	ОФЗ 24018	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		17 060 00	29.01.2016	9.85	19 700 00	0.05%	
25081RMFS ОФЗ 25081	ОФЗ 25081	Облигация	Уровень А1	ММББ	2 650	2 457 603 1	29.01.2016	934.16	2 475 528 30	8.14%	31.01.2018
25081RMFS ОФЗ 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		68 821 00	29.01.2016	30.07	79 685 50	0.20%	03.02.2016
26203RMFS ОФЗ 26203	ОФЗ 26203	Облигация	Уровень А1	ММББ	780	769 916 04	29.01.2016	888.48	771 015 98	1.91%	03.08.2016
26203RMFS ОФЗ 26203 НКД	ОФЗ 26203	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		21 824 40	29.01.2016	33.46	26 098 80	0.06%	03.02.2016
26204RMFS ОФЗ 26204	ОФЗ 26204	Облигация	Уровень А1	ММББ	548	528 128 66	29.01.2016	954.50	524 020 50	1.30%	13.03.2016
26204RMFS ОФЗ 26204 НКД	ОФЗ 26204	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		11 847 42	29.01.2016	27.54	15 119 48	0.04%	17.03.2016
26206RMFS ОФЗ 26206	ОФЗ 26206	Облигация	Уровень А1	ММББ	3 000	2 897 631 00	29.01.2016	969.60	2 908 794 00	7.21%	14.06.2017
26206RMFS ОФЗ 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		5 120 00	29.01.2016	8.92	26 760 00	0.07%	15.06.2016
26211RMFS ОФЗ 26211	ОФЗ 26211	Облигация	Уровень А1	ММББ	1 500	1 297 889 00	29.01.2016	854.89	1 282 338 00	3.18%	15.01.2023
26211RMFS ОФЗ 26211 НКД	ОФЗ 26211	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		42 570 00	29.01.2016	33.94	50 910 00	0.13%	03.02.2016
46018RMFS ОФЗ 46018	ОФЗ 46018	Облигация	Уровень А1	ММББ	650	506 965 80	29.01.2016	758.39	588 605 45	1.38%	24.11.2021
46021RMFS ОФЗ 46021	ОФЗ 46021	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		3 300 50	29.01.2016	10.33	6 714 50	0.02%	02.03.2016
46021RMFS ОФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Облигация	Уровень А1	ММББ	390	354 806 49	29.01.2016	907.51	353 930 48	0.88%	06.06.2016
46021RMFS ОФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	Уровень А1	Уплаченный купонный доход		7 533 90	29.01.2016	23.29	9 083 10	0.02%	10.02.2016
Денежные средства в кассе					11 102 030 51			11 102 030 51	27.85%		
Денеги у брокера, р/с 30411810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (RUB)					19 496 62			19 496 62	0.05%		
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					31 318 49			2 423 030 14	6.01%		
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					2 282 576 11	28.01.2016		2 442 526 78	6.01%		
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					2 302 077 7						
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					7 000 000	7.159.753.42		7 198 578 58	17.85%	03.09.2016	
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					200 000	14.695.343.01		15 630 250 34	38.75%	03.09.2016	
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					50 000	3.673.836.88		3 807 562 78	9.69%	01.09.2016	
Денеги у брокера, р/с 40701810100001000910_ММББ_ДУ средствами компенсационного фонда_Союз "СРО АУ СЗ" (USD)					25 528 939 31	25.528.939.31		26 736 391 68	66.29%		
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ					38 933 042 55			40 332 909 47	100.00%		

Итоговая статистика	Балансовая стоимость, руб.*	Процент от всего по балансовой	Оценочная стоимость, руб.*	Процент от всего по цене
ИБ обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	10 922 096.29	28.05%	10 919 919.67	27.07%
ЦБ, входящие в котировальные списки, в т.ч.				
Федеральные ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Внебиржевые ИБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Имеющие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета	10 922 096.29	28.05%	10 919 919.67	27.07%
Федеральные ЦБ	10 922 096.29	28.05%	10 919 919.67	27.07%
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Не имеющие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета				
Федеральные ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
не обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	25 528 939.31	65.57%	26 736 391.68	66.29%
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Векселя				
Депозитные сертификаты (депозиты)	25 528 939.31	65.57%	26 736 391.68	66.29%

Начальник отдела
по ведению внутреннего учета
ЗАО "УК "Энергокапитал"
по доверенности № 23-01 от 05.08.13

Мосалова А.Н.

