

Отчет о составе и структуре имущества
на 29.02.2016 23:59

Инвестор: Союз "СРО АУ СЗ"
Датировка: АДМ000001 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 RUR**	Текущая оценка RUR**	Процент от всего по оценке	Дата погашения	Эффективная доходность к погашению (оферте)
24018RMFS ОФЗ 24018	ОФЗ 24018	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	2 000	2 036 855.95	29.02.2016	1 022.10	2 044 194.00	5.09%	27.12.2017	
24018RMFS ОФЗ 24018 НКД	ОФЗ 24018	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	17 060.00	29.02.2016	20.02	40 040.00	0.10%		
25081RMFS ОФЗ 25081	ОФЗ 25081	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	2 650	2 467 603.15	29.02.2016	944.48	2 552 874.65	6.23%	31.01.2018	
25081RMFS ОФЗ 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	-	29.02.2016	4.42	11 713.00	0.03%	03.08.2016	
26203RMFS ОФЗ 26203	ОФЗ 26203	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	850	838 354.84	29.02.2016	989.51	841 081.80	2.09%	03.08.2016	
26203RMFS ОФЗ 26203 НКД	ОФЗ 26203	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	105.70	29.02.2016	4.92	4 182.00	0.01%	03.08.2016	
26204RMFS ОФЗ 26204	ОФЗ 26204	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	549	526 128.66	29.02.2016	964.73	529 634.03	1.32%	16.03.2018	
26204RMFS ОФЗ 26204 НКД	ОФЗ 26204	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	11 847.42	29.02.2016	33.91	18 616.59	0.05%	17.03.2016	
26206RMFS ОФЗ 26206	ОФЗ 26206	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	2 750	2 656 181.75	29.02.2016	975.82	2 683 507.75	6.68%	14.06.2017	
26206RMFS ОФЗ 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	8 360.00	29.02.2016	15.21	11 827.50	0.10%	15.06.2016	
26211RMFS ОФЗ 26211	ОФЗ-обл26211	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	1 500	1 297 080.00	29.02.2016	877.47	1 316 202.00	3.28%	25.01.2023	
26211RMFS ОФЗ 26211 НКД	ОФЗ-обл26211	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	-	29.02.2016	4.99	7 485.00	0.02%	03.08.2016	
46018RMFS ОФЗ 46018	ОФЗ-обл46018	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	650	569 955.00	29.02.2016	878.49	571 017.20	1.42%	24.11.2021	
46018RMFS ОФЗ 46018 НКД	ОФЗ-обл46018	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	3 360.50	29.02.2016	15.85	10 302.50	0.03%	02.03.2016	
46021RMFS ОФЗ 46021	ОФЗ 46021	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММББ	500	466 054.54	29.02.2016	917.69	466 846.00	1.14%	08.08.2016	
46021RMFS ОФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	15.40	29.02.2016	2.60	1 300.00	0.00%	10.08.2016	
по всем федеральным облигациям						10 890 872.91			11 082 624.02	27.60%		
Денежные средства у брокера, р/с 30411810100901000619, ММББ, ДУ средствами компенсационного фонда "Союз"СРО АУ СЗ" (RUB)						474 516.94			474 516.94	1.18%		
Денежные средства у брокера, р/с 40701840622000046374, ММББ, ДУ средствами компенсационного фонда "Союз"СРО АУ СЗ" (USD)						31 318.49	27.02.2016		2 351 714.81	5.80%		
по всем денежным средствам у брокера						2 757 085.04			2 326 233.75	7.04%		
ПАО "Бинк БФ", договор №103312 от 28.08.2015 (RUB)						7 600 800	7.153 / 53.43		7 240 081.29	18.03%	03.08.2016	
ПАО "Бинк БФ", договор №103313 от 28.08.2015 (USD)						209 000	14 885 349.04		15 202 016.97	37.85%	03.08.2016	
ПАО "Бинк БФ", договор №103314 от 28.08.2015 (RUB)						50 000	3 673 835.56		3 800 504.05	9.46%	03.08.2016	
по всем депозитам						7 716.81			26 242 602.31	65.35%		
р/с 40701810406220000283 (RUB) в ПАО "Бинк "Александровский"						7 716.81			7 716.81	0.02%		
по всем прочим вложениям						7 716.81			7 716.81	0.02%		
ПО ВСЕМ ВЛОЖЕНИЯМ						39 184 626.08			46 159 376.89	100.00%		

Итоговая статистика	Балансовая стоимость, руб.*	Процент от всего по балансу	Эффективная стоимость, руб.*	Процент от всего по оценке
ЦБ обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	10 890 123.89	27.69%	10 947 357.43	27.26%
ЦБ входящие в котировальные списки, в т.ч.	-	-	-	-
Федеральные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
Паи	-	-	-	-
Внесписочные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
Паи	-	-	-	-
Имевшие рыночную цену (познаваемую котировку) на дату отчета	10 850 123.89	27.69%	10 947 357.43	27.26%
Федеральные ЦБ	10 850 123.89	27.69%	10 947 357.43	27.26%
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
Паи	-	-	-	-
Не имевшие рыночную цену (познаваемую котировку) на дату отчета	-	-	-	-
Федеральные ЦБ	-	-	-	-
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
Паи	-	-	-	-
ЦБ, не обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	25 528 939.31	65.15%	26 242 602.31	65.35%
Субфедеральные ЦБ	-	-	-	-
Муниципальные ЦБ	-	-	-	-
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)	-	-	-	-
Облигации с ипотечным покрытием	-	-	-	-
Акции	-	-	-	-
Паи	-	-	-	-
Векселя	-	-	-	-
Депозитные сертификаты (депозиты)	25 528 939.31	65.15%	26 242 602.31	65.35%

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

Мосалова А.Н.

