

Отчет о составе и структуре имущества
на 30.11.2015 23:59

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

Финансовый инструмент	Код Финанс. 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)
25077RMFS ОФЗ 25077	ОФЗ-обл25077	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	2 000	1 885 642 00	30.11.2015	995.82	1 991 648 00	5.40%	20.01.2016	10.67%
25077RMFS ОФЗ 25077 НКД	ОФЗ-обл25077	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	28 200 00	30.11.2015	26.38	52 780 00	0.14%	20.01.2016	-
25081RMFS ОФЗ 25081	ОФЗ 25081	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	2 650	2 395 888 85	30.11.2015	925.16	2 451 663 40	6.66%	21.01.2016	10.37%
25081RMFS ОФЗ 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	25 201 50	30.11.2015	18.89	52 682 00	0.14%	03.02.2016	-
26203RMFS ОФЗ 26203	ОФЗ 26203	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	539	629 869 98	30.11.2016	979.01	1 077 685 31	1.43%	03.08.2016	10.42%
26203RMFS ОФЗ 26203 НКД	ОФЗ 26203	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	6 154 05	30.11.2015	22.12	11 922 68	0.03%	03.02.2016	-
26204RMFS ОФЗ 26204	ОФЗ 26204	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	549	609 299 20	30.11.2015	949.45	1 090 696 31	1.11%	15.03.2016	10.32%
26204RMFS ОФЗ 26204 НКД	ОФЗ 26204	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	1 511 39	30.11.2015	15.21	8 350 29	0.02%	17.03.2016	-
26206RMFS ОФЗ 26206	ОФЗ 26206	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	3 000	2 847 817 00	30.11.2015	964.92	2 894 763 00	7.85%	14.05.2017	10.15%
26206RMFS ОФЗ 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	63 470 00	30.11.2015	33.98	100 580 00	0.27%	16.12.2016	-
26211RMFS ОФЗ 26211	ОФЗ-обл26211	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	1 500	1 208 322 00	30.11.2016	866.43	1 299 648 00	3.52%	25.01.2016	9.63%
26211RMFS ОФЗ 26211 НКД	ОФЗ-обл26211	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	16 110 00	30.11.2015	22.44	33 680 00	0.08%	03.02.2016	-
46018RMFS ОФЗ 46018	ОФЗ-обл46018	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	650	533 011 70	30.11.2015	877.04	570 075 35	1.55%	24.11.2021	9.55%
46018RMFS ОФЗ 46018 НКД	ОФЗ-обл46018	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	3 243 58	30.11.2015	15.85	10 302 50	0.03%	02.12.2015	-
46021RMFS ОФЗ 46021	ОФЗ 46021	Облигация	I уровень/A1	КИТ ММВБ	390	343 672 75	30.11.2015	907.17	353 795 91	0.98%	08.08.2016	10.07%
46021RMFS ОФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	I уровень/A1	Уплаченный купонный доход	-	3 124 80	30.11.2015	15.07	5 877 30	0.02%	10.02.2016	-
по всем облигациям						10 494 998 32			10 889 510 01	29.52%		10.25%
Денежные средства в банках		Денежные средства	I-	КИТ ММВБ ДУ		1 856 91			1 856 91	0.01%		
по всем депозитам						1 856 91			1 856 91	0.01%		
"Банк БФА" ПАО, договор №103312 от 28.08.2015 (RUB)		Депозиты	I-	"Банк БФА" ПАО, договор №103312 от 28.08.2015	7 000 000	7 036 246 56			7 118 138 98	19.30%	03.09.2016	
"Банк БФА" ПАО, договор №103313 от 28.08.2015 (USD)		Депозиты	I-	"Банк БФА" ПАО, договор №103313 от 28.08.2015	200 000	13 271 836 31			13 327 710 16	38.14%	03.09.2016	-78.59%
"Банк БФА" ПАО, договор №103314 от 28.08.2015 (USD)		Депозиты	I-	"Банк БФА" ПАО, договор №103314 от 28.08.2015	50 000	3 317 958 91			3 331 827 54	0.03%	03.09.2016	-78.59%
по всем депозитам						23 626 044 80			23 777 774 68	64.47%		-55.06%
ДУ средствами компенсационного счета Союза "СРО АУ СЗ" (RUB) в "Банк "Александровский" ПАО		Денежные средства	I-	ДУ средствами компенсационного счета Союза "СРО АУ СЗ"	140 925,7	140 625 70			140 925 70	0.38%		
ДУ средствами компенсационного счета Союза "СРО АУ СЗ" (USD) в "Банк "Александровский" ПАО		Денежные средства	I-	ДУ средствами компенсационного счета Союза "СРО АУ СЗ"	31 318 49	2 074 433 43	28.11.2015		2 074 514 85	5.62%		
по всем депозитам						2 215 359 13			2 215 440 55	6.01%		
по всем вложениям:						36 338 259 16			36 881 582 19	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.	10 347 542 48	28.48%	10 609 975 28	28.77%
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				
Имеющие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета	10 347 542 48	28.48%	10 609 975 28	28.77%
Федеральные ЦБ	10 347 542 48	28.48%	10 609 975 28	28.77%
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				
ЦБ не обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	23 626 044 80	65.02%	23 777 774 68	64.47%
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Векселя				
Депозитные сертификаты (депозиты)	23 626 044 80	65.02%	23 777 774 68	64.47%

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



Матвеева А.Н.