

Отчет о составе и структуре имущества
на 31.05.2016 23:59

Инвестор: Союз "СРО АУ СЗ"
Договор ДДУ088/1 от 29.07.2013

Секретный инструмент	Код финан. инструмента	Тип вложения	Уровень котировального листа	Место хранения	Количество	Балансовая стоимость, руб.*	Дата котировки	Текущая оценка 1 бумаги RUB**	Текущая оценка RUB**	Процент от всего по оценке	Дата погашения	Эффективная доходность к погашению (офшорте)
24018RMFS OФЗ 24018	ОФЗ 24018	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	2 000	2 040 460 00	31.05.2016	1 019.63	2 039 054 00		31.12.2017	-4.15%
24018RMFS OФЗ 24018 НКД	ОФЗ 24018	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		60 460 00	31.05.2016	50.22	100 440 00			
25081RMFS OФЗ 25081	ОФЗ 25081	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	2 000	1 902 784 00	31.05.2016	953.10	1 906 204 00		31.01.2018	9.81%
25081RMFS OФЗ 25081 НКД	ОФЗ 25081	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		19 320 00	31.05.2016	20.05	40 100 00		03.06.2016	
26203RMFS OФЗ 26203	ОФЗ 26203	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	1 675	1 661 065 44	31.05.2016	994.96	1 668 964 70		03.06.2016	10.02%
26203RMFS OФЗ 26203 НКД	ОФЗ 26203	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		18 950 60	31.05.2016	22.31	37 369 25		03.06.2016	
26204RMFS OФЗ 26204	ОФЗ 26204	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	961	932 749 48	31.05.2016	972.68	934 749 32		15.03.2019	9.38%
26204RMFS OФЗ 26204 НКД	ОФЗ 26204	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		2 797 98	31.05.2016	15.41	14 809 01		15.06.2016	
26206RMFS OФЗ 26206	ОФЗ 26206	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	2 000	1 959 444 00	31.05.2016	979.98	1 959 968 00		14.06.2017	9.61%
26206RMFS OФЗ 26206 НКД	ОФЗ 26206	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		42 960 00	31.05.2016	33.86	67 720 00		15.06.2016	
26211RMFS OФЗ 26211	ОФЗ-обл26211	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	1 000	901 309 00	31.05.2016	906.44	906 440 00		26.01.2022	8.70%
26211RMFS OФЗ 26211 НКД	ОФЗ-обл26211	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		10 950 00	31.05.2016	22.63	22 630 00		03.06.2016	
46018RMFS OФЗ 46018	ОФЗ-обл46018	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	650	581 932 00	31.05.2016	912.12	592 875 40		24.11.2021	9.16%
46018RMFS OФЗ 46018 НКД	ОФЗ-обл46018	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		3 360 60	31.05.2016	16.03	10 419 50		01.06.2016	
46021RMFS OФЗ 46021	ОФЗ 46021	Облигация	1 уровень/A1	КИТ ММВБ	500	463 309 00	31.05.2016	933.78	466 862 00		08.09.2016	1.56%
46021RMFS OФЗ 46021 НКД	ОФЗ 46021	Купон	1 уровень/A1	Уплаченный купонный доход		3 425 00	31.05.2016	15.20	7 600 00		10.08.2016	
по всем федеральным облигациям						10 802 073 70			10 773 835 18	29.08%		6.83%
Денеги у брокера, р/с 3041181010021000919, ММВБ, ДУ средствами компенсационного фонда "Союз СРО АУ СЗ" (RUB)						9 993 89			9 993 89			
Денеги у брокера, р/с 40701540602000045374, ММВБ, ДУ средствами компенсационного фонда "Союз СРО АУ СЗ" (USD)						31 318 49	2 117 367 94	31.05.2016	2 069 604 12	5.61%		
по всем денежным средствам у брокера						2 127 361 83			2 079 598 01			
ПАО "Банк БФА", договор №103312 от 28.08.2015 (RUB)						7 000 000	7 281 584 02		7 363 250 69		03.06.2016	6.38%
ПАО "Банк БФА", договор №103313 от 28.08.2015 (USD)						200 000	13 115 377 59		13 461 444 04		03.06.2016	2.52%
ПАО "Банк БФА", договор №103314 от 28.08.2015 (USD)						50 000	2 428 543 90		3 365 361 01		03.06.2016	2.50%
по всем депозитам						24 426 305 51			24 190 055 74	65.29%		3.83%
р/с 4070121010000000203 (RUB) в ПАО "БАНК "Александровский"						9 348 81	9 348 81		9 348 81	0.03%		
по всем прочим вложениям						9 348 81			9 348 81			
по всем вложениям:						37 165 087 85			37 052 835 74	100.00%		

Итоговая статистика	Балансовая стоимость, руб.*	Процент от всего по оценке	Оценочная стоимость, руб.*	Процент от всего по оценке
ЦБ, обращающиеся на организованном рынке, в т.ч.	10 439 899 92	28.09%	10 472 747 42	28.26%
ЦБ, входящие в котировальные списки, в т.ч.				
Федеральные ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Внебиржевые ЦБ				
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Имеющие рыночную цену (признаваемую котировку) на дату отчета	10 439 899 92	28.09%	10 472 747 42	28.26%
Федеральные ЦБ	10 439 899 92	28.09%	10 472 747 42	28.26%
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.	24 426 305 51	65.72%	24 190 055 74	65.29%
Субфедеральные ЦБ				
Муниципальные ЦБ				
Корпоративные облигации (кроме ипотечных)				
Облигации с ипотечным покрытием				
Акции				
Паи				
Векселя				
Депозитные сертификаты (депозиты)	24 426 305 51	65.72%	24 190 055 74	65.29%

Начальник отдела
по ведению внутреннего учета
АО "Петербург-Инвест"
по доверенности № 23-01 от 05.08.13

Мосалова А.Н.