

Отчет № 1.1 Стоимость портфеля ОАО "УК "Арсатера" на 31.12.2011.

Отчет составлен в соответствии с п. 3.6, п.п. 1.1 Положения о Правлении ОАО "УК "Арсатера". В скобках указываются лимиты согласно Инвестиционной декларации для портфеля ОАО "УК "Арсатера".

Наименование актива	Количество ЦБ	Стоимость, руб.	Доля ценных бумаг одного эмитента, % от портфеля	Доля ценных бумаг данного типа, % от портфеля	Доля ценных бумаг (участия) данной категории, % от портфеля	
Государственные федеральные облигации				-	-	
ГЦБ субъектов и муниципальные облигации, Корпоративные облигации	Тип 5.1 + 2.1			0.00 (100)	0.00 (100)	
	Тип 5.2 + 2.2			0.00 (20)		
	Тип 5.3 + 2.3			0.00 (0)		
	Тип 5.4 + 2.4			0.00 (0)		
	Тип 5.5 + 2.5			0.00 (0)		
	Тип 5.6 + 2.6			0.00 (0)		
	Облигации, по которым не исполнено обязательство по погашению основного долга					
	Мособлтрастинвест обл., вып.2	5 800				
	ФК Еврокоммерц обл., вып.5	4 029				
	Держава-Финанс обл., вып.01	2 260				
ВТК обл., сер.1	2 921					
Акции	Тип 6.1			93.85 (100)	99.99 (100)	
	Транснефть, ап	225	11 175 750.00	9.42		
	ЛУКОЙЛ	6 495	11 038 252.50	9.31		
	Газпром	63 600	10 896 588.00	9.19		
	Газпром нефть	33 270	4 976 193.90	4.20		
	Тип 6.2				61.74 (80)	
	Группа Компаний ПИК	111 600	8 832 024.00	7.45		
	Группа ЛСР	18 275	8 444 877.50	7.12		
	Акрон	6 275	8 327 552.50	7.02		
	Татнефть, ап	93 200	8 221 172.00	6.93		
	Холдинг МРСК	1 754 000	4 016 660.00	3.39		
	Тип 6.3				29.83 (30)	
	Открытые инвестиции	12 864	5 918 726.40	4.99		
	Галс-Девелопмент	21 080	5 881 320.00	4.96		
	Нижекамскнефтехим, ап	362 100	5 844 294.00	4.93		
	Челябинский цинковый завод	53 190	3 756 809.70	3.17		
	КуйбышевАзот	30 000	1 921 500.00	1.62		
	Банк Санкт-Петербург	20 850	1 502 659.50	1.27		
	Мосэнергобыт	2 550 000	1 183 455.00	1.00		
	Тип 6.4				7.91 (10)	
	Комбинат Южуралникель	200	2 865 388.71	2.42		
	Казанский вертолетный завод	26 100	2 710 746.00	2.29		
	ЦМГ, ап	537 000	2 691 981.00	2.27		
	Башкирнефтепродукт	3 700	1 109 343.32	0.94		
	Тип 6.5				6.15 (0)	
	Башкирнефтепродукт, ап	25 900	4 721 286.52	3.98		
	Ковровский механический завод	738	1 222 201.80	1.03		
	Метзавод им. Серова, ап	150	683 319.38	0.58		
	Центрэнергохолдинг, ап	99 654	511 853.43	0.43		
	Интергенерация, ап	334 105	130 929.11	0.11		
Сибэнергохолдинг, ап	91 794	20 238.30	0.02			
ТТК-11 Холдинг, ап	116 228	0.00	0.00			
Банковские депозиты	Тип 3.1			0.00 (20)		
	Тип 3.2			0.00 (0)		
	Тип 3.3			0.00 (0)		
	Тип 3.4			-	0.00 (20)	
	Тип 3.5			-		
	Тип 3.6			-		
Денежные средства		6 396.26			0.01 (100)	
Дебиторская задолженность		1 062.00			0.00 (30)	
Кредиторская задолженность		4 927.44			0.00 (30)	
Итого стоимость портфеля ОАО "УК "Арсатера"		118 607 653.39			100.00	

Обязательства эмитентов облигаций, не учитываемые при расчете стоимости портфеля*

Ценная бумага (эмитент, серия)	Вид обязательства	Объем неисполненного обязательства, руб.
ВТК обл., сер.1	погашение купона	640 838.19
ВТК обл., сер.1	погашение основного долга	2 921 000.00
Держава-Финанс обл., вып.01	погашение купона	728 063.40
Держава-Финанс обл., вып.01	погашение основного долга	2 260 000.00
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение купона	620 658.00
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение основного долга	5 800 000.00
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение купона	1 449 996.81
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение основного долга	4 029 000.00
Итого объем неисполненных эмитентами облигаций обязательств, руб.		18 449 556.40

* действия, предпринятые Управляющей компанией по взысканию задолженности, описаны в отчете № 4.2.