ОТЧЕТ № 1.1А СТОИМОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ОАО "УК "АРСАГЕРА" на 31.12.2015.

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

Стоимость портфеля указывается без учета сделок, по которым не произведена оплата и(или) перерегистрация, а ценные бумаги оцениваются по рыночной цене, объявленной организатором торгов на дату определения стоимости портфеля, в соответствии с порядком, установленным ФСФР России. В случае отсутствия рыночной цены на дату определения стоимости портфеля или если ценная бумага не допущена к обращению, указывается балансовая стоимость.

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				
	ВТК обл., сер.1	2 921				
Акции	**Тип 6.1**				**97.99 (100)**	**99.98 (100)**
	Газпром	82 280	11 210 650.00	9.03		
	ЛУКОЙЛ	4 664	10 972 526.40	8.84		
	Сургутнефтегаз	286 100	9 773 176.00	7.88		
	АФК Система	365 200	6 440 302.00	5.19		
	Мобильные ТелеСистемы	29 280	6 175 152.00	4.98		
	АЛРОСА	107 600	6 043 892.00	4.87		
	Магнитогорский металлургический комбинат	231 100	4 267 261.50	3.44		
	Тип 6.2				**53.76 (80)**	
	Татнефть, ап	21 840	4 317 768.00	3.48		
	Группа ЛСР	6 354	4 292 127.00	3.46		
	Газпром нефть	27 430	4 214 619.50	3.40		
	Аэрофлот	73 500	4 123 350.00	3.32		
	Башнефть, ап	2 338	4 010 839.00	3.23		
	М.видео	15 190	3 979 780.00	3.21		
	Мосэнерго	4 834 000	3 954 212.00	3.19		
	ТМК	64 380	3 907 866.00	3.15		
	Тип 6.3				**27.33 (30)**	
	Нижнекамскнефтехим, ап	175 700	4 076 240.00	3.28		
	ОГК-2	17 329 000	3 876 497.30	3.12		
	Энел Россия	4 980 000	3 540 780.00	2.85		
	ТГК-1	851 700 000	3 534 555.00	2.85		
	Мечел, ап	87 830	3 517 591.50	2.83		
	Банк Санкт-Петербург	74 670	3 259 345.50	2.63		
	ЧМК	861	3 125 430.00	2.52		
	Возрождение Банк, ап	12 100	1 821 050.00	1.47		
	Тип 6.4				**5.78 (10)**	
	Открытые инвестиции	19 773	3 658 005.00	2.95		
	ЦМТ, ап	581 000	3 509 240.00	2.83		
	Тип 6.5				**1.99 (3)**	
	Метзавод им. Серова, ап	150	683 572.97	0.55		
	Главмосстрой ХК	3 000	615 584.26	0.50		
	Центрэнергохолдинг, ап	99 654	513 031.91	0.41		
	Комбинат Южуралникель	200	344 000.00	0.28		
	Ковровский механический завод	738	291 510.00	0.23		
	Сибэнергохолдинг, ап	91 794	21 361.67	0.02		
Банковские депозиты	**Тип 3.1**				**0.00 (20)**	**0.00 (20)**
	Тип 3.2				**0.00 (0)**	
	Тип 3.3				**0.00 (0)**	
	Тип 3.4				-	
	Тип 3.5				-	
	Тип 3.6				-	
Денежные средства			25 180.28			**0.02 (100)**
Дебиторская задолженность			0.00			**0.00 (30)**
Кредиторская задолженность			59.00			**0.00 (30)**
Итого стоимость портфеля ОАО "УК "Арсагера"			**124 096 437.79**			**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
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.		**15 461 493.00**

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

ОТЧЕТ № 1.1Б СТОИМОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ОАО "УК "АРСАГЕРА" на 31.12.2015.

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

Стоимость портфеля указывается с учетом сделок, по которым не произведена оплата и(или) перерегистрация, а ценные бумаги оцениваются по цене, определяемой как среднее между последними котировками на покупку и продажу. В случае отсутствия котировок за последние 90 дней ценные бумаги оцениваются по нулевой стоимости.

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
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				
	ВТК обл., сер.1	2 921				
Акции	**Тип 6.1**				**96.83 (100)**	**99.98 (100)**
	Газпром	82 280	11 206 124.60	8.89		
	ЛУКОЙЛ	4 664	10 958 767.60	8.70		
	Сургутнефтегаз	286 100	9 732 406.75	7.72		
	АФК Система	365 200	6 443 041.00	5.11		
	Мобильные ТелеСистемы	29 280	6 164 172.00	4.89		
	АЛРОСА	107 600	6 032 594.00	4.79		
	Магнитогорский металлургический комбинат	231 100	4 331 969.50	3.44		
	Тип 6.2				**53.30 (80)**	
	Татнефть, ап	21 840	4 342 884.00	3.45		
	Группа ЛСР	6 354	4 290 538.50	3.40		
	Газпром нефть	27 430	4 200 904.50	3.33		
	Аэрофлот	73 500	4 115 632.50	3.27		
	Башнефть, ап	2 338	4 008 501.00	3.18		
	М.видео	15 190	4 004 084.00	3.18		
	Мосэнерго	4 834 000	3 955 420.50	3.14		
	ТМК	64 380	3 912 694.50	3.10		
	Тип 6.3				**27.25 (30)**	
	Нижнекамскнефтехим, ап	175 700	4 124 557.50	3.27		
	ОГК-2	17 329 000	3 873 897.95	3.07		
	Энел Россия	4 980 000	3 558 210.00	2.82		
	ТГК-1	851 700 000	3 536 684.25	2.81		
	Мечел, ап	87 830	3 515 834.90	2.79		
	Банк Санкт-Петербург	74 670	3 244 411.50	2.57		
	ЧМК	861	3 129 735.00	2.48		
	Возрождение Банк, ап	12 100	1 827 100.00	1.45		
	Тип 6.4				**5.98 (10)**	
	ЦМТ, ап	581 000	3 773 595.00	2.99		
	Открытые инвестиции	19 773	3 756 870.00	2.98		
	Тип 6.5				**3.15 (3)**	
	Главмосстрой ХК	3 000	2 990 897.25	2.37		
	Комбинат Южуралникель	200	344 500.00	0.27		
	Метзавод им. Серова, ап	150	337 155.69	0.27		
	Ковровский механический завод	738	289 665.00	0.23		
	Сибэнергохолдинг, ап	91 794	2 460.45	0.00		
	Центрэнергохолдинг, ап	99 654	0.00	0.00		
Банковские депозиты	**Тип 3.1**				**0.00 (20)**	**0.00 (20)**
	Тип 3.2				**0.00 (0)**	
	Тип 3.3				**0.00 (0)**	
	Тип 3.4				-	
	Тип 3.5				-	
	Тип 3.6				-	
Денежные средства			25 180.28			**0.02 (100)**
Дебиторская задолженность			0.00			**0.00 (30)**
Кредиторская задолженность			59.00			**0.00 (30)**
Итого стоимость портфеля ОАО "УК "Арсагера"			126 030 430.72			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
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.		**15 461 493.00**

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